

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Instituts-nummer:

Prüfziffer:

Name:

Ort:

Stand Ende:

in Tsd Euro

	Gesamtbetrag der erzeugten Verbriefungspositionen	Synthetische Verbriefung: Auf das verbrieft 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 laufzeitberichtigte Beträge
		(-) Berücksichtigungsfähige finanzielle Sicherheiten: Schwankungsberichtigte Beträge (a)	(-) Abgänge insgesamt	Um Währungsinkongruenzen bereinigte berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate		Nominalbetrag zurückgehaltener oder zurückgehaltener Kreditversicherung	IRBA-Bemessungsgrundlage vor Berücksichtigung von Kreditrisikominderungstechniken (§ 251 Abs. 1 S. 4 VV)	Berücksichtigungsfähige Garantien und Kreditderivate: Inkongruenzberichtigte Beträge	Als Gewährleistungen berücksichtigungsfähige sonstige Ansprüche sowie Lebensversicherungen: Inkongruenzberichtigte Beträge		
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
010 Gesamtsumme											
020 Originator: Gesamtengagement											
030 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
040 Höchststrangig											
050 Mezzanine											
060 Erstverlustpositionen											
070 Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen											
080 Vorzeitige Tilgung											
090 Investor: Gesamtengagement											
091 darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist											
100 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen											
110 Höchststrangig											
120 Mezzanine											
130 Erstverlustpositionen											
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen											
150 Sponsor: Gesamtengagement											
160 Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen											
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen											

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

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-
Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen	Institutsnummer:	<input type="text"/>
Summenblatt	Ort:	<input type="text"/>

Prüf- ziffer:	<input type="text"/>	Name:	<input type="text"/>
Stand Ende:	<input type="text"/>		

in Tsd Euro

	IRBA-Bemessungsgrundlage nach Berücksichtigung sämtlicher Kreditrisikominderungsrechnen	Aufgliederung der IRBA-Bemessungsgrundlage aus Spalte (12) von außerbilanziellen Positionen nach IRBA-Konversionsfaktoren				IRBA-Positionswert (§ 252 SdVV)	(-) Abzug vom Eigenkapital (§ 268 SdVV)	IRBA-Positionswert nach Eigenkapitalabzugspositionen	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten								
		0%	>0% und <=20%	>20% und <=50%	>50% und <=100%				Ratingbasierter Ansatz (Bonitätsstufe 1 bis 11 bei Langfristung und 1 bis 3 bei Kurzfristung)								
									6 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	50 - 75%	100%	250%	425%	650%	
	12	13	14	15	16	17	18	19=17+18	20	21	22	23	24	25	26	27	
010 Gesamtsumme																	
020 Originator: Gesamtengagement																	
030 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
040 Höchststrangig																	
050 Mezzanine																	
060 Erstverlustpositionen																	
070 Außerbilanzielle und derivative Adressen- ausfallrisikopositionen																	
080 Vorzeitige Tilgung																	
090 Investor: Gesamtengagement																	
091 darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWG ist																	
100 Bilanzielle Adressenausfall- risikopositionen																	
110 Höchststrangig																	
120 Mezzanine																	
130 Erstverlustpositionen																	
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	
150 Sponsor: Gesamtengagement																	
160 Bilanzielle Adressen- ausfallrisikopositionen																	
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfall- risikopositionen																	

25. Meldung über IRBA-Positionen

IRBA EV

IRBA-Forderungsklasse:
Verbriefungsart:

Verbriefungen
Summenblatt

Institutsnummer:

Ort:

Prüfziffer:

Stand Ende:

Name:

in Tsd Euro

	Aufgliederung der IRBA-Positionswerte nach Risikogewichten							(*) Reduzierung des risikogewichteten IRBA-Positionswertes durch Wertberichtigungen und Rückstellungen	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.1 V)	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.2 V)	Risikogewichteter IRBA-Positionswert (§ 253 S.3 V) bei Verlust gegen die Sorgfaltspflichten nach § 18a Abs. 4 und § 18b Abs. 1 (§ 18b Abs. 6 KWVG)	Zuschlagsbetrag auf den risikogewichteten IRBA-Positionswert zur Erfassung einer Laufzeitunterdeckung bei synthetischen Verbriefungen	Aggregierte Kapitalanforderungen ohne Anwendung der Kappungsregelungen	Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	nachrichtlich: Eigenkapitalanforderung entsprechend dem Abgang von IRBA-Verbriefung zu anderen Forderungsklassen	Aggregierte Kapitalanforderungen
	1250%		Bankaufsichtlicher Formelansatz		Durchschnittliches Internes Einstufungsverfahren	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)									
	Mit Rating	Ohne Rating	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)	Durchschnittliche Risikogewichtung (%)												
	28	29	30	31	32	33	34									
010 Gesamtsumme																Übertrag ÜB-Meldebogen
020 Originator: Gesamtengagement																
030 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																
040 Höchststrangig																
050 Mezzanine																
060 Erstverlustpositionen																
070 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																
080 Vorzeitige Tilgung																
090 Investor: Gesamtengagement																
091 darunter: Positionen, deren Originator oder Sponsor nicht offenlegungspflichtig i.S.d. § 18b Abs. 5 KWVG ist																
100 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																
110 Höchststrangig																
120 Mezzanine																
130 Erstverlustpositionen																
140 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																
150 Sponsor: Gesamtengagement																
160 Bilanzielle Adressenausfallrisikopositionen																
170 Außerbilanzielle und derivative Adressenausfallrisikopositionen																