I-10438-01-01-01

RFR

FUNCTIONAL DETAILED SPECIFICATION

CORD-A360 POSITION Geschäfte KG inkl. ABSTest

Status: Draft

Version: 06.52- Stand: 14.05.2024 - Nur für den internen Gebrauch -

Migration Abacus360 🎯

Cluster Lead: Susanne Endler

Copyright Commerzbank Aktiengesellschaft 2025

Herausgeber:

Commerzbank Aktiengesellschaft

Group Finance Architecture

60261 Frankfurt am Main

Ablagepfad: GFA Sharepoint, Zugriff über MapMe! XX\_Approach\_IND = 'AIRB'

Deliverable Information

| **Autor** | **Georgiana Ban** |
| --- | --- |
| **Status** | Draft |
| **Ablageort** | GFA Sharepoint, Zugriff über MapMe! |

Tabelle 1: Deliverable Information

Änderungsnachweis

| **Version** | **Status** | **Datum** | **Autor** | **Beschreibung der Änderung** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **00.01** | **Draft** | **23.03.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:00000.**  **Ersterstellung** |
| **00.02** | **Draft** | **25.03.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung fehlende DF.** |
| **00.03** | **Draft** | **06.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Korrektur Schlüsselmapping sowie redaktionelle Änderungen** |
| **00.04** | **Draft** | **06.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Korrektur Schlüsselmapping in V00.03 nicht übernommen, neuen Versuch.** |
| **00.05** | **Draft** | **06.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Korrektur ABS\_CR\_REL\_F** |
| **00.06** | **Draft** | **12.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Inhaltsverzeichnis - Aktualisierung** |
| **00.07** | **Draft** | **21.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anderungen in der Aliasse, PTY001 Mapping und Einfugen von andere relevante Informationen.** |
| **00.80** | **Draft for Review** | **27.04.2022** | **Ban, Georgiana (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Schlüsselmapping** |
| **01.00** | **Final** | **17.05.2022** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **Versionierung auf Final** |
| **01.01** | **Draft** | **02.08.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Bearbeitung Änderungen im Mapping** |
| **01.02** | **Draft** | **02.08.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Format Tabelle Aliase** |
| **01.03** | **Draft** | **02.08.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Korrekturen Inhaltverzeichniss und Abbildungsverzeichniss, Mapping von VAD227, C223 und C224** |
| **01.80** | **Draft for Review** | **03.08.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassungen Details** |
| **01.81** | **Draft for Review** | **12.08.2022** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **ReqID:00000.**  **Einarbeitung Reviewanmerkungen: Löschung Alias XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_MIO, Bewirtschaftung B928 entfällt, Wegfall XX\_MAP\_C215, Anpassung B640 und C215, Neuaufnahme Alias X\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV** |
| **01.82** | **Draft** | **05.10.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Erweiterung Mapping** |
| **01.83** | **Draft** | **11.10.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Erweiterung Mappings, Anpassung Aliasse** |
| **01.84** | **Draft for Review** | **13.10.2022** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **ReqID:00000.**  **Anpassung Mapping C215 und PTY001** |
| **01.85** | **Draft** | **20.10.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Einfügen von Aliase XX\_C\_COUNTRY und XX\_C\_CUSTOMER\_T, Aktualisierungen in den Feldern B005, EXC201, C215 und RLV202-RLV209.** |
| **01.86** | **Draft** | **21.10.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Schluesselmapping und C220** |
| **01.87** | **Draft** | **02.11.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Aliase und bei den folgenden Feldern: B005,B013,B014,B017,B036,B037,B194,B211,B416,B429,B430,B431,B432,B480,B481,B500,B562,B564,B565,B618,B825,B856,B873,B880,B891,B892,C215,C226,C265,CRI502,J305,J306,SEC191,SEC502,SEC905,VAD920,B028,B029,B641,CRE125,CRE126, CRE128 und CRE129.** |
| **01.88** | **Draft for Review** | **07.11.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung feldbeschreibungen und im Feld B024** |
| **01.89** | **Draft** | **14.11.2022** | **Ban, Georgiana (extern) (eh2baz7)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Review/Anmerkungen in den Feldern B036, B037, B194, B211, B416, B429, B430, B431, B432, B480, B481, B562, B565, B618, B825, B564, B856, B873, B880, B891, B892, SEC191, SEC502, SEC905, B005, C226, C265, CRI502 und C215.** |
| **01.90** | **Draft for Review** | **27.02.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Folgende Kapitel/ Tabellen bzw. Felder wurden angepasst:**  **- Kap. 3.3/ 3.4: Aufnahme XX\_LUT\_COMP\_REL**  **- Kap. 4: Aufnahme B035 (Übergangslösung) – finale Anpassung erfolgt mit DP9.2**  **- Kap. 4/5: Mappinganpassung für B007, B436, B603, B780, C215, CRE025, CRE026, CRI010, J301, RLV209, EXC033, PTY002, B640, B641** |
| **01.91** | **Draft** | **03.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Mapping SEC191** |
| **01.92** | **Draft for Review** | **10.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 2:**  **Schlüsselmapping erweitert: XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS**  **Kap.3:**  **- Aufnahme XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS**  **- Anpassung der Filterbedingungen XX\_C\_CONTRACT\_KG wg. CommerzReal (Delisyst 208), Bista (100, 101, 102, 107/ Passiv), Delisyst 218 für VS\_MOTRANS, Ausschluss REWE**  **Kap.4/5:**  **- Aufnahme Mapping NPE: RLV370, CRI167, VAD280, VAL370, VAL375**  **- Anpassung Relevanzflag wg. CommerzReal: C254, C700, EXC120, Z001, EXC033**  **- Anpassung EXC201, C22** |
| **01.93** | **Draft** | **10.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Reviewanmerkungen**  **Kap.4/5:**  **- Anpassung Quellfelder C226**  **- Anpassung Mapping RLV202-RLV209, B200** |
| **01.94** | **Draft** | **13.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Einarbeitung von Reviewanmerkungen:**  **Kap.4:**  **Kommentierung von Abhängigkeiten bei der Bewirtschaftun** |
| **01.95** | **Draft** | **15.03.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Aufnahme von VAD620, Anpassung von B013** |
| **01.96** | **Draft** | **17.03.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung von B194** |
| **01.97** | **Draft** | **23.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassungen**  **Kap. 4./5.**  **C226** |
| **01.98** | **Draft** | **29.03.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassungen**  **Kap.3:**  **- Aufnahme globaler Kontextparameter zur Steuerung interner Geschäfte**  **- Filterbedingung XX\_C\_CONTRACT, Auslagerung des Filter für interne Geschäfte wg. neuem Aufrufparameter (siehe vorherigen Punkt)**  **Kap. 4/5:**  **- B035 (DP9.2)**  **- B028, B029 Klammersetzung** |
| **01.99** | **Draft** | **03.04.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Reviewanmerkungen bzw. redaktionelle Änderungen** |
| **02.80** | **Draft for Review** | **05.04.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Aufnahme B262** |
| **02.81** | **Draft for Review** | **20.04.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 2: Einbetten des Schlüsselmappings als Excel**  **Kap. 4: Anpassung an CRE125 / CRE126** |
| **02.82** | **Draft for Review** | **21.04.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4 /5: Anpassung Mapping B640 und B641** |
| **02.83** | **Draft for Review** | **27.04.2023** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **ReqID:00000.**  **Erweiterung Filter XX\_C\_CONTRACT\_KG um Delisyst 308 und 316; Neuaufnahme XX\_CON\_ 2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV in Schlüsselmapping; Anpassung Mapping für CRE025 und CRE026** |
| **02.84** | **Draft** | **28.04.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung SEC191** |
| **02.85** | **Draft** | **16.05.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Erweiterung LR004** |
| **02.86** | **Draft** | **30.05.2023** | **Saßmannshausen, Henri (extern) (eh2sayp)** | **ReqID:000000.**  **Kap.2/3: Aufnahme FX\_RATE & XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA & XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLSTA im Schlüsselmapping**  **Kap.4: Aufnahme von CRE100,CRE101,CRE102,CRE103,D551,D552,D916,PTY004,VAL507,VAL550,Y009,VAD224 & Anpassung von C213, C223, C224, Z001, B023, B024, B040, B173, VAD227, VTY215**  **Kap.5: Neue Transformation für C213, CRE101, CRE102, CRE103 & Anpassung der Transformation für C215/PTY001** |
| **02.87** | **Draft** | **05.06.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung B007, C072, C215, C223** |
| **02.88** | **Draft for Review** | **14.06.2023** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **ReqID:00000.**  **Kapitel 4: Mappinganpassung EXC201 und VAD670, Kapitel 5.5.1: redaktionelle Korrekturen in Rang 14 und 15, Kapitel 5.5.2 Korrekturen der zugeordneten Folgeränge** |
| **02.89** | **Draft** | **23.06.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung**  **Kap. 2/3:**  **- Erweiterung Schlüsselmapping XX\_C\_GLOBAL\_PARTY**  **- Wegfall Schlüsselmapping XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV (CRE025/CRE026)**  **- Bereinigung Schlüsselmapping wg. fehlerhafter Darstellung in Word/ Excel**  **- Ergänzung der Vorverarbeitung in Kap. 2.1 (Erweiterung BISTA & Liqui)**  **- Aufnahme & Aktualisierung der Quelltabellen XX\_C\_GLOBAL\_PARTY, XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA, XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLSTA,XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG**  **Kap.4:**  **- CRI010**  **- B007 (Aufnahme in CORD mit DP9.3.1.0)**  **- CRE025/CRE026 (Aufnahme in CORD mit DP9.3.0.0)**  **- D551, D552 Anpassung Quelltabellen** |
| **02.90** | **Draft for Review** | **28.06.2023** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 2: Schlüsselmapping XX\_C\_GLOBAL\_PARTY: Anpassung Join-Felder Kap.4:**  **- C215 Abgrenzung Eventualverbindlichkeiten (Kippkonten)**  **- C226 Kappung** |
| **02.91** | **Draft for Review** | **03.07.2023** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung Kap.2/Kap.3/Kap.4: Aufnahme von XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV in das Schlüsselmapping Erstellung Alias XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV Anpassung der Quellfelder und Transformationanweisung von B007, Cre025 und Cre026** |
| **02.92** | **Draft** | **06.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.3: Anpassung Alias XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV**  **Kap.4: Aufnahme CRE123, CRE124** |
| **02.93** | **Draft** | **07.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.3: Anpassung Alias XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV und XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA für Commerz Real**  **Kap.4: Anpassung Mapping CRE123, CRE124** |
| **02.94** | **Draft** | **07.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung RLV375** |
| **02.95** | **Draft** | **10.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassungen an RLV370 , VAD670** |
| **02.96** | **Draft** | **11.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.3: Anpassung Alias XX\_C\_CONTRACT\_KG**  **Kap.4: Anpassung CRI159** |
| **02.97** | **Draft** | **12.07.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Anpassungen**  **Kap. 3.5**  **- Filterbedingungen Cluster HGB/IFRS: Erläuterung zu C223 wg. unterschiedlicher Bewirtschaftung für OWF/LR bzw. LE,**  **Kap. 4**  **- C223**  **- Präzisierung der Ableitung für VAL370, LR004, C226 wg. Anpassung C223** |
| **02.98** | **Draft** | **24.07.2023** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 3: Filteraufnahme XX\_B2\_REL\_F in XX\_C\_CONTRACT\_KG** |
| **02.99** | **Draft** | **27.07.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4/5: Anpassung C215** |
| **03.80** | **Draft** | **25.08.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung C213 - Hinweis auf HGB**  **Kap.5: Anpassung C215 - Schritt 10c** |
| **03.81** | **Draft** | **30.08.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.5: Anpassung C215 - Schritt 18** |
| **03.82** | **Draft** | **31.08.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung CRI010** |
| **03.83** | **Draft** | **31.08.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4/ 5: Entfernen Mapping LR004** |
| **03.84** | **Draft** | **07.09.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung LR001, Aufnahme C214 / EXC205 für Handelsbuchpositionen** |
| **03.85** | **Draft** | **07.09.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung VAL370** |
| **03.86** | **Draft** | **07.09.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung RLV375** |
| **03.87** | **Draft** | **26.09.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung B565** |
| **03.88** | **Draft** | **06.10.2023** | **Gabriel, Melinda (extern) (eh2gada)** | **ReqID:000000.**  **Anpassungen im Feld SEC191 (Kap. 2,3,4)** |
| **03.89** | **Draft** | **10.10.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung VAL370, VAD670** |
| **03.90** | **Draft** | **13.10.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4 / 5.: Anpassung B023, B024, CRE015, CRE016, CRE123, CRE124** |
| **03.91** | **Draft** | **16.10.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 2 / 3: Aufnahme Quelltabelle XX\_SST\_E\_IKIK**  **Kap. 4: Anpassung EXC033** |
| **03.92** | **Draft** | **19.10.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung J306** |
| **03.93** | **Draft** | **20.10.2023** | **Zauner, Timo (extern) (eh2zauo)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung RLV370** |
| **03.94** | **Draft** | **31.10.2023** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Mappinganpassung für B217** |
| **03.95** | **Draft** | **14.11.2023** | **Saßmannshausen, Henri (extern) (eh2sayp)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung SEC191** |
| **03.96** | **Draft** | **15.11.2023** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Mapping von B035 angepasst** |
| **03.97** | **Draft** | **04.01.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap4.: Anpassung CRE123/CRE124 Mapping** |
| **04.80** | **Draft** | **12.01.2024** | **Mall, Lisa (cb2mas6)** | **ReqID:000000.**  **Aufnahme des neuen Quellsystem 337 wg. Migration des Liefersystem 307 zu 337. Die Anpassung betrifft folgende Aliasse in Kap. 3.3:**  **XX\_C\_CONTRACT\_KG** |
| **04.81** | **Draft** | **29.01.2024** | **Faulhaber, Jenny (extern) (eh2fauy)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung in Kapitel 4: VTY215=0; C254=0 für NL London und CFCB, Anpassung in Kapitel 5.11: Bewirtschaftung CRE101 für abgelaufene Geschäfte** |
| **04.82** | **Draft** | **01.02.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung CRI159,CRE015,CRE016,CRE101,CRE102,CRE103**    **Kap. 5: 5.16 Bewirtschaftung CRE015**    **Kap. 3: Anpassung Filterbedingung für Alias XX\_C\_CONTRACT\_KG** |
| **04.83** | **Draft** | **01.02.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 3: Anpassung Filterbedingung für Alias XX\_C\_CONTRACT\_KG** |
| **04.84** | **Draft** | **14.02.2024** | **Faulhaber, Jenny (extern) (eh2fauy)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung im Kapitel 5.11: Bedingunng (1.Rang) für CER101 (TERM\_END\_DATE <=REF\_D)** |
| **04.85** | **Draft** | **26.02.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung CRE015/ CRE016, Anpassung B020**  **Kap. 5: 5.16. Bewirtschaftung des Feldes CRE015 gelöscht.** |
| **05.50** | **Draft for Review** | **27.02.2024** | **Faulhaber, Jenny (extern) (eh2fauy)** | **ReqID:000000.**  **Anpassung im Kapitel 5.11: Bedingunng (1. + 2. Rang) für CER101 (TERM\_END\_DATE <=REF\_D) [Anpassung aus Version 04.84 ist noch nicht umegsetzt]** |
| **05.51** | **Draft for Review** | **27.02.2024** | **Glasmacher, Daniel (extern) (eh2glp0)** | **ReqID:000000.**  **Kap.4: Anpassung der Transformationsanweisung für VTY215** |
| **05.52** | **Draft** | **06.03.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap 4: Anpassung B020** |
| **05.53** | **Draft** | **18.03.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung B020** |
| **05.54** | **Draft** | **19.03.2024** | **Saßmannshausen, Henri (extern) (eh2sayp)** | **ReqID:000000.**  **Kap.5: Anpassung CRE101** |
| **05.55** | **Draft for Review** | **26.03.2024** | **Faulhaber, Jenny (extern) (eh2fauy)** | **ReqID:000000.**  **Kapitel 4: Ergänzung VAL507, PTY001 für Verwaltungskredite**  **Kapitel 5: Anpassung PTY001 für HGB (Verwaltungskredite)** |
| **05.56** | **Draft** | **03.04.2024** | **Hendrichs, Roland (cb2heaz)** | **ReqID:00000.**  **Kap. 4: B262 - Entfernen der Prüfung auf High-Risk-Flag** |
| **05.57** | **Draft for Review** | **10.04.2024** | **Glasmacher, Daniel (extern) (eh2glp0)** | **ReqID:000000.**  **Kap.2.1: Erweiterung der Aggregationsbedinungen im Join für XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG (XX\_DELISYST & XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND)**  **Kap.3: Anpassung der Filterbedingungen für XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA & XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLST** |
| **05.58** | **Draft** | **17.04.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: B007 Anpassung Transformationsanweisung** |
| **05.59** | **Draft for Review** | **26.04.2024** | **Saßmannshausen, Henri (extern) (eh2sayp)** | **ReqID:000000.**  **Kap.5: Anpassung CRE101** |
| **06.50** | **Draft for Review** | **03.05.2024** | **Lerch, Sebastian (extern) (eh2lehy)** | **ReqID:000000.**  **Kapitel 4:**  **Änderung C715, C762, C773 und PTY652**  **Kapitel 5:**  **Erweiterung/Anpassung C213** |
| **06.51** | **Draft** | **13.05.2024** | **Obrist, Johannes (extern) (eh2obri)** | **ReqID:000000.**  **Kap. 4: Anpassung Transformationsanweisung B007** |
| **06.52** | **Draft** | **14.05.2024** | **Bauer, Felix (GM-F) (cb2basw)** | **Ergänzen der DQ-Errornummern** |

Tabelle 2: Änderungsnachweis

Inhaltsverzeichnis

[1 Leitplanken i](#_Toc165633758)

[2 Schlüsselmappings ii](#_Toc165633759)

[2.1 Vorverarbeitung Sicherheiten für Bista & LCR/NSFR ii](#_Toc165633760)

[2.2 Vorverarbeitung für XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE iii](#_Toc165633761)

[3 Generelle Filter xviii](#_Toc165633762)

[3.1 Filter für Veredelungen – aktuell nicht relevant xviii](#_Toc165633763)

[3.2 Filter für Laufzeitkomponenten / Bewirtschaftungsprozesse – aktuell nicht relevant xviii](#_Toc165633764)

[3.3 Filter für Quelltabellen / Aliasse xix](#_Toc165633765)

[3.4 Filter für die relevanten Datensätze über XX\_LUT\_COMP\_REL xxv](#_Toc165633766)

[3.5 Filterbedingungen Cluster (HGB/IFRS) xxv](#_Toc165633767)

[4 Transformationsübersicht xxvii](#_Toc165633768)

[5 Details der Transformation clxxi](#_Toc165633769)

[5.1 Bewirtschaftung des Feldes B014 clxxi](#_Toc165633770)

[5.2 Bewirtschaftung des Feldes B017 clxxiii](#_Toc165633771)

[5.3 Bewirtschaftung des Feldes B024 clxxv](#_Toc165633772)

[5.4 Bewirtschaftung des Feldes PTY002 clxxvi](#_Toc165633773)

[5.5 Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001 clxxviii](#_Toc165633774)

[5.5.1 Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001 für Cluster HGB clxxviii](#_Toc165633775)

[5.5.2 Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001 für Cluster IFRS clxxxv](#_Toc165633776)

[5.6 Bewirtschaftung des Feldes C226 cxciii](#_Toc165633777)

[5.7 Bewirtschaftung des Feldes CRI114/CRI115 cxcv](#_Toc165633778)

[5.8 Bewirtschaftung des Feldes B005 cxcix](#_Toc165633779)

[5.9 Bewirtschaftung des Feldes CRI502 ccii](#_Toc165633780)

[5.10 Bewirtschaftung des Feldes C213 ccv](#_Toc165633781)

[5.10.1 Bewirtschaftung des Feldes C213 HGB ccv](#_Toc165633782)

[5.10.2 Bewirtschaftung des Feldes C213 IFRS ccvii](#_Toc165633783)

[5.11 Bewirtschaftung des Feldes CRE101 ccx](#_Toc165633784)

[5.12 Bewirtschaftung des Feldes CRE102 ccxii](#_Toc165633785)

[5.13 Bewirtschaftung des Feldes CRE103 ccxiv](#_Toc165633786)

[5.14 Zugriff auf die Tabelle XX\_LUT\_COMP\_REL ccxv](#_Toc165633787)

[5.15 Zugriff auf Referenztabelle (Look-Up) – aktuell nicht relevant, zukünftig ggfs. via decision table in A360 ccxvi](#_Toc165633788)

# Leitplanken

In diesem Kapitel werden ausschließlich Designdokumente aufgeführt, die in MapMe! hinterlegt sind, ein Verweis auf (Projekt-)Laufwerke ist nicht vorgesehen.

***Die Ausgestaltung der Hinterlegung von Rahmendokumenten befindet sich aktuell noch in Klärung. Sobald diese abgeschlossen wurden, wird dieses Kapitel entspr. angepasst.***

Das FDS basiert auf den übergreifenden Regelungen, die in folgenden Konzepten festgehalten sind:

* Business Team <XY>
  + FRDWH Rahmenkonzept <XY>

Bei Änderungen nach der Abnahme dieses Dokumentes ist folgendes Vorgehen einzuhalten:

* Sofern noch Änderungen im Änderungsmodus vorhanden sind, sind diese zu Beginn der Anpassungen anzunehmen
* Neue Änderungen sind im Änderungsmodus zu dokumentieren

Damit soll sichergestellt werden, dass nur die Änderungen zur Vorversion sichtbar sind.

# Schlüsselmappings

## Vorverarbeitung Sicherheiten für Bista & LCR/NSFR

Für BISTA und Liqui (LCR/NSFR) werden die Sicherheitenbeträge auf aggregierter Ebene am Geschäft benötigt.

Die Tabelle XX\_CON\_ 2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLSTA wird mit der XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA per INNER JOIN verknüpft.

|  |  |
| --- | --- |
| **XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLSTA** | **XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA** |
| XX\_DELISYST\_CB |  |
| XX\_CONTRACT |  |
| XX\_RISK\_TYPE\_IND | XX\_RISK\_TYPE\_IND |
| XX\_CALC\_MODE\_IND | XX\_CALC\_MODE\_IND |
| XX\_LINK\_TYPE |  |
|  | XX\_LINK\_TYPE |
| XX\_UNSTRESSED\_F | XX\_UNSTRESSED\_F |
| XX\_STRESSED\_F |  |
|  | XX\_STRESSED\_F |
| XX\_ABS\_CR\_REL\_F | XX\_ABS\_CR\_REL\_F |
| XX\_DELISYST\_AS | XX\_DELISYST\_AS |
| XX\_ASSET\_ID | XX\_ASSET\_ID\_AS |
| XX\_DELISYST\_AG | XX\_DELISYST\_AG |
| XX\_AGREEMENT\_ID | XX\_AGREEMENT\_ID |

Nach dem Schlüsselmapping muss zunächst eine Aggregation der Tabelle XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLSTA/XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA erfolgen, sodass der Betrag der Sicherheiten in Abhängigkeit von der Sicherheitenkategorie am Geschäft dargestellt werden kann.

Die Aggregation des oben stehenden Joins unter Kapitel 2.1 erfolgt für die nachfolgend aufgeführten Wertfelder auf Ebene des Feldes und wird als Alias XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG fortgeführt:

XX\_DELISYST

XX\_CONTRACT

XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND

## Vorverarbeitung für XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE

Im Vorfeld der Verarbeitung muss zunächst eine Aggregation der Tabelle XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE erfolgen, da die Schlüsselfelder dieser CORD-Tabelle granularer sind als in der Zieltabelle.

Die Aggregation der XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE ist in nachfolgenden Kapiteln durch die Angabe des Alias XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG dargestellt.

Die Aggregation der XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE Datensätze erfolgt für die nachfolgend aufgeführten Wertfelder auf Ebene der Felder:

XX\_DELISYST

XX\_CONTRACT

Bewirtschaftung Cluster HGB

XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA (HGB antizipative Zinsabgrenzung kompensiert in Konzernwährung)

XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA (HGB transitorische Zinsabgrenzung in Konzernwährung)

XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA (HGB Agio/Disagio und kompens Agio/Disagio in Konzernwährung)

XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA (HGB Rückstände/Überziehungen in Konzernwährung)

XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA (HGB Langfristige Forderungen/Verbindlichkeiten kompensiert in Konzernwährung)

XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA (HGB Buchwert kompensiert Saldiert in Konzernwährung)

XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA (HGB Fair Value Adjustment in Konzernwährung)

Bewirtschaftung Cluster IFRS

XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA (IFRS antizipative Zinsabgrenzung kompensiert in Konzernwährung)

XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA (IFRS transitorische Zinsabgrenzung in Konzernwährung)

XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA (IFRS Agio/Disagio und kompens Agio/Disagio in Konzernwährung)

XX\_ARR\_OVERDR\_IFRS\_CLA (IFRS Rückstände/Überziehungen in Konzernwährung)

XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_IFRS\_CLA (IFRS Langfristige Forderungen/Verbindlichkeiten kompensiert in Konzernwährung)

XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA (IFRS Buchwert kompensiert Saldiert in Konzernwährung)

XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_IFRS\_CLA (IFRS Fair Value Adjustment in Konzernwährung)

WICHTIG: Wenn eines der Wertfelder mit NULL befüllt ist, dann jeweils NULL durch 0 ersetzen, bevor eine Aggregation über die verschiedenen Felder durchgeführt wird!

Folgendes Schlüsselmapping ist zur Ausleitung der Kommerziellen Geschäfte (KG) erforderlich, hierbei ist die XX\_C\_CONTRACT\_KG führend.

Aus einem Satz in der XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mindestens ein Satz bzw. werden maximal zwei Sätze in der POSITION erzeugt.

JOIN Typ **LEFT OUTER JOIN**:

* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der INSTRUMENT per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* INSTRUMENT wird mit der XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* INSTRUMENT wird mit der XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* INSTRUMENT wird mit der XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* INSTRUMENT wird mit der XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* INSTRUMENT wird mit der XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CUSTOMER per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV wird mit XX\_C\_COUNTRY per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_COUNTRY wird mit XX\_C\_CUSTOMER\_T per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_ABS\_TRANSACTION per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_ABS\_TRANCHE per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der FX\_RATE per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_GLOBAL\_PARTY per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_SST\_E\_KV\_VERBR wird mit der XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_C\_CONTRACT\_KG wird mit der XX\_SST\_E\_KV\_VERBR per LEFT OUTER JOIN verknüpft
* XX\_SST\_E\_IKIK wird mit der XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY per LEFT OUTER JOIN verknüpft

**Erläuterung des Schlüsselmappings zur Erzeugung des SEC191:**

Aus der Tabelle XX\_SST\_E\_KV\_VERBR wird mit dem Feld XX\_CONTRACT in der Tabelle XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY gelesen, um das XX\_DELISYST zu bekommen.

Anschließend wird die Tabelle XX\_C\_CONTRACT\_KG mit der XX\_SST\_E\_KV\_VERBR über die Felder XX\_CONTRACT und XX\_DELISYST gejoint, um das Kaufkennzeichen FOKVKZ zu erhalten.

Bei der nachfolgenden Tabelle handelt es sich inhaltlich um 1 Tabelle zur Darstellung der benötigten Felder für einen Join. Aufgrund der limitierten Breite dieses Word-Dokuments wird die Tabelle zur besseren Lesbarkeit aber auf 4 Tabellen aufgeteilt. Darüber hinaus ist das Schlüsselmapping in Form einer Excel-Datei nach der folgenden Tabelle eingebettet.

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **XX\_C\_CONTRACT\_KG** | **INSTRUMENT** | **XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY** | **XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV** |
|  | F001 |  |  |
|  | INSTRUMENT\_ID |  |  |
| XX\_DELISYST | INF031 | XX\_DELISYST | XX\_DELISYST |
| XX\_CONTRACT | INF032 | XX\_CONTRACT | XX\_CONTRACT |
|  |  | XX\_SPARTE |  |
|  |  | XX\_GESNRGEN |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  | XX\_CALC\_MODE\_IND |
|  | INF033 |  | XX\_RISK\_TYPE\_IND |
|  |  |  | XX\_UNSTRESSED\_F |
|  |  |  | XX\_STRESSED\_F |
|  |  |  | XX\_ABS\_CR\_REL\_F |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_CU\_DELISYST\_COUNTERPART |  |  |  |
| XX\_CU\_NO\_COUNTERPART |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_DELISYST\_TR |  |  |  |
| XX\_TRANSACTION\_ID\_TR |  |  |  |
| XX\_TRANCHE\_ID\_TR |  |  |  |
| XX\_CURRENCY\_C |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_GP\_DELISYST\_COUNTERPART |  |  |  |
| XX\_GP\_NO\_COUNTERPART |  |  |  |
| XX\_USAGE\_POOL\_PR\_PORTF |  |  |  |
| XX\_USAGE\_POOL\_PR\_GROUP |  |  |  |
| XX\_USAGE\_POOL\_TYPE\_PR\_IND |  |  |  |
|  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV** | **XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA** | **XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS** | **XX\_C\_CUSTOMER** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_DELISYST\_CB | XX\_DELISYST | XX\_DELISYST |  |
| XX\_CONTRACT\_CB | XX\_CONTRACT | XX\_CONTRACT |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_DELISYST\_TA |  |  |  |
| XX\_TRANSACTION\_ID\_TA |  |  |  |
|  |  | XX\_CALC\_MODE\_IND |  |
|  | XX\_RISK\_TYPE\_IND | XX\_RISK\_TYPE\_IND |  |
|  |  | XX\_UNSTRESSED\_F |  |
|  |  | XX\_STRESSED\_F |  |
|  |  | XX\_ABS\_CR\_REL\_F |  |
|  | XX\_UNSTRESSED\_F |  |  |
|  | XX\_STRESSED\_F |  |  |
|  | XX\_ABS\_CR\_REL\_F |  |  |
|  | XX\_CALC\_MODE\_IND |  |  |
|  |  |  | XX\_DELISYST |
|  |  |  | XX\_CUSTOMER\_NO |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV** | **XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG** | **XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB** | **XX\_C\_COUNTRY** |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  | XX\_DELISYST | XX\_DELISYST |  |
|  | XX\_CONTRACT | XX\_CONTRACT |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
| XX\_DELISYST |  |  |  |
| XX\_CUSTOMER\_NO |  |  |  |
| XX\_CALC\_MODE\_IND |  |  |  |
| XX\_RISK\_TYPE\_IND |  |  |  |
|  | XX\_TA\_C |  |  |
|  |  | XX\_SEQUENCE\_LEG |  |
|  |  | XX\_LEDGER\_IND |  |
|  |  | XX\_CURRENCY\_C |  |
| XX\_CTRY\_TR |  |  | XX\_COUNTRY\_CODE\_CDB\_IND |
|  |  |  | XX\_DELISYST\_CU\_NO\_COUNTERPART |
|  |  |  | XX\_CU\_NO\_COUNTERPART |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |
|  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **XX\_C\_CUSTOMER\_T** | **XX\_C\_ABS\_TRANSACTION** | **XX\_C\_ABS\_TRANCHE** | **XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS** | **FX\_RATE** |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  | XX\_DELISYST |  |
|  |  |  | XX\_CONTRACT |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  | XX\_SEQUENCE\_LEG |  |
|  |  |  | XX\_LEDGER\_IND |  |
|  |  |  | XX\_CURRENCY\_C |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| XX\_CUSTOMER\_NO |  |  |  |  |
| XX\_DELISYST |  |  |  |  |
|  | XX\_DELISYST | XX\_DELISYST |  |  |
|  | XX\_TRANSACTION\_ID | XX\_TRANSACTION\_ID |  |  |
|  |  | XX\_TRANCHE\_ID |  |  |
|  |  |  |  | CUR001 |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **XX\_CON\_ 2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG** | **XX\_C\_GLOBAL\_PARTY** | **XX\_CON\_ 2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV** | **XX\_SST\_E\_KV\_VERBR** | **XX\_SST\_E\_IKIK** |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| XX\_DELISYST\_CB |  | XX\_DELISYST\_CB |  |  |
| XX\_CONTRACT |  | XX\_CONTRACT | XX\_CONTRACT |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | XX\_GESNRGEN |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
| XX\_RISK\_TYPE\_IND |  | XX\_RISK\_TYPE\_IND |  |  |
| XX\_CALC\_MODE\_IND |  | XX\_CALC\_MODE\_IND |  |  |
| XX\_LINK\_TYPE |  | XX\_LINK\_TYPE |  |  |
| XX\_UNSTRESSED\_F |  | XX\_UNSTRESSED\_F |  |  |
| XX\_STRESSED\_F |  | XX\_STRESSED\_F |  |  |
| XX\_ABS\_CR\_REL\_F |  | XX\_ABS\_CR\_REL\_F |  |  |
| XX\_DELISYST\_AS |  | XX\_DELISYST\_AS |  |  |
| XX\_ASSET\_ID |  | XX\_ASSET\_ID |  |  |
| XX\_DELISYST\_AG |  | XX\_DELISYST\_AG |  |  |
| XX\_AGREEMENT\_ID |  | XX\_AGREEMENT\_ID |  |  |
|  | XX\_DELISYST |  |  |  |
|  | XX\_GLOBAL\_PARTY\_NO |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  | XX\_FOKVKZ |  |

Tabelle 3: Schlüsselmapping zur Generierung von Einträgen in Tabelle POSITION

Zu beachten ist, dass vor Ausführung der in diesem Kapitel definierten Joins zunächst die jeweiligen Datenmengen gefiltert werden gemäß den im Kapitel „Filter für Quelltabellen / Aliasse“ festgelegten Filterbedingungen.

Grundlage des Schlüsselmappings als Excel-Datei: 

# Generelle Filter

## Filter für Veredelungen – aktuell nicht relevant

Dieses Kapitel ist nur für den Lesezugriff auf EGB-Tabellen relevant.

Für den Lesezugriff auf EGB-Tabellen müssen **extern freigegebene** Veredelungen berücksichtigt werden.

Für Für den Lesezugriff auf EGB-Tabellen sollen **keine** Veredelungen berücksichtigt werden.

## Filter für Laufzeitkomponenten / Bewirtschaftungsprozesse – aktuell nicht relevant

Die Bewirtschaftung des FRDWH erfolgt getrennt nach Laufzeitkomponenten. Der Filter für die jeweilige Laufzeitkomponente wird zur Laufzeit parametergesteuert gesetzt, deshalb werden hier die relevanten Laufzeitkomponenten gelistet.

Die folgende Tabelle stellt dar, für welche Laufzeitkomponenten die Bewirtschaftung gemäß diesem FDS relevant ist und welche Filter für die jeweiligen Laufzeitkomponenten zu setzen sind:

Zur Verdeutlichung des Zusammenspiels zwischen der Definition der Laufzeitkomponenten und Aliasse wird ein fiktives, an SAP Credit angelehntes Beispiel definiert.

Es wird unterstellt, dass es für die Datenquellen zwei Bewirtschaftungen gibt:

* EGB\_CBGLBAS wird für den gesamten Konzern in einem Prozess bewirtschaftet
* EGB\_LICBBP wird mit verschiedenen Linktypes in einem Prozess bewirtschaftet

Die Verarbeitung im nachfolgenden Prozess soll nach AG-Inland und Rest getrennt erfolgen, dabei werden zwei unterschiedliche Links (zum Darlehensnehmer und zum Refinanzierungsgeber) je Verarbeitungsprozess benötigt

Die Tabelle wird (perspektivisch) von MapMe! befüllt, bis dahin direkt im Word-Dokument.

| **Ziel-Laufzeitkomponente (LZK)** | **Alias der Quelltabelle** | **Quell-FDS** | **Quell-Laufzeitkomponente** | **Filter** |
| --- | --- | --- | --- | --- |

Tabelle 4: Übersicht der Aliasse je Laufzeitkomponente

## Filter für Quelltabellen / Aliasse

Sofern für eine Quelltabelle bzw. einen Alias neben dem Quellsystem weitere Filter verwendet werden, sind diese hier aufgeführt.

Für die flexible Steuerung interner Geschäfte, wird ein **globaler Kontextparameter** in Abacus eingeführt und verwendet. Der Parameter bietet den Vorteil, dass das Aussteuern oder Einbeziehen von internen Geschäften ohne einen Deployment-Einsatz möglich ist.

In Abacus ist der Parameter unter dem Transformprozess (Transform XX CORD Data to Abacus) zu finden. Für die automatisierte Verarbeitung wird der Parameter in UC4 konfiguriert.

Der Parameter hat die Ausprägungen “Ja“ und “Nein“. Bei der Auswahl “Ja“, werden die internen Geschäfte ausgeschlossen, d.h. der folgende Filter kommt in der Tabelle XX\_C\_CONTRACT zum Einsatz:

XX\_INTERN\_TRADE\_IND in ('0', '^', NULL) and XX\_INTERN\_TRADE\_BENEF\_IND in ('0', '^', NULL)

Andernfalls bzw. bei der Auswahl “Nein“ darf kein Filter angewandt werden, d.h. interne Geschäfte werden berücksichtigt.

| **Aliasname** (**ALIAS**) | **Quelltabelle** | **Filterbedingung** | **Bemerkung** | **Tabellencluster** | **Aggregation** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| FX\_RATE | FX\_RATE |  | Fremdwährungskurse  Aufnahme von FX\_RATE für die Bewirtschaftung CRE101, CRE102 und CRE103 |  |  |
| INSTRUMENT | INSTRUMENT |  |  |  |  |
| POSITION | POSITION |  |  |  |  |
| XX\_C\_ABS\_TRANCHE | XX\_C\_ABS\_TRANCHE |  | Verbriefungstranche ABS aus CARISMA |  |  |
| XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR | select XX\_DELISYST\_CB, XX\_CONTRACT\_CB, SUM(XX\_SEC\_RATE\_NO) from XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR group by XX\_DELISYST\_CB, XX\_CONTRACT\_CB | Wird für verbriefte Geschäfte benötigt; XX\_SEC\_RATE\_NO = in Verbriefungstransaktion eingeflossener Anteil des Geschäfts. |  |  |
| XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION |  | Verbriefungstransaktion ABS aus CARISMA |  |  |
| XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND = 'SOLVV\_FULLSTA'  and XX\_LINK\_TYPE = '60001'  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'O'  and XX\_UNSTRESSED\_F = 'T' | Beschränkung auf FULLSTA Daten |  |  |
| XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR |  | Details siehe Kapitel 2.1 |  |  |
| XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_FULLST | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND = 'SOLVV\_FULLSTA'  and XX\_LINK\_TYPE = '80001'  and XX\_COLLATERAL\_OID !='-10'  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'O'  and XX\_UNSTRESSED\_F ='T'  and XX\_STRESSED\_F ='T'  and XX\_ABS\_CR\_REL\_F = 'F' | Beschränkung auf FULLSTA Daten |  |  |
| XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR | select XX\_DELISYST\_CB, XX\_CONTRACT, SUM(RWA\_OB\_PRESUP\_CLA), SUM(XX\_EAD\_COLL\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA) from  XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR  where  XX\_CALC\_MODE\_IND = 'SOLVV'  and XX\_LINK\_TYPE = '80001'  and XX\_COLLATERAL\_OID !='-10'  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'O'  and XX\_UNSTRESSED\_F ='T'  and XX\_STRESSED\_F ='T'  and XX\_ABS\_CR\_REL\_F = 'F'  and ((XX\_APPROACH\_IND = 'STA'  and XX\_EAD\_COLL\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA > '0')  or (XX\_APPROACH\_IND = 'AIRB'  and XX\_EAD\_COLL\_CCF\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA > '0'))  group by XX\_DELISYST\_CB, XX\_CONTRACT | Anreicherung RWA vor Supporting Faktor für das besichertes Teilchen. |  |  |
| XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE | XX\_TA\_C != 'STK' | Zur Aggregation siehe Abschnitt Vorverarbeitung in Kapitel Schlüsselmapping, Stücke werden als Objektwährung ausgeschlossen |  |  |
| XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD | XX\_LEDGER\_IND = 'HGB' | Risikovorsorge-Spiegel Accounting eingeschränkt auf HGB-Daten |  |  |
| XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD | LEDGER\_IND = 'IFRS' und  SEQUENCE\_LEG = '1' | Risikovorsorge-Spiegel Accounting eingeschränkt auf IFRS-Daten |  |  |
| XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY | XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY |  |  |  |  |
| XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_C\_CONTRACT | PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND != 'REWE'  and  (CDB\_STRUCT = 'VS\_LOAN' and DELISYST in ('103','104','115','208','209','210','212','221','223','224','237','247','602')  or  CDB\_STRUCT = 'VS\_ACCOUNT' and DELISYST in ('100','101','106','107','108','111','208','210','211','212','218','219','223','224','225','237','308','316','602')  or  CDB\_STRUCT = 'VS\_LIMIT' and DELISYST in ('020','111','208','602')  or  CDB\_STRUCT = 'VS\_MOTRANS' and DELISYST in ('102','107','110','210','211','212','218','223','224','225','237','303','307','337','308','316','602')) | Führende Tabelle mit Filterung auf KG-relevante Strukturen, über Delisyst erfolgt insbesondere die Abgrenzung zum Portfolio Derivate/ SFT/ Wertpapiere.  Zur Vereinfachung der Tests wurde der Filter um das B2 Kennzeichen erweitert. |  |  |
| XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND = 'SOLVV'  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'A'  and XX\_UNSTRESSED\_F ='F'  and XX\_STRESSED\_F = 'T'  and XX\_ABS\_CR\_REL\_F = 'F' | Nur verbriefungsrelevante Positionen (XX\_ABS\_CR\_REL\_F) mit ABS-Risiko (XX\_RISK\_TYPE\_IND) |  |  |
| XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND in ('CRAG\_FULLSTA', 'SOLVV\_FULLSTA')  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'O'  and XX\_UNSTRESSED\_F ='T'  and XX\_STRESSED\_F = 'T'  and XX\_ABS\_CR\_REL\_F = 'F' | Filterung auf Obligorrisiken (XX\_RISK\_TYPE\_IND) für Ermittlung CCF in der LR (B017); für KG- und REWE-Positionen keine Unterscheidung zwischen stressed/ unstressed, daher immer 'true' (XX\_UNSTRESSED\_F und XX\_STRESSED\_F); Ausschluß verbriefungsrelevante Positionen (XX\_ABS\_CR\_REL\_F) |  |  |
| XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND in ('CRAG\_SOLVV','SOLVV')  and XX\_RISK\_TYPE\_IND in ('O', 'T')  and XX\_UNSTRESSED\_F ='T'  and XX\_STRESSED\_F = 'T'  and XX\_ABS\_CR\_REL\_F in ('F','T') | Filterung auf Obligor- und Transferrisiken (XX\_RISK\_TYPE\_IND) für SOLVV und LE; für KG- und REWE-Positionen keine Unterscheidung zwischen stressed/ unstressed, daher immer 'true' (XX\_UNSTRESSED\_F und XX\_STRESSED\_F); verbriefungsrelevante und irrelevante Positionen (XX\_ABS\_CR\_REL\_F) |  |  |
| XX\_C\_COUNTRY | XX\_C\_COUNTRY |  | Wird für die Ermittlung des Transferrisiko-Partners benötigt. |  |  |
| XX\_C\_CUSTOMER | XX\_C\_CUSTOMER |  |  |  |  |
| XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR | XX\_CALC\_MODE\_IND = 'SOLVV'  and XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'O' | Partnerinformationen zu Obligorrisiken (XX\_RISK\_TYPE\_IND) für SOLVV und LE |  |  |
| XX\_C\_CUSTOMER\_T | XX\_C\_CUSTOMER |  | Wird für die Ermittlung des Ausfallkennzeichen des Transferrisiko-Partners benötigt. |  |  |
| XX\_C\_GLOBAL\_PARTY | XX\_C\_GLOBAL\_PARTY |  |  |  |  |
| XX\_LUT\_COMP\_REL | XX\_LUT\_COMP\_REL |  | Tabelle zur Kennzeichnung relevanter Liefersysteme (DELISYST) i.V.m. dem COMPANY\_CODE\_IND. |  |  |
| XX\_MAP\_B013\_DEAL | XX\_MAP\_B013\_DEAL |  | Mapping Forderungsklasse KSA |  |  |
| XX\_MAP\_B014\_DEAL | XX\_MAP\_B014\_DEAL |  | Mapping Forderungsklasse IRBA |  |  |
| XX\_MAP\_CRI502\_DEAL | XX\_MAP\_CRI502\_DEAL |  | IRB-Kalkulationsansatz (Verbriefungen) |  |  |
| XX\_MAP\_PTY002 | XX\_MAP\_PTY002 |  | Unterscheidung On-/Offbalance |  |  |
| XX\_SST\_E\_IKIK | XX\_SST\_E\_IKIK | Keine |  |  |  |
| XX\_SST\_E\_KV\_VERBR | XX\_SST\_E\_KV\_VERBR | Keine |  |  |  |

Tabelle 5: Übersicht der Aliase

## Filter für die relevanten Datensätze über XX\_LUT\_COMP\_REL

Bei der Ausleitung der Daten muss entschieden werden, welche Datensätze übermittelt werden dürfen. Hierzu existiert die Referenztabelle XX\_LUT\_COMP\_REL (Zugriff gemäß Kapitel 5.10). In dieser Tabelle wird pro XX\_DELISYST und XX\_COMPANY\_CODE\_IND definiert, welche Datensätze ausgeliefert werden dürfen/sollen und welche nicht (XX\_DELIVERY\_RELEVANT\_F).

## Filterbedingungen Cluster (HGB/IFRS)

**Bewirtschaftung HGB Cluster**

Ausschluss der Transferrisikosätze (RISK\_TYPE\_IND = 'T')

**Bewirtschaftung IFRS Cluster**

Für die Large Exposure Meldung sind die anteiligen Zinsen (C223) am Einzelgeschäft analog zu AG Inland auch für AG Ausland anzuliefern. Für die Own Funds/LR Meldung sind anteilige Zinsen für AG Inland am Einzelgeschäft anzuliefern und für AG Ausland via Sammelkonto (ReWe-Konten), da der Rechenkern in der Bemessungsgrundlage bzw. im EAD und somit auch in der RWA-Berechnung keine anteiligen Zinsen für AG Ausland berücksichtigt. Um eine Datenduplizierung der Datensätze für AG Ausland zu umgehen, erfolgt die Steuerung der Bewirtschaftung über die unterschiedlichen Cluster IFRS OWF/LR vs. Cluster IFRS LE.

# Transformationsübersicht

Zur Bewirtschaftung des Feldes F001 wird auf das zuvor in der Entität INSTRUMENT zu bewirtschaftende Feld F001 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes INSTRUMENT\_ID0 wird auf das zuvor in der Entität INSTRUMENT zu bewirtschaftende Feld INSTRUMENT\_ID zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes B436 wird auf das zuvor in der Entität INSTRUMENT zu bewirtschaftende Feld C206 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung der Felder C215 und PTY001 wird auf das zuvor in der Entität INSTRUMENT zu bewirtschaftende Feld C207 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung der Felder B007 und C226 wird auf das zuvor zu bewirtschaftende Feld C215 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung der Felder C223 und C224 wird auf das zuvor zu bewirtschaftende Feld PTY001 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes B046 wird auf das zuvor zu bewirtschaftende Feld CRI159 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes B217 wird auf das zuvor zu bewirtschaftende Feld B014 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes CRI113 wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder C265 und C267 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung einer großen Anzahl von Feldern in der Entität POSITION wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder B500 und B603 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes B036 muss das Feld B603 vorher ermittelt werden!

Zur Bewirtschaftung des Feldes CRI167 wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder B436 und RLV370 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes RLV370 wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder B436, C206 und B603 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes RLV375 wird auf das zuvor zu bewirtschaftende Feld RLV370 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes VAL370 wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder B500, C215, RLV370, VAD280, C265 und B603 zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung der Felder CRE101, CRE102 & CRE104 wird auf die zuvor zu bewirtschaftende Tabelle FX\_RATE zugegriffen.

Zur Bewirtschaftung des Feldes VAD670 wird auf die zuvor zu bewirtschaftenden Felder RLV370, VAD280, C226 und C265 zugegriffen.

Die folgende Tabelle beschreibt die Transformationen zur Bewirtschaftung der Zieltabelle POSITION:

| **#1** | **Ziel-Feld** | **Ziel-Datentyp** | **Quell-Objekt** | **Quell-Feld** | **Quell-Datentyp** | **Transformationsanweisung** | **Bemerkung** |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1 | F001 | VARCHAR(20) | INSTRUMENT | F001 | VARCHAR(20) | POSITION.F001 = INSTRUMENT.F001 | Geschäftseinheit  Übernahme aus Entität INSTRUMENT |
| 2 | POSITION\_ID | VARCHAR(100) | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) | if XX\_RISK\_TYPE\_IND = 'T'  then  'FRDWH-' || XX\_DELISYST || '-' || XX\_CONTRACT || '-' || XX\_RISK\_TYPE\_IND  else  'FRDWH-' || XX\_DELISYST || '-' || XX\_CONTRACT | Position ID  Besonderheit TDA: Der gelieferte CONTRACT aus CORD wäre in der Staging zu trennen und die POSITION\_ID z.B. mit Suffix "\_A" und "\_L" zu erweitern, wobei hier die Aktiva und Passiva gekennzeichnet werden |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RISK\_TYPE\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 3 | B005 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  siehe Kap. 5.8 | Risikogewicht KSA  XX\_RW\_IRB\_BS\_AS = KSA-Risikogewicht vor Besicherung nach Kreditsubstitution, XX\_SME\_SUPPORT\_FACT\_CRR\_P = KMU-Unterstützungsfaktor gem. CRRII, B500 = Risikoansatz (0 = KSA)  In XX\_RW\_IRB\_BS\_AS liegt nur das finale Risikogewicht inkl. KMU-Unterstützungsfaktor vor. Für B005 muss daher über XX\_SME\_SUPPORT\_FACT\_CRR\_P eine Rückrechnung erfolgen. |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RM\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_EXCL\_RM | NUMBER(10,8) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_INCL\_RM | NUMBER(10,8) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RW\_PRESUP | NUMBER(25,10) |  |  |
| 4 | B007 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'O'  then (if B500 = 2  then ( if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.ADJ\_RW\_PRESUP is NULL  then (if XX\_RW\_IRB\_BS\_AS is not NULL then XX\_RW\_IRB\_BS\_AS /XX\_SME\_SUPPORT\_FACT\_CRR\_P else NULL)  else XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.ADJ\_RW\_PRESUP)  else NULL)  else (if B500 = 2  then (if ( XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = 0 or POSITION.C215 [IFRS] = 0)  then 0  else ( XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA /(POSITION.C215 [IFRS] \* POSITION.B018)))  else NULL)  Hinweis: das Feld POSITION.C215 und POSITION.B018 soll aus dem IFRS-Cluster gezogen werden. | Risikogewicht IRBA  "XX\_ADJ\_RW\_PRESUP = IRB-Risikogewicht vor Besicherung nach Kreditsubstitution vor KMU, XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Transferrisiko nach KMU, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) "  XX\_RW\_IRB\_BS\_AS = IRB-Risikogewicht vor Besicherung nach Kreditsubstitution, B018 = CCF Factor FIRB  XX\_SME\_SUPPORT\_FACT\_CRR\_P = KMU-Unterstützungsfaktor gem. CRRII  Für Transferrisiken liegt kein Risikogewicht vor, es bedarf daher der Rückrechnung via RWA und EAD.  POSITION.C215 sollte aus IFRS Cluster herangezogen werden. |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | C215 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ADJ\_RW\_PRESUP | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RW\_IRB\_BS\_AS | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_SME\_SUPPORT\_FACT\_CRR\_P | NUMBER(18,9) |  |  |
| 5 | B008 | double |  |  |  | NULL |  |
| 6 | B013 | Integer | POSITION | B500 | Integer | if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then if XX\_APPROACH\_IND != 'IRBA' then '60' else NULL  else  if B500 = 0 and XX\_HIGH\_RISK\_F = 'T'  then 80  else if CRI159 in ('1','2','3') then 91  else (if B500 = 0  then Zugriff auf XX\_MAP\_B013\_DEAL mit XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND und XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR.XX\_COVERED\_BOND\_F  else (if B500 = 2  then (if B603 = 'T'  then 10  else Zugriff auf XX\_MAP\_B013\_DEAL mit XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND und XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR.XX\_COVERED\_BOND\_F)  else NULL))  Wird in der XX\_MAP\_B013\_DEAL kein Eintrag gefunden, dann wird B013 mit NULL befüllt und Error ID 1001 #DQ protokolliert. | Forderungsklasse KSA  Annahme: Transferrisiko wird weiterhin berücksichtigt.  XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND = KSA-Forderungsklasse, XX\_COVERED\_BOND\_F = Kennz. Gedeckte Schuldverschreibung, XX\_HIGH\_RISK\_F = Kennz. Geschäft mit hohem Risiko, B500 = Risikoansatz (0 = KSA, 2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko), CRI159 = Verzugs- & Ausfallkennzeichen, B013 (10 = Zentralregierungen, 80 = Mit besonders hohen Risiken verbundene Positionen, 60 = Verbriefungen, 91 = Ausgefallene Forderungen) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | CRI159 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_COVERED\_BOND\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_HIGH\_RISK\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_B013\_DEAL | XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_B013\_DEAL | XX\_COVERED\_BOND\_F | CHAR(1) |  |  |
| 7 | B014 | Integer | POSITION | B500 | Integer | Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.1 beschrieben. | Forderungsklasse IRBA  Annahme: Transferrisiken werden berücksichtigt. |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RETAIL\_CAT\_SOLVV\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_SPECIAL\_LOAN\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_B014\_DEAL | XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
| 8 | B017 | double | POSITION | B500 | Integer | Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.2 beschrieben. | Kreditumrechnungsfaktor (CCF) KSA |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_CONV\_FACT\_STA\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CCF\_USED\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 9 | B018 | double | POSITION | B500 | Integer | if B500 = 2  then (if XX\_CCF\_USED\_P is NULL  then 1  else XX\_CCF\_USED\_P / 100)  else NULL | Kreditumrechnungsfaktor (CCF) IRB  XX\_CCF\_USED\_P = CCF aus SolvV-RK-Lauf, B500 = Risikoansatz (0= KSA) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CCF\_USED\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 10 | B020 | double | POSITION | B500 | Integer | if B500 = 2  then (if B603 = 'T'  then (if xx\_PTE\_P > 99 and xx\_PTE\_P < 100 then 0,99 else round(XX\_PTE\_P / 100, 6))  else (if XX\_PD\_CU\_INCL\_FLOOR\_CR\_P > 99 and XX\_PD\_CU\_INCL\_FLOOR\_CR\_P < 100 then 0,99 else round(XX\_PD\_CU\_INCL\_FLOOR\_CR\_P/100, 6)))  else null | Ausfallwahrscheinlichkeit  XX\_PD\_CU\_INCL\_FLOOR\_CR\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit inkl. Floor Schuldner, PTE\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PD\_CU\_INCL\_FLOOR\_CR\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 11 | B022 | double |  |  |  | NULL |  |
| 12 | B023 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB:  baw. keine Umsetzung für HGB  Bewirtschaftung Cluster IFRS:  if B603 = 'A' and SEC502 in (2,3,4) then XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA - XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_ABS\_LLP\_CLA else  if B500 = 0  then XX\_C\_CONTRACT\_LDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA  else NULL | Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktor (CCF) KSA  XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA/XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA = Bemessungsgrundlage, XX\_ABS\_LLP\_CLA = Wertberichtigungen, SEC502 = Verbriefungsansatz (1 = SEC IRBA, 2 = SEC SA, 3 = SEC ERBA, 4 = SEC IAA), B500 = Risikoansatz (0 = KSA),B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko, A=ABS) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | SEC502 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_LLP\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 13 | B024 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB:  baw. keine Umsetzung für HGB  Bewirtschaftung Cluster IFRS:  Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.3 beschrieben. | Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktor (CCF) IRB  XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA/XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA = Bemessungsgrundlage, SEC502 = Verbriefungsansatz (1 = SEC IRBA, 2 = SEC SA, 3 = SEC ERBA, 4 = SEC IAA), B500 = Risikoansatz (0 = KSA), XX\_LGD\_BE\_P = LGD Best Estimate, XX\_PTE\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko, ABS) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | SEC502 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_BE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 14 | B026 | double |  |  |  | NULL |  |
| 15 | B027 | double |  |  |  | NULL |  |
| 16 | B028 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'O'  then (if B500 = 0  then (if XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA)  else NULL)  else NULL | RWA KSA  XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA = KSA-RWA Obligor nach KMU, B500 = Risikoansatz (0 = KSA), B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 17 | B029 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O'  then (if XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA)  else (if XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA))  else NULL | RWA IRBA  XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Obligor nach KMU, XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Transferrisiko nach KMU, B500 = Risikoansatz (2 = IRBA), B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 18 | B032 | double |  |  |  | NULL |  |
| 19 | B033 | double |  |  |  | NULL |  |
| 20 | B035 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O'  then if XX\_LGD\_BS\_AS\_BE\_UNSEC\_PART\_P is NULL or XX\_LGD\_BS\_AS\_BE\_UNSEC\_PART\_P = 0  then NULL  else round((XX\_LGD\_BS\_AS\_BE\_UNSEC\_PART\_P/100),7)  else (if B603 = 'T'  then 1,0  else NULL))  else NULL | Effektive Verlustquote  B500 = Risikoansatz (0=KSA; 2=IRBA), B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko), XX\_LGD\_BS\_AS\_BE\_UNSEC\_PART\_P (=LGD adj. BE after CRM) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_BS\_AS\_BE\_UNSEC\_PART\_P | NUMBER(25,10) |  |  |
| 21 | B036 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then round(XX\_ABS\_PPD\_CLA,2)  else NULL | Kaufpreisnachlass  XX\_ABS\_PPD\_CLA=Kaufpreisnachlass |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_PPD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 22 | B037 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if  (XX\_ABS\_NON\_REFUND\_PPD\_CLA != 0 and XX\_ABS\_NON\_REFUND\_PPD\_CLA is not NULL) and  (XX\_ABS\_PPD\_CLA != 0 and XX\_ABS\_PPD\_CLA is not NULL)  then  (XX\_ABS\_NON\_REFUND\_PPD\_CLA / XX\_ABS\_PPD\_CLA)  else  NULL)  else NULL | Prozentualer nicht erstattungsfähiger Kaufpreisabschlag  XX\_ABS\_NON\_REFUND\_PPD\_CLA=  Nicht erstattungsfähiger Kaufpreis  XX\_ABS\_PPD\_CLA=Kaufpreisnachlass |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_NON\_REFUND\_PPD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_PPD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 23 | B040 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB:  baw. keine Umsetzung für HGB  Bewirtschaftung Cluster IFRS:  if B500 = 2  then (if (B603 = 'O' or (B603 = 'T' and XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_PTE\_P = 100))  then round ((XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_LGD\_BE\_UNSEC\_P/ 100), 9)  else (if (B603 = 'T' and XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_PTE\_P < 100)  then 1  else NULL))  else NULL | Erwartete Verlustquote bei Ausfall (LGD) als beste Schätzung  XX\_LGD\_BE\_UNSEC\_P = LGD Best Estimate, XX\_PTE\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_BE\_UNSEC\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 24 | B062 | double |  |  |  | NULL |  |
| 25 | B067 | double |  |  |  | NULL |  |
| 26 | B072 | double |  |  |  | NULL |  |
| 27 | B073 | double |  |  |  | NULL |  |
| 28 | B080 | double |  |  |  | NULL |  |
| 29 | B081 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 30 | B135 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 31 | B148 | double |  |  |  | NULL |  |
| 32 | B152 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 33 | B153 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 34 | B156 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 35 | B173 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 != 'T' and XX\_FORFAITING\_F = 'T'  then 1  else 0 | Angekaufte Forderung (0=Nein, 1=Ja)  XX\_FORFAITING\_F = Forfaitierungskennzeichen: Das Kennzeichen dient der Identifikation forfaitierter Darlehen  B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_FORFAITING\_F | CHAR(1) |  |  |
| 36 | B183 | double |  |  |  | NULL |  |
| 37 | B188 | double |  |  |  | NULL |  |
| 38 | B196 | double |  |  |  | NULL |  |
| 39 | B197 | double |  |  |  | NULL |  |
| 40 | B199 | double |  |  |  | NULL |  |
| 41 | B210 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 42 | B211 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_TRNCHE\_MAT\_RM\_YEAR is not NULL and XX\_ABS\_TRNCHE\_MAT\_RM\_YEAR != '0'  then round((XX\_ABS\_TRNCHE\_MAT\_RM\_YEAR x 360),0) (ganzzahlig runden)  else NULL)  else NULL | Konservative Restlaufzeit in Tagen  XX\_ABS\_TRNCHE\_MAT\_RM\_YEAR=Die Restlaufzeit der Tranche in Jahren |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_TRNCHE\_MAT\_RM\_YEAR | NUMBER(7,5) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 43 | B212 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 44 | B227 | double |  |  |  | NULL |  |
| 45 | B280 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 46 | B309 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 47 | B412 | double |  |  |  | NULL |  |
| 48 | B416 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA is not NULL  then round(XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA,2)  else NULL)  else NULL | Zuschlagsbetrag auf den RWA  XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA=RWA Zuschlag/  Differenz zwischen gekappter RWA und RWA vor der Anwendung von Wertberichtigung |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 49 | B421 | double |  |  |  | NULL |  |
| 50 | B422 | double |  |  |  | NULL |  |
| 51 | B425 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 52 | B426 | double |  |  |  | NULL |  |
| 53 | B429 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND != 'SEC-IRBA' and XX\_RW\_METH\_IND != 'V'  then round(XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA,2) else 0)  else NULL | Exposure Verbriefungsframework SA  XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA=Bemessungsgrundlage vor Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken gem. SolvV  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18 KWG)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 54 | B430 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND is not NULL and XX\_ABS\_APPROACH\_IND != 'SEC-IRBA'  and XX\_CDB\_STRUCT != 'VS\_LIMIT'  then round((XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P / 100),2) else 1)  else NULL | CCF Verbriefungsframework SA  XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P=ABS Konversionsfaktor gem. SolvV § 239 (2), § 247 bzw. § 252 (2)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P | NUMBER(16,13) |  |  |
| 55 | B431 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-IRBA'  then round((XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P / 100),2) else NULL)  else NULL | CCF Verbriefungsframework IRB  XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P=ABS Konversionsfaktor gem. SolvV § 239 (2), § 247 bzw. § 252 (2)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P | NUMBER(16,13) |  |  |
| 56 | B432 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-IRBA' and XX\_RW\_METH\_IND != 'V'  then round(XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA,2) else 0)  else NULL | Exposure Verbriefungsframework IRB  XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA=Bemessungsgrundlage vor Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken gem. SolvV  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18b KWG)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 57 | B433 | double |  |  |  | NULL |  |
| 58 | B435 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 59 | B438 | double |  |  |  | NULL |  |
| 60 | B561 | double |  |  |  | NULL |  |
| 61 | B562 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then round(XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA,2)  else NULL | Bemessungsgrundlage Verbriefungsposition  XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA=Bemessungsgrundlage vor Anwendung von Kreditrisikominderungstechniken |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 62 | B570 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 63 | B603 | VARCHAR(25) | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) | if XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RISK\_TYPE\_IND != 'T' and XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_CONTRACT is not NULL then 'A' else if XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RISK\_TYPE\_IND != 'T' then 'O' else if XX\_DELISYST in ('100','101','102','107') then NULL else 'T' | Prüfpfad 3 Basel III  XX\_RISK\_TYPE\_IND = Art des Risikos (T= Transferrisiko, O = Obligorrisiko, A = ABS)  XX\_DELISYST = 100, 101, 102, 107 (Passivliefersysteme) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RISK\_TYPE\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RISK\_TYPE\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 64 | B605 | double |  |  |  | NULL |  |
| 65 | B606 | double |  |  |  | NULL |  |
| 66 | B608 | double |  |  |  | NULL |  |
| 67 | B613 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 68 | B614 | double |  |  |  | NULL |  |
| 69 | B712 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 70 | B740 | double |  |  |  | NULL |  |
| 71 | B764 | double |  |  |  | NULL |  |
| 72 | B780 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then XX\_ABS\_EC\_REDUCTION\_CLA  else NULL | Eigenkapitalabzugsbetrag für Verbriefungen  B603 Kreditrisiko (T= Transferrisiko, O= Obligorrisiko, A= ABS Risik0)  XX\_ABS\_EC\_REDUCTION\_CLA = Eigenkapitalabzugsbetrag |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_EC\_REDUCTION\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 73 | B825 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND is not NULL  then XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND  else if XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND is not NULL and  ((XX\_RW\_METH\_IND = 'R' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND != 'I') or  (XX\_RW\_METH\_IND = 'A' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND in ('A', 'E', 'O')))  then XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND  else NULL)  else NULL | Bonitätsstufe  XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND=Initiale Bonitätsstufe (CQS, credit quality Step, gemäß Solvv) der Tranche, Stufe (01-12)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND=Maßgebliche Bonitätsstufe aktuell der Verbriefungstranche (Credit Quality Step)  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde. (R= ratingbasierter Ansatz ext. Rating, A= 1250% Risikogewicht (kein anderes Verfahren anwendbar))  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND=Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (A=Inferred rating, E=External ratings, O=No valid rating, I=IAA rating) |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANCHE | XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND | NUMBER(2,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND | NUMBER(2,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 74 | B842 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 75 | B851 | double |  |  |  | NULL |  |
| 76 | B852 | double |  |  |  | NULL |  |
| 77 | B854 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 78 | B855 | double |  |  |  | NULL |  |
| 79 | B857 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 80 | B858 | double |  |  |  | NULL |  |
| 81 | B859 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 82 | B867 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 83 | B872 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 84 | B874 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 85 | B878 | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 86 | B880 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-SA' and XX\_RM\_METH\_IND = 'O'  and XX\_RW\_METH\_IND = 'I' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND = 'I'  then 1  else NULL)  else NULL | Ausnahmeregelung zur Verwendung IAA für Verbriefungen im Standardansatz gem. Art. 109 (1) CRR erfüllt  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (I=Rating based approach on IAA, A= 1250% Risikogewicht (kein anderes Verfahren anwendbar, R= Ratings basierter Ansatz/ externe Rating)  XX\_RM\_METH\_IND=Art der Kreditrisikominderung (O= nicht besichert)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND=Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (I= IAA rating, A=Inferred rating, E=External ratings, O=No valid rating) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RM\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 87 | B891 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if ((XX\_RW\_METH\_IND = 'R' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND != 'I') or  (XX\_RW\_METH\_IND = 'A' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND in ('A', 'E', 'O')))  then if XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND is not NULL  then (200 + XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND)  else if XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND is not NULL  then (200 + XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND)  else if XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND is NULL  then 218  else NULL)  else NULL | CQS bei Auflegung einer Verbriefungsposition  XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND=Initiale Bonitätsstufe (CQS, credit quality Step, gemäß Solvv) der Tranche, Stufe (01-12)  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (A= 1250% Risikogewicht (kein anderes Verfahren anwendbar, R= Ratings basierter Ansatz/ externe Rating)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND=Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (I= IAA rating, A=Inferred rating, E=External ratings, O=No valid rating)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND=Maßgebliche Bonitätsstufe aktuell der Verbriefungstranche (Credit Quality Step) |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANCHE | XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND | NUMBER(2,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_IND | NUMBER(2,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 88 | B892 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND is not NULL  and XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND != 0  then 0  else NULL)  else NULL | Kennzeichen kurzfristiges/langfristiges Rating bei Auflegung einer Verbriefungstransaktion  XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND=Initiale Bonitätsstufe (CQS, credit quality Step, gemäß Solvv) der Tranche, Stufe (01-12) |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANCHE | XX\_ABS\_CQS\_INITIAL\_IND | NUMBER(2,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 89 | C154 | double |  |  |  | NULL |  |
| 90 | C213 | double | POSITION | POSITION\_ID | VARCHAR(100) | Bewirtschaftung Cluster HGB  Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.10.1 beschrieben.  Bewirtschaftung Cluster IFRS  Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.10.2 beschrieben. | C213 = Nominalwert |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_A\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_L\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_NOMINAL\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_NOMINAL\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
| 91 | C214 | double | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BOOK\_VALUE\_O\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) | if XX\_TRADING\_BOOK\_F = 'T' then abs (BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA) else NULL | Anlieferung von Marktwert für Handelsbuchpositionen |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TRADING\_BOOK\_F | CHAR(1) |  |  |
| 92 | C215 | double | INSTRUMENT | C207 | DATE | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'T'  then NULL  else siehe Transformationsvorschriften in Kapitel 5.5.1  Bewirtschaftung Cluster IFRS  Transformationsvorschriften siehe Kapitel 5.5.2  Für die Umsetzung des Mappings sind die Hinweise in Kapitel 2 (Schlüsselmapping) zur Vorverarbeitung der Tabelle XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE zu beachten! | C215 = Buchwert  PTY001= Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1 = Aktiv-Position; 2 = Passiv-Position)  B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | PTY002 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_SEC\_RATE\_NO | NUMBER(14,13) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CDB\_STRUCT | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REF\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REFI\_IND | VARCHAR(5) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_D2\_CR\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_BE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 93 | C220 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TRADING\_BOOK\_F | CHAR(1) | if XX\_TRADING\_BOOK\_F = 'T'  then 1  else (if XX\_TRADING\_BOOK\_F = 'F'  then 0  else NULL) | Handelsbuch/Anlagebuch-Kennzeichen (0 = Anlagebuch, 1 = Handelsbuch)  XX\_TRADING\_BOOK\_F = Kennz. Handelsbuch |
| 94 | C240 | double |  |  |  | NULL |  |
| 95 | C283 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 96 | C286 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 97 | C289 | double |  |  |  | NULL |  |
| 98 | C292 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 99 | C298 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 100 | C721 | double |  |  |  | NULL |  |
| 101 | COL001 | Integer |  |  |  | COL001 = 0 | Kennzeichen Sicherheit  0= Keine Sicherheit |
| 102 | CRE015 | double | POSITION | B429 | double | 1:1 Übernahme B429 | Ursprüngliche Bemessungsgrundlage nach Aufrechnung |
| 103 | CRE016 | double | POSITION | B429 | double | 1:1 Übernahme B429 | Ursprüngliche Bemessungsgrundlage vor der Verteilung der Wertberichtigungen |
| 104 | CRE104 | double |  |  |  | NULL |  |
| 105 | CRE123 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'A' and SEC502 in (2,3,4) then XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA - XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_ABS\_LLP\_CLA else  if B500 = 0  then ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA  else NULL | Unbesicherte Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktor (CCF) KSA  ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA/XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA = Unbesicherte Bemessungsgrundlage vor CCF/Bemessungsgrundlage, XX\_ABS\_LLP\_CLA = Wertberichtigungen, SEC502 = Verbriefungsansatz (1 = SEC IRBA, 2 = SEC SA, 3 = SEC ERBA, 4 = SEC IAA), B500 = Risikoansatz (0 = KSA),B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | SEC502 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_LLP\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 106 | CRE124 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'A' and SEC502 = 1 then XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA else  if B500 = 2 then  (if B603 = 'O' then ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA  else XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA)  else NULL | Unbesicherte Bemessungsgrundlage vor Konversionsfaktor (CCF) IRB  ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA/XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA = Unbesicherte Bemessungsgrundlage vor CCF/Bemessungsgrundlage SolvV, SEC502 = Verbriefungsansatz (1 = SEC IRBA, 2 = SEC SA, 3 = SEC ERBA, 4 = SEC IAA), B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko), XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA = Bemesslungsgrundlage = Solvv |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | SEC502 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | NUMBER(14,2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSBAS\_UNSEC\_PRECCF\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 107 | CRE125 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'O'  then (if B500 = 0  then (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA)  else NULL  else NULL | Unbesicherter risikogewichteter Positionswert pre SME Faktor KSA  XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA = unbes. KSA-RWA Obligor vor KMU  B500 = Risikoansatz (0 = KSA)  B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 108 | CRE126 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O'  then (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA)  else (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA)  else NULL | Unbesicherter risikogewichteter Positionswert pre SME Faktor IRBA  XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA = unbes. IRBA-RWA Obligor vor KMU  XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Transferrisiko nach KMU B500 = Risikoansatz (2 = IRBA)  B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 109 | CRE128 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'O'  then (if B500 = 0  then (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA)  else NULL  else NULL | Unbesicherter risikogewichteter Positionswert KSA  XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA = Teil-RWA des unbesicherten Geschäfts nach SME  B500 = Risikoansatz (0 = KSA)  B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 110 | CRE129 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O'  then (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA)  else (if XX\_C\_CONTRACT \_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA)  else NULL | Unbesicherter risikogewichteter Positionswert IRBA  XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA = Teil-RWA des unbesicherten Geschäfts nach SME  XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Transferrisiko nach KMU  B500 = Risikoansatz (2 = IRBA)  B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 111 | CRI502 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | siehe Kapitel 5.9 | IRB-Kalkulationsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RM\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_CRI502\_DEAL | CRI502 | Integer |  |  |
| 112 | CUR008 | VARCHAR(3) |  |  |  | NULL |  |
| 113 | D104 | double |  |  |  | NULL |  |
| 114 | D517 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'O' and XX\_CATEGORY\_HGB\_IND = 'HB'  then 1  else 0 | Kennzeichen Handelsbestand (0 = nein, 1 = ja)  XX\_CATEGORY\_HGB\_IND = HGB-Bestandskategorie (HB= Handelsbestand), B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CATEGORY\_HGB\_IND | VARCHAR(8) |  |  |
| 115 | G002 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 116 | G008 | double |  |  |  | NULL |  |
| 117 | G009 | double |  |  |  | NULL |  |
| 118 | G010 | double |  |  |  | NULL |  |
| 119 | G011 | double |  |  |  | NULL |  |
| 120 | G012 | double |  |  |  | NULL |  |
| 121 | G013 | double |  |  |  | NULL |  |
| 122 | G020 | double |  |  |  | NULL |  |
| 123 | I001 | double |  |  |  | NULL |  |
| 124 | I003 | double |  |  |  | NULL |  |
| 125 | I004 | double |  |  |  | NULL |  |
| 126 | INSTRUMENT\_ID0 | VARCHAR(120) | INSTRUMENT | INSTRUMENT\_ID | VARCHAR(120) | INSTRUMENT\_ID0 = INSTRUMENT.INSTRUMENT\_ID | Instrument ID Referenz 0 Position - Instrument  Übernahme aus Entität INSTRUMENT |
| 127 | M316 | VARCHAR(3) |  |  |  | NULL |  |
| 128 | POSITION\_ID0 | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 129 | PTY010 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 130 | PTY011 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 131 | PTY069 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 132 | RLV105 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 133 | SEC124 | double |  |  |  | NULL |  |
| 134 | SEC126 | double |  |  |  | NULL |  |
| 135 | SEC903 | double |  |  |  | NULL |  |
| 136 | SEC905 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_ERBA\_LEASING\_F = 'T'  then 1  else if XX\_ABS\_ERBA\_OPTION\_F = 'T'  then2  else if XX\_ABS\_ERBA\_STS\_F = 'T'  then 3  else if XX\_ABS\_ERBA\_NON\_STS\_F = 'T'  then 4  else if XX\_ABS\_ERBA\_PRECLUDE\_F = 'T'  then 5  else if XX\_ABS\_ERBA\_HIERARCHY\_F = 'T'  then 7  else NULL)  else NULL | Anwendungsgrund des SEC-ERBA  XX\_ABS\_ERBA\_LEASING\_F=AUTO LOANS, AUTO LEASES AND EQUIPMENT LEASES  Article 254 (2) (c) of CRR. All auto loans, auto leases and equipment leases shall be reported in this column, even if they qualify for Article 254 (2) (a) or (b) of CRR  XX\_ABS\_ERBA\_OPTION\_F=SEC-ERBA OPTION  Article 254 (3) of CRR  XX\_ABS\_ERBA\_STS\_F=POSITIONS SUBJECT TO ART. 254(2)(a) CRR  Article 254 (2) (a) ofRR  XX\_ABS\_ERBA\_NON\_STS\_F=POSITIONS SUBJECT TO ART. 254(2)(b) CRR  Article 254 (2) (b) ofRR  XX\_ABS\_ERBA\_PRECLUDE\_F=POSITIONS SUBJECT TO ART. 254 (4) OR 258 (2) CRR  Securitisation positions subject to SEC-ERBA where the application of SEC-IRBA or SEC-SA has been precluded (ausgeschlossen) by the competent authorities as described in Article 254 (4) or 258 (2) of CRR  XX\_ABS\_ERBA\_HIERARCHY\_F=FOLLOWING THE HIERARCHY OF APPROACHES  Securitisation positions where SEC-ERBA is applied by following the hierarchy of approaches described in Article 254 (1) of CRR  SEC905=Anwendungsgrund des SEC-ERBA (1=Auto Loans, Auto Leases and Equipment Leases,2=SEC-ERBA Option, 3=Positions subject to Art. 254(2)(a) CRR, 4=Positions subject to Art. 254(2)(b) CRR, 5=Positions subject to Art. 254 (4) CRR, 6=Positions subject to Art. 258 (2) CRR, 7=Following the Hierarchy of Approaches) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_HIERARCHY\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_LEASING\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_NON\_STS\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_OPTION\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_PRECLUDE\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_ERBA\_STS\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 137 | SEC907 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 138 | TYP019 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 139 | VAD026 | double |  |  |  | NULL |  |
| 140 | VAD126 | double |  |  |  | NULL |  |
| 141 | VAD225 | double |  |  |  | NULL |  |
| 142 | VAL115 | double |  |  |  | NULL |  |
| 143 | Y021 | double |  |  |  | NULL |  |
| 144 | B500 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) | if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_APPROACH\_IND = 'IRBA' then 1 else 0)  else if ((XX\_PARTIAL\_USE\_IND > '10') or (XX\_PARTIAL\_USE\_IND < '10' and XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND = '80') or (XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND = '^' and XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND = '80'))  then 0  else if XX\_APPROACH\_IND = 'AIRB' then 2 else NULL | Verwendeter Risikoansatz (1 = KSA, 2 = AIRB)  XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND = Forderungsklasse  XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND = Forderungsklasse KSA XX\_PARTIAL\_USE\_IND = Kennz. Partial Use Geschäft  XX\_APPROACH\_IND = Risikoansatz  B500 = Risikoansatz (0 = KSA, 1=FIRB, 2 = IRBA)  80 = Beteiligungen |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PARTIAL\_USE\_IND | VARCHAR(6) |  |  |
| 145 | J306 | VARCHAR(254) | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then XX\_CONTRACT\_KG.transaction\_id\_t  else XX\_C\_CONTRACT\_KG.XX\_DELISYST | Liefersystem/ Verbriefungsansatz  XX\_DELISYST=Liefersystem  XX\_Transaction\_ID\_T = Transaction ID ABS |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TRANSACTION\_ID\_TR | VARCHAR(16) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 146 | J307 | VARCHAR(254) | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) | J307 = XX\_CONTRACT | Prüfpfad 11  Contract |
| 147 | B002 | VARCHAR(10) |  |  |  | NULL |  |
| 148 | B021 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O' or (B603 = 'T' and XX\_PTE\_P = 100)  then (XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_LGD\_DT\_UNSEC\_P/ 100)  else (if (B603 = 'T' and XX\_PTE\_P < 100)  then 1,0  else NULL))  else NULL | Verlustquote bei Ausfall (LGD)  XX\_LGD\_DT\_UNSEC\_P = LGD unbesichert Down Turn, PTE\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit, B500 = Risikoansatz (0 = KSA, 2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_DT\_UNSEC\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 149 | B046 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then 0  else (if CRI159 not in (1, 2, 3)  then (if (XX\_SME\_IND in ('1', '2', '3') and XX\_INFRASTRUCTURE\_CRR\_F != 'T')  then 1  else 0)  else 0) | Berücksichtigung SME Supporting Faktor  XX\_INFRASTRUCTURE\_CRR\_F = Kennz. Infrastrukturfinanzierung, XX\_SME\_IND = KMU-Kennzeichen (1 = KMU Retail, 2/3 = KMU Unternehmen), CRI159 = Verzugs- & Ausfallkennzeichen (1 = Drohende Zahlungsunfähigkeit, 2 = Zahlungsverzug (> 90/180 Tage), 3 = Ausfall wegen drohender Zahlungsunfähigkeit und mehr als 90/180 Tagen Verzug), B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | CRI159 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_INFRASTRUCTURE\_CRR\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_SME\_IND | VARCHAR(2) |  |  |
| 150 | B052 | Integer | POSITION | B500 | Integer | if B500 = 0  then 98  else NULL | Abdeckungsgrad Ausnahmen  B500 = Risikoansatz (0 = KSA), 98 = Sonstige (in Domäne B052 aktuell nicht enthalten, aber dennoch funktionsfähig) |
| 151 | B086 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 152 | B144 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 153 | B145 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 154 | B146 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 155 | B147 | double |  |  |  | NULL |  |
| 156 | B178 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 157 | B179 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 158 | B180 | double |  |  |  | NULL |  |
| 159 | B181 | Integer | POSITION | B500 | Integer | if (B603 = 'O' and B500 = '2' and XX\_SLOTTING\_CLS\_IND in ('1', '2', '3', '4', '5'))  then XX\_SLOTTING\_CLS\_IND  else NULL | Risikoklassifikation Spezialfinanzierungen  XX\_SLOTTING\_CLS\_IND = Slottingklasse Spezialfinanzierung (1= Strong, 2= Good, 3= Satisfactory, 4= Weak, 5= Default), B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_SLOTTING\_CLS\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
| 160 | B186 | double |  |  |  | NULL |  |
| 161 | B194 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_EXT\_RAT\_IND is not NULL and XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_EXT\_RAT\_IND != '^'  then 2  else 1)  else (if XX\_EXT\_RAT\_SRC\_IND != 'C' and XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_EXT\_RAT\_IND != '^' then 2  else (if XX\_EXT\_RAT\_SRC\_IND = 'C' and XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_EXT\_RAT\_IND != '^'  then 3  else NULL)) | Kennzeichen Rating  XX\_EXT\_RAT\_IND=Externes Rating  XX\_EXT\_RAT\_SRC\_IND (^=Defaultwert, P= Partner, C= Country, E = Emission, N= Kein Rating)  B194 = 1 (=  Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur liegt nicht vor (kein Sitzlandrating))  B194 = 2 (=Bonitätsbeurteilung einer anerkannten Ratingagentur liegt vor (kein Sitzlandrating))  B194 = 3 (=Bonitätsbeurteilung einer Zentralregierung / Sitzlandrating liegt vor) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_EXT\_RAT\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_EXT\_RAT\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_EXT\_RAT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 162 | B200 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 163 | B217 | double | POSITION | B014 | Integer | if (XX\_TERM\_END\_D = '31.12.9999' or XX\_TERM\_END\_D = '01.01.1753' or XX\_TERM\_END\_D is NULL)  then XX\_MAT\_REG  else (if (B014 not in (40, 41, 42) and XX\_MAT\_REG is not NULL)  then round((XX\_MAT\_REG/12), 5)  else NULL) | Effektive Laufzeit  XX\_MAT\_REG = Testlaufzeit regulatorisch, XX\_TERM\_END\_D = Laufzeitende, B014 = Forderungsklasse IRBA (40 = Mengengeschäft Sonstige, 41 = Mengengeschäft Immobilien Wohn/ Gewerbe, 42 = Mengengeschäft qualifiziert revolvierend) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TERM\_END\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_MAT\_REG | NUMBER(12,10) |  |  |
| 164 | B267 | double |  |  |  | NULL |  |
| 165 | B301 | double |  |  |  | B301 = 0 | Haircut für Sicherheit bzw. Geschäft |
| 166 | B436 | DATE | INSTRUMENT | C206 | DATE | if (B603 = 'O' and XX\_LD\_DF\_F = 'T')  then (if (XX\_DEFAULT\_SOLVV\_D != '01.01.1753' or XX\_DEFAULT\_SOLVV\_D is not NULL)  then XX\_DEFAULT\_SOLVV\_D  else C206)  else NULL | Datum des Ausfalls  XX\_LD\_DF\_F = Ausfall-Kennzeichen, XX\_DEFAULT\_SOLVV\_D = Ausfalldatum SolvV-Rechenkern, C206 = Laufzeitbeginn des Geschäfts, B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_LD\_DF\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_DEFAULT\_SOLVV\_D | DATE |  |  |
| 167 | B607 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then 0  else NULL | Betrag nach Liquidationsnetting/On-Balance-Sheet-Netting/Repo-Netting. Das Datenfeld entspricht inhaltlich dem Feld I004.  B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
| 168 | B618 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_CDB\_STRUCT = 'VS\_LIMIT' then 2  else 1)  else NULL | Forderungstyp  XX\_CDB\_STRUCT=Struktur (VS\_LIMIT = Linie, VS\_LOAN = Darlehen)  B618=1 (=bilanziell), 2 (=außerbilanziell) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CDB\_STRUCT | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 169 | B640 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if XX\_EL is NULL  then NULL  else XX\_EL)  else NULL | XX\_EL = Expected Loss, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_EL | NUMBER(25,10) |  |  |
| 170 | B641 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then if B603 = 'O' then (if XX\_EL\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_EL\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA)  else (if XX\_EL is NULL  then NULL  else XX\_EL)  else NULL | EL des unbesichertes Teils  XX\_EL = Expected Loss, XX\_EL\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA = EL obligor unsec after CRM, B500 = Risikoansatz (2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_EL | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_EL\_OB\_UNSEC\_PART\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 171 | B704 | double |  |  |  | NULL |  |
| 172 | B705 | double |  |  |  | NULL |  |
| 173 | B706 | double |  |  |  | NULL |  |
| 174 | B707 | double |  |  |  | NULL |  |
| 175 | B917 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 176 | C267 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'O'  then (if((XX\_DEPR\_LTD\_CLA < 0 or XX\_DEPR\_LTD\_POCI\_CLA < 0) and ((NVL(XX\_DEPR\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_DEPR\_LTD\_POCI\_CLA, 0)) < 0))  then round (abs(NVL(XX\_DEPR\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_DEPR\_LTD\_POCI\_CLA, 0)), 2)  else NULL)  else NULL  Bewirtschaftung Cluster IFRS  baw. keine Anlieferung | Indirekte Abschreibungen/EWB-Verbräuche  DEPR\_LTD\_CLA = Betrag der gebuchten Abschreibung - Verbrauch life-to-date in Konzernbilanzwährung, DEPR\_LTD\_POCI\_CLA = Betrag Abschreibung Verbrauch - RV für POCI Geschäft - life-to-date in Konzernbilanzwährung, B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_DEPR\_LTD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_DEPR\_LTD\_POCI\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 177 | CRI010 | Integer | POSITION | B013 | Integer | Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B013 in ('15') then  if ((XX\_PARTNER\_GROUP\_IND not like '3%' and XX\_CP\_INFO\_IND in ('30','31','42','47','48','49','52','56')) or XX\_PARTNER\_GROUP\_IND like '3%') then 6 else 5)  else if (B013 in ('5',’12’,'18') then  if XX\_RW\_PRESUP = 0 then 0 else  if XX\_RW\_PRESUP = 0.2 then 1 else  if XX\_RW\_PRESUP = 0.5 then 2 else  if XX\_RW\_PRESUP = 1.0 then 3 else 3 und protokolliere Error ID 1006 #DQ)  else NUL | CRI010=Sub-Forderungsklasse SA  B013= Forderungsklasse (5=Internationale Organisation, 12=Regionalregierungen und örtl. Gebietskörperschaft, 15=Sonstige öffentliche Stellen, 18=Multilaterale Entwicklungsbank); XX\_RW\_PRESUP = Risikogewicht KSA vor KMU, XX\_PARTNER\_GROUP\_IND = Berufsgruppenschlüssel (3% = öffentliche Stellen), XX\_CP\_INFO\_IND = Geschäftspartnerinformation (30/31 = Nachfolgeorganisationen der Treuhandanstalt, 42 = örtliche Gebietskörperschaften (in Dtl.: Gemeinden und Gemeindeverbände)  auch beim Ausland, 47 = örtliche Gebietskörperschaften (in Dtl.: Gemeinden und Gemeindeverbände)  auch beim Ausland, 48 = juristische Personen d. öff. Rechts oder Unternehmen, die vom Bund, einem Land, einem unselbst. Sonderverm. D. Bundes, eines Landes, einer Gemeinde oder einem Gemeindeverb. Getr. Werden u. keine Erwerbszwecke verfolgen,  §13 Abs. 3 Nr. 1 b GS1 und §13 Abs. 3 Nr. 1 i GS1, 49 = juristische Personen d. öff. Rechts oder Unternehmen, die vom Bund, einem Land, einem unselbst. Sonderverm. D. Bundes, eines Landes, einer Gemeinde oder einem Gemeindeverb. Getr. Werden u. keine Erwerbszwecke verfolgen,  §13 Abs. 3 Nr. 1 b GS1 und §13 Abs. 3 Nr. 1 i GS1, 52 = Sozialversicherungsträger , 56 = Eigen- und Regiebetriebe der inländischen öffentlichen Haushalte. |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RW\_PRESUP | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_GLOBAL\_PARTY | XX\_CP\_INFO\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_GLOBAL\_PARTY | XX\_PARTNER\_GROUP\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
| 178 | CRI159 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) | if B603 = 'O' then (if XX\_LD\_DF\_F = 'T' and XX\_C\_CUSTOMER.XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND = '58' then 2 else (  if XX\_C\_CUSTOMER.XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND = '61'  then 2  else (if XX\_C\_CUSTOMER.XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND in ('62','63')  then 1  else (if XX\_C\_CUSTOMER.XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND in ('64','65')  then 3  else 0))))  else (if B603 = 'T' then (if XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.PTE\_P = 100  then 3  else 0)  else 0) | Verzugs- & Ausfallkennzeichen (0= Kein Zahlungsverzug, 1= Drohende Zahlungsunfähigkeit, 2= Zahlungsverzug > 90/ 180 Tage, 3= Ausfall wegen drohender Zahlungsunfähigkeit und mehr als 90/ 180 Tage Verzug)  XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND = Finales Rating ohne Transferrisiko (61= Drohende Zahlungsunfähigkeit Past Due > 90 Tage, 62= Sanierung/ Restrukturierung, 63= Sanierung mit Sanierungsbeiträgen, 64= Kündigung ohne Insolvenz, 65= Insolvenz/ Abwicklungsengagement)  XX\_PTE\_P = Ausfallwahrscheinlichkeit des Transferrisikos  Sonderlogik für comdirect-Ratenkredite: Für ein paar wenige Kunden existieren Dateninkonsistenzen. Die Kunden sind in der Wohlverhaltensphase, weißen richtigerweise eine PD von 1 und ein Ausfallkennzeichen aus, aber befinden sich in der Ratingkategorie 5.8. Aufgrund dessen, dass es sich seitens der comdirect-Ratenkredite um ein auslaufendes Portfolio handelt, wird von einer Anpassung abgesehen. Stattdessen wird die Dateninkonsistenz im Mapping von A360 geheilt. |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_LD\_DF\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND | VARCHAR(2) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER\_T | XX\_LD\_RAT\_ETR\_IND | VARCHAR(2) |  |  |
| 179 | CRI166 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 180 | CRI167 | DATE | POSITION | B436 | DATE | if B603 = 'O'  then (if RLV370=2  then (if (XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D != '01.01.1753' and XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D is not NULL)  then XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D  else B436)  else NULL)  else NULL | Datum der ersten Stundungsmaßnahme nach NPE-Werdung  XX\_RISK\_TYPE\_IND= Risikoart (O=Obligor-Risk)  XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D = Datum der jüngsten, zum Stichtag gültigen Forbearance-Maßnahme.  B436=Ausfalldatum  RLV370 (0=nicht notleidend, 1=notleidend, 2=notleidend & gestundet, 3=Innerhalb Bewährungsfrist & nicht notleidend, 4=Innerhalb Bewährungsfrist & erneut gestundet) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | RLV370 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D | DATE |  |  |
| 181 | CRI168 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 182 | CRI501 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 183 | EXC201 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TRADING\_BOOK\_F | CHAR(1) | if XX\_CONTRACT is not NULL and XX\_TRADING\_BOOK\_F != 'T'  then 0  else if XX\_TRADING\_BOOK\_F = 'T'  then 91  else 75 | Ausschlussgrund fürs Kreditrisiko  Alle Einträge aus dem Rechenkern kommend sind per se relevant für das Kreditrisiko.  EXC201 (0 = Relevant für Kreditrisiko, 75 = Aussteuerung von Geschäften mit einem EAD kleiner oder gleich Null, 91 = Aussteuerung von Positionen ohne Kontrahentenrisiko die dem Handelsbuch zugeordnet sind) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 184 | J301 | VARCHAR(254) | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_TRANSACTION\_NAME | VARCHAR(255) | XX\_TRANSACTION\_NAME | Prüfpfad 6  Transaktionsname (ABS) |
| 185 | J305 | VARCHAR(254) | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL then 'FRDWH\_ABS' else 'FRDWH' | Prüfpfad 9  Liefersystem |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 186 | MAT313 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 187 | P043 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 188 | PER378 | double |  |  |  | NULL |  |
| 189 | PTY001 | Integer | INSTRUMENT | C207 | DATE | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'T'  then NULL  else siehe Transformationsvorschriften in Kapitel 5.5.1  Bewirtschaftung Cluster IFRS  Transformationsvorschriften siehe Kapitel 5.5.2  Für die Umsetzung des Mappings sind die Hinweise in Kapitel 2 (Schlüsselmapping) zur Vorverarbeitung der Tabelle XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE zu beachten! | Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1 = Aktiv-Position; 2 = Passiv-Position)  B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_SEC\_RATE\_NO | NUMBER(14,13) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BALANCE\_SHEET\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CDB\_STRUCT | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REF\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REFI\_IND | VARCHAR(5) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_D2\_CR\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_LGD\_BE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_PTE\_P | NUMBER(13,10) |  |  |
| 190 | PTY002 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BALANCE\_SHEET\_IND | VARCHAR(3) | Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.4 beschrieben. | On-/Off-Balance-Kennzeichen (1= bilanziell, 2= außerbilanziell) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REFI\_IND | VARCHAR(5) |  |  |
| 191 | PTY009 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 192 | PTY025 | Integer |  |  |  | PTY025 = 0 | Beteiligungen  0 = Kein verbundenes Unternehmen, Beteiligungen werden separat an ABACUS geliefert |
| 193 | PTY151 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 194 | RLV202 | Integer |  |  |  | RLV202 = 0 | Relevanzkennzeichen Rohwarenrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Marktpreisrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 195 | RLV203 | Integer |  |  |  | RLV203 = 0 | Relevanzkennzeichen Fremdwährungsrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Marktpreisrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 196 | RLV204 | Integer |  |  |  | RLV204 = 0 | Relevanzkennzeichen allgemeines Zinsänderungsrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Zinsänderungsrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 197 | RLV205 | Integer |  |  |  | RLV205 = 0 | Relevanzkennzeichen allgemeines Aktienkursrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Aktienkursrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 198 | RLV206 | Integer |  |  |  | RLV206 = 0 | Relevanzkennzeichen spezifisches Zinsänderungsrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von spez. Zinsänderungsrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 199 | RLV207 | Integer |  |  |  | RLV207 = 0 | Relevanzkennzeichen spezifisches Aktienkursrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Aktienrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 200 | RLV208 | Integer |  |  |  | RLV208 = 0 | Relevanzkennzeichen Gamma- und Vegafaktorrisiko  0 = Nein, keine Anlieferung von Gamma- und Vegafaktorrisiken auf Einzelgeschäftsebene |
| 201 | RLV209 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) | if XX\_CONTRACT is not NULL  then 1  else 0 | Relevanzkennzeichen Eigenmittel  RLV209 (0 = Nein, 1 = Ja)  Alle Einträge aus dem Rechenkern kommend sind per se relevant für die Eigenmittel. |
| 202 | RLV370 | Integer | INSTRUMENT | C206 | DATE | if B603 = 'O'  then if XX\_LD\_DF\_F = 'T'  then if (PRD013 not in ('4210', '4050', '1172') and B436 > '26.04.2019' and (C206 > '26.04.2019' or C206 is NULL or C206 = '01.01.1753'))  then if (XX\_NPE\_STATUS\_DESC ='FORB\_NPE' and XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D != '01.01.1753' and XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D is not NULL)  then 2  else 1  else 0  else 0  else 0 | NPE Statuskennzeichen  RLV370 (0=nicht notleidend, 1=notleidend, 2=notleidend & gestundet, 3=Innerhalb Bewährungsfrist & nicht notleidend, 4=Innerhalb Bewährungsfrist & erneut gestundet)  XX\_RISK\_TYPE\_IND= Risikoart (O=Obligor-Risk)  XX\_LD\_DF\_F=AUSFALL-KENNZEICHEN Kennzeichen ob der Kunde aktuell ausgefallen ist.  XX\_MOD\_SUBST\_START\_D= Startdatum der Erfasssungsphase der Restrukturierung bzw. Erfassungsdatum des Geschäfts in CIMT, sofern das Geschäft erst nach dem Start der Restukturierung in CIMT erfasst wurde. Datum bleibt nach erstmaliger Erfassung unverändert.  XX\_NPE\_STATUS\_DESC=Ausprägungen:NPE = Non Performing Exposure ohne Forbearance (die sind PD-Rating >= 6.0)FORB\_NPE = Non Performing Exposure mit Forbearance (die sind entweder PD-Rating >= 6.0 oder zwangsklassifiziert als Non Performing Exposure aufgrund einer 2. Forbearance Maßnahme während der 24 Monatigen Wohlverhaltensphase oder > 30 dpd während der 24 Monatigen WohlverhaltensphaseFORB\_PERFORM = Forbearance im Weiß-/Graubuch (PD-Rating < 6.0)leer oder PERFORM = gesund (PD-Rating < 6.0) und ohne ForbearanceHinweis: Für die mBank-Gruppe sind derzeit keine Forbearance-Informationen auf Einzelgeschäftsebene in der RMDB hinterlegt.  XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D = Datum der jüngsten, zum Stichtag gültigen Forbearance-Maßnahme.  C206 [IFRS]= Laufzeitbeginn des Geschäfts mit der Besonderheit, dass für ausgefallene Kunden das INVENTORY\_TERM\_START\_D verwendet wird. |
|  |  |  | INSTRUMENT | PRD013 | Integer |  |  |
|  |  |  | POSITION | B436 | DATE |  |  |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_LD\_DF\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_NPE\_STATUS\_DESC | VARCHAR(50) |  |  |
| 203 | VAD280 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'O' then  if XX\_DEPR\_STATUS\_IND=1  then (if XX\_DEPR\_LTD\_CLA is NULL  then NULL  else abs(XX\_DEPR\_LTD\_CLA))  else NULL | Betrag der Vorsichtigen Bewertung am CRR NPE Einzelgeschäft (Teilwertabschreibung)  XX\_DEPR\_LTD\_CLA = Betrag der gebuchten Abschreibung  XX\_DEPR\_STATUS\_IND= Abschreibungsstatus (1=Teilabschreibung)  XX\_RISK\_TYPE\_IND = Risikoart (O=Obligor-Risk) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_IFRS | XX\_DEPR\_LTD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DEPR\_STATUS\_IND | VARCHAR(2) |  |  |
| 204 | VAD379 | double |  |  |  | NULL |  |
| 205 | VAD620 | double |  |  |  | NULL |  |
| 206 | VAD626 | double |  |  |  | NULL |  |
| 207 | VAL370 | double | POSITION | B500 | Integer | if B500 = 0  then if RLV370 in ('1', '2')  then if VAD280 [IFRS] is NULL  then round((C215[IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] - C224 [IFRS] + C265 [IFRS]),3) \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))  else round((C215 [IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] - C224 [IFRS] + VAD280 [IFRS] + C265 [IFRS]),3) \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))  else NULL  else if (B500 = 2 and B603 ='O')  then if RLV370 in ('1', '2')  then if VAD280 [IFRS] is NULL  then round((C215 [IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] - C224 [IFRS] + C265 [IFRS]),3) \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))  else round((C215 [IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] - C224 [IFRS] + VAD280 [IFRS] + C265 [IFRS]),3) \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))  else NULL  else NULL | CRR NPE-Wert  B500 = Risikoansatz (0=KSA, 2=IRBA), RLV370 NPE Statuskennzeichen (1=notleidend, 2=notleidend, gestundet), C215 = Buchwert, C265 = D2 Abschreibung, VAD280=Teilwertabschreibung, B603='O' (=Kreditrisiko), C223 Anteilige Zinsen, C224 Anteilige Gebühren/ Rechnungsabgrenzungsposten. |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | C215 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C223 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C224 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C265 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | RLV370 | Integer |  |  |
|  |  |  | POSITION | VAD280 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_SEC\_RATE\_NO | NUMBER(14,13) |  |  |
| 208 | VAL377 | double |  |  |  | NULL |  |
| 209 | VAL378 | double |  |  |  | NULL |  |
| 210 | B262 | Integer | POSITION | B500 | Integer | if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then if XX\_APPROACH\_IND != 'IRBA' then '60' else NULL  else (if B500 = 0  then Zugriff auf XX\_MAP\_B013\_DEAL mit XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND und XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR.XX\_COVERED\_BOND\_F  else (if B500 = 2  then (if B603 = 'T'  then 10  else Zugriff auf XX\_MAP\_B013\_DEAL mit XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND und XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR.XX\_COVERED\_BOND\_F)  else NULL))  Wird in der XX\_MAP\_B013\_DEAL kein Eintrag gefunden, dann wird B262 mit NULL befüllt und Error ID 1001 #DQ protokolliert | Ursprüngliche Forderungsklasse  Annahme: Transferrisiko wird weiterhin berücksichtigt.  XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND = KSA-Forderungsklasse, XX\_COVERED\_BOND\_F = Kennz. Gedeckte Schuldverschreibung, B500 = Risikoansatz (0 = KSA, 2 = AIRB), B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko), B262 (10 = Zentralregierungen, 60 = Verbriefungen) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND | VARCHAR(4) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_COVERED\_BOND\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_B013\_DEAL | XX\_ASSET\_CLASS\_STA\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_MAP\_B013\_DEAL | XX\_COVERED\_BOND\_F | CHAR(1) |  |  |
| 211 | ACC106 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 212 | ACC111 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 213 | B928 | Integer |  |  |  | NULL | Risiko Ansatz Kredit (GroMiKV) |
| 214 | C072 | VARCHAR(40) | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 != 'T'  then XX\_C\_CONTRACT.XX\_CU\_NO\_COUNTERPART  else XX\_C\_COUNTRY.XX\_CU\_NO\_COUNTERPART | Prüfpfad 1  XX\_C\_CONTRACT.XX\_CU\_NO\_COUNTERPART = (Basis-) Kundennummer Kreditrisiko, XX\_C\_COUNTRY.XX\_CU\_NO\_COUNTERPART = (Basis-) Kundennummer Transferrisiko, B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko/ Transferrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CU\_NO\_COUNTERPART | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_COUNTRY | XX\_CU\_NO\_COUNTERPART | VARCHAR(25) |  |  |
| 215 | C202 | VARCHAR(40) | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then NULL  else XX\_AGREEMENT\_ID | Prüfpfad 3  XX\_AGREEMENT\_ID = Vereinbarungs-ID, B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_AGREEMENT\_ID | VARCHAR(40) |  |  |
| 216 | C226 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'O' then  if EL\_LTD\_3\_CLA < 0  then NULL  else if XX\_STAGE\_IND = '3'  then NVL(XX\_EL\_LTD\_3\_CLA,0)  else NULL  else NULL  Der ermittelte Wert wird nach folgender Logik in die Tabelle geschrieben:  GROUP BY C202 AND ORDER BY C202,CONTRACT, PTY001 ascending  IF C202 is NULL  THEN write the calculated value to this contract  ELSE IF C202 <> NULL AND PTY001=1  THEN write the calculated value to the first contract  Else NULL  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'T'  then NULL  else siehe Transformationsvorschriften in Kapitel 5.6 | Einzelwertberichtigungen/-rückstellungen sonstige gesamt  XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA = Impairments  XX\_STAGE\_CR\_IND = IFRS9-Stufeneinteilung Geschäft XX\_POCI\_CR\_F = Kennzeichen POCI-Geschäft (POCI = Purchased of Originated Credit Impaired)  XX\_D2\_CR\_CLA = Betrag des Kredit-Abschreibung-Verbrauchs (D2 ungeglättet)  C215 = Buchwert  B603 = Prüfpfad 3 (aktuelle Belegung Obligor- vs. Transferrisiko)  HGB Cluster  Der nachfolgende Teil der Logik wurde als Teil der Transformationsanweisung zur Bewirtschaftung des Zielfeldes aufgrund einer konkreten abnehmerspezifischen Anforderung zum Angleich der Daten aufgenommen:  Überprüfung, dass der LTD-Risikovorsorgewert für Stage 3 (EL\_LTD\_3\_CLA) nicht negativ ist.  Innerhalb eines Kompensationsverbundes sollen alle Wertefelder auf Verbundebene am selben aktivischen CONTRACT dargestellt werden.  Für CONTRACTs außerhalb eines Kompensationsverbundes (C202 = NULL) wird der Wert an diesen CONTRACT geschrieben. |
|  |  |  | POSITION | C215 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C223 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C224 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_EL\_LTD\_3\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_STAGE\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_LLP\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_D2\_CR\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 217 | C254 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T' or  XX\_DELISYST = '208' or F001=5-AT-1081 (CFCB) or  F001=6-A-1019 (Filiale London)  then 0  else NULL | Relevanzflag Bista  Transferrisiken (B603 = 'T') und CommerzReal (XX\_DELISYST = 208) sowie Commerzbank Finance & Covered Bonds S.A. (CFCB) und die Niederlassung London werden ausgesteuert (CFCB und NL London liefern ihre Daten via Summen-Schnittstelle zu), ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS.  C254 (0 = Nicht relevant für das Bista Modul, 1 = Relevant für das Bista Modul) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 218 | C265 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'O'  then (if (XX\_DIRECT\_DEPR\_3\_LTD\_CLA < 0 or XX\_DIRECT\_DEPR\_POCI\_LTD\_CLA< 0 or XX\_WR\_OFF\_SMALL\_DEBTS\_LTD\_CLA< 0) and (NVL(XX\_DIRECT\_DEPR\_3\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_DIRECT\_DEPR\_POCI\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_WR\_OFF\_SMALL\_DEBTS\_LTD\_CLA, 0)) < 0  then round(abs(NVL(XX\_DIRECT\_DEPR\_3\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_DIRECT\_DEPR\_POCI\_LTD\_CLA, 0) + NVL(XX\_WR\_OFF\_SMALL\_DEBTS\_LTD\_CLA, 0)), 2)  else NULL)  else NULL  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then if XX\_RW\_METH\_IND != 'V' and (XX\_CDB\_STRUCT = 'VS\_ACCOUNT' or XX\_CDB\_STRUCT = 'VS\_LIMIT' or XX\_CDB\_STRUCT = 'VS\_LOAN')  then round (XX\_D2\_CR\_CLA, 3)  else if B603 = 'O'  then round(XX\_D2\_CR\_CLA,3)  else NULL  else NULL | Direkte Abschreibungen  XX\_D2\_CR\_CLA = Betrag des Kredit-Abschreibung-Verbrauchs (D2 ungeglättet)  XX\_DIRECT\_DEPR\_3\_LTD\_CLA = Abschreibung Stage 3  XX\_DIRECT\_DEPR\_POCI\_LTD\_CLA = Abschreibung POCI XX\_WR\_OFF\_SMALL\_DEBTS\_LTD\_CLA = Abschreibung auf Kleinstforderungen  B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko)  XX\_RW\_METH\_IND = Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18 KWG) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_DIRECT\_DEPR\_3\_LTD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_DIRECT\_DEPR\_POCI\_LTD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_WR\_OFF\_SMALL\_DEBTS\_LTD\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CDB\_STRUCT | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_D2\_CR\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 219 | C700 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T' or XX\_DELISYST = '208'  then 0  else NULL | Relevanzflag LCR/NSFR  Transferrisiken (B603 = 'T') und CommerzReal (XX\_DELISYST = 208) werden ausgesteuert, ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS.  Relevanzflag LCR/NSFR (0 = Nicht relevant für das LCR/NSFR Modul, 1 = Relevant für LCR/NSFR, 2 = Relevant für LCR, 3 = Relevant für NSFR), B603 (T= Transferrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 220 | C736 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BALANCE\_SHEET\_IND | VARCHAR(3) | if ((XX\_DELISYST in ('106', '111')) and (substr(XX\_BALANCE\_SHEET\_IND, 2, 2) in ('80', '81', '82', '84', '85')))  then 999  else NULL | Besicherte Forderungen und Verbindlichkeiten ITS LCR/NSFR  XX\_DELISYST (106= CoRealK - Kontokorrent, 111= Kreditkarten), XX\_BALANCE\_SHEET\_IND = HGB-Bilanzschlüssel, 999 = Sonstige Vermögenswerte  Auf die Ableitung für MoneyMarkets kann gem. Team Liqui verzichtet werden. |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 221 | CRI113 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then NULL  else (if XX\_NPE\_STATUS\_DESC in ('NPE', 'FORB\_NPE') or C265 > 0 or C267 > 0  then 0  else 1) | Leistungsstatus des Instruments  Wenn eine "Direkte Abschreibung" (C265) oder "Indirekte Abschreibung" (C267) vorliegt, wird CRI113 mit "Notleidend" (= 0) bewirtschaftet (1= Vertragsgemäß bedient). XX\_NPE\_STATUS\_DESC = Status Non Performing Exporsure (NPE= Non Performing Exposure ohne Forbearance, FORB\_NPE= Non Performing Exposure mit Forbearance), B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko)  XX\_NPE\_STATUS\_DESC wird für die tgl./mtl. Werte aus dem Vormonat (Stand UF) fortgeschrieben, sodass kein Rückgriff auf Tabellen des Vormonats notwendig ist. |
|  |  |  | POSITION | C265 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C267 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_NPE\_STATUS\_DESC | VARCHAR(50) |  |  |
| 222 | CRI114 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if POSITION.B603 = 'T'  then NULL  else siehe Rangverarbeitung Kap. 5.7  Bewirtschaftung Cluster IFRS  keine Bewirtschaftung | Stundungs- und Neuverhandlungsstatus |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PROLONGATION\_LAST\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REF\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_RENEGOTIATION\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_ACTION\_DESC | VARCHAR(50) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D | DATE |  |  |
| 223 | CRI115 | DATE | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | siehe Kap.5.7 |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PROLONGATION\_LAST\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REF\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_RENEGOTIATION\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_ACTION\_DESC | VARCHAR(50) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D | DATE |  |  |
| 224 | CRI116 | DATE | INSTRUMENT | C206 | DATE | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'T'  then NULL else  if MAT106 is NULL and C206 > XX\_PERFORMANCE\_D  then C206  else if MAT106 is not NULL and MAT106 > XX\_PERFORMANCE\_D  then MAT106  else if (XX\_PERFORMANCE\_D != '01.01.1753' or XX\_PERFORMANCE\_D is not NULL)  then XX\_PERFORMANCE\_D  else NULL  Bewirtschaftung Cluster IFRS  Keine Bewirtschaftung | Datum des Leistungsstatus  MAT106 = Datum des Vertragsabschluss  C206 = Laufzeitbeginn  XX\_PERFORMANCE\_D = Performancedatum des Basiskunden (Performing auf Non-Performing oder umgekehrt) |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | POSITION | MAT106 | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PERFORMANCE\_D | DATE |  |  |
| 225 | CRI162 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 226 | EXC033 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if (B603 = 'T' or XX\_DELISYST = '208' or XX\_IKFAMNR in ('1000','1402','2400','2500','2600','4400','4700','4800','4900'))  then 2  else NULL | Privilegierungskategorie für LE  Transferrisiken (B603 = 'T') und CommerzReal (XX\_DELISYST = 208) werden ausgesteuert, ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS.  IKFAMNR:  1000= Bankenvorschusskonten  1402= Herausgegebene Avale aus zeiten der Dresdner Bank Einzelfälle Avale ohne Rückgriffsrecht  2400= Obligokonten im Akkreditivgeschäft: Echtobligen  2500= Obligokonten im Akkreditivgeschäft: Eventualobligen  2600= Obligokonten im Akkreditivgeschäft: Negoziierung /CAF  4400= Pilotierung Mainz  4700= Verrechnungskonten für Mittel öffentlicher Refi-Geber (Segment PUK und Segement FK)  4800= Verrechnungskonten Versicherungsdarlehen Segment PUK  4900= Zwischenkonten Gewerbesteuer  EXC033 (0= Anzeige, aber keine oder nur teilweise Anrechnungspflicht in LE; 1 = Abzugsposition, 2 = Keine Anzeigepflicht für LE |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_SST\_E\_IKIK | XX\_GESNRGEN | VARCHAR(16) |  |  |
|  |  |  | XX\_SST\_E\_IKIK | XX\_IKFAMNR | NUMBER(4,0) |  |  |
| 227 | EXC034 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then 0  else NULL | Privilegierungskategorie für Mio  Transferrisiken werden ausgesteuert (B603 = 'T'), ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS |
| 228 | J302 | VARCHAR(254) | XX\_C\_CONTR\_OLD\_KEY | XX\_GESNRGEN | VARCHAR(16) | J302 = XX\_GESNRGEN | Prüfpfad 6  GESNRGEN |
| 229 | LR001 | Integer | POSITION | B500 | Integer | if B603 = 'T'  then 0  else if B500 is NULL  then 0  else NULL | Relevanzkennzeichen Leverage Ratio  Transferrisiken werden ausgesteuert (B603 = 'T'), ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS. Über Prüfung auf B500 werden Geschäfte für welche keine Rechenkerninformationen vorliegen mit 0 befüllt. |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
| 230 | LR026 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'O' and XX\_FINANCING\_TYPE\_IND in ( '83', '84', '85', '87', '88', '89', '93')  then 1  else 0 | Relevanzkennzeichen Exportkredite (0= Nein, 1= Ja)  XX\_FINANCING\_TYPE\_IND = Immobilien-/ Spezialfinanzierungskennzeichen (83, 84, 85, 87, 88, 89, 93 = Exportfinanzierung), B603 = Prüfpfad 3 (Obligorrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CUSTOMER | XX\_FINANCING\_TYPE\_IND | VARCHAR(2) |  |  |
| 231 | M012 | double |  |  |  | NULL |  |
| 232 | MAT106 | DATE | INSTRUMENT | C206 | DATE | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 ='T'  then NULL  else  if XX\_DELISYST ='110' then  if XX\_BOE\_PURCHASE\_D != '01.01.1753' or XX\_BOE\_PURCHASE\_D != '31.12.9999'  then XX\_BOE\_PURCHASE\_D else NULL  if XX\_DELISYST !='110' then  INSTRUMENT.C206  Bewirtschaftung Cluster IFRS  Keine Bewirtschaftung | Datum des Vertragsabschlusses  XX\_DELISYST = 110 (=Wechsel)  XX\_BOE\_PURCHASE\_D = Wechselankaufsdatum |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BOE\_PURCHASE\_D | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 233 | PLD109 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T'  then NULL  else (if (XX\_SOURCE\_OF\_ENCUMBRANCE\_IND = '^' or XX\_SOURCE\_OF\_ENCUMBRANCE\_IND is NULL)  then 10  else XX\_SOURCE\_OF\_ENCUMBRANCE\_IND) | Belastungsquellen  Kennzeichung von Aktiva die eine Quelle der Belastung darstellen, 10 = keine Belastung, B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_SOURCE\_OF\_ENCUMBRANCE\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
| 234 | RLV130 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 235 | VAL006 | double | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CUMULATED\_RECOVERIES\_CLA | NUMBER(18,3) | round(XX\_CUMULATED\_RECOVERIES\_CLA, 2) | Kumulierte Rückflüsse seit dem Ausfall  Betrag kumulierte Rückflüsse gemäß AnaCredit in Konzern-Bilanzwährung |
| 236 | VTY215 | Integer |  |  |  | Bewirtschaftung Cluster HGB:  VTY215 = 0  Bewirtschaftung Cluster IFRS:  VTY215 = NULL | Rückständige Tilgung (0 = Buchwert exklusive rückständige Tilgung) |
| 237 | C223 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if B603 = 'T'  then NULL  else (if PTY001 = 1 and XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA != NULL  then round(XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA, 2)  else (if PTY001 = 2 and XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA != NULL  then round((XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA\*(-1)), 2)  else NULL))  Bewirtschaftung Cluster IFRS OWF/LR  if B603 = 'T' or XX\_DELISYST like '2%'  then NULL  else (if PTY001 = 1 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL  then round(XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA, 2)  else (if PTY001 = 2 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL  then round((XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA\*(-1)), 2)  else NULL))  Bewirtschaftung Cluster IFRS LE    if B603 = 'T'  then NULL  else (if PTY001 = 1 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL  then round(XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA, 2)  else (if PTY001 = 2 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL  then round((XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA\*(-1)), 2)  else NULL))  Für die Umsetzung des Mappings sind die Hinweise in Kapitel 2 (Schlüsselmapping) zur Vorverarbeitung der Tabelle XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE zu beachten! | Anteilige Zinsen  XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA/ XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA = antizipative Rechnungsgrenzung in Konzernwährung HGB bzw. IFRS, PTY001= Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1 = Aktiv-Position; 2 = Passiv-Position), B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko)  Details zur abweichenden Bewirtschaftung Cluster IFRS OWF/LR vs. Cluster IFRS LE können dem Kap. 3.5 entnommen werden. |
|  |  |  | POSITION | PTY001 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 238 | C224 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  if POSITION.B603 = 'T'  then NULL  else (if PTY001 = 1 and (XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA != 0 and XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA != NULL or XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA != NULL)  then round ((XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA), 2)  else (if PTY001 = 2 and (XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA != 0 and XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA != NULL or XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA != NULL)  then round (((XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA)\*(-1)), 2)  else NULL))  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if POSITION.B603 = 'T'  then NULL  else (if PTY001 = 1 and (XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL or XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA != NULL)  then round ((XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA), 2)  else (if PTY001 = 2 and (XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA != NULL or XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA != 0 and XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA != NULL)  then round (((XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA)\*(-1)), 2)  else NULL))  Für die Umsetzung des Mappings sind die Hinweise in Kapitel 2 (Schlüsselmapping) zur Vorverarbeitung der Tabelle XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE zu beachten! | Anteilige Gebühren/ sonstige Rechnungsabgrenzungsposten  XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA/ XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA = Agio/ Disagio in Konzernwährung für HGB bzw. IFRS, XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA/ XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA = transitorische Rechnungsabgrenzung in Konzernwährung für HGB bzw. IFRS, PTY001= Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1 = Aktiv-Position; 2 = Passiv-Position), B603 = Prüfpfad 3 (Transferrisiko) |
|  |  |  | POSITION | PTY001 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 239 | VAD227 | double |  |  |  | NULL |  |
| 240 | CRE026 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 2  then (if B603 = 'O'  then (if XX\_RWA\_PRESUP\_CLA is NULL  then (NVL(XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA,0) + NVL(XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA,0))  else XX\_RWA\_PRESUP\_CLA)  else (if XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA is NULL  then NULL  else XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA))  else NULL | RWA IRBA vor KMU  XX\_RWA\_PRESUP\_CLA = RWA vor KMU, XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA = IRBA-RWA Transferrisiko nach KMU, B500 = Risikoansatz (2 = IRBA), B603 = Risikoart (O=Obligor, T=Transferrisiko)  XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA = IRBA-RWA Obligor vor KMU unbesichertes Teil, XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA = IRBA-RWA Obligor vor KMU besichertes Teil |
|  |  |  | POSITION | B603 | VARCHAR(25) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_PRESUP\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_TR\_SEC\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 241 | C218 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 242 | CRE025 | double | POSITION | B500 | Integer | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B500 = 0  then (if XX\_RWA\_PRESUP\_CLA is NULL  then (NVL(XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA,0) + NVL(XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA,0))  else XX\_RWA\_PRESUP\_CLA)  else NULL | RWA KSA vor KMU  XX\_RWA\_PRESUP\_CLA = RWA vor KMU, B500 = Risikoansatz (0 = KSA)  XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA = IRBA-RWA Obligor vor KMU unbesichertes Teil, XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA = IRBA-RWA Obligor vor KMU besichertes Teil |
|  |  |  | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_OB\_PRESUP\_UNSEC\_PRT\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RWA\_PRESUP\_CLA | NUMBER(25,10) |  |  |
| 243 | D200 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 244 | POSITION\_ID25 | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 245 | B203 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 246 | B269 | double |  |  |  | NULL |  |
| 247 | B931 | double |  |  |  | NULL |  |
| 248 | B932 | double |  |  |  | NULL |  |
| 249 | B950 | double |  |  |  | NULL |  |
| 250 | C232 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 251 | CRE306 | double |  |  |  | NULL |  |
| 252 | CRE324 | double |  |  |  | NULL |  |
| 253 | CRE361 | double |  |  |  | NULL |  |
| 254 | CRE362 | double |  |  |  | NULL |  |
| 255 | CRE363 | double |  |  |  | NULL |  |
| 256 | CRE364 | double |  |  |  | NULL |  |
| 257 | CRE365 | double |  |  |  | NULL |  |
| 258 | CRE366 | double |  |  |  | NULL |  |
| 259 | CRE367 | double |  |  |  | NULL |  |
| 260 | CRE370 | double |  |  |  | NULL |  |
| 261 | CRE380 | double |  |  |  | NULL |  |
| 262 | CRI160 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 263 | CRI321 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 264 | G003 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 265 | IDN361 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 266 | IDN362 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 267 | IDN363 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 268 | IDN364 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 269 | IDN365 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 270 | IDN366 | VARCHAR(150) |  |  |  | NULL |  |
| 271 | POSITION\_ID\_ORIG | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 272 | VAL320 | double |  |  |  | NULL |  |
| 273 | B601 | VARCHAR(40) | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_FU\_CODE\_IND | VARCHAR(30) | XX\_FU\_CODE\_IND | Prüfpfad 1 Basel III |
| 274 | EXC120 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T' or XX\_DELISYST = '208'  then 4  else NULL | Ausnahmeregel für Instrument/Position in AnaCredit  Transferrisiken (B603 = 'T') und CommerzReal (XX\_DELISYST = 208) werden ausgesteuert, ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS.  EXC120 (4 = Aussteuerung durch den Anwender) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 275 | Z001 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | if B603 = 'T' or XX\_DELISYST = '208'  or [C226 > 0 and C226 is not NULL] (1)  or [C265 > 0 and C226 is not NULL] (1)  or [C267 > 0 and C226 is not NULL] (1)  or [(XX\_PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND = 'REWE'  and SUBSTR(XX\_CONTRACT,4,2) in (99,93))] (2)  or [XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB = '454'] (3)  or [(XX\_DELISYST = '512')] (4)  or [(XX\_DELISYST = '106'  and XX\_PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND = 'REWE')] (5)  then 0  else NULL | Relevanzflag Zinsstatistik  Transferrisiken (B603 = 'T') und CommerzReal (XX\_DELISYST = 208) werden ausgesteuert, ansonsten erfolgt die Relevanzprüfung für das Modul in ABACUS.  Z001 (0 = Nicht relevant, z.B. notleidender Kredit  , 1 = Rausschließlich relevant für Bestandsmeldung, 2 = Relevant für Bestandsmeldung und Neugeschäftsmeldung), 3 = Ausschließlich relevant für Neugeschäftsmeldung  Hinweis: REWE-Konten sind über diese Filterung mit ausgeschlossen:  (1) Erkennung notleidender Kredite  (2) Erkennung 99er und 93er Konten AG Ausland (AGA)  (3) Erkennung 94er Konten AG Ausland (AGA) und AG Inland (AGI)  (4) Erkennung 99er und 93er Konten AG Inland (AGI)  (5) erkennung 93er Konten AG Inland (AGI) |
|  |  |  | POSITION | C226 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C265 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | C267 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND | VARCHAR(40) |  |  |
| 276 | CRE303 | double |  |  |  | NULL |  |
| 277 | CRI500 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 278 | CTY273 | VARCHAR(5) |  |  |  | NULL |  |
| 279 | J304 | VARCHAR(254) |  |  |  | NULL |  |
| 280 | SEC191 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | case when  XX\_USAGE\_POOL\_PR\_PORTF = 'EULE1' and  XX\_USAGE\_POOL\_PR\_GROUP = 'Nutzung' and  XX\_USAGE\_POOL\_TYPE\_PR\_IND = '1’ then SEC191=1  or  case when XX\_SST\_E\_KV\_VERBR.FOKVKZ = ‘K’ then SEC191=1  or  case when B603 != 'T' then  case when XX\_ABS\_ROLE\_IND = 'I' then 3  when XX\_ABS\_ROLE\_IND = 'S' then 2  when XX\_CONTRACT\_CB is not NULL then 1  else NULL end  else NULL end SEC191 | Verbriefungsrolle  XX\_ABS\_ROLE\_IND=Rolle der Commerzbank Gruppe in Bezug auf diese Transaktion: O(riginator), S(ponsor) oder I(nvestor)  SEC191 = Verbriefungsrolle (1=Originatorrolle, 2= Sponsorrolle, 3=Investorrolle, 0=Sonstige) |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_CONTRACT\_CB | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_ABS\_ROLE\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_USAGE\_POOL\_PR\_GROUP | VARCHAR(30) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_USAGE\_POOL\_PR\_PORTF | VARCHAR(30) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_USAGE\_POOL\_TYPE\_PR\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_SST\_E\_KV\_VERBR | XX\_FOKVKZ | CHAR(1) |  |  |
| 281 | SEC901 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 282 | T007 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 283 | TXT202 | VARCHAR(255) |  |  |  | NULL |  |
| 284 | B480 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_RW\_METH\_IND = 'V' and  XX\_ABS\_APPROACH\_IND != 'SEC-IRBA'  and XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA > 0  then round(XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA,2) else 0)  else NULL | Zusätzlicher RWA bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflicht im KSA  XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA=RWA Zuschlag/  Differenz zwischen gekappter RWA und RWA vor der Anwendung von Wertberichtigung  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18 KWG)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 285 | B481 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_RW\_METH\_IND = 'V' and  XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-IRBA'  and XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA > 0  then round(XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA,2) else 0)  else NULL | Zusätzlicher RWA bei Verstoß gegen die Sorgfaltspflicht im IRBA  XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA=RWA Zuschlag/  Differenz zwischen gekappter RWA und RWA vor der Anwendung von Wertberichtigung  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18 KWG)  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 286 | B564 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then round((XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P / 100),2)  else NULL | CCF Verbriefungsposition  XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P=ABS Konversionsfaktor gem. SolvV § 239 (2), § 247 bzw. § 252 (2) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONV\_FACT\_ABS\_P | NUMBER(16,13) |  |  |
| 287 | B565 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 = 'A' and XX\_RM\_METH\_IND = 'O' and XX\_ABS\_POS\_REDUCTION\_F = 'F'  then round(XX\_RWA\_INCL\_SEC,2)  else 0 | Teil-RWA der unbesicherten Verbriefungsposition  XX\_RM\_METH\_IND=Art der Kreditrisikominderung (O= ohne Besicherung)  XX\_ABS\_POS\_REDUCTION\_F=Gibt an, ob diese Position als Abzugsposition behandelt wird  XX\_RWA\_INCL\_SEC=RWA Ergebnis mit Berücksichtigung der Effekte eigener Verbriefungen |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_POS\_REDUCTION\_F | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RM\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RWA\_INCL\_SEC | NUMBER(20,10) |  |  |
| 288 | B856 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_TRANSACTION\_TYPE\_IND = 'S' and XX\_RM\_METH\_IND != 'O'  and XX\_ABS\_ROLE\_IND = 'O'  then 1  else 0)  else NULL | Kennzeichen einer Verbriefungsposition als Wasserfallbestandteil  XX\_ABS\_TRANSACTION\_TYPE\_IND=Art der Transaktion. (Traditionell, syn-thetisch, ABCP, unbekannt)  XX\_RM\_METH\_IND=Art der Kreditrisikominderung (O= nicht besichert, S=Subsitution, U=Compregensive method, D=Due Diligence, N=Capital deduction because of negative interest rate)  XX\_ABS\_ROLE\_IND=Rolle der Commerzbank Gruppe in Bezug auf diese Transaktion: O(riginator), S(ponsor) oder I(nvestor) |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_ABS\_ROLE\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_ABS\_TRANSACTION\_TYPE\_IND | VARCHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV | XX\_RM\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 289 | B873 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_RW\_METH\_IND = 'V' and  XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA > 0  then 1  else 0)  else NULL | Zusatz-Risikogewicht bei Verstoß Artikel 405, 406 oder 409 CRR  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren (D=Durchschau, I= ratingsbasierter Ansatz IAA, K=Risikogewicht inkl. KRM, R=ratinsbasierter Ansatz ext. Rating, S=Aufsichtl. Formelansatz, A=1250% RW, E=Early Amortisation, Q=Rückfalllösung für qual. Verbriefungsliquiditätsfazilität, Z=ABCP-Zweitverlustposition, V=Aufsichtl. Vorgabe bei Verstoß §18 KWG)  XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA=RWA Zuschlag/Differenz zwischen gekappter RWA und RWA vor der Anwendung von Wertberichtigung |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_RWA\_SUPPLEMENT\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_RW\_METH\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 290 | SEC502 | Integer | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  then (if XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-IRBA'  then 1  else if XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-SA'  then 2  else if (XX\_ABS\_APPROACH\_IND = 'SEC-ERBA' and XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND = 'I')  then 4  else if (XX\_DELISYST = '703' and XX\_ABS\_APPROACH\_IND = '^')  then 1  else 3)  else NULL | Verbriefungsansatz  XX\_ABS\_APPROACH\_IND=Verbriefungsansatz  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND=Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (I = IAA rating)  XX\_DELISYST=Liefersystem (703 = Risk Calculation Engines)  SEC502 = Verbriefungsansatz (1=SEC IRBA (CRR Fassung 01.01.2019 oder später)  , 2=SEC SA (CRR Fassung 01.01.2019 oder später), 3=SEC ERBA (CRR Fassung 01.01.2019 oder später), 4=SEC IAA (CRR Fassung 01.01.2019 oder später)) |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_APPROACH\_IND | VARCHAR(10) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 291 | VAD920 | double | POSITION | B603 | VARCHAR(25) | Bewirtschaftung Cluster HGB  keine Bewirtschaftung  Bewirtschaftung Cluster IFRS  if B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL then (if XX\_ABS\_ROLE\_IND = 'O'  then XX\_ABS\_LLP\_CLA  else 0) else NULL | Spezifische Kreditrisikoanpassungen der zugrundeliegenden Forderung  XX\_ABS\_ROLE\_IND=Rolle der Commerzbank Gruppe in Bezug auf diese Transaktion: O(riginator), S(ponsor) oder I(nvestor); XX\_ABS\_LLP\_CLA = Angerechnete Wertberichtigung |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANSACTION | XX\_ABS\_ROLE\_IND | CHAR(1) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_ABS\_LLP\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_CONTRACT | VARCHAR(40) |  |  |
| 292 | B711 | double |  |  |  | NULL |  |
| 293 | B710 | double |  |  |  | NULL |  |
| 294 | PTY006 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 295 | EXC145 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 296 | PTY013 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 297 | LR013 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 298 | C737 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 299 | COL120 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 300 | COL123 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 301 | C235 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 302 | C236 | double |  |  |  | NULL |  |
| 303 | RLV375 | Integer | POSITION | RLV370 | Integer | else if RLV370 in ('1', '2')  then 1  else 0 | NPE Relevanz für Kapitalabzug  "RLV370 NPE Statuskennzeichen (0= nicht notleidend, 1=notleidend, 2=notleidend, gestundet), RLV375 NPE Relevanz für Kapitalabzug (0 = Nicht relevant, 1 = Relevant für NPE CRR, 2 =  Relevant für NPE ECB NEW, 3 =  Relevant für NPE ECB STOCK)"  C206 Laufzeitbeginn des Geschäfts  B436 Datum des Ausfalls |
| 304 | VAD670 | double | POSITION | C226 | double | if RLV375 in (1, 2) and (C226[IFRS] + C265[IFRS] +VAD280) > 0  then C226[IFRS] + C265[IFRS] +VAD280 \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))  else 0 | CRR Gesamtwert NPE  RLV375=NPE Relevanz für Kapitalabzug (1=Relevant für NPE CRR, 2=Relevant für NPE ECB NEW, 3 = Relevant für NPE ECB STOCK), C265=D2 Abschreibung, VAD280=Teilwertabschreibung, C226=Risikovorsorge |
|  |  |  | POSITION | C265 | double |  |  |
|  |  |  | POSITION | RLV375 | Integer |  |  |
|  |  |  | POSITION | VAD280 | double |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_ABS\_TRANS\_2\_CONTR\_AGG\_TV | XX\_SEC\_RATE\_NO | NUMBER(14,13) |  |  |
| 305 | SEC911 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 306 | C393 | double |  |  |  | NULL |  |
| 307 | CRI320 | VARCHAR(6) |  |  |  | NULL |  |
| 308 | RLV320 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 309 | TYP024 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 310 | MKR\_NET\_TYPE\_SPECIFIC | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 311 | CRE314 | double |  |  |  | NULL |  |
| 312 | NET\_AMOUNT\_CALC\_LE | double |  |  |  | NULL |  |
| 313 | POSITION\_ID19 | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 314 | POSITION\_ID100 | VARCHAR(100) |  |  |  | NULL |  |
| 315 | C201 | VARCHAR(40) |  |  |  | NULL |  |
| 316 | LR004 | double |  |  |  | NULL | LR Exposure |
| 317 | CRE100 | double |  |  |  | NULL |  |
| 318 | CRE101 | double | FX\_RATE | C222 | double | Bewirtschaftung Cluster HGB: Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.11 beschrieben.  Bewirtschaftung Cluster IFRS: NULL | Rückständige Tilgung |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR001 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR002 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | INSTRUMENT | C207 | DATE |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG | XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_AMORT\_ARR\_TA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CURRENCY\_C | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_REF\_D | DATE |  |  |
| 319 | CRE102 | double | FX\_RATE | C222 | double | Bewirtschaftung Cluster HGB: Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.12 beschrieben.  Bewirtschaftung Cluster IFRS: NULL | Rückständige Zinsen |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR001 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR002 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CURRENCY\_C | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DEF\_INT\_ARR\_TOTAL\_TA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_INT\_ARR\_SUM\_TA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 320 | CRE103 | double | FX\_RATE | C222 | double | Bewirtschaftung Cluster HGB: Die Transformationsvorschriften für die Befüllung des Zielfeldes sind in Kapitel 5.13 beschrieben.  Bewirtschaftung Cluster IFRS: NULL | Rückständige Gebühren |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR001 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | FX\_RATE | CUR002 | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_CURRENCY\_C | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_EXPENSES\_DEQ\_TA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 321 | D551 | double | XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND | VARCHAR(3) | if XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND in ('40','41')  then XX\_EAD\_COLL\_CCF\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA  else 0 | Betrag Grundpfandrecht  40 = Wohnimmobilien  41 = Gewerbeimmobilien |
|  |  |  | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG | XX\_EAD\_COLL\_CCF\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 322 | D552 | double | XX\_C\_COLL\_DET\_LGDS\_CR\_FULLSTA | XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND | VARCHAR(3) | if XX\_COLL\_TYPE\_CR\_IND not in ('40','41')  then XX\_EAD\_COLL\_CCF\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA  else 0 | Betrag Grundpfandrecht  40 = Wohnimmobilien  41 = Gewerbeimmobilien |
|  |  |  | XX\_C\_CON\_2\_CODT\_LGDS\_CR\_AGG | XX\_EAD\_COLL\_CCF\_EXCL\_SEC\_CR\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
| 323 | D916 | VARCHAR(25) |  |  |  | NULL |  |
| 324 | PTY004 | Integer |  |  |  | '0' | Verwaltung und Verwahrung (0 = sonstige) |
| 325 | VAL507 | double | POSITION | C215 | double | If BALANCE\_SHEET\_IND like %95 then VAL507 = C215 else NULL | Verwaltungskredite werden in der BiSta über den VAL507 allokiert |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BALANCE\_SHEET\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
| 326 | VAL550 | double |  |  |  | NULL |  |
| 327 | Y009 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 328 | VAD224 | double | POSITION | C202 | VARCHAR(40) | Bewirtschaftung Cluster HGB:  if sum (NVL(XX\_EL\_LTD\_1\_CLA,0) + NVL(XX\_EL\_LTD\_2\_CLA,0)) < 0  then NULL  else (if XX\_STAGE\_IND in ('1','2')  then round (sum(NVL(XX\_EL\_LTD\_1\_CLA,0) + NVL(XX\_EL\_LTD\_2\_CLA,0)),2)  else NULL)  Der ermittelte Wert wird nach folgender Logik in die Tabelle geschrieben:  group by C202 and order by C202, J307, PTY001 ascending  if C202 is NULL  then calculate VAD224 with this CONTRACT (J307) and write VAD224 to this CONTRACT  else (if C202 is not NULL and PTY001=1  then calculate VAD224 with the the first CONTRACT and write VAD224 to this CONTRACT  else NULL)  Bewirtschaftung Cluster IFRS:  baw. keine Bewirtschaftung | Unversteuerte Pauschalwertberichtigungen  XX\_STAGE\_IND = IFRS-Stufeneinteilung Geschäft  XX\_EL\_LTD\_1\_CLA = Risikovorsorge Stage 1 XX\_EL\_LTD\_2\_CLA = Risikovorsorge Stage 2  PTY001 = Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1= Aktiv)  C202 = Prüfpfad 3 (Agreement\_ID)  J307 = Prüfpfad 11 (Contract)  Beim Design der Transformationsanweisung wurden folgende Anforderungen des Abnehmers AnaCredit berücksichtigt:  Überprüfung, dass keiner der LTD-Risikovorsorgewerte für Stage 1 (EL\_LTD\_1\_CLA) oder Stage 2 (EL\_LTD\_2\_CLA) negativ ist.  Innerhalb eines Kompensationsverbundes sollen alle Wertefelder auf Verbundebene am selben aktivischen CONTRACT dargestellt werden.  Für CONTRACTs außerhalb eines Kompensationsverbundes (C202 = NULL) wird der Wert an diesen CONTRACT geschrieben. |
|  |  |  | POSITION | J307 | VARCHAR(254) |  |  |
|  |  |  | POSITION | PTY001 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_EL\_LTD\_1\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_EL\_LTD\_2\_CLA | NUMBER(18,3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTR\_LLP\_LTD\_HGB | XX\_STAGE\_IND | CHAR(1) |  |  |
| 329 | B236 | DATE |  |  |  | NULL |  |
| 330 | EXC205 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_TRADING\_BOOK\_F | CHAR(1) | if XX\_TRADING\_BOOK\_F = ‘T’  then 1  else NULL | Einschluss für Handelsbuchpositionen für die LE |
| 331 | PTY024 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 332 | B826 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 333 | C711 | double |  |  |  | NULL |  |
| 334 | C748 | double |  |  |  | NULL |  |
| 335 | C641 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 336 | C705 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 337 | C761 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 338 | D914 | double |  |  |  | NULL |  |
| 339 | J303 | VARCHAR(254) |  |  |  | NULL |  |
| 340 | NUM702 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 341 | NUM320 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 342 | COL810 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 343 | D943 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 344 | C260 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 345 | C624 | Integer |  |  |  | NULL |  |
| 346 | C715 | Integer | INSTRUMENT | C206 | DATE | If XX\_DELISYST in ('106','211','218','219','512','210','222','223','224','225','226','227','228','237’  ')  And C206 is NULL  Then C715=030 | Restlaufzeitenband LCR/NSFR  030 = Bis einschließlich 30 Tage |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 347 | C773 | Integer | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) | if ((XX\_DELISYST in ('107','210','223','303','307', '106','210','211','218','219','222','223','224','225','226','227','228','237','512'))) and XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('115','302','303','304','305','308','311', ','313','314','343','423')  then C773=0 | Kategorien Retaileinlagen mit höheren Abflussfaktoren  0 = Keine Kategorie, Retaileinlage kommt nicht für einen höheren Abflussfaktor gem. Art. 25 Abs. 2 und 3 DR in Betracht |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB | NUMBER(5,0) |  |  |
| 348 | C762 | Integer | INSTRUMENT | C206 | DATE | If XX\_DELISYST in ('106','211','218','219','512','210','222','223','224','225','226','227','228','237’  ')  And C206 is NULL  Then C762=020 | Restlaufzeitenband ALMM  020 = Tagesgeld |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |
| 349 | C767 | double |  |  |  | NULL |  |
| 350 | C781 | double |  |  |  | NULL |  |
| 351 | C793 | VARCHAR(6) |  |  |  | NULL |  |
| 352 | PTY652 | Integer | INSTRUMENT | PRD013 | Integer | if PRD013=1020 and PTY001=1 and  ((XX\_DELISYST in ('103', '104',))  and (substr(XX\_BALANCE\_SHEET\_IND, 2, 2) in ('14','16','17','18','25','26','27','38','39')))  then PTY652 = 2  else  if PRD013=1020 and PTY001=2 and  ((XX\_DELISYST in ('103', '104',))  and (substr(XX\_BALANCE\_SHEET\_IND, 2, 2) in ('80','81','82','83','84','85')))  then PTY652 = 2 | Interdependente Cashflows NSFR DR  PTY652 = 2 (Förderkredite und dazugehörige Kredit- und Liquiditätsfazilitäten) |
|  |  |  | POSITION | PTY001 | Integer |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_BALANCE\_SHEET\_IND | VARCHAR(3) |  |  |
|  |  |  | XX\_C\_CONTRACT\_KG | XX\_DELISYST | VARCHAR(3) |  |  |

Tabelle 6: Übersicht der Transformationen für Zieltabelle POSITION

# Details der Transformation

## Bewirtschaftung des Feldes B014

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL   Info: Prüfe ob Verbriefungsposition vorhanden | Prüfung war erfolgreich. | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 3 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_APPROACH\_IND = 'IRBA'  Info:  XX\_APPROACH\_IND = Risikoansatz | Prüfung war erfolgreich. | 18 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 17 |
| 3 | Prüfe folgende Bedingung:   B500 = 2  Info: Risikoansatz (2 = IRB) | Prüfung war erfolgreich. | 4 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 17 |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung:  B603 = 'T'  Info: Prüfpfad 3 (Transferrisiko) | Prüfung war erfolgreich. | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 6 |
| 5 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 10  Info: 10 = Zentralregierungen | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 6 | Prüfe die Ausprägung des Feldes XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND  Info: Forderungsklasse IRBA, 40 = Unternehmen, 50/ 51/ 52 = Mengengeschäft, 99 = Unternehmen (keine Zuordnung möglich) | XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND in ('40', '99') | 7 |
| XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND in ('50', '51', '52') | 10 |
| XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND not in ('40, '50', '51', '52', '99') | 14 |
| 7 | Prüfe die Ausprägung des Feldes XX\_SPECIAL\_LOAN\_IND  Info: Sonderkreditkennzeichen, 99 = keine Spezialfinanzierung | XX\_SPECIAL\_LOAN\_IND = '99' | 8 |
| XX\_SPECIAL\_LOAN\_IND != '99' | 9 |
| 8 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 30  Info: 30 = Unternehmen | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 9 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 31  Info: 31 = Spezialfinanzierungen | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 10 | Prüfe die Ausprägung des Feldes XX\_RETAIL\_CAT\_SOLVV\_IND  Info: Kategorie Retailgeschäft, 1 = revolvierender Kredit, 2 = Hypothekarkredit | XX\_RETAIL\_CAT\_SOLVV\_IND = '1' | 11 |
| XX\_RETAIL\_CAT\_SOLVV\_IND = '2' | 12 |
| XX\_RETAIL\_CAT\_SOLVV\_IND not in ('1', '2') | 13 |
| 11 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 42  Info: 42 = Mengengeschäft qualifiziert revolvierend | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 12 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 41  Info: 41 = Mengengeschäft Immobilien Wohn/ Gewerbe | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 13 | Ermittle das Zielfeld: B014 = 40  Info: 40 = Mengengeschäft Sonstige | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 14 | Zugriff auf Tabelle XX\_MAP\_B014 mit XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSET\_CLASS\_IRBA\_IND. | Zugriff auf Referenztabelle war erfolgreich. | 15 |
| Zugriff auf Referenztabelle war nicht erfolgreich. | 16 |
| 15 | Übernehme das Outputfeld B014. | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 16 | B014 wird mit NULL befüllt und Error ID 1001 #DQ protokolliert. | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 17 | Das Zielfeld B014 wird mit NULL befüllt. | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 18 | Das Zielfeld B014 wird mit 60 befüllt.  Info: 60 = Verbriefungen | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |

Tabelle 7: Details der Transformation zur Ermittlung von B014

## Bewirtschaftung des Feldes B017

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: B603 != 'T' and XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_CONTRACT is not NULL | Prüfung war erfolgreich | 9 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 2 |
| 2 | Prüfe Ausprägung des Feldes B500  Info: Risikoansatz (0= KSA, 2 = IRB) | B500 = 0 | 3 |
| B500 = 2 | 5 |
| B500 not in (0, 2) | 10 |
| 3 | Prüfe Ausprägung des Feldes XX\_CCF\_USED\_P  Info: CCF aus SolvV-RK-Lauf | XX\_CCF\_USED\_P is NULL | 9 |
| XX\_CCF\_USED\_P is not NULL | 4 |
| 4 | Ermittle das Zielfeld: B017 = XX\_CCF\_USED\_P / 100 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 5 | Prüfe Ausprägung des Feldes B603  Info: Prüfpfad 3 (Transferrisiko) | B603 = 'T' | 9 |
| B603 != 'T' | 6 |
| 6 | Prüfe Ausprägung des Feldes XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_FULLSTA.XX\_CONTRACT | XX\_CONTRACT is NULL | 10 |
| XX\_CONTRACT is not NULL | 7 |
| 7 | Prüfe Ausprägung des Feldes XX\_CONV\_FACT\_STA\_P  Info: CCF aus Full-KSA-Lauf | XX\_CONV\_FACT\_STA\_P is NULL | 9 |
| XX\_CONV\_FACT\_STA\_P is not NULL | 8 |
| 8 | Ermittle das Zielfeld: B017 = XX\_CONV\_FACT\_STA\_P / 100 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
|  |
| 9 | Befülle Zielfeld: B017 = 1 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |  |
| 10 | Das Zielfeld B017 wird mit NULL befüllt. Fehlerprotokollierung Error ID 1007, kein Eintrag für das Geschäft in FULLSTA-Lauf - #DQ. | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |  |

Tabelle 8: Details der Transformation zur Ermittlung von B017

## Bewirtschaftung des Feldes B024

**Bewirtschaftung Cluster IFRS:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 0 | Prüfe Ausprägung des Feldes B603 und SEC502  Info: ABS & IRBA | B603 = 'A' and SEC502 = 1 | 8 |
| B603 != 'A' and SEC502 != 1 | 1 |
| 1 | Prüfe Ausprägung des Feldes B500  Info: Risikoansatz (0=KSA, 2 =IRBA) | B500 = 2 | 2 |
| B500 = 0 | 7 |
| 2 | Prüfe Ausprägung des Feldes B603  Info: Prüfpfad 3 (Obligor-/ Transferrisiko) | B603 = 'O' | 5 |
| B603 = 'T' | 3 |
| 3 | Prüfe Ausprägung des Feldes XX\_PTE\_P  Info: Ausfallwahrscheinlichkeit | 0 < XX\_PTE\_P < 100 | 4 |
| XX\_PTE\_P = 0 | 6 |
| XX\_PTE\_P = 100 | 5 |
| 4 | Ermittle das Zielfeld: B024 = XX\_C\_CONTRACT\_LDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA \* (XX\_LGD\_BE\_P/100) | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 5 | Ermittle das Zielfeld: B024 = XX\_C\_CONTRACT\_LDS\_CR\_SOLVV.XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 6 | Ermittle das Zielfeld: B024 = 0 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 7 | Zielfeld B024 is NULL | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 8 | Ermittle das Zielfeld: B024 = XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_ASSESS\_BASIS\_CLA | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |

Tabelle 9: Details der Transformation zur Ermittlung von B024

## Bewirtschaftung des Feldes PTY002

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_REFI\_IND = 'V' Info: Verwaltungskredit? | Prüfung war erfolgreich. | 7 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_DELISYST = '106' and substr(XX\_BALANCE\_SHEET\_IND,2,2) = '95' Info: Verwaltungskredit? | Prüfung war erfolgreich. | 7 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 3 |
| 3 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND is not NULL and XX\_PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND != '^'  Info: PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND = Ergänzende Aufschlüsselung zur übergreifenden Produktart (PRODUCT-TYPE\_CDB) | Prüfung war erfolgreich. | 4 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 5 |
| 4 | Zugriff auf Tabelle XX\_MAP\_PTY002 mit XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB und XX\_PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND | Zugriff war erfolgreich -> Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| Zugriff war nicht erfolgreich | 5 |
| 5 | Zugriff auf Tabelle XX\_MAP\_PTY002 mit XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB XX\_PRODUCT\_TYPE\_2\_ORIG\_IND is NULL  Info: PRODUCT\_TYPE\_CDB = Eindeutige Produktart über alle angelieferten Strukturen im FRDWH (CDB\_STRUCT) | Zugriff war erfolgreich -> Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| Zugriff war nicht erfolgreich | 6 |
| 6 | Ermittle das Zielfeld: PTY002 = 1  Fehlerprotokollierung Error ID 1001 #DQ. | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 7 | Setze: PTY002 = 2 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |

Tabelle 10:Details der Transformation zur Ermittlung von PTY002

## Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001

## Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001 für Cluster HGB

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Rang | Bedingung / Aktion | Ergebnis | Folgerang |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_DELISYST in ('100','101','102','107')  Info: 100 = Spar. 101 = Vertragsspar, 102 = Sparbrief, 107 = Termingeld | Prüfung war erfolgreich | 13 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‚308‘,‘316‘)  Info: 308 & 316 = TDA | Prüfung war erfolgreich | 14 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 3 |
| **3** | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('115', '150', '151', '152', '153', '154', '155', '156', '159', '160', '162', '317', '320', '321', '322', '323', '324', '325', '326', '327', '328', '329', '330', '331', '332', '333', '334', '335', '336', '337', '338', '339', '340', '341', '342', '346', '347', '348', '349', '374', '375', '376', '377', '378', '379', '380', '381', '382', '383', '384', '385', '386', '387', '388', '389', '390', '391', '392', '393', '394', '395', '396', '397', '398', '399',‘400‘, '401', '402', '403', '404', '405',‘406‘, '423', '434', '435', '436', '437', '438', '439', '440', '441', '444', '445', '447', '449', '450', '451', '452', '454', '459', '460', '461', '462', '463', '464', '601', '602', '603', '604', '605', '66')  Info: Eindeutige Produktart über alle angelieferten Strukturen im FRDWH (CDB\_STRUCT); Filterung hier dient der Abgrenzung von den Produktgruppen Limite bzw. Akkreditive, da für diese die in Rang 2 verwendeten Betragsfelder nicht gefüllt sind (separate Prüfung ab Rang 3) | Prüfung war erfolgreich | **4** |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **5** |
| **4** | Befülle die Hilfsvariable VAR\_C215 wie folgt:    if XX\_CONTRACT is NULL  then NULL  else (if XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA <= 0  then (NVL(XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA, 0) + NVL(XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA, 0) + NVL(XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA, 0))  else (if  ((XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA > 0 or XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA is NULL) or XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_ HGB\_CLA is not NULL or XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA is not NULL)  then (NVL(XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA, 0) + NVL(XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA, 0))  else NULL | VAR\_C215 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | **8** |
| Info: XX\_ARR\_OVERDR\_HGB\_CLA = Rückstand/Überzahlung für HGB, XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA = Buchwert kompensiert saldiert in Konzernwährung für HGB, XX\_FAIR\_VALUE\_ADJ\_HGB\_CLA = Fair Value Adjustment in Konzernwährung für HGB, XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA = langfristige Ford./Verbindlichkeiten kompensiert in Konzernwährung für HGB |
| **5** | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('345', '366', '367', '368', '369', '370', '371', '372', '373', '470', '471') | Prüfung war erfolgreich | **6** |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **7** |
| **6** | VAR\_C215 =  XX\_BOOK\_VALUE\_ COMP\_O\_HGB\_CLA | VAR\_C215 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | **8** |
| **7** | VAR\_C215 =  XX\_BOOK\_VALUE\_ COMP\_O\_HGB\_CLA  Schreibe Error ID 1002 #DQ wg. fehlender Parametrisierung. | VAR\_C215 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | **8** |
| **8** | Prüfe folgende Bedingung:  VAR\_C215 is not NULL and XX\_REF\_D >= C207  Info: Erkennung abgelaufene Geschäfte, C207 = Laufzeitende des Kontraktes bzw. Endfälligkeit eines Wertpapiers | Prüfung war erfolgreich | **9** |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **12** |
| **9** | Prüfe folgende Bedingung:  VAR\_C215 < 0 and XX\_CDB\_STRUCT != 'VS\_LIMIT'  Info: Abgrenzung Passivgeschäfte, XX\_CDB\_STRUCT = CDB-Struktur, Vorzeichen VAR\_C215: negativ bei Passivpositionen und Limiten, positiv bei allen übrigen Aktivpositionen | Prüfung war erfolgreich | **11** |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **10** |
| **10** | C215 = 0  PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |
| Info: Aktivgeschäft (IA oder Limit), welches das Laufzeitenddatum überschritten hat. Für AnaCredit/Bista impliziert es, dass sich der Kredit im Rückstand befindet. Für Abbildung Rückstände wird zukünftig CRE101, CRE102 und CRE103 bzw.das Summenfeld CRE100 bewirtschafet, daher C215 = 0 bzw. PTY001 = 1. PTY001 = Aktiv-/Passiv-Kennzeichen (1 = Aktiv-Position; 2 = Passiv-Position) |
| **11** | C215 = round (abs(VAR\_C215), 2) | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |
|  |
| PTY001 = 2 |
|  |
|  |
| **12** | C215 = round (abs(VAR\_C215), 2) | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |
|  |
| PTY001 = |
| if ((VAR\_C215 < 0 and XX\_CDB\_STRUCT != 'VS\_LIMIT') or BALANCE\_SHEET\_IND like ‚%95‘)  then 2 else 1 |
| **13** | C215= round((ABS(XX\_BOOK\_VALUE\_ COMP\_O\_HGB\_CLA)),2)  PTY001=2 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |
| **14** | if XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA is not NULL and  XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA is NULL  then PTY001 = 1 and C215 = XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA  else if XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA is NULL and  XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA is not NULL  then PTY001 = 2 and C215 = XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA | Prüfung war erfolgreich  Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **15** |
| **15** | if XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA is not NULL and XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA is not NULL then  set for POSITION\_ID with Suffix ‘\_A’ PTY001 = 1 and C215 = XX\_BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA  and for POSITION\_ID with Suffix ‘\_L’ PTY001 = 2 and C215 = XX\_BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA  Info: Für die TDA Geschäfte (Delisyst 308, 316) erfolgt ein Split in der POSITION, wobei das Aktiv- und Passivgeschäft durch das Suffix ‘\_A‘ (Assets) bzw. ‘\_L‘ (Liabilities) gekennzeichnet wird. | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | **ENDE** |

Tabelle 11: Details der Transformation zur Ermittlung von C215/ PTY001 für Cluster HGB

## Bewirtschaftung des Feldes C215/ PTY001 für Cluster IFRS

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Rang | Bedingung / Aktion | Ergebnis | Folgerang |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_CONTRACT is not NULL  Info: Verbriefungsposition vorhanden? | Prüfung war erfolgreich und B603 != T | 18 |
| Prüfung war erfolgreich und B603 = T | 19 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_C\_CONTR\_ACC\_VALUE\_AGG.XX\_CONTRACT is not NULL  Info: Für das Geschäft gibt es einen Eintrag in der Tabelle ACC\_VALUE | Prüfung war erfolgreich | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 12 |
| 3 | Prüfe folgende Bedingung: B603 = 'O'  Info: Kreditrisiko | Prüfung war erfolgreich | 4 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 13 |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_CDB\_STRUCT ('VS\_LOAN', 'VS\_MOTRANS', VS\_ACCOUNT')  Info: Darlehen, Geldhandel, Kontenbasiertes Geschäft | Prüfung war erfolgreich | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 6 |
| 5 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_REFI\_IND = 'V'  Info: Verwaltungskredite | Prüfung war erfolgreich | 9 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 7a |
| 6 | Prüfe folgende Bedingung (VS\_LIMIT): XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA <= 0  Info: Freier Anteil Limit | Prüfung war erfolgreich | 9 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 11 |
| 7a | Prüfe folgende Bedingung:  B500 = 0 and (XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA-XX\_D2\_CR\_CLA)<0  Info: Geschäft im KSA hat eine negtive LLP (Zuschreibung). | Prüfung war erfolgreich | 20 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 7b |
| 7b | Prüfe Inhalt der folgenden Felder XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA and XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA and XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA and XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA  Info: XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA = IFRS Buchwert kompensiert XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA = antizipative Zinsabgrenzung kompensiert (IFRS) XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA = transitorische Zinsabgrenzung in Konzernwährung (IFRS) XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA= IFRS Agio/Disagio | (XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA -XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA) >= 0 (Aktiv) | 8 |
| (XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA -XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA) < 0 (Passiv) | 10a |
| 8 | Befülle Zielfelder wie folgt: C215 = round((XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA-XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA),2)  PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
| 9 | Befülle Zielfelder wie folgt: C215 = round(ABS(XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA),2)  PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
| 10a | Prüfe folgende Bedingung: XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA >= 0  Info: Es kann vorkommen, dass ein passivischer Buchwert aufgrund der D2 Abschreibung ins Aktiv schwenkt. Bei diesen Fällen, ist der Buchwert (C215) mit neg. Vorzeichen i. V. m. dem Aktivkennzeichen (PTY001) anzuliefern. | Bedingung trifft nicht zu XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA < 0 or XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA is NULL | 10b |
| Bedingung trifft zu XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA >= 0 and PTY002 = 2  Info: außerbilanziell | 10b |
| Bedingung trifft zu XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA >= 0 and PTY002 != 2  Info: bilanziell | 10c |
| 10b | Befülle Zielfelder wie folgt: C215 = round(ABS(XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA-XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA),2)  PTY001 = 2 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
| 10c | Befülle Zielfeld wie folgt: C215 = 0 PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
| 11 | Befülle Zielfeld wie folgt: C215 = 0 PTY001 = 1  Schreibe Error ID 1005 #DQ Geschäfte aus VS\_LIMIT sind immer mit negativem Vorzeichen anzuliefern. | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt & Error ist protokolliert | ENDE |
| 12 | Befülle Zielfelder wie folgt: C215 = NULL PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
| 13 | Prüfe die Ausprägung des Feldes XX\_PTE\_P für Transferrisiken (B603 = 'T') Info: Eintrittswahrscheinlichkeit | 0 < XX\_PTE\_P < 100 | 14 |
| XX\_PTE\_P = 0 | 15 |
| XX\_PTE\_P = 100 | 16 |
| 14 | Befülle die Hilfsvariable VAR\_TRANSFER wie folgt:  VAR\_TRANSFER = XX\_LGD\_BE\_P/100  Info: XX\_LGD\_BE\_P = LGD Best Estimate, VAR\_TRANSFER wird benötigt, um eine konsistente Bemessungsgrundlage für die vom Rechenkern bereits ermittelte RWA anliefern zu können | VAR\_TRANSFER wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | 17 |
| 15 | VAR\_TRANSFER = 0 | VAR\_TRANSFER wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | 17 |
| 16 | VAR\_TRANSFER = 1 | VAR\_TRANSFER wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | 17 |
| 17 | Befülle Zielfelder wie folgt:  C215 = round( (XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA \* VAR\_TRANSFER \* (1-NVL(XX\_SEC\_RATE\_NO,0))) ,2)   PTY001 = 1  Info: XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA = Bemessungsgrundlage, XX\_D2\_CR\_CLA = Betrag des Kredit-Abschreibung-Verbrauches (D2 ungeglättet), XX\_SEC\_RATE\_NO = relativer Anteil eines Geschäfts der in eine Verbriefung gelaufen ist | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |
|  |
| 18 | Befülle Zielfelder wie folgt: C215= if XX\_RW\_METH\_IND != 'V' then abs(XX\_BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_IFRS\_CLA -  XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA) else 0  PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |  |
| 19 | Ausschluss des Transferrisikodatensatz von der weiteren Verarbeitung, da Originärgeschäft verbrieft ist. | Der Datensatz wird von der weiteren Verarbeitung ausgeschlossen | ENDE |  |
| 20 | Prüfe folgende Bedingung:  (XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA+ NVL(XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA,0) -  NVL(XX\_D2\_CR\_CLA,0) -XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA) < 0 | Das Ergbenis der Formel ist kleiner 0 | 21 |  |
| Das Ergbenis der Formel ist größer/gleich 0 | 22 |
| 21 | Befülle das Zielfeld wie folgt:  C215 = abs(XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA+ NVL(XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA,0) -  NVL(XX\_D2\_CR\_CLA,0) -XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA)  PTY001 = 2 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |  |
| 22 | Befülle das Zielfeld wie folgt:  C215 = XX\_ASSESS\_BASE\_CRSOLVV\_CLA+ NVL(XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA,0) -  NVL(XX\_D2\_CR\_CLA,0) -XX\_ACCR\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_DEFER\_INTEREST\_IFRS\_CLA + XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_IFRS\_CLA  PTY001 = 1 | Die Zielfelder C215 und PTY001 sind befüllt. | ENDE |  |

Tabelle 12: Details der Transformation zur Ermittlung von C215/ PTY001 für Cluster IFRS

## Bewirtschaftung des Feldes C226

**Bewirtschaftung Cluster IFRS:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: and XX\_CONTRACT is not NULL  Info: Verbriefungsposition vorhanden? | Prüfung war erfolgreich. | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 3 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_RW\_METH\_IND != 'V'  Info: XX\_RW\_METH\_IND = Risikogewichtsverfahren, mit dem das RW ermittelt wurde (V=Aufsichtliche Vorgabe bei Verstoß gegen § 18 KWG) | Prüfung war erfolgreich. | 7 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 8 |
| 3 | Ermittle folgendes Ergebnis:  VAR\_C226 = NVL(XX\_CRA\_CR\_EXCL\_CLA, 0) - NVL(XX\_D2\_CR\_CLA, 0) | VAR\_C226 ist befüllt. | 4 |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung:  VAR\_C226 [IFRS] >= C215[IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] - C224 [IFRS]  Info: Risikovorsorge > BMG C215 = Buchwert C223 = Anteilige Zinsen C224 = Anteilige Gebühren | Prüfung war erfolgreich. | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 6 |
| 5 | Ermittle das Zielfeld:  C226 = C215 [IFRS] + C223 [IFRS OWF/LR] – C224 [IFRS] | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 6 | Ermittle das Zielfeld: C226 = round(VAR\_C226,3) | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 7 | C226 = XX\_ABS\_LLP\_CLA | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 8 | C226 = 0 | Zielfeld ist befüllt. | ENDE |

Tabelle 13: Details der Transformation zur Ermittlung von C226

## Bewirtschaftung des Feldes CRI114/CRI115

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| Rang | Bedingung / Aktion | Ergebnis | Folgerang |
| 1 | Prüfe ob XX\_DELISYST = '020'  Info: Limite | Prüfung war erfolgreich | 12 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_C\_CUSTOMER.XX\_FORBE\_STATUS\_F = 'T'  Info: Vorhandener Forbearance Status | Prüfung war erfolgreich | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich (-> 'F‘ or NULL) | 6 |
| 3 | Prüfe folgende Bedingung: |  | 4 |
| (XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D is not NULL or | Prüfung war erfolgreich |
| XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D != '01.01.1753' or |  |
| XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D != '31.12.1212') and |  |
| XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D > POSITION.MAT106 |  |
| Info:  XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D = Datum der jüngsten, zum Stichtag gültigen Forbearance Maßnahme.  MAT106 = Datum des Vertragsabschlusses | Prüfung war nicht erfolgreich | 5 |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_C\_CUSTOMER.XX\_FORBE\_ACTION\_DESC = ‘FORB\_OTHER’  Info:  FORB\_OTHER = Sonstige Maßnahme | Prüfung war erfolgreich | 9 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 5 |
| 5 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_C\_CUSTOMER.XX\_FORBE\_ACTION\_DESC = ‘FORB\_REFIN’  Info:  FORB\_REFIN = Limiterhöhung/ Neue Kreditmittel | Prüfung war erfolgreich | 10 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 9 |
| 6 | Prüfe folgende Bedingung: | Prüfung war erfolgreich | 12 |
| POSITION.MAT106 is NULL | Prüfung war nicht erfolgreich | 7 |
| 7 | Prüfe folgende Bedingung: | Pürfung war erfolgreich | 12 |
| XX\_PROLONGATION\_LAST\_D or XX\_RENEGOTIATION\_D > Monatsultimo |
| Info: XX\_PROLONGATION\_LAST\_D = Datum der letzten Konditionsvereinbarung XX\_RENEGOTIATION\_D = Datum der letzten Neuverhandlung der Konditionsvereinbarung | Prüfung war nicht erfolgreich | 8 |
| 8 | Prüfe folgende Bedingung: |  | 11 |
| XX\_PROLONGATION\_LAST\_D or XX\_RENEGOTIATION\_D > POSITION.MAT106 | Pürfung war erfolgreich |
| and XX\_PROLONGATION\_LAST\_D or XX\_RENEGOTIATION\_D > ’31.08.2018’ |  |
|  | Prüfung war nicht erfolgreich | 12 |
| 9 | Setze | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| CRI114 = ‘2’ und CRI115 = XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D  Info: 2 = Gestundet: Instrumente mit anderen geänderten vertraglichen Bedingungen |
| 10 | Setze | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| CRI114 = ‘3’ und CRI115 = XX\_C\_CUSTOMER.XX\_FORBE\_CURR\_VALID\_FROM\_D  Info:  3 = Gestundet: ganz oder teilweise umgeschuldete Verbindlichkeit |
| 11 | Setze | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| CRI114 = 5 und CRI115 = MAX(XX\_PROLONGATION\_LAST\_D, XX\_RENEGOTIATION\_D)  Info: 5 = Neu verhandeltes Instrument ohne Stundungsmaßnahmen |
| 12 | Setze | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| CRI114 = NULL und CRI115=NULL |

Tabelle 14: Details der Transformation zur Ermittlung von CRI114/CRI115

## Bewirtschaftung des Feldes B005

**Bewirtschaftung Cluster IFRS:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| **1** | Prüfe folgende Bedingung: B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL  Info: Verbriefungsposition vorhanden? | Prüfung war erfolgreich | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | **3** |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_RW\_METH\_IND != 'S' and  XX\_RM\_METH\_IND != 'O'  Info:  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren (D=Durchschau, I= ratingsbasierter Ansatz IAA, K=Risikogewicht inkl. KRM,R=ratinsbasierter Ansatz ext. Rating, S=Aufsichtl. Formelansatz, A=1250% RW, E=Early Amortisation, Q=Rückfalllösung für qual. Verbriefungsliquiditätsfazilität, Z=ABCP-Zweitverlustposition, V=Aufsichtl. Vorgane bei Verstoß $18 KWG)  XX\_RM\_METH\_IND = Art der Kreditrisikominderung (O=unbesichert, S=Substitution, U=Comprehensive, D=Due Diligence, N=Capital deduction) | Prüfung war erfolgreich | 7 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 8 |
| 3 | Prüfe folgende Bedingung: B500 = '0'  Info: KSA | Prüfung war erfolgreich | 4 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 6 |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_SOLVV.XX\_RW\_PRESUP is not NULL  Info: XX\_RW\_PRESUP = KSA-Risikogewicht vor Besicherung nach Kreditsubstitution (vor KMU) | Prüfung war erfolgreich | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 6 |
| 5 | Bewirtschafte das Zielfeld wie folgt: B005 = XX\_RW\_PRESUP | Zielfeld ist befüllt | ENDE |
| 6 | Bewirtschafte das Zielfeld wie folgt: B005 = NULL | Zielfeld ist befüllt | ENDE |
| 7 | Bewirtschafte das Zielfeld wie folgt: B005 = XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_RW\_EXCL\_RM  Info: Risikogewicht der Verbriefungsposition exkl. KRM | Zielfeld ist befüllt | ENDE |
| 8 | Bewirtschafte das Zielfeld wie folgt: B005 = XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS.XX\_RW\_INCL\_RM  Info: Risikogewicht der Verbriefungsposition inkl. KRM | Zielfeld ist befüllt | ENDE |

Tabelle 15: Details der Transformation zur Ermittlung von B005

## Bewirtschaftung des Feldes CRI502

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: B603 != 'T' and XX\_CONTRACT is not NULL | Prüfung war erfolgreich | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 10 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: XX\_RM\_METH\_IND != ‘O’  Info: XX\_RM\_METH\_IND = Art der Kreditrisikominderung (O=unbesichert, S=Substitution, U=Comprehensive, D=Due Diligence, N=Capital deduction) | Prüfung war erfolgreich | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich | 6 |
| 3 | Prüfe die Quellausprägung des Feldes XX\_APPROACH\_IND der Tabelle XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND = ‘KSA’ | 4 |
| XX\_APPROACH\_IND = ‘IRBA’ | 5 |
| XX\_APPROACH\_IND != ‘KSA’ or  XX\_APPROACH\_IND != ‘IRBA’ | 9 |
| 4 | Das Zielfeld wird wie folgt befüllt: CRI502 = 0 | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 5 | Das Zielfeld wird wie folgt befüllt: CRI502 = 4 | Das Zielfeld ist befüllt. | ENDE |
| 6 | Prüfe die Quellausprägung des Feldes XX\_APPROACH\_IND der Tabelle XX\_C\_CONTRACT\_LGDS\_CR\_ABS | XX\_APPROACH\_IND = ‘KSA’ | 7 |
| XX\_APPROACH\_IND = ‘IRBA’ | 8 |
| XX\_APPROACH\_IND != ‘KSA’ or XX\_APPROACH\_IND != ‘IRBA’ | 9 |
| 7 | Zugriff auf die XX\_MAP\_CRI502\_DEAL mit den Feldinhalten von:  XX\_APPROACH\_IND XX\_RM\_METH\_IND XX\_RW\_METH\_IND XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND  Info:  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren (D=Durchschau, I= ratingsbasierter Ansatz IAA, K=Risikogewicht inkl. KRM,R=ratinsbasierter Ansatz ext. Rating, S=Aufsichtl. Formelansatz, A=1250% RW, E=Early Amortisation, Q=Rückfalllösung für qual. Verbriefungsliquiditätsfazilität, Z=ABCP-Zweitverlustposition, V=Aufsichtl. Vorgane bei Verstoß §18 KWG)  XX\_RM\_METH\_IND = Art der Kreditrisikominderung (O=unbesichert, S=Substitution, U=Comprehensive, D=Due Diligence, N=Capital deduction)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND = Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (I= IAA rating, A=Inferred rating, E=External ratings, O=No valid rating) | Zugriff erfolgreich & Übernahme des Output in Zielfeld. | ENDE |
| Zugriff nicht erfolgreich. | 10 |
| 8 | Zugriff auf die XX\_MAP\_CRI502\_DEAL mit den Feldinhalten von:  XX\_APPROACH\_IND XX\_RM\_METH\_IND XX\_RW\_METH\_IND XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND  Info:  XX\_RW\_METH\_IND=Risikogewichtsverfahren (D=Durchschau, I= ratingsbasierter Ansatz IAA, K=Risikogewicht inkl. KRM,R=ratinsbasierter Ansatz ext. Rating, S=Aufsichtl. Formelansatz, A=1250% RW, E=Early Amortisation, Q=Rückfalllösung für qual. Verbriefungsliquiditätsfazilität, Z=ABCP-Zweitverlustposition, V=Aufsichtl. Vorgane bei Verstoß $18 KWG)  XX\_RM\_METH\_IND = Art der Kreditrisikominderung (O=unbesichert, S=Substitution, U=Comprehensive, D=Due Diligence, N=Capital deduction)  XX\_ABS\_CQS\_ACT\_SRC\_IND = Herkunft von BONITAETSSTUFE und RATING (I= IAA rating, A=Inferred rating, E=External ratings, O=No valid rating) | Zugriff erfolgreich & Übernahme des Output in Zielfeld. | ENDE |
| Zugriff nicht erfolgreich | 10 |
| 9 | Das Zielfeld CRI502 wird mit NULL befüllen &  Error ID 1003 #DQ protokollieren | Zielfeld ist befüllt & Error ID wurde protokolliert. | ENDE |
| 10 | Das Zielfeld CRI502 mit NULL befüllen | Das Zielfeld CRI502 ist leer. | ENDE |

Tabelle 16: Details der Transformation zur Ermittlung von CRI502

## Bewirtschaftung des Feldes C213

### Bewirtschaftung des Feldes C213 HGB

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‘308‘,‘316‘)  Info: 308 & 316 = TDA | Prüfung war erfolgreich. | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‘100‘,‘101‘,‘102‘,‘107‘)  or  XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('115', '150', '151', '152', '153', '154', '155', '156', '159', '160', '162', '317', '320', '321', '322', '323', '324', '325', '326', '327', '328', '329', '330', '331', '332', '333', '334', '335', '336', '337', '338', '339', '340', '341', '342', ‘345’,'346', '347', '348', '349',’366’,’367’,’368’,’369’,’370’,’371’,’372’,’373’ '374', '375', '376', '377', '378', '379', '380', '381', '382', '383', '384', '385', '386', '387', '388', '389', '390', '391', '392', '393', '394', '395', '396', '397', '398', '399',‘400‘, '401', '402', '403', '404', '405',‘406‘, '423', '434', '435', '436', '437', '438', '439', '440', '441', '444', '445', ‘446’,'447', '449', '450', '451', '452', '454', '459', '460', '461', '462', '463', '464',’470’,’471’, '601', '602', '603', '604', '605', '66')  Info: Eindeutige Produktart über alle angelieferten Strukturen im FRDWH (CDB\_STRUCT) | Prüfung war erfolgreich. | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 4 |
| 3 | if XX\_CONTRACT is NULL  then NULL  else (if XX\_NOMINAL\_HGB\_CLA is not NULL  then VAR\_C213 = XX\_NOMINAL\_HGB\_CLA)  else  if XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA is not NULL  then VAR\_C213 = XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA  else 0  Info: XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_HGB\_CLA = langfristige Forderungen/Verbindlichkeiten kompensiert in Konzernwährung für HGB,  XX\_NOMINAL\_HGB\_CLA = HGB Nominalwert in Konzernwährung | VAR\_C213 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | ENDE |
| 4 | VAR C213 = 0 | VAR\_C213 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | ENDE |
| 5 | set for POSITION\_ID with Suffix ‘\_A’ C213 = BOOK\_VALUE\_A\_HGB\_CLA  and for POSITION\_ID with Suffix ‘\_L’ C213 = BOOK\_VALUE\_L\_HGB\_CLA\*(-1)  Hinweis: Für die TDA Geschäfte (Delisyst 308,316) erfolgt ein Split in der POSITION, wobei das Aktiv und Passivgeschäft durch das Suffix ‘\_A‘ (Assets) bzw. ‘\_L‘ (Liabilities) gekennzeichnet wird. | Das Zielfeld C213 ist befüllt | ENDE |

### Bewirtschaftung des Feldes C213 IFRS

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung: | Prüfung war erfolgreich. | 5 |
| XX\_DELISYST in (‘308‘,‘316‘) |
|  |
|  |
| Info: 308 & 316 = TDA | Prüfung war nicht erfolgreich. | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung: | Prüfung war erfolgreich. | 3 |
| XX\_DELISYST in (‘100‘,‘101‘,‘102‘,‘107‘) |
| or |
| XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('115', '150', '151', '152', '153', '154', '155', '156', '159', '160', '162', '317', '320', '321', '322', '323', '324', '325', '326', '327', '328', '329', '330', '331', '332', '333', '334', '335', '336', '337', '338', '339', '340', '341', '342', ‘345’,'346', '347', '348', '349',’366’,’367’,’368’,’369’,’370’,’371’,’372’,’373’ '374', '375', '376', '377', '378', '379', '380', '381', '382', '383', '384', '385', '386', '387', '388', '389', '390', '391', '392', '393', '394', '395', '396', '397', '398', '399',‘400‘, '401', '402', '403', '404', '405',‘406‘, '423', '434', '435', '436', '437', '438', '439', '440', '441', '444', '445', ‘446’,'447', '449', '450', '451', '452', '454', '459', '460', '461', '462', '463', '464',’470’,’471’, '601', '602', '603', '604', '605', '66') |
|  |
|  |
|  |
| Info: Eindeutige Produktart über alle angelieferten Strukturen im FRDWH (CDB\_STRUCT) | Prüfung war nicht erfolgreich. | 4 |
| 3 | if XX\_CONTRACT is NULL |  |  |
| then NULL |  |  |
| else (if XX\_NOMINAL\_IFRS\_CLA is not NULL |  |  |
| then VAR\_C213 = XX\_NOMINAL\_IFRS\_CLA) |  |  |
| else |  |  |
| if XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_IFRS\_CLA is not NULL |  |  |
| then VAR\_C213 = XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_IFRS\_CLA |  |  |
| else 0 | VAR\_C213 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | ENDE |
|  |  |  |
|  |  |  |
| Info: XX\_LT\_LIA\_REC\_COMP\_IFRS\_CLA = langfristige Forderungen/Verbindlichkeiten kompensiert in Konzernwährung für IFRS, |  |  |
| XX\_NOMINAL\_IFRS\_CLA = IFRS Nominalwert in Konzernwährung |  |  |
| 4 |  |  |  |
| VAR C213 = 0 | VAR\_C213 wurde ermittelt und steht zur weiteren Verarbeitung zur Verfügung. | ENDE |
|  |  |  |
| 5 | set for POSITION\_ID with Suffix ‘\_A’ C213 = BOOK\_VALUE\_A\_IFRS\_CLA |  |  |
| and for POSITION\_ID with Suffix ‘\_L’ C213 = BOOK\_VALUE\_L\_IFRS\_CLA\*(-1) |  |  |
|  |  |  |
| Hinweis: Für die TDA Geschäfte (Delisyst 308,316) erfolgt ein Split in der POSITION, wobei das Aktiv und Passivgeschäft durch das Suffix ‘\_A‘ (Assets) bzw. ‘\_L‘ (Liabilities) gekennzeichnet wird. |  |  |
|  | Das Zielfeld C213 ist befüllt | ENDE |

## Bewirtschaftung des Feldes CRE101

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_PRODUCT\_TYPE\_CDB in ('324', '326', '345', '349', '366', '367', '368', '369', '370', '371', '372', '373', '374', '375', '376', '377', '378', '379', '380', '381', '382', '383', '384', '385', '386', '387', '388', '389', '390', '391', '392', '393', '394', '395', '396', '397', '398', '399', '400', '401', '402', '403', '404', '405', '462', '463', '470'; '471') | Prüfung war erfolgreich. | 8 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 2 |
| 2 | Prüfe folgende Bedingung:  C207 <= REF\_D | Prüfung war erfolgreich. | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 4 |
| 3 | Ermittle das Zielfeld  CRE101=  NVL(XX\_ BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA)  - NVL(XX\_ACCR\_INTEREST\_HGB\_CLA)  - NVL(XX\_DEFER\_INTEREST\_HGB\_CLA)  - NVL(XX\_ACCR\_DEFER\_ITEMS\_HGB\_CLA)  Abgelaufene Geschäfte erhalten i.d.R. C215=0, der Restbetrag, der noch im BOOK\_VALUE\_COMP\_O\_HGB\_CLA hinterlegt ist, soll abzgl. antizipativer und transitorischer Zinsabgrenzung und abzgl. Agio/Disagio in CRE101 (rückständige Tilgung) eingestellt werden. | Zielfeld wurde ermittelt. | ENDE |
| 4 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‘103‘,‘104‘)  Info: 103 = CoAktiv, 104 = SAP Mark Aktiv | Prüfung war erfolgreich. | 5 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 8 |
| 5 | Zugriff auf die Tabelle: FX\_RATE mit CURRENCY\_C is not (‘EUR‘)  Info: CURRENCY\_C = ISO-Währungs\_Code | Prüfung war erfolgreich. | 6 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 7 |
| 6 | Ermittle das Zielfeld: if XX\_CURRENCY\_C = CUR001  and CUR002 = ‘EUR’  then  NVL(XX\_AMORT\_ARR\_TA,0)\*C222  else NULL (inkl. Fehlermeldung)  Info: AMORT\_ARR\_TA = Rückstand Tilgung | Zielfeld wurde ermittelt. | ENDE |
| 7 | Ermittle das Zielfeld:  CRE101 = XX\_AMORT\_ARR\_TA | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |
| 8 | Ermittle das Zielfeld:  CRE101 = NULL | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |

## Bewirtschaftung des Feldes CRE102

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‘103‘,‘104‘)  Info: 103 = CoAktiv, 104 = SAP Mark Aktiv | Prüfung war erfolgreich. | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 5 |
| 2 | Zugriff auf die Tabelle: FX\_RATE mit CURRENCY\_C is not (‘EUR‘) | Prüfung war erfolgreich. | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 4 |
| 3 | Ermittle das Zielfeld: if XX\_CURRENCY\_C = CUR001  and CUR002 = ‘EUR’  then  (NVL(XX\_INT\_ARR\_SUM\_TA,0) + NVL(XX\_DEF\_INT\_ARR\_TOTAL\_TA,0))\*C222  else NULL (inkl. Fehlermeldung)  Info: INT\_ARR\_SUM\_TA = Zinsrückstand  DEF\_INT\_ARR\_TOTAL\_TA = Verzugszinsrückstand | Zielfeld wurde ermittelt. | ENDE |
| 4 | Ermittle das Zielfeld:  CRE102 = (NVL(XX\_INT\_ARR\_SUM\_TA,0) + NVL(XX\_DEF\_INT\_ARR\_TOTAL\_TA,0)) | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |
| 5 | Ermittle das Zielfeld:  CRE102 = NULL | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |

## Bewirtschaftung des Feldes CRE103

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Prüfe folgende Bedingung:  XX\_DELISYST in (‘103‘,‘104‘)  Info: 103 = CoAktiv, 104 = SAP Mark Aktiv | Prüfung war erfolgreich. | 2 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 5 |
| 2 | Zugriff auf die Tabelle: FX\_RATE mit CURRENCY\_C is not (‘EUR‘)  Info: CURRENCY\_C = ISO\_Währungs-Code | Prüfung war erfolgreich. | 3 |
| Prüfung war nicht erfolgreich. | 4 |
| 3 | Ermittle das Zielfeld: if XX\_CURRENCY\_C = CUR001  and CUR002 = ‘EUR’  then  NVL(XX\_EXPENSES\_DEQ\_TA,0)\*C222  else NULL (inkl. Fehlermeldung)  Info: EXPENSES\_DEQ\_TA = Gebührenrückstand | Zielfeld wurde ermittelt. | ENDE |
| 4 | Ermittle das Zielfeld:  CRE103 = XX\_EXPENSES\_DEQ\_TA | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |
| 5 | Ermittle das Zielfeld:  CRE103 = NULL | Zielfeld wurde ermittelt | ENDE |

## Zugriff auf die Tabelle XX\_LUT\_COMP\_REL

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Rang** | **Bedingung / Aktion** | **Ergebnis** | **Folgerang** |
| 1 | Zugriff auf die Referenztabelle XX\_LUT\_COMP\_REL mit den Feldern XX\_DELISYST und XX\_COMPANY\_CODE\_IND aus der XX\_C\_CONTRACT\_KG  XX\_C\_CONTRACT\_KG.XX\_DELISYST = XX\_LUT\_COMP\_REL.XX\_DELISYST  XX\_C\_CONTRACT\_KG.XX\_COMPANY\_CODE\_IND = XX\_LUT\_COMP\_REL.XX\_COMPANY\_CODE\_IND | Der Zugriff auf die Referenztabelle XX\_LUT\_COMP\_REL war erfolgreich und das Feld DELIVERY\_RELEVANT\_F hat die Ausprägung 'T'. | 2 |
| Der Zugriff auf die Referenztabelle war erfolgreich und das Feld DELIVERY\_RELEVANT\_F hat die Ausprägung 'F'. | 3 |
| Der Zugriff auf die Referenztabelle XX\_LUT\_COMP\_REL war nicht erfolgreich. | 4 |
| 2 | Der Datensatz steht zur weiteren Verarbeitung bereit. | Weiterverarbeitung des Datensatz | ENDE |
| 3 | Der Datensatz wird von der weiteren Verarbeitung ausgeschlossen. | Ausschluss des Datensatz | ENDE |
| 4 | Wird in der XX\_LUT\_COMP\_REL kein Eintrag gefunden, dann wird der Datensatz weiterverarbeitet. | Weiterverarbeitung des Datensatz | ENDE |

Tabelle 17: Details zur Einschränkung auf die relevante Grundgesamtheit bezogen auf XX\_DELISYST und XX\_COMPANY\_CODE\_IND

## Zugriff auf Referenztabelle (Look-Up) – aktuell nicht relevant, zukünftig ggfs. via decision table in A360

Dieses Kapitel stellt exemplarisch einen Zugriff auf eine Referenztabelle dar.

Input:

| **Alias / Quellfeld** | **Feld in Referenztabelle** | **Erläuterung** |
| --- | --- | --- |
| CBGLBAS\_BO.DELISYST | DELISYST | Der Zugriff erfolgt mit dem Inhalt des Feldes „Herkunftssystem“ |
| CBGLBAS\_BO.PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND | PRODUCT\_TYPE\_ORIG\_IND | Der Zugriff erfolgt mit dem Inhalt des Feldes „Produkttyp“ |

Output:

| **Ergebnis des Zugriffs** | **Verarbeitung** |
| --- | --- |
| Zugriff auf Referenztabelle war erfolgreich | Weitere Behandlung gemäß der im Kapitel 4 definierten Verarbeitungslogik. |
| Zugriff auf Referenztabelle war nicht erfolgreich | Weitere Behandlung gemäß der im Kapitel 4 definierten Verarbeitungslogik. |

Anhang

Abbildungsverzeichnis

[Tabelle 1: Deliverable Information iii](#_Toc132965571)

[Tabelle 2: Änderungsnachweis xxvi](#_Toc132965572)

[Tabelle 3: Schlüsselmapping zur Generierung von Einträgen in Tabelle POSITION xvii](#_Toc132965573)

[Tabelle 4: Übersicht der Aliasse je Laufzeitkomponente xix](#_Toc132965574)

[Tabelle 5: Übersicht der Aliase xxv](#_Toc132965575)

[Tabelle 6: Übersicht der Transformationen für Zieltabelle POSITION clxx](#_Toc132965576)

[Tabelle 7: Details der Transformation zur Ermittlung von B014 clxxiii](#_Toc132965577)

[Tabelle 8: Details der Transformation zur Ermittlung von B017 clxxv](#_Toc132965578)

[Tabelle 9: Details der Transformation zur Ermittlung von B024 clxxvi](#_Toc132965579)

[Tabelle 10:Details der Transformation zur Ermittlung von PTY002 clxxviii](#_Toc132965580)

[Tabelle 11: Details der Transformation zur Ermittlung von C215/ PTY001 für Cluster HGB clxxxiv](#_Toc132965581)

[Tabelle 12: Details der Transformation zur Ermittlung von C215/ PTY001 für Cluster IFRS cxciii](#_Toc132965582)

[Tabelle 13: Details der Transformation zur Ermittlung von C226 cxcv](#_Toc132965583)

[Tabelle 14: Details der Transformation zur Ermittlung von CRI114/CRI115 cxcix](#_Toc132965584)

[Tabelle 15: Details der Transformation zur Ermittlung von B005 cci](#_Toc132965585)

[Tabelle 16: Details der Transformation zur Ermittlung von CRI502 ccv](#_Toc132965586)