

DBL		Bericht - Risikotragfähigkeit	
ID (Z)	ID (S)	10	
10	1.	Institutsname	<input type="text"/>
20	2.	Kreditgeber-ID	<input type="text"/>
30	3.	Berichtsumfang	<input type="text" value="▼"/>
40	4.	Stichtag	<input type="text"/>
45	5.	Betragsbasis	<input type="text" value="▼"/>
50	6.	Ansprechpartner	<input type="text"/> (Vorname, Name)
60	7.	Telefon	<input type="text"/>
70	8.	E-Mail	<input type="text"/>

GRP			Anwendungsbereich / Umfang des Risikotragfähigkeitskonzepts																	
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50	60												
			<b>1. Nicht einbezogene Unternehmen i. S. des § 10a KWG</b>																	
			Umfassen die Angaben alle Unternehmen i. S. des § 10a KWG? Falls nicht, so führen Sie bitte alle nicht einbezogenen gruppenangehörigen Unternehmen i. S. des § 10a KWG nachfolgend an.																	
10	1		<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 15%;">Kreditnehmer-ID</th> <th style="width: 20%;">Name des Unternehmens</th> <th style="width: 15%;">Bilanzsumme</th> <th style="width: 15%;">Beteiligungsquote (in Prozent)</th> <th style="width: 15%;">Rechnungslegungsstandard</th> <th style="width: 20%;">Anwendungsbereich</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> <td> </td> <td style="text-align: right;">▼</td> <td style="text-align: right;">▼</td> </tr> </tbody> </table>						Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Beteiligungsquote (in Prozent)	Rechnungslegungsstandard	Anwendungsbereich					▼	▼
Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Beteiligungsquote (in Prozent)	Rechnungslegungsstandard	Anwendungsbereich															
				▼	▼															
			Änderung der Angaben: <a href="#">+Unternehmen hinzufügen</a> <a href="#">+Unternehmen zusammen mit Stammdatenmeldung (STA) hinzufügen</a>																	
20			Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 30px; width: 100%;"></div>																	
			<b>2. Einbezogene Unternehmen, die nicht unter § 10a KWG fallen</b>																	
			Sind Unternehmen in das Risikotragfähigkeitskonzept einbezogen, die nicht zu den Unternehmen i. S. des § 10a KWG gehören? Falls ja, so führen Sie bitte die einbezogenen Unternehmen, die nicht unter § 10a KWG fallen, nachfolgend an.																	
30	1		<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 15%;">Kreditnehmer-ID</th> <th style="width: 20%;">Name des Unternehmens</th> <th style="width: 15%;">Bilanzsumme</th> <th style="width: 15%;">Beteiligungsquote (in Prozent)</th> <th style="width: 15%;">Rechnungslegungsstandard</th> <th style="width: 20%;">Anwendungsbereich</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td> </td> <td> </td> <td> </td> <td> </td> <td style="text-align: right;">▼</td> <td style="text-align: right;">▼</td> </tr> </tbody> </table>						Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Beteiligungsquote (in Prozent)	Rechnungslegungsstandard	Anwendungsbereich					▼	▼
Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Beteiligungsquote (in Prozent)	Rechnungslegungsstandard	Anwendungsbereich															
				▼	▼															
			Änderung der Angaben: <a href="#">+Unternehmen hinzufügen</a> <a href="#">+Unternehmen zusammen mit Stammdatenmeldung (STA) hinzufügen</a>																	
40			Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 30px; width: 100%;"></div>																	

<b>GRP</b>						<b>Anwendungsbereich / Umfang des Risikotragfähigkeitskonzepts</b>															
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50														
50	1		<p><b>3. Unternehmen mit Freistellung nach § 2a Absatz 2, Absatz 4 oder Absatz 5 KWG</b></p> <p>Gibt es Unternehmen in der Gruppe, die für das Management von Risiken von den Anforderungen an eine ordnungsgemäße Geschäftsorganisation gemäß § 25a Absatz 1 KWG eine Freistellung nach § 2a Absatz 2, Absatz 4 oder Absatz 5 KWG in Anspruch nehmen?                      Falls ja, so führen Sie bitte die betreffenden Unternehmen nachfolgend an.</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin: 10px 0;"> <thead> <tr> <th style="width: 20%; padding: 5px;">Kreditnehmer-ID</th> <th style="width: 30%; padding: 5px;">Name des Unternehmens</th> <th style="width: 20%; padding: 5px;">Bilanzsumme</th> <th style="width: 20%; padding: 5px;">Rechnungslegungsstandard</th> <th style="width: 10%; padding: 5px;">Freistellung i.S.v.</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="height: 20px;"></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td style="text-align: center;">▼</td> </tr> </tbody> </table> <p>Änderung der Angaben: <u>+ Unternehmen hinzufügen</u>    <u>+ Unternehmen zusammen mit Stammdatenmeldung (STA) hinzufügen</u></p> <p>Erläuterungen:</p> <div style="border: 1px solid black; height: 30px; margin: 5px 0;"></div>									Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Rechnungslegungsstandard	Freistellung i.S.v.				▼	▼
Kreditnehmer-ID	Name des Unternehmens	Bilanzsumme	Rechnungslegungsstandard	Freistellung i.S.v.																	
			▼	▼																	
60			<p><b>4. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b></p> <div style="border: 1px solid black; height: 40px; margin: 5px 0;"></div>																		
70			<div style="border: 1px solid black; height: 40px; margin: 5px 0;"></div>																		

STA			Stammdatenmeldung													
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10													
10	1	Name/Firma (lt. Registereintragung)	<table border="1"> <tr><td> </td></tr> </table>													
20	1	Postleitzahl														
30	1	Sitz														
40	1	Staat														
50	1	ISO-Code (Staat)														
60	1	Bundesstaat														
70	1	Wirtschaftszweig-Code														
80	1	Steuernummer														
90	1	Registereintragung - Art und Nummer														
100	1	Registereintragung - Ort														
110	1	Legal Entity Identifier (LEI)														
120	1	Kreditnehmer-ID														

<b>RTFK</b>			<b>Konzeption der Risikotragfähigkeitsberechnungen</b>	
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20
<b>1. Angaben zum Steuerungskreis oder ergänzenden Verfahren</b>				
10	1		<b>Bankinterne Bezeichnung</b>	<input style="width: 100%; height: 20px;" type="text"/>
20	1		<b>Steuerungskreis Kennnummer (KNR)</b>	<input style="width: 100%; height: 20px;" type="text"/>
30	1		<b>Folgejahresbetrachtung zu Steuerungskreis (KNR)</b>	<input style="width: 100%; height: 20px;" type="text"/>
40	1		<b>Die Folgejahresbetrachtung ist zum Stichtag nicht relevant</b>	<input type="checkbox"/>
50	1		<b>Ergänzendes Verfahren zu Steuerungskreis (KNR)</b>	<input style="width: 100%; height: 20px;" type="text"/>
60	1		<b>Der Steuerungskreis ist primär steuerungsrelevant</b>	<input type="checkbox"/>
Änderung der Angaben: + <u>Steuerungskreis hinzufügen</u>				
<b>2. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b>				
70	<div style="border: 1px solid black; height: 100px; width: 100%;"></div>			

STKK			Konzeption des Steuerungskreises - Steuerungskreis KNR ...			
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40
			<b>1. Verfahren</b>			
10			Konzeption des verwendeten Verfahrens: <input type="text" value=""/>			
20			Erläuterungen: <input type="text"/>			
			<b>2. RTF-Betrachtungshorizont</b>			
30			<b>2.1 Konzeption des RTF-Betrachtungshorizonts</b> <input type="text" value=""/>			
50			<b>2.2 Betrachtungshorizont für diese RTF-Meldung</b> <input type="text" value=""/> (TT.MM.JJJJ)			
55			<b>2.3 Frequenz für die Berechnung des Steuerungskreises</b> <input type="text" value=""/>			
40			Erläuterungen: <input type="text"/>			
			<b>3. Zielsetzung und Motivation des Steuerungskreises</b>			
60			<b>3.1 Liegt dem Steuerungskreis ein einheitliches Konfidenzniveau zu Grunde?</b> Falls ja, geben Sie dieses bitte an. Höhe des Konfidenzniveaus <input type="text" value=""/> (in Prozent)			
90			<b>3.2 Welche Ziele liegen dem Steuerungskreis zu Grunde? (Mehrfachnennung möglich)</b> <input type="checkbox"/> Einhaltung folgender Zielkapitalkennziffer(n):			
100			Harte Kernkapitalquote <input type="text" value=""/> (in Prozent)			
110			Kernkapitalquote <input type="text" value=""/> (in Prozent)			
120			Gesamtkapitalquote <input type="text" value=""/> (in Prozent)			
210			Erläuterungen: <input type="text"/>			

RDP-R			Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von den regulatorischen Eigenmitteln																																																				
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50																																																
			<b>1. Zusammensetzung des Risikodeckungspotenzials</b>																																																				
10			Auf welchem Rechnungslegungsstandard beruht die Ermittlung der regulatorischen Eigenmittel? <input type="text"/>																																																				
			<table border="1"> <thead> <tr> <th>Bestandteil des Risikodeckungspotenzials</th> <th>Stichtagswert</th> <th>Angepasster Wert</th> <th>Im RDP berücksichtigter Wert</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td colspan="4"><b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Eigenmitteln</b></td> </tr> <tr> <td>Hartes Kernkapital</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Kernkapital</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderung nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Eigenmittel</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Eigenmittel, die zur Einhaltung der Anforderung aus Artikel 92 CRR erforderlich sind (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>					Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert	<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Eigenmitteln</b>				Hartes Kernkapital				Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)				Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)				Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)				Kernkapital				Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderung nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)				Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)				Eigenmittel				Eigenmittel, die zur Einhaltung der Anforderung aus Artikel 92 CRR erforderlich sind (-)				Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)			
Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert																																																				
<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Eigenmitteln</b>																																																							
Hartes Kernkapital																																																							
Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)																																																							
Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)																																																							
Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)																																																							
Kernkapital																																																							
Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderung nach Artikel 92 CRR erforderlich ist (-)																																																							
Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)																																																							
Eigenmittel																																																							
Eigenmittel, die zur Einhaltung der Anforderung aus Artikel 92 CRR erforderlich sind (-)																																																							
Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)																																																							
20																																																							
30																																																							
40																																																							
50																																																							
60																																																							
70																																																							
80																																																							
90																																																							
100																																																							
110																																																							



RDP-R			Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von den regulatorischen Eigenmitteln				
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
			Bestandteil des Risikodeckungspotenzials		Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert
			<b>1.3 Weitere Posten</b>				
420			Planergebnis (+/-)				
430			<input type="checkbox"/> vor Bewertung <input type="checkbox"/> vor Steuern <input type="checkbox"/> nach Bewertung <input type="checkbox"/> nach Steuern				
440			Mindestgewinn / Geplante Ausschüttung (-)				
450			Ungebundene Vorsorgereserven nach § 26a KWG a. F.				
460			Stille Reserven				
470			<input type="checkbox"/> mit Berücksichtigung steuerlicher Effekte <input type="checkbox"/> ohne Berücksichtigung steuerlicher Effekte				
480			└ davon in Immobilien				
490			└ davon in Wertpapieren				
500			└ davon in Beteiligungen				
510	1		+ <u>weiteren Bestandteil der stillen Reserven hinzufügen</u>				
520			Stille Lasten (-)				
530			└ davon in Immobilien (-)				
540			└ davon in Wertpapieren (-)				
550			└ davon in Beteiligungen (-)				
560			└ davon aus Pensionsverpflichtungen (-)				
570	1		+ <u>weiteren Bestandteil der stillen Lasten hinzufügen</u>				
580	1		+ <u>weiteren Bestandteil oder Abzugsposten hinzufügen</u>				
590			<b>1.4 Zwischensumme</b>				
			<b>1.5 Zusätzliche Korrekturposten</b>				
600			Abzugsposten für bereits im RDP berücksichtigte Risiken (-)				
610			Nicht explizit zur Abdeckung von Risiken berücksichtigter Puffer (-)				
620			<b>1.6 Gesamt</b>				
			<b>2. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b>				
630							

RDP-BI			Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von der externen Rechnungslegung (IFRS)								
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50				
			<b>1. Zusammensetzung des Risikodeckungspotenzials</b>								
			<table border="1"> <thead> <tr> <th>Bestandteil des Risikodeckungspotenzials</th> <th>Stichtagswert</th> <th>Angepasster Wert</th> <th>Im RDP berücksichtigter Wert</th> </tr> </thead> </table>					Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert
Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert								
			<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Eigenkapital</b>								
10			Bilanzielles Eigenkapital								
			<b>1.2 Nachrichtliche Posten</b>								
20			Neubewertungsrücklage								
30			Anteile im Fremdbesitz								
40			Eigenkapitaldifferenz aus Währungsumrechnung								
50			Cash-Flow-Hedge-Rücklage								
			<b>1.3 Weitere Posten</b>								
60			Verbindlichkeiten mit laufender Verlustteilnahme								
70			Nachrangige Verbindlichkeiten ohne laufende Verlustteilnahme								
80			nachrichtlich: von in die Konsolidierung einbezogenen Unternehmen begebene Instrumente								
90			Planergebnis (+/-)								
100			<input type="checkbox"/> vor Bewertung <input type="checkbox"/> vor Steuern <input type="checkbox"/> nach Bewertung <input type="checkbox"/> nach Steuern								
110			Mindestgewinn / Geplante Ausschüttung (-)								
120			Aufgelaufene Gewinne und Verluste zum Meldestichtag (+/-)								
130			Stille Reserven								
140			<input type="checkbox"/> mit Berücksichtigung steuerlicher Effekte <input type="checkbox"/> ohne Berücksichtigung steuerlicher Effekte								
150			└ davon in Immobilien								
160			└ davon in Wertpapieren								
170			└ davon in Beteiligungen								
180	1		+ weiteren Bestandteil der stillen Reserven hinzufügen.								
190			Stille Lasten (-)								
200			└ davon in Immobilien (-)								
210			└ davon in Wertpapieren (-)								
220			└ davon in Beteiligungen (-)								
230			└ davon aus Pensionsverpflichtungen (-)								
240	1		+ weiteren Bestandteil der stillen Lasten hinzufügen.								



RDP-BI		Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von der externen Rechnungslegung (IFRS)					
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
420							
		2.	Ergänzende Angaben und Erläuterungen				
			<div style="border: 1px solid black; height: 60px; width: 100%;"></div>				

RDP-BH		Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von der externen Rechnungslegung (HGB)					
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
<b>1. Zusammensetzung des Risikodeckungspotenzials</b>							
			<b>Bestandteil des Risikodeckungspotenzials</b>	<b>Stichtagswert</b>	<b>Angepasster Wert</b>	<b>Im RDP berücksichtigter Wert</b>	
10			<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Eigenkapital</b>				
			Bilanzielles Eigenkapital				
20			<b>1.2 Nachrichtliche Posten</b>				
			Anteile im Fremdbesitz				
30			Rücklage für Anteile am herrschenden oder mit Mehrheitsbesitz beteiligten Unternehmen				
40			Eigenkapitaldifferenz aus Währungsumrechnung				
50			Drohverlustrückstellung wegen verlustfreier Bewertung des Zinsbuchs				
60			<b>1.3 Weitere Posten</b>				
70			Fonds für allgemeine Bankrisiken				
80			Verbindlichkeiten mit laufender Verlustteilnahme				
90			Nachrangige Verbindlichkeiten ohne laufende Verlustteilnahme				
100			nachrichtlich: von in die Konsolidierung einbezogenen Unternehmen begebene Instrumente				
110			Ungebundene § 340f HGB Reserven				
120			Ungebundene Vorsorgereserven nach § 26a KWG a. F.				
130			Planergebnis (+/-)				
			<input type="checkbox"/> vor Bewertung <input type="checkbox"/> vor Steuern				
			<input type="checkbox"/> nach Bewertung <input type="checkbox"/> nach Steuern				
140			Mindestgewinn / Geplante Ausschüttung (-)				
150			Aufgelaufene Gewinne und Verluste zum Meldestichtag (+/-)				
160			Stille Reserven				
170			<input type="checkbox"/> mit Berücksichtigung steuerlicher Effekte				
180			<input type="checkbox"/> ohne Berücksichtigung steuerlicher Effekte				
190			↳ davon in Immobilien				
200			↳ davon in Wertpapieren				
210	1		↳ davon in Beteiligungen				
			+ weiteren Bestandteil der stillen Reserven hinzufügen				



RDP-BH		Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Ableitung ausgehend von der externen Rechnungslegung (HGB)						
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50	
440								
		2.	Ergänzende Angaben und Erläuterungen					

RDP-BW			Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Barwertige Ableitung																																																																							
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40																																																																				
			<b>1. Zusammensetzung des Risikodeckungspotenzials (Barwertige Ableitung)</b>																																																																							
			<table border="1"> <thead> <tr> <th>Bestandteil des Risikodeckungspotenzials</th> <th>Stichtagswert</th> <th>Angepasster Wert</th> <th>Im RDP berücksichtigter Wert</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td colspan="4"><b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Nettovermögenswert</b></td> </tr> <tr> <td>Nettovermögenswert</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>    ↳ davon Barwert des Zinsbuchs</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>    ↳ davon Kostenbarwert</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>    ↳ davon Standardrisikokostenbarwert</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten des Nettovermögenswerts hinzufügen</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten hinzufügen</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="4"><b>1.2 Posten</b></td> </tr> <tr> <td>Zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigte Eigenmittel (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>    ↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes Kernkapital (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>        ↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes hartes Kernkapital (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>    ↳ darunter Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>        ↳ darunter hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>+ weiteren Abzugsposten hinzufügen</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>				Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert	<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Nettovermögenswert</b>				Nettovermögenswert				↳ davon Barwert des Zinsbuchs				↳ davon Kostenbarwert				↳ davon Standardrisikokostenbarwert				+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten des Nettovermögenswerts hinzufügen				+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten hinzufügen				<b>1.2 Posten</b>				Zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigte Eigenmittel (-)				↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes Kernkapital (-)				↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes hartes Kernkapital (-)				Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)				Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)				↳ darunter Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)				↳ darunter hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)				+ weiteren Abzugsposten hinzufügen			
Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert																																																																							
<b>1.1 Risikodeckungspotenzial aus Nettovermögenswert</b>																																																																										
Nettovermögenswert																																																																										
↳ davon Barwert des Zinsbuchs																																																																										
↳ davon Kostenbarwert																																																																										
↳ davon Standardrisikokostenbarwert																																																																										
+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten des Nettovermögenswerts hinzufügen																																																																										
+ weiteren Bestandteil oder Abzugsposten hinzufügen																																																																										
<b>1.2 Posten</b>																																																																										
Zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigte Eigenmittel (-)																																																																										
↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes Kernkapital (-)																																																																										
↳ darunter zur Einhaltung der Anforderungen nach Artikel 92 CRR benötigtes hartes Kernkapital (-)																																																																										
Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist (-)																																																																										
Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind (-)																																																																										
↳ darunter Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)																																																																										
↳ darunter hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist (-)																																																																										
+ weiteren Abzugsposten hinzufügen																																																																										
10																																																																										
20																																																																										
30																																																																										
40																																																																										
50	1																																																																									
60	1																																																																									
70																																																																										
80																																																																										
90																																																																										
100																																																																										
110																																																																										
120																																																																										
130																																																																										
140																																																																										

RDP-BW			Risikodeckungspotenzial - Steuerungskreis KNR ... - Barwertige Ableitung							
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40				
			<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 40%;">Bestandteil des Risikodeckungspotenzials</th> <th style="width: 20%;">Stichtagswert</th> <th style="width: 20%;">Angepasster Wert</th> <th style="width: 20%;">Im RDP berücksichtigter Wert</th> </tr> </thead> </table>	Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert			
Bestandteil des Risikodeckungspotenzials	Stichtagswert	Angepasster Wert	Im RDP berücksichtigter Wert							
150			<b>1.3 Zusätzliche Korrekturposten</b>							
160			Abzugsposten für bereits im RDP berücksichtigte Risiken							
170			Nicht explizit zur Abdeckung von Risiken berücksichtigter Puffer							
			<b>1.4 Gesamt</b>							
180			Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 40px; width: 100%;"></div>							
			<b>2. Qualitative Angaben</b>							
190			2.1 Wie werden die Standardrisikokosten ermittelt? Bitte erläutern Sie kurz die Systematik. Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 30px; width: 100%;"></div>							
200			2.2 Wie werden die Ablaufkationen bei Positionen mit unbestimmter Kapitalbindung für die Barwertberechnung hergeleitet? <span style="float: right;"><input style="width: 80px;" type="text"/></span> Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 30px; width: 100%;"></div>							
210			2.3 Werden Erträge aus erwartetem Neugeschäft berücksichtigt? Falls ja, bitte kurz erläutern. Erläuterungen: <div style="border: 1px solid black; height: 30px; width: 100%;"></div>							
220										
230			<b>3. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b> <div style="border: 1px solid black; height: 60px; width: 100%;"></div>							

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...																														
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60																									
				1. In der Risikotragfähigkeitsbetrachtung quantifizierte wesentliche Risiken																														
				<table border="1"> <thead> <tr> <th>Risikoart (Mehrfachauswahl möglich)</th> <th>Unterkategorie</th> <th>Risikobetrag</th> <th>Risikolimit</th> <th>Limitüberschreitung seit letztem Meldestichtag (falls zutreffend)</th> <th>Berechnungs- intervall</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>10</td> <td>1</td> <td><del> </del></td> <td><del> </del></td> <td><del> </del></td> <td><del> </del></td> </tr> <tr> <td>20</td> <td>1</td> <td>1</td> <td><del> </del></td> <td><del> </del></td> <td><del> </del></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>+ Risikoart hinzufügen</td> <td>+ Unterkategorie hinzufügen</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>							Risikoart (Mehrfachauswahl möglich)	Unterkategorie	Risikobetrag	Risikolimit	Limitüberschreitung seit letztem Meldestichtag (falls zutreffend)	Berechnungs- intervall	10	1	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>	20	1	1	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>			+ Risikoart hinzufügen	+ Unterkategorie hinzufügen		
Risikoart (Mehrfachauswahl möglich)	Unterkategorie	Risikobetrag	Risikolimit	Limitüberschreitung seit letztem Meldestichtag (falls zutreffend)	Berechnungs- intervall																													
10	1	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>																													
20	1	1	<del> </del>	<del> </del>	<del> </del>																													
		+ Risikoart hinzufügen	+ Unterkategorie hinzufügen																															
30				Gesamt ohne Inter-Risikodiversifikationseffekte																														
40				Inter-Risikodiversifikationseffekte																														
50				Gesamt mit Inter-Risikodiversifikationseffekten																														

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...			
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	70	80	90	100
				1. In der Risikotragfähigkeitsbetrachtung quantifizierte wesentliche Risiken (Fortsetzung Zeile)			
				Angaben zum Risikoquantifizierungsverfahren			
				Ansatz/Methode			Risikobetrachtungshorizont
10	1		(...)	▲	▲	▲	▼
				▼	▼	▼	
20	1	1	(...)	▲	▲	▲	▼
				▼	▼	▼	

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...															
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	110	120	130	140												
10	1			1. In der Risikotragfähigkeitsbetrachtung quantifizierte wesentliche Risiken (Fortsetzung Zeile)															
				<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="4">Angaben zum Risikoquantifizierungsverfahren</th> </tr> <tr> <th>Haltedauer</th> <th>Minimale Haltedauer (in Geschäftstagen)</th> <th>Maximale Haltedauer (in Geschäftstagen)</th> <th>Risikobegriff</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>▼</td> </tr> <tr> <td colspan="4">(...)</td> </tr> </tbody> </table>				Angaben zum Risikoquantifizierungsverfahren				Haltedauer	Minimale Haltedauer (in Geschäftstagen)	Maximale Haltedauer (in Geschäftstagen)	Risikobegriff				▼
Angaben zum Risikoquantifizierungsverfahren																			
Haltedauer	Minimale Haltedauer (in Geschäftstagen)	Maximale Haltedauer (in Geschäftstagen)	Risikobegriff																
			▼																
(...)																			
20	1	1		<table border="1"> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>▼</td> </tr> <tr> <td colspan="4">(...)</td> </tr> </tbody> </table>							▼	(...)							
			▼																
(...)																			



RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...											
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60						
				<b>2 . Risiken, die bereits im RDP berücksichtigt sind</b>											
				<p>Wurden bereits im Rahmen der RDP-Ableitung bestimmte Risikoarten durch eine Abzugsposition berücksichtigt? Falls ja, um welche Risikoarten handelt es sich? Bitte geben Sie soweit möglich den auf die jeweilige Risikoart entfallenden Betrag an.</p>											
60	1			Risikoart <input style="width: 100px;" type="text"/>			Betrag <input style="width: 100px;" type="text"/>								
				Änderung der Angaben: + <a href="#">Risikoart hinzufügen</a>											
70	1			Erläuterungen: <input style="width: 100%; height: 30px;" type="text"/>											
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	140	145	(...)	170								
				<b>2 . Risiken, die bereits im RDP berücksichtigt sind (Fortsetzung Zeile)</b>											
60	1		(...)	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 50%;">Risikobegriff</th> <th style="width: 50%;">Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="height: 20px;"></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>		Risikobegriff	Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk			(...)	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 100%;">Erläuterung</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="height: 20px;"></td> </tr> </tbody> </table>			Erläuterung	
Risikobegriff	Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk														
Erläuterung															

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...						
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	
<b>3. Limite</b>										
3.1 Wie bestimmt sich das Gesamtlimit in Abschnitt 1?										
80				<input type="checkbox"/>	Fester Prozentsatz des Risikodeckungspotenzials			<input type="text"/>	(in Prozent ohne Nachkommastellen)	
90				<input type="checkbox"/>	Fester Prozentsatz des Gesamtlimits aus Abschnitt 3.2			<input type="text"/>	(in Prozent ohne Nachkommastellen)	
100				<input type="checkbox"/>	Differenz in absoluter Höhe zum Risikodeckungspotenzial			<input type="text"/>		
110				<input type="checkbox"/>	Differenz in absoluter Höhe zum Gesamtlimit			<input type="text"/>		
120				<input type="checkbox"/>	Absoluter Betrag			<input type="text"/>		
130				<input type="checkbox"/>	Sonstiges (bitte kurz erläutern)			<input type="text"/>		
3.2 Gibt es ein höheres Gesamtlimit als die Summe der Risikolimit (ggf. inkl. Inter-Risikodiversifikationseffekte) in Abschnitt 1, das gleichzeitig kleiner ist als das Risikodeckungspotenzial? Falls ja, wie bestimmt sich das Gesamtlimit?										
140				<input type="checkbox"/>	Fester Prozentsatz des Risikodeckungspotenzials			<input type="text"/>	(in Prozent ohne Nachkommastellen)	
150				<input type="checkbox"/>	Differenz in absoluter Höhe zum Risikodeckungspotenzial			<input type="text"/>		
160				<input type="checkbox"/>	Absoluter Betrag			<input type="text"/>		
170				<input type="checkbox"/>	Sonstiges (bitte kurz erläutern)			<input type="text"/>		

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...						
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	
				<b>4. Überschreitungen des RDP zwischen Meldestichtagen</b>						
180				4.1 Überstiegen die Risiken seit dem Stichtag der letzten Meldung das zur Abdeckung zur Verfügung stehende Risikodeckungspotenzial? Falls ja, um welchen Betrag? <input type="text"/>						
190				4.2 Überstiegen die Risiken seit dem Stichtag der letzten Meldung das Gesamtlimit? Falls ja, um welchen Betrag? <input type="text"/>						
200				Erläuterungen: <input type="text"/>						
				<b>5. Berücksichtigung eingetretener Verluste bzw. geringerer Gewinne</b>						
210				5.1 Wie werden bereits eingetretene Verluste berücksichtigt? <input type="text"/> ▼						
220				5.2 Wie werden geringere Gewinne als in der RDP-Ableitung angenommen berücksichtigt? <input type="text"/> ▼						
230				5.3 Falls Berücksichtigung über Risikoseite erfolgt, wie hoch ist der Betrag nach etwaigen Diversifikationseffekten? <input type="text"/>						
240				Erläuterungen: <input type="text"/>						
				<b>6. Nicht mit Risikodeckungspotenzial unterlegte wesentliche Risiken</b>						
250				Haben Sie wesentliche Risiken identifiziert, die nicht mit Risikodeckungspotenzial unterlegt werden? Falls ja, so geben Sie diese bitte an. Risikoart <input type="text"/> ▼						
				Änderung der Angaben: + <a href="#">Risikoart hinzufügen</a>						
260				Erläuterungen: <input type="text"/>						

RSK				Limite und Risiken - Steuerungskreis KNR ...					
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60
350									
			7.	Ergänzende Angaben und Erläuterungen					

STG		Steuerungsmaßnahmen und zukünftige Risikotragfähigkeit																					
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70														
10			<p><b>1. Frequenz der Berichterstattung</b></p> <p>Welche Frequenz der Berichterstattung ist in dem RTF-Konzept vorgesehen?</p> <div style="border: 1px solid black; width: 100px; height: 20px; margin-bottom: 5px;"></div> <p>Erläuterungen:</p> <div style="border: 1px solid black; width: 600px; height: 30px; margin-top: 5px;"></div>																				
20			<p><b>2. Maßnahmen zur Verbesserung der Risikotragfähigkeit</b></p> <p>Wurden aufgrund einer bereits vorliegenden oder sich konkret abzeichnenden Gefährdung der Risikotragfähigkeit seit der letzten RTF-Meldung Maßnahmen zur Verbesserung der Risikotragfähigkeit beschlossen und/oder durchgeführt? Falls ja, geben Sie diese bitte nachfolgend an.</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; margin-top: 10px;"> <thead> <tr> <th rowspan="2" style="width: 40%;">Maßnahme</th> <th rowspan="2" style="width: 10%;">Höhe</th> <th colspan="2" style="width: 15%;">Zeitraum / Zeitpunkt</th> <th rowspan="2" style="width: 15%;">Aufgrund welcher Maßnahmen wurde der Handlungsbedarf identifiziert</th> <th rowspan="2" style="width: 10%;">Erläuterungen</th> </tr> <tr> <th style="width: 5%;">Start</th> <th style="width: 5%;">Ende</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="height: 20px;"></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>Änderung der Angaben: + <a href="#">Maßnahme hinzufügen</a></p> <p>Erläuterungen:</p> <div style="border: 1px solid black; width: 600px; height: 30px; margin-top: 5px;"></div>							Maßnahme	Höhe	Zeitraum / Zeitpunkt		Aufgrund welcher Maßnahmen wurde der Handlungsbedarf identifiziert	Erläuterungen	Start	Ende						
Maßnahme	Höhe	Zeitraum / Zeitpunkt		Aufgrund welcher Maßnahmen wurde der Handlungsbedarf identifiziert	Erläuterungen																		
		Start	Ende																				
110	1		<p><b>3. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b></p> <div style="border: 1px solid black; width: 600px; height: 50px; margin-top: 10px;"></div>																				
120																							
170																							

KPL			Kapitalplanung - Kapitalplanungsszenario-KNR ...				
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
			1. Allgemeine Angaben zum Szenario für Kapitalplanung				
10			Kapitalplanungsszenario-Kennnummer (KPN)	<input type="text"/>			
20			Bankinterne Bezeichnung	<input type="text"/>			
30			Beschlussdatum der Kapitalplanung	<input type="text"/>			
40			Art des Szenarios	<input type="text"/>			
50			Szenariobeschreibung	<input type="text"/>			
60			Berechnungsintervall	<input type="text"/>			
70			Erläuterungen:	<input type="text"/>			

KPL			Kapitalplanung - Kapitalplanungsszenario-KNR ...				
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
2. Normative Perspektive des Szenarios / regulatorische Kapitalplanung							
				t0	t1	t2	t3
<b>2.1 Kapitalplanung und Risikopositionen</b>							
80			Stichtag / Enddatum der Kapitalplanungsperiode				
90			Einzuhaltendes Hartes Kernkapital				
100			darunter Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderung nach Artikel 92 CRR erforderlich ist				
110			darunter Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist				
120			darunter Hartes Kernkapital, das zur Einhaltung der kombinierten Kapitalpufferanforderung nach § 10i KWG erforderlich ist				
130			Hartes Kernkapital				
140			Einzuhaltendes Kernkapital				
150			darunter Kernkapital, das zur Einhaltung der Anforderung nach Artikel 92 CRR erforderlich ist				
160			darunter Kernkapital, das zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich ist				
170			Kernkapital				
180			Einzuhaltende Eigenmittel				
190			darunter Eigenmittel, die zur Einhaltung der Anforderung aus Artikel 92 CRR erforderlich sind				
200			darunter Eigenmittel, die zur Einhaltung von der Aufsicht festgesetzter zusätzlicher Anforderungen erforderlich sind				
210			Eigenmittel				
220			Zusätzlicher Eigenmittelbedarf aus mitgeteilter bzw. erwarteter aufsichtlicher Eigenmittellempfehlung				
230	1		wird abgedeckt durch				
			<input type="text"/>				
			+ weiteren Bestandteil zur Abdeckung des Eigenmittelbedarfs hinzufügen				
240			Eigenmittelbedarf inklusive bankindividuellem Managementpuffer				
250	1		davon Eigenmittelbedarf an				
			<input type="text"/>				
			+ weiteren Bestandteil zur Abdeckung des Eigenmittelbedarfs hinzufügen				
260			Nicht genutzte, freie, ungebundene Vorsorgereserven				
270			Erläuterungen:				

KPL			Kapitalplanung - Kapitalplanungsszenario-KNR ...				
ID (Z)	ID (U)	ID (S)	10	20	30	40	50
280			Gesamtrisikobetrag gemäß CRR				
290			davon Gesamtbetrag der Risikopositionen für Adressenausfallrisiken				
300			davon Gesamtbetrag der Risikopositionen für Marktpreisrisiken				
310			davon Gesamtbetrag der Risikopositionen für operationelle Risiken				
320			Gesamtrisikopositionsmessgröße für die Verschuldungsquote				
330			Erläuterungen:				





KPL			Kapitalplanung - Kapitalplanungsszenario-KNR ...				
ID (Z)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50
780			Anteil am Gewinn oder (-) Verlust aus nach der Equity-Methode bilanzierten Beteiligungen an Tochter-, Gemeinschafts- und assoziierten Unternehmen				
790			Gewinn oder (-) Verlust aus als zur Veräußerung gehalten eingestuft langfristigen Vermögenswerten und Veräußerungsgruppen, die nicht die Voraussetzungen für eine Einstufung				
800			Gewinn oder (-) Verlust aus fortzuführenden Geschäften vor Steuern				
810			(Den fortzuführenden Geschäften zuzurechnender Steueraufwand oder (-) Steuerertrag)				
820			Gewinn oder (-) Verlust aus fortzuführenden Geschäften nach Steuern				
830			Gewinn oder (-) Verlust aus aufgegebenen Geschäftsbereichen nach Steuern				
850			(Geplante Ausschüttung)				
860			Erläuterungen:				

KPL			Kapitalplanung - Kapitalplanungsszenario-KNR ...				
ID (Z)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50
			<b>3. Interne Kapitalplanung (Going Concern-Ansatz alter Prägung)</b>				
870			Auf welchen Steuerungskreis (KNR) bezieht sich die Kapitalplanung? <input style="width: 100px;" type="text"/>				
880				t0	t1	t2	t3
890			Stichtag / Enddatum der Kapitalplanungsperiode				
			Risikodeckungspotenzial				
900			Gesamtrisiko				
910	1		Risikoart <input style="width: 150px;" type="text"/> ▼				
			+ Risikoart hinzufügen				
920			Erläuterungen: <input style="width: 300px;" type="text"/>				
			<b>4. Ergänzende Angaben und Erläuterungen</b>				
999							

ILAAP				ILAAP Verfahren zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität																																							
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100																														
				<b>1. Kapitalmarktorientierung</b>																																							
10				<p>Sind die zusätzlichen Anforderungen an das Liquiditätsrisikomanagement für kapitalmarktorientierte Institute i.S. der MaRisk einzuhalten?</p> <div style="border: 1px solid black; width: 100px; height: 50px; margin-left: 100px;"></div>																																							
				<b>2. Umfang des Liquiditätsrisikomanagements</b>																																							
20	1			Welche Arten von Liquiditätsrisiken werden im Rahmen der Risikoinventur identifiziert?																																							
30	1	1		<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 15%;">Risikoart</th> <th style="width: 15%;">Unterkategorie</th> <th style="width: 15%;">Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk</th> <th style="width: 15%;">Berechnungsintervall</th> <th style="width: 20%;">Definition / Abgrenzung der Risikoarten</th> <th style="width: 20%;">Erläuterung</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">▼</td> <td style="text-align: center;"><del>▼</del></td> <td></td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><small>+ Risikoart hinzufügen</small></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">▼</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="6"><small>+ Unterkategorie hinzufügen</small></td> </tr> </tbody> </table>										Risikoart	Unterkategorie	Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk	Berechnungsintervall	Definition / Abgrenzung der Risikoarten	Erläuterung	▼	<del>▼</del>		▼			<small>+ Risikoart hinzufügen</small>						▼	▼		▼			<small>+ Unterkategorie hinzufügen</small>					
Risikoart	Unterkategorie	Einstufung als wesentliches Risiko i.S. der MaRisk	Berechnungsintervall	Definition / Abgrenzung der Risikoarten	Erläuterung																																						
▼	<del>▼</del>		▼																																								
<small>+ Risikoart hinzufügen</small>																																											
▼	▼		▼																																								
<small>+ Unterkategorie hinzufügen</small>																																											
40				<p>Erläuterungen:</p> <div style="border: 1px solid black; width: 100%; height: 20px;"></div>																																							
50	1			Welche wesentlichen Liquiditätsrisiken aus Fremdwährungen bestehen?																																							
60				<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 15%;">Fremdwährung</th> <th style="width: 15%;">Volumina in % der Verbindlichkeiten</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> </tr> <tr> <td colspan="2"><small>+ Fremdwährung hinzufügen</small></td> </tr> </tbody> </table> <p>Erläuterungen:</p> <div style="border: 1px solid black; width: 100%; height: 20px;"></div>										Fremdwährung	Volumina in % der Verbindlichkeiten	▼		<small>+ Fremdwährung hinzufügen</small>																									
Fremdwährung	Volumina in % der Verbindlichkeiten																																										
▼																																											
<small>+ Fremdwährung hinzufügen</small>																																											

ILAAP				ILAAP Verfahren zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität										
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100	
				<b>3. Steuerungskennzahlen</b>										
				<p><b>Werden Kennzahlen zur Steuerung des Liquiditätsrisiko herangezogen?</b>                      Falls ja, bitte geben Sie die Höhe an:</p>										
				Weitere Kennzahlen (vordefiniert)	Zielgröße (minimum)	Zielgröße (maximum)	Höhe zum aktuellen Meldestichtag	Internes Limit	Falls es eine Limitverletzung (seit letztem Meldestichtag) gab oder sich abgezeichnet hat, wurden Maßnahmen ergriffen? Wenn ja, welche? (falls zutreffend)	Berechnungsintervall	Erläuterungen / Definition			
70				<del> </del>						▼				
80	1			▼							▼			
				<u>+ Steuerungskennzahl hinzufügen</u>										
90	1			▼							▼			
				<u>+ Steuerungskennzahl hinzufügen</u>										
100	1			▼							▼			
				<u>+ Steuerungskennzahl hinzufügen</u>										
110				Erläuterungen:										

ILAAP				ILAAP Verfahren zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität																																																																															
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100																																																																						
<b>4. Aufbau der Liquiditätsübersicht</b>																																																																																			
120				<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;"></td> <td style="width: 15%; text-align: center;">Untergliederung der Zeitbänder</td> <td style="width: 15%;"></td> </tr> <tr> <td>Tägliche Rasterung bis</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Wöchentliche Rasterung bis</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Monatliche Rasterung bis</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Gesamtzellhorizont der Liquiditätsübersicht</td> <td style="text-align: center;">▼</td> <td></td> </tr> </table>											Untergliederung der Zeitbänder													Tägliche Rasterung bis	▼													Wöchentliche Rasterung bis	▼													Monatliche Rasterung bis	▼													Gesamtzellhorizont der Liquiditätsübersicht	▼												
	Untergliederung der Zeitbänder																																																																																		
Tägliche Rasterung bis	▼																																																																																		
Wöchentliche Rasterung bis	▼																																																																																		
Monatliche Rasterung bis	▼																																																																																		
Gesamtzellhorizont der Liquiditätsübersicht	▼																																																																																		
130																																																																																			
140																																																																																			
150																																																																																			
160				<b>Erläuterungen:</b> <input style="width: 95%;" type="text"/>																																																																															
<b>5. Abflussannahmen für das Stressszenario gemäß MaRisk</b>																																																																																			
Abflussannahmen im Stressszenario gemäß MaRisk in %																																																																																			
				Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition																																																																											
170				<del>X</del>																																																																															
180	1			L darunter Unterkategorie	▼																																																																														
+ Unterkategorie hinzufügen																																																																																			
190				<del>X</del>																																																																															
200	1			L darunter Unterkategorie	▼																																																																														
+ Unterkategorie hinzufügen																																																																																			
210				<del>X</del>																																																																															
220	1			L darunter Unterkategorie	▼																																																																														
+ Unterkategorie hinzufügen																																																																																			
230				<del>X</del>																																																																															
240	1			L darunter Unterkategorie	▼																																																																														
+ Unterkategorie hinzufügen																																																																																			
Inanspruchnahme im steuerungsrelevanten MaRisk-Szenario in %																																																																																			
				Unterkategorie	1 Woche (kumuliert)	1 Monat (kumuliert)	bis 3 Monate (kumuliert)	Erläuterungen / Definition																																																																											
250				<del>X</del>																																																																															
260	1			L darunter Unterkategorie	▼																																																																														
+ Unterkategorie hinzufügen																																																																																			
270				<b>Erläuterungen:</b> <input style="width: 95%;" type="text"/>																																																																															

ILAAP				ILAAP Verfahren zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität																										
ID (Z)	ID (U1)	ID (U2)	ID (S)	10	20	30	40	50	60	70	80	90	100																	
				<b>6. Haircuts der Positionen des Liquiditätspuffers</b>																										
280	1	Abschläge bei den Positionen des Liquiditätspuffers im Stressszenario gemäß MaRisk in %																												
		<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 25%;">Hauptkategorie</th> <th style="width: 25%;"><del>Abschlag</del></th> <th style="width: 25%;">Abschlag</th> <th style="width: 25%;">Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>+ Hauptkategorie hinzufügen</p>												Hauptkategorie	<del>Abschlag</del>	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers	▼												
Hauptkategorie	<del>Abschlag</del>	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers																											
▼																														
290	1	1	Abschläge bei den Positionen des Liquiditätspuffers im Stressszenario gemäß MaRisk in %																											
			<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 25%;">Hauptkategorie</th> <th style="width: 25%;">Unterkategorie</th> <th style="width: 25%;">Abschlag</th> <th style="width: 25%;">Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>▼</td> <td>▼</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>+ Unterkategorie hinzufügen</p>										Hauptkategorie	Unterkategorie	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers	▼	▼												
Hauptkategorie	Unterkategorie	Abschlag	Definition / Abgrenzung der Positionen des Liquiditätspuffers																											
▼	▼																													
300	<p><b>Erläuterungen:</b> <input style="width: 100%;" type="text"/></p>																													
				<b>7. Liquiditätsstresstests</b>																										
310	1	Liquiditätsstresstests																												
		<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 10%;">Bezeichnung des Stresstests</th> <th style="width: 10%;">Art des Szenarios</th> <th style="width: 10%;">Zugrunde liegende Annahme</th> <th style="width: 10%;">Zugrunde liegender Zeithorizont (in Tagen)</th> <th style="width: 10%;">Wird ein Überlebenshorizont ermittelt? Falls ja, geben Sie diesen bitte in Tagen an</th> <th style="width: 10%;">Wird das Ergebnis limitiert? Wenn ja, wie?</th> <th style="width: 10%;">Welche Maßnahmen wurden aufgrund des Stresstests beschlossen? (falls zutreffend)</th> <th style="width: 10%;">Erläuterung</th> <th style="width: 10%;">Berechnungsintervall</th> <th style="width: 10%;">Validierungsintervall</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td>▼</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>▼</td> <td>▼</td> <td></td> <td>▼</td> <td>▼</td> </tr> </tbody> </table> <p>+ Stresstest hinzufügen</p>											Bezeichnung des Stresstests	Art des Szenarios	Zugrunde liegende Annahme	Zugrunde liegender Zeithorizont (in Tagen)	Wird ein Überlebenshorizont ermittelt? Falls ja, geben Sie diesen bitte in Tagen an	Wird das Ergebnis limitiert? Wenn ja, wie?	Welche Maßnahmen wurden aufgrund des Stresstests beschlossen? (falls zutreffend)	Erläuterung	Berechnungsintervall	Validierungsintervall		▼				▼	▼	
Bezeichnung des Stresstests	Art des Szenarios	Zugrunde liegende Annahme	Zugrunde liegender Zeithorizont (in Tagen)	Wird ein Überlebenshorizont ermittelt? Falls ja, geben Sie diesen bitte in Tagen an	Wird das Ergebnis limitiert? Wenn ja, wie?	Welche Maßnahmen wurden aufgrund des Stresstests beschlossen? (falls zutreffend)	Erläuterung	Berechnungsintervall	Validierungsintervall																					
	▼				▼	▼		▼	▼																					
320	1	<p><b>Erläuterungen:</b> <input style="width: 100%;" type="text"/></p>																												

