

Anlage 2A**Instrument-, Finanz- und Sicherheitendaten - CRR-Finanzinstitute (monatliche Meldung)****Anlage 2A 1****Instrumente gemäß Art. 1 Nr. 23 der Verordnung (EU) 2016/867¹****Instrument – Daten**

Mandant Identnummer
Instrument ID ²
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ²
Ausstehender Nominalwert
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ²
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ²
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

¹ 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.

² Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldner Ebene 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 ³
Art des Instruments
Schuldnergruppe

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ³
Nominale
Außerbilanzieller Wert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ³
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ³
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

³ 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 ⁴
Art des Instruments

Finanzdaten

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Ausstehender Nominalwert

Daten zu Gegenpartei – Instrument

Mandant Identnummer
Gegenpartei Identnummer
Instrument ID ⁴
Rolle

Daten zu Instrument – empfangene Sicherheit

Mandant Identnummer
Instrument ID ⁴
Zerlegungsansatz
Berücksichtigungsfähiger Wert der Sicherheit

Daten zu Referenzwerten von Kreditderivaten

Mandant Identnummer
Referenzwert ID
Instrument ID
ISIN
Referenzschuldner Identnummer
Nominale

⁴ Instrumente, welche die gleiche Art des Instruments aufweisen, dürfen für die Zwecke des Primärschlüssels „Instrument ID“ auf Schuldner Ebene 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