

## Rakar Brigita

---

**Von:** Raunig, Jutta <jutta.raunig@bmf.gv.at>  
**Gesendet:** Mittwoch, 11. August 2021 10:10  
**An:** Begutachtung; Gollmann Philip  
**Cc:** BAUER, Josef; TREFIL, Barbara; Beate Schaffer; Peter Maerschalk  
**Betreff:** Stammdatenmeldungsverordnung 2016-StDMV 2016-  
Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2021-08-10.docx, StDMV 2016-  
Anlage 1-Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2021-08-10.docx,  
StDMV 2016-Anlage 2-Begutachtungsentwurf-BMF-  
Anmerkungen-2021-08-10.docx  
**Anlagen:** Stammdatenmeldungsverordnung 2016-StDMV 2016-  
Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2021-08-10.docx; StDMV 2016-  
Anlage 1-Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2021-08-10.docx;  
StDMV 2016-Anlage 2-Begutachtungsentwurf-BMF-  
Anmerkungen-2021-08-10.docx  
**Kennzeichnung:** Zur Nachverfolgung  
**Kennzeichnungsstatus:** Gekennzeichnet

Mit der Bitte um Berücksichtigung der BMF-Anmerkungen.

Freundliche Grüße  
Jutta Raunig

### **Bundesministerium für Finanzen**

Sektion III – Wirtschaftspolitik, Finanzmärkte und Zoll  
Abteilung III/5 – Banken- und Kapitalmarktrecht

### **MR Mag. Jutta Raunig**

Tel.: +43 1 51433 503125  
Mobil: +43 664 88219048  
Johannesgasse 5, 1010 Wien  
[jutta.raunig@bmf.gv.at](mailto:jutta.raunig@bmf.gv.at)  
[bmf.gv.at](http://bmf.gv.at)

## Entwurf

**Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA), mit der die Stammdatenmelldungsverordnung 2016 geändert wird**

Auf Grund des § 74 Abs. 2 in Verbindung mit § 74 Abs. 6 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 98/2021, wird mit Zustimmung des Bundesministers für Finanzen verordnet:

Die Stammdatenmelldungsverordnung 2016 – StDMV 2016, BGBl. II Nr. 371/2016, zuletzt geändert durch die Verordnung BGBl. II Nr. 39/2020, wird wie folgt geändert:

1. In § 3 Z 2 wird die Wortfolge „der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichts Anforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, ABl. Nr. L 176 vom 27.06.2013 S. 1, in der Fassung der Verordnung (EU) 2019/876, ABl. Nr. L 150 vom 07.06.2019 S. 1,“ durch die Abkürzung „CRR“ ersetzt.

2. In § 3 Z 3, 4 und 5 sowie in § 9 Abs. 3 wird die Wortfolge „der Verordnung (EU) Nr. 575/2013“ jeweils durch die Abkürzung „CRR“ ersetzt.

3. § 9 Abs. 1 samt Überschrift lautet:

**„Risikoansätze**

**§ 9.** (1) Kreditinstitute haben die Meldungen betreffend die zur Berechnung des Eigenmittelerfordernisses gemäß Art. 92 ~~der~~ CRR verwendeten Risikoansätze gemäß der **Anlage 2** zu übermitteln. Übergeordnete Kreditinstitute gemäß § 30 Abs. 5 BWG haben dabei die auf konsolidierter Ebene verwendeten Risikoansätze anzugeben, sofern diese von jenen abweichen, welche auf der Einzelinstitutsebene verwendet werden.“

4. Vor § 11 samt Überschrift wird folgender § 10a samt Überschrift eingefügt:

**„Verweise**

**§ 10a.** Für Verweise auf Rechtsakte in dieser Verordnung sowie in den Anlagen dazu gilt Folgendes:

1. Soweit auf Bestimmungen des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, verwiesen wird, ist dieses in der Fassung des Bundesgesetzes BGBl. I Nr. 98/2021 anzuwenden;
2. soweit auf Bestimmungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, in dieser Verordnung CRR genannt, verwiesen wird, bezieht sich dies auf die Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichts Anforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 6468/2012, ABl. Nr. L 176 vom 27.06.2013, S. 1, zuletzt geändert durch die in der Fassung der Verordnung (EU) 2021/558, ABl. Nr. L 116 vom 06.04.2021 S. 25;
3. soweit auf Bestimmungen der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 verwiesen wird, bezieht sich dies auf die Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 ~~des Rates~~ sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik, ABl. Nr. L 393 vom 30.12.2006 S. 1, zuletzt geändert durch die in der Fassung der Verordnung (EU) 2019/1243, ABl. Nr. L 198 vom 25.7.2019 S. 241;
4. soweit auf Bestimmungen der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013 verwiesen wird, bezieht sich dies auf die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 153/2013 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 ~~des Europäischen Parlaments und des Rates~~ in Bezug auf

technische Regulierungsstandards für Anforderungen an zentrale Gegenparteien, ABl. Nr. L 52 vom 23.02.2013 S. 41, in der Fassung der Delegierten Verordnung (EU) 2016/822, ABl. Nr. L 137 vom 26.05.2016, S. 1.

5. Dem § 11 wird folgender Abs. 4 angefügt:

„(4) § 3 Z 2, ~~§ 3 Z 3~~, 4 und 5, § 9 Abs. 1 samt Überschrift, § 9 Abs. 3, § 10a samt Überschrift sowie die **Anlagen 1** und **2** in der Fassung der Verordnung BGBl. II Nr. xxx/2021 treten mit 31. Dezember 2021 in Kraft.“

6. Die **Anlagen 1** und **2** lauten: (siehe Anlagen).

## Begründung

### Allgemeiner Teil

Mit der gegenständlichen Novelle ~~werden~~wird mit Zustimmung des Bundesministers für Finanzen die Verordnungsermächtigungen gemäß ~~§ 74 Abs. 2 in Verbindung mit~~ § 74 Abs. 6 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 98/2021, ausgeübt. Es werden in der Stammdatenmelldungsverordnung 2016 – StDMV 2016, BGBl. II Nr. 371/2016, zuletzt geändert durch die Verordnung BGBl. II Nr. 39/2020, Änderungen des BWG bzw. der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 6468/2012, ABl. Nr. L 176 vom 27.06.2013, S. 1, ~~zuletzt geändert durch die in der Fassung der~~ Verordnung (EU) 2021/558, ABl. Nr. L 116 vom 06.04.2021 S. 25, in diesem Dokument CRR genannt, nachgebildet. Weiters wird erstmals berücksichtigt, dass in einzelnen Fällen die Risikoansätze auf Einzelinstituts-ebene und konsolidierter Ebene auseinanderfallen können, sodass separate Angaben dazu in der entsprechenden Anlage aufgenommen wurden.

### Besonderer Teil

#### **Zu Z 1, 2 und 4 (§ 3 Z 2 bis 5, § 9 Abs. 3, § 10a):**

Aktualisierung von Verweisen und Überführung der Langzitate in eine eigene Bestimmung (vgl. § 10a).

#### **Zu Z 3 (§ 9 Abs. 1 samt Überschrift):**

Nachdem ein Auseinanderfallen der zur Berechnung des Eigenmittelerfordernisses verwendeten Risikoansätze auf Einzelinstituts-ebene bzw. konsolidierter Ebene in vereinzelt Fällen möglich ist, wird die Verpflichtung zur Angabe durch das übergeordnete Kreditinstitut in § 9 sowie eine diesbezügliche Kennzeichnung in **Anlage 2** aufgenommen. Es handelt sich hierbei um Informationen, welche in der europäischen Zusammenarbeit im Einheitlichen Aufsichtsmechanismus (Single Supervisory Mechanism – SSM) mit der EZB ausgetauscht werden.

#### **Zu Z 5 (§ 11 Abs. 4):**

Inkrafttretensbestimmung.

#### **Zu den Anlagen:**

#### **Zu Anlage 1 (Unternehmensdaten gemäß § 8 StDMV 2016):**

In **Anlage 1** wurden zwei Ergänzungen vorgenommen. Zunächst wurde in Teil A die in der CRR nunmehr vorgesehene Unterscheidung in Größenklassen aufgenommen, an welche unterschiedliche Melde- und Offenlegungserfordernisse anknüpfen. Die Einfügung des § 28a Abs. 5a und 5b BWG hat die in den RZ 88 bis 93 der EBA-Leitlinien, EBA/GL/2017/12/ESMA71-99-598, normierte Anforderung, formal unabhängige Mitglieder im Aufsichtsorgan zu haben, im BWG verankert. Daher wurde in **Anlage 1** Teil B eine diesbezügliche Kennzeichnung aufgenommen. Darüber hinaus wurden Langzitate in den neuen § 10a StDMV 2016 übergeführt und in **Anlage 1** entsprechend durch Kurzzitate ersetzt.

#### **Zu Anlage 2 (Risikoansätze gemäß § 9 StDMV 2016):**

In **Anlage 2** wurden in den Teilen C und D die in der CRR modifizierten bzw. neu eingeführten Risikoansätze abgebildet. Weiters wurde ein neuer Teil H aufgenommen, um anzugeben, ob die vereinfachte strukturelle Liquiditätsquote verwendet wird. Bei allen Ansätzen wurde eine separate Kennzeichnung für den Fall aufgenommen, dass unterschiedliche Ansätze auf Einzelinstituts-ebene bzw. konsolidierter Ebene verwendet werden. Nachdem dies allein in wenigen Ausnahmefällen vorkommt, hat diese Angabe ausschließlich im Anlassfall zu erfolgen.

**Anlage 1**  
**zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zur Stammdatenmeldung**  
**(Stammdatenmeldeverordnung 2016 – StDMV 2016)**

**Meldeinhalte zu § 8 StDMV 2016 (Unternehmensdaten)**

**A. Hauptniederlassung des Meldeverpflichteten**

OeNB Identnummer	
Firmenbuchnummer/Zusatz	
Firmenwortlaut	
Sitzadresse:	Straße
	Ort
	Postleitzahl
Postadresse:	Postfach
	Straße
	Ort
	Postleitzahl
Bundesland	
SWIFT-Code	
SEPA-Routing BIC	
Telefonnummer	
Telefax	
E-Mail	
Homepage	
Länder ISO-Code der Heimatlandaufsichtsbehörde	
BLZ – IBAN	
BLZ – nicht IBAN	
BLZ – deaktivieren	
ULZ (Unternehmensleitzahl)	
LEI (Legal Entity Identifier)	
Rechnungslegungsstandard – unkonsolidiert	[1 – UGB; 2 – IFRS]
Rechnungslegungsstandard – konsolidiert	[1 – UGB; 2 – IFRS]
Finanzkonglomerat	[1 – Ja; 2 – Nein]
Größenklasse gemäß CRR – unkonsolidiert	[1 – Großes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 <del>ZNr. 146 der CRR</del> ; 2 – Anderes Institut 3 – Kleines, nicht-komplexes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 <del>ZNr. 145 der CRR</del> ]
Größenklasse gemäß CRR – konsolidiert <sup>1</sup>	[1 – Großes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 <del>ZNr. 146 der CRR</del> ; 2 – Anderes Institut 3 – Kleines, nicht-komplexes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 <del>ZNr. 145 der CRR</del> ]

**Kommentiert [RJ1]:** Gleiche Schreibweise wie in § 2 BWG (Begriffsbestimmungen).

<sup>1</sup> Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

#### B. Organwalter/innen und Funktionsträger/innen

OeNB Identnummer	
Funktion (gemäß Tabelle „Übersicht Funktionen“)	<i>[Funktionsnummer]</i>
E-Mailadresse (zu den Funktionsnummern 43, 46, 51, 52, 53 und 60 der Tabelle „Übersicht Funktionen“)	
Kennzeichnung des unabhängigen Mitgliedes gemäß § 28a Abs. 5b BWG (hinsichtlich der Funktionsnummern 62, 63 und 65)	

#### C. Mitarbeiter/innen

Stichtag	<i>[Datum]</i>
----------	----------------

##### C.1. Anzahl Mitarbeiter/innen

	Männlich	Weiblich	Insgesamt
Vollzeitbeschäftigte			
Teilzeitbeschäftigte			
Geringfügig Beschäftigte			
<b>Insgesamt</b>			
- hiervon karenziert			

##### C.2. Anzahl Mitarbeiter/innen nach Bundesländern/Ausland

Wien	
Steiermark	
Oberösterreich	
Salzburg	
Tirol	
Kärnten	
Vorarlberg	
Burgenland	
Niederösterreich	
Ausland	

#### D. Zweigstellen und Repräsentanzen

Die nachfolgenden Informationen sind anzugeben für:

- i. Inländische nichtprotokolierte Zweigstellen
- ii. Inländische protokollierte Zweigstellen
- iii. Ausländische Zweigstellen
- iv. Ausländische Repräsentanzen

OeNB Identnummer	
Firmenbuchnummer/Zusatz	

Firmenwortlaut		
Sitzadresse:	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Postadresse:	Postfach	
	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Bundesland		
SWIFT-Code (Angabe bei Zweigstellen mit Sitz im Inland)		
SEPA-Routing BIC		
Telefonnummer		
Telefax		
E-Mail		
Homepage		
Länder ISO-Code		

## E. Ausländische Tochterinstitute

### E.1. Allgemeine Angaben

OeNB Identnummer		
Firmenwortlaut		
Rechtsform		
Postadresse:	Postfach	
	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
SWIFT-Code		
Telefonnummer		
Telefax		
E-Mail		
Homepage		
Länder ISO-Code		
LEI (Legal Entity Identifier)		
NACE gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006		
Anzahl der Zweigstellen		
Anzahl der Mitarbeiter/innen		
Rechnungslegungsstandard – unkonsolidiert		<i>[1 – nationaler Rechnungslegungsstandard; 2 – IFRS]</i>

**E.2. Organwalter/innen und Funktionsträger/innen ausländischer Tochterinstitute**

OeNB Identnummer	
Funktion (gemäß Tabelle „Übersicht Funktionen“)	[ <i>Funktionsnummer</i> ]

**Tabelle „Übersicht Funktionen“**

<b>Funktionsnummer</b>	<b>Funktionsbezeichnung</b>
31	Vorstandsmitglied
37	Verwaltungsratsvorsitzende/r bzw. Verwaltungsratspräsident/in
38	Verwaltungsrat (Stellvertreter/in des/der Vorsitzenden)
40	Verwaltungsratsmitglied/Verwaltungsrat
43	Vorstand (Vorsitzende/r)
46	Vorstand (Stellvertreter/in des/der Vorsitzenden)
49	Obmann/frau (Genossenschaft)
50	Obmann/frau-Stellvertreter/in (Genossenschaft)
51	Geschäftsleiter/in (Genossenschaft)
52	Geschäftsführer/in
53	Geschäftsführer/in-Stellvertreter/in
60	Ständige/r Vertreter/in von Zweigstellen gemäß § 9 BWG
62	Aufsichtsrat (Vorsitzende/r)
63	Aufsichtsrat (Stellvertreter/in des/der Aufsichtsratsvorsitzenden)
65	Aufsichtsrat (Mitglied, außer Arbeitnehmervertreter/innen)
144	Aufsichtsrat (Arbeitnehmervertreter/innen)
103	Staatskommissär/in
104	Staatskommissär/in-Stellvertreter/in
109	Leiter/in der internen Revision
123	Abschlussprüfer
141	Risk Officer gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013
142	Compliance Officer gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013
143	Technical Officer gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013

**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 <sup>1</sup>
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	IRB-Ansatz mit eigenen Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 7 und <del>Abs. 9</del> 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)
[jeweils: 1 – Ja; 2 – Nein]					
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

<sup>1</sup> Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

**A.3. Beteiligungen**

OeNB Identnummer	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup>
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]
Residueller 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 <sup>1</sup>
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 <del>ff</del> )	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

**Kommentiert [RJ1]:** Statt „ff“ konkrete Angabe der Artikel (Art. 283 bis ...).

<sup>1</sup> Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

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

OeNB Identnummer	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup>
Schuldtitle (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]

<sup>1</sup> Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

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

		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene <sup>1</sup>
Schuldtitel:	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 <sup>1</sup>
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 <sup>1</sup>
Vereinfachte strukturelle Liquiditätsquote (simplified NSFR) gemäß Teil 6, Titel IV, Kapitel 6 <del>der</del> CRR	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

<sup>1</sup> Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.