

DE
ANHANG I

MELDUNGEN ZUR MINDESTANFORDERUNG AN EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN

MREL- UND TLAC-MELDEBÖGEN			
Meldebogen- Nummer	Meldebogen- Code	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogen-Gruppe	Kurzbezeichnung
		BETRÄGE: MREL- UND TLAC-SCHLÜSSELPARAMETER	
1	M 01.00	MREL- und TLAC-Schlüsselparameter (Abwicklungsgruppen/-einheiten)	KM2
		Zusammensetzung und Fälligkeit	
2	M 02.00	MREL- und TLAC-Kapazität und -Zusammensetzung (Abwicklungsgruppen/-einheiten)	TLAC1
3	M 03.00	Interne MREL und interne TLAC	ILAC:
4	M 04.00	Finanzierungsstruktur der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten	LIAB-MREL
		RANGFOLGE DER GLÄUBIGER	
5	M 05.00	Rangfolge der Gläubiger (Unternehmen, das keine Abwicklungseinheit ist)	TLAC2
6	M 06.00	Rangfolge der Gläubiger (Abwicklungseinheit)	TLAC3
		VERTRAGSSPEZIFISCHE ANGABEN	
7	M 07.00	Instrumente, die Rechtsvorschriften von Drittländern unterliegen	MTCI

DE
ANHANG I

M 01.00 – MREL- und TLAC-Schlüsselparameter (Abwicklungsgruppen/-einheiten) (KM2)

		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)	Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten für G-SRI (TLAC)
		0010	0020
	Gesamtrisikobetrag und Gesamtrisikopositionsmessgröße		
0100	GESAMTRISIKOBETRAG (TREA)		
0110	GESAMTRISIKOPOSITIONSMESSGRÖßE (TEM)		
	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten		
0200	EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN		
0210	Davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten		
0220	Davon: dem Recht eines Drittlandes unterliegend		
0230	Davon: mit einer Herabschreibungs- und Umwandlungsklausel im Sinne von Artikel 55 der Richtlinie 2014/59/EU		
	Sonstige bail-in-fähige Verbindlichkeiten		
0250	SONSTIGE BAIL-IN-FÄHIGE VERBINDLICHKEITEN		
0260	Davon: dem Recht eines Drittlandes unterliegend		
0270	Davon: mit einer Herabschreibungs- und Umwandlungsklausel im Sinne von Artikel 55 der Richtlinie 2014/59/EU		
0280	Restlaufzeit < 1 Jahr		
0285	Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre		
0290	Restlaufzeit >= 2 Jahre		
	Verhältniszahlen und Ausnahmen von der Nachrangigkeit		
0300	EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN ALS PROZENTUALER ANTEIL AM TREA		
0310	Davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten		
0320	EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN ALS PROZENTUALER ANTEIL AN DER TEM		
0330	Davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten		
0340	Gilt die in Artikel 72b Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegte Ausnahme von der Nachrangigkeit? (5%-Ausnahme)		
0350	Aggregierte Beträge der zulässigen nicht nachrangigen Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, wenn der in Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegte Ermessensspielraum für die Rangfolge angewendet wird (max. 3,5 % Ausnahme)		
0360	Anteil der gesamten nicht nachrangigen Verbindlichkeiten, der in den Eigenmitteln und berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten enthalten ist		

DE
ANHANG I

M 02.00 – MREL- und TLAC-Kapazität und -Zusammensetzung (Abwicklungsgruppen/-einheiten) (TLAC1)				
		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)	G-SRI-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (TLAC)	Zusatzinformation: Beträge, die für die Zwecke der MREL, aber nicht der TLAC berücksichtigungsfähig sind
		0010	0020	0030
0010	EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN			
0020	(Berücksichtigungsfähige) Eigenmittel			
0030	Hartes Kernkapital			
0040	(Berücksichtigungsfähiges) Zusätzliches Kernkapital			
0050	(Berücksichtigungsfähiges) Ergänzungskapital			
0060	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten			
0070	Posten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten vor Anpassungen			
0080	davon: berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die als strukturell nachrangig gelten			
0090	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nachrangig zu ausgenommenen Verbindlichkeiten sind			
0100	Direkt von der Abwicklungseinheit begebene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten (nicht bestandsgeschützt)			
0110	Von anderen Unternehmen der Abwicklungsgruppe begebene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten (nicht bestandsgeschützt)			
0120	Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die vor dem 27. Juni 2019 begeben wurden			
0130	Ergänzungskapitalinstrumente mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr, in dem Umfang, in dem sie nicht als Ergänzungskapitalposten gelten			
0132	(-) Eigene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die gegenüber ausgenommenen Verbindlichkeiten nachrangig sind			
0135	(-) davon: ungenutzte Beträge im Rahmen einer vorherigen Erlaubnis			
0140	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nicht nachrangig zu ausgenommenen Verbindlichkeiten sind			
0150	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nicht nachrangig zu ausgenommenen Verbindlichkeiten sind (nicht bestandsgeschützt, vor Anwendung der Obergrenze)			
0160	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, die nicht nachrangig zu den vor dem 27. Juni 2019 begebenen ausgenommenen Verbindlichkeiten sind (vor Anwendung der Obergrenze)			
0162	(-) Eigene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die gegenüber ausgenommenen Verbindlichkeiten nicht nachrangig sind			
0165	(-) davon: ungenutzte Beträge im Rahmen einer vorherigen Erlaubnis			
0170	Berücksichtigungsfähige Beträge nach Anwendung der Obergrenze gemäß Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (nicht bestandsgeschützt)			
0180	Berücksichtigungsfähige Beträge nach Anwendung der Obergrenze gemäß Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, bestehend aus Posten, die vor dem 27. Juni 2019 begeben wurden			
0190	(-) Abzüge			
0200	(-) Positionen zwischen Multiple-Point-of-Entry- (MPE-)Abwicklungsgruppen			
0211	(-) Investitionen in andere Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten			
0220	Von den berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten in Abzug zu bringende Posten, die die berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten überschreiten (abgezogen vom Ergänzungskapital)			
ZUSATZINFORMATIONEN				
0400	Verfügbares hartes Kernkapital (CET1; in %) nach Erfüllung der Anforderungen des Unternehmens			
0410	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (in %)			
0420	davon: Kapitalerhaltungspuffer			
0430	davon: antizyklischer Kapitalpuffer			
0440	davon: Systemrisikopuffer			
0450	davon: Puffer für global systemrelevante Institute (G-SRI) oder andere systemrelevante Institute (A-SRI)			
0460	Investitionen in nachrangigen berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten anderer Institute			
0470	Investitionen in nachrangigen berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten von G-SRI			
0480	Investitionen in nachrangigen berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten von A-SRI			
0490	Investitionen in nachrangigen berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten anderer Institute			
0500	Ausgenommene Verbindlichkeiten			

DE
ANHANG I

M 03.00 – Interne MREL und interne TLAC (ILAC)

		Interne MREL	Interne TLAC
		0010	0020
0010	Anwendungsebene		
	Gesamtrisikobetrag und Gesamtrisikopositionsmessgröße		
0100	Gesamtrisikobetrag (TREA)		
0110	Gesamtrisikopositionsmessgröße (TEM)		
	Berücksichtigungsfähige Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten		
0200	Berücksichtigungsfähige Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten		
0210	Berücksichtigungsfähige Eigenmittel		
0220	Hartes Kernkapital (CET1)		
0230	Berücksichtigungsfähiges zusätzliches Kernkapital		
0240	Berücksichtigungsfähiges Ergänzungskapital		
0250	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten und Sicherheiten		
0260	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (ausgenommen Garantien)		
0265	(-) Eigene Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten: Ungenutzte Beträge im Rahmen einer vorherigen Erlaubnis		
0270	Von der Abwicklungseinheit gestellte und von der Abwicklungsbehörde gewährte Garantien		
0280	Zusatzinformation: Besicherter Teil der Garantie		
0290	(-) Eigenmittelinstrumente und Instrumente berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten, die von Nicht-Abwicklungseinheiten derselben Abwicklungsgruppe begeben wurden		
0293	(-) davon: Von Liquidationseinheiten begebene Eigenmittelinstrumente		
0295	Von den berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten in Abzug zu bringende Posten, die die berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten überschreiten		
	Verhältnisswerte der berücksichtigungsfähigen Eigenmittel und berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten		
0400	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil am TREA		
0410	davon: gewährte Garantien		
0420	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil an der TEM		
0430	davon: gewährte Garantien		
0440	Verfügbares hartes Kernkapital (CET1; in %) nach Erfüllung der Anforderungen des Unternehmens		
	Zusatzinformationen		
0500	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (in %)		
0510	davon: Kapitalerhaltungspuffer		
0520	davon: antizyklischer Kapitalpuffer		
0530	davon: Systemrisikopuffer		
0540	davon: Puffer für global systemrelevante Institute (G-SRI) oder andere systemrelevante Institute (A-SRI)		
0550	Sonstige bail-in-fähige Verbindlichkeiten		
0560	davon: dem Recht eines Drittlandes unterliegend		
0570	davon: mit einer Herabschreibungs- und Umwandlungsklausel im Sinne von Artikel 55 der Richtlinie 2014/59/EU		
0580	Restlaufzeit < 1 Jahr		
0590	Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre		
0600	Restlaufzeit >= 2 Jahre		
0610	Ausgenommene Verbindlichkeiten		
0620	(-) Eigenmittelinstrumente, die von Liquidationseinheiten derselben Abwicklungsgruppe begeben wurden		
0630	Verhältnis der Positionen in Eigenmittelinstrumenten, die von Liquidationseinheiten begeben wurden, zu den berücksichtigungsfähigen Eigenmitteln und berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten		

DE
ANHANG I

M 04.00 - Finanzierungsstruktur der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten (LIAB MREL)		
		Berücksichtigungs- fähiger Betrag für MREL/interne MREL
		0010
0100	BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN	
0200	Nicht gedeckte nicht vorrangige Einlagen >= 1 Jahr	
0210	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0220	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0230	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0300	Besicherte Verbindlichkeiten, für die keine Sicherheit gestellt wurde >= 1 Jahr	
0310	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0320	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0330	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0400	Strukturierte Schuldtitel >= 1 Jahr	
0410	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0420	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0430	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0500	Vorrangige unbesicherte Verbindlichkeiten >= 1 Jahr	
0510	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0520	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0530	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0600	Vorrangige nicht bevorrechtigte Verbindlichkeiten >= 1 Jahr	
0610	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0620	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0630	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0700	Nicht zu den Eigenmitteln gehörende nachrangige Verbindlichkeiten >= 1 Jahr	
0710	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0720	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0730	davon: von Tochterunternehmen begeben	
0800	Sonstige für die MREL berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten >= 1 Jahr	
0810	davon: Restlaufzeit >= 1 Jahr < 2 Jahre	
0820	davon: Restlaufzeit >= 2 Jahre	
0830	davon: von Tochterunternehmen begeben	

DE
ANHANG I

M 05.00 – Rangfolge der Gläubiger (Unternehmen, das keine Abwicklungseinheit ist) (TLAC2)

Rang in der Insolvenz	Art des Gläubigers	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz	Verbindlichkeiten und Eigenmittel		Verbindlichkeiten und Eigenmittel (abzüglich ausgenommene Verbindlichkeiten)						
			davon: ausgenommene Verbindlichkeiten	davon: Eigenmittel und berücksichtigungs-fähige Verbindlichkeiten im Sinne der internen MREL							
				davon: mit einer Restlaufzeit von				davon: Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit			
				≥ 1 Jahr < 2 Jahre	≥ 2 Jahre < 5 Jahre	≥ 5 Jahre < 10 Jahre	≥ 10 Jahre				
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120

DE
ANHANG I

M 06.00 – Rangfolge der Gläubiger (Abwicklungseinheiten) (TLAC3)

Rang in der Insolvenz	Beschreibung des Rangs in der Insolvenz	Verbindlichkeiten und Eigenmittel		Verbindlichkeiten und Eigenmittel (abzüglich ausgenommene Verbindlichkeiten)						
			davon: ausgenommene Verbindlichkeiten		davon: Eigenmittel und berücksichtigungs- fähige					
					Verbindlichkeiten, die potenziell für die Erfüllung der MREL anrechenbar sind	davon: mit einer Restlaufzeit von				davon: Wertpapiere ohne bestimmte Fälligkeit
						≥ 1 Jahr < 2 Jahre	≥ 2 Jahre < 5 Jahre	≥ 5 Jahre < 10 Jahre	≥ 10 Jahre	
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110

M 07.00 – Instrumente, die dem Recht eines Drittlands unterliegen (MTCI)

Emittierendes Unternehmen			Vertrags- kennung	Anwendbares Recht (Drittland)	Vertragliche Anerkennung von Herabschreibungs- und Umwandlungsbefugnissen	Aufsichtsrechtliche Behandlung		Betrag	Rang in regulären Insolvenzverfahren		Laufzeit	(Erster) Kündigungs- termin	Kündigungs-rechte aufgrund von Änderungen rechtlicher Rahmen- bedingungen (Regulatory Call) (J/N)
Bezeichnung	Code	Art des Codes				Art der Eigenmittel oder berücksichtigungs- fähigen Verbindlichkeiten	Art des Instruments		Anwend- bares Recht	Rang in der Insolvenz			
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140