

**Anlage 3A****Verbriefungsmeldung konsolidiert (UGB-Konzern) (quartalsweise Meldung)****Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere (inkl. Short-Positionen)****Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene**

Unternehmen Identnummer
Instrument ID
Gegenpartei Identnummer
ISIN
Rechnungslegungsklassifikation
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart
Nominale
Marktwert
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen
Weighted Average Life
Attachment Point
Detachment Point
Ausfallwahrscheinlichkeit

**Kreditrisikodaten**

Unternehmen Identnummer
Risikoposition ID
Instrument ID
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke
Risikopositionsklasse
Risikopositionswert
Risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors