

EBA/GL/2016/01

---

29/02/2016

---

## Leitlinien

---

Überarbeiteten Leitlinien zur weiteren Festlegung der Indikatoren für die globale systemische Relevanz und deren Offenlegung

## Status dieser Leitlinien

1. Das vorliegende Dokument enthält Leitlinien, die gemäß Artikel 16 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 herausgegeben wurden.<sup>1</sup> Gemäß Artikel 16 Artikel 3 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 müssen die zuständigen Behörden und Finanzinstitute alle erforderlichen Anstrengungen unternehmen, um diesen Leitlinien nachzukommen.
2. Die Leitlinien legen fest, was nach Ansicht der EBA angemessene Aufsichtspraktiken innerhalb des Europäischen Finanzaufsichtssystems sind oder wie das Unionsrecht in einem bestimmten Bereich anzuwenden ist. Dazu sollten die zuständigen Behörden gemäß Artikel 2 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 die an sie gerichteten Leitlinien in geeigneter Weise in ihre Aufsichtspraktiken (z. B. durch Änderung ihres Rechtsrahmens oder ihrer Aufsichtsverfahren) integrieren, einschließlich der Leitlinien in diesem Dokument, die in erster Linie an Institute gerichtet sind.

## Meldepflichten

3. Nach Artikel 16 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 müssen die zuständigen Behörden der EBA bis zum 02.05.2016 mitteilen, ob sie diesen Leitlinien nachkommen oder nachzukommen beabsichtigen, oder die Gründe nennen, warum sie dies nicht tun. Geht innerhalb der genannten Frist keine Mitteilung ein, geht die EBA davon aus, dass die zuständige Behörde den Anforderungen nicht nachkommt. Die Mitteilungen sind unter Verwendung des auf der Website der EBA abrufbaren Formulars mit dem Betreff „EBA/GL/2016/01“ an [compliance@eba.europa.eu](mailto:compliance@eba.europa.eu) zu senden. Die Mitteilungen sollten durch Personen erfolgen, die befugt sind, entsprechende Meldungen im Auftrag ihrer Behörde zu übermitteln. Jegliche Änderungen des Status der Einhaltung müssen der EBA ebenfalls gemeldet werden.
4. Die Meldungen werden gemäß Artikel 16 Absatz 3 der EBA-Verordnung auf der Website der EBA veröffentlicht.

---

<sup>1</sup> Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Bankenaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/78/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 12).

## Titel I – Gegenstand, Anwendungsbereich und Begriffsbestimmungen

### 1. Die Leitlinien betreffen

(a) die in der geltenden Fassung der delegierten Verordnung (EU) Nr. 1222/2014 der Kommission festgelegten Indikatoren („Indikatoren“) für das Jahr 2016 und

(b) die Meldung der Daten (Indikatoren und zusätzliche Angaben zur Bestimmung von G-SRI sowie die jährliche Offenlegung der Indikatorwerte.

2. Die Leitlinien gelten für (i) EU-Mutterinstitute, EU-Mutterfinanzholdinggesellschaften, gemischte EU-Mutterfinanzholdinggesellschaften sowie Institute, die keine Tochterunternehmen eines EU-Mutterinstituts, einer EU-Mutterfinanzholdinggesellschaft oder einer gemischten EU-Mutterfinanzholdinggesellschaft sind („relevante Unternehmen“), die bei Anwendung eines angemessenen Wechselkurses, der den von der Europäischen Zentralbank am Ende des Geschäftsjahres veröffentlichten Referenzwechselkurs sowie internationale Standards berücksichtigt, eine Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote von über 200 Mrd. Euro aufweisen, sowie für (ii) zuständige Behörden im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Punkt 40 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, zu denen auch die Europäische Zentralbank im Zusammenhang mit den ihr gemäß Verordnung (EU) Nr. 1024/2013 übertragenen Aufgaben gehört.

## Titel II – Festlegung der Daten zur Bestimmung von G-SRI

3. Bei der Ermittlung der Bewertungsergebnisse relevanter Unternehmen anhand der Indikatoren sollten die Behörden die im Anhang zu diesen Leitlinien aufgeführten Datenspezifikationen heranziehen. Beim Melden der Daten sollten die relevanten Unternehmen die auf der Website der EBA veröffentlichten Anweisungen beachten.

4. Die zuständigen Behörden sollten die zusätzlichen Angaben (Abschnitte 14 und 15 des Anhangs) heranziehen, um ihre Einstufung nach behördlichem Ermessen gemäß Artikel 5 Absatz 6 der Verordnung (EU) Nr. 1222/2014 in der geltenden Fassung zu stützen. Außerdem berücksichtigen sie nach bestmöglichem Bemühen die nachrichtlichen Positionen (Abschnitte 16 bis 20 des Anhangs), um die Qualität der Daten zu erhöhen und künftige Verbesserungen an der Methode zur Bestimmung von G-SRI zu erleichtern. Die nachrichtlichen Positionen sollten ggf. durch Anmerkungen zur Datenqualität und -verfügbarkeit ergänzt werden.

## Titel III – Anforderungen an die Offenlegung durch Institute

5. Die zuständigen Behörden sollten sicherstellen, dass die relevanten Unternehmen die Daten (Indikatoren und zusätzliche Angaben) an die entsprechenden Behörden melden und die Daten und Indikatorwerte gemäß den Abschnitten 1 bis 13 des Anhangs zur jährlichen Bestimmung der G-SRI anhand der in Artikel 131 der Richtlinie 2013/36/EU festgelegten Methode offenlegen.

6. Die zuständigen Behörden sollten sicherstellen, dass die Offenlegung unter Verwendung der zu diesem Zweck auf der Website der EBA bereitgestellten elektronischen Vorlage und in Übereinstimmung mit den gemäß Artikel 441 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 erlassenen technischen Durchführungsstandards sowie mit dem Anhang zu den vorliegenden Leitlinien erfolgt. Die relevanten Unternehmen sollten die Informationen zum Abschluss des Geschäftsjahres spätestens

vier Monate nach dem Ende des jeweiligen Geschäftsjahres offenlegen. Die zuständigen Behörden können den relevanten Unternehmen, deren Geschäftsjahresende nicht auf den 31. Dezember fällt, gestatten, die Werte ihrer Indikatoren ausgehend von ihrer Lage zu einem näher am 31. Dezember liegenden Zeitpunkt zu melden. In jedem Fall sollte die Offenlegung der Informationen spätestens bis zum 31. Juli erfolgen.

7. Die zuständigen Behörden sollten bei Bedarf sicherstellen, dass die Daten mit denen identisch sind, die beim Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht eingereicht werden.

## Titel IV – Kommunikation der offengelegten Indikatorwerte

8. Die relevanten Unternehmen sollten ihre jeweiligen Vorlagen auf ihren Websites veröffentlichen. Soweit wie möglich sollten diese Vorlagen auch in das Dokument mit den gemäß Teil 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 erforderlichen Informationen aufgenommen werden. Alternativ sollte in diesem Dokument ein Verweis auf die Website erfolgen, auf der die Vorlagen veröffentlicht werden.
9. Die offengelegten Daten (einschließlich der zusätzlichen Angaben) sollten von den zuständigen Behörden in dem Format, das im technischen Durchführungsstandard nach Artikel 441 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 vorgesehen ist, zur Zentralisierung auf der EBA-Website an die EBA übermittelt werden. Die übermittelten zusätzlichen Angaben werden von der EBA nicht veröffentlicht.

## Titel V – Schlussbestimmungen und Umsetzung

10. Diese Leitlinien sind ab dem Tag nach ihrer Veröffentlichung in allen Amtssprachen der EU anzuwenden.
11. Die Leitlinien zur Offenlegung von Indikatoren für die globale systemische Relevanz vom 5. Juni 2014 (EBA/GL/2014/02) werden hiermit aufgehoben.

## Anhang

### Vorlage

#### Allgemeine Bankdaten

Abschnitt 1 – Allgemeine Informationen	Antwort
a. Allgemeine, von der zuständigen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben:	
(1) Ländercode	
(2) Name der Bank	
(3) Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	
(4) Meldewährung	
(5) Euro-Umrechnungskurs	
(6) Datum der Übermittlung (JJJJ-MM-TT)	
b. Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben:	
(1) Meldende Abteilung	
(2) Rechnungslegungsstandard	
(3) Datum der Offenlegung (JJJJ-MM-TT)	
(4) Sprache der Offenlegung	
(5) Webadresse der Offenlegung	-

#### Größenindikatoren

Abschnitt 2 – Gesamtrisikoposition	Betrag
a. Derivate	
(1) Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten	
(2) Nominalwert von Kreditderivaten (Obergrenze)	
(3) Potenzielle zukünftige Risikopositionen aus Derivatkontrakten	
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)	
(1) Angepasster Bruttowert von SFT	
(2) Gegenparteien-Risiken aus SFT	
c. Sonstige Vermögenswerte	
d. Bruttonominalwert außerbilanzieller Positionen	
(1) Positionen mit einem CCF von 0 % (CCF = Kreditumrechnungsfaktor)	
(2) Positionen mit einem CCF von 20 %	
(3) Positionen mit einem CCF von 50 %	
(4) Positionen mit einem CCF von 100 %	
e. Regulatorische Anpassungen	
f. Indikator für die Gesamtrisikoposition (Gesamtrisikoposition vor den regulatorischen Anpassungen) (Summe aus den Positionen 2 a Unterpunkt 1 bis 2 c, dem 0,1-Fachen von 2 d Unterpunkt 1, dem 0,2-Fachen von 2 d Unterpunkt 2, dem 0,5-Fachen von 2 d Unterpunkt 3 sowie 2 d Unterpunkt 4)	

## Indikatoren für Verflechtungen

<b>Abschnitt 3 – Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems</b>	<b>Betrag</b>
a. Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	
(1) Einlagenzertifikate	
b. Nicht in Anspruch genommener Teil der verbindlich zugesagten Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	
c. Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände:	
(1) Besicherte Schuldverschreibungen	
(2) Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	
(3) Nachrangige Schuldverschreibungen	
(4) Geldmarktpapiere	
(5) Eigenkapitalinstrumente	
(6) In Verbindung mit den unter Position 3 c Unterpunkt 5 bestimmten Eigenkapitalinstrumenten aufgerechnete Short-Positionen	
d. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	
e. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert:	
(1) Positiver beizulegender Nettozeitwert	
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	
f. Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 3 a, 3 b bis 3 c Unterpunkt 5, 3 d, 3 e Unterpunkt 1 und 3 e Unterpunkt 2, abzüglich 3 c Unterpunkt 6)	
<b>Abschnitt 4 – Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems</b>	<b>Betrag</b>
a. Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel	
(1) Einlagen durch Verwahrstellen	
(2) Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	
(3) Von anderen Finanzinstituten gewährte Darlehen	
b. Nicht in Anspruch genommener Teil der zugesagten Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	
c. Aktuelle negative Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	
d. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert:	
(1) Negativer beizulegender Nettozeitwert	
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	
e. Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4 a Unterpunkt 1 bis 4 d Unterpunkt 2)	
<b>Abschnitt 5 – Ausstehende Wertpapiere</b>	<b>Betrag</b>
a. Besicherte Schuldverschreibungen	
b. Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	
c. Nachrangige Schuldverschreibungen	
d. Geldmarktpapiere	

e. Einlagenzertifikate

f. Eigenkapital

g. Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5 c nicht erfasst sind

h. Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5 a bis 5 g)

### Indikatoren für Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur

<b>Abschnitt 6 – Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen (ausgenommen Zahlungen innerhalb der Gruppe)</b>	<b>Betrag</b>
--	---------------

a. Australische Dollar (AUD)

b. Brasilianische Reais (BRL)

c. Kanadische Dollar (CAD)

d. Schweizer Franken (CHF)

e. Chinesische Yuan (CNY)

f. Euro (EUR)

g. Britische Pfund (GBP)

h. Hongkong-Dollar (HKD)

i. Indische Rupien (INR)

j. Japanische Yen (JPY)

k. Schwedische Kronen (SEK)

l. US-Dollar (USD)

m. Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6 a bis 6 l)

<b>Abschnitt 7 – Custody-Vermögen</b>	<b>Betrag</b>
---------------------------------------	---------------

a. Indikator für Custody-Vermögen

<b>Abschnitt 8 – Übernommene Transaktionen an Fremd- und Eigenkapitalmärkten</b>	<b>Betrag</b>
--	---------------

a. Aktienemissionsgeschäfte

b. Anleihenemissionsgeschäfte

c. Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8 a und 8 b)

### Indikatoren für Komplexität

<b>Abschnitt 9 – Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate</b>	<b>Betrag</b>
---	---------------

a. Über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate

b. Bilateral abgewickelte OTC-Derivate

c. Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9 a und 9 b)

<b>Abschnitt 10 – Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung</b>	<b>Betrag</b>
---	---------------

**verfügbare Wertpapiere**

- a. Wertpapiere des Handelsbestands
- b. Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere
- c. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen
- d. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen
- e. Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere (Summe aus den Positionen 10 a und 10 b, abzüglich der Summe von 10 c und 10 d)

**Abschnitt 11 – Vermögenswerte der Stufe 3**

**Betrag**

- a. Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3 (Vermögenswerte, die anhand von Bewertungsparametern auf Stufe 3 zu Bilanzzwecken bewertet werden)

**Indikatoren für Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Geschäfte**

**Abschnitt 12 – Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Forderungen**

**Betrag**

- a. Indikator für Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Forderungen (gesamte ausländische Forderungen auf Basis des letzten Risikos)

**Abschnitt 13 – Verbindlichkeiten**

**Zuständigkeitsgrenzen**

**überschreitende**

**Betrag**

- a. Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)

(1) Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13 a

- b. Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäfte)

- c. Indikator für Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13 a und 13 b, abzüglich 13 a Unterpunkt 1)

**Zusätzliche Angaben**

**Abschnitt 14 – Hilfsindikatoren**

**Betrag**

- a. Gesamtverbindlichkeiten
- b. Retail-Funding
- c. Kennzahl der Abhängigkeit vom Wholesale-Funding (Differenz zwischen den Positionen 14 a und 14 b, dividiert durch 14 a)
- d. Bruttoumsatz insgesamt
- e. Nettoumsatz insgesamt
- f. Netto-Auslandsumsatz
- g. Bruttowert bereitgestellter Geldmittel und Bruttozeitwert in SFT bereitgestellter Sicherheiten
- h. Bruttowert entliehener Geldmittel und Bruttozeitwert in SFT entliehener Sicherheiten



i. Positiver beizulegender Bruttozeitwert von OTC-Derivategeschäften

j. Negativer beizulegender Bruttozeitwert von OTC-Derivategeschäften

**Betrag in einzelnen Einheiten**

k. Anzahl der Rechtsräume

**Abschnitt 15 – Hilfspositionen**

**Betrag**

e. Bis zur Fälligkeit gehaltene Wertpapiere

f. Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen

(1) Mexikanische Pesos (MXN)

(2) Neuseeland-Dollar (NZD)

(3) Russische Rubel (RUB)

**Nachrichtliche Positionen**

**Abschnitt 16 – Positionen zur Größe**

**Betrag**

a. Kontowert für verschiedene Versicherungsprodukte mit Mindestgarantien (einschl. Rückversicherung)

b. Kontowert für verschiedene Versicherungsprodukte mit Mindestgarantien (abzgl. Rückversicherung) c.

d. Risikopositionen einschl. Versicherungstochtergesellschaften

e. Risikopositionen von Versicherungstochtergesellschaften:

(1) Bilanzielle Versicherungsvermögen

(2) Potenzielle zukünftige Risikopositionen aus Derivatekontrakten für Versicherungstochtergesellschaften

(3) Unbedingt kündbare Verpflichtungen für Versicherungstochtergesellschaften

(4) Sonstige außerbilanzielle Verpflichtungen für Versicherungstochtergesellschaften

(5) Investitionswert in Bezug auf die konsolidierten Unternehmen

**Abschnitt 17 – Positionen zu Verflechtungen**

**Betrag**

a. Buchwert von Aktien, für die kein Marktpreis verfügbar ist

b. Von genossenschaftlichen Banken ausgestellte Zertifikate

c. Minderheitsanteile

d. Verflechtung mit Instituten, die ausschließlich Wertpapiermakler sind, Vermögenswerte

e. Verflechtung mit Instituten, die ausschließlich Wertpapiermakler sind, Verbindlichkeiten

f. Kreditgarantien für anderen Finanzinstituten eingeräumte Kredite

g. Kreditgarantien für von anderen Finanzinstituten gewährte Kredite

h. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus SFT mit anderen Finanzinstituten (überarbeitete Definition)

i. Aktuelle negative Nettorisikoposition aus SFT mit anderen Finanzinstituten (überarbeitete Definition)

j. Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems einschl.

Versicherungstochtergesellschaften

(1) Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel
(2) Nicht in Anspruch genommener Teil der zugesagten Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden
(3) Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände
(4) Aktuelle positive Nettorisikoposition aus SFT mit anderen Finanzinstituten
(5) OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert:
k. Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems einschl. Versicherungstochtergesellschaften
(1) Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel
(2) Nicht in Anspruch genommener Teil der zugesagten Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden
(3) Aktuelle negative Nettorisikoposition aus SFT mit anderen Finanzinstituten
(4) OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert
l. Ausstehende Wertpapiere, einschließlich von Versicherungstochtergesellschaften ausgegebene Wertpapiere

**Abschnitt 18 – Positionen zur Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur**

**Betrag**

a. Als Korrespondenzbank für andere Banken geleistete Zahlungen	
(1) Australische Dollar (AUD)	
(2) Brasilianische Reais (BRL)	
(3) Kanadische Dollar (CAD)	
(4) Schweizer Franken (CHF)	
(5) Chinesische Yuan (CNY)	
(6) Euro (EUR)	
(7) Britische Pfund (GBP)	
(8) Hongkong-Dollar (HKD)	
(9) Indische Rupien (INR)	
(10) Japanische Yen (JPY)	
(11) Schwedische Kronen (SEK)	
(12) US-Dollar (USD)	
(13) Mexikanische Pesos (MXN)	
(14) Neuseeland-Dollar (NZD)	
(15) Russische Rubel (RUB)	
b. Handelsvolumen der von Staaten ausgegebenen Wertpapiere	
c. Handelsvolumen der von anderen Unternehmen der öffentlichen Hand ausgegebenen Wertpapiere	
d. Handelsvolumen sonstiger festverzinslicher Wertpapiere	
e. Handelsvolumen gelisteter Wertpapiere	
f. Handelsvolumen aller sonstigen Wertpapiere	
g. Im Auftrag von Kunden auf zentrale Gegenparteien verbuchte Sicherheitsmarge	
h. Für die berichtende Gruppe auf zentrale Gegenparteien verbuchte Sicherheitsmarge	
i. Beiträge zum Ausfallfonds für zentrale Gegenparteien	

j. Sonstige Fazilitäten für zentrale Gegenparteien

k. Bereitstellung von Abwicklungsdiensten im Zusammenhang mit zentral abgewickelten Transaktionen

**Abschnitt 19 – Positionen zur Komplexität**

**Betrag**

a. Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate, einschl. Versicherungstochtergesellschaften

b. Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung verfügbare (AFS-)Wertpapiere, einschl. Versicherungstochtergesellschaften

c. Vermögenswerte der Stufe 3, einschl. Versicherungstochtergesellschaften

**Abschnitt 20 – Positionen zu rechtsräumeübergreifenden Geschäften**

**Betrag**

a. Ausländische derivative Forderungen auf Basis des letztlichen Risikos

b. Auslandsverbindlichkeiten auf Basis des unmittelbaren Risikos (einschl. Derivaten)

(1) Ausländische derivative Verbindlichkeiten auf Basis des unmittelbaren Risikos

**Abschnitt 21 – Positionen zur kurzfristigen Finanzierung**

**Betrag**

a. In der Mindestliquiditätsquote (LCR) erfasste gesicherte Finanzierung:

(1) Durch liquide Mittel der Stufe 1 gedeckte Finanzierung

(2) Durch liquide Mittel der Stufe 2A gedeckte Finanzierung

(3) Durch liquide Mittel der Stufe 2B gedeckte Finanzierung

(4) Durch Nicht-HQLA gedeckte Finanzierung

(5) ABS, strukturierte Finanzierungsinstrumente, ABCP, Conduits, SIV und andere Finanzierungstätigkeiten

(6) Sicherheitsleistungen

b. In der Mindestliquiditätsquote (LCR) erfasste unbesicherte großvolumige Finanzierungen:

(1) Operative Einlagen von Nichtfinanzunternehmen

(2) Operative Einlagen von Finanzinstituten

(3) Nicht-operative Einlagen von Nichtfinanzunternehmen

(4) Nicht-operative Einlagen von Finanzinstituten und ungesicherte Schuldtitlemission

c. In der strukturellen Liquiditätsquote (NSFR) erfasste gesicherte Finanzierung:

(1) Gesicherte Finanzierung mit einer Fälligkeit von weniger als 6 Monaten

(2) Gesicherte Finanzierung mit einer Fälligkeit zwischen 6 Monaten und 1 Jahr

d. In der strukturellen Liquiditätsquote (NSFR) erfasste unbesicherte großvolumige Finanzierungen mit einer Fälligkeit von weniger als 6 Monaten:

(1) Operative Einlagen von Nichtfinanzunternehmen

(2) Operative Einlagen von Finanzinstituten

(3) Nicht-operative Einlagen und unbesicherte Finanzierungen von Nichtfinanzunternehmen

(4) Nicht-operative Einlagen und sonstige großvolumige Finanzierungen von Finanzinstituten

f. In der strukturellen Liquiditätsquote (NSFR) erfasste unbesicherte großvolumige Finanzierungen mit einer Fälligkeit zwischen 6 Monaten und 1 Jahr:

- (1) Operative Einlagen von Nichtfinanzunternehmen
- (2) Operative Einlagen von Finanzinstituten
- (3) Nicht-operative Einlagen und unbesicherte Finanzierungen von Nichtfinanzunternehmen
- (4) Nicht-operative Einlagen und sonstige großvolumige Finanzierungen von Finanzinstituten

### Zusammenfassung der Kontrollen

	Indikatorwert in Mio. EUR
<b>Abschnitt 22 – Indikatorwerte</b>	
a. Abschnitt 2 – Indikator für die Gesamtrisikoposition	
b. Abschnitt 3 – Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems	
c. Abschnitt 4 – Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems	
d. Abschnitt 5 – Indikator für ausstehende Wertpapiere	
e. Abschnitt 6 – Indikator für Zahlungsaktivität	
f. Abschnitt 7 – Indikator für Custody-Vermögen	
g. Abschnitt 8 – Indikator für Emissionsgeschäfte	
h. Abschnitt 9 – Indikator für OTC-Derivative	
i. Abschnitt 10 – Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (AfS-)Wertpapiere	
j. Abschnitt 11 – Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	
k. Abschnitt 12 – Indikator für Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Forderungen	
l. Abschnitt 13 – Indikator für Zuständigkeitsgrenzen überschreitende Verbindlichkeiten	
m. Sonstige Abschnitte	
(1) Position 1.a – Allgemeine, von der Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben:	
(2) Position 1.b – Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben:	
(3) Abschnitt 14 – Hilfsindikatoren	
(4) Abschnitt 15 – Hilfspositionen	
(5) Abschnitt 16 – Positionen zur Größe	
(6) Abschnitt 17 – Positionen zu Verflechtungen	
(7) Abschnitt 18 – Positionen zur Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur	
(8) Abschnitt 19 – Positionen zur Komplexität	
(9) Abschnitt 20 – Positionen zu r Zuständigkeitsgrenzen überschreitende n Geschäften	
(10) Abschnitt 21 – Kurzfristige Finanzierung	