

„ANHANG VIII

Ergebnisse der aufsichtlichen Referenzportfolios

Meldebogennummer	Meldebogencode	Bezeichnung des Meldebogens/der Meldebogengruppe
111.00	C 111.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei
112.00	C 112.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei und ökonomischem Szenario
113.00	C 113.00	Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Fazilität
114.00	C 114.00	Details der makroökonomischen Szenarien nach Land

C 111.00 – Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei

Code der Gegenpartei	Anzahl der Fazilitäten	BIP – Gebietscode	Risikopositionswert - IFRS 9	PD - 12 Monate IFRS 9	PD - IRB ohne konservative Anpassungen	LGD - IFRS 9	ECL-Betrag – 12 Monate IFRS 9	Erwarteter Verlust - IRB
0010	0020	0030	0040	0100	0110	0200	0400	0410

C 112.00 – Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Gegenpartei und ökonomischem Szenario

Code der Gegenpartei	ID des ökonomischen Szenarios	PD - 0-12 Monate	PD - 0-24 Monate	PD - 0-36 Monate	PD - 0-48 Monate	PD - 0-60 Monate	PD - 0-72 Monate	PD - 0-84 Monate	PD - 0-96 Monate	PD - 0-108 Monate	PD - 0-120 Monate
0010	0020	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190

C 113.00 – Details der Risikopositionen in Portfolios mit geringem Ausfallrisiko nach Fazilität

Code der Gegenpartei	ID der Fazilität	Risikopositionswert	Wertminderungsstatus	Bei Ausreichung geschätzte jährliche PD	Jährliche PD am Meldestichtag	Quantitativer Auslöser für die Umgliederung in Stufe 2 (in jährlicher PD)	Freistellungsschwelle bei Instrumenten mit geringem Ausfallrisiko (falls zutreffend)	Set der qualitativen Auslöser für die Umgliederung in Stufe 2
0010	0020	0100	0200	0300	0400	0500	0550	0600

C 114.00 – Details der makroökonomischen Szenarien nach Land

BIP – Gebietscode	ID des ökonomischen Szenarios	BIP-Wachstum 0-12 Monate	BIP-Wachstum 12-24 Monate	BIP-Wachstum 24-36 Monate	BIP-Wachstum 36-48 Monate	BIP-Wachstum 48-60 Monate	BIP-Wachstum 60-72 Monate	BIP-Wachstum 72-84 Monate	BIP-Wachstum 84-96 Monate	BIP-Wachstum 96-108 Monate	BIP-Wachstum 108-120 Monate	Gewicht des ökonomischen Szenarios
0010	0020	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200“