

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2001

Ausgegeben am 18. Dezember 2001

Teil II

447. Verordnung: 6. Monatsausweisverordnung

447. Verordnung des Bundesministers für Finanzen zur Durchführung des Bankwesengesetzes (6. Monatsausweisverordnung)

Auf Grund von § 74 Abs. 1 und 5 des Bankwesengesetzes (BWG), BGBl. Nr. 532/1993, zuletzt geändert durch BGBl. I Nr. 97/2001, wird verordnet:

§ 1. Kreditinstitute und Kreditinstitute aus Mitgliedstaaten, die in Österreich gemäß § 9 BWG über eine Zweigstelle tätig werden, haben die Monatsausweise gemäß § 74 Abs. 1 und 4 BWG entsprechend der **Anlage** zu gliedern. Bei Vorliegen einer Kreditinstituts-Gruppe nach § 30 BWG, bei der eine Finanz-Holdinggesellschaft als übergeordnetes Institut auftritt, hat das unmittelbar der Finanz-Holdinggesellschaft nachgeordnete Kreditinstitut für die Kreditinstituts-Gruppe den Teil D sowohl unter Einbeziehung als auch unter Ausklammerung der Finanz-Holdinggesellschaft (zweifache Konsolidierung) zu melden. Teil C, mit Ausnahme der Liquiditätsbestimmungen, und Teil D der Anlage sind von Kreditinstituten aus Mitgliedstaaten, die in Österreich gemäß § 9 BWG über eine Zweigstelle tätig werden, nicht auszufüllen.

§ 2. (1) Der Teil A des Monatsausweises ist unverzüglich nach Ablauf jeden Kalendermonats, spätestens aber bis zum zehnten Bankarbeitstag des Folgemonats, die Teile B1 und B2 des Monatsausweises sind unverzüglich nach Ablauf eines jeden Kalendervierteljahres, spätestens aber bis zum fünfzehnten Bankarbeitstag des Folgemonats, Teil C ist unverzüglich nach Ablauf eines jeden Kalendermonats, spätestens aber bis zum zwölften Bankarbeitstag des Folgemonats, und Teil D ist bis zum letzten Bankarbeitstag des Folgemonats der Oesterreichischen Nationalbank zu übermitteln.

(2) Die Übermittlung der Monatsausweise ist in standardisierter Form ausschließlich im Wege einer elektronischen Datenübertragung durchzuführen. Dabei sind die von der Oesterreichischen Nationalbank bekannt gegebenen Mindestanforderungen einzuhalten. Diese betreffen den Satzaufbau der Daten, die technischen Übertragungsvorgaben sowie die Korrektheit der Daten.

(3) Kreditinstitute, die einem Zentralinstitut angeschlossen sind, können ihre Monatsausweise im Wege einer von einer Zentralstelle durchgeführten elektronischen Datenübertragung abgeben, soweit sichergestellt ist, dass diese Monatsausweise von der Zentralstelle selbst hinsichtlich der Teile A, B1, B2 und C bis spätestens drei Tage nach Ablauf der in Abs. 1 genannten Fristen und hinsichtlich des Teiles D innerhalb der in Abs. 1 genannten Frist übermittelt werden.

(4) Eine Übermittlung des Monatsausweises an den Bundesminister für Finanzen ist nur auf dessen Verlangen erforderlich.

§ 3. Der Umrechnung von Fremdwährungspositionen sind die EZB-Referenzkurse am Monatsultimo zugrunde zu legen. Für jene Fremdwährungspositionen, für die keine EZB-Referenzkurse veröffentlicht werden, sind die Devisenmittelkurse am Monatsultimo heranzuziehen.

§ 4. (1) Diese Verordnung tritt mit 1. Dezember 2001 in Kraft. Die 5. Monatsausweisverordnung, BGBl. II Nr. 5/2001, tritt mit Ablauf des 30. November 2001 außer Kraft.

(2) Für die Meldungslegung zum Berichtstermin 31. Dezember 2001 sind anstelle der Teile Geschäftsstrukturdaten (Teil A), Restlaufzeitendarstellungen (Teil B1), Aufsichtsrelevante Zusatzdaten (Teil C) sowie Konsolidierung (Teil D) der Anlage zur 6. Monatsausweisverordnung noch die Teile Geschäftsstrukturdaten (Teil A), Restlaufzeitendarstellungen (Teil B), Aufsichtsrelevante Zusatzdaten (Teil C) sowie Konsolidierung (Teil D) der Anlage zur 5. Monatsausweis-Verordnung maßgeblich.

(3) Die Zinsrisikostatistik (Teil B2) ist, nach zwei Gruppen von Kreditinstituten unterschieden, erstmals ab den folgenden beiden Berichtsterminen auszufüllen: Alle Kreditinstitute, die zum Berichtstermin 12/2000 CAD-Handelsbuch-Melder waren (also § 22b Abs. 2 BWG nicht anwendeten) oder per

Jahresende 2000 eine Bilanzsumme von mehr als 40 Milliarden Schilling hatten – ausgenommen Bausparkassen –, haben als ersten Berichtstermin für die Zinsrisikostatistik den 31. Dezember 2001. Alle anderen Kreditinstitute einschließlich aller Bausparkassen haben als ersten Berichtstermin den 31. Dezember 2002.

(4) Die Position „hievon hybrides Kapital“ im Teil D, § 24 BWG – Konsolidierte Eigenmittel, ist erstmals ab Berichtstermin 30. Juni 2002 zu melden.

Grasser

**Positionsnummern
zu**

MONATSAUSWEIS (MAUS)

gemäß § 74 Abs. 1 und 4 Bankwesengesetz

Bestehend aus:

- Teil A: Geschäftsstrukturdaten**
- Teil B1: Restlaufzeitendarstellungen**
- Teil B2: Zinsrisikostatistik**
- Teil C: Aufsichtsrelevante Zusatzdaten**
- Teil D: Konsolidierung**

Versionsübersicht:

Änderungen mit 1. Jänner 1999:

- Änderung aller entsprechenden Schilling Positionen auf Euro und Erstellung der neuen Positionsnummer 9999999 zur Meldung entweder in Schilling oder in Euro.
- Löschung der Positionsnummern 0501022 sowie 0501021 bei Punkt 1 im Teil A.
- Neue Positionsnummern bei Punkt 8: 3821091, 3821041 und 3821031 im Teil A.
- Neue Positionsnummer bei Punkt 9: 0900011 im Teil A.
- Löschung der Positionsnummern 7111012, 7112012, 7111013, 7112013, 7121012 und 71222012 bei Punkt 17 im Teil A.
- Löschung der Positionsnummern 5300099 und 5400099 im Teil B, Restlaufzeitenstatistik.
- Neuaufnahme des § 22e WP-Handelsbuch (Punkt 4 Gamma- und Vega-Risiko).
- Änderung des Punkt 4 beim § 26 BWG Offene Devisenpositionen im Teil C.
- Löschung der Positionsnummer 7460011 bei § 27 GVA (Dotationseinlage) im Teil C.
- Löschung der Positionsnummer 7460011 bei § 27 GVA (Dotationseinlage) im Teil D.

Änderungen im Zuge der 5. MAUS-Verordnung:

- Teil A: Entfall der Position „Zur Refinanzierung bei der OeNB zugelassene Wechsel“.
- Teil A: Erweiterung um „sicherungspflichtige Wertpapierdienstleistungen“.
- Teil A, Sonstige Angaben zur Aktivseite: Entfall der zwei Positionen betreffend OeNB Lombard. Weiters Entfall der Position 4111019 (OeNB Lombard) bei Punkt 10 – Verbindlichkeiten gegenüber inländische Kl.
- Teil A, Barreserve: Entfall der Positionen 0131000 und 0132000 (Postscheckguthaben bei der ÖPSK).
- Teile C und D: Änderungen im Bereich des § 22b BWG sowie im Bereich der Zusammenfassung des Eigenmittelerfordernisses.
- Teile C und D, § 23 BWG Eigenmittel: Neugestaltung des Tier-III-Kapitals.
- Teil C: Entfall der Position „Postscheckguthaben (gemäß § 25 Abs. 6 Z 5)“ im Bereich des § 25 BWG.
- Teil C: Änderungen im Bereich des § 26 BWG.
- Teil C, Großveranlagungen gemäß § 27 BWG: Neugestaltung.

Änderungen im Zuge der 6. MAUS-Verordnung (Euro-Umstellung + Zinsrisikostatistik):

Inkrafttretung 1. Dezember 2001:

Teil B2, Restlaufzeiten: Erweiterung um die Zinsrisikostatistik: Alle Kreditinstitute, die zum Berichtstermin 12/2000 CAD-Handelsbuch-Melder waren (also § 22b Abs. 2 BWG nicht anwendeten) oder per Jahresende 2000 eine Bilanzsumme von mehr als 40 Milliarden Schilling hatten – ausgenommen Bausparkassen – haben als ersten Berichtstermin für die Zinsrisikostatistik den 31. Dezember 2001. Alle anderen Kreditinstitute einschließlich aller Bausparkassen haben als ersten Berichtstermin den 31. Dezember 2002.

Inkrafttretung 1. Jänner 2002:

- Entfall der Position 9999999
- Teil A, Punkt 1b, Andere Schuldtitel öffentlicher Stellen, sofern sie ...: Neue Position 3131092.
- Teil A, Punkt 3d, Forderungen an Kunden, Gliederung nach der Höhe: Änderung der Schilling-Beträge auf runde Euro-Beträge, daher neue Positionen.

- Teil A, Punkt 5b, Investmentzertifikate: Entfall der Positionen 3531590, 3541590, 3532590, 3542590, 3551590, 3561590, 3552590, 3562590 (hv. börsenotiert).
- Teil A, Punkt 8, Sonstige Aktivposten: Entfall der Position 3821091 (Kassenbestand, Ausland, EUR).
- Teil A, Punkt 11, Verbindlichkeiten gegenüber Kunden, Anzahl der Konten: Änderung der Schilling-Beträge auf runde Euro-Beträge, daher neue Positionen.
- Teil D, § 24 BWG – Konsolidierte Eigenmittel: Ergänzung um die hievon-Position „. hievon hybrides Kapital“.

TEIL A

GESCHÄFTSSTRUKTURDATEN

SUMMEN

Aktiv/Passivpositionen	Betrag
1. Schuldtitel öffentlicher Stellen und Wechsel, die zur Refinanzierung bei der Zentralnotenbank zugelassen sind	3100001
2. Forderungen an Kreditinstitute	3200001
3. Forderungen an Kunden (Nichtbanken)	3300001
4. Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche Wertpapiere	3400000
5. Aktien und andere nicht festverzinsliche Wertpapiere	3500000
6. Beteiligungen	3600000
7. Anteile an verbundenen Unternehmen	3700000
8. Sonstige Aktivposten	3800000
10. Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	4100000
11. Verbindlichkeiten gegenüber Kunden (Nichtbanken)	4200000
12. Verbriefte Verbindlichkeiten	4300000
13. Sonstige Passivposten	4400001
Summe der Aktiva/Passiva	2000000

1. SCHULDITEL ÖFFENTLICHER STELLEN UND WECHSEL, DIE ZUR REFINANZIERUNG BEI DER ZENTRALNOTENBANK ZUGELASSEN SIND

a) Bundesschatzscheine, sofern sie zur Refinanzierung bei Zentralnotenbanken zugelassen sind

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Summe	3111101	3112101	3121101	3122101	3111201	3112201	3121201	3122201

	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Summe	3111301	3112301	3121301	3122301	3111401	3112401	3121401	3122401

b) Andere Schuldtitel öffentlicher Stellen, sofern sie zur Refinanzierung bei Zentralnotenbanken zugelassen sind

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Sektor Bund	3121160	3122160	xxxxxxx	xxxxxxx	3121260	3122260	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3121161	3122161	xxxxxxx	xxxxxxx	3121261	3122261	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3121162	3122162	xxxxxxx	xxxxxxx	3121262	3122262	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3121163	3122163	xxxxxxx	xxxxxxx	3121263	3122263	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3121164	3122164	xxxxxxx	xxxxxxx	3121264	3122264	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3121102	3122102	3131102	3132102	3121202	3122202	3131202	3132202

	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Sektor Bund	3121360	3122360	xxxxxxx	xxxxxxx	3121460	3122460	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3121361	3122361	xxxxxxx	xxxxxxx	3121461	3122461	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3121362	3122362	xxxxxxx	xxxxxxx	3121462	3122462	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3121363	3122363	xxxxxxx	xxxxxxx	3121463	3122463	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3121364	3122364	xxxxxxx	xxxxxxx	3121464	3122464	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3121302	3122302	3131302	3132302	3121402	3122402	3131402	3132402

	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Zur Refinanzierung bei der OeNB zugelassene andere Schuldtitel öffentlicher Stellen	3121092	xxxxxxx	3131092	xxxxxxx

c) Wechsel, sofern sie zur Refinanzierung bei Zentralnotenbanken zugelassen sind

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	3141150	3142150	xxxxxxx	xxxxxxx	3141250	3142250	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3141151	3142151	xxxxxxx	xxxxxxx	3141251	3142251	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	3141160	3142160	xxxxxxx	xxxxxxx	3141260	3142260	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3141161	3142161	xxxxxxx	xxxxxxx	3141261	3142261	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3141162	3142162	xxxxxxx	xxxxxxx	3141262	3142262	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3141163	3142163	xxxxxxx	xxxxxxx	3141263	3142263	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3141164	3142164	xxxxxxx	xxxxxxx	3141264	3142264	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3141170	3142170	xxxxxxx	xxxxxxx	3141270	3142270	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	3141171	3142171	xxxxxxx	xxxxxxx	3141271	3142271	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	3141180	3142180	xxxxxxx	xxxxxxx	3141280	3142280	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3141103	3142103	3151103	3152103	3141203	3142203	3151203	3152203

	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	3141350	3142350	xxxxxxx	xxxxxxx	3141450	3142450	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3141351	3142351	xxxxxxx	xxxxxxx	3141451	3142451	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	3141360	3142360	xxxxxxx	xxxxxxx	3141460	3142460	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3141361	3142361	xxxxxxx	xxxxxxx	3141461	3142461	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3141362	3142362	xxxxxxx	xxxxxxx	3141462	3142462	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3141363	3142363	xxxxxxx	xxxxxxx	3141463	3142463	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3141364	3142364	xxxxxxx	xxxxxxx	3141464	3142464	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3141370	3142370	xxxxxxx	xxxxxxx	3141470	3142470	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	3141371	3142371	xxxxxxx	xxxxxxx	3141471	3142471	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	3141380	3142380	xxxxxxx	xxxxxxx	3141480	3142480	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3141303	3142303	3151303	3152303	3141403	3142403	3151403	3152403
. Festzinsgebunden	3141399	3142399	3151399	3152399	3141499	3142499	3151499	3152499

2. FORDERUNGEN AN KREDITINSTITUTE

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nicht verbriefte Ford.	3211101	3212101	3221101	3222101	3211201	3212201	3221201	3222201
. Namensschuldversch.	3211191	3212191	3221191	3222191	3211291	3212291	3221291	3222291
. Ergänzungskapital	3211181	3212181	3221181	3222181	3211281	3212281	3221281	3222281
Verbriefte Ford.	3211102	3212102	3221102	3222102	3211202	3212202	3221202	3222202
.. aus eigener Emission	3211192	3212192	3221192	3222192	3211292	3212292	3221292	3222292
. Namensschuldversch.	3211182	3212182	3221182	3222182	3211282	3212282	3221282	3222282
Summe	3211100	3212100	3221100	3222100	3211200	3212200	3221200	3222200

	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nicht verbriefte Ford.	3211301	3212301	3221301	3222301	3211401	3212401	3221401	3222401
. Namensschuldversch.	3211391	3212391	3221391	3222391	3211491	3212491	3221491	3222491
. Ergänzungskapital	3211381	3212381	3221381	3222381	3211481	3212481	3221481	3222481
Verbriefte Ford.	3211302	3212302	3221302	3222302	3211402	3212402	3221402	3222402
.. aus eigener Emission	3211392	3212392	3221392	3222392	3211492	3212492	3221492	3222492
. Namensschuldversch.	3211382	3212382	3221382	3222382	3211482	3212482	3221482	3222482
Summe	3211300	3212300	3221300	3222300	3211400	3212400	3221400	3222400
. Festzinsgebunden	3211399	3212399	3221399	3222399	3211499	3212499	3221499	3222499

Forderungen an inländische Kreditinstitute

	in EURO
Aktienbanken und Bankiers	3211011
Sparkassensektor	3211012
Landes-Hypothekenbanken	3211013
Raiffeisensektor	3211014
Volksbankensektor	3211015
Bausparkassen	3211016
Sonder-Kreditinstitute	3211017
Summe	3211020
. beim Zentralinstitut	3211098
.. LI-Reserve beim ZI	0311011

3. FORDERUNGEN AN KUNDEN (NICHTBANKEN)

a) Gliederung nach Sektoren

Sektoren	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	3311150	3312150	xxxxxxx	xxxxxxx	3311250	3312250	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3311151	3312151	xxxxxxx	xxxxxxx	3311251	3312251	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	3311160	3312160	xxxxxxx	xxxxxxx	3311260	3312260	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3311161	3312161	xxxxxxx	xxxxxxx	3311261	3312261	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3311162	3312162	xxxxxxx	xxxxxxx	3311262	3312262	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3311163	3312163	xxxxxxx	xxxxxxx	3311263	3312263	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3311164	3312164	xxxxxxx	xxxxxxx	3311264	3312264	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3311170	3312170	xxxxxxx	xxxxxxx	3311270	3312270	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	3311171	3312171	xxxxxxx	xxxxxxx	3311271	3312271	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	3311180	3312180	xxxxxxx	xxxxxxx	3311280	3312280	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3311100	3312100	3321100	3322100	3311200	3312200	3321200	3322200

Sektoren	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	3311350	3312350	xxxxxxx	xxxxxxx	3311450	3312450	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3311351	3312351	xxxxxxx	xxxxxxx	3311451	3312451	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	3311360	3312360	xxxxxxx	xxxxxxx	3311460	3312460	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3311361	3312361	xxxxxxx	xxxxxxx	3311461	3312461	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3311362	3312362	xxxxxxx	xxxxxxx	3311462	3312462	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3311363	3312363	xxxxxxx	xxxxxxx	3311463	3312463	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3311364	3312364	xxxxxxx	xxxxxxx	3311464	3312464	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3311370	3312370	xxxxxxx	xxxxxxx	3311470	3312470	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	3311371	3312371	xxxxxxx	xxxxxxx	3311471	3312471	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	3311380	3312380	xxxxxxx	xxxxxxx	3311480	3312480	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	3311300	3312300	3321300	3322300	3311400	3312400	3321400	3322400
. Festzinsgebunden	3311399	3312399	3321399	3322399	3311499	3312499	3321499	3322499

b) Gliederung nach Forderungsarten

Forderungsart	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Wechselkredite	3311101	3312101	3321101	3322101	3311201	3312201	3321201	3322201
Kontokorrentkredite	3311102	3312102	3321102	3322102	3311202	3312202	3321202	3322202
Einmalkredite	3311103	3312103	3321103	3322103	3311203	3312203	3321203	3322203
Darlehen	3311104	3312104	3321104	3322104	3311204	3312204	3321204	3322204
Verbriefte Forderungen	3311105	3312105	3321105	3322105	3311205	3312205	3321205	3322205
. Namensschuldverschr.	3311195	3312195	3321195	3322195	3311295	3312295	3321295	3322295
Sonstige	3311106	3312106	3321106	3322106	3311206	3312206	3321206	3322206
. Namensschuldverschr.	3311196	3312196	3321196	3322196	3311296	3312296	3321296	3322296
. Ergänzungskapital	3311186	3312186	3321186	3322186	3311286	3312286	3321286	3322286
Summe	3311100	3312100	3321100	3322100	3311200	3312200	3321200	3322200
. hypothekarisch besichert	3311198	3312198	3321198	3322198	3311298	3312298	3321298	3322298
. für die Beschaffung und Erhaltung von Wohnraum	3311197	3312197	3321197	3322197	3311297	3312297	3321297	3322297
. Barvorlagen	3311194	3312194	3321194	3322194	3311294	3312294	3321294	3322294

Forderungsart	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Wechselkredite	3311301	3312301	3321301	3322301	3311401	3312401	3321401	3322401
Kontokorrentkredite	3311302	3312302	3321302	3322302	3311402	3312402	3321402	3322402
Einmalkredite	3311303	3312303	3321303	3322303	3311403	3312403	3321403	3322403
Darlehen	3311304	3312304	3321304	3322304	3311404	3312404	3321404	3322404
Verbriefte Forderungen	3311305	3312305	3321305	3322305	3311405	3312405	3321405	3322405
. Namensschuldverschr.	3311395	3312395	3321395	3322395	3311495	3312495	3321495	3322495
Sonstige	3311306	3312306	3321306	3322306	3311406	3312406	3321406	3322406
. Namensschuldverschr.	3311396	3312396	3321396	3322396	3311496	3312496	3321496	3322496
. Ergänzungskapital	3311386	3312386	3321386	3322386	3311486	3312486	3321486	3322486
Summe	3311300	3312300	3321300	3322300	3311400	3312400	3321400	3322400
. hypothekarisch besichert	3311398	3312398	3321398	3322398	3311498	3312498	3321498	3322498
. für die Beschaffung und Erhaltung von Wohnraum	3311397	3312397	3321397	3322397	3311497	3312497	3321497	3322497
. Barvorlagen	3311394	3312394	3321394	3322394	3311494	3312494	3321494	3322494

c) Sonstige Angaben (vierteljährlich zu melden)

	EURO		Fremdwährung	
	Anzahl	Betrag	Anzahl	Betrag
Immobilienfinanzierung	3311971	3311071	3312971	3312071
Subventionierte Wohnbaukredite	3311972	3311072	3312972	3312072
. mit Zinssubvention	3311992	3311092	3312992	3312092
Sonstige subventionierte Kredite	3311973	3311073	3312973	3312073
. mit Zinssubvention	3311993	3311093	3312993	3312093
Forderungen an Leasinggesellschaften	3311974	3311074	3312974	3312074
Forderungen an verbundene Unternehmen	3311975	3311075	3312975	3312075

d) Gliederung nach der Höhe (vierteljährlich zu melden)

nach der Höhe	EURO		Fremdwährung	
	Anzahl	Betrag	Anzahl	Betrag
bis 10 000 €	3311987	3311087	3312987	3312087
über 10 000 € bis 50 000 €	3311988	3311088	3312988	3312088
über 50 000 € bis 100 000 €	3311989	3311089	3312989	3312089
über 100 000 € bis 500 000 €	3311990	3311090	3312990	3312090
über 500 000 € bis 1 Mio. €	3311991	3311091	3312991	3312091
über 1 bis 3 Mio. €	3311994	3311094	3312994	3312094
über 3 Mio. €	3311995	3311095	3312995	3312095
Summe	3311902	3311002	3312902	3312002

4. SCHULDVERSCHREIBUNGEN UND ANDERE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

Emittenten	EURO-Wertpapiere inländischer Emittenten							
	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Kreditinstitute	3431140	3441140	3431240	3441240	3431340	3441340	3431440	3441440
. aus eigener Emission	3431198	3441198	3431298	3441298	3431398	3441398	3431498	3441498
Nbk-Finanzintermediäre	3431150	3441150	3431250	3441250	3431350	3441350	3431450	3441450
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3431151	3441151	3431251	3441251	3431351	3441351	3431451	3441451
Sektor Bund	3431160	3441160	3431260	3441260	3431360	3441360	3431460	3441460
. Bund	3431161	3441161	3431261	3441261	3431361	3441361	3431461	3441461
Länder	3431162	3441162	3431262	3441262	3431362	3441362	3431462	3441462
Gemeinden	3431163	3441163	3431263	3441263	3431363	3441363	3431463	3441463
Sozialversicherungen	3431164	3441164	3431264	3441264	3431364	3441364	3431464	3441464
Nicht-finanzielle Untern.	3431170	3441170	3431270	3441270	3431370	3441370	3431470	3441470
. Freie Berufe u. selbst. E.	3431171	3441171	3431271	3441271	3431371	3441371	3431471	3441471
Summe	3431100	3441100	3431200	3441200	3431300	3441300	3431400	3441400
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	3431399	3441399	3431499	3441499

Emittenten	Fremdwährungswertpapiere inländischer Emittenten							
	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Kreditinstitute	3432140	3442140	3432240	3442240	3432340	3442340	3432440	3442440
. aus eigener Emission	3432198	3442198	3432298	3442298	3432398	3442398	3432498	3442498
Nbk-Finanzintermediäre	3432150	3442150	3432250	3442250	3432350	3442350	3432450	3442450
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3432151	3442151	3432251	3442251	3432351	3442351	3432451	3442451
Sektor Bund	3432160	3442160	3432260	3442260	3432360	3442360	3432460	3442460
. Bund	3432161	3442161	3432261	3442261	3432361	3442361	3432461	3442461
Länder	3432162	3442162	3432262	3442262	3432362	3442362	3432462	3442462
Gemeinden	3432163	3442163	3432263	3442263	3432363	3442363	3432463	3442463
Sozialversicherungen	3432164	3442164	3432264	3442264	3432364	3442364	3432464	3442464
Nicht-finanzielle Untern.	3432170	3442170	3432270	3442270	3432370	3442370	3432470	3442470
. Freie Berufe u. selbst. E.	3432171	3442171	3432271	3442271	3432371	3442371	3432471	3442471
Summe	3432100	3442100	3432200	3442200	3432300	3442300	3432400	3442400
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	3432399	3442399	3432499	3442499

SCHULDVERSCHREIBUNGEN UND ANDERE FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

(Fortsetzung)

Emittenten	EURO-Wertpapiere ausländischer Emittenten							
	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Kreditinstitute	3451140	3461140	3451240	3461240	3451340	3461340	3451440	3461440
Nichtbanken	3451130	3461130	3451230	3461230	3451330	3461330	3451430	3461430
Summe	3451100	3461100	3451200	3461200	3451300	3461300	3451400	3461400
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	3451399	3461399	3451499	3461499

Emittenten	Fremdwährungswertpapiere ausländischer Emittenten							
	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Kreditinstitute	3452140	3462140	3452240	3462240	3452340	3462340	3452440	3462440
Nichtbanken	3452130	3462130	3452230	3462230	3452330	3462330	3452430	3462430
Summe	3452100	3462100	3452200	3462200	3452300	3462300	3452400	3462400
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	3452399	3462399	3452499	3462499

5. AKTIEN UND ANDERE NICHT FESTVERZINSLICHE WERTPAPIERE

a) Aktien

Emittenten	Inländische		Ausländische	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Kreditinstitute	3530540	3540540	3550540	3560540
Nbk-Finanzintermediäre	3530550	3540550		
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3530551	3540551		
Nicht-finanz. Untern.	3530571	3540571		
Nichtbanken	xxxxxxx	xxxxxxx	3550530	3560530
Summe	3530500	3540500	3550500	3560500
. börsennotiert	3530590	3540590	3550590	3560590

b) Investmentzertifikate

Emittent	Inländische				Ausländische			
	EURO- Investmentz.		FW- Investmentz.		EURO- Investmentz.		FW- Investmentz.	
	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert	Buchwert	Kurswert
Investmentfonds	0611028	3541501	0612028	3542501	0621513	3561501	0622513	3562501

c) Partizipations- und Ergänzungskapital

Emittenten	Part.kapital		Erg.kapital	
	Inländ.	Ausländ.	Inländ.	Ausländ.
Kreditinstitute	3510640	3520640	3510740	3520740
. aus eigener Emission	xxxxxxx	xxxxxxx	3510798	3520798
Nbk-Finanzintermediäre	3510650	xxxxxxx	3510750	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3510651	xxxxxxx	3510751	xxxxxxx
Nicht-finanz. Untern.	3510671	xxxxxxx	3510771	xxxxxxx
Nichtbanken	xxxxxxx	3520630	xxxxxxx	3520730
Summe	3510600	3520600	3510700	3520700
. börsennotiert	3510690	3520690	3510790	3520790

d) Sonstige nicht festverzinsliche Wertpapiere

Emittenten	Sonst. nicht festverzinsl. Wertpapiere			
	Inländische		Ausländische	
	EURO	FW	EURO	FW
Kreditinstitute	3511840	3512840	3521840	3522840
. aus eigener Emission	3511898	3512898	3521898	3522898
Nbk-Finanzintermediäre	3511850	3512850	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3511851	3512851	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	3511860	3512860	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	3511861	3512861	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	3511862	3512862	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	3511863	3512863	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	3511864	3512864	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3511870	3512870	xxxxxxx	xxxxxxx
Nichtbanken	xxxxxxx	xxxxxxx	3521830	3522830
Summe	3511800	3512800	3521800	3522800
. börsennotiert	3511890	3512890	3521890	3522890

6. BETEILIGUNGEN

an	Aktien		And. Beteil.rechte	
	Inland	Ausland	Inland	Ausland
Kreditinstituten	3610540	3620540	3610840	3620840
Nbk-Finanzinterm.	3610550	xxxxxxx	3610850	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	3610551	xxxxxxx	3610851	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	3610570	xxxxxxx	3610870	xxxxxxx
Nichtbanken	xxxxxxx	3620530	xxxxxxx	3620830
Summe	3610500	3620500	3610800	3620800
. börsenotiert	3610590	3620590	xxxxxxx	xxxxxxx

7. ANTEILE AN VERBUNDENEN UNTERNEHMEN

an	Aktien		And. Beteil.rechte	
	Inland	Ausland	Inland	Ausland
verbundenen Untern.	3710500	3720500	3710800	3720800
. börsenotiert	3710590	3720590		

8. SONSTIGE AKTIVPOSTEN

	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Barreserve	3811001	3812001	3821001	3822001
. Kassenbestand	0111000	xxxxxxx	3821091	3822091
. Guthaben bei Zentralnotenbanken	3811081	3812081	3821081	3822081
.. Guthaben bei der OeNB	0121000	0122000	xxxxxxx	xxxxxxx
. Guthaben bei Postgiroämtern	xxxxxxx	xxxxxxx	3821061	3822061
. Gold, gemünzt und ungemünzt	3811041	3812041	3821041	3822041
. Sonstige Edelmetalle	3811031	3812031	3821031	3822031
Immaterielle Vermögensgegenstände des Anlagevermögens	3811002	3812002	3821002	3822002
Sachanlagen	3811003	3812003	3821003	3822003
. Grundstücke und Bauten, die vom KI im Rahmen seiner eigenen Tätigkeit genutzt werden	3811093	3812093	3821093	3822093
. Sonstige	3811083	3812083	3821083	3822083
Eigene Aktien oder Anteile sowie Anteile an einer herrschenden oder an mit Mehrheit beteil. Gesellschaft	3811004	3812004	3821004	3822004
. Nennwert	3811094	3812094	3821094	3822094
. Eigenes Partizipationskapital	3811084	3812084	3821084	3822084
Gezeichnetes Kapital, das eingefordert, aber noch nicht eingezahlt ist	3811005	3812005	3821005	3822005
Sonstige Vermögensgegenstände	3811006	3812006	3821006	3822006

9. SONSTIGE ANGABEN ZUR AKTIVSEITE

	Betrag
Volumen der im ESZB refinanzierungsfähigen Aktiva	0900011
Wertpapiere des Anlagevermögens	0600041
Wertpapiere des Umlaufvermögens	0600042
Wertpapiere bewertet zum Marktwert gem. § 56 Abs. 5 BWG	0600043
Im Stand der €-Forderungen an inl. Kunden (ohne verbr. Ford.) enthaltene angelastete Zinsen und Abschlussposten	0821021
Im Stand der FW-Forderungen an inl. Kunden (ohne verbr. Ford.) enthaltene angelastete Zinsen und Abschlussposten	0822021

Wertberichtigungen	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Einzelwertberichtigungen zu Forderungen an KI	3911001	3912001	3921001	3922001
Einzelwertberichtigungen zu Forderungen an Kunden	3911002	3912002	3921002	3922002
Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 zu Ford. an KI	3911003	3912003	3921003	3922003
Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 zu Ford. an Kunden	3911004	3912004	3921004	3922004

Treuhandvermögen enthalten in	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Forderungen an KI	3911011	3912011	3921011	3922011
Forderungen an Kunden (Nichtbanken)	3911012	3912012	3921012	3922012
Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche WP	3911013	3912013	3921013	3922013
Aktien und andere nicht festverzinsliche WP	3911014	3912014	3921014	3922014
Sonstigen	3911015	3912015	3921015	3922015

10. VERBINDLICHKEITEN GEGENÜBER KREDITINSTITUTEN

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Summe	4111100	4112100	4121100	4122100	4111200	4112200	4121200	4122200
. Namensschuldv.	4111198	4112198	4121198	4122198	4111298	4112298	4121298	4122298

	über 1 bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Summe	4111300	4112300	4121300	4122300	4111400	4112400	4121400	4122400
. Namensschuldv.	4111398	4112398	4121398	4122398	4111498	4112498	4121498	4122498
. Festzinsgebunden	4111399	4112399	4121399	4122399	4111499	4112499	4121499	4122499

Verbindlichkeiten gegenüber inländischen KI

	EURO
Aktienbanken und Bankiers	4111011
Sparkassensektor	4111012
Landes-Hypothekenbanken	4111013
Raiffeisensektor	4111014
Volksbankensektor	4111015
Bausparkassen	4111016
Sonder-Kreditinstitute	4111017
OeNB	4111018
Summe	4111020
. gegenüber Zentralinstitut ¹⁾	4111097
. LI-Reserve ²⁾	2111011

¹⁾ Nur von einem ZI angeschlossenen KI auszufüllen.

²⁾ Nur von einem ZI auszufüllen.

11. VERBINDLICHKEITEN GEGENÜBER KUNDEN (NICHTBANKEN)

Sektoren	Sichteinlagen				Termineinlagen			
	Inland		Ausland		bis 1 Jahr			
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	4211150	4212150	xxxxxxx	xxxxxxx	4211250	4212250	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	4211151	4212151	xxxxxxx	xxxxxxx	4211251	4212251	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	4211160	4212160	xxxxxxx	xxxxxxx	4211260	4212260	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	4211161	4212161	xxxxxxx	xxxxxxx	4211261	4212261	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	4211162	4212162	xxxxxxx	xxxxxxx	4211262	4212262	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	4211163	4212163	xxxxxxx	xxxxxxx	4211263	4212263	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	4211164	4212164	xxxxxxx	xxxxxxx	4211264	4212264	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	4211170	4212170	xxxxxxx	xxxxxxx	4211270	4212270	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	4211171	4212171	xxxxxxx	xxxxxxx	4211271	4212271	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	4211180	4212180	xxxxxxx	xxxxxxx	4211280	4212280	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	2121600	4212100	4221100	4222100	4211200	4212200	4221200	4222200
. Namensschuld v.	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	4211298	4212298	4221298	4222298
. Gehalts- und Pensionskonten	2121618	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx

Sektoren	Termineinlagen							
	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	4211350	4212350	xxxxxxx	xxxxxxx	4211450	4212450	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	4211351	4212351	xxxxxxx	xxxxxxx	4211451	4212451	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	4211360	4212360	xxxxxxx	xxxxxxx	4211460	4212460	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	4211361	4212361	xxxxxxx	xxxxxxx	4211461	4212461	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	4211362	4212362	xxxxxxx	xxxxxxx	4211462	4212462	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	4211363	4212363	xxxxxxx	xxxxxxx	4211463	4212463	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	4211364	4212364	xxxxxxx	xxxxxxx	4211464	4212464	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern.	4211370	4212370	xxxxxxx	xxxxxxx	4211470	4212470	xxxxxxx	xxxxxxx
. Freie Berufe u. selbst. E.	4211371	4212371	xxxxxxx	xxxxxxx	4211471	4212471	xxxxxxx	xxxxxxx
Private Haushalte	4211380	4212380	xxxxxxx	xxxxxxx	4211480	4212480	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	4211300	4212300	4221300	4222300	4211400	4212400	4221400	4222400
. Namensschuld v.	4211398	4212398	4221398	4222398	4211498	4212498	4221498	4222498
. Festzinsgebunden	4211399	4212399	4221399	4222399	4211499	4212499	4221499	4222499

Sektoren	Spareinlagen							
	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	4211550	4212550	xxxxxxx	xxxxxxx	4211650	4212650	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherung und Pensionskassen	4211551	4212551	xxxxxxx	xxxxxxx	4211651	4212651	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	4211560	4212560	xxxxxxx	xxxxxxx	4211660	4212660	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	4211561	4212561	xxxxxxx	xxxxxxx	4211661	4212661	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	4211562	4212562	xxxxxxx	xxxxxxx	4211662	4212662	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	4211563	4212563	xxxxxxx	xxxxxxx	4211663	4212663	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	4211564	4212564	xxxxxxx	xxxxxxx	4211664	4212664	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern. und private Haushalte	4211590	4212590	xxxxxxx	xxxxxxx	4211690	4212690	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	2211861	4212500	2221100	2222100	2211852	4212600	2221400	2222400
. Sparbriefe	4211501	4212501	4221501	4222501	4211601	4212601	4221601	4222601
. Bauspareinlagen	4211502	4212502	4221502	4222502	4211602	4212602	4221602	4222602

Sektoren	Spareinlagen							
	über 1 Jahr bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nbk-Finanzintermediäre	4211750	4212750	xxxxxxx	xxxxxxx	4211850	4212850	xxxxxxx	xxxxxxx
. Vertragsversicherungen und Pensionskassen	4211751	4212751	xxxxxxx	xxxxxxx	4211851	4212851	xxxxxxx	xxxxxxx
Sektor Bund	4211760	4212760	xxxxxxx	xxxxxxx	4211860	4212860	xxxxxxx	xxxxxxx
. Bund	4211761	4212761	xxxxxxx	xxxxxxx	4211861	4212861	xxxxxxx	xxxxxxx
Länder	4211762	4212762	xxxxxxx	xxxxxxx	4211862	4212862	xxxxxxx	xxxxxxx
Gemeinden	4211763	4212763	xxxxxxx	xxxxxxx	4211863	4212863	xxxxxxx	xxxxxxx
Sozialversicherungen	4211764	4212764	xxxxxxx	xxxxxxx	4211864	4212864	xxxxxxx	xxxxxxx
Nicht-finanzielle Untern. und private Haushalte	4211790	4212790	xxxxxxx	xxxxxxx	4211890	4212890	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	4211700	4212700	2221500	2222500	4211800	4212800	2221900	2222900
. Festzinsgebunden	4211799	4212799	2221511	2222511	4211899	4212899	2221911	2222911
. Sparbriefe	4211701	4212701	4221701	4222701	4211801	4212801	4221801	4222801
. Bauspareinlagen	4211702	4212702	4221702	4222702	4211802	4212802	4221802	4222802

Anzahl der Konten (halbjährlich)

	Anzahl	Betrag
Sichteinlagen von inl. Kunden in EURO	4211901	
. Gehalts- und Pensionskonten	4211991	
Sichteinlagen von inl. Kunden in FW	4212901	
Termineinlagen von inl. Kunden in EURO	4211902	
Termineinlagen von inl. Kunden in FW	4212902	
Spareinlagen	xxxxxxx	
. von inl. Kunden in EURO	4211903	
.. bis 10 000 €	4211931	2211831
.. über 10 000 € bis 20 000 €	4211932	2211832
.. über 20 000 € bis 50 000 €	4211933	2211833
.. über 50 000 € bis 100 000 €	4211934	2211834
.. über 100 000 € bis 500 000 €	4211935	2211835
.. über 500 000 € bis 1 Mio. €	4211936	2211836
.. über 1 Mio. € bis 3 Mio. €	4211937	2211837
.. über 3 Mio. €	4211938	2211838
. von inl. Kunden in FW	4212903	
. von ausl. Kunden in EURO	4221903	
. von ausl. Kunden in FW	4222903	
. Bauspareinlagen	9340900	

	Anzahl	Betrag
Sicherungspflichtige Einlagen gem. § 93 Abs. 2 BWG	4200911	4200011
Sicherungspflichtige Wertpapierdienstleistungen gem. § 93 Abs. 2a Z 1 BWG	xxxxxxx	4200012

12. VERBRIEFTE VERBINDLICHKEITEN

	täglich fällig				bis 1 Jahr			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Begebene Schuldverschreibungen:								
Beg. Schuldv.	4311101	4312101	4321101	4322101	4311201	4312201	4321201	4322201
. Kassenobligationen	4311191	4312191	4321191	4322191	4311291	4312291	4321291	4322291
. Pfandbriefe	4311181	4312181	4321181	4322181	4311281	4312281	4321281	4322281
. Kommunalbriefe	4311171	4312171	4321171	4322171	4311271	4312271	4321271	4322271
Andere verbrieftete Verbindlichkeiten:								
Kassenobligationen	4311102	4312102	4321102	4322102	4311202	4312202	4321202	4322202
Namensschuldv.	4311103	4312103	4321103	4322103	4311203	4312203	4321203	4322203
Depotzertifikate	4311104	4312104	4321104	4322104	4311204	4312204	4321204	4322204
Sonstige	4311105	4312105	4321105	4322105	4311205	4312205	4321205	4322205
Summe	4311100	4312100	4321100	4322100	4311200	4312200	4321200	4322200

	über 1 bis 5 Jahre				über 5 Jahre			
	Inland		Ausland		Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Begebene Schuldverschreibungen:								
Beg. Schuldv.	4311301	4312301	4321301	4322301	4311401	4312401	4321401	4322401
. Kassenobligationen	4311391	4312391	4321391	4322391	4311491	4312491	4321491	4322491
. Pfandbriefe	4311381	4312381	4321381	4322381	4311481	4312481	4321481	4322481
. Kommunalbriefe	4311371	4312371	4321371	4322371	4311471	4312471	4321471	4322471
Andere verbrieftete Verbindlichkeiten:								
Kassenobligationen	4311302	4312302	4321302	4322302	4311402	4312402	4321402	4322402
Namensschuldv.	4311303	4312303	4321303	4322303	4311403	4312403	4321403	4322403
Depotzertifikate	4311304	4312304	4321304	4322304	4311404	4312404	4321404	4322404
Sonstige	4311305	4312305	4321305	4322305	4311405	4312405	4321405	4322405
Summe	4311300	4312300	4321300	4322300	4311400	4312400	4321400	4322400
. Festzinsgebunden	4311399	4312399	4321399	4322399	4311499	4312499	4321499	4322499

13. SONSTIGE PASSIVPOSTEN

	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Rückstellungen	4411001	4412001	4421001	4422001
Fonds für allgemeine Bankrisiken	3301000	3302000	xxxxxxx	xxxxxxx
Nachrangige Verbindlichkeiten	4411003	4412003	4421003	4422003
. in Form von Einlagen	4411093	4412093	4421093	4422093
. nachrangige verbriefte Verbindlichkeiten	4411083	4412083	4421083	4422083
Ergänzungskapital	2811000	2812000	2821000	2822000
. in verbriefter Form	2811011	2812011	2821011	2822011
Gezeichnetes Kapital	4411005	4412005	4421005	4422005
. Partizipationskapital	2711000	2712000	2721000	2722000
Kapitalrücklagen	4411006	4412006	xxxxxxx	xxxxxxx
Gewinnrücklagen	4411007	4412007	xxxxxxx	xxxxxxx
Hafrücklage	3001000	3002000	xxxxxxx	xxxxxxx
Unversteuerte Rücklagen	4411009	4412009	xxxxxxx	xxxxxxx
Verlustvortrag	1411000	1412000	xxxxxxx	xxxxxxx
Gewinnvortrag	3211000	3212000	xxxxxxx	xxxxxxx
Sonstige Verbindlichkeiten	4411010	4412010	4421010	4422010

14. SONSTIGE ANGABEN ZUR PASSIVSEITE

	Betrag
Kapitalisierte Spareinlagenzinsen zum 31. Dezember	2200811

Treuhandvermögen enthalten in	Inland		Ausland	
	EURO	FW	EURO	FW
Verbindlichkeiten gegenüber KI	4511001	4512001	4521001	4522001
Verbindlichkeiten gegenüber Kunden (Nichtbanken)	4511002	4512002	4521002	4522002
Verbrieften Verbindlichkeiten	4511003	4512003	4521003	4522003
Sonstigen	4511004	4512004	4521004	4522004

Kommentierung zu Forderungen an Kreditinstitute im Inland:

15. FORDERUNGEN AN AUSLANDSFILIALEN ANDERER ÖSTERREICHISCHER KREDITINSTITUTE

[bei MAUS des Mutterinstitutes sind hier auch die Forderungen
gegen eigene Auslandsfiliale(n) auszuweisen]

	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Nicht verbriefte Ford.	9101101	9102101	9101201	9102201	9101301	9102301	9101401	9102401
. Namensschuldverschr.	9101191	9102191	9101291	9102291	9101391	9102391	9101491	9102491
. Ergänzungskapital	9101181	9102181	9101281	9102281	9101381	9102381	9101481	9102481
Verbriefte Ford.	9101102	9102102	9101202	9102202	9101302	9102302	9101402	9102402
. Namensschuldverschr.	9101192	9102192	9101292	9102292	9101392	9102392	9101492	9102492
Summe	9101100	9102100	9101200	9102200	9101300	9102300	9101400	9102400
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	9101399	9102399	9101499	9102499

Kommentierung zu Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten im Inland:

16. VERBINDLICHKEITEN GEGENÜBER AUSLANDSFILIALEN ANDERER ÖSTERREICHISCHER KREDITINSTITUTE

[bei MAUS des Mutterinstitutes sind hier auch die Verbindlichkeiten
gegenüber eigene Auslandsfiliale(n) auszuweisen]

	täglich fällig		bis 1 Jahr		über 1 bis 5 Jahre		über 5 Jahre	
	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW	EURO	FW
Summe	9201100	9202100	9201200	9202200	9201300	9202300	9201400	9202400
. Namensschuldv.	9201198	9202198	9201298	9202298	9201398	9202398	9201498	9202498
. Festzinsgebunden	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	xxxxxxx	9201399	9202399	9201499	9202499

17. AUSSERBILANZMÄSSIGE GESCHÄFTE GEMÄSS ANLAGE 1 ZU ARTIKEL 1, § 22 BWG

	EURO	FW
Hohes Kreditrisiko:		
Akzepte mit Kreditsubstitutscharakter und Wechselverbindlichkeiten in Form von eigene Ziehungen im Umlauf	7111011	7112011
Indossamentverbindlichkeiten aus weitergegebenen Wechseln	7121011	7122011
Bürgschaften und Garantien für solche Aktivposten (einschl. „standby letters of credit“), die als finanzielle Garantie für Kredite und Wertpapiere dienen sowie Wechsel- und Scheckeinlösungsgarantien	7131011	7132011
Bestellung von Sicherheiten für fremde Verbindlichkeiten	7511017	7512017
Terminkäufe auf Aktivposten, bei denen eine unbedingte Verpflichtung zur Abnahme des Liefergegenstandes besteht	7511018	7512018
Verkäufe von Termineinlagen auf Termin (FFD)	7511019	7512019
Verkäufe von Aktivposten mit Rückgriff, sofern das Kreditrisiko beim verkaufenden Kreditinstitut bleibt	7511020	7512020
Übernahmegarantien für Wertpapiere	7511023	7512023
Nicht eingezahlter Teil von Aktien und sonstigen Wertpapieren	7511022	7512022
Verkaufte Put-Optionen auf Vermögensgegenstände (gem. Anl.1 zu § 22 Z 1 lit. j)	7511024	7512024
Mittleres Kreditrisiko:		
Ausgestellte und bestätigte Akkreditive, sofern sie nicht Posten mit unterdurchschnittlichem Kreditrisiko darstellen	7521011	7522011
Erfüllungsgarantien (einschl. der Bietungs-, Anzahlungs-, Zahlungs- und Kaufpreisgarantien, Zoll- und Steuerbürgschaften) und andere als in der Anlage zu § 22 BWG genannte Garantien und Bürgschaften, auch wenn diese in Form eines „standby letters of credit“ erstellt werden	7521012	7522012
Pensionsgeschäfte gem. § 50 Abs. 3 und 5 BWG	7521013	7522013
Verpflichtungen zur Emission oder aus der revolvingen Emission von Geldmarktpapieren durch Dritte, insbesondere aus „Note Issuance Facilities“ (NIFs), „Revolving Underwriting Facilities“ (RUFs) und ähnlichen Instrumenten	7521014	7522014
Noch nicht in Anspruch genommene Kreditzusagen (Kreditrahmen, Promessen, Verpflichtungen, Garantien oder Akzepte bereitzustellen), die eine Ursprungslaufzeit von mehr als einem Jahr haben und nicht fristlos und vorbehaltlos vom Kreditinstitut gekündigt werden können	7521019	7522019
Unterdurchschnittliches Kreditrisiko:		
Eröffnung und Bestätigung von Dokumentenakkreditiven, die durch Wertpapiere gesichert werden, oder andere leicht liquidierbare Transaktionen	7531011	7532011
Die Haftsummen als Mitglieder einer Genossenschaft; bei Genossenschaften mit unbeschränkter Haftung ist das Dreißigfache des Nennwertes der Geschäftsanteile anzusetzen	7531012	7532012
Niedriges Kreditrisiko:		
Noch nicht in Anspruch genommene Kreditzusagen (Kreditrahmen, Promessen, Verpflichtungen, Garantien oder Akzepte bereitzustellen), die eine Ursprungslaufzeit von höchstens einem Jahr haben oder fristlos und vorbehaltlos vom Kreditinstitut gekündigt werden können	7541011	7542011
Wechselverbindlichkeiten in der Form von Indossamenten, bei denen die Oesterreichische Nationalbank im Übereinkommen vom 16. November 1966 mit dem ERP-Fonds in Durchführung des ERP-Fondsgesetzes sich verpflichtet hat, die ihr aus diesen Wechseln zustehenden Rechte gegen die ermächtigenden Banken nicht geltend zu machen und diese Wechsel nicht weiter zu begeben	7541012	7542012
Alle sonstigen, nicht angeführten Geschäfte	7541013	7542013
. Treuhandgeschäfte	7541014	7542014

18. BESONDERE AUSSERBILANZMÄSSIGE FINANZGESCHÄFTE

	Bankbuch		Handelsbuch	
	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte
Zinssatzverträge:				
Zinsswaps (mit einer einzigen Währung)	7611111	7612111	7611211	7612211
Floating/floating Zinsswaps („Basis Swaps“)	7611112	7612112	7611212	7612212
Zinstermingeschäfte (forward rate agreements) einschl. Käufe von Termineinlagen und Wertpapieren auf Termin (OTC-Geschäfte)	7611113	7612113	7611213	7612213
Zinsterminkontrakte und zinsbezogene Index-Kontrakte (Börsenkontrakte)	7611114	7612114	7611214	7612214
Zinssatzoptionen (OTC-Geschäfte)	7341113	7342113	7341213	7342213
Zinssatzoptionen (Börsenkontrakte)	7341114	7342114	7341214	7342214
Andere vergleichbare Verträge	7611116	7612116	7611216	7612216
Wechselkurs- und Goldverträge:				
Währungs- und Zinsswaps mit mehreren Währungen (Cross Currency Zinsswaps)	7621121	7622121	7621221	7622221
. Kapitalmarktswaps	7621199	7622199	7621299	7622299
. Geldmarktswaps	7621198	7622198	7621298	7622298
Devisentermingeschäfte (OTC-Geschäfte)	7621122	7622122	7621222	7622222
Währungsterminkontrakte und währungsbezogene Index-Kontrakte (Börsenkontrakte)	7621123	7622123	7621223	7622223
Währungsoptionen (OTC-Geschäfte)	7621124	7622124	7621224	7622224
Währungsoptionen (Börsenkontrakte)	7621125	7622125	7621225	7622225
Gold betreffende Verträge und Verträge, die mit den v.e. vergleichbar sind	7621126	7622126	7621226	7622226
Verträge in Substanzwerten und sonstige wertpapierbezogene Geschäfte:				
Termingeschäfte in Substanzwerten und sonstige wertpapier-kursbezogene Termingeschäfte	7671111	7672111	7671211	7672211
Index-Kontrakte in Substanzwerten und sonstige wertpapier-kursbezogene Index-Terminkontrakte	7671112	7672112	7671212	7672212
Optionen auf Substanzwerte und sonstige Wertpapierindex-Optionen	7671113	7672113	7671213	7672213
Andere vergleichbare Verträge hinsichtlich Substanzwerte und anderer Wertpapiere	7671114	7672114	7671214	7672214
Edelmetallverträge: ¹⁾				
Edelmetall-Termingeschäfte (OTC-Geschäfte)	7631111	7632111	7631211	7632211
Edelmetall-Terminkontrakte (Börsenkontrakte)	7631112	7632112	7631212	7632212
Edelmetall-Optionen	7631115	7632115	7631215	7632215
Andere vergleichbare Edelmetallverträge	7631114	7632114	7631214	7632214

¹⁾ Ausgenommen Goldverträge gemäß Anlage 2 zu § 22 Z 2 lit. e.

	Bankbuch		Handelsbuch	
	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte
Warenverträge: ¹⁾				
Waren-Termingeschäfte (OTC-Geschäfte)	7651111	7652111	7651211	7652211
Waren-Terminkontrakte (Börsenkontrakte)	7651112	7652112	7651212	7652212
Waren-Optionen	7651115	7652115	7651215	7652215
Andere vergleichbare Warengeschäfte	7651114	7652114	7651214	7652214
Sonstige:				
Sonstige Termingeschäfte, Terminkontrakte, Optionen und vergleichbare Geschäfte, die nicht den bisher angeführten Kategorien zuzuordnen sind	7681111	7682111	7681211	7682211

¹⁾ Ausgenommen Edelmetallverträge.

	mit Kreditinst.		mit Nichtbanken	
	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte	Kauf- kontrakte	Verkaufs- kontrakte
Zinssatzverträge	7613100	7614100	7613200	7614200
Wechselkurs- und Goldverträge	7623101	7624101	7623201	7624201
Verträge in Substanzwerten und sonst. wertpapierb. Geschäfte	7673100	7674100	7673200	7674200
Edelmetallverträge, ausgenommen Goldverträge	7633101	7634101	7633201	7634201
Warenverträge, ausgenommen Edelmetallverträge	7653100	7654100	7653200	7654200
Sonstige Termingeschäfte, Terminkontrakte, Optionen und vergleichbare Geschäfte, die nicht den bisher angeführten Kategorien zuzuordnen sind	7683100	7684100	7683200	7684200

19A. PENSIONSGESCHÄFTE

a) vom Pensionsgeber anzugeben

Echte Pensionsgeschäfte	mit inl. KI		mit ausl. KI	
	EURO	FW	EURO	FW
. mit inländ. Schuldverschreibungen und anderen inländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111001	5112001	5121001	5122001
. mit ausländ. Schuldverschreibungen und anderen ausländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111002	5112002	5121002	5122002
. mit inländ. Aktien und anderen inländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111003	5112003	5121003	5122003
. mit ausländ. Aktien und anderen ausländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111004	5112004	5121004	5122004
. mit Forderungen an inländ. Kunden (Nichtbk.)	5111005	5112005	5121005	5122005
. mit Forderungen an ausländ. Kunden (Nichtbk.)	5111006	5112006	5121006	5122006
. mit Schuldtitel öffentlicher Stellen	5111007	5112007	5121007	5122007

Echte Pensionsgeschäfte	mit inl. Nichtbk.		mit ausl. Nichtbk.	
	EURO	FW	EURO	FW
. mit inländ. Schuldverschreibungen und anderen inländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111011	5112011	5121011	5122011
. mit ausländ. Schuldverschreibungen und anderen ausländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111012	5112012	5121012	5122012
. mit inländ. Aktien und anderen inländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111013	5112013	5121013	5122013
. mit ausländ. Aktien und anderen ausländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111014	5112014	5121014	5122014
. mit Forderungen an inländ. Kunden (Nichtbk.)	5111015	5112015	5121015	5122015
. mit Forderungen an ausländ. Kunden (Nichtbk.)	5111016	5112016	5121016	5122016
. mit Schuldtitel öffentlicher Stellen	5111017	5112017	5121017	5122017

b) vom Pensionsnehmer anzugeben

Unechte Pensionsgeschäfte	mit inl. KI		mit ausl. KI	
	EURO	FW	EURO	FW
. mit inländ. Schuldverschreibungen und anderen inländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111021	5112021	5121021	5122021
. mit ausländ. Schuldverschreibungen und anderen ausländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111022	5112022	5121022	5122022
. mit inländ. Aktien und anderen inländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111023	5112023	5121023	5122023
. mit ausländ. Aktien und anderen ausländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111024	5112024	5121024	5122024
. mit Forderungen an inländ. Kunden (Nichtbk.)	5111025	5112025	5121025	5122025
. mit Forderungen an ausländ. Kunden (Nichtbk.)	5111026	5112026	5121026	5122026
. mit Schuldtitel öffentlicher Stellen	5111027	5112027	5121027	5122027

Unechte Pensionsgeschäfte	mit inl. Nichtbk.		mit ausl. Nichtbk.	
	EURO	FW	EURO	FW
. mit inländ. Schuldverschreibungen und anderen inländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111031	5112031	5121031	5122031
. mit ausländ. Schuldverschreibungen und anderen ausländ. festverzinslichen Wertpapieren	5111032	5112032	5121032	5122032
. mit inländ. Aktien und anderen inländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111033	5112033	5121033	5122033
. mit ausländ. Aktien und anderen ausländ. nicht festverzinslichen Wertpapieren	5111034	5112034	5121034	5122034
. mit Forderungen an inländ. Kunden (Nichtbk.)	5111035	5112035	5121035	5122035
. mit Forderungen an ausländ. Kunden (Nichtbk.)	5111036	5112036	5121036	5122036
. mit Schuldtitel öffentlicher Stellen	5111037	5112037	5121037	5122037

19B. WERTPAPIERLEIH- BZW. VERLEIHGESCHÄFTE

	Betrag
Wertpapierverleihgeschäfte	5210000
Wertpapierleihgeschäfte	5220000

TEIL B 1

RESTLAUFZEITENDARSTELLUNGEN

(vierteljährlich)

RESTLAUFZEITENDARSTELLUNGEN

a) Aktiva

	täglich fällig	bis 3 Mon.	über 3 Mon. bis 1 Jahr	über 1 Jahr bis 5 Jahre	über 5 Jahre
Schuldtitel öffentlicher Stellen und Wechsel, die zur Refinanzierung bei Zentralnotenbanken zugelassen sind	5300101	5300701	5300801	5300301	5300401
Forderungen an Kreditinstitute	5300102	5300702	5300802	5300302	5300402
Forderungen an Kunden	5300103	5300703	5300803	5300303	5300403
Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche Wertpapiere	5300104	5300704	5300804	5300304	5300404
Sonstige Aktivposten mit Laufzeit	5300105	5300705	5300805	5300305	5300405
Summe	5300100	5300700	5300800	5300300	5300400

b) Passiva

	täglich fällig	bis 3 Mon.	über 3 Mon. bis 1 Jahr	über 1 Jahr bis 5 Jahre	über 5 Jahre
Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten	5400101	5400701	5400801	5400301	5400401
Verbindlichkeiten gegenüber Kunden	5400102	5400702	5400802	5400302	5400402
Verbriefte Verbindlichkeiten	5400103	5400703	5400803	5400303	5400403
Sonstige Passivposten mit Laufzeit	5400104	5400704	5400804	5400304	5400404
Summe	5400100	5400700	5400800	5400300	5400400

TEIL B 2

ZINSRISIKOSTATISTIK

(vierteljährlich)

Die Zinsrisikostatistik im Teil B ist, nach zwei Gruppen von Kreditinstituten unterschieden, erstmals ab den folgenden beiden Berichtsterminen auszufüllen:

Alle Kreditinstitute, die zum Berichtstermin 12/2000 CAD-Handelsbuch-Melder waren (also § 22b Abs. 2 BWG nicht anwendeten) oder per Jahresende 2000 eine Bilanzsumme von mehr als 40 Mrd. S hatten – ausgenommen Bausparkassen –, haben als ersten Berichtstermin für die Zinsrisikostatistik den 31. Dezember 2001. Alle anderen Kreditinstitute einschließlich aller Bausparkassen haben als ersten Berichtstermin den 31. Dezember 2002.

Meldung		Zinsbindungsbilanz (1)		Zinsbindungsbilanz/ Durationsbilanz		Währung ¹⁾		ISO-Code<_>							
		Durationsbilanz (2)													
AKTIVA		Bis zur nächsten Zinsanpassung bzw. nach Restlaufzeit (falls 1) bzw. nach modifizierter Duration (falls 2)													
I. On-balance-Positionen	1. Zinsbindungsbilanz	bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 2 Jahre	>2 Jahre bis 3 Jahre	>3 Jahre bis 4 Jahre	>4 Jahre bis 5 Jahre	>5 Jahre bis 7 Jahre	>7 Jahre bis 10 J.	>10 Jahre bis 15 J.	>15 Jahre bis 20 J.	über 20 Jahre	
	2. Durationsbilanz	bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 1,86 J.	>1,86 J. bis 2,72 J.	>2,72 J. bis 3,55 J.	>3,55 J. bis 4,33 J.	>4,33 J. bis 5,79 J.	>5,79 J. bis 7,72 J.	>7,72 J. bis 10,38 J.	>10,38 J. bis 12,46 J.	über 12,46 J.	
	Zinsfixe Forderungen	5500110	5500210	5500310	5500410	5500510	5500610	5500710	5500810	5500910	5501010	5501110	5501210	5501310	
	Zinsvariable Forderungen	5500120	5500220	5500320	5500420	5500520	5500620	5500720	5500820	5500920	5501020	5501120	5501220	5501320	
	Forderungen mit unbestimmter Zinsbindung	5500130	5500230	5500330	5500430	5500530	5500630	5500730	5500830	5500930	5501030	5501130	5501230	5501330	
	Sonstige Aktiva	5500140	5500240	5500340	5500440	5500540	5500640	5500740	5500840	5500940	5501040	5501140	5501240	5501340	
	Synthetische Aktiva aus Derivaten	5500150	5500250	5500350	5500450	5500550	5500650	5500750	5500850	5500950	5501050	5501150	5501250	5501350	
	davon:														
	Zinsswaps	5500151	5500251	5500351	5500451	5500551	5500651	5500751	5500851	5500951	5501051	5501151	5501251	5501351	
	Zinstermingeschäfte	5500152	5500252	5500352	5500452	5500552	5500652	5500752	5500852	5500952	5501052	5501152	5501252	5501352	
II. Off-balance-Positionen	Zinsterminkontrakte (futures) u. zinsbezogene Index-Kontrakte	5500153	5500253	5500353	5500453	5500553	5500653	5500753	5500853	5500953	5501053	5501153	5501253	5501353	
	Zinsoptionen	5500154	5500254	5500354	5500454	5500554	5500654	5500754	5500854	5500954	5501054	5501154	5501254	5501354	
	Sonstige vergleichbare Verträge	5500155	5500255	5500355	5500455	5500555	5500655	5500755	5500855	5500955	5501055	5501155	5501255	5501355	
	FX-Kontrakte	5500156	5500256	5500356	5500456	5500556	5500656	5500756	5500856	5500956	5501056	5501156	5501256	5501356	
	Summe Aktiva	5500100	5500200	5500300	5500400	5500500	5500600	5500700	5500800	5500900	5501000	5501100	5501200	5501300	

¹⁾ Folgende Einzelwährungen sind unter I. und II. generell zu melden: EUR, USD, CHF, JPY, GBP, CAD. Alle anderen unter I. und II. zu meldenden Währungen sind unter dem Kürzel XXX als „Sonstige Währungen“ zusammen zu melden.

PASSIVA		Bis zur nächsten Zinsanpassung bzw. nach Restlaufzeit (falls 1) bzw. nach modifizierter Duration (falls 2)													
		bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 2 Jahre	>2 Jahre bis 3 Jahre	>3 Jahre bis 4 Jahre	>4 Jahre bis 5 Jahre	>5 Jahre bis 7 Jahre	>7 Jahre bis 10 J.	>10 Jahre bis 15 J.	>15 Jahre bis 20 J.	über 20 Jahre	
I. On-balance-Positionen	1. Zinsbindungsbilanz														
	2. Durationsbilanz	bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 1,86 J.	>1,86 J. bis 2,72 J.	>2,72 J. bis 3,55 J.	>3,55 J. bis 4,33 J.	>4,33 J. bis 5,79 J.	>5,79 J. bis 7,72 J.	>7,72 J. bis 10,38 J.	>10,38 J. bis 12,46 J.	über 12,46 J.	
	Zinsfixe Verbindlichkeiten	5600110	5600210	5600310	5600410	5600510	5600610	5600710	5600810	5600910	5601010	5601110	5601210	5601310	
	Zinsvariable Verbindlichkeiten	5600120	5600220	5600320	5600420	5600520	5600620	5600720	5600820	5600920	5601020	5601120	5601220	5601320	
	Verbindlichkeiten mit unbestimmter Zinsbindung	5600130	5600230	5600330	5600430	5600530	5600630	5600730	5600830	5600930	5601030	5601130	5601230	5601330	
II. Off-balance-Positionen	Sonst. Passiva u. Eigenkapital	5600140	5600240	5600340	5600440	5600540	5600640	5600740	5600840	5600940	5601040	5601140	5601240	5601340	
	Synthetische Passiva aus Derivaten	5600150	5600250	5600350	5600450	5600550	5600650	5600750	5600850	5600950	5601050	5601150	5601250	5601350	
	davon:														
	Zinsswaps	5600151	5600251	5600351	5600451	5600551	5600651	5600751	5600851	5600951	5601051	5601151	5601251	5601351	
	Zinstermingeschäfte	5600152	5600252	5600352	5600452	5600552	5600652	5600752	5600852	5600952	5601052	5601152	5601252	5601352	
	Zinsterminkontrakte (futures) u. zinsbezogene Index-Kontrakte	5600153	5600253	5600353	5600453	5600553	5600653	5600753	5600853	5600953	5601053	5601153	5601253	5601353	
	Zinsoptionen	5600154	5600254	5600354	5600454	5600554	5600654	5600754	5600854	5600954	5601054	5601154	5601254	5601354	
	Sonstige vergleichbare Verträge	5600155	5600255	5600355	5600455	5600555	5600655	5600755	5600855	5600955	5601055	5601155	5601255	5601355	
	FX-Kontrakte	5600156	5600256	5600356	5600456	5600556	5600656	5600756	5600856	5600956	5601056	5601156	5601256	5601356	
	Summe Passiva	5600100	5600200	5600300	5600400	5600500	5600600	5600700	5600800	5600900	5601000	5601100	5601200	5601300	

III. Standardverfahren ¹⁾

Barwerfänderung bei angenommener Zinsänderung:

In % der anrechenbaren Eigenmittel:

5700010
5700011

IV. Internes Risikomanagement ¹⁾

Barwerfänderung bei angenommener Zinsänderung:

In % der anrechenbaren Eigenmittel:

5700020
5700021

¹⁾ Institute, die ein vom jeweils gewählten Standardverfahren abweichendes internes Risikomanagementsystem haben, haben zugleich unter IV. und III. zu melden. Alle anderen Institute haben unter IV. identische Zahlen wie unter III. zu melden.

TEIL C

AUFSICHTSRELEVANTE ZUSATZDATEN

§ 22 BWG – SOLVABILITÄT

1. Risikogewichtete Aktiva

	Ungewichteter Wert	Gewichteter Wert
Gewicht 0%	7710111	xxxxxxx
Gewicht 10% (gem. § 22 Abs. 3 Z 6 sowie § 103 Z 10 lit. b)	7710112	7710212
Gewicht 20%	7710113	7710213
Gewicht 50%	7710114	7710214
Gewicht 100%	7710115	7710215
Investmentzertifikate (gem. § 22 Abs. 3 Z 4)	7710116	7710216
Summe	7710100	xxxxxxx
Summe risikogewichteter Aktiva	xxxxxxx	7710000

2. Außerbilanzmäßige Geschäfte gem. Anlage 1 zu § 22 BWG, abzüglich hierfür gebildeter Rückstellungen

	Gewichteter Wert gem. Risiko	Gewichteter Wert gem. Vertragspartner
a) Hohes Kreditrisiko (100%)	xxxxxxx	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 0%	7720111	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 20%	7720112	7720212
Gewicht Vertragspartner 50%	7720113	7720213
Gewicht Vertragspartner 100%	7720114	7720214
Summe	7720101	7720201
b) Mittleres Kreditrisiko (50%)	xxxxxxx	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 0%	7720121	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 20%	7720122	7720222
Gewicht Vertragspartner 50%	7720123	7720223
Gewicht Vertragspartner 100%	7720124	7720224
Summe	7720102	7720202
c) Unterdurchschnittliches Kreditrisiko (20%)	xxxxxxx	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 0%	7720131	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 20%	7720132	7720232
Gewicht Vertragspartner 50%	7720133	7720233
Gewicht Vertragspartner 100%	7720134	7720234
Summe	7720103	7720203
Summe aller risikogew. außerbilanzmäßigen Geschäfte	xxxxxxx	7720000

3. Besondere außerbilanzmäßige Finanzgeschäfte gemäß Anlage 2 zu § 22 BWG

Marktbewertungsansatz

a) Verträge mit positiven Marktwerten

	Betrag
Summe (A) – nach Netting	7741001
Herausgenettetes Volumen	7741002

b) Zukünftiges Kreditrisiko – nach Netting

Restlaufzeiten	Ungewichteter Wert	Gewichteter Wert
Zinssatzverträge bis 1 Jahr	7741211	xxxxxxx
Zinssatzverträge über 1 Jahr bis 5 Jahre	7741311	7742311
Zinssatzverträge über 5 Jahre	7741411	7742411
Wechselkursverträge und Gold bis 1 Jahr	7741212	7742212
Wechselkursverträge und Gold über 1 Jahr bis 5 Jahre	7741312	7742312
Wechselkursverträge und Gold über 5 Jahre	7741412	7742412
Verträge in Substanzwerten bis 1 Jahr	7741213	7742213
Verträge in Substanzwerten über 1 Jahr bis 5 Jahre	7741313	7742313
Verträge in Substanzwerten über 5 Jahre	7741413	7742413
Edelmetallverträge ausgenommen Goldverträge bis 1 Jahr	7741214	7742214
Edelmetallverträge ausgenommen Goldverträge über 1 Jahr bis 5 J.	7741314	7742314
Edelmetallverträge ausgenommen Goldverträge über 5 Jahre	7741414	7742414
Warenverträge und Verträge gem. Z 6 der Anl. 2 bis 1 Jahr	7741215	7742215
Warenverträge und Verträge gem. Z 6 der Anl. 2 über 1 Jahr bis 5 J.	7741315	7742315
Warenverträge und Verträge gem. Z 6 der Anl. 2 über 5 Jahre	7741415	7742415
Summe (B) – nach Netting	7741401	7742401
Herausgenettetes Volumen	7741402	7742402

	Betrag
Summe C – nach Netting (= A + B)	7740001

c) Gewichtung der Summe C

	Ungewichteter Wert (jedoch laufzeiten- gewichtet)	Gewichteter Wert
Gewicht Vertragspartner 0%	7741011	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 20%	7741012	7742012
Gewicht Vertragspartner 50%	7741013	7742013
Gewicht Vertragspartner 50% (§ 22 Abs. 2 Z 3)	7741014	7742014
Summe Marktbewertungsansatz – nach Netting	xxxxxxx	7742001

Ursprungsrisikoansatz – nach Netting

Laufzeit	Zinssatzverträge ¹⁾		Wechselkurs- und Goldverträge
	Ursprungs- laufzeit	Restlaufzeit	Ursprungs- laufzeit
	laufzeitengewichtet		
bis 1 Jahr ²⁾	7743011	7744011	7745011
über 1 bis 2 Jahre	7743012	7744012	7745012
über 2 bis 3 Jahre	7743013	7744013	7745013
über 3 bis 4 Jahre	7743014	7744014	7745014
über 4 bis 5 Jahre	7743015	7744015	7745015
über 5 bis 6 Jahre	7743016	7744016	7745016
über 6 bis 7 Jahre	7743017	7744017	7745017
über 7 bis 8 Jahre	7743018	7744018	7745018
über 8 bis 9 Jahre	7743019	7744019	7745019
über 9 bis 10 Jahre	7743020	7744020	7745020
über 10 Jahre	7743021	7744021	7745021
Summe nach Netting	7743001	7744001	7745001
Herausgenettetes Volumen	7743002	7744002	7745002

¹⁾ Entweder Ursprungslaufzeit oder Restlaufzeit auszufüllen.

²⁾ Ausgenommen Wechselkursverträge mit einer Ursprungslaufzeit von 14 Kalendertagen oder weniger.

Zinssatz-, Wechselkurs- und Goldverträge insgesamt – nach Netting

	Betrag
Summe (D) nach Netting	7746000

Gewichtung der Summe D

	Ungewichteter Wert, jedoch laufzeiten-gewichtet	Gewichteter Wert
Gewicht Vertragspartner 0%	7746011	xxxxxxx
Gewicht Vertragspartner 20%	7746012	7747012
Gewicht Vertragspartner 50%	7746013	7747013
Gewicht Vertragspartner 50% (§ 22 Abs. 2)	7746014	7747014
Summe Ursprungsrisikoansatz – nach Netting	7746001	7747001

§ 22b BWG – WERTPAPIERHANDELSBUCH

1. Volumen des Handelsbuches gem. § 22b Abs. 2 BWG

	Anzahl der Tage
bis inkl. 5% des Geschäftsvolumens	7751011
über 5% bis inkl. 6% des Geschäftsvolumens	7751012
über 6% des Geschäftsvolumens	7751013

	Anzahl der Tage
bis inkl. 15 Mio. €	7751021
über 15 Mio. € bis inkl. 20 Mio. €	7751022
über 20 Mio. €	7751023

	Betrag ¹⁾
Geschäftsvolumen	7751001
Wertpapierhandelsbuch	7751002

¹⁾ Stand zum Meldestichtag.

2. Positionsrisiko in Schuldtitel (Zinsänderungsrisiko)

a) Spezifisches Positionsrisiko (auf Basis Restlaufzeiten) gem. § 22g BWG

Emittent	ungewichtet	EM-Erford. gewichtet
Zentralstaat (0%)	7752111	xxxxxxx
Qualifizierte Emittenten		
bis 6 Mon. (0,25% bzw. 0,125% gem. § 103 Z 11c)	7752112	7752212
über 6 Mon. bis 24 Mon. (1% bzw. 0,5% gem. § 103 Z 11c)	7752113	7752213
über 24 Mon. (1,6% bzw. 0,8% gem. § 103 Z 11c)	7752114	7752214
Sonstige Emittenten (8%)	7752115	7752215
Summe	7752101	7752201

b) Allgemeines Positionsrisiko gem. § 22h BWG

	Eigenmittel- erfordernis
Laufzeitmethode	7752002
Durationsmethode	7752003

3. Substanzwertrisiko

a) Spezifisches Risiko gem. § 22i BWG

	ungewichtet	EM-Erford. gewichtet
Bruttoposition A (4%)	7753111	7753211
Bruttoposition B (2%)	7753112	7753212
Summe	7753101	7753201

b) Allgemeines Risiko gem. § 22i Abs. 3 und § 22j Abs. 3 BWG

	ungewichtet	EM-Erford. gewichtet
Nettogesamtposition – Substanzwerte	7753121	7753221
Nettogesamtposition Aktienindices	7753122	7753222
Summe	7753102	7753202

4. Abwicklungsrisiko gem. § 22l BWG

Negative Preisdifferenz je nach Anzahl der Arbeitstage nach dem festgesetzten Abrechnungstermin	Methode gem. Z 1		Methode gem. Z 2	
	ungewichtet	EM-Erford. gewichtet	ungewichtet	EM-Erford. gewichtet
5 – 15 Tage (8% bzw. 0,5%)	7754111	7754211	7754121	7754221
16 – 30 Tage (50% bzw. 4,0%)	7754112	7754212	7754122	7754222
31 – 45 Tage (75% bzw. 9,0%)	7754113	7754213	7754123	7754223
46 und mehr (jeweils 100%)	7754114	7754214	xxxxxxx	xxxxxxx
Summe	7754101	7754201	7754102	7754202

5. Verwendung interner Modelle gem. § 26b BWG

	Allgemeines		Spezifisches	
	Risikopos. des Vortages	Durchschnitt der letzten 60 Tage x F ¹⁾	Risikopos. des Vortages	Durchschnitt der letzten 60 Tage x F ¹⁾
VAR – Positionsrisiko in zinsbezogenen Instrumenten	7755011	7755021		
VAR – Positionsrisiko in Substanzwerten	7755012	7755022		
VAR – Fremdwährungen und Gold	7755013	7755023		
VAR – Waren	7755014	7755024		
VAR – Gesamt	7755001	7755002	7755003	7755004

¹⁾ Faktor.

6. Gamma- und Vega-Risiko gemäß § 22e Abs. 4 BWG bzw. § 22p Abs. 5

	EM-Erfordernis
Zinsbezogene Instrumente	7756110
Gamma	7756111
Vega	7756112
Substanzwerte	7756120
Gamma	7756121
Vega	7756122
Fremdwährungen und Gold	7756130
Gamma	7756131
Vega	7756132
Waren	7756140
Gamma	7756141
Vega	7756142
Summe	7756100

7. Szenario Matrix gem. § 22e Abs. 3 BWG

	EM-Erfordernis
Zinsbezogene Instrumente	7757110
Substanzwerte	7757120
Fremdwährungen und Gold	7757130
Waren	7757140
Summe	7750024

ZUSAMMENFASSUNG DER EIGENMITTELERFORDERNISSE

1. Bemessungsgrundlage und Eigenmittelerfordernis gem. § 22 Abs. 2 BWG (ohne Wertpapierhandelsbuch)

	Betrag
Summe risikogewichtete Aktiva	7710000
Summe aller risikogewichteten außerbilanzmäßigen Geschäfte	7720000
Summe Marktbewertungsansatz	7742001
Summe Ursprungsrisikoansatz	7747001
Bemessungsgrundlage	7700001
Eigenmittelerfordernis für Solvabilität	7700002

2. Eigenmittelerfordernis für Wertpapierhandelsbuch gem. § 22b Abs. 1 Z 1 bis 13 BWG

	Betrag
1. Spezifisches Positionsrisiko in Schuldtiteln und am Geldmarkt gegebenen Geldern gem. § 22g	7750012
2. Allgemeines Positionsrisiko in in zinsbezogenen Instrumenten gem. § 22h Abs. 3 Z 9 oder § 22h Abs. 4 Z 6	7750013
3. Spezifisches Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 2 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750014
4. Allgemeines Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 3 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750015
5. Risiko aus Aktienindex-Terminkontrakten gem. § 22j Abs. 2	7750016
6. Sonst. mit Optionen verbundene Risiken gem. § 22e Abs. 4 BWG und § 22p Abs. 5 BWG ¹⁾	7756100
7. Nach der Szenario Matrix Methode behandelte Optionen gem. § 22e Abs. 3	7750024
8. Abwicklungsrisiko gem. § 22l	7750017
9. Vorleistungen gem. § 22m Abs. 2	7750018
10. Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte gem. § 22n Abs. 1	7750019
11. Wertpapierleihgeschäfte und Wertpapierverleihgeschäfte des Wertpapierhandelsbuches gem. § 22n Abs. 1	7750020
12. Ausfallsrisiko gem. § 22o	7750021
13. Warenpositionsrisiko gem. § 22p	7750025
14. Risikoposition gem. § 26b Abs. 2	7750022
Summe	7750100

¹⁾ Da nun eine eigene Position für das Gamma/Vega-Risiko besteht, erfolgt keine Aufteilung mehr in das allgemeine Positionsrisiko in Schuldtiteln, Substanzwerten sowie EM-Erfordernis für offene Devisenpositionen. Aus diesem Grund wurde auch die Position 6840000 auf 6840001 geändert.

**3. Eigenmittelerfordernis für offene Fremdwährungspositionen und Gold
gem. § 26 Abs. 1 oder Abs. 2 BWG**

	Betrag
	6840000

**4. Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen gem.
§ 29 Abs. 4 BWG**

	Betrag
	7900002

5. Eigenmittelerfordernis – insgesamt

	Betrag
	7700003

§ 23 BWG – EIGENMITTEL

					Anrechnung für Eigenmittel
Kernkapital:					
a) Eingezahltes Kapital (inkl. Vorzugsaktien)				§ 23 Abs. 1 Z 1 u. Abs. 2	7810011
b) Offene Rücklagen (nach Steuerlatenz)				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810012
hiev. bestätigte Zwischengewinne				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810016
c) Fonds für allgemeine Bankrisiken				§ 23 Abs. 1 Z 3	7810013
d) Abzugsposten immaterielle Vermögensgegenstände				§ 23 Abs. 13 Z 1	7810014
e) Abzugsposten Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse				§ 23 Abs. 13 Z 2	7810015
Kernkapital (Tier I-Kapital)				§ 23 Abs. 14 Z 1	7810001
Ergänzende Eigenmittel:					
f) Stille Reserven			§ 23 Abs. 1 Z 4	7820011	
g) Ergänzungskapital			§ 23 Abs. 1 Z 5	7820012	
h) Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht			§ 23 Abs. 1 Z 5	7820013	
i) Neubewertungsreserve	§ 23 Abs. 1 Z 7	7820014 ¹⁾	§ 23 Abs. 14 Z 4	7820015 ²⁾	
j) Nachrangiges Kapital	§ 23 Abs. 1 Z 6	7820016 ³⁾	§ 23 Abs. 14 Z 5	7820017 ⁴⁾	
k) Haftsummenzuschlag	§ 23 Abs. 1 Z 8	7820018 ¹⁾	§ 23 Abs. 14 Z 6	7820019 ⁵⁾	
vorhandene ergänzende Eigenmittel				7820001 ⁶⁾	
Ergänzende Eigenmittel (Tier II-Kapital)				§ 23 Abs. 14 Z 2	7830001 ⁷⁾
l) Abzugsposten bei einem Anteilsbesitz von mehr als 10%				§ 23 Abs. 13 Z 3	7840011
m) Abzugsposten gem. § 23 Abs. 13 Z 4				§ 23 Abs. 13 Z 4	7840012
ANRECHENBARE EIGENMITTEL [Tier I-Kapital + Tier II-Kapital abzügl. l) und m)]					7850001
n) kurzfristiges nachrangiges Kapital				7860001 ⁸⁾	7890017 ⁹⁾
o) für Tier III-Kap. umgewidmet. Tier II-Kap.			§ 23 Abs. 8a	7820021 ¹⁰⁾	7890018 ¹¹⁾
Tier III-Kapital					7860004 ¹²⁾
EIGENMITTEL					7800000

Fußnoten zu Eigenmittelberechnung

- ¹⁾ Voller Betrag der Neubewertungsreserve (nach Abschlag der 55%).
- ²⁾ Anrechenbare Neubewertungsreserve.
- ³⁾ Voller Betrag.
- ⁴⁾ Anrechenbarer Betrag. Zusammen mit Haftsummenzuschlag max. 50% von Tier I-Kapital.
- ⁵⁾ Anrechenbarer Betrag. Max. 25% von Tier I-Kapital; zusammen mit anrechenbarem nachrangigen Kapital max. 50% von Tier I-Kapital.
- ⁶⁾ Summe der vollen Beträge f bis h sowie der anrechenbaren Beträge i bis k.
- ⁷⁾ Anrechenbare ergänzende Eigenmittel. Max. 100% von Tier I-Kapital.
- ⁸⁾ Vorhandenes Tier III-Kapital.
- ⁹⁾ Anrechenbares Tier III-Kapital.
- ¹⁰⁾ Hier ist das zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehende Tier II-Kapital anzugeben.
- ¹¹⁾ Anrechenbares Kapital.
- ¹²⁾ Summe aus anrechenbaren Kapitalia von n und o. Achtung – neue Positionsnummer!

ZUSAMMENFASSUNG DER KAPITALIA

	Volumen	Freies Kapital nach Verwen- dung für Sol- vabilität und Nichtfinanz- beteiligungen	Abzugserfor- dernis gem. § 23 Abs. 13 Z 3 und 4	Für Markt- risiko ver- wendbares Kapital	Freies Kapital nach Abdek- kung sämt- licher EM-Er- fordernisse
Kernkapital (Tier I-Kapital)	7810001	7890011	7890013	7890015	7890019
Ergänz. Eigenmittel (Tier II-Kapital)	7830001	7890012	7890014	7890016	7890020
kurzfr. nachr. Kapital (Tier III-Kapital)	7860001	xxxxxxx	xxxxxxx	7890017	7890021
Zur Umwidmung in Tier III-Kapital zur Verfügung stehendes Tier II-Kapital	7820021	xxxxxxx	xxxxxxx	7890018	7890022

§ 25 BWG – LIQUIDITÄT

AUF BASIS VON RESTLAUFZEITEN

1. Liquidität 1

a) €-Verpflichtungen-Liquidität 1 gem. § 25 Abs. 7 Z 1	Durchschnitt ¹⁾
Nur von Zentralinstituten auszufüllen: Einlagen bei Zentralinstituten unter 30 Tagen (gem. § 25 Abs. 4 Z 1)	6311100

b) €-Verpflichtungen-Liquidität 1 gem. § 25 Abs. 7 Z 2	Durchschnitt ²⁾
+ €-Verpflichtungen-LI 1 gem. § 25 Abs. 4 Z 1 bis 5	6400100
– €-Verpflichtungen-LI 1 gem. § 25 Abs. 5 Z 1 bis 6	6401100
Summe der Verpflichtungen LI I gem. § 25 Abs. 4 und 5	6402100

c) Flüssige Mittel 1. Grades gem. § 25 Abs. 6	Durchschnitt ³⁾
Summe	6500100

¹⁾ Arithmetisches Mittel der Tagesendstände am Letzten des vorletzten Monats sowie am 7., 15. und 23. des Vormonats.

²⁾ Arithmetisches Mittel der Tagesstände am Letzten des Vormonats sowie am 7., 15. und 23. des laufenden Monats.

³⁾ Kalenderdurchschnitt.

2. Liquidität 2

a) €-Verpflichtungen-Liquidität 2 gem. § 25 Abs. 8	15. des Berichtsmonats
+ €-Verpflichtungen-LI 1 gem. § 25 Abs. 8 Z 1	6403115
+ €-Verpflichtungen-LI 2 gem. § 25 Abs. 8 Z 2 bis 5	6600115
– €-Verpflichtungen-LI 2 gem. § 25 Abs. 9	6601115
Summe	6602115

b) Flüssige Mittel 2. Grades gem. § 25 Abs. 10 und 11	Ultimo des Berichtsmonats
+ Flüssige Mittel 2. Grades gem. § 25 Abs. 10 Z 1 bis 9	6700131
. Überschuss Liquidität 1 gem. § 25 Abs. 10 Z 7	6723131
– Flüssige Mittel 2. Grades gem. § 25 Abs. 11	6701131
Summe	6702131

§ 26 BWG – OFFENE FREMDWÄHRUNGSPPOSITIONEN UND GOLD ¹⁾ BZW.

§ 26a BWG – OFFENE FRISTIGKEITSPOSITIONEN

1. Höchststand der offenen Devisenpositionen pro Währung im Monat

Währung	Betrag
ISO-Code<__>	6800001

2. Höchste Überschreitung der 50-Prozent-Grenze (der EM) aller offenen Fristigkeitspositionen sowie Anzahl der Überschreitungen im Monat sowie der Quartale und Halbjahre

a) kalendervierteljährliche Fälligkeit (gem. § 26a Abs. 2 BWG)

Betrag	Anzahl im Monat	Anzahl der Quartale
6800013	9600013	9600113

b) kalenderhalbjährliche Fälligkeit (gem. § 26a Abs. 3 BWG)

Betrag	Anzahl im Monat	Anzahl der Halbjahre
6800014	9600014	9600214

¹⁾ Inklusive Goldmünzen sowie Valutenbestände.

3. Eigenmittelerfordernis für Fremdwährungspositionen und Gold gem. § 26 Abs. 1 oder Abs. 2 BWG

a) Eigenmittelerfordernis für Fremdwährungspositionen und Gold gem. § 26 Abs. 1 BWG

	Eigenmittel- erfordernis
8% der Währungsgesamtposition ¹⁾	6842011
Abzüglich 8% des Freibetrages ²⁾ gem. § 103 Z 18a	6842012
Eigenmittelerfordernis	6840001 ³⁾

b) Eigenmittelerfordernis für Fremdwährungspositionen und Gold gem. § 26 Abs. 2 BWG

	Eigenmittel- erfordernis
8% des Nettogesamtbetrages nach Abzug von ausgeglichenen Positionen in nachweislich eng verbundenen Währungen	6841011
4% der ausgeglichenen Position in eng verbundenen Währungen	6841013
Eigenmittelerfordernis	6840001 ³⁾

¹⁾ Falls die berechnete Währungsgesamtposition kleiner gleich 2% der anrechenbaren Eigenmittel beträgt, so ist kein Eigenmittelerfordernis notwendig (Bagatellschwelle).

²⁾ 2% der anrechenbaren Eigenmittel (inkl. Tier III-Kapital).

³⁾ Achtung – Änderung der Positionsnummer! Betrifft auch Zusammenfassung der EM-Erfordernisse.

§ 27 – GROSSVERANLAGUNGEN

1. A) Großveranlagung gem. § 27 Abs. 2 Z 1 bis 4 iVm § 103 Z 21 lit. b BWG

B) GVA gem. § 27 Abs. 2 BWG nach Gewichtung

C) Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung der vertraglichen Bindung gem. § 103 Z 21 lit. d BWG

Meldeblock B		Meldeblock A			Meldeblock B				Mb C
Ident-nummer	GVA-Kennz. ¹⁾	GVA nach Abzug von WB	Zurechnungen gem. § 27 Abs. 5 zu einem Dritten		GVA nach Zurechnungen	GVA Gewicht	ungew. Wert	gewicht. Wert	vertragl. geb. Wert nach Gewichtung
			Ident-Nr. ²⁾	Betrag					
	7410001	7410003		7410004	7410010	0%	7410111	xxxxxxx	xxxxxxx
				...		20%	7410112	7410212	7410313
				...		50%	7410113	7410213	7410314
						100%	7410114	7410214	7410315
Summe							7410100	7410200	7410300

2. Zusatzangaben für unter Punkt 1 gemeldete Gruppen verbundener Kunden sowie Tochterkonzerne des kreditgewährenden Kreditinstitutes gem. § 27 Abs. 4 Z 1 BWG

Identnummer ³⁾	Einzel-identnummern der Gruppe	GVA nach Abzug von WB
		7410002
		...
		...

3. Gesamtheit aller GVA

Wert
7400010

4. Summe der nicht in der Gesamtheit enthaltenen GVA (= mehrfach zugerechnete Obligoanteile)

Wert
7400020

¹⁾ Kennzeichen: GVA-Gewährung an eigene Gruppe verbundener Kunden: „1“.

Übrige GVA-Gewährungen: „2“.

²⁾ Hier ist auf jeden Fall – auch dann, wenn das Subjekt nicht in der GVA/GKE meldepflichtig ist – eine Identnummer anzuführen.

³⁾ Hier ist entweder die Gruppenidentnummer oder – bei Vorliegen eines Tochterkonzerns – die Einzelidentnummer anzugeben.

§ 29 BWG – BETEILIGUNGEN**Alle qualifizierten Beteiligungen über 15% der anrechenbaren Eigenmittel**

Identnummer	Beteiligung Betrag
	7900001

	Betrag
Gesamtbuchwert der qualifizierten Beteiligungen (an anderen Unternehmen als den in § 29 Abs. 1 Z 1 bis 3 genannten)	7900000
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gem. § 29 Abs. 1	7900011
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gem. § 29 Abs. 2	7900012

TEIL D

KONSOLIDIERUNG

§ 24 BWG – KONSOLIDIERTE EIGENMITTEL

					Anrechnung für Eigenmittel
Kernkapital:					
a) Eingezahltes Kapital des übergeordneten Instituts (inkl. Vorzugsaktien)				§ 23 Abs. 2 und 3	7810811
b) Offene Rücklagen des übergeordneten Inst.				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810812
hiev. bestätigte Gewinne				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810821
Anteile anderer Gesellschafter				§ 24 Abs. 2 Z 1	7810813
hievon hybrides Kapital				§ 24 Abs. 2 Z 1 sowie § 24 Abs. 2 Z 5 und 6	7810822
+/- Unterschiedsbetrag aus der Zusammenfassung von Eigenkapital und Beteiligungen				§ 24 Abs. 2 Z 2	7810814
+/- Umrechnungsdifferenzen ausl. Währungen				§ 24 Abs. 2 Z 3	7810815
+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung der nachgeordneten Institute				§ 24 Abs. 3 Z 2	7810816
+/- Unterschiedsbetrag aus der Equity-Bewertung von Beteiligungen an Unternehmen					7810817
c) Fonds für allgemeine Bankrisiken				§ 23 Abs. 1 Z 3	7810818
d) Abzugsposten immaterielle Vermögensgegenstände				§ 23 Abs. 13 Z 1	7810819
e) Abzugsposten Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse				§ 23 Abs. 13 Z 2	7810820
Kernkapital (Tier I-Kapital) (Kernkap. gem. § 23 Abs. 14 Z 1; Basis für ergänzende Eigenmittel)				§ 23 Abs. 14 Z 1	7810801
Ergänzende Eigenmittel:					
f) Stille Reserven				§ 23 Abs. 1 Z 4	7820811
g) Ergänzungskapital				§ 23 Abs. 1 Z 5	7820812
h) Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht				§ 23 Abs. 1 Z 5	7820813
i) Neubewertungsreserve	§ 23 Abs. 1 Z 7	7820814 ¹⁾	§ 23 Abs. 14 Z 4	7820815 ²⁾	
j) Nachrangiges Kapital	§ 23 Abs. 1 Z 6	7820816 ³⁾	§ 23 Abs. 14 Z 5	7820817 ⁴⁾	
k) Haftsummenzuschlag	§ 23 Abs. 1 Z 8	7820818 ³⁾	§ 23 Abs. 14 Z 6	7820819 ⁵⁾	
vorhandene ergänzende Eigenmittel				7820801 ⁶⁾	
Ergänzende Eigenmittel (Tier II-Kapital)				§ 23 Abs. 14 Z 2	7830801 ⁷⁾
l) Abzugsposten bei einem Anteilsbesitz von mehr als 10%					7840811
m) Abzugsposten gem. § 23 Abs. 13 Z 4					7840812
ANRECHENBARE EIGENMITTEL [Tier I-Kapital + Tier II-Kapital abzügl. l) und m)]					7850801
n) kurzfristiges nachrangiges Kapital				7860801 ⁸⁾	7860804 ⁹⁾
o) für Tier III-Kap. umgewidmet. Tier II-Kap.				7860805 ¹⁰⁾	7860803 ¹¹⁾
Tier III-Kapital					7860806 ¹²⁾
EIGENMITTEL					7800800

Fußnoten siehe § 23 (Teil C) – Seite 48.

ZUSAMMENFASSUNG DER EIGENMITTELERFORDERNISSE

KI-Gruppe

1. Bemessungsgrundlage und Eigenmittelerfordernis gem. § 22 Abs. 2 BWG (ohne Wertpapierhandelsbuch)

	Betrag
Summe risikogewichtete Aktiva	7710800
Summe aller risikogewichteten außerbilanzmäßigen Geschäfte	7720800
Summe Marktbewertungsansatz	7733800
Summe Ursprungsrisikoansatz	7734800
Bemessungsgrundlage	7700801
Eigenmittelerfordernis für Solvabilität	7700802

2. Eigenmittelerfordernis für Wertpapierhandelsbuch gem. § 22b Abs. 1 Z 1 bis 13 BWG

	Betrag
1. Spezifisches Positionsrisiko in Schuldtiteln und Geldmarkt beg. Geldern gem. § 22g	7750812
2. Allgemeines Positionsrisiko in zinsbezogenen Instrumenten gem. § 22h Abs. 2 Z 9 oder § 22h Abs. 3 Z 6	7750813
3. Spezifisches Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 2 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750814
4. Allgemeines Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 3 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750815
5. Risiko aus Aktienindex-Terminkontrakten gem. § 22j Abs. 2	7750816
6. Sonst. mit Optionen verbundene Risiken gem. § 22e Abs. 4 BWG und § 22p Abs. 5 BWG ¹⁾	7750823
7. Nach der Szenario Matrix Methode behandelte Optionen gem. § 22e Abs. 3	7750824
8. Abwicklungsrisiko gem. § 22l	7750817
9. Vorleistungen gem. § 22m Abs. 2	7750818
10. Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte gem. § 22n Abs. 1	7750819
11. Wertpapierleihgeschäfte und Wertpapierverleihgeschäfte des Wertpapierhandelsbuches gem. § 22n Abs. 1	7750820
12. Ausfallsrisiko gem. § 22o	7750821
13. Warenpositionsrisiko gem. § 22p	7750825
14. Risikoposition gem. § 26b Abs. 2	7750822
Summe	7750800

¹⁾ Da nun eine eigene Position für das Gamma/Vega-Risiko besteht, erfolgt keine Aufteilung mehr in das allgemeine Positionsrisiko in Schuldtiteln, Substanzwerten sowie EM-Erfordernis für offene Devisenpositionen. Aus diesem Grund wurde auch die Position 6840800 auf 6840801 geändert.

**3. Eigenmittelerfordernis für offene Fremdwährungspositionen und Gold
gem. § 26 Abs. 1 BWG**

	Betrag
	6840801

**4. Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen gem.
§ 29 Abs. 4 BWG**

	Betrag
	7900802

5. Eigenmittelerfordernis – insgesamt

	Betrag
	7700803

§ 27 – GROSSVERANLAGUNGEN

KI-Gruppe

1. A) Großveranlagung gem. § 27 Abs. 2 Z 1 bis 4 iVm § 103 Z 21 lit. b BWG

B) GVA gem. § 27 Abs. 2 BWG nach Gewichtung

C) Inanspruchnahme der Übergangsbestimmung der vertraglichen Bindung gem. § 103 Z 21 lit. d BWG

			A)	B)	C)
Identnummer	GVA-Kennzeichen ¹⁾	GVA-Gewicht	ungewichteter Wert ²⁾	gewichteter Wert	vertragl. geb. Wert nach Gewichtung
	7410001	0%	7410111	xxxxxxx	xxxxxxx
		20%	7410112	7410212	7410313
		50%	7410113	7410213	7410314
		100%	7410114	7410214	7410315
Summe			7410010	7410200	7410300

2. Gesamtheit aller GVA

Wert
7400010

¹⁾ Kennzeichen: GVA-Gewährung an eigene Gruppe verbundener Kunden: „1“;
Übrige GVA-Gewährungen: „2“.

²⁾ Nach Zurechnung auf Grund von Haftungen bzw. WP-Sicherheiten.

§ 29 BWG – BETEILIGUNGEN**KI-Gruppe****Alle qualifizierten Beteiligungen über 15% der anrechenbaren Eigenmittel**

Identnummer	Beteiligung Betrag
	7900001

	Betrag
Gesamtbuchwert der qualifizierten Beteiligungen (an anderen Unternehmen als den in § 29 Abs. 1 Z 1 bis 3 genannten)	7900000
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gem. § 29 Abs. 1	7900011
Summe der Überschreitung der Beteiligungsgrenzen gem. § 29 Abs. 2	7900012

EIGENMITTEL GEM. § 23 ABS. 13 Z 6 A BWG**(von Zentralinstituten auszufüllen – für gesamten Sektor auf konsolidierter Basis)**

					Anrechnung für Eigenmittel
Kernkapital:					
a) Eingezahltes Kapital				§ 23 Abs. 1 Z 1	7810911
b) Offene Rücklagen (nach Steuerlatenz)				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810912
hiev. bestätigte Gewinne				§ 23 Abs. 1 Z 2	7810916
c) Fonds für allgemeine Bankrisiken				§ 23 Abs. 1 Z 3	7810913
d) Abzugsposten immaterielle Vermögensgegenstände				§ 23 Abs. 13 Z 1	7810914
e) Abzugsposten Bilanzverlust sowie materielle negative Ergebnisse				§ 23 Abs. 13 Z 2	7810915
Kernkapital (Tier I-Kapital)				§ 23 Abs. 14 Z 1	7810901
Ergänzende Eigenmittel:					
f) Stille Reserven				§ 23 Abs. 1 Z 4	7820911
g) Ergänzungskapital				§ 23 Abs. 1 Z 5	7820912
h) Partizipationskapital mit Dividendennachzahlungspflicht				§ 23 Abs. 1 Z 5	7820913
i) Neubewertungsreserve	§ 23 Abs. 1 Z 7	7820914 ¹⁾	§ 23 Abs. 14 Z 4	7820915 ²⁾	
j) Nachrangiges Kapital	§ 23 Abs. 1 Z 6	7820916 ³⁾	§ 23 Abs. 14 Z 5	7820917 ⁴⁾	
k) Haftsummenzuschlag	§ 23 Abs. 1 Z 8	7820918 ³⁾	§ 23 Abs. 14 Z 6	7820919 ⁵⁾	
vorhandene ergänzende Eigenmittel				7820901 ⁶⁾	
Ergänzende Eigenmittel (Tier II-Kapital)				§ 23 Abs. 14 Z 2	7830901 ⁷⁾
l) Abzugsposten bei einem Anteilsbesitz von mehr als 10%				§ 23 Abs. 13 Z 3	7840911
m) Abzugsposten gem. § 23 Abs. 13 Z 4				§ 23 Abs. 13 Z 4	7840912
ANRECHENBARE EIGENMITTEL [Tier I-Kapital + Tier II-Kapital abzügl. l) und m)]					7850901
n) kurzfristiges nachrangiges Kapital				7860901 ⁸⁾	7860904 ⁹⁾
o) für Tier III-Kap. umgewidmet. Tier II-Kap.				7860905 ¹⁰⁾	7860903 ¹¹⁾
Tier III-Kapital					7860906 ¹²⁾
EIGENMITTEL					7800900

ZUSAMMENFASSUNG DER EIGENMITTELERFORDERNISSE

(gesamter Sektor auf konsolidierter Basis)

1. Bemessungsgrundlage und Eigenmittelerfordernis gem. § 22 Abs. 2 BWG (ohne Wertpapierhandelsbuch)

	Betrag
Summe risikogewichtete Aktiva	7710900
Summe aller risikogewichteten außerbilanzmäßigen Geschäfte	7720900
Summe Marktbewertungsansatz	7733900
Summe Ursprungsrisikoansatz	7734900
Bemessungsgrundlage	7700901
Eigenmittelerfordernis für Solvabilität	7700902

2. Eigenmittelerfordernis für Wertpapierhandelsbuch gem. § 22b Abs. 1 Z 1 bis 13 BWG

	Betrag
1. Spezifisches Positionsrisiko in Schuldtiteln und Geldmarkt beg. Geldern gem. § 22g	7750912
2. Allgemeines Positionsrisiko in zinsbezogenen Instrumenten gem. § 22h Abs. 2 Z 9 oder § 22h Abs. 3 Z 6	7750913
3. Spezifisches Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 2 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750914
4. Allgemeines Positionsrisiko in Substanzwerten gem. § 22i Abs. 3 in Verbindung mit § 22j Abs. 3	7750915
5. Risiko aus Aktienindex-Terminkontrakten gem. § 22j Abs. 2	7750916
6. Sonst. mit Optionen verbundene Risiken gem. § 22e Abs. 4 BWG und § 22p Abs. 5 BWG ¹⁾	7750923
7. Nach der Szenario Matrix Methode behandelte Optionen gem. § 22e Abs. 3	7750924
8. Abwicklungsrisiko gem. § 22l	7750917
9. Vorleistungen gem. § 22m Abs. 2	7750918
10. Pensionsgeschäfte, umgekehrte Pensionsgeschäfte gem. § 22n Abs. 1	7750919
11. Wertpapierleihgeschäfte und Wertpapierverleihgeschäfte des Wertpapierhandelsbuches gem. § 22n Abs. 1	7750920
12. Ausfallsrisiko gem. § 22o	7750921
13. Warenpositionsrisiko gem. § 22p	7750925
14. Risikoposition gem. § 26b Abs. 2	7750922
Summe	7750900

¹⁾ Da nun eine eigene Position für das Gamma/Vega-Risiko besteht, erfolgt keine Aufteilung mehr in das allgemeine Positionsrisiko in Schuldtiteln, Substanzwerten sowie EM-Erfordernis für offene Devisenpositionen. Aus diesem Grund wurde auch die Position 6840900 auf 6840901 geändert.

**3. Eigenmittelerfordernis für offene Fremdwährungspositionen und Gold
gem. § 26 Abs. 1 oder 2 BWG**

	Betrag
	6840901

**4. Eigenmittelerfordernis für qualifizierte Nichtfinanzbeteiligungen gem.
§ 29 Abs. 4 BWG**

	Betrag
	7900902

5. Eigenmittelerfordernis – insgesamt

	Betrag
	7700903

Meldung		Zinsbindungsbilanz (1)		Zinsbindungsbilanz/ Durationsbilanz		Währung ¹⁾									
		Durationsbilanz (2)			ISO-Code<_>										
		Bis zur nächsten Zinsanpassung bzw. nach Restlaufzeit (falls 1) bzw. nach modifizierter Duration (falls 2)													
I. On-balance-Positionen	AKTIVA		bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 2 Jahre	>2 Jahre bis 3 Jahre	>3 Jahre bis 4 Jahre	>4 Jahre bis 5 Jahre	>5 Jahre bis 7 Jahre	>7 Jahre bis 10 J.	>10 Jahre bis 15 J.	>15 Jahre bis 20 J.	über 20 Jahre
	1. Zinsbindungsbilanz		bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 1,86 J.	>1,86 J. bis 2,72 J.	>2,72 J. bis 3,55 J.	>3,55 J. bis 4,33 J.	>4,33 J. bis 5,79 J.	>5,79 J. bis 7,72 J.	>7,72 J. bis 10,38 J.	>10,38 J. bis 12,46 J.	über 12,46 J.
	2. Durationsbilanz		bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 1,86 J.	>1,86 J. bis 2,72 J.	>2,72 J. bis 3,55 J.	>3,55 J. bis 4,33 J.	>4,33 J. bis 5,79 J.	>5,79 J. bis 7,72 J.	>7,72 J. bis 10,38 J.	>10,38 J. bis 12,46 J.	über 12,46 J.
	Zinsfixe Forderungen		5500110	5500210	5500310	5500410	5500510	5500610	5500710	5500810	5500910	5501010	5501110	5501210	5501310
	Zinsvariable Forderungen		5500120	5500220	5500320	5500420	5500520	5500620	5500720	5500820	5500920	5501020	5501120	5501220	5501320
II. Off-balance-Positionen	Forderungen mit unbestimmter Zinsbindung		5500130	5500230	5500330	5500430	5500530	5500630	5500730	5500830	5500930	5501030	5501130	5501230	5501330
	Sonstige Aktiva		5500140	5500240	5500340	5500440	5500540	5500640	5500740	5500840	5500940	5501040	5501140	5501240	5501340
	Synthetische Aktiva aus Derivaten		5500150	5500250	5500350	5500450	5500550	5500650	5500750	5500850	5500950	5501050	5501150	5501250	5501350
	davon: Zinsswaps		5500151	5500251	5500351	5500451	5500551	5500651	5500751	5500851	5500951	5501051	5501151	5501251	5501351
	Zinstermingeschäfte		5500152	5500252	5500352	5500452	5500552	5500652	5500752	5500852	5500952	5501052	5501152	5501252	5501352
	Zinsterminkontrakte (futures) u. zinsbezogene Index-Kontrakte		5500153	5500253	5500353	5500453	5500553	5500653	5500753	5500853	5500953	5501053	5501153	5501253	5501353
	Zinsoptionen		5500154	5500254	5500354	5500454	5500554	5500654	5500754	5500854	5500954	5501054	5501154	5501254	5501354
	Sonstige vergleichbare Verträge		5500155	5500255	5500355	5500455	5500555	5500655	5500755	5500855	5500955	5501055	5501155	5501255	5501355
	FX-Kontrakte		5500156	5500256	5500356	5500456	5500556	5500656	5500756	5500856	5500956	5501056	5501156	5501256	5501356
	Summe Aktiva		5500100	5500200	5500300	5500400	5500500	5500600	5500700	5500800	5500900	5501000	5501100	5501200	5501300

¹⁾ Folgende Einzelwährungen sind unter I. und II. generell zu melden: EUR, USD, CHF, JPY, GBP, CAD. Alle anderen unter I. und II. zu meldenden Währungen sind unter dem Kürzel XXX als „Sonstige Währungen“ zusammen zu melden.

PASSIVA		Bis zur nächsten Zinsanpassung bzw. nach Restlaufzeit (falls 1) bzw. nach modifizierter Duration (falls 2)													
I. On-balance-Positionen	1. Zinsbindungsbilanz	bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 2 Jahre	>2 Jahre bis 3 Jahre	>3 Jahre bis 4 Jahre	>4 Jahre bis 5 Jahre	>5 Jahre bis 7 Jahre	>7 Jahre bis 10 J.	>10 Jahre bis 15 J.	>15 Jahre bis 20 J.	über 20 Jahre	
	2. Durationsbilanz	bis 1 Monat	>1 bis 3 Monate	>3 bis 6 Monate	>6 Monate bis 1 Jahr	>1 Jahr bis 1,86 J.	>1,86 J. bis 2,72 J.	>2,72 J. bis 3,55 J.	>3,55 J. bis 4,33 J.	>4,33 J. bis 5,79 J.	>5,79 J. bis 7,72 J.	>7,72 J. bis 10,38 J.	>10,38 J. bis 12,46 J.	über 12,46 J.	
	Zinsfixe Verbindlichkeiten	5600110	5600210	5600310	5600410	5600510	5600610	5600710	5600810	5600910	5601010	5601110	5601210	5601310	
	Zinsvariable Verbindlichkeiten	5600120	5600220	5600320	5600420	5600520	5600620	5600720	5600820	5600920	5601020	5601120	5601220	5601320	
	Verbindlichkeiten mit unbestimmter Zinsbindung	5600130	5600230	5600330	5600430	5600530	5600630	5600730	5600830	5600930	5601030	5601130	5601230	5601330	
II. Off-balance-Positionen	Sonst. Passiva u. Eigenkapital	5600140	5600240	5600340	5600440	5600540	5600640	5600740	5600840	5600940	5601040	5601140	5601240	5601340	
	Synthetische Passiva aus Derivaten	5600150	5600250	5600350	5600450	5600550	5600650	5600750	5600850	5600950	5601050	5601150	5601250	5601350	
	davon:														
	Zinsswaps	5600151	5600251	5600351	5600451	5600551	5600651	5600751	5600851	5600951	5601051	5601151	5601251	5601351	
	Zinstermingeschäfte	5600152	5600252	5600352	5600452	5600552	5600652	5600752	5600852	5600952	5601052	5601152	5601252	5601352	
	Zinsterminkontrakte (futures) u. zinsbezogene Index-Kontrakte	5600153	5600253	5600353	5600453	5600553	5600653	5600753	5600853	5600953	5601053	5601153	5601253	5601353	
	Zinsoptionen	5600154	5600254	5600354	5600454	5600554	5600654	5600754	5600854	5600954	5601054	5601154	5601254	5601354	
	Sonstige vergleichbare Verträge	5600155	5600255	5600355	5600455	5600555	5600655	5600755	5600855	5600955	5601055	5601155	5601255	5601355	
	FX-Kontrakte	5600156	5600256	5600356	5600456	5600556	5600656	5600756	5600856	5600956	5601056	5601156	5601256	5601356	
		Summe Passiva	5600100	5600200	5600300	5600400	5600500	5600600	5600700	5600800	5600900	5601000	5601100	5601200	5601300

III. Standardverfahren ¹⁾

Barwerfänderung bei angenommener Zinsänderung:

In % der anrechenbaren Eigenmittel:

5700010
5700011

IV. Internes Risikomanagement ¹⁾

Barwerfänderung bei angenommener Zinsänderung:

In % der anrechenbaren Eigenmittel:

5700020
5700021

¹⁾ Institute, die ein vom jeweils gewählten Standardverfahren abweichendes internes Risikomanagementsystem haben, haben zugleich unter IV. und III. zu melden. Alle anderen Institute haben unter IV. identische Zahlen wie unter III. zu melden.