

Überleitung vom IFRS-Konsolidierungskreis zum aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis gemäß CRR
Werte in TEUR

| | Bankkonzern nach IFRS | Veränderung Konsolidierungs- kreis | KIG nach CRR | |
|--|--------------------------|--|-------------------|--------------------|
| A01 Barreserve | 589.719 | 0 | 589.719 | |
| A02 Handelsaktiva | 152.840 | 0 | 152.840 | Tabelle (8+9) |
| A03 Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (SPPI) | 784.728 | -58.462 | 726.266 | Tabelle (8+9) |
| A04 Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (Option) | 392.168 | 0 | 392.168 | Tabelle (8+9) |
| A05 Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (OCI) | 0 | 0 | 0 | Tabelle (8+9) |
| A07 Finanzielle Vermögenswerte at Cost | 11.535.870 | 71 | 11.535.941 | Tabelle (8) |
| A08 Positive Marktwerte aus Sicherungsgeschäften | 81.179 | 0 | 81.179 | Tabelle (8+9) |
| A10 Beteiligungen | 4.195 | 2.022 | 6.217 | Tabelle (8+9) |
| A11 Sachanlagen | 70.217 | -18 | 70.199 | |
| A12 Als Finanzinvestition gehaltene Immobilien | 58.184 | 0 | 58.184 | |
| A13 Immaterielle Vermögenswerte | 2.483 | 2 | 2.485 | Tabelle (5) |
| A14 Ertragssteueransprüche | 2.163 | 0 | 2.163 | |
| A15 Latente Ertragssteuerforderungen | 8.845 | 2.895 | 11.740 | Tabelle (7) |
| A16 Zur Veräußerung gehaltene langfristige VW | 0 | 0 | 0 | |
| A17 Sonstige Vermögenswerte | 72.017 | 56.458 | 128.475 | |
| Summe Vermögenswerte | 13.754.608 | 2.968 | 13.757.576 | |
| P01 Handelspassiva | 167.132 | 0 | 167.132 | Tabellen (6+8) |
| P02 Finanzielle Verbindlichkeiten atFairValue (Option) | 1.172.869 | 0 | 1.172.869 | Tabellen (1+2+6+8) |
| P03 Finanzielle Verbindlichkeiten at Cost | 11.072.878 | -2.565 | 11.070.313 | Tabellen (1+2) |
| P04 Negative Marktwerte aus Sicherungsgeschäften | 110.116 | 0 | 110.116 | |
| P06 Rückstellungen | 42.042 | -140 | 41.902 | |
| P07 Ertragssteuerverpflichtungen | 9.318 | 0 | 9.318 | Tabellen (1+2+6+9) |
| P08 Latente Ertragssteuerverbindlichkeiten | 3.098 | 3.411 | 6.509 | Tabelle (7) |
| P09 Verbindlichkeiten zu azVeräußerung gehaltene VM | 0 | 0 | 0 | |
| P10 Sonstige Verbindlichkeiten | 45.978 | -6.421 | 39.557 | |
| P11 Eigenkapital | 1.131.177 | 8.683 | 1.139.860 | Tabellen (1+2) |
| Summe Verbindlichkeiten und Eigenkapital | 13.754.608 | 2.968 | 13.757.576 | |

Überleitung von Kapitalbestandteilen

| | 31.12.2018 | KAT | ohne Übergangs- bestim- mungen | mit Übergangs- bestim- mungen |
|--|------------------|-------------|---|--|
| Tabelle (1) Gliederung Kapitalbestandteile nach Instrumenten | | | | |
| Bilanzielles Eigenkapital KIG nach CRR | 1.139.860 | | | |
| .davon Grundkapital | 162.152 | | | |
| .davon Kapitalrücklagen aus Agien | 44.674 | | | |
| .davon kumuliertes sonstiges Ergebnis | -1.630 | | | |
| .davon einbehaltene Gewinne der Vorjahre | 877.303 | | | |
| .davon Jahresgewinn | 57.303 | | | |
| .davon nicht anrechenbarer Jahresgewinn | 0 | | | |
| .davon Anteile ohne beherrschenden Einfluss | 58 | | | |
| Bilanzielles zusätzliches Kernkapital und Ergänzungskapital KIG nach CRR | 293.296 | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten atFairValue (Option) | 1.172.869 | | | |
| .davon nicht nachrangige Verpflichtungen at Fair Value | 1.142.023 | | | |
| .davon nachrangige Verpflichtungen at Fair Value | 30.846 | | | |
| .davon zusätzliches Kernkapital at Fair Value | 0 | | | |
| Finanzielle Verbindlichkeiten at Cost | 11.070.313 | | | |
| .davon nicht nachrangige Verpflichtungen at Cost | 10.807.863 | | | |
| .davon nachrangige Verpflichtungen at Cost | 211.916 | | | |
| .davon zusätzliches Kernkapital at Cost | 50.534 | | | |
| Tabelle (2) Gliederung Kapitalbestandteile nach Anrechenbarkeit | | | | |
| Eigenkapitalinstrumente | 162.152 | CET1 | 162.152 | |
| Agio | 44.674 | CET1 | 44.674 | |
| Anrechenbare Eigenkapitalinstrumente | 206.826 | CET1 | | 206.826 |
| Einbehaltene Gewinne der Vorjahre | 877.303 | CET1 | 877.303 | |
| Anrechenbarer Jahresgewinn | 57.303 | CET1 | 57.303 | |
| Übergangsanpassung nicht realisierte Gewinne | | | | |
| Anrechenbare einbehaltene Gewinne | 934.606 | CET1 | | 934.606 |
| Kumuliertes sonstiges Ergebnis | -1.630 | CET1 | -1.630 | |
| Übergangsanpassung nicht realisierte Gewinne | | | | |
| Anrechenbares kumuliertes sonstiges Ergebnis | -1.630 | CET1 | | -1.630 |
| Anteile ohne beherrschenden Einfluss | 58 | | | |
| Nicht anrechenbare Minderheitsbeteiligungen | -15 | | | |
| Qualifiziertes hartes Kernkapital | 43 | | | |
| Bilanzielles Ergänzungskapital KIG nach CRR | 293.296 | | | |
| .davon Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals | 50.534 | | | |
| .davon Instrumente des Ergänzungskapitals | 242.762 | | | |
| Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals | 50.534 | | | |
| Nicht anrechenbares zusätzliches Kernkapital | -534 | | | |
| Qualifiziertes zusätzliches Kernkapital | 50.000 | AT1 | 50.000 | 50.000 |
| Instrumente des Ergänzungskapitals | 242.762 | | | |
| Nicht anrechenbares Ergänzungskapital | -42.869 | | | |
| Qualifiziertes Ergänzungskapital | 199.893 | T2 | 199.893 | 199.893 |
| Qualifizierte Eigenmittel | | | | |
| .davon Minderheitsbeteiligung, die zum harten Kernkapital zählt | 33 | CET1 | 33 | |
| .davon qualifiziertes zusätzliches Kernkapital | 7 | AT1 | 7 | |
| .davon qualifiziertes Ergänzungskapital | 9 | T2 | 9 | |
| Minderheitsbeteiligung, die zum harten Kernkapital zählt | 33 | | | |
| Übergangsbestimmung Minderheitsbeteiligung, die zum harten Kernkapital zählt | 0 | | | |
| Minderheitsbeteiligung, die zum harten Kernkapital zählt nach Übergangsbestimmung | 33 | CET1 | | 33 |
| Qualifiziertes zusätzliches Kernkapital | 7 | | | |
| Übergangsbestimmung qualifiziertes zusätzliches Kernkapital | 0 | | | |
| Qualifiziertes zusätzliches Kernkapital nach Übergangsbestimmung | 7 | AT1 | | 7 |
| Qualifiziertes Ergänzungskapital | 9 | | | |
| Übergangsbestimmung qualifiziertes Ergänzungskapital | 0 | | | |
| Qualifiziertes Ergänzungskapital nach Übergangsbestimmung | 9 | T2 | | 9 |

Überleitung von Abzugsposten

Tabelle (5) Immaterielle Vermögenswerte

| | | | | |
|---|---------------|-------------|---------------|---------------|
| Bilanzielle immaterielle Vermögenswerte | -2.485 | CET1 | -2.485 | |
| Übergangsbestimmung Abzug CET1 | | | | |
| Abzugsposten immaterielle Vermögenswerte nach Übergangsbestimmung CET1 | -2.485 | CET1 | | -2.485 |
| Übergangsbestimmung Abzug AT1 | 0 | | | |
| Abzugsposten immaterielle Vermögenswerte nach Übergangsbestimmung AT1 | 0 | AT1 | | 0 |

Tabelle (6) Bewertungseffekte aus der eigenen Bonität nach IFRS

| | | | | |
|---|------------|-------------|------------|------------|
| Finanzielle Verbindlichkeiten atFairValue (Option) | 1.172.869 | | | |
| .davon Rückzahlungsbetrag | 1.159.142 | | | |
| .davon kumulierte Fair Value Bewertung | 102.311 | | | |
| .davon kumulierte Bewertung aus eigenem Bonitätsrisiko | 204 | | | |
| .daraus erfasste latente Steuerverpflichtung | -51 | | | |
| Abzug Bewertungseffekte aus der eigenen Bonität nach IFRS | 153 | CET1 | 153 | 153 |
| Handelsspassiva | 167.132 | | | |
| Negative Marktwerte aus Sicherungsgeschäften | 110.116 | | | |
| davon kumulierte Bewertung aus eigenem Bonitätsrisiko | -21 | | | |
| .daraus erfasste latente Steuerverpflichtung | 5 | | | |
| Abzug Bewertungseffekte aus der eigenen Bonität für Derivate | -16 | CET1 | -16 | -16 |

Tabelle (7) Ermittlung der latenten Steuerforderungen

| | | | | |
|--|--------------|-------------|----------|----------|
| Latente Ertragssteuerforderungen | 11.740 | | | |
| Latente Ertragssteuerverbindlichkeiten | 6.509 | | | |
| Abzug latenter Steueransprüche von künftiger Rentabilität abhängig | 11.740 | | | |
| Verrechenbare latente Steuerverpflichtungen | -6.509 | | | |
| Nettoposition Abzug latenter Steueransprüche | 5.231 | | | |
| Der den Schwellenwert überschreitender Betrag | 0 | CET1 | 0 | 0 |

Tabelle (8) Ermittlung der Abzugsposten aus Beteiligungen an Unternehmen der Finanzbranche

| | | | |
|--|-------------------|-------------|---|
| Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (SPPI) | 726.266 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 19.556 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 21.541 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 3.331 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 768 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (OCI) | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| Finanzielle Vermögenswerte at Cost | 11.535.941 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 15.809 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| Beteiligungen | 6.217 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon unwesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 1.033 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| .davon wesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| Summe unwesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 19.556 | | |
| Summe unwesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 21.541 | | |
| Summe unwesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 19.140 | | |
| Summe wesentliche Beteiligungen am harten Kernkapital | 1.801 | | |
| Summe wesentliche Beteiligungen am zusätzlichen Kernkapital | 0 | | |
| Summe wesentliche Beteiligungen am Ergänzungskapital | 0 | | |
| Summe der unwesentlichen Beteiligungen | 60.237 | | |
| Schwellwert für den Abzug von unwesentlichen Beteiligungen | 112.986 | | |
| Basis für den Abzug von unwesentlichen Beteiligungen | 0 | | |
| .davon Abzug vom harten Kernkapital | 0 | CET1 | 0 |
| .davon Abzug vom zusätzlichen Kernkapital | 0 | AT1 | 0 |
| .davon Abzug vom Ergänzungskapital | 0 | T2 | 0 |

Tabelle (9) Ermittlung der Abzugsposten aus den Anforderungen für eine vorsichtige Bewertung

| | |
|--|------------------|
| Vermögenswerte zum Fair Value bewertet | |
| Handelsaktiva | 152.840 |
| Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (SPPI) | 726.266 |
| Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (Option) | 392.168 |
| Finanzielle Vermögenswerte at Fair Value (OCI) | 0 |
| Positive Marktwerte aus Sicherungsgeschäften | 81.179 |
| Beteiligungen | 6.217 |
| Summe Vermögenswerte | 1.358.670 |
| Verbindlichkeiten zum Fair Value bewertet | |
| Handelsspassiva | 167.132 |
| Finanzielle Verbindlichkeiten atFairValue (Option) | 1.172.869 |
| Negative Marktwerte aus Sicherungsgeschäften | 110.116 |
| Summe Verbindlichkeiten | 1.450.117 |
| Gegenläufige Bewertungseffekte AFV | -353.149 |
| Gegenläufige Bewertungseffekte Hedge-Accounting | -155.355 |

| | | | | |
|---|------------------|-------------|---------------|---------------|
| Nettogesamtwerte | 2.300.283 | | | |
| Abzugsposten aus den Anforderungen für eine vorsichtige Bewertung *1) | -2.300 | CET1 | -2.300 | -2.300 |
| *1) vereinfachter Ansatz = 0,1 % der Nettogesamtwerte | | | | |

| | | | | |
|--|---------------|-------------|---------------|---------------|
| Tabelle (10) Ermittlung der Abzugsposten aus Verbriefungsposten | | | | |
| Abzugsposten aus Verbriefungstransaktion als Originator aus Mezzanin-Tranche | -4.632 | | | |
| Abzugsposten aus Verbriefungstransaktion als Originator aus Junior-Tranche | -690 | | | |
| Abzugsposten aus Verbriefungstransaktionen als Investor | -6 | | | |
| Summe Abzugsposten aus Verbriefungsposten | -5.328 | CET1 | -5.328 | -5.328 |

| | | | | |
|--------------------------|--|-------------|------------------|------------------|
| | | xxx | | |
| Summe CET1 | | CET1 | 1.129.859 | 1.129.859 |
| Summe AT1 | | AT1 | 50.007 | 50.007 |
| Summe T2 | | T2 | 199.902 | 199.902 |
| Gesamteigenmittel | | | 1.379.768 | 1.379.768 |