

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 erster Satz und 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				xxxxxxx
Lit. c (Risikopositionen gegenüber Unternehmen)					
Lit. d (Risikopositionen aus dem Mengengeschäft)		xxxxxxx			xxxxxxx

A.3. Behandlung von Beteiligungen im Rahmen des IRB-Ansatzes (bis zum 31.12.2029)

OeNB Identnummer			
		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Berechnung gemäß Art. 133 CRR		<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Sofern keine Berechnung gemäß Art. 133 CRR erfolgt:	Einfacher risikogewichteter Ansatz (Art. 155 Abs. 2 CRR ²)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	PD/LGD-Ansatz (Art. 155 Abs. 3 CRR ²)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Internes Modell (Art. 155 Abs. 4 CRR ²)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 495 CRR ²)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial use“, Art. 150 Abs. 1 lit. g und h CRR ²)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

B. Kreditrisikominderung gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 4 CRR

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

C. Verbriefung gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 5 CRR

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

D. Gegenparteiausfallsrisiko gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 6 CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Standardansatz (Art. 274 bis 280f 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 bis 294 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

E. Marktrisiko gemäß Teil 3 Titel IV CRR**E.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]

E.2. Standardansatz

		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
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 (Teil 3 Titel IV Kapitel 4 CRR):	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]

E.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]

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

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Standardansatz (Art. 383 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Basisansatz (Art. 384 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Vereinfachter Ansatz (Art. 385 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

G. Strukturelle Liquiditätsquote gemäß Teil 6 Titel IV CRR

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

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

² Gemäß Art. 495 Abs. 1 Buchstabe b CRR bezieht der Verweis sich auf die vor dem 8. Juli 2024 gültige Fassung der CRR, somit auf Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichtsanforderungen 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) 2023/2869, ABl. Nr. L 2023/2869 vom 20.12.2023.