

ANHANG III

Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios

Meldebogennummer	Meldebogencode	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe
101	C 101.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei
102	C 102.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko
103	C 103.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko
105.01	C 105.01	Bestimmung interner Modelle
105.02	C 105.02	Zuordnung interner Modelle zu Portfolios
105.03	C 105.03	Zuordnung interner Modelle zu Ländern

C 101.00 — Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei

Code der Gegenpartei	Risikopositionen-klasse	Einstufung	Zeitpunkt der letzten Einstufung der Gegenpartei	PD	Ausfallstatus	Ursprüngliche Risikoposition vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren	Risikoposition nach Substitutions-effekten aufgrund von Kreditrisiko-minderungen vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren
0010	0020	0040	0050	0060	0070	0080	0090

CCF	EAD	Sicherheitenwert	Vorrangige unbesicherte Hyp LGD ohne Negativerklärung	Vorrangige unbesicherte Hyp LGD mit Negativerklärung	LGD	Laufzeit	RWEA
0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170

C 102.00 – Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko

Portfolio-ID	Anzahl der Schuldner	PD	PD ohne aufsichtliche Maßnahmen	PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen	Ursprüngliche Risikoposition vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Risikoposition nach Substitutions-effekten aufgrund von Kreditrisikominde-rungen vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren
0010	0040	0060	0061	0062	0080	0090

CCF	EAD	Sicherheitenwert	LGD	LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen	LGD ohne MoC und ohne aufsichtliche Maßnahmen	LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwungkompo-nente
0100	0110	0120	0130	0131	0132	0133

Laufzeit	Erwarteter Verlustbetrag	Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen	RWEA	Standardisierter RWEA
0140	0150	0160	0170	0180

C 103.00 — Details der Risikopositionen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko

Portfolio-ID	Anzahl der Schuldner	PD	PD ohne aufsichtliche Maßnahmen	PD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen	Ursprüngliche Risikoposition vor Anwendung von Umrechnungs-faktoren	Risikoposition nach Substitutionseffekten aufgrund von Kreditrisikominderungen vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren	CCF	EAD
0010	0040	0060	0061	0062	0080	0090	0100	0110

Sicherheitenwert	LGD	LGD ohne aufsichtliche Maßnahmen	LGD ohne MoC und aufsichtliche Maßnahmen	LGD ohne MoC, aufsichtliche Maßnahmen und Abschwung-komponente	Laufzeit	Erwarteter Verlustbetrag	Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen	RWEA
0120	0130	0131	0132	0133	0140	0150	0160	0170

Standardisierter RWEA	Ausfallrate des letzten Jahres	Ausfallrate der letzten 5 Jahre	Verlustrate des letzten Jahres	Verlustrate der letzten 5 Jahre	RWEA-	RWEA+	RWEA- -	RWEA++
0180	0190	0200	0210	0220	0250	0260	0270	0280

C 105.01 – Bestimmung interner Modelle

ID des internen Modells	Bezeichnung des Modells	IRBA-Risikoparameter	EAD	EAD-gewichtete durchschnittliche Ausfallrate zur Kalibrierung	Fallspezifisch gewichtete durchschnittliche Ausfallrate zur Kalibrierung	Langfristige PD
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

Gesundungsrate ausgefallener Vermögenswerte	Erlösrate von Rettungserwerben für nicht genesene Ausfälle	Verwertungszeitraum für Rettungserwerbe für nicht genesene Ausfälle	Gemeinsame Entscheidung	Konsolidierende Aufsichtsbehörde	RWEA	RWEA-Zuschlagsfaktoren
0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140

C 105.02 — Zuordnung interner Modelle zu Portfolios

Portfolio-ID	ID des internen Modells	EAD	RWEA
0010	0020	0030	0040

C 105.03 – Zuordnung interner Modelle zu Ländern

Zeilen-ID	ID des internen Modells	Standort des Instituts
0005	0010	0020“