

**Anlage 2**

**zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA), mit der die Pfandbrief-Melde-  
Verordnung (PB-MV) erlassen und die Granulare Kreditdatenerhebungs-  
Verordnung 2018 (GKE-V 2018) geändert wird**

**Änderung der Anlage 1A zur GKE-V 2018**

**Anlage 1A****Instrument-, Finanz- und Sicherheidsdaten – 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
Ratingsystem intern
Bonitätsklasse intern
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.

## Anlage 1A 2

**Nicht-verbrieft 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>
Rechtsträger
Art des Instruments
Schuldnergruppe

**Finanzdaten**

Mandant Identnummer
Instrument ID
Ratingsystem intern
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, in der Fassung der 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-verbrieft 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 Verbriefungstranchen 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
Land der physischen Sicherheit <sup>8)</sup>

<sup>8)</sup> Land der Immobiliensicherheit oder Land des öffentlichen Registers bei Pfandrechten auf Schiffe bzw. auf sonstige physische Vermögenswerte. Anzugeben, sofern Vermögenswerte, die in einem Deckungsstock enthalten sind, besichert werden.

**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

