

ANHANG XXI (DPM 3.0)

ERLÄUTERUNGEN ZUR MELDUNG DER KONZENTRATION DES LIQUIDITÄTSDECKUNGSPOTENZIALS

1. Bei den Angaben im Meldebogen C 71.00 zur Konzentration des Liquiditätsdeckungspotenzials des meldenden Instituts, aufgeschlüsselt nach den zehn größten gehaltenen Vermögenswerten bzw. den dem Institut zu diesem Zweck zugesagten Liquiditätslinien, folgen die Institute den in diesem Anhang enthaltenen Erläuterungen.
2. Ist ein Emittent oder eine Gegenpartei mehr als einer Produktart, Währung oder Bonitätsstufe zugeordnet, ist der Gesamtbetrag anzugeben. Auszuweisen sind jene Produktarten, Währungen oder Bonitätsstufen, die für den größten Teil der Konzentration des Liquiditätsdeckungspotenzials relevant sind.
3. Das im Meldebogen C 71.00 gemeldete Liquiditätsdeckungspotenzial muss mit jenem im Meldebogen C 66.01 übereinstimmen, für die Zwecke des Meldebogens C 71.00 aber unbelastet sein, damit das Institut es zum Berichtsstichtag in Bargeld umwandeln kann.
4. Um die Konzentrationen für die Zwecke des Meldebogens C 71.00 nach maßgeblichen Währungen zu berechnen, verwenden die Institute die Konzentrationen in allen Währungen.
5. Gehört ein Emittent oder eine Gegenpartei mehreren Gruppen verbundener Kunden an, ist er oder sie einmalig der Gruppe mit der höheren Konzentration des Liquiditätsdeckungspotenzials zuzuordnen.
6. Außer in Zeile 120 sind Konzentrationen des Liquiditätsdeckungspotenzials mit einer Zentralbank als Emittent oder Gegenpartei in diesem Meldebogen nicht auszuweisen. Falls ein Institut bei einer Zentralbank Vermögenswerte für gewöhnliche geldpolitische Operationen bereitgestellt hat und soweit diese Vermögenswerte auf die zehn größten Emittenten oder Gegenparteien von unbelastetem Liquiditätsdeckungspotenzial entfallen, meldet das Institut den ursprünglichen Emittenten und die ursprüngliche Produktart.

Spalte	Rechtsgrundlagen und Erläuterungen
010	<p><u>Name des Emittenten</u></p> <p>Die Namen der zehn größten Emittenten unbelasteter Vermögenswerte oder Gegenparteien von dem Institut zugesagten, nicht in Anspruch genommenen Liquiditätslinien sind in Spalte 010 in absteigender Reihenfolge anzugeben. Die größte Position wird unter 1.01 ausgewiesen, die zweitgrößte Position unter 1.02 usw. Emittenten und Gegenparteien, die eine Gruppe verbundener Kunden bilden, sind als eine einzige Konzentration zu melden.</p> <p>Beim angegebenen Namen des Emittenten bzw. der Gegenpartei muss es sich um den vollständigen Namen des Rechtsträgers, der die Vermögenswerte ausgegeben bzw. die Liquiditätslinien zugesagt hat,</p>

	einschließlich etwaiger Verweise auf die Art des Unternehmens nach dem jeweiligen nationalen Gesellschaftsrecht handeln.
020	<u>Unternehmenskennung (LEI)</u> Die Unternehmenskennung der Gegenpartei.
030	<u>Branche des Emittenten</u> Jedem Emittenten/jeder Gegenpartei ist auf der Grundlage der Branchenklassen nach FINREP eine der folgenden Branchen zuzuweisen. i) Sektor Staat; ii) Kreditinstitute; iii) „Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften“; iv) Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften; v) Privathaushalte. Bei Gruppen verbundener Kunden wird keine Branche gemeldet.
040	<u>Sitz des Emittenten</u> Es ist der Ländercode des Landes der Eintragung des Emittenten bzw. der Gegenpartei nach ISO-Standard 3166-1-Alpha-2 zu verwenden, einschließlich der für internationale Organisationen geltenden Pseudo-ISO-Codes, die der neuesten Ausgabe des Zahlungsbilanz-Vademekums von Eurostat zu entnehmen sind. Bei Gruppen verbundener Kunden ist kein Land anzugeben.
050	<u>Produktart</u> Den in Spalte 010 angeführten Emittenten/Gegenparteien wird unter Verwendung der nachstehenden fettgedruckten Codes eine Produktart zugeordnet, die dem Produkt entspricht, in dem der Vermögenswert gehalten wird bzw. die abrufbare Liquiditätsfazilität empfangen wurde: <ul style="list-style-type: none"> • SrB (Senior Bond — vorrangige Anleihe); • SubB (Subordinated Bond — nachrangige Anleihe); • CP (Commercial Paper — Geldmarktpapier); • CB (Covered Bonds — gedeckte Schuldverschreibungen); • US (UCITS-security — OGAW, d. h. Finanzinstrumente, bei denen es sich um einen Anteil an einem Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren oder ein von einem OGAW emittiertes Wertpapier handelt); • ABS (Asset Backed Security — forderungsgedecktes Wertpapier); • CrCl (Credit Claim — Kreditforderung); • Eq (Equity — Beteiligung); • Gold (im Fall von physischem Gold, das als eine einzige Gegenpartei behandelt werden kann); • LiqL (Undrawn committed liquidity line granted to the institution — dem Institut zugesagte, nicht in Anspruch genommene Liquiditätslinie); • OPT (Other product type — andere Produktart).
060	<u>Währung</u> Den in Spalte 010 angeführten Emittenten bzw. Gegenparteien wird in Spalte 060 ein ISO-Währungscode zugewiesen, der der Währung des

	<p>empfangenen Vermögenswerts bzw. der dem Institut zugesagten, nicht in Anspruch genommenen Liquiditätslinie entspricht. Anzugeben ist der aus drei Buchstaben bestehende Code für die Währungseinheit nach ISO 4217.</p> <p>Enthält eine Konzentration des Liquiditätsdeckungspotenzials eine Linie bestehend aus mehreren Währungen, so wird diese Linie in der Währung gezählt, die in der Konzentration ansonsten vorherrschend ist. Im Hinblick auf eine gesonderte Meldung in signifikanten Währungen gemäß Artikel 415 Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bewerten die Institute, in welcher Währung der Ab- oder Zufluss voraussichtlich erfolgt, und melden die Position im Einklang mit den Vorgaben für die gesonderte Meldung signifikanter Währungen im Rahmen der Liquiditätsdeckungsanforderung gemäß der Verordnung (EU) 2016/322 ausschließlich in dieser signifikanten Währung.</p>
070	<p><u>Bonitätsstufe</u></p> <p>Die zutreffende Bonitätsstufe ist gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 zuzuweisen und hat der Bonitätsstufe der im Meldebogen „Laufzeitband“ ausgewiesenen Posten zu entsprechen. Liegt keine Einstufung vor, wird die Stufe „ohne Rating“ zugewiesen.</p>
080	<p><u>Marktpreis/Nennwert</u></p> <p>Der Marktpreis oder Zeitwert der Vermögenswerte oder — gegebenenfalls — der Nennwert der dem Institut zugesagten, nicht in Anspruch genommenen Liquiditätslinie.</p>
090	<p><u>Zentralbankfähiger Sicherheitenwert</u></p> <p>Sicherheitenwert gemäß den Vorschriften der Zentralbank für ständige Fazilitäten für die jeweiligen Vermögenswerte.</p> <p>Bei Vermögenswerten in einer Währung, die laut der Verordnung (EU) Nr. 2015/233 zu den Währungen zählt, deren Zentralbankfähigkeit äußerst eng definiert ist, lassen die Institute dieses Feld leer.</p>