

**58. Meldung über IRBA-Positionen
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

IRBA QV

**IRBA-Forderungs-
klasse:**

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-nummer:
 Institutsgruppe/
 Finanzholding-Gruppe:

Prüfziffer:

Übergeordnetes
 Unternehmen:
 Stand Ende:

Verbriefungsart:

in Mio Euro

	Gesamtbeitrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken			Verbriefungs- positionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	(*) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und laufzeiterneigte Beträge
		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsberneigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen berneigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Nominalbetrag zurückbehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S.4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzberneigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzberneigte Beträge		
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
010 Gesamtsumme											
011 darunter: Wiederverbriefungspositionen											
020 Originator: Gesamtengagement											
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
031 A											
032 B											
033 C											
034 D											
035 E											
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen											
071 A											
072 B											
073 C											
074 D											
075 E											
080 Vorzeitige Tilgung											

(a) einschließlich um Währungsinkongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

**58. Meldung über IRBA-Positionen
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

IRBA QV

**IRBA-Forderungs-
klasse:**

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-nummer:

Prüfziffer:

Übergeordnetes
Unternehmen:

Institutsgruppe/
Finanzholding-Gruppe:

Stand Ende:

Verbriefungsart:

in Mio Euro

	Gesamtbeitrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbriefte Portfolio angewandte Kreditrisikominderungstechniken			Verbriefungs- positionen	Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten auf die IRBA-Bemessungsgrundlage				IRBA-Bemessungsgrundlage nach Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken mit Substitutionseffekten	(-) Kreditrisikominderungstechniken nach der umfassenden Methode: Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungs- und lauffzeitberichtigte Beträge
		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsberichtigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungskongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditleitwerte		Normalertrag zurückbehaltener oder zurückgeworbener Kreditbesicherungen	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S. 4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditleitwerte: Inkongruenzberichtigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche: Inkongruenzberichtigte Beträge		
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
Investor: Gesamtengagement											
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist											
100 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
101 A											
102 B											
103 C											
104 D											
105 E											
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen											
141 A											
142 B											
143 C											
144 D											
145 E											
Sponsor: Gesamtengagement											
160 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen											
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen											

(a) einschließlich um Währungskongruenzen bereinigte als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche

**58. Meldung über IRBA-Positionen
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

IRBA QV

IRBA-Forderungs-
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen	Instituts- nummer:	Prüf- ziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Summenblatt	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:

in Mio Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsbeschränkungen	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 S.1 VV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 288 S.1 VV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugpositionen	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten														
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)														
									7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%
	12	13	14	15	16	17	18	19=17+18	20	21	22	23	24	42	44	25	45	46	26	47	27	48	49
010 Gesamtsumme																							
011 darunter: Wiederverbriefungspositionen																							
020 Originator: Gesamtengagement																							
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																							
031 A																							
032 B																							
033 C																							
034 D																							
035 E																							
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																							
071 A																							
072 B																							
073 C																							
074 D																							
075 E																							
080 Vorzeitige Tilgung																							

**58. Meldung über IRBA-Positionen
(Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)**

IRBA QV

IRBA-Forderungs-
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen	Instituts- nummer:	Prüf- ziffer:	Übergeordnetes Unternehmen:
Summenblatt	Institutsgruppe/ Finanzholding-Gruppe:		Stand Ende:

in Mio Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikomodifizierungstechniken	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 S.1 VV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 S.1 VV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugpositionen	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten															
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristrating)															
									7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	150%	200%	225%	250%	300%	350%	425%	500%	650%	750%	850%
12	13	14	15	16	17	18	19=17+18	20	21	22	23	24	42	43	44	25	45	46	26	47	27	48	49	
Investor: Gesamtengagement																								
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenkundigpflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																								
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																								
A																								
B																								
C																								
D																								
E																								
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																								
A																								
B																								
C																								
D																								
E																								
Sponsor: Gesamtengagement																								
Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																								
Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																								

58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA-Forderungs-
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-
nummer: Prüf-
ziffer:

Institutsgruppe/
Finanzholding-Gruppe

Übergeordnetes Unternehmen:

Stand
Ende:

in Mio Euro

	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten							(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Verberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.4 V)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 S.4 V) bei Verlust gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und 5 (KVG) (§ 18b Abs. 6 KVG)	Zuschlagbetrag auf den risikogewichteten KSA/IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbriefungen zu anderen Forderungsklassen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbriefungen zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
	1250%	Mit Rating	Ohne Rating	Bankaufsichtlicher Formelansatz	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau	Internes Einstufungsverfahren								
	28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38	39	
010 Gesamtsumme															Übertrag ÜB-Meldebogen
011 darunter: Wiederverbriefungspositionen															Übertrag ÜB-Meldebogen
020 Originator: Gesamtengagement															
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
031 A															
032 B															
033 C															
034 D															
035 E															
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen															
071 A															
072 B															
073 C															
074 D															
075 E															
080 Vorzeitige Tilgung															

58. Meldung über IRBA-Positionen (Instituts- bzw. Finanzholding-Gruppe)

IRBA-Forderungs-
klasse:

Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-
nummer: Prüf-
ziffer:

Institutsgruppe/
Finanzholding-Gruppe

Übergeordnetes Unternehmen:

Stand
Ende:

in Mio Euro

	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten							(-) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.1vV)	Zuschlag zum risikogewichteten IRBA-Positionswert (§ 253 S.1vV) bei Verlust gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 bis 3 und § 5 KWG (§ 18b Abs. 6 KWG)	Zuschlagsbeitrag auf den risikogewichteten KSA/IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbindungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbindungen zu anderen Forderungsklassen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbindungen zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
	Mit Rating	Ohne Rating	Bankaufsichtlicher Formel-Ansatz	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschau	Internes Einstufungsverfahren	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)								
	28	29	30	31	32	33	34	35	36	40	41	37	38		39
Investor:															
Gesamtengagement															
darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist															
100 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
101 A															
102 B															
103 C															
104 D															
105 E															
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen															
141 A															
142 B															
143 C															
144 D															
145 E															
150 Sponsor:															
Gesamtengagement															
160 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen															
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen															