

**Anlage 1A**

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

**Anlage 1A 1  
Kredite und Kreditzusagen**

**Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Verbrieft
Verbriefungsart
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
OeNB Kreditforderungs ID
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert
Übertragener Betrag <sup>1</sup>
Zinsabgrenzung Soll (Kundensicht) <sup>1</sup>
Zinsabgrenzung Haben (Kundensicht) <sup>1</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> Diese Attribute sind nicht für Instrumente gegenüber natürlichen Personen zu melden.

**Anlage 1A 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
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
Brutto-Buchwert
Nominale
Außerbilanzieller Wert
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

**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
Bonitätsklasse intern
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart
Weighted Average Life
Attachment Point
Detachment Point
Ausfallwahrscheinlichkeit

**Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten**

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

### 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