

Anlage 2

zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zur Stammdatenmeldung
(Stammdatenmeldeverordnung 2016 – StDMV 2016)

Meldeinhalte zu § 9 StDMV 2016 (Risikoansätze)

A. Kreditrisiko gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 3 CRR

A.1. Auf internen Einstufungen basierender Ansatz (IRB-Ansatz, Teil 3, Titel II, Kapitel 3 CRR)

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (IRB-Ansatz, Art. 143 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

A.2. Umfang der Bewilligung

Risikopositionsklassen gemäß Art. 147 Abs. 2 CRR [jeweils: 1 – Ja; 2 – Nein]	IRB-Ansatz mit eigenen Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 7 und Abs. 9 CRR)	IRB-Ansatz ohne eigene Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 8 CRR)	Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 148 CRR)	Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial Use“, Art. 150 CRR)	„Slotting-Ansatz“ (Art. 153 Abs. 5 CRR)
Lit. a (Zentralstaaten und Zentralbanken)					xxxxxxx
Lit. b (Risikopositionen gegenüber Instituten)					xxxxxxx
Lit. c (Risikopositionen gegenüber Unternehmen)					
Lit. d (Risikopositionen aus dem Mengengeschäft)		xxxxxxx			xxxxxxx

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

A.3. Beteiligungen

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Einfacher risikogewichteter Ansatz (Art. 155 Abs. 2 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
PD/LGD-Ansatz (Art. 155 Abs. 3 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Internes Modell (Art. 155 Abs. 4 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 495 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial Use“, Art. 150 Abs. 1 lit. g und h CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

B. Kreditrisikominderung gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 4 der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Umfassende Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 223 bis 228 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf eigenen Schätzungen beruhende Volatilitätsanpassungen bei der umfassenden Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 225 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

C. Verbriefung gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 5 der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (SEC-IRBA, Art. 258 bis 260 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardansatz (SEC-SA, Art. 261 bis 262 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf externen Beurteilungen basierender Ansatz (SEC-ERBA, Art. 263 bis 264 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Interner Bemessungsansatz (SEC-SIAA, Art. 265 bis 266 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Residualer Ansatz (SEC-other, Art. 254 Abs. 7 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

D. Gegenparteiausfallsrisiko gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 6 der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Standardansatz (Art. 274 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Vereinfachter Standardansatz (Art. 281 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Ursprungsrisikomethode (Art. 282 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf einem internen Modell beruhende Methode (Art. 283 ff)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

E. Operationelles Risiko gemäß Teil 3, Titel III der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Basisindikatoransatz (Art. 315 und 316 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardansatz (Art. 317, 318 und 320 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Alternativer Standardansatz (Art. 319 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fortgeschrittene Messansätze (Art. 321 bis 324 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

F. Marktrisiko gemäß Teil 3, Titel IV der CRR**F.1. Allgemeine Angaben**

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Nutzung der Ausnahmebestimmung gemäß Art. 94 CRR („kleines Handelsbuch“)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (Art. 363 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

F.2. Standardansatz

		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Schuldtitel (Teil 3, Titel IV, Kapitel 2, Abschnitt 2 CRR):	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Laufzeitbezogene Berechnung (Art. 339 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Durationsbasierte Berechnung (Art. 340 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Aktieninstrumente (Teil 3, Titel IV, Kapitel 2, Abschnitt 3 CRR):	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fremdwährungsrisiko (Teil 3, Titel IV, Kapitel 3 CRR):	Positionen des Bankbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Positionen des Handelsbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Warenpositionsrisiko:	Laufzeitbandverfahren (Art. 359 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Vereinfachtes Verfahren (Art. 360 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Erweitertes Laufzeitbandverfahren (Art. 361 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Korrelationshandelsportfolio (Art. 338 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

F.3. Internes Marktrisikomodell (IMM, Teil 3, Titel IV, Kapitel 5 CRR)

		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Schuldtitle:	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Aktieninstrumente:	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fremdwährungsrisiko:	Positionen des Bankbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Positionen des Handelsbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Warenpositionsrisiko:		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Korrelationshandelsaktivitäten (Art. 377 CRR):		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

G. Risiko einer Anpassung der Kreditbewertung (CVA-Risiko) gemäß Teil 3, Titel VI der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Fortgeschrittene Methode (Art. 383 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardmethode (Art. 384 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Alternative Methode (Art. 385 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

H. Strukturelle Liquiditätsquote gemäß Teil 6, Titel IV der CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Vereinfachte strukturelle Liquiditätsquote (simplified NSFR) gemäß Teil 6, Titel IV, Kapitel 6 der CRR	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.