

- Sonstige Angaben -

(Übergeordnetes Unternehmen einschließlich nachgeordneter Unternehmen mit Sitz im Inland und im Ausland) ¹⁾

Übergeordnetes Unternehmen _____ Institutgruppe/ Finanzholding-Gruppe/ gemischte Finanzholding-Gruppe _____
 (gemäß § 10a Absatz 1 Satz 2, 4 bis 8 und Absatz 2 in Verbindung mit Absatz 3 KWG)
 Ort _____ Institutsnummer _____ Prüfziffer _____ Stand Ende _____

Die angegebenen Beträge lauten auf volle Euro. ²⁾

QSA 2

Sonstige Angaben

(1) Angaben zu Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch ³⁾

378	Steuerung der Zinsänderungsrisiken auf Anwendungsebene des Gruppen-Waivers (=1)	378	_____
380	Zinsbuchbarwert	380	_____
390	Barwertänderung bei Zinserhöhung ⁴⁾	390	_____
400	Zinskoeffizient bei Zinserhöhung ⁴⁾ (in %)	400	_____
410	Barwertänderung bei Zinssenkung ⁴⁾	410	_____
420	Zinskoeffizient bei Zinssenkung ⁴⁾ (in %)	420	_____
430	Anwendung Ausweichverfahren (=1); sonstige Verfahren (=2)	430	_____
435	Berücksichtigung (=1) bzw. Nicht-Berücksichtigung (=2) von Margen in Cashflows	435	_____

(2) Weitere Angaben

450	Konditionenbeitrag ⁴⁾	450	_____
460	Aktivgeschäft ⁴⁾	460	_____
470	Passivgeschäft ⁴⁾	470	_____
480	Strukturbeitrag ⁴⁾	480	_____
490	Rechnungslegungsstandard: HGB (=1), IFRS (=2)	490	_____

¹⁾ Institute gemäß § 1 Absatz 1b KWG sowie weitere nach § 10a Absatz 1 Satz 2, 4 bis 8 und Absatz 2 in Verbindung mit Absatz 3 KWG einzubeziehende Unternehmen.

²⁾ Angaben – außer bei Posten 400 und 420 – bitte ohne Kommastellen, Rundung nach kaufmännischer Rundungsregel (5/4). Die Angaben zu den Posten 400 und 420 sind mit zwei Kommastellen anzugeben.

³⁾ Gemäß Rundschreiben 11/2011 (BA) der BaFin.

⁴⁾ Vorzeichen angeben.

Größere Veränderungen einzelner Positionen bitte gesondert erläutern.