

# **Anlage 1B**

## **ZKR-Verbriefungsmeldung Kreditinstitute**

**gemäß § 2 Abs. 1 ZKRM-V**

<b>ZKRM-V Anlage 1B ZKR-Verbriefungsmeldung - Strukturierte Kreditprodukte Kreditinstitute</b>	
<b>Stammdateninformation</b>	
Code Produkttyp	
Typ Verbriefung	
Geographische Zuordnung Referenzwert Land/Region	
Code Marktwert	
<b>Obligoinformation</b>	
Marktwert/Modellwert	
Nominale	
IFRS Fair Value	
IFRS Available for Sale	
IFRS Held-to-Maturity	
IFRS Loans & Receivables	
Buchwert (UGB) bilanziell	
Buchwert (UGB) Kreditderivate	
Forderungswert (Exposure Value) bilanziell	
Forderungswert (Exposure Value) Kreditderivate	
<b>Risikoinformation</b>	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ratingsystem	
Bonitätsklasse	
Ausfallwahrscheinlichkeit (PD)	
Gewichtete Forderungsbeträge (RWA)	
Ansatz	

<b>Sicherheitenmeldung ZKR-Verbriefungsmeldung Kreditinstitute</b>	<b>Wert der Sicherheit</b>
<b>gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anrechenbare Sicherheiten</b>	
- hievon persönliche Sicherheiten	
- hievon öffentliche Haftung	
- hievon Haftung anderes meldepflichtiges Institut	
- hievon Kreditderivate	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon Immobiliensicherheiten	
- hievon sonstige Sachsicherheiten	
- hievon finanzielle Sicherheiten	
<b>Sicherheiten gemäß internem Risikomanagement</b>	
- hievon Kreditderivate des Handelsbuchs	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon Kreditderivate des Bankbuchs	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon finanzielle Sicherheiten	
<b>Synthetische Verbriefungen</b>	