

**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-verbrieft 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