

**Anhang II: LCR Offenlegungsvorlage und die Vorlage zu qualitativen Informationen über die LCR**

LCR-Offenlegungsvorlage zu quantitativen Informationen über die LCR, die Artikel 435 Absatz 1 Buchstabe f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ergänzt.

<b>Zweck:</b> Offenlegung der Ebene und der Komponenten der LCR
<b>Anwendungsbereich:</b> Der Anwendungsbereich richtet sich nach den Vorgaben unter Nr. 1 und Nr. 3 des Rundschreibens
<b>Inhalt:</b> Quantitative Informationen
<b>Häufigkeit:</b> Mindestens einmal pro Jahr
<b>Format:</b> Fest

Konsolidierungsumfang (solo/konsolidiert)		Ungewichteter Gesamtwert (Durchschnitt)				Gewichteter Gesamtwert (Durchschnitt)			
Währung und Einheiten (XXX Millionen)									
Quartal endet am (TT. Monat JJJJ)									
Anzahl der bei der Berechnung der Durchschnittswerte verwendeten Datenpunkte									
<b>HOCHWERTIGE LIQUIDE VERMÖGENSWERTE</b>									
1	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)	X							
<b>MITTELABFLÜSSE</b>									
2	Privatkundeneinlagen und Einlagen von kleinen Geschäftskunden, davon:								
3	<i>stabile Einlagen</i>								
4	<i>weniger stabile Einlagen</i>								
5	unbesicherte Großhandelsfinanzierung								

6	<i>betriebliche Einlagen (alle Gegenparteien) und Einlagen in Netzwerken von Genossenschaftsbanken</i>								
7	<i>nicht betriebliche Einlagen (alle Gegenparteien)</i>								
8	<i>unbesicherte Verbindlichkeiten</i>								
9	besicherte Großhandelsfinanzierung								
10	zusätzliche Anforderungen								
11	<i>Abflüsse im Zusammenhang mit Derivatepositionen und sonstigen Besicherungsanforderungen</i>								
12	<i>Abflüsse im Zusammenhang mit dem Verlust der Finanzierung auf Schuldtiteln</i>								
13	<i>Kredit- und Liquiditätsfazilitäten</i>								
14	sonstige vertragliche Finanzierungsverpflichtungen								
15	sonstige Eventualverbindlichkeiten								
16	<b>GESAMTMITTELABFLÜSSE</b>								
<b>MITTELZUFLÜSSE</b>									
17	Besicherte Kredite (z. B. Reverse Repos)								
18	Zuflüsse von ausgebuchten Positionen								
19	Sonstige Mittelzuflüsse								
EU-19a	(Differenz zwischen den gesamten gewichteten Zuflüssen und den gesamten gewichteten Abflüssen aus Transaktionen in Drittländern, in denen Transaktionsbeschränkungen bestehen oder die auf nicht konvertierbare Währungen lauten)								
EU-19b	(Überschusszuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut)								
20	<b>GESAMTMITTELZUFLÜSSE</b>								

EU-20a	<b>Vollständig ausgenommene Zuflüsse</b>								
EU-20b	<b>Zuflüsse, die einer Obergrenze von 90 % unterliegen</b>								
EU-20c	<b>Zuflüsse, die einer Obergrenze von 75 % unterliegen</b>								
BEREINIGTER GESAMTWERT									
21	<b>LIQUIDITÄTSPUFFER</b>								
22	<b>GESAMTE NETTOMITTELABFLÜSSE</b>								
23	<b>LIQUIDITÄTSDECKUNGSQU OTE (%)</b>								

**Vorlage zu qualitativen Informationen über die LCR, die die LCR-Offenlegungsvorlage ergänzt**

<p><b>Zweck:</b> Offenlegung weiterer Erläuterungen über die in der LCR-Offenlegungsvorlage enthaltenen Positionen</p>
<p><b>Anwendungsbereich:</b> Der Anwendungsbereich richtet sich nach den Vorgaben unter Nr. 3 des Rundschreibens</p>
<p><b>Inhalt:</b> Vor allem qualitative Diskussionen, die durch quantitative Informationen unterstützt werden könnten</p>
<p><b>Häufigkeit:</b> Mindestens einmal pro Jahr</p>
<p><b>Format:</b> Flexibel</p>

Konzentration von Finanzierungs- und Liquiditätsquellen	
Derivatepositionen und potenzielle Besicherungsaufforderungen	
Währungsinkongruenz in der Liquiditätsdeckungsquote	

Eine Beschreibung des Zentralisierungsgrads des Liquiditätsmanagements und der Interaktion zwischen den einzelnen Instituten der Gruppe	
Sonstige Positionen in der LCR-Berechnung, die nicht in der LCR-Offlegungsvorlage erfasst sind, aber die das Institut als für sein Liquiditätsprofil relevant betrachtet	