

Beilagen zur Datenmodellverordnung 2018

Grau markierte Zellen in den Schaubildern dieser Verordnung sind nicht zu melden.

Beilage Aa Kredit-Cube

Beilage Aa1 Kredit-Cube MONSTAT

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										
Kredit-Verwendungszweck										
Kreditübertragung An- oder Verkauf										
Kreditübertragung Art										

Kreditübertragung serviciert Kennzeichen										
NACE										
Notional Cash Pooling Kennzeichen										
Reverse Repos Kennzeichen										
Sektor ESVG										
Sektor Geschäftspartner Kreditübertragung										
Sitzland										
Sitzland Geschäftspartner Kreditübertragung										
Treuhand Kennzeichen										
Überfällige Forderungen Kennzeichen										
Ursprungslaufzeit										
Vertragliche Restlaufzeit										
Verzinsungsart										
Währung										
Zinsanpassungsrestlaufzeit										
Buchwert										
direkte Ab-/Zuschreibung										
Einzelwertberichtigung gesamt										
in aktueller Periode angekaufter Kredit (Einzelkredit)										
in aktueller Periode verkaufter Kredit (Einzelkredit)										
Marktwert										
nicht-ausgenützter Rahmen										
ausstehender Nominalwert										
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG										
Reklassifikation										
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien										
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)										
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)										

Beilage Aa2 Kredit-Cube MONSTAT und ZINSSTAT

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Anfängliche Zinsbindungsfrist										
Besicherung Zinsstat Kennzeichen										
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										
Kredit-Verwendungszweck										
Kredithöhenklasse Neugeschäft										
Kredithöhenklasse Neukreditvergabe										
Kreditübertragung An- oder Verkauf										
Kreditübertragung Art										

Reklassifikation										
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien										
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)										
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)										

Beilage Aa3 Kredit-Cube MONSTAT und ZINSSTAT Finanzmarktstabilität ohne Länderrisiko

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Anfängliche Zinsbindungsfrist										
Begründung für Neukreditvergabe										
Besicherung Zinsstat Kennzeichen										
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
Kapital-Restlaufzeit										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										
Kredit-Verwendungszweck										
Kredithöhenklasse Neugeschäft										
Kredithöhenklasse Neukreditvergabe										

Kreditübertragung An- oder Verkauf										
Kreditübertragung Art										
Kreditübertragung serviciert Kennzeichen										
NACE										
Notional Cash Pooling Kennzeichen										
Reverse Repos Kennzeichen										
Sektor ESVG										
Sektor Geschäftspartner Kreditübertragung										
Sitzland										
Mandant Identnummer										
Sitzland Geschäftspartner Kreditübertragung										
Tilgungsart										
Tilgungsträger Kennzeichen										
Treuhand Kennzeichen										
Überfällige Forderungen Kennzeichen										
Ursprungslaufzeit										
Vertragliche Restlaufzeit										
Verzinsungsart										
Währung										
Zinsanpassungsrestlaufzeit										
Buchwert										
direkte Ab-/Zuschreibung										
Einzelwertberichtigung gesamt										
in aktueller Periode angekaufter Kredit (Einzelkredit)										
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (ausstehender Nominalwert)										
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neugeschäft)										
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neukreditvergabe)										
kapitalgewichteter Effektivzinssatz (Neugeschäft)										
in aktueller Periode verkaufter Kredit (Einzelkredit)										

Marktwert										
nicht-ausgenützter Rahmen										
Neugeschäft										
Neukreditvergabe										
Neukreditvergabe gem. FMA										
ausstehender Nominalwert										
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG										
Reklassifikation										
Kapital-Restlaufzeit-Wert										
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen										
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien										
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)										
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)										

Beilage Aa4 Kredit-Cube MONSTAT und ZINSSTAT Finanzmarktstabilität

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Anfängliche Zinsbindungsfrist										
Art des Risikotransfers										
Außerbilanzielles Geschäft Typ LR										
Begründung für Neukreditvergabe										
Besicherung Zinsstat Kennzeichen										
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Geschäftsfall Absicherung Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
Kapital-Restlaufzeit										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										

Kredit-Verwendungszweck										
Kredithöhenklasse Neugeschäft										
Kredithöhenklasse Neukreditvergabe										
Kreditübertragung An- oder Verkauf										
Kreditübertragung Art										
Kreditübertragung serviciert Kennzeichen										
Letztrisiko Land										
Letztrisiko Sektor										
NACE										
Notional Cash Pooling Kennzeichen										
Reverse Repos Kennzeichen										
Sektor ESVG										
Sektor Geschäftspartner Kreditübertragung										
Sicherungsgeber Kennzeichen										
Sitzland										
Mandant Identnummer										
Sitzland Geschäftspartner Kreditübertragung										
Tilgungsart										
Tilgungsträger Kennzeichen										
Treuhand Kennzeichen										
Überfällige Forderungen Kennzeichen										
Ursprungslaufzeit										
Vertragliche Restlaufzeit										
Verzinsungsart										
Währung										
Zinsanpassungsrestlaufzeit										
Buchwert										
direkte Ab-/Zuschreibung										
Einzelwertberichtigung gesamt										
in aktueller Periode angekaufter Kredit (Einzelkredit)										

kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (ausstehender Nominalwert)									
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neugeschäft)									
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neukreditvergabe)									
kapitalgewichteter Effektivzinssatz (Neugeschäft)									
in aktueller Periode verkaufter Kredit (Einzelkredit)									
Marktwert									
nicht-ausgenützter Rahmen									
Neugeschäft									
Nominale									
Neukreditvergabe									
Neukreditvergabe gem. FMA									
ausstehender Nominalwert									
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG									
Reklassifikation									
Kapital-Restlaufzeit-Wert									
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen									
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien									
unwiderruflicher Kreditrahmen									
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)									
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)									

Beilage Aa5 Kredit-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität ohne Länderrisiko

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Begründung für Neukreditvergabe										
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
Kapital-Restlaufzeit										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										
Kredit-Verwendungszweck										
Kreditübertragung An- oder Verkauf										
Kreditübertragung Art										
Kreditübertragung serviciert Kennzeichen										
NACE										

Notional Cash Pooling Kennzeichen									
Reverse Repos Kennzeichen									
Sektor ESVG									
Sektor Geschäftspartner Kreditübertragung									
Sitzland									
Mandant Identnummer									
Sitzland Geschäftspartner Kreditübertragung									
Tilgungsart									
Tilgungsträger Kennzeichen									
Treuhand Kennzeichen									
Überfällige Forderungen Kennzeichen									
Ursprungslaufzeit									
Vertragliche Restlaufzeit									
Verzinsungsart									
Währung									
Zinsanpassungsrestlaufzeit									
Buchwert									
direkte Ab-/Zuschreibung									
Einzelwertberichtigung gesamt									
in aktueller Periode angekaufter Kredit (Einzelkredit)									
in aktueller Periode verkaufter Kredit (Einzelkredit)									
Marktwert									
nicht-ausgenützter Rahmen									
Neukreditvergabe gem. FMA									
ausstehender Nominalwert									
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG									
Reklassifikation									
Kapital-Restlaufzeit-Wert									
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen									

Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien										
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)										
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)										

Beilage Aa6 Kredit-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität

Attribut	Einmalkredite	Kreditkartenkredite	Revolvierende Kredite und Überziehungen	Finance Leasing	Anteilsrechte nicht in Form von Wertpapieren	Finanzderivate mit nicht negativem Brutto-Marktwert	Außerbilanzielle Geschäfte gem. Anhang I CRR (exkl. Kreditderivate, Kreditrahmen)	Sonstige Forderungen	Sonstige Aktiva aus Zwischenkonten	Sonstige Aktiva aus Schwebender Verrechnung
Art des Risikotransfers										
Außerbilanzielles Geschäft Typ LR										
Begründung für Neukreditvergabe										
Bilanzposition local GAAP										
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen										
Geschäftsfall Absicherung Kennzeichen										
Immobilienbesicherung Kennzeichen										
Kapital-Restlaufzeit										
KI Gruppe Mitglied Ident										
Konsortial Kredit Kennzeichen										
Kredit-Verwendungszweck										
Kreditübertragung An- oder Verkauf										

Neukreditvergabe gem. FMA ausstehender Nominalwert										
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG										
Reklassifikation										
Kapital-Restlaufzeit-Wert										
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen										
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien unwiderruflicher Kreditrahmen										
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)										
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)										

Beilage Ab Einlagen- und Sachkonten-Cube

Beilage Ab1 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sitzland						
Sparen						
Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						
BETRAG(Marktwert)						

Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ab2 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT und ZINSSTAT

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sitzland						
Sparen						
Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						
BETRAG(Marktwert)						
Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						

kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (ausstehender Nominalwert)						
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neugeschäft)						
Neugeschäft						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ab3 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT und ZINSSTAT Finanzmarktstabilität ohne Länderrisiko

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
Kapital-Restlaufzeit						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sitzland						
Mandant Identnummer						
Sparen						
Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						

BETRAG(Marktwert)						
Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (ausstehender Nominalwert)						
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neugeschäft)						
Neugeschäft						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Kapital-Restlaufzeit-Wert						
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ab4 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT und ZINSSTAT Finanzmarktstabilität

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Art des Risikotransfers						
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
Geschäftsfall Absicherung Kennzeichen						
Kapital-Restlaufzeit						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Letztrisiko Land						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sicherungsgeber Kennzeichen						
Sitzland						
Mandant Identnummer						
Sparen						

Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						
BETRAG(Marktwert)						
Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (ausstehender Nominalwert)						
kapitalgewichteter annualisierter Jahreszinssatz (Neugeschäft)						
Neugeschäft						
Nominale						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Kapital-Restlaufzeit-Wert						
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ab5 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität ohne Länderrisiko

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
Kapital-Restlaufzeit						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sitzland						
Mandant Identnummer						
Sparen						
Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						

BETRAG(Marktwert)						
Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Kapital-Restlaufzeit-Wert						
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ab6 Einlagen- und Sachkonten-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität

Attribut	Einlagen	Sachkonten	Finanzderivate mit negativem Brutto-Marktwert	Sonstige Passiva aus Zwischenkonten	Sonstige Passiva aus Schwebender Verrechnung	Mindestreserve Netto Soll
Art des Risikotransfers						
Bilanzposition local GAAP						
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen						
Geschäftsfall Absicherung Kennzeichen						
Kapital-Restlaufzeit						
KI Gruppe Mitglied Ident						
Konsortial Kredit Kennzeichen						
Kündigungsfrist						
Letztrisiko Land						
Notional Cash Pooling Kennzeichen						
Repo Kennzeichen						
Sachkontokategorie						
Sektor ESVG						
Sicherungsgeber Kennzeichen						
Sitzland						
Mandant Identnummer						
Sparen						

Treuhand Kennzeichen						
Übertragbar Kennzeichen						
Ursprungslaufzeit						
Währung						
BETRAG(Marktwert)						
Buchwert						
direkte Ab-/Zuschreibung						
Nominale						
ausstehender Nominalwert						
Reklassifikation						
Kapital-Restlaufzeit-Wert						
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen						
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)						
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)						

Beilage Ac Wertpapier-Cube

Beilage Ac1 Wertpapier-Cube MONSTAT

Attribut	Wertpapiere
Anlage- oder Umlaufvermögen	
Bilanzposition local GAAP	
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen	
Handelsbuch Kennzeichen	
Instrument ID	
ISIN	
Kapitalsicherheit unter 100 Kennzeichen	
KI Gruppe Mitglied Ident	
OeNB Identnummer Schuldner	
OeNB Identnummer Schuldner Hauptanstalt	
Short Position Kennzeichen	
Mandant Identnummer	
Treuhand Kennzeichen	
Ursprungslaufzeit	
Wertpapierklassifikation	
Buchwert	
direkte Ab-/Zuschreibung	
Emission	
Einzelwertberichtigung gesamt	
Marktwert	
Nominale	
ausstehender Nominalwert	

Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG	
Stück	
Tilgung	
Zinsabgrenzung Haben aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Haben sonstige (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll sonstige (Kundensicht)	

Beilage Ac2 Wertpapier-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität ohne Länderrisiko

Attribut	Wertpapiere
Anlage- oder Umlaufvermögen	
Bilanzposition local GAAP	
Börse notiert Kennzeichen	
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen	
Handelsbuch Kennzeichen	
Instrument ID	
ISIN	
Kapital-Restlaufzeit	
Kapitalsicherheit unter 100 Kennzeichen	
KI Gruppe Mitglied Ident	
Nachrangigkeit	
OeNB Identnummer Schuldner	
OeNB Identnummer Schuldner Hauptanstalt	
Short Position Kennzeichen	
Mandant Identnummer	
Treuhand Kennzeichen	
Ursprungslaufzeit	
Wertpapierklassifikation	
Buchwert	
direkte Ab-/Zuschreibung	
Emission	
Einzelwertberichtigung gesamt	
Marktwert	

Nominale	
ausstehender Nominalwert	
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG	
Kapital-Restlaufzeit-Wert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Stück	
Tilgung	
Zinsabgrenzung Haben aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Haben sonstige (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll sonstige (Kundensicht)	

Beilage Ac3 Wertpapier-Cube MONSTAT Finanzmarktstabilität

Attribut	Wertpapiere
Anlage- oder Umlaufvermögen	
Art des Risikotransfers	
Bilanzposition local GAAP	
Börse notiert Kennzeichen	
Eigene Auslandsfiliale Kennzeichen	
Handelsbuch Kennzeichen	
Instrument ID	
ISIN	
Kapital-Restlaufzeit	
Kapitalsicherheit unter 100 Kennzeichen	
KI Gruppe Mitglied Ident	
Letztrisiko Land	
Letztrisiko Sektor	
Nachrangigkeit	
OeNB Identnummer Schuldner	
OeNB Identnummer Schuldner Hauptanstalt	
Short Position Kennzeichen	
Mandant Identnummer	
Treuhand Kennzeichen	
Ursprungslaufzeit	
Wertpapierklassifikation	
Buchwert	
direkte Ab-/Zuschreibung	

Emission	
Einzelwertberichtigung gesamt	
Marktwert	
Nominale	
ausstehender Nominalwert	
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG	
Kapital-Restlaufzeit-Wert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Stück	
Tilgung	
Zinsabgrenzung Haben aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Haben sonstige (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll aus Agio/Disagio (Kundensicht)	
Zinsabgrenzung Soll sonstige (Kundensicht)	

Beilage Ad Ausprägungen der Attribute aus den SmartCube-Schaubildern

Bezeichnung	Ausprägungen
Bilanzseite	Aktiv in der Bilanz Passiv in der Bilanz Aktiv nur unter der Bilanz Passiv nur unter der Bilanz Nicht in der Bilanz
	Nicht-finanzielle Unternehmen Zentralbank MFIs - CRD - MiRe-pflichtig MFIs - Nicht-CRD, other MFIs MFIs - CRD - nicht MiRe-pflichtig Kreditinstitute (MFI) nicht zuordenbar Geldmarktfonds Rentenfonds Sonstige Fonds Immobilienfonds Aktienfonds Hedgefonds Gemischte Fonds Investmentfonds nicht zuordenbar Andere finanzielle Unternehmen (exkl. Versicherungen und Pensionskassen) Betriebliche Vorsorgekassen Clearinghäuser Financial Vehicle Corporations (FVCs) Finanzleasinggesellschaften Sonstige Finanzinstitute nicht zuordenbar Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten Finanzielle Head-Offices Firmeneigene Finanzinstitute und Kapitalgeber ohne Privatstiftungen (Holdings)

<p>Sektor ESVG</p>	<p>Privatstiftungen nach dem Privatstiftungsgesetz Sparkassenstiftungen (Anteilsverwaltungen) Pfandhäuser mit Kreditvergabe Ausländische Nicht-Holdinggesellschaften Firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber nicht zuordenbar Versicherungsgesellschaften Pensionskassen (Alterssicherungssysteme) Zentralstaat Länder (inkl. Landeskammern, Landesfonds) Gemeinden (inkl. Gemeindefonds und -verbände) Sozialversicherung Staat nicht zuordenbar Selbständigenhaushalte (mit u. ohne Arbeitnehmer) Sonstige private Haushalte Private Haushalte nicht zuordenbar Private Organisationen ohne Erwerbszweck</p>
<p>Vertragliche Restlaufzeit</p>	<p>Keine Frist 1 Tag Bis ein Monat 1-3 Monate 3-6 Monate 6-12 Monate > 1 Jahr <= 2 Jahre > 2 Jahre <= 3 Jahre</p>
<p>Kapital-Restlaufzeit</p>	<p>> 3 Jahre <= 4 Jahre > 4 Jahre <= 5 Jahre > 5 Jahre <= 7 Jahre > 7 Jahre <= 10 Jahre > 10 Jahre <= 15 Jahre > 15 Jahre <= 20 Jahre 20 Jahre plus</p>

Art des Risikotransfers	Hauptanstalt-Zweiganstalt-Beziehung Lookthrough Underlying Kein Risikotransfer Finanzgarantie (exkl. Kreditderivat) Andere Garantien Kreditderivat (als Finanzgarantie verwendet) Kreditderivat (nicht als Finanzgarantie verwendet) Wohnimmobilie Büros und sonstige Gewerberäume Sonstige Gewerbeimmobilien Bareinlage oder bargeldähnliche Instrumente Wertpapiere (exklusive Anteilsrechte und Investmentfondanteile) Anteilsrechte und Investmentfondsanteile Gold Forderungen aus Warenlieferungen und Dienstleistungen Kredite An das kreditgebende Institut verpfändete Lebensversicherung Sonstige Sachsicherheit Andere Sicherheiten
Außerbilanzielles Geschäft Typ LR	Garantien Kreditzusagen Sonstige außerbilanzielle Geschäfte

Letztrisiko Sektor	<p>Nicht-finanzielle Unternehmen Zentralbank MFIs - CRD - MiRe-pflichtig MFIs - Nicht-CRD, other MFIs MFIs - CRD - nicht MiRe-pflichtig Kreditinstitute (MFI) nicht zuordenbar Geldmarktfonds Rentenfonds Sonstige Fonds Immobilienfonds Aktienfonds Hedgefonds Gemischte Fonds Investmentfonds nicht zuordenbar Andere finanzielle Unternehmen (exkl. Versicherungen und Pensionskassen) Betriebliche Vorsorgekassen Clearinghäuser Financial Vehicle Corporations (FVCs)</p>
Sektor Geschäftspartner Kreditübertragung	<p>Finanzleasinggesellschaften Sonstige Finanzinstitute nicht zuordenbar Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten Finanzielle Head-Offices Firmeneigene Finanzinstitute und Kapitalgeber ohne Privatstiftungen (Holdings) Privatstiftungen nach dem Privatstiftungsgesetz Sparkassenstiftungen (Anteilsverwaltungen) Pfandhäuser mit Kreditvergabe Ausländische Nicht-Holdinggesellschaften Firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber nicht zuordenbar Versicherungsgesellschaften Pensionskassen (Alterssicherungssysteme) Zentralstaat</p>

	<p>Länder (inkl. Landeskammern, Landesfonds) Gemeinden (inkl. Gemeindefonds und -verbände) Sozialversicherung Staat nicht zuordenbar Selbständigenhaushalte (mit u. ohne Arbeitnehmer) Sonstige private Haushalte Private Haushalte nicht zuordenbar Private Organisationen ohne Erwerbszweck Nicht zuordenbar</p>
Sachkontokategorie	<p>Kassenbestand/Bargeld - Heimatwährung Fonds für allgemeine Bankrisiken GuV Kapital Rücklagen Rückstellung für Abfertigungen Rückstellungen für Pensionen Sachanlagen Sonstige Aktiva Sonstige Passiva</p>
Anlage- oder Umlaufvermögen	<p>Anlagevermögen Umlaufvermögen Kein Betriebsvermögen</p>

Bilanzposition local GAAP	<p>Nicht in der Bilanz Aktiv nur unter der Bilanz Passiv nur unter der Bilanz Schuldtitel öffentlicher Stellen und Wechsel, die zur Refinanzierung bei der Zentralnotenbank zugelassen sind Forderungen an Kreditinstitute Forderungen an Kunden (Nichtbanken) Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche Wertpapiere Aktien und andere nicht festverzinsliche Wertpapiere Beteiligungen Anteile an verbundenen Unternehmen Sonstige Aktivposten Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstituten Verbindlichkeiten gegenüber Kunden (Nichtbanken) Verbriefte Verbindlichkeiten Sonstige Passivposten</p>
	<p><u>Beilagen Aa1 bis Aa6 und Beilagen Ab1 bis Ab6:</u> Keine Frist 1 Tag Bis ein Monat 1-3 Monate 3-6 Monate 6-12 Monate > 1 Jahr <= 2 Jahre > 2 Jahre <= 3 Jahre 3-5 Jahre 5-10 Jahre 10 Jahre plus</p>

<p>Ursprungslaufzeit</p>	<p><u>Beilagen Ac1 bis Ac3:</u> Keine Frist 1 Tag > 1 Tag <= 1 Woche > 1 Woche <= 2 Wochen > 2 Wochen <= 1 Monat > 1 Monat <= 2 Monate > 2 Monate <= 3 Monate > 3 Monate <= 4 Monate > 4 Monate <= 5 Monate > 5 Monate <= 6 Monate > 6 Monate <= 9 Monate > 9 Monate <= 12 Monate > 1 Jahr <= 2 Jahre > 2 Jahre <= 3 Jahre > 3 Jahre <= 4 Jahre > 4 Jahre <= 5 Jahre > 5 Jahre <= 7 Jahre > 7 Jahre <= 10 Jahre > 10 Jahre <= 15 Jahre > 15 Jahre <= 20 Jahre > 20 Jahre <= 30 Jahre > 30 Jahre</p>
<p>Wertpapierklassifikation</p>	<p>Verbriefungstranche Investmentzertifikat Geldmarktfondsanteile Schuldverschreibung Credit Linked Note Aktien Partizipationsscheine Sonstige Wertpapiere Begebene Wertpapiere - Lead Management</p>

Kredit-Verwendungszweck	Kredit für Schaffung und Erhaltung von Wohnraum Konsumkredit Kredit für Immobilienfinanzierung Sonstige Ausleihungen
Kreditübertragung An- oder Verkauf	Verkauf ohne Einfluss auf die Bilanz Verkauf mit Einfluss auf die Bilanz Ankauf ohne Einfluss auf die Bilanz Ankauf mit Einfluss auf die Bilanz Kein An-/Verkauf
Kreditübertragung Art	Factoring/Forfaitierung mit Regress Factoring/Forfaitierung ohne Regress True Sales-Verbriefung Sonstige
NACE	Dieser Code ist 5-stellig alphanumerisch und folgt der österreichischen Version (ÖNACE) der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige in der Europäischen Gemeinschaft (franz.: Nomenclature statistique des activités économiques dans la Communauté européenne), meist nur als NACE bezeichnet.
Verzinsungsart	Keine Verzinsung Fix Variabel (indikatorgebunden) ohne Fixzinsphase Variabel (sonstige) Fixzinsstaffel Gemischt
Zinsanpassungsrestlaufzeit	Keine Frist 1 Tag Bis 1 Jahr > 1 Jahr <= 2 Jahre 2 Jahre plus

Anfängliche Zinsbindungsfrist	Keine Frist 1 Tag Bis 3 Monate 3-12 Monate 1-3 Jahre 3-5 Jahre 5-10 Jahre 10 Jahre plus
Kredithöhenklasse Neugeschäft	Bis zu 0,25 Mio. 0,25 bis 1 Mio.
Kredithöhenklasse Neukreditvergabe	Über 1 Mio.
Begründung für Neukreditvergabe	Personen mit währungskongruentem Einkommen Personen mit anderen währungskongruenten Einnahmen Vermögende Privatkunden bester Bonität Rahmenüberziehungen Neuverhandlung der Kreditvereinbarung hinsichtlich Kreditwährung Neuverhandlung der Kreditvereinbarung hinsichtlich sonstiger Konditionen Sonstige – Vergabe gemäß Mindeststandard konform
Tilgungsart	Ratentilgung Endfällig Sonstige
Kündigungsfrist	Keine Frist 1 Tag Bis 3 Monate 3-12 Monate > 1 Jahr <= 2 Jahre 2 Jahre plus
Nachrangigkeit	Nachrangkapital Ergänzungskapital Nicht bevorrechtigt Vorrangig

Sitzland Geschäftspartner Kreditübertragung	Der Code ist 2-stellig alphanumerisch und wird innerhalb der Regeln für den ISO 3166 vergeben. Der ISO 3166 ist ein Standard für die Kodierung von geographischen Einheiten, herausgegeben von der Internationalen Organisation für Normung (ISO). Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.
Sitzland	Der Code ist 2-stellig und alphanumerisch. Er ist entweder die Kodierung von einer geographischen Einheit, herausgegeben von der Internationalen Organisation für Normung (ISO) nach ISO 3166 oder die Kodierung einer relevanten Internationalen Organisation gemäß ISO-Norm. Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.
Sparen	Bauspareinlagen Sparkarten Sparbriefe Sparbücher Online Sparen Sonstige nicht-BWG konforme Sparprodukte
Währung	Der Code ist 3-stellig alphanumerisch und wird innerhalb der Regeln für den ISO 4217 vergeben. Der ISO 4217 ist ein Standard für die Kodierung von Währungen, herausgegeben von der internationalen Organisation für Normung (ISO). Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.
Letztrisiko Land	Der Code ist 2-stellig und alphanumerisch. Er ist entweder die Kodierung von einer geographischen Einheit, herausgegeben von der Internationalen Organisation für Normung (ISO) nach ISO 3166 oder die Kodierung einer relevanten Internationalen Organisation gemäß ISO-Norm. Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.
Attribute mit dem Suffix „Kennzeichen“	WAHR FALSCH

Beilage B1 Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten CRR-Kreditinstitute**Beilage B1a Kredite und Kreditzusagen*****Instrument-Daten***

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Rechtsträger Kennzeichen		
Vertrag ID		
Art des Instruments		
Schuldnergruppe Kennzeichen		
Währung		
Vertragsabschluss Datum		
Rechtlich endgültig fällig Datum		
Treuhand Kennzeichen		
Nachrangigkeit		
Abwicklungstermin Datum		
Projektfinanzierungskredit Kennzeichen		
Kurzfristige Rückzahlungsansprüche Kennzeichen		
Rückgriff Kennzeichen		
Verzinsungsart		
Häufigkeit der Zinsanpassung		
Ende des Zeitraums ausschließlicher Zinszahlungen Datum		
Referenzzinssatz		
Referenzzinssatz Fälligkeit		
Kredit-Verwendungszweck		
Tilgungsart		
Zahlungshäufigkeit		

Konsortialvertragskennung ID		
Zinsspanne/Marge		
Zinsobergrenze		
Zinsuntergrenze		
Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken vor dem Kauf ursprünglich eingeräumter Rahmen		

Finanzdaten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Nächster Zinsanpassungstermin Datum		
Ausfallstatus des Instruments Datum		
Überfällig seit Datum		
Verbrieft		
Verbriefungsart		
Ratingsystem intern		
Bonitätsklasse intern		
OeNB Kreditforderungs ID		
ausstehender Nominalwert		
Rückstände		
übertragener Betrag		
annualisierter vereinbarter Jahreszinssatz		
nicht-ausgenützter Rahmen		
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht)		
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht)		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Daten zu Vertragspartner-Instrument

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Vertragspartner Identnummer		
Instrument ID		
Rolle		

Daten zu Verbindlichkeiten mit mitschuldnerischer Haftung

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Vertragspartner Identnummer		
Instrument ID		
Betrag der Verbindlichkeiten mit mitschuldnerischer Haftung		

Daten zu Instrument-empfangene Sicherheit

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Sicherheiten ID		
Zerlegungsansatz		
anrechenbarer Wert der Sicherheit		
vorrangige Ansprüche Dritter		

Beilage B1b Nicht-verbrieftete Anteilsrechte, außerbilanzielle Geschäfte (gem. CRR, Anhang I, exkl. Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze

Instrument-Daten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Rechtsträger Kennzeichen		
Art des Instruments		
Schuldnergruppe Kennzeichen		

Finanzdaten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Ratingsystem intern		
Bonitätsklasse intern		
Buchwert		
Nominale		
nicht-ausgenützter Rahmen		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Daten zu Vertragspartner-Instrument

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Vertragspartner Identnummer		
Instrument ID		
Rolle		

Daten zu Instrument-empfangene Sicherheit

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Sicherheiten ID		
Zerlegungsansatz		
anrechenbarer Wert der Sicherheit		

Daten zu Underlyings von Kreditderivaten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Underlying ID		
Instrument ID		
ISIN		
Vertragspartner Identnummer		
Nominale		

Beilage B1c gehaltene Wertpapiere

Daten zu Instrument-empfangene Sicherheit

Attribut	Schuldverschreibungen und verbriefte Anteilsrechte	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Sicherheiten ID		
Zerlegungsansatz		
anrechenbarer Wert der Sicherheit		

Wertpapier-Daten zu Ratings und Risikoindikatoren

Attribut	Schuldverschreibungen und verbriefte Anteilsrechte	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Ratingsystem intern		
Bonitätsklasse intern		
Ratingsystem standardisiert		
Bonitätsklasse standardisiert		
Verbriefungsart		
Weighted Average Life		
Attachment Point		
Detachment Point		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Daten zu Underlyings von Kreditderivaten

Attribut	Schuldverschreibungen und verbriefte Anteilsrechte	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Underlying ID		
Instrument ID		

ISIN		
Vertragspartner Identnummer		
Nominale		

Beilage B1d Vertragspartner und Exposure-zugeordnete Einheiten***Daten zu Vertragspartnern und Exposure-zugeordnete Einheiten***

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000 bzw. natürliche Person über 350.000
Vertragspartner Identnummer	
Ausfallstatus Datum	
Ratingsystem intern	
Bonitätsklasse intern	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Beilage B1e Sicherheiten***Daten zu empfangenen Sicherheiten***

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Sicherheiten ID		
Vertragspartner Identnummer		
Fälligkeitstag der Sicherheit Datum		
Art der Sicherheit		
Land der Immobiliensicherheit		
PLZ der Immobiliensicherheit		
Ansatz der Sicherheitenbewertung		
Wert der Sicherheit Datum		
Ursprünglicher Wert der Sicherheit Datum		
ursprünglicher Wert der Sicherheit		
Marktwert		
CRR Beleihungswert		
beizulegender Zeitwert		
Nominale		
anderer Wert der Sicherheit		

Beilage B1f Meldung der institutsinternen Ratingsysteme

Auflistung der Ratingsysteme

Attribut	geratete Kreditnehmer, Exposure-zugeordnete Einheiten und Instrumente
Ratingsystem intern	
Ratingsystem Quelle Identnummer	
Abgenommenes IRB Ratingsystem Kennzeichen	
Bezeichnung Ratingsystem	

Bonitätsklassen je Ratingsystem

Attribut	geratete Kreditnehmer, Exposure-zugeordnete Einheiten und Instrumente
Bonitätsklasse intern	
Ratingsystem intern	
Beschreibung Bonitätsklasse	
PD-Untergrenze	
PD-Obergrenze	

Beilage B2 Bilanz- und Risikodaten CRR-Kreditinstitute**Beilage B2a Kredite und Kreditzusagen*****Rechnungslegungsdaten***

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Rechnungslegungsklassifikation		
Belastungsquelle		
Performing Kennzeichen		
Performing Status Datum		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus Datum		
Handelsbuch Kennzeichen		
kumulierte Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken		
Rückstellung für Kreditzusagen, Bürgschaften und Garantien		
kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall		
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen		
kumulierte Abschreibungen		
Pauschalwertberichtigungen		
Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG		
Einzelwertberichtigung		
pauschale Einzelwertberichtigung		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – individuell bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) - individuell bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 3 (IFRS 9) - Pauschale Einzelwertberichtigung		

Wertberichtigung in Stufe 3 (IFRS 9) - Einzelwertberichtigung	
---	--

Kreditrisikodaten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Forderungskategorie		
Vertragspartner Identnummer		
Risikopositionswert		
erwarteter Verlust		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Beilage B2b Nicht-verbrieftete Anteilsrechte, außerbilanzielle Geschäfte (gem. CRR, Anhang I, exkl. Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze

Kreditrisikodaten

Attribut	Rechtsträger iSd Art. 1(5) der AnaCredit-VO über 25.000	natürliche Person über 350.000
Mandant Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Forderungskategorie		
Berechnungsmethode Gegenparteiausfallsrisiko		
Vertragspartner Identnummer		
Risikopositionswert		
erwarteter Verlust		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Beilage B2c gehaltene Wertpapiere

Kreditrisikodaten

Attribut	Schuldverschreibungen und verbriefte Anteilsrechte	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Forderungskategorie		
Vertragspartner Identnummer		
Risikopositionswert		
erwarteter Verlust		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Beilage B3 Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten CRR-Finanzinstitute**Beilage B3a Kredite und Kreditzusagen*****Instrument-Daten***

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
Art des Instruments	
Schuldnergruppe Kennzeichen	

Finanzdaten

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
ausstehender Nominalwert	
nicht-ausgenützter Rahmen	

Daten zu Vertragspartner-Instrument

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Vertragspartner Identnummer	
Instrument ID	
Rolle	

Daten zu Instrument-empfangene***Sicherheit***

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
Zerlegungsansatz	

anrechenbarer Wert der Sicherheit

Beilage B3b Nicht-verbriefte Anteilsrechte, außerbilanzielle Geschäfte (gem. CRR, Anhang I, exkl. Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze

Instrument-Daten

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
Art des Instruments	
Schuldnergruppe Kennzeichen	

Finanzdaten

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
Buchwert	
Nominale	
nicht-ausgenützter Rahmen	

Daten zu Vertragspartner-Instrument

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Vertragspartner Identnummer	
Instrument ID	
Rolle	

Daten zu Instrument-empfangene Sicherheit

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	

Zerlegungsansatz	
anrechenbarer Wert der Sicherheit	

***Daten zu Underlyings von
Kreditderivaten***

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Underlying ID	
Instrument ID	
ISIN	
Vertragspartner Identnummer	
Nominale	

Beilage B3c gehaltene Wertpapiere

Instrument-Daten

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Art des Instruments		

Finanzdaten

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
ausstehender Nominalwert		

Daten zu Vertragspartner-Instrument

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Vertragspartner Identnummer		
Instrument ID		
Rolle		

Daten zu Instrument-empfangene Sicherheit

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Zerlegungsansatz		
anrechenbarer Wert der Sicherheit		

Daten zu Underlyings von Kreditderivaten

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Underlying ID		
Instrument ID		

ISIN		
Vertragspartner Identnummer		
Nominale		

Beilage B3d Vertragspartner und Exposure-zugeordnete Einheiten***Daten zu Vertragspartnern und Exposure-zugeordnete Einheiten***

Attribut	Einzel Schuldner über 350.000
Vertragspartner Identnummer	
Ratingsystem intern	
Bonitätsklasse intern	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Beilage B3e Meldung der institutsinternen Ratingsysteme

Auflistung der Ratingsysteme

Attribut	geratete Kreditnehmer, Exposure-zugeordnete Einheiten und Instrumente
Ratingsystem intern	
Ratingsystem Quelle Identnummer	
Abgenommenes IRB Ratingsystem Kennzeichen	
Bezeichnung Ratingsystem	

Bonitätsklassen je Ratingsystem

Attribut	geratete Kreditnehmer, Exposure-zugeordnete Einheiten und Instrumente
Bonitätsklasse intern	
Ratingsystem intern	
Beschreibung Bonitätsklasse	
PD-Untergrenze	
PD-Obergrenze	

Beilage B4 Bilanz- und Risikodaten CRR-Finanzinstitute**Beilage B4a Kredite und Kreditzusagen*****Rechnungslegungsdaten***

Attribut	Schuldner über 350.000
Mandant Identnummer	
Instrument ID	
Einzelwertberichtigung gesamt	

Beilage B4b gehaltene Wertpapiere***Rechnungslegungsdaten***

Attribut	Schuldverschreibungen	Verbriefungstranchen
Mandant Identnummer		
Instrument ID		
Einzelwertberichtigung gesamt		

Beilage B5 Ausprägungen der Attribute aus den Granulare Kredit Erhebung-Schaubildern

Bezeichnung	Ausprägungen
Art des Instruments	Einlagen bei anderen Instituten, außer umgekehrte Pensionsgeschäfte Überziehung Kreditkartenforderung Revolvierende Kredite (ohne Überziehungs- und Kreditkartenkredite) Kreditlinien ohne revolvierende Kredite Umgekehrte Pensionsgeschäfte Forderungen aus Warenlieferungen und Dienstleistungen Finanzierungsleasings Andere Kredite Nicht verbriefte Anteilsrechte Einlagentermingeschäfte Sonstige Zusagen Finanzgarantien (exklusive Kreditderivate) Begebene unfunded Kreditderivate Regulatorischer Netting-Satz Verbrieft Anteilsrechte Schuldverschreibungen Verbriefungstranchen Nicht relevant für GKE
Nachrangigkeit	Nachrangig Nicht nachrangig
Verzinsungsart	Fixe und keine Verzinsung Variabel verzinst Gemischt

Häufigkeit der Zinsanpassung	Nicht rückstellbar Über Nacht Monatlich Vierteljährlich Halbjährlich Jährlich Im Ermessen des Gläubigers Andere Häufigkeit
Referenzzinssatz	EURIBOR USD LIBOR GBP LIBOR EUR LIBOR JPY LIBOR CHF LIBOR MIBOR €STR SOFR Andere einzelne Referenzsätze Andere multiple Referenzsätze

Referenzzinssatz Fälligkeit	Über Nacht Eine Woche Zwei Wochen Drei Wochen Ein Monat Zwei Monate Drei Monate Vier Monate Fünf Monate Sechs Monate Sieben Monate Acht Monate Neun Monate Zehn Monate Elf Monate Zwölf Monate
Kredit-Verwendungszweck	Kredit für Schaffung und Erhaltung von Wohnraum Bauinvestitionen - Wohnimmobilien Konsumkredit Gewerbeimmobilienerwerb Lombardkredite Einführen Ausführen Bauinvestitionen – Gewerbeimmobilien Bauinvestitionen - Andere Betriebsmittelkredit Andere Zwecke

Tilgungsart	Französisch Deutsch Fester Tilgungsplan Endfällig Andere Arten der Tilgung
Zahlungshäufigkeit	Monatlich Vierteljährlich Halbjährlich Jährlich Einmaltilgung Nullkupon Andere
Verbrieft	Nicht verbrieft
Verbriefungsart	Traditionelle Verbriefung Synthetisch
Rolle	Kreditnehmer lt. GKE Gläubiger Originator Servicer Begünstigter
Zerlegungsansatz	Internes Risikomanagement CoRep

Art der Sicherheit	Finanzgarantie (exkl. Kreditderivat) Andere Garantien Kreditderivat (als Finanzgarantie verwendet) Kreditderivat (nicht als Finanzgarantie verwendet) Wohnimmobilie Büros und sonstige Gewerberäume Sonstige Gewerbeimmobilien Bareinlage oder bargeldähnliche Instrumente Wertpapiere (exklusive Anteilsrechte und Investmentfondanteile) Anteilsrechte und Investmentfondsanteile Gold Forderungen aus Warenlieferungen und Dienstleistungen Kredite An das kreditgebende Institut verpfändete Lebensversicherung Sonstige Sachsicherheit Andere Sicherheiten
Ansatz der Sicherheitenbewertung	Marktpreisbewertung Schätzung des Vertragspartners Bewertung durch den Gläubiger Bewertung durch Dritte Andere Bewertungsart
Belastungsquelle	Zentralbanken-Refinanzierung Börsengehandelte Derivate Außerbörslich gehandelte Derivate Einlagen - Rückkaufsvereinbarungen, außer mit Zentralbanken Einlagen, außer Rückkaufsvereinbarungen Begebene Schuldverschreibungen - gedeckte Schuldverschreibungen Begebene Schuldverschreibungen - forderungsunterlegte Wertpapiere Begebene Schuldverschreibungen, außer gedeckten Schuldverschreibungen und ABS Andere Belastungsquellen Keine Belastung

<p>Stundungs- und Neuverhandlungsstatus</p>	<p>Refinanzierung Instrumente mit geändertem, unter den Marktkonditionen liegendem Zinssatz Instrumente mit anderen geänderten vertraglichen Bedingungen Neu verhandeltes Instrument ohne Stundungsmaßnahmen Nicht gestundet oder neu verhandelt</p>
<p>Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke</p>	<p>Advanced-IRB-Ansatz Foundation-IRB-Ansatz Standardansatz PD-/LGD-IRB-Ansatz (Beteiligung) Internal models-IRB-Ansatz (Beteiligung) Fixed risk weights-IRB-Ansatz (Beteiligung) Simple risk weight-IRB-Ansatz (Beteiligung) SEC-IRBA SEC-IRBA (STS) SEC-SA SEC-SA (STS) SEC-SA (Wiederverbriefungen) SEC-SA (STS, Wiederverbriefungen) SEC-ERBA SEC-ERBA (STS) Interner Bemessungsansatz 1.250% für un beurteilte Verbriefungspositionen</p>
<p>Forderungskategorie</p>	<p>Onbalance Offbalance Gegenparteiausfallsrisiko</p>
<p>Berechnungsmethode Gegenparteiausfallsrisiko</p>	<p>Kein Gegenparteiausfallrisiko Ursprungsrisikomethode Marktbewertungsmethode Standardmethode Auf einem internen Modell beruhende Methode Berechnung nach Kapitel 4 CRR</p>

Land der Immobiliensicherheit	Der Code ist 2-stellig alphanumerisch und wird innerhalb der Regeln für den ISO 3166 vergeben. Der ISO 3166 ist ein Standard für die Kodierung von geographischen Einheiten, herausgegeben von der Internationalen Organisation für Normung (ISO). Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.
Risikopositionsklasse	<p>Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten oder Zentralbanken (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber öffentlichen Stellen (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber multilateralen Entwicklungsbanken (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber internationalen Organisationen (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Instituten ohne kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Unternehmen ohne kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft (STD)</p> <p>Durch Immobilien besicherte Risikopositionen (STD)</p> <p>Ausgefallene Risikopositionen (STD)</p> <p>Mit besonders hohen Risiken verbundene Risikopositionen (STD)</p> <p>Risikopositionen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)</p> <p>Risikopositionen in Form von Anteilen an Organismen für Gemeinsame Anlagen (OGA) (STD)</p> <p>Sonstige Posten (STD)</p> <p>Beteiligungspositionen (STD)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten oder Zentralbanken (IRB)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Instituten (IRB)</p> <p>Beteiligungspositionen (IRB)</p> <p>sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind (IRB)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Unternehmen – Spezialfinanzierungen (IRB)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - qualifiziert revolving (IRB)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Unternehmen – KMU (IRB)</p> <p>Risikopositionen gegenüber Unternehmen – Sonstige (IRB)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - durch Immobilien besichert, KMU (IRB)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - durch Immobilien besichert, keine KMU (IRB)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - Sonstige, KMU (IRB)</p> <p>Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - Sonstige, keine KMU (IRB)</p>

	<p>External ratings-based approach (SEC-ERBA) (Verbriefungen) Standardised approach (SEC-SA) (Verbriefungen) Internal ratings-based approach (SEC-IRBA) (Verbriefungen) Internal assessment approach (IAA) (Verbriefungen) Other (RW = 1.250%) (Verbriefungen)</p>
Währung	<p>Der Code ist 3-stellig alphanumerisch und wird innerhalb der Regeln für den ISO 4217 vergeben. Der ISO 4217 ist ein Standard für die Kodierung von Währungen, herausgegeben von der internationalen Organisation für Normung (ISO). Eine Liste der aktuellen Codes kann über die Internetadresse www.oenb.at unter Statistik/Klassifikationen/ISO-Codes abgerufen werden.</p>
Ratingsystem standardisiert	<p>Die Codeliste listet sämtliche standardisierten Ratingsysteme auf, insbesondere sind hier alle ECAI-Ratingsysteme enthalten. Das standardisierte Ratingsystem ist immer in Kombination mit Bonitätsklasse standardisiert zu verstehen.</p>
Rechnungslegungsklassifikation	<p>Guthaben bei Zentralbanken und andere Sichteinlagen Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte Nicht zu Handelszwecken gehaltene, verbindlich erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte Finanzielle Vermögenswerte, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden Finanzielle Vermögenswerte zum beizulegenden Zeitwert im sonstigen Ergebnis Finanzielle Vermögenswerte zu fortgeführten Anschaffungskosten Guthaben bei Zentralbanken Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte Nach der Kostenmethode bewertete nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte Sonstige nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte</p>

Bonitätsklasse standardisiert	Die Codeliste listet sämtliche standardisierten Bonitätsklassen auf, insbesondere sind hier alle Bonitätsklassen von ECAI-Ratings enthalten. Die standardisierte Bonitätsklasse ist immer in Kombination mit Ratingsystem standardisiert zu verstehen.
Attribute mit dem Suffix „Kennzeichen“	WAHR FALSCH

Beilage C1 SHSG und Verbriefungen - Spitzeninstitute signifikanter Bankengruppen (UGB-Konzern)**Beilage C1a Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere (Mutter und inländische Töchter, die CRR-Kreditinstitute sind)*****Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutebene***

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Vertragspartner Identnummer		
Short Position Kennzeichen		
ISIN		
Handelsbuch Kennzeichen		
Rechnungslegungsklassifikation		
Ratingsystem standardisiert		
Bonitätsklasse standardisiert		
Verbriefungsart		
Nominale		
Marktwert		
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen		
Einzelwertberichtigung		
pauschale Einzelwertberichtigung		
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG		
kumulierte Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken		
kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall		
Weighted Average Life		

Attachment Point		
Detachment Point		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Kreditrisikodaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Risikopositionswert		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Belastungsdaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Belastungsquelle		
belasteter Anteil		

**Beilage C1b Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere
(Auslandstöchter und inländische Töchter, die keine CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Vertragspartner Identnummer		
Short Position Kennzeichen		
ISIN		
Handelsbuch Kennzeichen		
Rechnungslegungsklassifikation		
Ratingsystem standardisiert		
Bonitätsklasse standardisiert		
Verbriefungsart		
Nominale		
Marktwert		
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen		
Einzelwertberichtigung		
pauschale Einzelwertberichtigung		
Pauschalwertberichtigungen und Wertberichtigungen gem. § 57 Abs. 1 BWG		
kumulierte Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken		
kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall		
Weighted Average Life		
Attachment Point		
Detachment Point		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Kreditrisikodaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Risikopositionswert		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Belastungsdaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Belastungsquelle		
belasteter Anteil		

**Beilage C1c Konzern-Daten
(Konzern)**

Wertpapierdaten auf Konzernebene

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
ISIN		
Performing Kennzeichen		
Performing Status Datum		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus Datum		
Rückstände Datum		
Ansatz LGD		
Rückstände		
Loss given default		
Risikogewicht		

Risikodaten zum Emittenten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Vertragspartner Identnummer		
Ausfallstatus Datum		
Ausfallstatus		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Beilage C2 SHSG und Verbriefungen - Spitzeninstitute signifikanter Bankengruppen (IFRS-Konzern)**Beilage C2a Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere (Mutter und inländische Töchter, die CRR-Kreditinstitute sind)*****Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutebene***

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Vertragspartner Identnummer		
Short Position Kennzeichen		
ISIN		
Handelsbuch Kennzeichen		
Rechnungslegungsklassifikation		
Ratingsystem standardisiert		
Bonitätsklasse standardisiert		
Verbriefungsart		
Nominale		
Marktwert		
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen		
Anteil des Geschäftsfalls in IFRS-Stage 1		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – individuell bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) – individuell bewertet		
Einzelwertberichtigung		
pauschale Einzelwertberichtigung		

kumulierte Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken		
kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall		
Weighted Average Life		
Attachment Point		
Detachment Point		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Kreditrisikodaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Risikopositionswert		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Belastungsdaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Belastungsquelle		
belasteter Anteil		

**Beilage C2b Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere
(Auslandstöchter und inländische Töchter, die keine CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Vertragspartner Identnummer		
Short Position Kennzeichen		
ISIN		
Handelsbuch Kennzeichen		
Rechnungslegungsklassifikation		
Ratingsystem standardisiert		
Bonitätsklasse standardisiert		
Verbriefungsart		
Nominale		
Marktwert		
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen		
Anteil des Geschäftsfalls in IFRS-Stage 1		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 1 (IFRS 9) – individuell bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) – kollektiv bewertet		
Wertberichtigung in Stufe 2 (IFRS 9) – individuell bewertet		
Einzelwertberichtigung		
pauschale Einzelwertberichtigung		
kumulierte Änderungen des beizulegenden Zeitwerts aufgrund von Ausfallrisiken		

kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall		
Weighted Average Life		
Attachment Point		
Detachment Point		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Kreditrisikodaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Exposure ID		
Instrument ID		
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke		
Risikopositionsklasse		
Risikopositionswert		
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors		

Belastungsdaten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Unternehmen Identnummer		
Instrument ID		
Belastungsquelle		
belasteter Anteil		

**Beilage C2c Konzern-Daten
(Konzern)**

Wertpapierdaten auf Konzernebene

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
ISIN		
Performing Kennzeichen		
Performing Status Datum		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus		
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus Datum		
Rückstände Datum		
Ansatz LGD		
Rückstände		
Loss given default		
Risikogewicht		

Risikodaten zum Emittenten

Attribut	Schuldverschreibungen (exkl. Verbriefungstranchen), Börsennotierte Aktien und Anteile an Geldmarktfonds und anderen Investmentfonds	Verbriefungstranchen
Vertragspartner Identnummer		
Ausfallstatus Datum		
Ausfallstatus		
Ausfallwahrscheinlichkeit		

Beilage C3 Verbriefungen - Sonstige übergeordnete Kreditinstitute (UGB-Konzern)

**Beilage C3a Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und einbehaltene Wertpapiere
(Mutter und inländische Töchter, die CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Instrument ID	
Vertragspartner Identnummer	
ISIN	
Rechnungslegungsklassifikation	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Verbriefungsart	
Nominale	
Marktwert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Kreditrisikodaten

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Exposure ID	
Instrument ID	
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke	

Risikopositionsklasse	
Risikopositionswert	
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors	

**Beilage C3b Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere
(Auslandstöchter und inländische Töchter, die keine CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Instrument ID	
Vertragspartner Identnummer	
ISIN	
Rechnungslegungsklassifikation	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Verbriefungsart	
Nominale	
Marktwert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Kreditrisikodaten

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Exposure ID	
Instrument ID	
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke	
Risikopositionsklasse	
Risikopositionswert	
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors	

Beilage C4 Verbriefungen - Sonstige übergeordnete Kreditinstitute (IFRS-Konzern)

**Beilage C4a Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere
(Mutter und inländische Töchter, die CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Instrument ID	
Vertragspartner Identnummer	
ISIN	
Rechnungslegungsklassifikation	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Verbriefungsart	
Nominale	
Marktwert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Kreditrisikodaten

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Exposure ID	
Instrument ID	

Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke	
Risikopositionsklasse	
Risikopositionswert	
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors	

**Beilage C4b Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere sowie Short-Positionen und eigene, einbehaltene Wertpapiere
(Auslandstöchter und inländische Töchter, die keine CRR-Kreditinstitute sind)**

Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Instrument ID	
Vertragspartner Identnummer	
ISIN	
Rechnungslegungsklassifikation	
Ratingsystem standardisiert	
Bonitätsklasse standardisiert	
Verbriefungsart	
Nominale	
Marktwert	
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ausfallwahrscheinlichkeit	

Kreditrisikodaten

Attribut	Tranche über 25.000
Unternehmen Identnummer	
Exposure ID	
Instrument ID	
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke	
Risikopositionsklasse	
Risikopositionswert	
risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors	

Beilage C5 Ausprägungen der Attribute aus den SHSG und Verbriefungsmeldung konsolidiert-Schaubildern

Bezeichnung	Ausprägungen
Verbriefungsart	Nicht verbrieft Traditionelle Verbriefung Synthetisch
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke	Advanced-IRB-Ansatz Foundation-IRB-Ansatz Standardansatz PD-/LGD-IRB-Ansatz (Beteiligung) Internal models-IRB-Ansatz (Beteiligung) Fixed risk weights-IRB-Ansatz (Beteiligung) Simple risk weight-IRB-Ansatz (Beteiligung) SEC-IRBA SEC-IRBA (STS) SEC-SA SEC-SA (STS) SEC-SA (Wiederverbriefungen) SEC-SA (STS, Wiederverbriefungen) SEC-ERBA SEC-ERBA (STS) Interner Bemessungsansatz 1.250% für un beurteilte Verbriefungspositionen

Belastungsquelle	Zentralbanken-Refinanzierung Börsengehandelte Derivate Außerbörslich gehandelte Derivate Einlagen - Rückkaufsvereinbarungen, außer mit Zentralbanken Einlagen, außer Rückkaufsvereinbarungen Begebene Schuldverschreibungen - gedeckte Schuldverschreibungen Begebene Schuldverschreibungen - forderungsunterlegte Wertpapiere Begebene Schuldverschreibungen, außer gedeckten Schuldverschreibungen und ABS Andere Belastungsquellen Keine Belastung
Stundungs- und Neuverhandlungsstatus	Refinanzierung Instrumente mit geändertem, unter den Marktkonditionen liegendem Zinssatz Instrumente mit anderen geänderten vertraglichen Bedingungen Neu verhandeltes Instrument ohne Stundungsmaßnahmen Nicht gestundet oder neu verhandelt
Ansatz LGD	Regulatorisch vorgegeben Eigene LGD-Schätzung (wirtschaftliche Normalität) Eigene LGD-Schätzung (Wirtschaftsabschwung)
Ausfallstatus	Kein Ausfall Ausfall wegen Unwahrscheinlichkeit der Zahlung Ausfall wegen Überfälligkeit von mehr als 90 Tagen Ausfall wegen Unwahrscheinlichkeit der Zahlung und Überfälligkeit von mehr als 90 Tagen

Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten oder Zentralbanken (STD)
Risikopositionen gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften (STD)
Risikopositionen gegenüber öffentlichen Stellen (STD)
Risikopositionen gegenüber multilateralen Entwicklungsbanken (STD)
Risikopositionen gegenüber internationalen Organisationen (STD)
Risikopositionen gegenüber Instituten ohne kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)
Risikopositionen gegenüber Unternehmen ohne kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft (STD)
Durch Immobilien besicherte Risikopositionen (STD)
Ausgefallene Risikopositionen (STD)
Mit besonders hohen Risiken verbundene Risikopositionen (STD)
Risikopositionen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen (STD)
Risikopositionen gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung (STD)
Risikopositionen in Form von Anteilen an Organismen für Gemeinsame Anlagen (OGA) (STD)
Sonstige Posten (STD)
Beteiligungspositionen (STD)
Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten oder Zentralbanken (IRB)
Risikopositionen gegenüber Instituten (IRB)
Beteiligungspositionen (IRB)
Sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind (IRB)
Risikopositionen gegenüber Unternehmen – Spezialfinanzierungen (IRB)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - qualifiziert revolving (IRB)
Risikopositionen gegenüber Unternehmen – KMU (IRB)
Risikopositionen gegenüber Unternehmen – Sonstige (IRB)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - durch Immobilien besichert, KMU (IRB)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - durch Immobilien besichert, keine KMU (IRB)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - Sonstige, KMU (IRB)
Risikopositionen aus dem Mengengeschäft - Sonstige, keine KMU (IRB)

Risikopositionsklasse

Rechnungslegungsklassifikation	<p>Zu Handelszwecken gehaltene finanzielle Vermögenswerte</p> <p>Nicht zu Handelszwecken gehaltene, verbindlich erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete finanzielle Vermögenswerte</p> <p>Finanzielle Vermögenswerte, die erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertet werden</p> <p>Finanzielle Vermögenswerte zum beizulegenden Zeitwert im sonstigen Ergebnis</p> <p>Finanzielle Vermögenswerte zu fortgeführten Anschaffungskosten</p> <p>Erfolgswirksam zum beizulegenden Zeitwert bewertete nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte</p> <p>Nach der Kostenmethode bewertete nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte</p> <p>Sonstige nicht zu Handelszwecken gehaltene nicht-derivative finanzielle Vermögenswerte</p>
Ratingsystem standardisiert	Die Codeliste listet sämtliche standardisierten Ratingsysteme auf, insbesondere sind hier alle ECAI-Ratingsysteme enthalten. Das standardisierte Ratingsystem ist immer in Kombination mit Bonitätsklasse standardisiert zu verstehen.
Bonitätsklasse standardisiert	Die Codeliste listet sämtliche standardisierten Bonitätsklassen auf, insbesondere sind hier alle Bonitätsklassen von ECAI-Ratings enthalten. Die standardisierte Bonitätsklasse ist immer in Kombination mit Ratingsystem standardisiert zu verstehen.
Attribute mit dem Suffix „Kennzeichen“	<p>WAHR</p> <p>FALSCH</p>