

**Anlage 1A**

**Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten - CRR-Kreditinstitute (monatliche Meldung)**

**Anlage 1A 1**

**Instrumente gemäß Art. 1 Nr. 23 der Verordnung (EU) 2016/867<sup>1</sup>**

**Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Vertrag ID
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe
Rückgriff

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Verbrieft
Verbriefungsart
Ratingsystemintern
Bonitätsklasseintern
OeNB Kreditforderungs ID
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert
Übertragener Betrag <sup>2</sup>
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht) <sup>2</sup>
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht) <sup>2</sup>
Rückstände <sup>2</sup>
Ausfallwahrscheinlichkeit

**Daten zu Gegenpartei – Instrument**

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

**Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

<sup>1</sup> Verordnung (EU) 2016/867 der Europäischen Zentralbank über die Erhebung granularer Kreditdaten und Kreditrisikodaten (EZB/2016/13), ABl. Nr. L 144 vom 01.06.2016 S. 44.

<sup>2</sup> Diese Attribute sind nicht für Instrumente gegenüber natürlichen Personen zu melden.

Anmerkung: Werden in den Tabellen dieser Anlage Attribute weiß hinterlegt, so handelt es sich hierbei um identifizierende Attribute. Werden in den Tabellen dieser Anlage Attribute grau hinterlegt, so handelt es sich um beschreibende Attribute.

**Anlage 1A 2**

**Nicht-verbrieftete Anteilsrechte, Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 575/2013<sup>3</sup>  
(exkl. von 1A 1 umfasste Kreditzusagen) und regulatorische Netting-Sätze**

**Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Vertrag ID <sup>4</sup>
Rechtssträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystemintern
Bonitätsklasse intern
Brutto-Buchwert <sup>5</sup>
Nominale <sup>4</sup>
Außerbilanzieller Wert <sup>4</sup>
Ausfallwahrscheinlichkeit

**Daten zu Gegenpartei – Instrument**

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

**Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

**Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten**

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

<sup>3</sup> 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, zuletzt geändert durch die Verordnung (EU) 2021/558, ABl. Nr. L 116 vom 06.04.2021 S. 25.

<sup>4</sup> Diese Attribute sind nur für Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (exkl. von 1A 1 umfasste Kreditzusagen) zu melden.

<sup>5</sup> Dieses Attribut ist nur für nicht-verbrieftete Anteilsrechte zu melden.

### Anlage 1A 3 Gehaltene Wertpapiere

#### Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Art des Instruments

#### Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ausstehender Nominalwert

#### Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

#### Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Sicherheiten ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

#### Wertpapier – Daten zu Ratings und Risikoindikatoren

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern <sup>6</sup>
Bonitätsklasse intern <sup>6</sup>
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart <sup>7</sup>
Weighted Average Life <sup>7</sup>
Attachment Point <sup>7</sup>
Detachment Point <sup>7</sup>
Ausfallwahrscheinlichkeit <sup>7</sup>

#### Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

<sup>6</sup> Dieses Attribut ist nur für Schuldverschreibungen und verbrieftete Anteilsrechte zu melden.

<sup>7</sup> Dieses Attribut ist nur für Verbriefungsstranchen zu melden.

**Anlage 1A 4  
Gegenparteien**

**Risikodaten zu Gegenparteien**

Gegenpartei Identnummer
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Ausfallwahrscheinlichkeit

**Anlage 1A 5  
Sicherheiten**

**Daten zu empfangenen Sicherheiten**

Mandant Identnummer
Sicherheiten ID
Art der Sicherheit

**Anlage 1A 6  
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