

Anlage 3A**Verbriefungsmeldung konsolidiert (UGB-Konzern) (quartalsweise Meldung)****Aktiv in der Bilanz gehaltene Wertpapiere (inkl. Short-Positionen)****Daten zu Wertpapierpositionen auf Institutsebene**

Unternehmen Identnummer
Instrument ID
Gegenpartei Identnummer
ISIN
Rechnungslegungsklassifikation
Ratingsystem standardisiert
Bonitätsklasse standardisiert
Verbriefungsart
Nominale
Marktwert
Netto-Buchwert inkl. Zinsabgrenzungen
Weighted Average Life
Attachment Point
Detachment Point
Ausfallwahrscheinlichkeit

Kreditrisikodaten

Unternehmen Identnummer
Risikoposition ID
Instrument ID
Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke
Risikopositionsklasse
Risikopositionswert
Risikogewichteter Positionsbetrag nach Anwendung des KMU-Faktors