

Anlage 1A**Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten - CRR-Kreditinstitute (monatliche Meldung)****Anlage 1A 1
Kredite und Kreditzusagen****Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Verbrieft
Verbriefungsart
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
OeNB Kreditforderungs ID
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert
Übertragener Betrag ¹
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht) ¹
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht) ¹
Ausfallwahrscheinlichkeit

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

¹ Diese Attribute sind nicht für Instrumente gegenüber natürlichen Personen zu melden.

Anlage 1A 2

**Nicht-verbrieftete Anteilsrechte, Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU)
Nr. 575/2013 (exkl. Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze**

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Brutto-Buchwert
Nominale
Außerbilanzieller Wert
Ausfallwahrscheinlichkeit

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

Anlage 1A 3 Gehaltene Wertpapiere

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Art des Instruments

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ausstehender Nominalwert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Wertpapier – Daten zu Ratings und Risikoindikatoren

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart
Weighted Average Life
Attachment Point
Detachment Point
Ausfallwahrscheinlichkeit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

Anlage 1A 4 Gegenparteien

Risikodaten zu Gegenparteien

Gegenpartei Identnummer
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Ausfallwahrscheinlichkeit

Anlage 1A 5 Sicherheiten

Daten zu empfangenen Sicherheiten

Mandant Identnummer
Sicherheiten ID
Art der Sicherheit

Anlage 1A 6 Meldung der institutsinternen Ratingsysteme

Auflistung der Ratingsysteme

Ratingsystem intern
Ratingsystem Quelle Identnummer
Abgenommenes IRB Ratingsystem
Bezeichnung Ratingsystem

Bonitätsklassen je Ratingsystem

Bonitätsklasse intern
Ratingsystem intern
Beschreibung Bonitätsklasse
Ausfallwahrscheinlichkeit – Untergrenze
Ausfallwahrscheinlichkeit – Obergrenze