

**Anlage 2A****Instrument-, Finanz- und Sicherheitsdaten - CRR-Finanzinstitute (monatliche Meldung)****Anlage 2A 1****Instrumente gemäß Art. 1 Nr. 23 der Verordnung (EU) 2016/867<sup>1</sup>****Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>2</sup>
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>2</sup>
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert

**Daten zu Gegenpartei – Instrument**

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID <sup>2</sup>
Rolle

**Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>2</sup>
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> Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldnerbene aggregiert werden.

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 2A 2**  
**Geschäfte gemäß Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 575/2013**  
**(exkl. von 2A 1 umfasste Kreditzusagen)**

**Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>3</sup>
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>3</sup>
Nominale
Außerbilanzieller Wert

**Daten zu Gegenpartei – Instrument**

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID <sup>3</sup>
Rolle

**Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit**

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>3</sup>
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

**Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten**

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

<sup>3</sup> 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 <sup>4</sup>
Art des Instruments

#### Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>4</sup>
Ausstehender Nominalwert

#### Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID <sup>4</sup>
Rolle

#### Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID <sup>4</sup>
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

#### Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

<sup>4</sup> Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldnebene 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