

Anlage 1B

ZKR-Verbriefungsmeldung
Kreditinstitute

gemäß § 2 Abs. 1 ZKRM-V

ZKRM-V Anlage 1B ZKR-Verbriefungsmeldung - Strukturierte Kreditprodukte Kreditinstitute	
Stammdateninformation	
Code Produkttyp	
Typ Verbriefung	
Geographische Zuordnung Referenzwert Land/Region	
Code Marktwert	
Obligoinformation	
Marktwert/Modellwert	
Nominale	
IFRS Fair Value	
IFRS Available for Sale	
IFRS Held-to-Maturity	
IFRS Loans & Receivables	
Buchwert (UGB) bilanziell	
Buchwert (UGB) Kreditderivate	
Forderungswert (Exposure Value) bilanziell	
Forderungswert (Exposure Value) Kreditderivate	
Risikoinformation	
Weighted Average Life	
Attachment Point	
Detachment Point	
Ratingsystem	
Bonitätsklasse	
Ausfallwahrscheinlichkeit (PD)	
Gewichtete Forderungsbeträge (RWA)	
Ansatz	

Sicherheitenmeldung ZKR-Verbriefungsmeldung Kreditinstitute	Wert der Sicherheit
gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anrechenbare Sicherheiten	
- hievon persönliche Sicherheiten	
- hievon öffentliche Haftung	
- hievon Haftung anderes meldepflichtiges Institut	
- hievon Kreditderivate	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon Immobiliensicherheiten	
- hievon sonstige Sachsicherheiten	
- hievon finanzielle Sicherheiten	
Sicherheiten gemäß internem Risikomanagement	
- hievon Kreditderivate des Handelsbuchs	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon Kreditderivate des Bankbuchs	
- hievon Betrag Kreditderivate + Identität Gegenpartei (*1-n Vorkommen)	
- hievon finanzielle Sicherheiten	
Synthetische Verbriefungen	