

Anlage 2A

Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten – CRR-Finanzinstitute (monatliche Meldung)

Anlage 2A 1
Kredite und Kreditzusagen

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ⁴
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

⁴ Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldner Ebene aggregiert werden.

Anlage 2A 2

**Nicht-verbrieftete Anteilsrechte, Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 575/2013
(exkl. Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze**

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Brutto-Buchwert
Nominale
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ⁴
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

⁴ Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldner Ebene aggregiert werden.

Anlage 2A 3 Gehaltene Wertpapiere

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Art des Instruments

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Ausstehender Nominalwert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ⁴
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

⁴ Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldner Ebene aggregiert werden.

Anlage 2A 4
Gegenparteien

Risikodaten zu Gegenparteien

Gegenpartei Identnummer
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Ausfallwahrscheinlichkeit

Anlage 2A 5
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

