

# Meldung der Klumpenrisiken (Art. 21 - 22 BankV)

VERTRAULICH

Seite 1

Einzelabschluss: vierteljährlich an Organ für Oberleitung, Aufsicht und Kontrolle und innert 1 Monat an Revisionsstelle (Art. 21 Abs. 2)  
 Konsolidiert: halbjährlich an Organ für Oberleitung, Aufsicht und Kontrolle und innert 2 Monaten an Revisionsstelle (Art. 21m)

in Tausend Schweizer Franken  
 in Millionen Schweizer Franken

Bank: \_\_\_\_\_  
Tel.-Nr.: \_\_\_\_\_  
Sachbearbeiter: \_\_\_\_\_  
Stichtag: \_\_\_\_\_

## Erläuterungen:

- Kol. 01 Die Klumpenrisiken sind mit Namen/Firma und Wohnort/Domizil der Gegenpartei bzw. der Gruppe verbundener Gegenparteien klar zu bezeichnen. Weicht der wirtschaftlich Berechtigte vom Namen/Firma ab, ist dessen Namen/Firma mit Wohnort/Domizil unmittelbar danach anzugeben. Die Klumpenrisiken sind in alphabetischer Reihenfolge der wirtschaftlich Berechtigten aufzulisten.
- Kol. 02 Datum: Datum der erstmaligen Meldung (z.B. 1998/2 = 2. Quartalsmeldung im Jahre 1998).
- Kol. 03 Organgeschäfte: Die Organgeschäfte im Sinne von Art. 21 Abs. 3 sind mit dem Buchstaben "O" zu kennzeichnen. Dies gilt auch, wenn nur ein Teil der Risikoposition ein Organgeschäft darstellt.  
Konzerngeschäfte: Die Konzerngeschäfte im Sinne von Art. 21 Abs. 4 sind mit dem Buchstaben "K" zu kennzeichnen.
- Kol. 04 Einzelwertberichtigungen/-rückstellungen: Mit "J" (Ja) oder "N" (Nein) ist anzugeben, ob für die betreffende Risikoposition Einzelwertberichtigungen oder -rückstellungen gebildet wurden.
- Kol. 06 Übersteigt der Betrag die Grenze von 10% der anrechenbaren eigenen Mittel gemäss dem Eigenmittelausweis des letzten Quartalsabschlusses, wird die Meldepflicht gemäss Art. 21 Abs. 1 und 2 bzw. Art. 21m ausgelöst.
- Kol. 09 Kol. 06 abzüglich Kol. 07 abzüglich Kol. 08.
- Kol. 10 Risikoposition (netto) aus Kol. 09 in % der anrechenbaren eigenen Mittel. Die Risikoposition (netto) gemäss Kol. 10 darf die massgebende Obergrenze gemäss Kol. 05 nicht übersteigen, ansonsten EBK und Revisionsstelle unverzüglich zu benachrichtigen sind.

Die Banken können das Formular auch mit eigenen Hilfsmitteln darstellen, sofern der Inhalt mit dem vorgegebenen Formular gleichwertig ist.

**Bei erstmaliger Meldung einer Risikoposition ist zusätzlich eine Zusammenstellung der Risikoposition gemäss bankinterner Aufstellung beizulegen.**

Ort und Datum:

Stempel und Unterschrift:





Meldung der Klumpenrisiken (Art. 21 - 22 BankV)

VERTRAULICH

Seite .....

Bank: \_\_\_\_\_

Stichtag: \_\_\_\_\_

Klumpenrisiken	Datum	Kennzeichnung <small>(Art. 21 Abs. 3, 4)</small>	Einzelwertberichtigungen / -rückstellungen	Massgebende Obergrenze <small>(Art. 21a Abs. 1 22 Abs. 2 Bst.a)</small>	Meldepflichtige gewichtete Risikoposition (brutto) <small>(Art. 21 Abs. 1, 4, 5)</small>	Abzüglich:		Gewichtete Risikoposition (netto) <small>(Art. 21a)</small>		Davon: massgebend für Gesamtheit der Klumpenrisiken <small>(Art. 21b)</small>
						Von d. Anwend. ausgenommene Pos. d. Konzerns <small>(Art. 21a Abs. 2, 22 Abs. 2 Bst. b)</small>	Durch freie anrechenbare eigene Mittel gedeckt <small>(Art. 21a Abs. 5)</small>			
01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
Hertrag				%					%	
Zwischentotal										
<b>Abzüglich:</b>										
- Entlastungen für Doppelzählungen bei Konsortien [negative Zahl(en) / von mehreren verfügbaren Zahlen können nur die kleineren entlastet werden/ entlastete Zahlen sind in Kol. 03 mit * zu kennzeichnen]										
- Durch freie anrechenbare eigene Mittel gedeckte Überschreitung der Obergrenze für die Gesamtheit der Klumpenrisiken (Art. 21b Abs. 3, Art. 21a Abs. 5) [positive Zahl in Kol. 08, negative Zahl in Kol. 11] .....										
<b>Total Beanspruchung von eigenen Mitteln für Klumpenrisiken</b> .....										
Freie eigene Mittel (Pos. 11.3 abzüglich Pos. 11.5 des Eigenmittelausweises per letztem Quartalsabschluss) .....										
<b>Verbleibende freie eigene Mittel</b> [Betrag darf nie negativ sein] .....										
<b>Gesamtheit der Klumpenrisiken (netto)</b> .....										