

Anlage 2**zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zur Stammdatenmeldung
(Stammdatenmeldungsverordnung 2016 – StDMV 2016)****Meldeinhalte zu § 9 StDMV 2016 (Risikoansatz)****A. Kreditrisiko gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013****A.1. Auf internen Einstufungen basierender Ansatz (IRB-Ansatz, Teil 3, Titel II, Kapitel 3 CRR)**

OeNB Identnummer	
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (IRB-Ansatz, Art. 143 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

A.2. Umfang der Bewilligung

Risikopositionsklassen gemäß Art. 147 Abs. 2 CRR <i>[jeweils: 1 – Ja; 2 – Nein]</i>	IRB-Ansatz mit eigenen Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 7 und Abs. 9 CRR)	IRB-Ansatz ohne eigene Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 8 CRR)	Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 148 CRR)	Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial Use“, Art. 150 CRR)	„Slotting-Ansatz“ (Art. 153 Abs. 5 CRR)
Lit. a (Zentralstaaten und Zentralbanken)					xxxxxxx
Lit. b (Risikopositionen gegenüber Instituten)					xxxxxxx
Lit. c (Risikopositionen gegenüber Unternehmen)					
Lit. d (Risikopositionen aus dem Mengengeschäft)		xxxxxxx			xxxxxxx

A.3. Beteiligungen

Einfacher risikogewichteter Ansatz (Art. 155 Abs. 2 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
PD/LGD-Ansatz (Art. 155 Abs. 3 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Internes Modell (Art. 155 Abs. 4 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 495 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial Use“, Art. 150 Abs. 1 lit. g und h CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

B. Kreditrisikominderung gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

OeNB Identnummer	
Umfassende Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 223 bis 228 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf eigenen Schätzungen beruhende Volatilitätsanpassungen bei der umfassenden Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 225 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]

C. Verbriefung gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

OeNB Identnummer	
Standardansatz (Art. 251 bis 258 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Ratingbasierter Ansatz (Art. 261 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Aufsichtlicher Formelansatz (Art. 262 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Interner Bemessungsansatz (Art. 259 Abs. 4 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]

D. Gegenparteiausfallsrisiko gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 6 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

OeNB Identnummer	
Marktbewertungsmethode (Art. 274 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Ursprungsrisikomethode (Art. 275 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardmethode (Art. 276 bis 282 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf einem internen Modell beruhende Methode (Art. 283ff)	[1 – Ja; 2 – Nein]

E. Operationelles Risiko gemäß Teil 3, Titel III der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

OeNB Identnummer	
Basisindikatoransatz (Art. 315 und 316 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardansatz (Art. 317 bis 320 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Alternativer Standardansatz (Art. 319 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fortgeschrittene Messansätze (Art. 321 bis 324 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]

F. Marktrisiko gemäß Teil 3, Titel IV der Verordnung (EU) Nr. 575/2013**F.1. Allgemeine Angaben**

OeNB Identnummer	
Nutzung der Ausnahmebestimmung gemäß Art. 94 CRR („kleines Handelsbuch“)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (Art. 363 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]

F.2. Standardansatz

Schuldtitel (Teil 3, Titel IV, Kapitel 2, Abschnitt 2 CRR):	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Laufzeitbezogene Berechnung (Art. 339 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Durationsbasierte	[1 – Ja; 2 – Nein]

	Berechnung (Art. 340 CRR)	
	Spezifisches Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Aktieninstrumente (Teil 3, Titel IV, Kapitel 2, Abschnitt 3 CRR):	Allgemeines Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Spezifisches Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Fremdwährungsrisiko (Teil 3, Titel IV, Kapitel 3 CRR):	Positionen des Bankbuchs	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Positionen des Handelsbuchs	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Warenpositionsrisiko:	Laufzeitbandverfahren (Art. 359 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Vereinfachtes Verfahren (Art. 360 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Erweitertes Laufzeitbandverfahren (Art. 361 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Korrelationshandelsportfolio (Art. 338 CRR)		<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

F.3. Internes Marktrisikomodell (IMM, Teil 3, Titel IV, Kapitel 5 CRR)

Schuldtitle:	Allgemeines Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Spezifisches Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Aktieninstrumente:	Allgemeines Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Spezifisches Risiko	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Fremdwährungsrisiko:	Positionen des Bankbuchs	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
	Positionen des Handelsbuchs	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Warenpositionsrisiko:		<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Korrelationshandelsaktivitäten (Art. 377 CRR):		<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

G. Risiko einer Anpassung der Kreditbewertung (CVA-Risiko) gemäß Teil 3, Titel VI der Verordnung (EU) Nr. 575/2013

OeNB Identnummer	
Fortgeschrittene Methode (Art. 383 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Standardmethode (Art. 384 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Alternative Methode (Art. 385 CRR)	<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>

