

Verbriefungspositionen

Entwurfs-Version vom Juli 2022

ID	Label	Bezeichnung	Rechtliche Hinweise und Kommentare
Zeilen			
1	Total exposures - bank acting as originator or as sponsor	Total Positionen - Bank als Originator oder als Sponsor	<p>Für die Definition des Originators oder Sponsors siehe CRE40.7</p> <p>Für die Definition oder den Umfang der aufsichtsrechtlichen Verbriefungspositionen, die in diesem Formular gemeldet werden müssen, siehe CRE40.1.</p> <p>Schweizer Banken, die Asset-Backed-Securities (ABS) emittiert haben, bei denen die Emission nicht die Kriterien für einen signifikanten Risikotransfer erfüllt (CRE40.24), melden ihre zurückbehaltenen Wertpapiere nicht in diesem Formular. Das Engagement in einem verbrieften Pool von Vermögenswerten wird in dem Formular gemeldet, die seiner aufsichtsrechtlichen Positionsklasse bzw. Meldekategorie entspricht, als ob es nicht verbrieft wäre.</p>
2	Total exposures - bank acting as investor	Total Positionen - Bank, die als Investor auftritt	<p>Schweizer Banken, die in Asset Backed Securities (ABS) investiert haben und eine oder mehrere ABS-Positionen in ihrem aufsichtsrechtlichen Bankenbuch halten (d.h. "Investoren"), müssen dieses Formular ausfüllen.</p> <p>Daher müssen alle aufsichtsrechtlichen Verbriefungspositionen (oder Wiederverbriefungspositionen), die nicht in Zeile 1 enthalten sind, in dieser Zeile gemeldet werden.</p>
1.1	Traditional securitisation	Traditionelle Verbriefung	CRE40.2
2.1	Synthetic securitisation	Synthetische Verbriefung	CRE40.3
1.1.1 1.2.1 2.1.1 2.2.1	Securitisation	Verbriefung	<p>CRE40.4 (Definition), CRE40.35 bis 40.55 und CRE40.66 (Behandlung)</p> <p>Wenn der der ABS oder der synthetischen Tranche zugrunde</p>

			liegende Pool von Vermögenswerten nach den Klassifizierungen der fortgeschrittenen Kreditrisikoansätze "gemischt" ist (d.h. der zugrunde liegende Pool umfasst sowohl Wholesale- als auch Retail-Vermögenswerte), ist die Forderung dem Bereich zuzuordnen, für den der Anteil im zugrunde liegenden Pool am grössten ist, oder im Falle von Gleichständen nach bestem Ermessen.
1.1.1.1 1.2.1.1 2.1.1.1 2.2.1.1	With retail underlying	Mit dem Einzelhandel als Basis	CRE44.18
1.1.1.2 1.2.1.2 2.1.1.2 2.2.1.2	With wholesale underlying	Mit dem zugrunde liegenden Großhandel	CRE44.18
1.1.1.1 .1 1.1.1.2 .1 2.1.1.1 .1 2.1.1.2 .1	Of which STC	Davon STC	CRE40.66 bis CRE40.71
1.1.2 1.2.2 2.1.2 2.2.2	Re-securitisation	Wiederverbriefung	CRE40.5 (Definition), CRE40–45 und insbesondere CRE40.48 und CRE41.16–19 (Behandlung)
1.1.2.1 1.2.2.1 2.1.2.1 2.2.2.1	Senior	Vorrangig	CRE40.18
1.1.2.2 1.2.2.2 2.1.2.2 2.2.2.2	Non-senior	Nicht vorrangig	Alle anderen Forderungen, die nicht vorrangig im Sinne von CRE40.18 sind
Spalten			
01-05	Exposure values (by RW bands)	Positionen (nach RW-Bändern)	Aufschlüsselung der Positionen nach Bandbreiten des Risikogewichts im entsprechenden aufsichtsrechtlichen Ansatz

06-09	Exposure values (by regulatory approach)	Positionen (nach Regulierungsansatz)	Aufschlüsselung der Positionen nach dem aufsichtsrechtlichen Ansatz, nach dem die Eigenmittelanforderungen berechnet werden CRE40.41 bis 40.48
10-13	RWA (by regulatory approach)	RWA (nach aufsichtsrechtlichem Ansatz)	Aufschlüsselung der nach Risiko gewichteten Positionen (RWA) nach aufsichtsrechtlichem Ansatz CRE40.41 bis 40.48 Diese Beträge sind <i>vor der</i> Berücksichtigung von Obergrenzen für die Mindesteigenmittelanforderungen zu melden.
14-17	Minimum capital requirements after cap	Mindestkapitalanforderungen nach Obergrenze	Aufschlüsselung der Eigenmittelanforderungen <i>nach</i> Obergrenze nach aufsichtsrechtlichem Ansatz. (Hinweis: Dieser Betrag wird dann in RWA umgerechnet und im RWA-Meldeformular CASIBISIRB_RWA verwendet). CRE40.50 bis 40.55
06 10 14	SEC-IRBA	SEC-IRBA	ERV Art. 59b Abs. 2 Bst. b CRE44
07 11 15	SEC-ERBA (including IAA)	SEC-ERBA (inklusive IAA)	ERV Art. 59b Abs. 2 Bst. c und d CRE42 und CRE43
08 12 16	SEC-SA	SEC-SA	ERV Art. 59b Abs. 2 Bst. a CRE41
09 13 17	1250% RW	1250% RW	ERV Art. 59b Abs. 3 CRE40.41