

Meldung der Klumpenrisiken (Art. 83 - 123 ERV)

VERTRAULICH

Seite 1

Einzelabschluss: vierteljährlich an Organ für Oberleitung, Aufsicht und Kontrolle und innert 1 Monat an Prüfungsgesellschaft (Art. 90 Abs. 1)
 Konsolidiert: halbjährlich an Organ für Oberleitung, Aufsicht und Kontrolle und innert 2 Monaten an Prüfungsgesellschaft (Art. 90 Abs. 2)

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. 2007/2 = 2. Quartalsmeldung im Jahre 2007).
- Kol. 03 Organgeschäfte: Die Organgeschäfte im Sinne von Art. 90 Abs. 4 sind mit dem Buchstaben "O" zu kennzeichnen. Dies gilt auch, wenn nur ein Teil der Gesamtposition ein Organgeschäft darstellt.
Gruppengeschäfte: Geschäfte mit anderen Gruppengesellschaften im Sinne von Art. 90 Abs. 5 sind mit dem Buchstaben "G" zu kennzeichnen.
- Kol. 04 Einzelwertberichtigungen/-rückstellungen: Mit "J" (Ja) oder "N" (Nein) ist anzugeben, ob für die betreffende Gesamtposition einer Gegenpartei Einzelwertberichtigungen oder -rückstellungen gebildet wurden.
- Kol. 06 Übersteigt der Betrag die Grenze von 10% der anrechenbaren Eigenmittel gemäss dem Eigenmittelausweis des letzten Quartalsabschlusses, wird die Meldepflicht gemäss Art. 83 Abs. 1 und Art. 90 Abs. 1 und 2 ausgelöst.
- Kol. 09 Kol. 06 abzüglich Kol. 07 abzüglich Kol. 08.
- Kol. 10 Gesamtposition einer Gegenpartei (netto) aus Kol. 09 in % der anrechenbaren Eigenmittel. Die Gesamtposition einer Gegenpartei (netto) gemäss Kol. 10 darf die massgebende Obergrenze gemäss Kol. 05 nicht übersteigen, ansonsten EBK und Prüfungsgesellschaft 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 Gesamtposition einer Gegenpartei ist zusätzlich eine Zusammenstellung der Gesamtposition gemäss bankinterner Aufstellung beizulegen.

Als Anhang ist die Meldung der gruppeninternen Positionen nach Art. 92 mitzuliefern.

Ort und Datum:

Stempel und Unterschrift:

Meldung der Klumpenrisiken (Art. 83 - 123 ERV)

VERTRAULICH

Seite

Bank: _____

Stichtag: _____

Klumpenrisiken	Datum	Kennzeichnung (Art. 90 Abs. 4, 5)	Einzelwertberichtigungen / -rückstellungen	Massgebende Obergrenze (Art. 86 und 103 Abs. 2 Bst. a)	Meldepflichtige gewichtete Gesamtposition einer Gegenpartei (brutto) (Art.83 Abs.1 & 90 Abs.3, 5)	Abzüglich:		Gewichtete Gesamtposition einer Gegenpartei (netto) (Art. 86)		Davon: massgebend für Gesamtheit der Klumpenrisiken (Art. 87)	
						Von d. Anwend. ausgenommene Pos. d. Gruppe (Art. 89 Abs. 1 und 103 Abs. 2 Bst. d)	Durch freie anrechenbare Eigenmittel gedeckt (Art. 88 Abs. 1 Bst. a)				
	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	11
Hertrag					%					%	
Zwischentotal											
Abzüglich:											
- Entlastungen für Doppelzahlungen 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 Eigenmittel gedeckte Überschreitung der Obergrenze für die Gesamtheit der Klumpenrisiken (Art. 88 Abs. 1 Bst. a) [positive Zahl in Kol. 08, negative Zahl in Kol. 11]											
Total Beanspruchung von Eigenmitteln für Klumpenrisiken											
Freie Eigenmittel (Pos. 4.1 abzüglich Pos. 1.5.4 des Eigenmittelausweises per letztem Quartalsabschluss)											
Verbleibende freie Eigenmittel (Betrag darf nie negativ sein)											
Gesamtheit der Klumpenrisiken (netto)											