

Anlage 2A

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

Anlage 2A 1

Kredite und Kreditzusagen

Instrument – Daten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

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
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID
Brutto-Buchwert
Nominale
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

Anlage 2A 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
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

**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