

## „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 | Risikopositionsklasse | Rating | Datum der letzten Einstufung der Gegenpartei | PD   | Ausfallstatus | Ursprungsrisikoposition vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren | Risikoposition nach Substitutionseffekten aufgrund von Kreditrisikominderungen vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren |
|----------------------|-----------------------|--------|--|------|---------------|---|--|
| 0010                 | 0020                  | 0040   | 0050   | 0060 | 0070          | 0080  | 0090   |
|                      |                       |        |  |      |               |   |  |

| CCF  | EAD  | Wert der Sicherheit(en) | 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**

| ID des Portfolios | Anzahl der Schuldner | PD   | Ursprungsrisikoposition vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren | Risikoposition nach Substitutionseffekten aufgrund von Kreditrisikominderungen vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren | CCF  | EAD  |
|-------------------|----------------------|------|---|--|------|------|
| 0010              | 0040                 | 0060 | 0080  | 0090   | 0100 | 0110 |
|                   |                      |      |   |  |      |      |

| Wert der Sicherheit(en) | LGD  | Laufzeit | Erwarteter Verlustbetrag | Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen | RWEA | Standardisierter RWEA |
|-------------------------|------|----------|--------------------------|--|------|-----------------------|
| 0120                    | 0130 | 0140     | 0150                     | 0160   | 0170 | 0180                  |
|                         |      |          |                          |  |      |                       |

**C 103.00 — Details der Risikopositionen in Portfolios mit hohem Ausfallrisiko**

| ID des Portfolios | Anzahl der Schuldner | PD   | Ursprungsrisikoposition vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren | Risikoposition nach Substitutionseffekten aufgrund von Kreditrisikominderungen vor Anwendung von Umrechnungsfaktoren | CCF  | EAD  | Wert der Sicherheit(en) | LGD  | Laufzeit | Erwarteter Verlustbetrag |
|-------------------|----------------------|------|---|--|------|------|-------------------------|------|----------|--------------------------|
| 0010              | 0040                 | 0060 | 0080  | 0090   | 0100 | 0110 | 0120                    | 0130 | 0140     | 0150                     |
|                   |                      |      |   |  |      |      |                         |      |          |                          |

| Rückstellungen für ausgefallene Risikopositionen | RWEA | Standardisierter RWEA | Ausfallquote des letzten Jahres | Ausfallquote der letzten 5 Jahre | Verlustquote des letzten Jahres | Verlustquote der letzten 5 Jahre | RWEA- | RWEA+ | RWEA- - | RWEA++ |
|--|------|-----------------------|---------------------------------|----------------------------------|---------------------------------|----------------------------------|-------|-------|---------|--------|
| 0160   | 0170 | 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 Ausfallquote zur Kalibrierung | Fallspezifisch gewichtete durchschnittliche Ausfallquote zur Kalibrierung | Langfristige PD |
|-------------------------|-------------------------|----------------------|------|--|---|-----------------|
| 0010                    | 0020                    | 0030                 | 0040 | 0050   | 0060  | 0070            |
|                         |                         |                      |      |  |   |                 |

| Gesundungsquote ausgefallener Vermögenswerte | Erlösquote von Rettungserwerben für nicht gesunde Ausfälle | Verwertungszeitraum für Rettungserwerbe für nicht gesunde Ausfälle | Gemeinsame Entscheidung | Konsolidierende Aufsichtsbehörde | RWEA |
|--|--|--|-------------------------|----------------------------------|------|
| 0080   | 0090   | 0100   | 0110                    | 0120                             | 0130 |
|  |  |  |                         |                                  |      |

### C 105.02 – Zuordnung interner Modelle zu Portfolios

| ID des Portfolios | 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“                  |
|           |                         |                        |