

Anlage 1A**Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten - CRR-Kreditinstitute (monatliche Meldung)****Anlage 1A 1****Instrumente gemäß Art. 1 Nr. 23 der Verordnung (EU) 2016/867¹****Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Vertrag ID
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe
Rückgriff

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Verbrieft
Verbriefungsart
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
OeNB Kreditforderungs ID
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert
Übertragener Betrag ²
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht) ²
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht) ²
Rückstände ²
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 Verordnung (EU) 2016/867 der Europäischen Zentralbank über die Erhebung granularer Kreditdaten und Kreditrisikodaten (EZB/2016/13), ABl. Nr. L 144 vom 01.06.2016 S. 44.

² 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. von 1A 1 umfasste Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Vertrag ID ³
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Brutto-Buchwert ⁴
Nominale ³
Außerbilanzieller Wert ³
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

³ Diese Attribute sind nur für Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (exkl. von 1A 1 umfasste Kreditzusagen) zu melden.

⁴ Dieses Attribut ist nur für nicht-verbrieftete Anteilsrechte zu melden.

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 ⁵
Bonitätsklasse intern ⁵
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart ⁶
Weighted Average Life ⁶
Attachment Point ⁶
Detachment Point ⁶
Ausfallwahrscheinlichkeit ⁶

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

⁵ Dieses Attribut ist nur für Schuldverschreibungen und verbrieft Anteilsrechte zu melden.

⁶ Dieses Attribut ist nur für Verbriefungstranchen zu melden.

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