

Anlage 4: Offenlegung der Vermögensbelastung (Stand: Ende Juni 2017)

Vorlage A-Vermögenswerte

		Buchwert der belasteten Vermögenswerte	Beizulegender Zeitwert der belasteten Vermögenswerte	Buchwert der unbelasteten Vermögenswerte	Beizulegender Zeitwert der unbelasteten Vermögenswerte
		010	040	060	090
010	Vermögenswerte des berichtenden Instituts	9.245.284		23.480.584	
030	Aktieninstrumente			7.655.338	
040	Schuldtitle			458.317	
120	Sonstige Vermögenswerte	9.245.284		15.366.929	

Vorlage B-Erhaltene Sicherheiten

		Beizulegender Zeitwert der belasteten erhaltenen Sicherheiten bzw. ausgegebenen eigenen Schuldtitle	Beizulegender Zeitwert der erhaltenen Sicherheiten bzw. ausgegebenen eigenen Schuldtitle, die zur Belastung infrage kommen
		010	040
130	Vom berichtenden Institut erhaltene Sicherheiten		
150	Aktieninstrumente		
160	Schuldtitle		
230	Sonstige erhaltene Sicherheiten		
240	Andere ausgegebene eigene Schuldtitle als eigene		

Vorlage C-Belastete Vermögenswerte/erhaltene Sicherheiten und damit verbundene Verbindlichkeiten

		Deckung der Verbindlichkeiten, Eventualverbindlichkeiten oder ausgeliehenen Wertpapiere	Vermögenswerte, erhaltene Sicherheiten und andere ausgegebene eigene Schuldtitle als belastete Pfandbriefe und ABS
		010	030
010	Buchwert ausgewählter Verbindlichkeiten	9.245.284	

Nicht in jedem Fall auszufüllen

D - Angaben zur Höhe der Belastung

Bürgschaften für Börsen und Miete: 3.436.937 EUR

Handelsbestand Short: 1.904.420 EUR

Margin (CCP und Leihe): 3.903.927 EUR