

CRR Verschuldungsquote - Offenlegung

Stichtag	29. September 2017
Name des Unternehmens	UniCredit Bank Austria AG
Anwendungsebene	subkonsolidiert

Tabelle LRSum: Summarische Abstimmung zwischen bilanzierten Aktiva und Risikopositionen für die Verschuldungsquote

		Anzusetzender Wert in EUR Mio
1	Summe der Aktiva laut veröffentlichtem Abschluss	104,114.9
2	Anpassung für Unternehmen, die für Rechnungslegungszwecke konsolidiert werden, aber nicht dem aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis angehören, oder die zu Bilanzierungszwecken nicht voll- oder quotenkonsolidiert werden, jedoch zum aufsichtlichen Konsolidierungskreis gehören	283.7
3	(Anpassung für Treuhandvermögen, das nach dem geltenden Rechnungslegungsrahmen in der Bilanz angesetzt wird, aber gemäß Artikel 429 Absatz 13 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bei der Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote unberücksichtigt bleibt)	0.0
4	Anpassungen für derivative Finanzinstrumente	-1,649.7
5	Anpassung für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)	158.1
6	Anpassung für außerbilanzielle Posten (d. h. Umrechnung außerbilanzieller Risikopositionen in Kreditäquivalenzbeträge)	10,901.9
EU-6a	(Anpassung für gruppeninterne Risikopositionen, die gemäß Artikel 429 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bei der Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote unberücksichtigt bleiben)	0.0
EU-6b	(Anpassung für Risikopositionen, die gemäß Artikel 429 Absatz 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 bei der Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote unberücksichtigt bleiben)	0.0
7	Sonstige Anpassungen	-1,139.2
8	Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote	112,669.7

Tabelle LRCom: Einheitliche Offenlegung der Verschuldungsquote

		Risikopositionen für die CRR-Verschuldungsquote in EUR Mio
Bilanzwirksame Risikopositionen (ohne Derivate und SFT)		
1	Bilanzwirksame Posten (ohne Derivate, SFT und Treuhandvermögen, aber einschließlich Sicherheiten)	98,002.4
2	(Bei der Ermittlung des Kernkapitals abgezogene Aktivabeträge)	-1,215.5
3	Summe der bilanzwirksamen Risikopositionen (ohne Derivate, SFT und Treuhandvermögen) (Summe der Zeilen 1 und 2)	96,786.9
Risikopositionen aus Derivaten		
4	Wiederbeschaffungswert aller Derivatgeschäfte (d. h. ohne anrechenbare, in bar erhaltene Nachschüsse)	517.7
5	Aufschläge für den potenziellen künftigen Wiederbeschaffungswert in Bezug auf alle Derivatgeschäfte (Marktbewertungsmethode)	824.1
EU-5a	Risikoposition gemäß Ursprungsrisikomethode	0.0
6	Hinzurechnung des Betrags von im Zusammenhang mit Derivaten gestellten Sicherheiten, die nach dem geltenden Rechnungslegungsrahmen von den Bilanzaktiva abgezogen werden	0.0
7	(Abzüge von Forderungen für in bar geleistete Nachschüsse bei Derivatgeschäften)	-80.7
8	(Ausgeschlossener ZGP-Teil kundengeclearter Handelsrisikopositionen)	0.0
9	Angepasster effektiver Nominalwert geschriebener Kreditderivate	355.6
10	(Aurechnungen der angepassten effektiven Nominalwerte und Abzüge der Ausriese für geschriebene Kreditderivate)	0.0
11	Summe der Risikopositionen aus Derivaten (Summe der Zeilen 4 bis 10)	1,616.7
Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)		
12	Brutto-Aktiva aus SFT (ohne Anerkennung von Netting), nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte	3,206.1
13	(Aufgerechnete Beträge von Barverbindlichkeiten und -forderungen aus Brutto-Aktiva aus SFT)	0.0
14	Gegenparteausfallrisikoposition für SFT-Aktiva	158.1
EU-14a	Abweichende Regelung für SFT: Gegenparteausfallrisikoposition gemäß Artikel 429b Absatz 4 und Artikel 222 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0.0
15	Risikopositionen aus als Beauftragter getätigten Geschäften	0.0
EU-15a	(Ausgeschlossener ZGP-Teil von kundengeclearten SFT-Risikopositionen)	0.0
16	Summe der Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (Summe der Zeilen 12 bis 15a)	3,364.2
Sonstige außerbilanzielle Risikopositionen		
17	Außerbilanzielle Risikopositionen zum Bruttonominalwert	37,865.3
18	(Anpassungen für die Umrechnung in Kreditäquivalenzbeträge)	-26,963.4
19	Sonstige außerbilanzielle Risikopositionen (Summe der Zeilen 17 und 18)	10,901.9
(Bilanzielle und außerbilanzielle) Risikopositionen, die nach Artikel 429 Absatz 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unberücksichtigt bleiben dürfen		
EU-19a	(Gemäß Artikel 429 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nicht einbezogene (bilanzielle und außerbilanzielle) gruppeninterne Risikopositionen (Einzelbasis))	0.0
EU-19b	(Bilanzielle und außerbilanzielle) Risikopositionen, die nach Artikel 429 Absatz 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unberücksichtigt bleiben dürfen	0.0
Eigenkapital und Gesamtrisikopositionsmessgröße		
20	Kernkapital	6,382.8
21	Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote (Summe der Zeilen 3, 11, 16, 19, EU-19a und EU-19b)	112,669.7
Verschuldungsquote		
22	Verschuldungsquote	5.67%
Gewählte Übergangsregelung und Betrag ausgebuchter Treuhandpositionen		
EU-23	Gewählte Übergangsregelung für die Definition der Kapitalmessgröße	TRANSITIONAL
EU-24	Betrag des gemäß Artikel 429 Absatz 11 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgebuchten Treuhandvermögens	0.0

Tabelle LRSpl: Aufgliederung der bilanzwirksamen Risikopositionen (ohne Derivate, SFT und ausgenommene Risikopositionen)

		Risikopositionen für die CRR- Verschuldungsquote in EUR Mio
EU-1	Gesamtsumme der bilanzwirksamen Risikopositionen (ohne Derivate, SFT und ausgenommene Risikopositionen), davon:	98,002.4
EU-2	Risikopositionen im Handelsbuch	1.4
EU-3	Risikopositionen im Anlagebuch, davon	98,001.0
EU-4	Gedeckte Schuldverschreibungen	0.9
EU-5	Risikopositionen, die wie Risikopositionen gegenüber Staaten behandelt werden	25,971.9
EU-6	Risikopositionen gegenüber regionalen Gebietskörperschaften, multilateralen Entwicklungsbanken, internationalen Organisationen und öffentlichen Stellen, die nicht wie Risikopositionen gegenüber Staaten behandelt werden	1,955.9
EU-7	Institute	11,341.9
EU-8	Durch Grundpfandrechte auf Immobilien besichert	11,993.0
EU-9	Risikopositionen aus dem Mengengeschäft	5,675.8
EU-10	Unternehmen	34,264.5
EU-11	Ausgefallene Positionen	1,087.9
EU-12	Sonstige Risikopositionen (z. B. Beteiligungen, Verbriefungen und sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind)	5,709.2