

OFFENLEGUNG DER MINDESTANFORDERUNGN AN EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEIT

Meldebogen-Code	Bezeichnung des Meldebogens
EU KM2	Schlüsselparameter – MREL und, falls zutreffend, G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten
EU TLAC1	Zusammensetzung – MREL und, falls zutreffend, G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten
EU iLAC	Interne Verlustabsorptionsfähigkeit: interne MREL und, falls zutreffend, Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten für Nicht-EU-G-SRI
EU TLAC2	Rangfolge der Gläubiger – Unternehmen, das keine Abwicklungseinheit ist
EU TLAC3	Rangfolge der Gläubiger – Abwicklungseinheit

EU KM2: Schlüsselparameter – MREL und, falls zutreffend, G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige V

		a	b	c	d	e	f
		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)	G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (TLAC)				
		T	T	T-1	T-2	T-3	T-4
Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, Verhältniszahlen und Bestandteile							
1	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten						
EU-1a	Davon Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten						
2	Gesamtrisikobetrag der Abwicklungsgruppe (TREA)						
3	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil am TREA						
EU-3a	Davon Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten						
4	Gesamtrisikopositionsmessgröße (TEM) der Abwicklungsgruppe						
5	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil an der TEM						
EU-5a	Davon Eigenmittel oder nachrangige Verbindlichkeiten						
6a	Gilt die Ausnahme von der Nachrangigkeit in Artikel 72b Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013? (5%-Ausnahme)						
6b	Aggregierter Betrag der zulässigen nicht nachrangigen berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten bei Anwendung des Ermessensspielraums für die Rangfolge gemäß Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (max. 3,5 % Befreiung)						
6c	Wenn eine Obergrenze für die Ausnahme von der Nachrangigkeit gemäß Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gilt, handelt es sich um den Betrag der begebenen Mittel, die gleichrangig mit den ausgenommenen Verbindlichkeiten sind und gemäß Zeile 1 angerechnet werden, dividiert durch die begebenen Mittel, die gleichrangig mit den ausgenommenen Verbindlichkeiten sind und die gemäß Zeile 1 angerechnet würden, wenn keine Obergrenze angewendet würde (in %).						
Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)							
EU-7	MREL als prozentualer Anteil am TREA						
EU-8	Davon mit Eigenmitteln oder nachrangigen Verbindlichkeiten zu erfüllen						
EU-9	MREL als prozentualer Anteil an der TEM						
EU-10	Davon mit Eigenmitteln oder nachrangigen Verbindlichkeiten zu erfüllen						

EU TLAC1 – Zusammensetzung – MREL und, falls zutreffend, G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten

		a	b	c
		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)	G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (TLAC)	Zusatzinformation: Beträge, die für die Zwecke der MREL, aber nicht der TLAC berücksichtigungsfähig sind
Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten sowie Anpassungen				
1	Hartes Kernkapital (CET1)			
2	Zusätzliches Kernkapital (AT1)			
3	In der EU: leeres Feld			
4	In der EU: leeres Feld			
5	In der EU: leeres Feld			
6	Ergänzungskapital (T2)			
7	In der EU: leeres Feld			
8	In der EU: leeres Feld			
11	Eigenmittel für die Zwecke von Artikel 92a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 und Artikel 45 der Richtlinie 2014/59/EU			
Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten: Nicht-regulatorische Bestandteile des Kapitals				
12	Direkt von der Abwicklungseinheit begebene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die gegenüber ausgenommenen Verbindlichkeiten nachrangig sind (nicht bestandsgeschützt)			
EU-12a	Von anderen Unternehmen der Abwicklungsgruppe begebene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die gegenüber ausgenommenen Verbindlichkeiten nachrangig sind (nicht bestandsgeschützt)			
EU-12b	Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die gegenüber ausgenommenen Verbindlichkeiten nachrangig sind, und vor dem 27. Juni 2019 begeben wurden (nachrangig bestandsgeschützt)			
EU-12c	Ergänzungskapitalinstrumente mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr, in dem Umfang, in dem sie nicht als Ergänzungskapitalposten gelten			
13	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nicht nachrangig zu ausgenommenen Verbindlichkeiten sind (nicht bestandsgeschützt, vor Anwendung der Obergrenze)			
EU-13a	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nicht nachrangig zu den vor dem 27. Juni 2019 begebenen ausgenommenen Verbindlichkeiten sind (vor Anwendung der Obergrenze)			
14	Betrag der nicht nachrangigen berücksichtigungsfähigen Instrumente, gegebenenfalls nach Anwendung von Artikel 72b Absatz 3 CRR			
15	In der EU: leeres Feld			
16	In der EU: leeres Feld			
17	Posten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten vor Anpassungen			
EU-17a	Davon Positionen der nachrangigen Verbindlichkeiten			
Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten: Anpassungen nicht-regulatorischer Bestandteile des Kapitals				
18	Eigenmittel und Positionen der nachrangigen Verbindlichkeiten vor Anpassungen			
19	(Abzug von Positionen zwischen Multiple-Point-of-Entry- (MPE-) Abwicklungsgruppen)			
20	(Abzug von Investitionen in andere Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten)			
21	In der EU: leeres Feld			
22	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten nach Anpassung			
EU-22a	Davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten			
Risikogewichteter Positionsbetrag und Risikopositionsmessgröße der Abwicklungsgruppe				
23	Gesamtrisikobetrag (TREA)			
24	Gesamtrisikopositionsmessgröße (TEM)			
Verhältniswert der Eigenmittel und der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten				
25	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil am TREA			
EU-25a	Davon Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten			
26	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil an der TEM			
EU-26a	Davon Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten			
27	CET1 (in Prozent des TREA), das nach Erfüllung der Anforderungen der Abwicklungsgruppe zur Verfügung steht			
28	Institutsspezifische kombinierte Kapitalpufferanforderung			
29	davon Kapitalerhaltungspuffer			
30	davon antizyklischer Kapitalpuffer			
31	davon Systemrisikopuffer			
EU-31a	davon Puffer für global systemrelevante Institute (G-SRI) oder andere systemrelevante Institute (A-SRI)			
Zusatzinformationen				
EU-32	Gesamtbetrag der ausgenommenen Verbindlichkeiten im Sinne von Artikel 72a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013			

EU ILAC – Interne Verlustabsorptionsfähigkeit: interne MREL und, falls zutreffend, Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten für Nicht-EU-G-SRI

		a	b	c
		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (interne MREL)	Nicht-EU-G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (interne TLAC)	Qualitative Angaben
Anwendbare Anforderung und Anwendungsebene				
EU-1	Unterliegt das Unternehmen einer G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten? (J/N)			
EU-2	Wenn EU-1 mit „Ja“ beantwortet wurde, gilt die Anforderung auf konsolidierter oder individueller Basis? (K/I)			
EU-2a	Unterliegt das Unternehmen einer internen MREL? (J/N)			
EU-2b	Wenn EU-2a mit „Ja“ beantwortet wurde, gilt die Anforderung auf konsolidierter oder individueller Basis? (K/I)			
Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten				
EU-3	Hartes Kernkapital (CET1)			
EU-4	Berücksichtigungsfähiges zusätzliches Kernkapital			
EU-5	Berücksichtigungsfähiges Ergänzungskapital			
EU-6	Berücksichtigungsfähige Eigenmittel			
EU-7	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten			
EU-8	davon gewährte Garantien			
EU-9a	(Anpassungen)			
EU-9b	Eigenmittel und Positionen der nachrangigen Verbindlichkeiten nach der Anpassung			
Gesamtrisikobetrag und Gesamtrisikopositionsmessgröße				
EU-10	Gesamtrisikobetrag (TREA)			
EU-11	Gesamtrisikopositionsmessgröße (TEM)			
Verhältniswert der Eigenmittel und der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten				
EU-12	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil am TREA			
EU-13	davon gewährte Garantien			
EU-14	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil an der TEM			
EU-15	davon gewährte Garantien			
EU-16	CET1 (in Prozent des TREA), das nach Erfüllung der Anforderungen des Unternehmens zur Verfügung steht			
EU-17	Institutsspezifische kombinierte Kapitalpufferanforderung			
Anforderungen				
EU-18	Anforderung als prozentualer Anteil am TREA			
EU-19	davon, welcher Teil der Anforderung mit einer Garantie erfüllt werden kann			
EU-20	Anforderung als prozentualer Anteil an der TEM			
EU-21	davon, welcher Teil der Anforderung mit einer Garantie erfüllt werden kann			
Zusatzinformationen				
EU-22	Gesamtbetrag der ausgenommenen Verbindlichkeiten im Sinne von Artikel 72a Absatz 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013			

EU TLAC2a: Rangfolge der Gläubiger – Unternehmen, das keine Abwicklungseinheit ist

		Insolvenzrangfolge							Summe von 1 bis n
		1	1	2	2	...	n	n	
		(rangniedrigster)	(rangniedrigster)				(ranghöchster)	(ranghöchster)	
		Abwicklungs- einheit	Sonstige	Abwicklungs- einheit	Sonstige	...	Abwicklungs- einheit	Sonstige	
1	In der EU: leeres Feld								
2	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz (Freitext)								
3	Verbindlichkeiten und Eigenmittel								
4	davon ausgenommene Verbindlichkeiten								
5	Verbindlichkeiten und Eigenmittel (abzüglich ausgenommene Verbindlichkeiten)								
6	Teilmenge der Verbindlichkeiten und Eigenmittel abzüglich der ausgenommenen Verbindlichkeiten, bei denen es sich um Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten handelt, für die Zwecke der [wählen Sie entsprechend: internen MREL/internen TLAC]								
7	davon Restlaufzeit ≥ 1 Jahr < 2 Jahre								
8	davon Restlaufzeit ≥ 2 Jahr < 5 Jahre								
9	davon Restlaufzeit ≥ 5 Jahre < 10 Jahre								
10	davon Restlaufzeit ≥ 10 Jahre, unter Ausschluss von Wertpapieren ohne bestimmte Fälligkeit								
11	davon Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit								

EU TLAC2b: Rangfolge der Gläubiger – Unternehmen, das keine Abwicklungseinheit ist

		Insolvenzrangfolge							Summe von 1 bis n
		1	1	2	2	...	n	n	
		(rangniedrigster)	(rangniedrigster)				(ranghöchster)	(ranghöchster)	
		Abwicklungs- einheit	Sonstige	Abwicklungs- einheit	Sonstige	...	Abwicklungs- einheit	Sonstige	
1	In der EU: leeres Feld								
2	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz (Freitext)								
3	In der EU: leeres Feld								
4	In der EU: leeres Feld								
5	In der EU: leeres Feld								
6	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten im Sinne der internen MREL								
7	davon Restlaufzeit ≥ 1 Jahr < 2 Jahre								
8	davon Restlaufzeit ≥ 2 Jahr < 5 Jahre								
9	davon Restlaufzeit ≥ 5 Jahre < 10 Jahre								
10	davon Restlaufzeit ≥ 10 Jahre, unter Ausschluss von Wertpapieren ohne bestimmte Fälligkeit								
11	davon Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit								

EU TLAC3a: Rangfolge der Gläubiger – Abwicklungseinheit

		Insolvenzrangfolge				Summe von 1 bis n
		1	2	...	n	
		(rangniedrigster)			(ranghöchster)	
1	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz (Freitext)					
2	Verbindlichkeiten und Eigenmittel					
3	davon ausgenommene Verbindlichkeiten					
4	Verbindlichkeiten und Eigenmittel (abzüglich ausgenommene Verbindlichkeiten)					
5	Teilmenge der Verbindlichkeiten und Eigenmittel abzüglich der ausgenommenen Verbindlichkeiten, bei denen es sich um Eigenmittel und Verbindlichkeiten handelt, die möglicherweise berücksichtigungsfähig sind für die Erfüllung der [wählen Sie entsprechend: MREL/TLAC]					
6	davon Restlaufzeit ≥ 1 Jahr < 2 Jahre					
7	davon Restlaufzeit ≥ 2 Jahr < 5 Jahre					
8	davon Restlaufzeit ≥ 5 Jahre < 10 Jahre					
9	davon Restlaufzeit ≥ 10 Jahre, unter Ausschluss von Wertpapieren ohne bestimmte Fälligkeit					
10	davon Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit					

EU TLAC3b: Rangfolge der Gläubiger – Abwicklungseinheit

		Insolvenzrangfolge				Summe von 1 bis n
		1	2	...	n	
		(rangniedrigster)			(ranghöchster)	
1	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz (Freitext)					
2	In der EU: leeres Feld					
3	In der EU: leeres Feld					
4	In der EU: leeres Feld					
5	Eigenmittel und Verbindlichkeiten, die potenziell für die Erfüllung der MREL anrechenbar sind					
6	davon Restlaufzeit ≥ 1 Jahr < 2 Jahre					
7	davon Restlaufzeit ≥ 2 Jahr < 5 Jahre					
8	davon Restlaufzeit ≥ 5 Jahre < 10 Jahre					
9	davon Restlaufzeit ≥ 10 Jahre, unter Ausschluss von Wertpapieren ohne bestimmte Fälligkeit					
10	davon Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit					