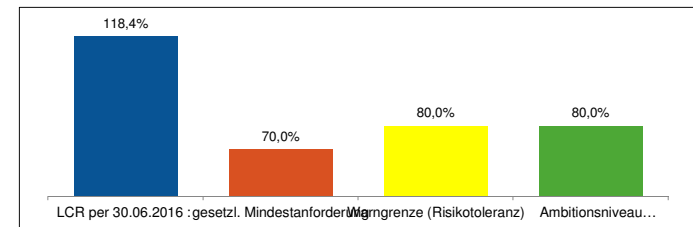


1. LCR per 30.06.2016

Grenzwerte	gesetzl. Mindestanforderung	Wargrenze (Risikotoleranz)	Ambitionsniveau (Frühwarnindikator)
Liquidity Coverage Ratio (LCR)	70,0%	80,0%	80,0%

LCR per 30.06.2016 :	(Gewichtete) Liquide Aktiva: 60.502	=	118,4%
	[Summe Abflüsse: 74.187 - Summe Zuflüsse: 23.077]		

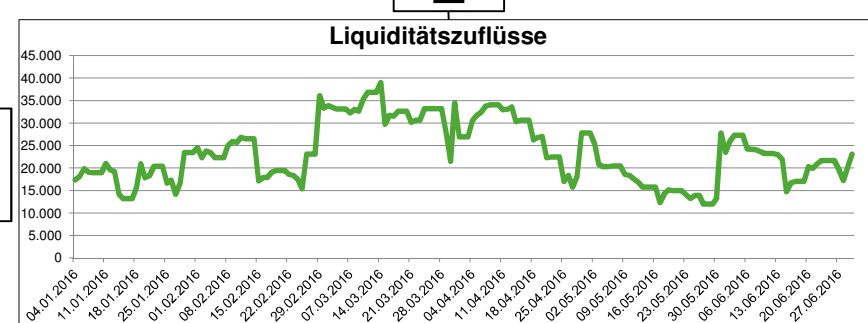
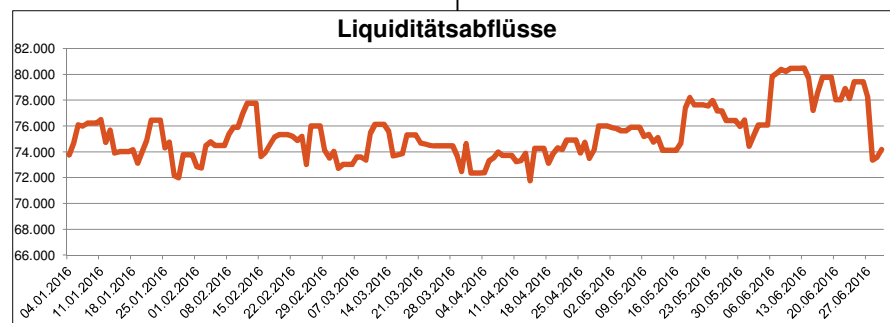
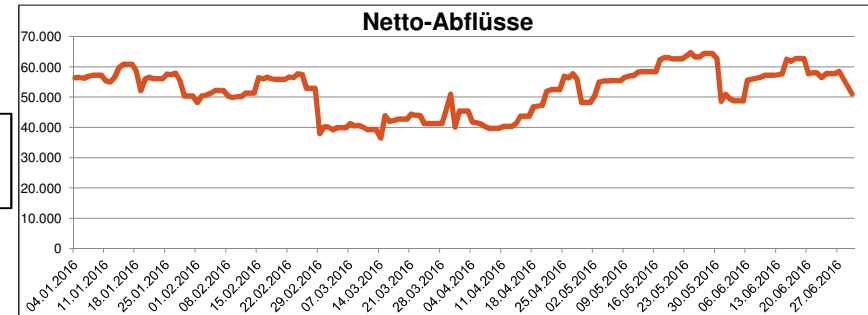
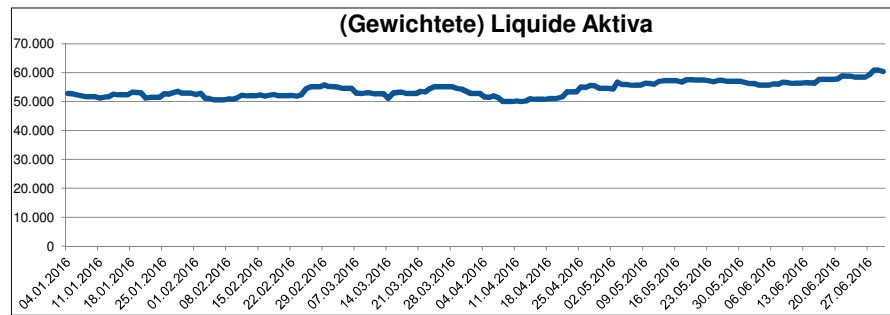
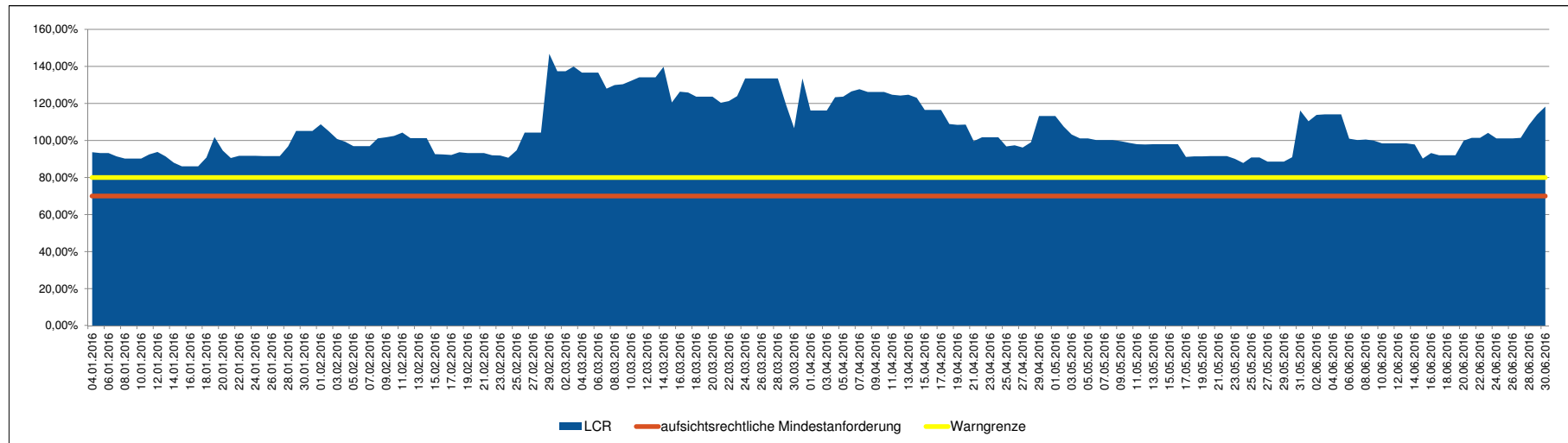


2. Entwicklungsdaten per 30.06.2016

2.1. LCR-Entwicklung der letzten 180 Tage (~ 6 Monate): Kennzahlen und Treiber

Berichtsgröße (Werte soweit nicht anders angegeben in TEUR)	30.06.16	31.05.16	30.04.16	31.03.16	29.02.16	31.01.16	Min. LCR per: 15.01.2016	Max. LCR per: 29.02.2016	Mittelwert letzte 180 Tg.	Standardabw. letzte 180 Tg.	Standardabw. Mittelwert letzte 180 Tg.
<b>LCR</b>	118,4%	116,2%	113,3%	133,5%	146,8%	105,2%	86,1%	146,8%	106,3%	15,0%	14,2%
<b>(Gewichtete) Liquide Aktiva</b> (unter Berücksichtigung der Kappung) / "davon" (nicht abschließend):	60.502	56.553	54.642	53.626	55.814	52.952	52.397	55.814	54.194	2.531	4,7%
Barmittel und Einlagen ZB	15.862	14.544	13.600	12.536	16.322	19.650	19.234	16.322	15.206	2.489	16,4%
anrechenbare Wertpapiere	44.639	42.008	41.042	41.090	39.492	33.302	33.163	39.492	38.988	42	0,1%
<b>Summe Abflüsse</b> "davon" (nicht abschließend):	74.187	76.461	76.010	74.629	74.128	73.761	74.024	74.128	51.989	7.505	14,4%
Abflüsse aus Einlagen von Retailkunden	58.180	60.128	58.763	58.597	58.734	56.689	54.405	58.734	57.136	1.334	2,3%
Abflüsse aus unbesicherter Refinanzierung (mit Großkunden)	46.793	48.746	50.213	46.315	46.474	46.242	47.357	46.474	48.870	3.686	7,5%
Sonstige Abflüsse inkl. Tagesgeldaufnahme	10	10	0	0	0	2.072	3.829	0	1.108	1.791	161,7%
Abflüsse Kredit- und Liquiditätsfazilitäten	5.844	5.341	4.576	6.576	5.532	5.188	4.994	5.532	5.510	745	13,5%
<b>Summe Zuflüsse:</b> "davon" (nicht abschließend):	23.077	27.791	27.777	34.473	36.118	23.430	13.196	36.118	23.401	6.731	28,8%
Fällige Zahlungen von Kunden	5.453	10.907	4.467	5.765	11.843	1.924	4.813	11.843	6.755	3.126	46,3%
Fällige Zahlungen Finanzkunden	13.692	13.977	18.781	24.751	21.860	20.859	8.382	21.860	14.142	4.950	35,0%
Zuflüsse Aktiva mit unbest. Vertragslaufzeit	804	876	625	740	858	647	0	858	469	264	56,2%
Zuflüsse liquider Aktiva	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Andere Zuflüsse	3.127	2.031	3.903	3.216	1.557	0	2	1.557	2.034	2.761	135,8%

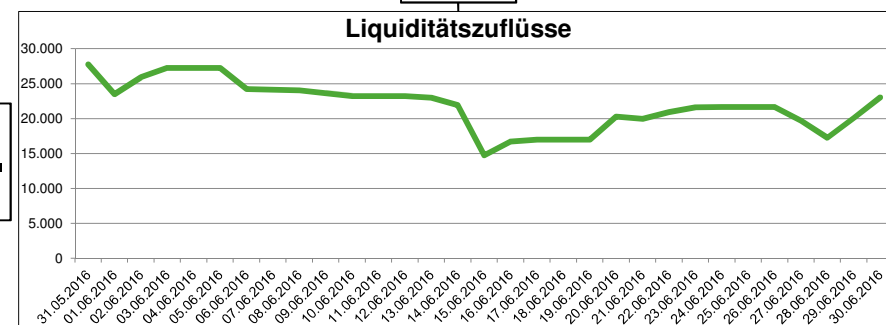
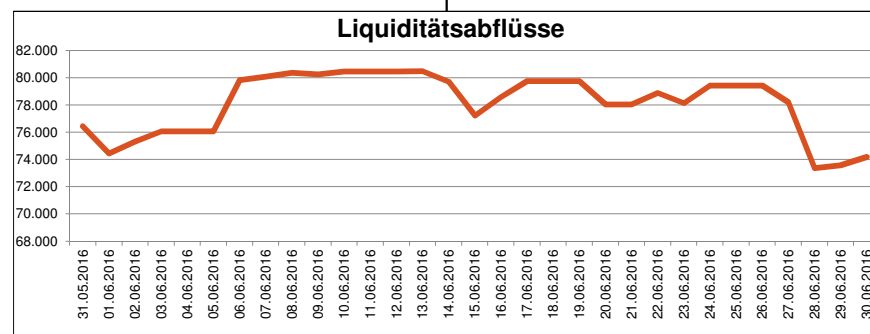
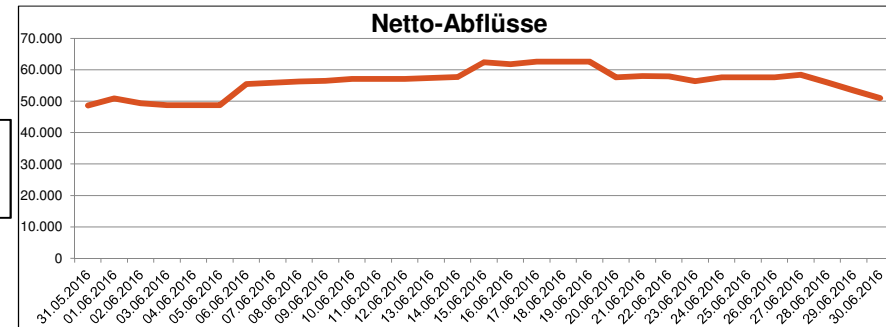
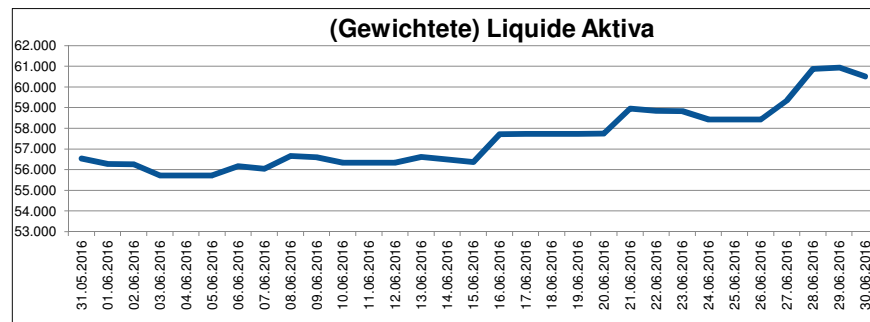
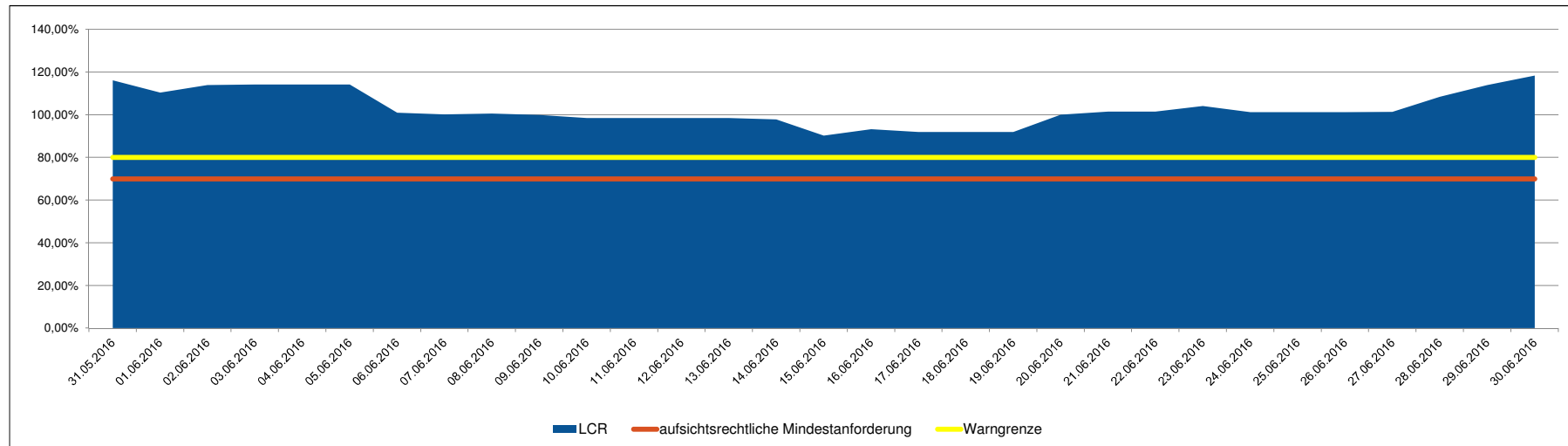
2.2. LCR-Entwicklung der letzten 180 Tage (~ 6 Monate): Grafische Analyse



2.3. LCR-Entwicklung des letzten Monats: Kennzahlen und Treiber

Berichtsgröße (Werte soweit nicht anders angegeben in TEUR)	30.06.16	24.06.16	18.06.16	12.06.16	06.06.16	31.05.16	Min. LCR per: 15.06.2016	Max. LCR per: 30.06.2016	Mittelwert letzter Monat	Standardabw. letzter Monat	Standardabw. Mittelwert letzter Monat
<b>LCR</b>	<b>118,4%</b>	<b>101,2%</b>	<b>92,0%</b>	<b>98,5%</b>	<b>101,0%</b>	<b>116,2%</b>	<b>90,2%</b>	<b>118,4%</b>	<b>102,9%</b>	<b>7,9%</b>	<b>7,7%</b>
<b>(Gewichtete) Liquide Aktiva</b> (unter Berücksichtigung der Kappung) / "davon" (nicht abschließend):	<b>60.502</b>	<b>58.427</b>	<b>57.739</b>	<b>56.349</b>	<b>56.169</b>	<b>56.553</b>	<b>56.371</b>	<b>60.502</b>	<b>57.504</b>	<b>1.527</b>	<b>2,7%</b>
Barmittel und Einlagen ZB	15.862	15.438	15.817	14.438	14.279	14.544	14.464	15.862	15.080	798	5,3%
anrechenbare Wertpapiere	44.639	42.989	41.922	41.911	41.890	42.008	41.907	44.639	42.424	729	1,7%
<b>Summe Abflüsse</b> "davon" (nicht abschließend):	<b>74.187</b>	<b>79.423</b>	<b>79.771</b>	<b>80.475</b>	<b>79.843</b>	<b>76.461</b>	<b>77.228</b>	<b>74.187</b>	<b>56.191</b>	<b>4.313</b>	<b>7,7%</b>
Abflüsse aus Einlagen von Retailkunden	58.180	55.404	55.483	55.854	56.623	60.128	54.777	58.180	56.677	1.833	3,2%
Abflüsse aus unbesicherter Refinanzierung (mit Großkunden)	46.793	57.163	57.947	58.483	56.871	48.746	54.875	46.793	54.260	4.629	8,5%
Sonstige Abflüsse inkl. Tagesgeldaufnahme	10	0	0	10	10	10	0	10	7	7	96,3%
Abflüsse Kredit- und Liquiditätsfazilitäten	5.844	6.083	5.740	5.874	5.772	5.341	5.719	5.844	5.798	240	4,1%
<b>Summe Zuflüsse:</b> "davon" (nicht abschließend):	<b>23.077</b>	<b>21.691</b>	<b>17.027</b>	<b>23.260</b>	<b>24.255</b>	<b>27.791</b>	<b>14.742</b>	<b>23.077</b>	<b>21.954</b>	<b>3.430</b>	<b>15,6%</b>
Fällige Zahlungen von Kunden	5.453	9.694	9.959	10.643	10.725	10.907	10.601	5.453	10.125	986	9,7%
Fällige Zahlungen Finanzkunden	13.692	8.469	5.506	11.054	11.968	13.977	2.579	13.692	9.220	3.416	37,0%
Zuflüsse Aktiva mit unbest. Vertragslaufzeit	804	400	0	0	0	876	0	804	275	361	131,5%
Zuflüsse liquider Aktiva	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Andere Zuflüsse	3.127	3.129	1.562	1.562	1.562	2.031	1.562	3.127	2.335	1.126	48,2%

2.4. LCR-Entwicklung des letzten Monats: Grafische Analyse

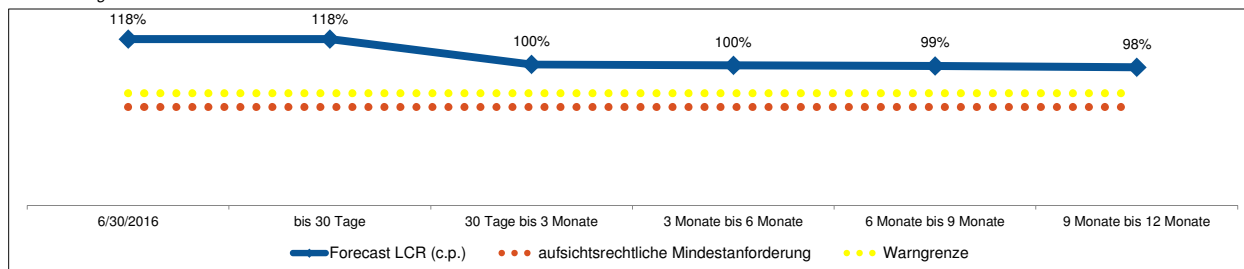




5. Forecast: Fälligkeiten liquider Aktiva und Auswirkungen auf LCR

Fälligkeiten	Level 1 - Aktiva	davon: Level 1 - ohne Covered Bonds	davon: Level 1 - Covered Bonds	Level 2A - Aktiva	Level 2B - Aktiva	Daraus resultierende neue LCR-Kennziffer (c.p.)*
<b>HQLA (anrechenbar) per 30.06.2016</b>	<b>48.727</b>	<b>34.498</b>	<b>14.230</b>	<b>3.911</b>	<b>7.863</b>	<b>118,4%</b>
Fällige HQLA bis 30 Tage	0	0	0	0	0	118,4%
Fällige HQLA größer 30 Tage bis 3 Monate	9.003	9.003	0	0	0	100,4%
Fällige HQLA größer 3 Monate bis 6 Monate	0	0	0	0	502	99,8%
Fällige HQLA größer 6 Monate bis 9 Monate	0	0	0	0	256	99,3%
Fällige HQLA größer 9 Monate bis 12 Monate	472	0	472	0	0	98,4%
<b>Summe fälliger HQLA bis 30.06.2017</b>	<b>9.475</b>	<b>9.003</b>	<b>472</b>	<b>0</b>	<b>757</b>	<b>Δ kumuliert: -20,0%</b>

\*Hinweis: Die Simulation der aus den Fälligkeiten der HQLA resultierenden LCR erfolgt unter der Annahme ansonsten konstanter Positionen (c.p.=ceteris paribus), insbesondere sind hier keine Auswirkungen fälliger HQLA bzw. sonstiger Wertpapiere auf Zuflüsse/Abflüsse mit berücksichtigt. Darüber hinaus wurde eine kumulative Wirkung der Fälligkeiten auf die hochgerechnete LCR unterstellt.

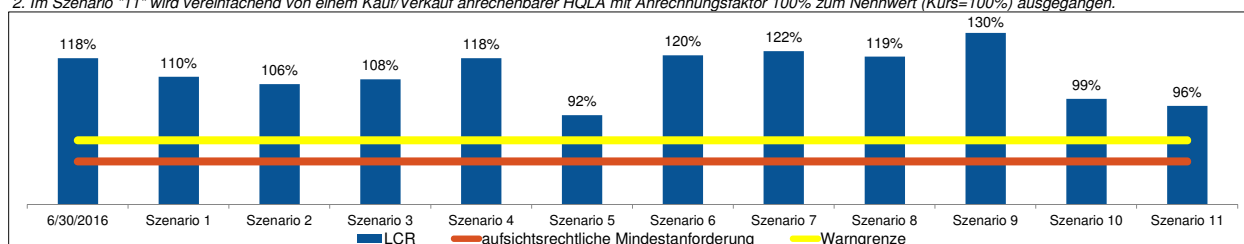


6. Szenarien und Auswirkungen auf LCR

Variation der Ausgangswerte ("Szenarien")	Szenariofaktor (individuell abgeleitet)	(Gewichtete) Liquide Aktiva (Δ bei Szenarien)	Abflüsse (Δ bei Szenarien)	Zuflüsse (Δ bei Szenarien)	Daraus resultierende neue LCR-Kennziffer (c.p.*1)	Δ LCR in %-Pkt.
<b>Ausgangswerte per 30.06.2016</b>	---	<b>60.502</b>	<b>74.187</b>	<b>23.077</b>	<b>118,4%</b>	---
1. Kursverfall anrechenbarer HQLA (hier: nur WP, ohne Barmittel bzw. ZB-Guth.) um 10%	10%	-4.464	---	---	109,6%	-8,7%
2. Erhöhung der Abflüsse aus Einlagen von Retailkunden um 10%	10%	---	5.818	---	106,3%	-12,1%
3. Erhöhung der Abflüsse aus unbesicherter Refinanzierung (mit Großkunden) um 10%	10%	---	4.679	---	108,4%	-9,9%
4. Erhöhung der Sonstige Abflüsse inkl. Tagesgeldaufnahme um 10%	10%	---	1	---	118,4%	0,0%
5. Generelle Erhöhung aller Abflüsse um 20%	20%	---	14.837	---	91,7%	-26,6%
6. Erhöhung der fälligen Zahlungen von Kunden (Zuflüsse) um 10%	10%	---	---	545	119,7%	1,3%
7. Erhöhung der fälligen Zahlungen von Finanzkunden (Zuflüsse) um 10%	10%	---	---	1.369	121,6%	3,3%
8. Erhöhung der anderen Zuflüsse um 10%	10%	---	---	313	119,1%	0,7%
9. Generelle Erhöhung aller Zuflüsse um 20%	20%	---	---	4.615	130,1%	11,8%
10. Generelle Erhöhung aller Abflüsse und Absinken aller Zuflüsse um 10%	10%	---	7.419	-2.308	99,4%	-18,9%
11. Kauf/Verkauf anrechenbarer HQLA i.H.v. - 15.000 TEUR zu Lasten ZB-Guth.*2	-15.000	-15.000	---	3.750	96,1%	-22,3%

Hinweise:

- Die Simulation der aus den Szenarien resultierenden LCR erfolgt unter der Annahme ansonsten konstanter Positionen (c.p.=ceteris paribus).
- Im Szenario "11" wird vereinfachend von einem Kauf/Verkauf anrechenbarer HQLA mit Anrechnungsfaktor 100% zum Nennwert (Kurs=100%) ausgegangen.



# VRB Muster eG - LCR-Reporting

## Anhang I: LCR-GENO-SAVE-Übersicht auf Basis Liste W7442 (neue Version)

Bestände per: 30.06.2016

Aktiva-Level	Zeile LCR	Tageswert (clean)	Zins-abgrenzung	Tageswert (dirty)	Anrechnung	LCR-Wert	Fälligkeit bis 12 Monate				
							bis 30 Tage	größer 30 Tage	größer 3 Monate	größer 6 Monate	größer 9 Monate
1	0060	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
1	0070	2.670	15	2.685	100%	2.670	0	0	0	0	0
1	0080	2.718	0	2.718	100%	2.718	0	0	0	0	0
1	0090	6.667	0	6.668	100%	6.667	0	9.000	0	0	0
1	0100	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
1	0110	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
1	0120	170	0	170	100%	170	0	0	0	0	0
1	0130	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
1	0140	0	0	0	95%	0	0	0	0	0	0
1	0150	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
1	0170	0	0	0	80%	0	0	0	0	0	0
1	0190	11.015	43	11.058	93%	10.244	0	0	0	0	500
1	0200	0	0	0	88%	0	0	0	0	0	0
2A	0240	0	0	0	85%	0	0	0	0	0	0
2A	0250	0	0	0	85%	0	0	0	0	0	0
2A	0260	1.332	0	1.332	85%	1.132	0	0	0	0	0
2A	0270	1.773	0	1.773	85%	1.507	0	0	0	0	0
2A	0280	0	0	0	85%	0	0	0	0	0	0
2A	0290	0	0	0	80%	0	0	0	0	0	0
2B	0320	0	0	0	75%	0	0	0	0	0	0
2B	0330	0	0	0	75%	0	0	0	0	0	0
2B	0340	0	0	0	70%	0	0	0	0	0	0
2B	0350	0	0	0	65%	0	0	0	0	0	0
2B	0360	10.611	58	10.669	50%	5.306	0	0	1.000	500	0
2B	0370	0	0	0	50%	0	0	0	0	0	0
2B	0380	0	0	0	50%	0	0	0	0	0	0
2B	0390	0	0	0	50%	0	0	0	0	0	0
2B	0400	0	0	0	100%	0	0	0	0	0	0
2B	0410	0	0	0	70%	0	0	0	0	0	0
2B	0420	0	0	0	65%	0	0	0	0	0	0
2B	0430	0	0	0	60%	0	0	0	0	0	0
2B	0440	0	0	0	45%	0	0	0	0	0	0
2B	0450	0	0	0	75%	0	0	0	0	0	0
2B	0460	0	0	0	75%	0	0	0	0	0	0
		36.955	117	37.073	82%	30.413	0	9.000	1.000	500	500
<b>ohne LCR Anrechnung</b>	<b>XXXX</b>	<b>123.676</b>	<b>506</b>	<b>124.182</b>	<b>0%</b>	<b>0</b>	<b>5.000</b>	<b>2.000</b>	<b>4.029</b>	<b>14.000</b>	<b>4.145</b>
<b>Summe</b>		<b>160.632</b>	<b>623</b>	<b>161.255</b>	<b>19%</b>	<b>30.413</b>	<b>5.000</b>	<b>11.000</b>	<b>5.029</b>	<b>14.500</b>	<b>4.645</b>

Anhang II: LCR-GENO-SAVE-Detail auf Basis Liste W7442 (neue Version)

30.06.2016

Nr.	Level	Zeile	ISIN	WKN	Bezeichnung	Fonds-WKN	VA	Tilgung	Nennwert	Buchwert	Tageswert (clean)	Zins-abgrenzung	Tageswert (dirty)	Fälligkeiten bis 12 Monte	Betrag	Zinszahlung < 30 Tage
1	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 1	0	200	29.01.2018	1.000.000	1.000.000	673.806	4.497	678.303			
2	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 2	0	200	30.09.2021	15.495	1.442.585	1.014.256		1.014.256			
3	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 3	0	200		3.875	674.874	408.737		408.737			
4	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 4	0	200		4.200	687.102	442.320		442.320			
5	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 5	0	200		6.224	311.200	208.881		208.881			
6	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 6	0	200	11.09.2017	1.000.000	1.009.250	681.294	12.030	693.325			
7	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 7	0	200	27.05.2024	2.000.000	1.999.200	1.332.969	957	1.333.926			
8	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 8	0	200	27.04.2020	2.500.000	2.524.555	1.694.699	3.385	1.698.084			
9	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 9	0	200	15.04.2019	1.000.000	994.770	653.558	429	653.986			7
10	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 10	0	200	10.09.2021	2.000.000	1.966.400	1.276.018	300	1.276.318			
11	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 11	0	100	23.12.2021	1.000.000	1.009.400	676.735	5.558	682.292			
12	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 12	0	100	23.12.2020	1.000.000	1.000.000	696.237	5.488	701.726			
13	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 13	0	100	23.12.2020	2.000.000	2.002.000	1.335.365	4.064	1.339.428			
14	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 14	0	100	23.06.2021	2.000.000	2.000.000	1.336.297	1.674	1.337.970			
15	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 15	0	100	25.02.2020	834.669	834.669	555.572		555.572			
16	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 16	0	100	23.03.2017	2.500.000	2.500.000	1.679.024	1.109	1.680.133	größer 6 Monate	2.500.000	
17	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 17	0	100	23.06.2017	2.000.000	1.998.400	1.358.661	715	1.359.376	größer 9 Monate	2.000.000	
18	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 18	0	100	23.06.2017	2.000.000	2.000.000	1.361.058	738	1.361.796	größer 9 Monate	2.000.000	
19	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 19	0	100	23.03.2018	2.000.000	1.998.200	1.375.834	8.826	1.384.661			
20	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 20	0	100	25.06.2019	4.000.000	3.928.000	2.715.459	941	2.716.400			
21	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 21	0	100	24.06.2020	3.000.000	3.001.500	2.058.560	718	2.059.278			
22	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 22	0	100	24.03.2021	1.000.000	1.000.000	677.068	3.972	681.039			
23	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 23	0	100	25.03.2020	2.000.000	2.001.000	1.347.213	7.292	1.354.504			
24	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 24	0	100	27.12.2017	1.000.000	997.200	664.554	4.523	669.077			
25	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 25	0	100	25.03.2020	2.000.000	1.972.200	1.311.669	4.146	1.315.815			
26	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 26	0	100	23.12.2016	1.000.000	1.000.000	669.280	212	669.492	größer 3 Monate	1.000.000	
27	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 27	0	100	23.03.2018	2.500.000	2.496.250	1.711.806	9.483	1.721.288			
28	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 28	0	200	18.08.2016	2.000.000	2.000.000	1.331.943	1.140	1.333.083	größer 30 Tage	2.000.000	
29	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 29	0	200	08.09.2017	2.000.000	2.003.000	1.334.566	287	1.334.853			
30	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 30	0	200	18.01.2017	3.000.000	2.995.950	1.997.855		1.997.855	größer 6 Monate	3.000.000	
31	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 31	0	200	02.02.2018	2.000.000	2.000.000	1.337.228	994	1.338.222			
32	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 32	0	200	02.12.2024	608.000	608.000	526.712	15.237	541.949			
33	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 33	0	200	11.09.2024	5.000.000	4.985.000	3.333.087	33.417	3.366.504			
34	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 34	0	200	20.12.2021	1.050.000	1.036.665	711.061	8.520	719.581			
35	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 35	0	200	20.01.2025	5.000.000	4.922.500	3.324.767	12.969	3.337.736			
36	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 36	0	200	07.04.2021	5.000.000	4.993.500	3.358.048	1.938	3.359.985			
37	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 37	0	200	15.12.2021	5.000.000	5.002.500	3.373.024	2.421	3.375.445			
38	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 38	0	200		18.000	964.620	705.090		705.090			
39	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 39	0	200		17.000	955.060	649.850		649.850			
40	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 40	0	200		89.810	2.070.121	1.493.285		1.493.285	größer 9 Monate	89.810	
41	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 41	0	200		54.890	1.097.800	871.745		871.745	größer 9 Monate	54.890	
42	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 42	0	200		9.470	865.747	568.316		568.316			
43	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 43	0	200		12.785	696.527	469.749		469.749			
44	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 44	0	200		64.234	3.146.181	2.118.956		2.118.956			
45	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 45	0	200	28.05.2018	2.000.000	1.998.800	1.341.222	476	1.341.698			
46	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 46	0	200		20.000	311	207		207			
47	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 47	0	200		11.075	635.695	385.247		385.247			
48	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 48	0	200	30.12.2016	28.880	2.717.319	1.735.459		1.735.459	größer 3 Monate	28.880	
49	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 49	0	200	29.12.2017	18.310	1.718.943	1.151.108		1.151.108			
50	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 50	0	200	28.12.2018	40.000	3.721.600	2.523.495		2.523.495			
51	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 51	0	200	02.05.2018	2.000.000	1.995.640	1.367.980	3.830	1.371.810			
52	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 52	0	200		2.300	100.507	64.146		64.146			
53	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 53	0	200	30.12.2022	20.800	1.977.872	1.393.763		1.393.763			
54	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 54	0	200	01.02.2017	2.000.000	2.000.000	1.348.544	5.547	1.354.091	größer 6 Monate	2.000.000	
55	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 55	0	200	10.01.2017	3.000.000	2.990.760	2.021.219	21.237	2.042.456	größer 6 Monate	3.000.000	
56	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 56	0	200	21.12.2016	2.000.000	1.998.860	1.351.073	21.060	1.372.133	größer 3 Monate	2.000.000	
57	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 57	0	200	27.03.2017	1.000.000	999.044	682.446	6.127	688.573	größer 6 Monate	1.000.000	
58	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 58	0	200	02.03.2017	2.500.000	2.500.000	1.685.181	2.949	1.688.130	größer 6 Monate	2.500.000	
59	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 59	0	200	12.07.2016	3.000.000	2.997.900	1.995.459	2.006	1.997.465	bis 30 Tage	3.000.000	42.463
60	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 60	0	200	20.07.2018	3.000.000	3.009.000	2.049.574	7.987	2.057.561			42.384
61	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 61	0	200	20.07.2016	2.000.000	1.996.600	1.332.436	25.243	1.357.679	bis 30 Tage	2.000.000	



Anhang II: LCR-GENO-SAVE-Detail auf Basis Liste W7442 (neue Version)

30.06.2016

Nr.	Level	Zeile	ISIN	WKN	Bezeichnung	Fonds-WKN	VA	Tilgung	Nennwert	Buchwert	Tageswert (clean)	Zins-abgrenzung	Tageswert (dirty)	Fälligkeiten bis 12 Monte	Betrag	Zinszahlung < 30 Tage
62	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 62	0	200	27.12.2018	1.000.000	999.340	708.551	8.672	717.224			
63	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 63	0	200	28.02.2018	600.000	598.728	414.675	3.214	417.889			
64	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 64	0	200	20.09.2017	2.000.000	1.999.400	1.333.900	1.769	1.335.669			
65	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 65	0	200	06.11.2017	1.000.000	1.000.000	680.462	2.174	682.637			
66	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 66	0	200	14.05.2018	2.000.000	1.998.440	1.373.771	3.501	1.377.272			
67	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 67	0	200	12.12.2018	1.000.000	997.000	696.970	7.347	704.317			
68	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 68	0	200	15.03.2018	1.400.000	1.398.782	958.332	4.481	962.812			
69	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 69	0	200	23.01.2018	1.500.000	1.494.750	1.018.197	7.638	1.025.836			
70	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 70	0	200	23.01.2018	3.000.000	2.989.830	2.053.108	17.459	2.070.567			
71	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 71	0	200	30.01.2018	2.000.000	2.000.000	1.366.649	10.240	1.376.888			
72	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 72	0	200	31.01.2018	3.000.000	2.984.010	2.062.354	20.732	2.083.086			
73	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 73	0	200	21.02.2018	3.000.000	3.009.792	2.056.563	15.188	2.071.751			
74	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 74	0	200	23.04.2018	3.000.000	2.981.400	2.001.849	6.134	2.007.983			
75	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 75	0	200	27.02.2019	1.000.000	995.900	694.374	4.831	699.204			
76	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 76	0	200	06.09.2018	2.000.000	2.020.400	1.374.503	19.032	1.393.535			
77	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 77	0	200	10.09.2018	1.000.000	997.280	695.885	11.401	707.285			
78	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 78	0	200	17.10.2016	1.000.000	997.670	667.962	7.038	675.000	größer 3 Monate	1.000.000	
79	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 79	0	200	26.11.2020	1.000.000	989.400	720.033	8.425	728.458			
80	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 80	0	200	02.12.2020	1.000.000	995.000	711.986	9.157	721.143			
81	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 81	0	200	22.01.2019	1.500.000	1.493.115	1.042.659	7.686	1.050.345			
82	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 82	0	200	18.10.2021	1.000.000	991.464	720.519	11.685	732.204			
83	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 83	0	200	17.02.2021	1.000.000	998.800	719.002	4.910	723.912			
84	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 84	0	200	19.02.2021	1.000.000	1.043.500	718.702	4.838	723.540			
85	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 85	0	200	04.03.2019	1.000.000	1.000.000	698.434	4.709	703.143			
86	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 86	0	200	04.10.2017	2.000.000	1.988.680	1.344.337	9.857	1.354.194			
87	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 87	0	200	09.04.2021	500.000	500.500	349.117	1.792	350.910			
88	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 88	0	200	14.04.2021	1.000.000	993.260	712.212	3.023	715.235			
89	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 89	0	200	01.04.2022	2.000.000	1.978.800	1.314.132	4.978	1.319.110			
90	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 90	0	200	29.10.2019	2.000.000	1.996.200	1.330.812	1.163	1.331.974			42.492
91	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 91	0	200	12.11.2019	1.000.000	999.660	656.300	4.747	661.047			
92	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 92	0	200	27.05.2019	700.000	699.230	471.338	670	472.008			
93	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 93	0	200	02.12.2019	1.600.000	1.594.400	1.060.837	205	1.061.042			
94	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 94	0	200	15.01.2018	1.000.000	996.740	667.436	1.528	668.964			
95	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 95	0	200	06.03.2024	500.000	477.000	333.142	1.729	334.871			
96	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 96	0	200	19.03.2025	1.000.000	959.200	659.162	1.897	661.059			
97	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 97	0	200	09.04.2021	2.000.000	1.959.800	1.334.433	2.649	1.337.082			
98	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 98	0	200	25.04.2022	1.000.000	970.200	670.944	1.375	672.318			
99	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 99	0	200	15.05.2018	2.000.000	1.996.316	1.338.293	857	1.339.151			
100	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 100	0	200	11.08.2020	1.000.000	1.001.700	670.611	4.433	675.044			
101	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 101	0	200	29.01.2019	1.000.000	999.400	669.799	1.050	670.849			
102	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 102	0	200	22.02.2021	1.100.000	1.097.635	746.063	1.950	748.013			
103	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 103	0	200	10.03.2020	2.000.000	1.994.860	1.338.360	1.546	1.339.906			
104	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 104	0	200	11.11.2022	2.000.000	1.998.480	1.340.956	2.182	1.343.138			
105	0	XXXX	DE000999991	9999991	Test 105	0	200	14.04.2021	2.000.000	1.998.140	1.327.710	1.778	1.329.488			
106	1	0070	DE000999991	9999991	Test 106	0	200	30.07.2021	1.000.000	1.009.200	681.128	1.569	682.696			42.615
107	1	0070	DE000999991	9999991	Test 107	0	200	15.09.2022	500.000	518.550	348.318	1.416	349.735			
108	1	0070	DE000999991	9999991	Test 108	0	200	21.01.2021	1.000.000	1.000.428	742.831	7.734	750.564			
109	1	0070	DE000999991	9999991	Test 109	0	200	14.10.2021	1.000.000	1.000.750	680.928	4.153	685.081			
110	1	0070	DE000999991	9999991	Test 110	0	200	15.12.2020	320.000	319.498	216.726	579	217.305			
111	1	0080	DE000999991	9999991	Test 111	0	200	14.03.2023	2.000.000	2.048.580	1.368.193	86	1.368.279			
112	1	0080	DE000999991	9999991	Test 112	0	200	28.10.2020	2.000.000	2.021.600	1.349.875	114	1.349.989			2
113	1	0090	DE000999991	9999991	Test 113	0	200	15.08.2016	9.000.000	8.982.950	5.992.368	321	5.992.689	größer 30 Tage	9.000.000	
114	1	0090	DE000999991	9999991	Test 114	0	200	25.11.2020	1.000.000	996.980	675.004	135	675.140			
115	1	0120	DE000999991	9999991	Test 115	0	200	03.11.2020	250.000	249.225	169.708	110	169.817			
116	1	0190	DE000999991	9999991	Test 116	0	200	24.02.2021	2.000.000	1.988.680	1.333.368	582	1.333.950			
117	1	0190	DE000999991	9999991	Test 117	0	200	13.01.2020	1.000.000	999.360	672.661	155	672.817			
118	1	0190	DE000999991	9999991	Test 118	0	200	02.09.2021	1.000.000	998.290	678.865	682	679.547			
119	1	0190	DE000999991	9999991	Test 119	0	200	06.11.2017	1.000.000	996.870	677.866	5.410	683.277			
120	1	0190	DE000999991	9999991	Test 120	0	200	10.09.2018	1.000.000	997.040	711.214	16.766	727.979			
121	1	0190	DE000999991	9999991	Test 121	0	200	25.09.2018	1.000.000	997.720	690.114	8.275	698.389			
122	1	0190	DE000999991	9999991	Test 122	0	200	13.05.2017	500.000	498.185	337.925	838	338.762	größer 9 Monate	500.000	

Anhang II: LCR-GENO-SAVE-Detail auf Basis Liste W7442 (neue Version)

30.06.2016

Nr.	Level	Zeile	ISIN	WKN	Bezeichnung	Fonds-WKN	VA	Tilgung	Nennwert	Buchwert	Tageswert (clean)	Zins-abgrenzung	Tageswert (dirty)	Fälligkeiten bis 12 Monte	Betrag	Zinszahlung < 30 Tage
123	1	0190	DE000999991	9999991	Test 123	0	200	07.05.2022	1.000.000	962.000	669.147	376	669.523			
124	1	0190	DE000999991	9999991	Test 124	0	200	22.07.2020	2.000.000	1.996.560	1.350.474	6.274	1.356.749			
125	1	0190	DE000999991	9999991	Test 125	0	200	06.11.2018	4.000.000	3.991.000	2.673.765	2.164	2.675.929			
126	1	0190	DE000999991	9999991	Test 126	0	200	14.01.2021	1.000.000	997.830	679.996	1.153	681.149			
127	1	0190	DE000999991	9999991	Test 127	0	200	10.02.2021	800.000	797.856	539.258	310	539.568			
128	2A	0260	DE000999991	9999991	Test 128	0	200	03.12.2018	2.000.000	1.993.000	1.331.904	77	1.331.980			
129	2A	0270	DE000999991	9999991	Test 129	0	200	14.04.2021	1.250.000	1.246.963	838.014	445	838.459			
130	2A	0270	DE000999991	9999991	Test 130	0	200	17.06.2021	1.400.000	1.397.494	934.662	45	934.707			
131	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 131	0	200	19.01.2017	500.000	500.750	340.414	6.152	346.566	größer 6 Monate	500.000	
132	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 132	0	200	11.05.2020	800.000	796.856	534.998	186	535.184			
133	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 133	0	200	12.07.2017	500.000	497.200	346.688	13.316	360.003			42.541
134	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 134	0	200	24.10.2016	1.000.000	995.992	667.776	4.565	672.340	größer 3 Monate	1.000.000	
135	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 135	0	200	17.07.2019	2.000.000	1.986.460	1.396.202	20.687	1.416.889			
136	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 136	0	200	24.01.2018	450.000	448.533	303.932	1.464	305.395			
137	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 137	0	200	04.06.2019	2.000.000	1.995.760	1.335.764	294	1.336.058			
138	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 138	0	200	01.06.2022	2.000.000	1.990.700	1.382.570	1.587	1.384.157			
139	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 139	0	200	16.07.2018	800.000	773.200	527.884	54	527.937			
140	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 140	0	200	17.11.2020	1.600.000	1.594.960	1.100.455	5.780	1.106.234			
141	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 141	0	200	25.02.2019	2.000.000	2.000.000	1.340.290	947	1.341.237			
142	2B	0360	DE000999991	9999991	Test 142	0	200	10.03.2021	2.000.000	1.994.000	1.334.034	2.576	1.336.609			
143																
144																
145																
146																
147																
148																
149																
150																