

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2015/3 DER KOMMISSION**vom 30. September 2014****zur Ergänzung der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf technische Regulierungsstandards für die Offenlegungspflichten bei strukturierten Finanzinstrumenten****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. September 2009 über Ratingagenturen ⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 8b Absatz 3 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Gemäß Artikel 8b der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 sollten Investoren ausreichende Informationen über die Kreditqualität und Wertentwicklung der zugrunde liegenden Werte erhalten, um ihnen zu ermöglichen, eine fundierte Bewertung der Bonität der strukturierten Finanzinstrumente durchzuführen. Dies würde auch die Abhängigkeit der Investoren von Bonitätsbewertungen verringern und sollte die Abgabe nicht angeforderter Ratings erleichtern.
- (2) Die vorliegende Verordnung soll für alle Finanzinstrumente oder anderen Vermögenswerte gelten, die aus einer in Artikel 4 Absatz 61 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽²⁾ genannten Verbriefungstransaktion oder -struktur hervorgehen, sofern der Emittent, Originator oder Sponsor seine Niederlassung und, für diese Zwecke, seinen satzungsmäßigen Sitz in der Europäischen Union hat. Daher sollte die vorliegende Verordnung ausschließlich Finanzinstrumente oder andere Vermögenswerte aus Transaktionen oder Strukturen abdecken, bei denen das mit einer Risikoposition oder einem Pool von Risikopositionen verbundene Kreditrisiko in Tranchen unterteilt wird und die die in diesem Artikel genannten Merkmale besitzen. Daher sollte, im Einklang mit der genannten Verordnung, eine Risikoposition, die für ein Geschäft oder eine Struktur eine direkte Zahlungsverpflichtung aus der Finanzierung oder dem Betrieb von Sachanlagen schafft, nicht als Risikoposition in einer Verbriefung gelten, selbst wenn die Zahlungsverpflichtungen aufgrund des Geschäfts oder der Struktur unterschiedlichen Rang haben.
- (3) Der Anwendungsbereich der vorliegenden Verordnung sollte nicht auf die Emission strukturierter Finanzinstrumente beschränkt sein, die als Sicherheiten gelten, sondern auch andere Finanzinstrumente und Vermögenswerte einschließen, die aus einer Verbriefungstransaktion oder -struktur hervorgehen, wie Finanzmarktinstrumente sowie besicherte Geldmarktpapier-Programme. Des Weiteren sollte diese Verordnung für strukturierte Finanzinstrumente mit und ohne Bonitätsbewertungen von in der EU registrierten Ratingagenturen gelten. Auch private und bilaterale Transaktionen sowie Transaktionen, die nicht öffentlich angeboten oder zum Handel an einem geregelten Markt zugelassen werden, sollten im Anwendungsbereich dieser Verordnung liegen.
- (4) Die vorliegende Verordnung enthält einheitliche Meldebögen für mehrere Kategorien von Anlageklassen. Unbeschadet des Anwendungsbereichs der vorliegenden Verordnung und bis die Meldepflichten von der ESMA entwickelt und von der Kommission angenommen wurden, sollten diese einheitlichen Meldebögen und sämtliche Meldepflichten gemäß dieser Verordnung nur für strukturierte Finanzinstrumente gelten, denen Vermögenswerte zugrunde liegen, die in der in dieser Verordnung festgelegten Liste der zugrunde liegenden Vermögenswertekategorien enthalten sind und die darüber hinaus nicht privater oder bilateraler Art sind.
- (5) Bei der Erfüllung dieser Verordnung sollten die Emittenten, Originatoren und Sponsoren die nationale und EU-Gesetzgebung einhalten, die den Schutz der Vertraulichkeit von Informationsquellen oder die Verarbeitung personenbezogener Daten regelt, um mögliche Verstöße gegen diese Gesetzgebung zu verhindern.

⁽¹⁾ ABl. L 302 vom 17.11.2009, S. 1.

⁽²⁾ Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (AbL. L 176 vom 27.6.2013, S. 1).

- (6) Emittent, Originator und Sponsor können eine Stelle benennen, die für die Meldung der gemäß dieser Verordnung erforderlichen Daten für die von der ESMA gemäß Artikel 8b Absatz 4 der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 einzurichtende Website („die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten“) verantwortlich ist. Es sollte auch möglich sein, die Meldepflicht an ein anderes Unternehmen, z. B. einen Servicer, auszulagern. Die Verantwortung von Emittent, Originator oder Sponsor im Rahmen dieser Verordnung sollte davon unberührt bleiben.
- (7) Eine Reihe technischer Anweisungen für die Meldung, u. a. solche, die die Übermittlung oder das Format der von den Emittenten, Originatoren oder Sponsoren zu übermittelnden Dateien betreffen, sollten von der ESMA auf ihrer Website mitgeteilt werden. Die ESMA sollte diese technischen Anweisungen zur Meldung zu gegebener Zeit vor dem in dieser Verordnung festgelegten Datum der Anwendung der Meldepflicht bekannt geben, um Emittenten, Originatoren, Sponsoren und anderen beteiligten Parteien ausreichend Zeit für die Entwicklung angemessener Systeme und Verfahren entsprechend den von der ESMA bereitgestellten technischen Anweisungen zu geben.
- (8) Die gemäß der vorliegenden Verordnung bereitzustellenden Informationen sollten in einem einheitlichen Format zusammengestellt werden, um die automatische Verarbeitung auf der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten zu ermöglichen. Die Informationen sollten weiterhin in einem Format veröffentlicht werden, das für jeden Nutzer der Webseite zu den strukturierten Finanzinstrumenten leicht zugänglich ist. Die ESMA sollte sicherstellen, dass die sektoralen zuständigen Behörden Zugang zur Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten haben, um die ihnen gemäß Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 übertragenen Aufgaben wahrnehmen zu können.
- (9) Diese Verordnung basiert auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der ESMA gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ unterbreitet wurde.
- (10) Die ESMA führte eine öffentliche Anhörung zu den Entwürfen der technischen Regulierungsstandards, auf denen die vorliegende Verordnung basiert, durch, analysierte die potenziell damit verbundenen Kosten und Nutzen und holte die Stellungnahme der gemäß Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte ein.
- (11) Um den Emittenten, Originatoren und Sponsoren eines strukturierten Finanzinstruments mit Sitz in der EU zu ermöglichen, sich vorzubereiten und die notwendigen Schritte zur Einhaltung der vorliegenden Verordnung zu ergreifen, und um der ESMA die Möglichkeit zur Entwicklung der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten, auf der die in der vorliegenden Verordnung vorgeschriebenen Informationen offenzulegen sind, zu geben, ist ein angemessener Zeitrahmen erforderlich. Daher sollte die vorliegende Verordnung ab dem 1. Januar 2017 gelten. Die ESMA sollte jedoch die notwendigen technischen Anweisungen für die Meldung rechtzeitig vor dem Datum der Anwendung dieser Verordnung bekannt geben. Dies ist erforderlich, um den Emittenten, Originatoren und Sponsoren eines strukturierten Finanzinstruments mit Sitz in der EU ausreichend Zeit für die Entwicklung angemessener Systeme und Verfahren gemäß diesen technischen Anweisungen zu geben, die eine vollständige und richtige Meldung gewährleisten, sowie um weitere Entwicklungen auf dem Finanzmarkt der Europäischen Union zu berücksichtigen —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Geltungsbereich

Diese Verordnung gilt für strukturierte Finanzinstrumente, deren Emittenten, Originatoren oder Sponsoren ihren Sitz in der EU haben und die nach dem Datum des Inkrafttretens dieser Verordnung ausgegeben werden.

Artikel 2

Meldende Stelle

(1) Der Emittent, Originator oder Sponsor eines strukturierten Finanzinstruments kann ein oder mehrere meldende Stellen benennen, die die gemäß den Artikeln 3 und 4 sowie die gemäß Artikel 5 Absatz 3 dieser Verordnung erforderlichen Informationen auf der in Artikel 8b Absatz 4 der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 genannten Website („Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten“) veröffentlichen. Diese Stellen veröffentlichen die erforderlichen Informationen auf der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten gemäß den Artikeln 4 bis 7 der vorliegenden Verordnung.

⁽¹⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

(2) Der Emittent, Originator oder Sponsor eines strukturierten Finanzinstruments, der eine oder mehrere in Absatz 1 genannte Stellen benannt hat, unterrichtet die ESMA gemäß diesem Absatz unverzüglich über jede benannte Stelle. Die Benennung berührt nicht die Verpflichtung des Emittenten, Originators und Sponsors zur Einhaltung von Artikel 8b der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009.

Artikel 3

Zu übermittelnde Informationen

Liegt einem strukturierten Finanzinstrument ein in Artikel 4 genannter Vermögenswert zugrunde, so übermittelt die meldende Stelle folgende Informationen an die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten:

- a) Informationen zur Einzelkreditebene mithilfe der in den Anhängen I bis VII enthaltenen einheitlichen Meldebögen;
- b) sofern für ein strukturiertes Finanzinstrument zutreffend, folgende Dokumente, einschließlich einer genauen Beschreibung der Zahlungswasserfälle des strukturierten Finanzinstruments:
 - i) endgültige Angebotsunterlage oder Prospekt zusammen mit den abschließenden Transaktionsdokumenten, einschließlich aller öffentlichen Dokumente, auf die im Prospekt Bezug genommen wird oder die die Arbeitsweise der Transaktion regeln, ohne Rechtsgutachten;
 - ii) Anlagenkaufvertrag, Übernahme-, Novations- oder Übertragungsvereinbarung und jedwede einschlägige Treuhanderklärung;
 - iii) Verträge über Servicing, Backup-Servicing, Verwaltung und Verwaltung von Zahlungsflüssen;
 - iv) Treuhandurkunde, Sicherheitenurkunde, Handelsvertretervereinbarung, Bankkontovertrag, garantierter Beteiligungsvertrag, Vertrag bezüglich der Bedingungen oder des Mastertrustrahmens oder der Verwendung von Definitionen;
 - v) jede einschlägige Gläubigervereinbarung, Dokumentation der Swaps, untergeordnete Kreditverträge, Kreditverträge mit Start-Ups und Liquiditätsfazilitätsverträge;
 - vi) jedwede weitere zugehörige Dokumentation, die zum Verständnis der Transaktion wesentlich ist;
- c) sofern ein Prospekt nicht in Übereinstimmung mit der Richtlinie 2003/71/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽¹⁾ erstellt wurde, eine Zusammenfassung der Transaktion oder ein Überblick über die wichtigsten Eigenschaften des strukturierten Finanzinstruments, einschließlich
 - i) der Struktur der Transaktion;
 - ii) der Eigenschaften der Vermögenswerte, Cash-Flows, Bonitätsverbesserung und liquiditätsunterstützenden Merkmale;
 - iii) der Stimmrechte der Investoren, der Beziehung zwischen den Investoren und anderen Gläubigern gesicherter Risikopositionen in einer Transaktion;
 - iv) einer Liste aller Trigger und Vorkommnisse, auf die in den Dokumenten, die gemäß Buchstabe b der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten übermittelt werden, Bezug genommen wird und die eine erhebliche Auswirkung auf die Wertentwicklung des strukturierten Finanzinstruments haben könnten;
 - v) der Strukturdiagramme mit einem Überblick über die Transaktionen, Cash-Flows und Eigentumsverhältnisse;
- d) Investorenberichte mit den in Anhang VIII enthaltenen Informationen.

Artikel 4

Zugrunde liegende Vermögenswerte

Die in Artikel 3 genannten Anforderungen zu den Informationen gelten für strukturierte Finanzinstrumente, denen folgende Vermögenswerte zugrunde liegen

- a) private Hypothekendarlehen: diese Klasse der strukturierten Finanzinstrumente schließt durch als erstklassig eingestufte und nicht als erstklassig eingestufte Hypothekendarlehen sowie durch Wohnbaukredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente ein. Bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang I enthaltenen Informationen zu übermitteln;

⁽¹⁾ Richtlinie 2003/71/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. November 2003 betreffend den Prospekt, der beim öffentlichen Angebot von Wertpapieren oder bei deren Zulassung zum Handel zu veröffentlichen ist, und zur Änderung der Richtlinie 2001/34/EG (ABl. L 345 vom 31.12.2003, S. 64).

- b) gewerbliche Hypothekendarlehen: diese Klasse der strukturierten Finanzinstrumente schließt durch Kleindarlehen oder Darlehen für Büroimmobilien, für Krankenhäuser, Pflegeheime, Lagerräume, Hotels, Betreuungseinrichtungen, Firmenkredite und Darlehen für Mehrfamilienhäuser besicherte strukturierte Finanzinstrumente ein. Bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang II enthaltenen Informationen zu übermitteln;
- c) Darlehen an kleine und mittlere Unternehmen: bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang III enthaltenen Informationen zu übermitteln;
- d) Kfz-Darlehen: bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang IV enthaltenen Informationen zu übermitteln;
- e) Kundendarlehen: bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang V enthaltenen Informationen zu übermitteln;
- f) Kreditkartendarlehen: bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang VI enthaltenen Informationen zu übermitteln;
- g) Leasing an Einzelpersonen und/oder Unternehmen: bei dieser Klasse der strukturierten Finanzinstrumente sind für die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten die im Meldebogen in Anhang VII enthaltenen Informationen zu übermitteln.

Artikel 5

Häufigkeit der Meldungen

- (1) Die in Artikel 3 Buchstaben a und d genannten Informationen werden vierteljährlich, nicht später als einen Monat nach dem Fälligkeitsdatum der Zinszahlung des betreffenden strukturierten Finanzinstruments verfügbar gemacht.
- (2) Die in Artikel 3 Buchstaben b und c genannten Informationen werden unverzüglich nach der Ausgabe eines strukturierten Finanzinstruments verfügbar gemacht.
- (3) Zusätzlich zu den in Absätzen 1 und 2 genannten Anforderungen veröffentlicht,
 - a) sofern die in Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽¹⁾ über Insidergeschäfte und Marktmissbrauch bestimmten Bedingungen auch in Bezug auf ein strukturiertes Finanzinstrument gelten, die meldende Stelle jede Offenlegung von Informationen gemäß diesem Artikel ebenfalls unverzüglich auf der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten;
 - b) sofern Buchstabe a nicht zutrifft, die meldende Stelle jegliche maßgebliche Änderung oder Vorkommnisse unverzüglich auf der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten betreffend
 - i) eine Verletzung der Verpflichtungen, die in den gemäß Artikel 3 Buchstabe b bereitgestellten Dokumenten festgelegt sind;
 - ii) strukturelle Merkmale, die erhebliche Auswirkungen auf die Wertentwicklung des strukturierten Finanzinstruments haben können;
 - iii) Risikomerkmale des strukturierten Finanzinstruments und der zugrunde liegenden Vermögenswerte.

Artikel 6

Meldeverfahren

- (1) Die meldende Stelle übermittelt die Dateien gemäß dem Übermittlungssystem der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten und den von der ESMA auf ihrer Website bereitgestellten technischen Anweisungen.

⁽¹⁾ Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. April 2014 über Marktmissbrauch (Marktmissbrauchsverordnung) und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/6/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und der Richtlinien 2003/124/EG, 2003/125/EG und 2004/72/EG der Kommission (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 1).

- (2) Die ESMA veröffentlicht diese technischen Anweisungen bis spätestens 1. Juli 2016.
- (3) Die meldende Stelle speichert die Dateien, die an die Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten übermittelt und von dieser empfangen wurden, für einen Zeitraum von mindestens fünf Jahren in elektronischer Form. Diese Dateien werden den in Artikel 3 Absatz 1 Buchstabe r der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 genannten sektoralen zuständigen Behörden nach Aufforderung von der meldenden Stelle, vom Emittenten, Originator oder Sponsor bereitgestellt.
- (4) Stellt die meldende Stelle oder der Emittent, der Originator oder der Sponsor faktische Fehler in den der Website zu den strukturierten Finanzinstrumenten zur Verfügung gestellten Daten fest, korrigiert sie/er die entsprechenden Daten unverzüglich.

Artikel 7

Meldungen im Zeitraum zwischen Inkrafttreten und Anwendung

- (1) In Bezug auf die strukturierten Finanzinstrumente, die im Zeitraum zwischen dem Inkrafttreten und dem Datum der Anwendung der vorliegenden Verordnung ausgegeben werden, erfüllen der Emittent, Originator und Sponsor die in dieser Verordnung festgelegten Meldepflichten nur hinsichtlich derjenigen strukturierten Finanzinstrumente, die zum Zeitpunkt der Anwendung der Verordnung noch ausstehen.
- (2) Emittent, Originator und Sponsor sind nicht verpflichtet, die gemäß dieser Verordnung erforderlichen Informationen zwischen dem Datum des Inkrafttretens und der Anwendung dieser Verordnung aufzubewahren.

Artikel 8

Inkrafttreten

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Sie gilt ab dem 1. Januar 2017.

Artikel 6 Absatz 2 gilt jedoch ab dem Datum des Inkrafttretens dieser Verordnung.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 30. September 2014

Für die Kommission
Der Präsident
José Manuel BARROSO

ANHANG I

Meldebogen für durch Hypothekenkredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

VERMÖGENSWERTE

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	Datum	Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios. Alle Daten entsprechen dem Format JJJJ-MM-TT.
Pool-Kennung	Statisch	Text/ Nume- risch	Kennung des Pools oder Portfolios/Name der Transaktion
Kreditkennung	Statisch	Text/ Nume- risch	Eindeutige Kennung für jeden Kredit. Die Kreditkennung sollte sich während der Laufzeit der Transaktion nicht ändern.
Originator	Statisch	Text	Kreditgeber, der den ursprünglichen Kredit vergeben hat
Servicer-Kennung	Statisch	Text/Nu- merisch	Eindeutige Kennung pro Servicer, um anzugeben, welches Unternehmen den Kredit verwaltet
Kreditnehmerkennung	Statisch	Text/Nu- merisch	Eindeutige Kennung je Kreditnehmer (nicht Angabe des wirklichen Namens), sodass Kreditnehmer mit mehreren Krediten im Pool bestimmt werden können (z. B. weitere Kreditvergaben/zweitrangige Kredite werden als separate Einträge gezeigt). Die Kreditnehmerkennung sollte sich während der Laufzeit der Transaktion nicht ändern.
Immobilienkennung	Statisch	Text/Nu- merisch	Eindeutige Kennung je Immobilie, sodass Immobilien mit mehreren Krediten in dem Pool angegeben werden können (z. B. weitere Kreditvergaben/zweitrangige Kredite werden als separate Einträge gezeigt).

Angaben zum Kreditnehmer

Beschäftigungsstatus des Kreditnehmers	Statisch	Liste	Beschäftigungsstatus des primären Antragsteller.
Primäreinkommen	Statisch	Nume- risch	Übernommenes jährliches Brutto-Primäreinkommen des Kreditnehmers (ohne Miete)
Einkommensüberprüfung für Primäreinkommen	Statisch	Liste	Einkommensüberprüfung für Primäreinkommen

Eigenschaften des Kredits

Kreditvergabedatum	Statisch	Datum/ Nume- risch	Datum der ursprünglichen Kreditvergabe
Kreditfälligkeit	Dynamisch	Datum/ Nume- risch	Fälligkeitsdatum des Kredits
Zweck	Statisch	Liste	Zweck des Kredits.
Kreditlaufzeit	Statisch	Nume- risch	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate)
Währungsfestlegung des Kredits	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits
Ursprünglicher Saldo	Statisch	Nume- risch	Ursprünglicher Kreditsaldo (einschließlich Gebühren)

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktueller Saldo	Dynamisch	Numerisch	Kreditbetrag zum Cut-Off-Datum des Pools. Dies sollte sämtliche Beträge einschließen, die durch die Hypothek besichert und in der Transaktion als Kapital eingestuft sind.
Rückzahlungsmethode	Statisch	Liste	Art der Kapitalrückzahlung
Zahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der fälligen Zahlungen, d. h. Anzahl der Monate zwischen Zahlungen
Zahlungsfälligkeit	Dynamisch	Numerisch	Periodische vertragliche Zahlungsfälligkeit (Zahlungsfälligkeit, sofern keine anderen Zahlungsvereinbarungen gelten)
Zahlungsart	Statisch	Liste	Art der Kapitalzahlung

Zinssatz

Zinssatzart	Statisch	Liste	Art des Zinssatzes
Aktueller Zinsindex	Dynamisch	Liste	Aktueller Zinsindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Kreditzinssatz festgelegt wird)
Aktueller Zinssatz	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Zinssatz (%)
Aktuelle Zinsmarge	Dynamisch	Numerisch	Aktuelle Zinsmarge (bei fest verzinslichen Krediten entspricht dies dem aktuellen Zinssatz, bei variabel verzinslichen Krediten entspricht dies der Marge über dem Indexsatz (oder darunter, sofern als negativ eingetragen).
Zinssatzanpassungsintervall	Dynamisch	Numerisch	Intervall in Monaten für die Anpassung des Zinssatzes (bei variabel verzinslichen Krediten)
Revisionsmarge 1	Dynamisch	Numerisch	Marge (%) für den Kredit am ersten Revisionsdatum
Zinsrevisionsdatum 1	Dynamisch	Datum/ Numerisch	Datum der nächsten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte Kredite usw., dies ist nicht das nächste LIBOR-Anpassungsdatum).
Revisionsmarge 2	Dynamisch	Numerisch	Marge (%) für den Kredit am zweiten Revisionsdatum
Zinsrevisionsdatum 2	Dynamisch	Datum/ Numerisch	Datum der zweiten Zinssatzänderung
Revisionsmarge 3	Dynamisch	Numerisch	Marge (%) für den Kredit am dritten Revisionsdatum
Zinsrevisionsdatum 3	Dynamisch	Datum/ Numerisch	Datum der dritten Zinssatzänderung
Revidierter Zinsindex	Dynamisch	Liste	Nächster Zinsindex

Immobilie und zusätzliche Sicherheit

Postleitzahl der Immobilie	Statisch	Text/ Numerisch	Es müssen mindestens die ersten zwei oder drei Zeichen eingegeben werden.
Immobilienart	Statisch	Liste	Art der Immobilie

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Ursprüngliche Beleihung	Statisch	Numerisch	Ursprüngliche übernommene Beleihungsquote des Originators. Bei zweitrangigen Krediten ist dies zusammenzurechnen oder Gesamtbeleihungsquote.
Bewertungsbetrag	Statisch	Numerisch	Immobilienwert zum Datum der letzten Kreditvergabe vor einer Verbriefung. Bewertungsbeträge sind in derselben Währung wie der Kredit anzugeben.
Ursprünglicher Bewertungstyp	Statisch	Liste	Bewertungstyp bei Vergabe
Bewertungsdatum	Statisch	Datum/ Numerisch	Datum der letzten Immobilienbewertung zum Zeitpunkt der letzten Kreditvergabe vor einer Verbriefung
Aktuelle Beleihung	Dynamisch	Numerisch	Aktuelle Beleihungsquote des Originators. Bei zweitrangigen Krediten ist dies zusammenzurechnen oder Gesamtbeleihungsquote.
Aktueller Bewertungsbetrag	Dynamisch	Numerisch	Letzter Bewertungsbetrag (wenn es beispielsweise bei einer Pfändung mehrere Bewertungen gab, sollte dies der niedrigste Betrag sein). Bewertungsbeträge sind in derselben Währung wie der Kredit anzugeben.
Aktuelle Bewertungsart	Dynamisch	Liste	Aktuelle Art der Bewertung
Aktuelles Bewertungsdatum	Dynamisch	Datum/ Numerisch	Datum der letzten Bewertung

Angaben zur Performance

Kontostatus	Dynamisch	Liste	Aktueller Status des Kontos
Rückstandssaldo	Dynamisch	Numerisch	Aktuelles Saldo der Rückstände. Rückstände definiert als: Summe der bis dato fälligen Zahlungen MINUS Summe der bis dato eingegangenen Zahlungen MINUS kapitalisierte Beträge. Dies sollte keine für das Konto geltenden Gebühren einschließen.
Rückstand in Monaten	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Monate, mit denen dieser Kredit im Rückstand ist (zum Cut-Off-Datum des Pools) gemäß Festlegung des Emittenten
Rückstände vor 1 Monat	Dynamisch	Numerisch	Rückstandssaldo (definiert gemäß „Rückstandssaldo“) für den Vormonat
Rückstände vor 2 Monaten	Dynamisch	Numerisch	Rückstandssaldo (definiert gemäß „Rückstandssaldo“) vor zwei Monaten
Rechtsstreit	Dynamisch	Y/N	Markierung zur Angabe, dass ein Gerichtsverfahren anhängig ist
Tilgungsdatum	Dynamisch	Datum/ Numerisch	Datum, an dem das Konto getilgt wurde
Ausfall oder Zwangsvollstreckung	Dynamisch	Numerisch	Gesamtausfallbetrag vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen
Ausfall- oder Zwangsvollstreckungsdatum	Dynamisch	Numerisch	Datum des Ausfalls oder der Zwangsvollstreckung
Veräußerungspreis Untergrenze	Dynamisch	Numerisch	Preis, der bei der Veräußerung der Immobilie im Falle einer Zwangsvollstreckung erzielt wurde, abgerundet auf die nächsten 10T

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Veräußerungsverlust	Dynamisch	Numerisch	Gesamtverlust ohne Gebühren, angefallene Zinsen usw. nach Anwendung der Veräußerungserlöse (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet)
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	Numerisch	Kumulierte Rückflüsse — nur bei Fällen mit Verlusten relevant

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Felder bei Daten auf Wertpapier- oder Anleiheebene			
Berichtsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem Transaktionsbericht ausgegeben wurde. Alle Daten entsprechen dem Format JJJJ-MM-TT
Emittent	Statisch	Text	Name des Emittenten und Emissionsserie, falls zutreffend
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Bestätigung, ob in der Periode, die am letzten Zinszahlungsdatum endet, eine Ziehung unter der Liquiditätsfazilität stattgefunden hat oder nicht

Felder bei Daten auf Sicherheitsebene

Trigger-Bewertungen/Quoten	Dynamisch	Y/N	Status von verschiedenen Verzugs-, Verwässerungs-, Ausfall-, Verlust- und vergleichbaren sicherheitsbezogenen Bewertungen und Quoten in Verbindung mit der vorzeitigen Tilgung oder anderen Trigger-Ereignissen zum aktuellen Feststellungsdatum. Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten?
Durchschnittliche konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	Dynamisch	Numerisch	<p>Die Meldung enthält die durchschnittliche konstante vorzeitige Rückzahlungsquote (Constant Pre-payment Rate, CPR) der zugrunde liegenden Hypothekenkredite. In einigen Rechtssystemen kann der Hypothekenspool auch kommerzielle Kredite enthalten. Die durchschnittliche CPR entspricht dem Betrag, der als annualisierter Prozentsatz des Kapitals, das über die planmäßigen Rückzahlungen hinaus vorzeitig zurückgezahlt wurde, ausgedrückt wird. Die durchschnittliche CPR wird durch Division des aktuellen Restsaldos des Hypothekenkredits (d. h. des tatsächlichen Saldos) durch den planmäßigen Restsaldo des Hypothekenkredits unter der Annahme, dass keine vorzeitigen Rückzahlungen (d.h. nur planmäßige Rückzahlungen) geleistet wurden, berechnet. Dieser Quotient wird dann potenziert, wobei der Exponent der Zahl 12 dividiert durch die Anzahl der Monate seit Emission entspricht. Dieses Ergebnis wird dann von 1 abgezogen und mit Hundert (100) multipliziert, um die durchschnittliche CPR zu bestimmen. Diese Rechnung wird wie folgt ausgedrückt:</p> $\text{Durchschnittliche CPR} = 100 \left(1 - \left(\left(\frac{\text{Aktueller Restsaldo des Hypothekenkredits}}{\text{Planmäßiger Restsaldo des Hypothekenkredits}} \right)^{\frac{12}{\text{Monate seit Emission}}} \right) \right)$

Kontaktinformationen für Transaktionsberichte

Kontakt	Statisch	Text	Name der Abteilung oder der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Felder auf Tranchenebene			
Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von RMBS mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Internationale Wertpapierkennnummer oder -nummern oder, falls keine ISIN, eine andere eindeutige Wertpapiernummer wie beispielsweise CUSIP, die dieser Tranche durch eine Börse oder ein sonstiges Unternehmen zugewiesen wurde. Im Falle mehrerer Nummern sind diese durch Kommata zu trennen.
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Periodisches Datum, an dem eine Zinszahlung an Inhaber einer bestimmten Tranche eines durch Hypothekenkredite besicherten strukturierten Finanzinstruments planmäßig erfolgt
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Periodisches Datum, an dem eine Kapitalzahlung an Inhaber einer bestimmten Tranche eines durch Hypothekenkredite besicherten strukturierten Finanzinstruments planmäßig erfolgt
Währung	Statisch	Text	Tauscheinheit(en), in denen die Salden und Zahlungen auf Wertpapiererebene gemeldet werden
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen (z. B. Euribor 3 Monate), der für eine bestimmte Tranche eines durch Hypothekenkredite besicherten strukturierten Finanzinstruments gilt
Anleiheemissionsdatum	Statisch	Datum	Datum, an dem die Anleihen ausgegeben wurden

ANHANG II

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch kommerzielle Kredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

KREDIT

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Kreditkennungen			
Transaktionspool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutiger Name der Transaktion oder des Geschäfts
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	Datum	Aktuelles Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios
Verbriefungsdatum	Statisch	Datum	Emissionsdatum der Transaktion — Datum der ersten Börsennotierung der Anleihe
Ursprüngliche Kreditbedingungen			
Gruppenkennung	Statisch	Text/Numerisch	Alphanumerischer Code, der jeder Kreditgruppe innerhalb einer Emission zugewiesen wird
Kredit-Servicer-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung des Kredit-Servicers, die dem Kredit zugewiesen wurde
Prospektkennung für Kredit	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung des Prospekts oder eindeutiger Name der Transaktion, die dem Kredit innerhalb der Transaktion oder dem Pool zugewiesen wurde
Kreditsponsor	Statisch	Text/Numerisch	Sponsor für den Kredit
Kreditvergabedatum	Statisch	Datum	Datum der ursprünglichen Kreditvergabe
Kreditwährung	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits
Kreditgesamtsaldo am Vergabedatum	Statisch	Numerisch	Kreditgesamtsaldo bei Vergabe, der 100 % der vollständigen Fazilität entspricht, d. h. besicherter und unbesicherter/bessener und nicht besserer Betrag (in Kreditwährung)
Ursprüngliche Kreditlaufzeit	Statisch	Numerisch	Vertragliche Laufzeit (in Monaten) am Vergabedatum
Tilgungsbeginn	Statisch	Datum	Datum, an dem die Tilgung des Gesamtkredits beginnt (dies kann ein Datum vor dem Verbriefungsdatum sein)
Zinsindexkennung	Statisch	Liste	Aktueller Zinsindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Kreditzinssatz festgelegt wird)
Ursprünglicher Kreditzinssatz	Statisch	Numerisch	Gesamtzinssatz des Kredits am Vergabedatum. Im Falle mehrerer Tranchen mit unterschiedlichen Zinssätzen ist ein gewichteter Durchschnittssatz anzuwenden.
Erste Zinszahlungsfälligkeit	Statisch	Datum	Datum, an dem die erste Zinszahlung auf den Kredit nach dem Vergabedatum fällig war
Kreditland	Statisch	Liste	Land des Kredits
Kreditzweck	Statisch	Liste	Zweck des Kredits
Hypothekarische Sicherheit	Statisch	Y/N	Ist der Kredit durch Hypotheken auf die Immobilien besichert?

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Kreditstatistik am Verbriefungsdatum			
Schuldendeckungsquote für den (Gesamt-)kredit am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Schuldendeckungsquote für den (Gesamt-)kredit am Verbriefungsdatum
Beleihungsquote für den (Gesamt-)kredit am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Beleihungsquote für den (Gesamt-)kredit am Verbriefungsdatum
Zinsdeckungsquote (A-Kredit) am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Zinsdeckungsquote für den A-Kredit am Verbriefungsdatum basierend auf den Angebotsunterlagen
Schuldendeckungsquote (A-Kredit) am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Berechnung der Schuldendeckungsquote für den A-Kredit am Verbriefungsdatum basierend auf den Angebotsunterlagen
Beleihungsquote (A-Kredit) am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Beleihungsquote für den A-Kredit am Verbriefungsdatum basierend auf den Angebotsunterlagen
Zugesicherter Kreditbetrag am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Zugesicherter Betrag, einschließlich ungenutzter Beträge, des Gesamtkredits am Verbriefungsdatum
Tatsächlicher Kreditsaldo am Verbriefungsdatum (Gesamtkredit)	Statisch	Numerisch	Tatsächlicher Kreditsaldo des Gesamtkredits am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt angegeben
Periodische Kapital- und Zinszahlung am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Planmäßiger Kapital- und Zinsbetrag, der bei der nächsten Kreditfälligkeit fällig ist, zum Verbriefungsdatum
Kreditzins am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Gesamtzinssatz (z. B. LIBOR und Marge), der zur Berechnung der auf den Kredit fälligen Zinsen verwendet wird, am Verbriefungsdatum
Rangigkeit der Belastung am Verbriefungsdatum	Statisch	Liste	Wird die Sicherheit zur Besicherung einer erst-rangigen Sicherheit gewährt?
Restlaufzeit am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Verbleibende Anzahl von Monaten (ausgenommen Verlängerungsoptionen) bis zur Fälligkeit des Kredits am Verbriefungsdatum
Verbleibende Tilgungsfrist am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Anzahl der bis zur Fälligkeit des Kredits verbleibenden Monate der Tilgungsfrist. Wenn die Tilgung am Verbriefungsdatum noch nicht begonnen hat, ist dies kürzer als die Restlaufzeit am Verbriefungsdatum.
Kreditfälligkeit am Verbriefungsdatum	Statisch	Datum	Fälligkeitsdatum des Kredits wie im Kreditvertrag festgelegt. Hierbei wird nicht eine etwaige verlängerte Fälligkeit, die gemäß Kreditvertrag gewährt wird, sondern die anfängliche Fälligkeit in Betracht gezogen.
Tatsächlicher Kreditsaldo am Verbriefungsdatum (A-Kredit)	Statisch	Numerisch	Tatsächlicher Kreditsaldo des A-Kredits am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt angegeben
Verlängerungsoption	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob die Kreditfrist verlängert und das Fälligkeitsdatum nach hinten verschoben werden kann

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Dauer der kürzesten Verlängerungsoption	Statisch	Numerisch	Dauer in Monaten der kürzesten Verlängerungsoption, die bei dem Kredit zur Verfügung steht
Art der Verlängerungsoption	Statisch	Liste	Art der Verlängerungsoption
Angaben zur Sicherheit			
Anzahl der Immobilien am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Anzahl der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, am Verbriefungsdatum
Anzahl der Immobilien am Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, am Cut-Off-Datum des Pools
Immobilien zur Besicherung des Kredits bei Verbriefung	Statisch	Text/Numerisch	Angabe der eindeutigen Immobilienkennungen (PC1) der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, am Verbriefungsdatum
Immobilien zur Besicherung des Kredits am Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	Text/Numerisch	Angabe der eindeutigen Immobilienkennungen (PC1) der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, am Cut-Off-Datum des Pool
Angaben zu Kreditkennzahlen			
Methode für Zinsdeckungsquote (Gesamtkredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnung der erforderlichen Finanzkennzahl „Zinsdeckungsquote“ (ICR) bezogen auf den Gesamtkredit, d. h. der abgeleiteten Berechnungsmethode
Methode für Schuldendeckungsquote (Gesamtkredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnung der erforderlichen Finanzkennzahl „Schuldendeckungsquote“ (DSCR) bezogen auf den Gesamtkredit, d. h. der abgeleiteten Berechnungsmethode
Methode für Beleihungsquote (Gesamtkredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnung der erforderlichen Finanzkennzahl „Beleihungsquote“ bezogen auf den Gesamtkredit, d. h. der abgeleiteten Berechnungsmethode
Sonstige Finanzkennzahl (Gesamtkredit)	Statisch	Liste	Wenn eine sonstige Kennzahl für die erforderliche Finanzkennzahl „Zinsdeckungsquote“ oder „Schuldendeckungsquote“ bezogen auf den Gesamtkredit erforderlich ist
Methode für Zinsdeckungsquote (A-Kredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnungsmethode für die Zinsdeckungsquote bezogen auf den A-Kredit
Methode für Schuldendeckungsquote (A-Kredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnungsmethode für die Schuldendeckungsquote bezogen auf den A-Kredit
Methode für Beleihungsquote (A-Kredit)	Statisch	Liste	Festlegung der Berechnungsmethode für die Beleihungsquote bezogen auf den A-Kredit
Zugrunde liegende Immobilienstatistik am Verbriefungsdatum			
Einnahmen am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Summe der übernommenen Einnahmen aus allen Quellen für eine Immobilie wie im Prospekt beschrieben. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte der Immobilien zu addieren.
Betriebskosten am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Summe der übernommenen Betriebskosten für die Immobilien wie im Prospekt beschrieben. Diese können Grundsteuern, Versicherung, Verwaltung, Betriebsstoffe, Instandhaltung und Reparaturen sowie unmittelbare Liegenschaftskosten für den Hausbesitzer umfassen; Kapitalkosten und Vermietungsprovisionen sind ausgeschlossen.

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Nettoergebnis am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Einnahmen abzüglich Betriebskosten am Vertriefsdatum (Feld „Einnahmen am Vertriefsdatum“ minus „Betriebskosten am Vertriefsdatum“). Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte zu addieren.
Kapitalkosten am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Kapitalkosten am Vertriefsdatum (im Gegensatz zu Reparaturen und Instandhaltung), falls im Prospekt angegeben
NCF am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Nettoergebnis abzüglich Kapitalkosten (Feld „Nettoergebnis am Vertriefsdatum“ minus „Kapitalkosten am Vertriefsdatum“)
Währung der Finanzberichterstattung bei Verbriefung	Statisch	Liste	Währung, die bei der anfänglichen Finanzberichterstattung in den Feldern „Einnahmen am Vertriefsdatum“ — „NCF am Vertriefsdatum“ verwendet wurde
ICR/DSCR-Indikator am Vertriefsdatum	Statisch	Liste	Angabe, wie die Schuldendeckungsquote im Falle mehrerer Immobilien bei einem Kredit berechnet/angewandt wird
Immobilienportfoliowert am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Bewertung der Immobilien zur Besicherung des Kredits am Vertriefsdatum, wie im Prospekt beschrieben. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte der Immobilien zu addieren.
Währung der Immobilienportfoliobewertung am Vertriefsdatum	Statisch	Liste	Währung der Bewertung in „Immobilienportfoliowert am Vertriefsdatum“
Bewertungsdatum am Vertriefsdatum	Statisch	Datum	Datum, an dem die Bewertung für die im Prospekt offen gelegten Werte erstellt wurde. Bei mehreren Immobilien und somit mehreren Daten ist das letzte Datum anzugeben.
Wirtschaftlicher Vermietungsgrad am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Vermietungsgrad mit unterzeichneten Mietverträgen am Vertriefsdatum, sofern im Prospekt offen gelegt (Mieter nutzen das Objekt eventuell nicht, zahlen aber Miete). Im Falle mehrerer Immobilien ist der gewichtete Durchschnitt zu verwenden, der durch Berechnung $\{\text{Aktuell vermietet \% (Immobilie)} \times (\text{Nutzung})\}$ für jede Immobilie berechnet wird.
Hinterlegte Beträge am Vertriefsdatum	Statisch	Numerisch	Summe der gesetzlich belasteten Rückstellungskonten auf Kreditebene am Vertriefsdatum
Einziehung von Hinterlegungen	Statisch	Y/N	Eingabe von „Y“, wenn Zahlungen gemäß Kreditvertrag nur zur Deckung von Grundstücks-pachtzahlungen, Versicherungen oder Steuern (nicht Instandhaltung, Ausbauten, Investitionsaufwand usw.) in Rückstellungskonten gehalten werden, ansonsten ist „N“ einzugeben.
Einziehung von sonstigen Rückstellungen	Statisch	Y/N	Werden sonstige Beträge ausgenommen Grundstücks-pacht, Steuern oder Versicherungen gemäß Kreditvertrag für Mieterausbauten, Vermietungsprovisionen und ähnliche Dinge in Bezug auf die zugehörige Immobilie oder zur Bereitstellung einer zusätzlichen Sicherheit für einen solchen Kredit in Rückstellungskonten gehalten?

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Gehaltene Hinterlegung bei Trigger-Ereignis	Statisch	Y/N	Sind im Kreditvertrag Rückstellungskonten bei Eintreten von Trigger-Ereignissen vorgesehen?
Trigger für Hinterlegung	Statisch	Liste	Art des Trigger-Ereignisses
Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rückstellungen	Statisch	Numerisch	Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rückstellungen
Freigabebedingungen für Hinterlegungskonto	Statisch	Text	Freigabebedingungen des Hinterlegungskonto.
Inanspruchnahmebedingungen für Barreserve	Statisch	Liste	Angabe, wann die Barreserve in Anspruch genommen werden kann
Hinterlegungswährung	Statisch	Liste	Währung der hinterlegten Zahlungen. Felder „Hinterlegte Beträge am Verbriefungsdatum“ und „Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rückstellungen“

Angaben zu Kreditgruppierung und Substitutionen

Gegenbesicherter Kredit	Statisch	Y/N	Angabe, ob dies ein gegenbesicherter Kredit ist (Beispiel: Die Kredite 1 und 44 sind gegenbesichert, ebenso wie die Kredite 4 und 47)
Substituierter Kredit	Dynamisch	Y/N	Dient dieser Kredit als Substitution für einen anderen Kredit an einem Datum nach dem Verbriefungsdatum?
Datum der Substitution	Dynamisch	Datum	Im Falle der Substitution nach dem Verbriefungsdatum das Datum einer solchen Substitution
Zulässige Kulanzfrist	Statisch	Numerisch	Anzahl der Tage nach Fälligkeit einer Zahlung, in denen der Kreditgeber keine Verzugsstrafe verlangt oder die Zahlung nicht als in Verzug meldet
Zusätzlicher Finanzierungsindikator	Statisch	Liste	Unterlag der Gesamtkredit einer zusätzlichen Finanzierung oder Mezzanine-Finanzierung?

Angaben zum Kreditzins (am Verbriefungsdatum)

Zinssatzart	Statisch	Liste	Art des auf den Kredit angewandten Zinssatzes
Code der Zinsmethode	Statisch	Liste	„Tage“-Vereinbarung zur Berechnung der Zinsen
Nachträgliche Zinszahlung	Statisch	Y/N	Werden die bei dem Kredit anfallenden Zinsen nachträglich gezahlt?
Tilgungsart des A-Kredits (falls zutreffend)	Statisch	Liste	Tilgungsart des A-Kredits

Angaben zur Tilgung des Gesamtkredits (am Verbriefungsdatum)

Tilgungsart des Gesamtkredits (falls zutreffend)	Statisch	Liste	Tilgungsart des Gesamtkredits
Zinszuwachs zulässig	Statisch	Y/N	Dürfen die Zinsen gemäß den Kreditunterlagen zuwachsen und kapitalisiert werden?

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Enddatum der Sperre der vorzeitigen Rückzahlung	Statisch	Datum	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung des Kredits erlaubt
Enddatum des Vorfälligkeitsentgelts	Statisch	Datum	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung des Kredits erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr oder ein Vorfälligkeitsentgelt fällig wird. Datum, nach dem der Kredit ohne Vorfälligkeitsentgelt vorzeitig zurückgezahlt werden kann
Enddatum der Vorfälligkeitsprämie	Statisch	Datum	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung des Kredits erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird
Beschreibung der Vorfälligkeitsbedingungen	Statisch	Text/Numerisch	Sollte die Angaben im Prospekt widerspiegeln. Wenn die Vorfälligkeitsbedingungen beispielsweise die Zahlung von 1 % Gebühr in Jahr 1, 0,5 % in Jahr 2 und 0,25 % in Jahr 3 des Kredits vorsehen, kann dies im Prospekt wie folgt angegeben werden: 1 %(12), 0,5 %(24), 0,25 %(36).
Stellen Nichtzahlungen bei vorrangig gesicherten Forderungen einen Kreditausfall dar?	Statisch	Y/N	Stellen Nichtzahlungen bei vorrangig gesicherten Forderungen einen Kreditausfall dar?
Stellen Nichtzahlungen bei gleichrangigen Krediten einen Immobilienausfall dar?	Statisch	Y/N	Stellen Nichtzahlungen bei gleichrangigen Krediten einen Immobilienausfall dar?

Angaben zur Kreditabsicherung (am Verbriefungsdatum)

Zinsscap während Laufzeit	Statisch	Numerisch	Höchstzins, den der Kreditnehmer bei einem variabel verzinslichen Kredit gemäß den Bedingungen des Kreditvertrags zahlen muss
Zinsfloor während Laufzeit	Statisch	Numerisch	Mindestzins, den der Kreditnehmer bei einem variabel verzinslichen Kredit gemäß den Bedingungen des Kreditvertrags zahlen muss
Art des Kreditswaps	Statisch	Liste	Beschreibung der Art des geltenden Swaps auf Kreditebene
Anbieter des Kreditswaps	Dynamisch	Text	Name des Anbieters des Kreditswap.
Art des Zinsswaps des Kredits	Statisch	Liste	Beschreibung des Zinsswaps, der für den Kredit gilt
Art des Devisenswaps	Statisch	Liste	Beschreibung der Art des Devisenswaps
Wechselkurs für Devisenswap	Statisch	Numerisch	Wechselkurs, der für einen Devisenswap festgelegt wurde
Startdatum des Kreditswaps	Statisch	Datum	Startdatum des Kreditswaps
Enddatum des Kreditswaps	Statisch	Datum	Enddatum des Kreditswaps
Pflicht des Kreditnehmers zur Zahlung von Zinsauflösungskosten bei Kreditswap	Statisch	Liste	Umfang, bis zu dem der Kreditnehmer Zinsauflösungskosten an den Anbieter des Kreditswaps zahlen muss

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben zur Kreditzinsanpassung (am Verbriefungsdatum)			
Zahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der Zins- und Tilgungszahlungen bei einem Kredit gemäß den ursprünglichen Kreditunterlagen
Häufigkeit der Zinsanpassung	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der der Zinssatz gemäß den ursprünglichen Kreditunterlagen angepasst wird
Häufigkeit der Zahlungsanpassung	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der die Kapital- und Zinszahlung gemäß den ursprünglichen Kreditunterlagen angepasst wird
Indexrückgriff in Tagen	Statisch	Numerisch	Anzahl der Tage vor dem Zinszahlungsdatum für die Festsetzung des Zinssatzes (beispielsweise wird Euribor 2 Tage vor dem Zinszahlungsdatum festgesetzt)
Indexfestsetzungsdatum	Statisch	Datum	Angabe des nächsten Indexfestsetzungsdatums, wenn der Kreditvertrag bestimmte Daten für die Indexfestsetzung vorsieht
Angaben zu Kreditsyndizierung und Beteiligung			
Kreditstruktur	Statisch	Liste	Angabe des Kreditstruktur-Codes zur Beschreibung der für diesen Kredit geltenden Struktur, z. B. Gesamtkredit, A/B-Teilkredite, syndiziert
Syndizierter Kredit	Statisch	Y/N	Gehört der Kredit zu einem syndizierten Kredit?
Prozentsatz der verbrieften Gesamtkreditfazilität	Statisch	Numerisch	Prozentsatz des verbrieften Gesamtkredits am Verbriefungsdatum
Rechte der kontrollierenden Partei auf wesentliche Entscheidungen	Statisch	Y/N	Hat ein anderer Anteilseigner außer dem Emittenten das Recht, wichtige Entscheidung zu treffen?
Korrespondenzbank der Syndizierung	Statisch	Text	Korrespondenzbank
Sonstige Angaben zum Kredit			
Abhilfe bei Nichteinhaltung der Finanzkennzahl	Statisch	Liste	Abhilfe bei Nichteinhaltung der Finanzkennzahl
Kreditoriginator	Statisch	Text	Name des Originators/Kreditgebers, der den Kredit an den Emittenten veräußert hat. Name des Unternehmens, das für die Zusicherungen und Garantien im Rahmen des Kredits zuständig ist
Strafen bei Nichtvorlage von Finanzdaten	Statisch	Liste	Indikator für Strafen wegen Versäumnis des Kreditnehmers, die geforderten Finanzdaten (Ergebnisrechnung, Zeitplan usw.) gemäß den Kreditunterlagen vorzulegen
Regressmöglichkeit	Statisch	Y/N	Besteht im Falle eines Versäumnisses des Kreditnehmers im Rahmen des Kreditvertrags die Möglichkeit des Rückgriffs auf eine andere Partei (z. B. Bürge)?
Rundungscode	Statisch	Liste	Methode der Zinsrundung

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Rundungsinkrement	Statisch	Numerisch	Inkrementeller Prozentsatz, um den ein Indexsatz zur Festsetzung des Zinssatzes gemäß dem Kreditvertrag gerundet werden sollte
Special-Servicer-Name am Verbriefungsdatum	Statisch	Text	Special-Servicer-Name am Verbriefungsdatum
Servicing-Standard	Statisch	Liste	Servicing-Standard (Option). Verwaltet der Servicer den Gesamtkredit (A und B) oder nur den A- oder B-Teilkredit?

Angaben zum Zahlungsdatum

Kreditzahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem Kapital und Zinsen an den Emittenten gezahlt werden. Normalerweise ist dies das Zinszahlungsdatum des Kredits.
Datum der vollständigen Zahlung	Dynamisch	Datum	Datum, an dem alle Zahlungen vollständig ohne Fehlbeträge geleistet wurden. Bei einem ordnungsgemäß bedienten Kredit ist dies das Kreditzahlungsdatum unmittelbar vor dem Datum, das im Feld „Kreditzahlungsdatum“ eingegeben wurde.
Datum der Indexsatanpassung	Dynamisch	Datum	Bei variabel verzinslichen Krediten Angabe des nächsten Datums, an dem eine Zinssatanpassung fällig ist. Bei fest verzinslichen Krediten Angabe des nächsten Zinszahlungsdatums
Nächstes Zahlungsanpassungsdatum	Dynamisch	Datum	Bei variabel verzinslichen Krediten Angabe des nächsten Datums, an dem die Höhe der planmäßigen Kapital- oder Zinszahlung angepasst werden soll. Bei fest verzinslichen Krediten Angabe des nächsten Zahlungsdatums
Kreditfälligkeitsdatum	Dynamisch	Datum	Aktuelles Fälligkeitsdatum des Kredits, wie im Kreditvertrag festgelegt. Hierbei wird nicht eine eventuell genehmigte Verlängerung der Fälligkeit, die gemäß Kreditvertrag zulässig ist, in Betracht gezogen.
Nächstes Kreditzahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Datum der nächsten Kreditzahlung

Angaben zum Zinssatz

Aktueller Indexsatz (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Indexsatz zur Festsetzung des aktuellen Zinssatzes für den Gesamtkredit. Zinssatz (vor Marge) zur Berechnung der gezahlten Zinsen am (Gesamt-)kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“
Aktueller Margenzinssatz (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Marge zur Festsetzung des aktuellen Zinssatzes für den Gesamtkredit. Marge zur Berechnung der gezahlten Zinsen am (Gesamt-)kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“
Aktueller Zinssatz (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Gesamtzinssatz zur Berechnung der gezahlten Zinsen am (Gesamt-)kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“ (Summe der Felder „Aktueller Indexsatz (Gesamtkredit)“ und „Aktueller Margensatz (Gesamtkredit)“ bei variabel verzinslichen Krediten)

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktueller Zinssatz (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Jährlicher Bruttosatz zur Berechnung der für die aktuelle Periode geplanten aktuellen Zinsen auf den A-Teilkredit
Nächster Indexsatz (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Indexsatz der nächsten Periode zur Festsetzung des aktuellen Zinssatzes für den Gesamtkredit. Zinssatz (vor Marge) zur Berechnung der gezahlten Zinsen basierend auf dem tatsächlichen Endsaldo (Gesamtkredit) im Feld „Tatsächlicher Endsaldo (Gesamtkredit)“
Aktueller Verzugszinssatz (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Gesamtzinsen zur Berechnung der gezahlten Verzugszinsen am Kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“

Angaben zum Kapital

Aktueller offener Anfangssaldo (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Offener Saldo am Anfang der aktuellen Periode. Offener Saldo des Kredits am Anfang der Zinsperiode zur Berechnung der am Kreditzahlungsdatum fälligen Zinsen im Feld „Kreditzahlungsdatum“
Planmäßiger Kapitalbetrag (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Planmäßige Kapitalzahlung, die auf den Kredit für die aktuelle Periode fällig ist. Fällige Kapitalzahlung, die an den Emittenten am Kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“ zu leisten ist, z. B. Tilgung, jedoch keine vorzeitigen Rückzahlungen
Aktueller planmäßiger Endsaldo (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Planmäßiger offener Kapitalsaldo des Kredits am Ende der aktuellen Periode nach Tilgung, jedoch vor eventuellen vorzeitigen Rückzahlungen. Kapitalsaldo des Kredits, der nach der planmäßigen Kapitalzahlung, jedoch vor eventuellen vorzeitigen Rückzahlungen offen wäre (Feld „Aktueller offener Anfangssaldo (Gesamtkredit)“ minus „Planmäßiger Kapitalbetrag (Gesamtkredit)“)
Außerplanmäßige Kapitaleinzahlungen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Außerplanmäßige Kapitaleinzahlungen während der aktuellen Periode. Sonstige Kapitaleinzahlungen während der Zinsperiode, die zum Abzahlen des Kredits verwendet werden. Dies kann sich auf Veräußerungserlöse, freiwillige vorzeitige Rückzahlungen oder Liquidationsbeträge beziehen.
Sonstige Kapitalanpassungen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Außerplanmäßige Kapitalanpassungen für die Zinsperiode, die nicht mit Bargeldbewegungen verknüpft sind. Sonstige Beträge, die zur Erhöhung oder Verringerung des Kreditsaldos in der aktuellen Periode führen würden und nicht als außerplanmäßige Kapitaleinzahlungen gelten und keine planmäßigen Kapitalzahlungen sind
Tatsächlich gezahltes Kapital	Dynamisch	Numerisch	Tatsächlich gezahltes Kapital zum letzten Zinszahlungsdatum
Tatsächlicher Endsaldo (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Tatsächlicher offener Kapitalsaldo am Ende der aktuellen Periode. Tatsächlicher offener Saldo des Kredits für die nächste Zinsperiode nach allen Kapitalzahlungen

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktueller Anfangssaldo (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Offener Saldo (A-Kredit) am Anfang der aktuellen Periode. Offener Saldo des A-Kredits am Anfang der Zinsperiode zur Berechnung der am Kreditzahlungsdatum fälligen Zinsen
Gesamtkapitaleinzahlungen (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Alle Kapitaleinzahlungen (A-Kredit) während der aktuellen Periode. Kapitalzahlung des A-Kredits, die an den Emittenten am Kreditzahlungsdatum im Feld „Kreditzahlungsdatum“ zu leisten ist, z. B. Tilgung, jedoch keine vorzeitigen Rückzahlungen
Tatsächlicher Endsaldo (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Tatsächlicher offener Kapitalsaldo (A-Kredit) am Ende der aktuellen Periode. Kapitalsaldo des A-Kredits, der nach der planmäßigen Kapitalzahlung offen wäre
Zugesicherter nicht in Anspruch genommener Kreditsaldo (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Verbleibende Fazilität bzw. nicht in Anspruch genommener Saldo des Gesamtkredits (vorrangige Schulden) am Ende der Periode. Verbleibende Fazilität des Gesamtkredits (vorrangige Schulden) nach dem Zinszahlungsdatum, die der Kreditnehmer noch in Anspruch nehmen kann

Angaben zu Zinsen

Planmäßig fälliger Zinsbetrag (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Bruttozinsen für die Periode unter der Annahme, dass keine vorzeitige Rückzahlung in der aktuellen Periode geleistet wurde, für den Gesamtkredit. Gesamtzinsen, die am Kreditzahlungsdatum fällig sind, unter der Annahme, dass keine vorzeitigen Rückzahlungen während der Zinsperiode geleistet wurden. Die Zinsen sollten auf dem zugrunde liegenden Zinssatz gemäß Kreditvertrag basieren.
Zinsmehrzahlung/-minderzahlung	Dynamisch	Numerisch	Zinsmehrzahlung oder -minderzahlung bei der planmäßigen Zinszahlung für die aktuelle Periode, die nicht mit einem Kreditausfall verbunden ist. Ergebnisse einer vorzeitigen Rückzahlung an einem anderen Datum als einem planmäßigen Zahlungsfälligkeitsdatum
Sonstige Zinsanpassung	Dynamisch	Numerisch	Begleitendes Feld für sonstige Kapitalanpassungen (Feld „Sonstige Kapitalanpassungen (Gesamtkredit)“, um außerplanmäßige Zinsanpassungen für die zugehörige Einziehungsperiode anzuzeigen
Negative Tilgung	Dynamisch	Numerisch	Negative Tilgung/aufgeschobene Zinsen/kapitalisierte Zinsen ohne Strafe
Tatsächlich gezahlte Zinsen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Zinsen, die während der aktuellen Periode tatsächlich auf den Gesamtkredit gezahlt wurden. Summe der Zinsen, die der Kreditnehmer während der Zinsperiode oder am Kreditzahlungsdatum gezahlt hat

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Tatsächlich gezahlte Zinsen (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Summe der Zinsen, die der Kreditnehmer auf den A-Kredit während der Zinsperiode oder am Kreditzahlungsdatum gezahlt hat
Tatsächliche Verzugszinsen	Dynamisch	Numerisch	Verzugszinsen, die während der aktuellen Periode tatsächlich auf den Gesamtkredit gezahlt wurden. Summe der Verzugszinsen, die der Kreditnehmer während der Zinsperiode oder am Kreditzahlungsdatum gezahlt hat
Aufgeschobene Zinsen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Aufgeschobene Zinsen auf den Gesamtkredit. Aufgeschobene Zinsen entsprechen dem Betrag, um den die Zinsen, die ein Kreditnehmer auf einen Hypothekenkredit zahlen muss, geringer sind, als der Betrag der aufgelaufenen Zinsen auf den offenen Kapitalsaldo.
Kapitalisierte Zinsen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Kapitalisierte Zinsen auf den Gesamtkredit. Kapitalisierte Zinsen entsprechen dem Betrag, der dem Kreditsaldo am Ende der Zinsperiode gemäß Kreditvertrag hinzuaddiert wird.

Angaben zu Kapital und Zinsen

Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtfälligigkeit (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Planmäßig fällige Kapital- und Zinszahlungen auf den Kredit für die aktuelle Periode für den Emittenten (Gesamtkredit). Summe der planmäßig fälligen Kapital- und Zinszahlungen am Kreditzahlungsdatum (Summe der Felder „Planmäßiger Kapitalbetrag (Gesamtkredit)“ und „Planmäßig fälliger Zinsbetrag (Gesamtkredit)“) — kann für DSCR-Berechnungen verwendet werden.
Gesamtminderzahlung bei offenen Kapital- und Zinsbeträgen (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Summe der offenen Kapital- und Zinsbeträge, die auf den Kredit fällig sind, am Ende der aktuellen Periode. Summe der nicht geleisteten Kapital- und Zinszahlungen am Kreditzahlungsdatum
Summe der sonstigen offenen Beträge	Dynamisch	Numerisch	Summe der offenen Beträge auf den Kredit (z. B. Versicherungsprämie, Grundstückspacht, Investitionsaufwand) am Ende der aktuellen Periode, die vom Emittenten/Servicer ausgegeben wurden. Summe der Eigentumsschutzvorschüsse oder sonstigen Beträge, die vom Servicer oder Emittenten ausgelegt und vom Kreditnehmer noch nicht erstattet wurden
Summe der offenen Beträge	Dynamisch	Numerisch	Summe der Felder „Gesamtminderzahlung bei offenen Kapital- und Zinsbeträgen (Gesamtkredit)“ und „Summe der sonstigen offenen Beträge“
Tilgungs-Trigger erreicht	Dynamisch	Y/N	Wurde der Tilgungs-Trigger erreicht?
Aktuelle Tilgungsart	Dynamisch	Liste	Art der Tilgung, die für den A-Kredit gilt
Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtfälligigkeit (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Planmäßig fällige Kapital- und Zinszahlungen auf den A-Kredit für die aktuelle Periode für den Emittenten

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Finanzdaten seit Jahresbeginn bis dato			
Verstoß gegen Berichtspflicht durch Kreditnehmer	Dynamisch	Y/N	Hat der Kreditnehmer gegen seine Berichtspflicht gegenüber dem Servicer oder Kreditgeber verstoßen?
Letzte Einnahmen	Dynamisch	Numerisch	Summe der Einnahmen für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (d. h. Jahresbeginn bis dato oder vorangehende 12 Monate), für alle Immobilien
Letzte Beleihungsquote (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Letzte Beleihungsquote für den (Gesamt-)kredit basierend auf den Kreditunterlagen
Letzte Schuldendeckungsquote (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Letzte Schuldendeckungsquote für den (Gesamt-)kredit basierend auf den Kreditunterlagen
Letzte Zinsdeckungsquote (Gesamtkredit)	Dynamisch	Numerisch	Letzte Zinsdeckungsquote für den (Gesamt-)kredit basierend auf den Kreditunterlagen
Letzte Zinsdeckungsquote (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Berechnung der letzten Zinsdeckungsquote für den A-Kredit basierend auf den Angebotsunterlagen
Letzte Schuldendeckungsquote (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Berechnung der letzten Schuldendeckungsquote für den A-Kredit basierend auf den Angebotsunterlagen
Letzte Beleihungsquote (A-Kredit)	Dynamisch	Numerisch	Letzte Beleihungsquote für den A-Kredit basierend auf den Angebotsunterlagen
Angaben zu Rückstellungen und Hinterlegungen			
Rückstellungsgesamtsaldo	Dynamisch	Numerisch	Gesamtsaldo der Rückstellungskonten auf Kreditebene am Kreditzahlungsdatum. Beinhaltet Instandhaltung, Reparaturen und Umweltkosten usw. (ausgenommen Rückstellungen für Steuern und Versicherung). Einschließlich LC für Rückstellungen. Ist auszufüllen, wenn das Feld „Einzahlung von sonstigen Rückstellungen“ bei der Krediteinrichtung „Y“ = Ja ist.
Hinterlegungs-Trigger eingetreten	Dynamisch	Y/N	Angabe von „Y“, wenn ein Ereignis eingetreten ist, wodurch das Anlegen von Rückstellungsbeträgen bewirkt wird. Angabe von „N“, wenn Zahlungen als normale Bedingung des Kreditvertrags aufgebaut werden
Hinterlegte Beträge in aktueller Periode	Dynamisch	Numerisch	Beträge, die während der aktuellen Periode hinterlegt oder zurückgestellt wurden
Währung des Rückstellungssaldos	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung des Rückstellungskontos
Hinterlegungswährung	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Hinterlegungskontos

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Daten zu Liquidation und vorzeitiger Rückzahlung			
Datum der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	Dynamisch	Datum	Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalzahlung oder Liquidationserlöse eingegangen sind
Code der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	Dynamisch	Liste	Code, der eingegangenen außerplanmäßigen Kapitalzahlungen oder Liquidationserlösen während der Einziehungsperiode zugewiesen wurde
Angaben zur Absicherung auf Kreditnehmerebene			
Name des Kreditswap-Anbieters (Kreditnehmerebene)	Dynamisch	Text	Name des Swap-Anbieters für den Kredit, wenn der Kreditnehmer einen direkten Vertrag mit der Swap-Gegenpartei abgeschlossen hat
Tatsächliche Ratings des Kreditswap-Anbieters (Kreditnehmerebene)	Dynamisch	Text/Numerisch	Angabe der Ratings der Swap-Gegenpartei zum Kreditzahlungsdatum
Vollständige oder teilweise Kündigung des Kreditswaps für aktuelle Periode (Kreditnehmerebene)	Dynamisch	Liste	Wenn der Kreditswap während der aktuellen Periode gekündigt wurde, ist der Grund anzugeben.
Fällige periodische Nettozahlung an Kreditswap-Anbieter (Kreditnehmerebene)	Dynamisch	Numerisch	Höhe der vom Kreditnehmer geleisteten Zahlung an die Swap-Gegenpartei am Kreditzahlungsdatum gemäß Swap-Vertrag
Fällige periodische Nettozahlung von Kreditswap-Anbieter (Kreditnehmerebene)	Dynamisch	Numerisch	Höhe der von der Swap-Gegenpartei geleisteten Zahlung an den Kreditnehmer am Kreditzahlungsdatum gemäß Swap-Vertrag
Zu zahlende Zinsauflösungskosten an Kreditswap-Anbieter	Dynamisch	Numerisch	Höhe der fälligen Zahlung vom Kreditnehmer an die Swap-Gegenpartei im Falle der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps
Minderzahlung bei Zinsauflösungskosten auf Kreditswap	Dynamisch	Numerisch	Höhe einer eventuellen Minderzahlung von Zinsauflösungskosten aufgrund der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps; gezahlt vom Kreditnehmer
Zu zahlende Zinsauflösungskosten von Kreditswap-Anbieter	Dynamisch	Numerisch	Höhe von eventuellen Gewinnen, die von der Swap-Gegenpartei an den Kreditnehmer bei der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps gezahlt werden
Nächstes Anpassungsdatum für Kreditswap	Dynamisch	Datum	Datum der nächsten Anpassung des Kreditswap.
Swap-Details	Dynamisch	Text	Details des Swaps
Daten zum Status von in Verzug stehenden Krediten			
Status der Immobilien	Dynamisch	Liste	Status der Immobilien
Kreditstatus	Dynamisch	Liste	Status des Kredits (z. B. laufend, Zahlungsverzug usw.) Wenn bei einem Kredit mehrere Statuscodes ausgelöst wurden, kann der Servicer nach eigenem Ermessen festlegen, welcher Code gemeldet wird.

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Datum des Vollstreckungsbeginns	Dynamisch	Datum	Datum, an dem ein Zwangsvollstreckungs- oder Vergleichsverfahren oder alternative Vollstreckungsverfahren gegen den Kreditnehmer eingeleitet wurden oder vom Kreditnehmer genehmigt wurden
Code der Verwertungsstrategie	Dynamisch	Liste	Verwertungsstrategie
Voraussichtlicher Zeitpunkt von Rückflüssen	Dynamisch	Numerisch	Voraussichtlicher Zeitpunkt von Rückflüssen in Monaten
In Insolvenz	Dynamisch	Y/N	Insolvenzstatus des Kredits (falls in Insolvenz „Y“, ansonsten „N“).
Insolvenzdatum	Dynamisch	Datum	Datum der Insolvenz
Datum des Eigentumsübergangs	Dynamisch	Datum	Datum, an dem das Eigentum (oder eine andere Form der effektiven Kontrolle und Verfügungsmöglichkeit) an der als Sicherheit genutzten Immobilie erworben wurde
Nettoerlöse bei Liquidation	Dynamisch	Numerisch	Nettoerlöse bei Liquidation zur Feststellung der dem Emittenten entstandenen Verluste gemäß Transaktionsunterlagen. Die Höhe der Nettoerlöse aus Veräußerungen bestimmt, ob es sich um einen Verlust oder Kreditausfall handelt.
Liquidationskosten	Dynamisch	Numerisch	Kosten im Zusammenhang mit der Liquidation, die bei den anderen Vermögenswerten des Emittenten saldiert werden, um den Verlust gemäß den Transaktionsunterlagen festzustellen. Höhe der Liquidationskosten, die aus den Nettoveräußerungserlösen gezahlt werden, um festzustellen, ob Verluste vorliegen
Realisierter Verlust bei Verbriefung	Dynamisch	Numerisch	Offener Kreditsaldo (plus Liquidationskosten) minus eingegangene Nettoliquidationserlöse. Höhe eines Verlusts für den Emittenten nach Abzug der Liquidationskosten von den Nettoveräußerungserlösen
Rückstand in Monaten	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Monate, mit denen dieser Kredit am Ende der aktuellen Periode gemäß Festlegung des Emittenten im Rückstand ist
Ausfallbetrag	Dynamisch	Numerisch	Gesamtausfallbetrag vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	Numerisch	Summe der Rückflüsse, einschließlich aller Veräußerungserlöse
Special Servicing-Status	Dynamisch	Y/N	Unterliegt der Kredit zum Kreditzahlungsdatum einem Special Servicing?
Ausfalldatum	Dynamisch	Datum	Datum des Kreditausfalls
Liquidationswährung	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung der Liquidation
Verlustwährung	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung der Verluste
Währung der Ausfälle/Rückstände	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung der Ausfälle/Rückstände

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben zu Kreditänderungen			
Zustimmung der Investoren	Dynamisch	Y/N	Ist die Zustimmung der Investoren im Falle einer Umstrukturierung notwendig?
Investorenversammlung geplant	Dynamisch	Datum	An welchem Datum ist die nächste Investorenversammlung geplant?
Letztes Kreditveräußerungsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der Kredit an den Emittenten veräußert wurde; falls der Kredit Teil der ursprünglichen Verbriefung war, ist dies das Verbriefungsdatum.
Letztes Immobilien-Verbriefungsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem die letzte(n) Immobilie(n) dieser Verbriefung hinzugefügt wurde(n). Falls Immobilien substituiert wurden, ist das Datum der letzten Substitution anzugeben. Wenn die Immobilien Teil der ursprünglichen Transaktion waren, ist dies das Verbriefungsdatum.
Datum der Annahme	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der neue Kreditnehmer die Übernahme/Novation oder Annahme vorgenommen hat
Datum des Bewertungsabschlages	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der Bewertungsabschlag berechnet und genehmigt wurde (anfängliche oder aktualisierte Berechnung zum Datum)
Datum der letzten Änderung	Dynamisch	Datum	Letztes wirksames Datum, an dem der Kredit geändert wurde
Änderungscode	Dynamisch	Liste	Art der Änderung
Geänderte Zahlungsrate	Dynamisch	Numerisch	Wenn der Kredit umstrukturiert (vielleicht während eines Verwertungsprozesses) und der Tilgungszeitplan geändert wurden, sollte der neue Betrag, ausgedrückt als Prozentsatz des Kreditsaldos, eingegeben werden.
Geänderter Kreditzinssatz	Dynamisch	Numerisch	Wenn der Kredit umstrukturiert (vielleicht während eines Verwertungsprozesses) und der Zinssatz oder die Marge geändert wurden, sollte der neue Satz eingegeben werden.
Angaben zum Special Servicing			
Servicer-Watchlist	Dynamisch	Datum	Datum des Beschlusses, einen Kredit auf die Watchlist zu setzen. Wenn ein Kredit in einer früheren Periode aus der Watchlist entfernt wurde und nun wieder hinzugefügt wird, ist hier das neue Eintragungsdatum anzugeben.
Datum der letzten Übertragung an Special Servicer	Dynamisch	Datum	Datum, an dem ein Kredit nach einem entsprechenden Vorfall an den Special Servicer übertragen wurde. Anmerkung: Wurde der Kredit mehrfach übertragen, ist das Datum anzugeben, an dem die letzte Übertragung an den Special Servicer erfolgt ist.
Datum der letzten Rückübertragung an Primary Servicer	Dynamisch	Datum	Datum, an dem ein Kredit ein „korrigierter Hypothekenkredit“ wird; dies entspricht dem Datum, an dem der Kredit vom Special Servicer zurück an den Master/Primary Servicer übertragen wurde.

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Uneinbringlichkeit festgestellt	Dynamisch	Y/N	Indikator (Ja/Nein), ob der Servicer/Special Servicer festgestellt hat, dass eventuell geleistete Vorschüsse und der offene Kreditsaldo sowie sonstige aus dem Kredit geschuldete Beträge von Erlösen bei Veräußerer oder Liquidation der Immobilie oder des Kredits uneinbringlich sind
Datum des Verstoßes gegen Kreditvertrag	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der Verstoß gegen den Kreditvertrag aufgetreten ist. Im Falle mehrerer Verstöße ist das Datum des frühesten Verstoßes anzugeben.
Datum der Behebung des Verstoßes gegen Kreditvertrag	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der Verstoß gegen den Kreditvertrag behoben wurde. Im Falle mehrerer Verstöße ist das Datum des zuletzt behobenen Verstoßes anzugeben.
Code der Watchlist-Kriterien	Dynamisch	Liste	Code der Watchlist des Servicers. Wenn mehrere Kriterien anwendbar sind, ist der ungünstigste Code anzugeben.
Währung der Gebühren	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung der Gebühren

Angaben zum Special Servicer

Name des Special Servicers	Dynamisch	Text	Name des Special Servicers
Special Servicer geändert?	Dynamisch	Y/N	Hat es bei dem Special Servicer seit der vorherigen Berichtsperiode eine Änderung gegeben?
Beteiligung sonstiger Kreditgeber an Vollstreckung	Dynamisch	Y/N	Ist ein anderer Kreditgeber an der Vollstreckung beteiligt?

Daten zum Status von notleidenden Krediten

Ausfall oder Zwangsvollstreckung	Dynamisch	Y/N	Ist der Kredit aktuell in Verzug oder unter Zwangsvollstreckung?
Verzugsgrund	Dynamisch		Grund des Verzugs
Nichteinhaltung der Finanzkennzahl/Trigger	Dynamisch	Liste	Art der Nichteinhaltung der Finanzkennzahl oder des entsprechenden Triggers

Angaben gemäß Eigenkapitalrichtlinie

Konformität des Originators mit einer der vier Selbsthaltoptionen angeben	Dynamisch	Liste	Art des Selbstbehalts
Gehalten durch Originator	Dynamisch	Numerisch	Materieller Nettoanteil, den der Originator in Prozent (%) hält, gemäß Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen

IMMOBILIE

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben zur Immobiliensicherheit			
Immobilienkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung der Immobilie. Im Falle mehrerer Immobilien (wie z. B. Wohnblock) sollte dies eine eindeutige Kennung sein, mit der diese kollektiv identifiziert werden.
Durch Immobilie gegenbesicherte Kreditgruppierung	Dynamisch	Text/Numerisch	Angabe der Kreditkennungen laut Prospekt; falls eine Immobilie mehrere Kredite innerhalb der Transaktion oder des Pools absichert, sind die Kennungen durch Kommata zu trennen.
Immobilienname	Statisch	Text/Numerisch	Name der Immobilie, die als Sicherheit für den Kredit dient. Im Falle mehrerer Immobilien (wie z. B. Wohnblock) sollte dies der Name sein, mit dem diese kollektiv identifiziert werden.
Adresse der Immobilie	Statisch	Text/Numerisch	Adresse der Immobilie, die als Sicherheit für den Kredit dient
Ort der Immobilie	Statisch	Text	Name des Orts, wo sich die Immobilie befindet
Postleitzahl der Immobilie	Statisch	Text/Numerisch	Primäre Postleitzahl der Immobilie. Es müssen mindestens die ersten 2 bis 4 Zeichen eingegeben werden.
Land der Immobilie	Statisch	Liste	Land, in dem sich die Immobilie befindet
Typcode der Immobilie	Statisch	Liste	Typ oder Nutzungsreferenz der Immobilie gemäß Bewertungsbericht oder Angebotsunterlagen
Baujahr	Statisch	Datum	Jahr, in dem die Immobilie gebaut wurde, gemäß Bewertungsbericht oder Angebotsunterlagen
Jahr der letzten Renovierung	Dynamisch	Datum	Jahr, in dem die letzte größere Renovierung bzw. der letzte Neubau an der Immobilie fertig gestellt wurde, gemäß Bewertungsbericht oder Angebotsunterlagen
Nettoquadratmeter am Vertriebsdatum	Dynamisch	Numerisch	Vermietbare Fläche in Quadratmetern der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, gemäß aktuellem Bewertungsbericht. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte zu addieren.
Validierte Nettowohnfläche	Dynamisch	Y/N	Hat ein Gutachter die Nettowohnfläche der Immobilie überprüft?
Anzahl der Einheiten/Betten/Räume	Statisch	Numerisch	Für eine Immobilie des Typs „Mehrfamilienhaus“ ist die Anzahl der Einheiten, für Gastgewerbe-/Hotel-/Gesundheitsimmobilien die Anzahl der Betten, für Campinganlagen die Anzahl der Einheiten, für Mietwohnungen die Anzahl der Räume und für Selbstlagerzentren die Anzahl der Einheiten anzugeben. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte zu addieren, sofern es sich bei allen um die gleiche Art von Immobilie handelt.
Immobilienstatus	Dynamisch	Liste	Letzter Kreditstatus der Immobilie
Eigentumsform der Immobilie	Statisch	Liste	Relevante Eigentumsform der Immobilie. Nur Verpachtung, bei der der Kreditnehmer gewöhnlich ein Gebäude besitzt oder bauen muss, wie im Pachtvertrag angegeben

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Ablauf der Grundstückspacht	Statisch	Datum	Angabe des frühesten Datums, an dem der Pachtzins abläuft
Zahlbare Grundstückspacht	Dynamisch	Numerisch	Ist die Immobilie gemietet, ist die aktuelle Jahresmiete anzugeben, die an den Vermieter zu zahlen ist.
Datum der letzten Bewertung	Dynamisch	Datum	Datum der letzten Bewertung der Immobilie
Letzte Bewertung	Dynamisch	Numerisch	Letzte Bewertung der Immobilie
Letzte Bewertungsbasis	Dynamisch	Liste	Letzte Bewertungsbasis
Währung der Grundstückspacht	Dynamisch	Liste	Währung der Grundstückspacht („Zahlbare Grundstückspacht“)
Währung der letzten Bewertung	Dynamisch	Liste	Währung der letzten Bewertung („Letzte Bewertung“)

Angaben zum Verbriefungsdatum

Immobilien-Verbriefungsdatum	Statisch	Datum	Datum, an dem die Immobilie dieser Verbriefung hinzugefügt wurde. Falls diese Immobilie substituiert wurde, ist das Datum der Substitution anzugeben. Wenn die Immobilie Teil der ursprünglichen Transaktion war, ist dies das Verbriefungsdatum.
Zugewiesener Prozentsatz des Kredits am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Kreditanteil, der der Immobilie zuzurechnen ist, am Verbriefungsdatum, wenn der Kredit durch mehrere Immobilien besichert wird
Datum der Finanzdaten am Verbriefungsdatum	Statisch	Datum	Enddatum der Finanzdaten für die im Prospekt verwendeten Informationen (z. B. Jahresbeginn bis dato, jährlich, vierteljährlich oder vorangegangene 12 Monate)
Nettoergebnis am Verbriefungsdatum	Dynamisch	Numerisch	Einnahmen abzüglich Betriebskosten am Verbriefungsdatum
Bewertung am Verbriefungsdatum	Statisch	Numerisch	Bewertung der Immobilien zur Besicherung des Kredits am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt beschrieben
Name des Gutachters bei Verbriefung	Statisch	Text	Name des Sachverständigenbüros, das die Immobilienbewertung bei der Verbriefung durchgeführt hat
Datum der Bewertung am Verbriefungsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem die Bewertung für die im Prospekt offen gelegten Werte erstellt wurde
Wert der leer stehenden Immobilie am Verbriefungsdatum	Dynamisch	Numerisch	Wert der leer stehenden Immobilie am Verbriefungsdatum
Gewerbliche Fläche	Dynamisch	Numerisch	Vermietbare gewerbliche Fläche in Quadratmetern der Immobilie, die als Sicherheit für den Kredit dient, gemäß aktuellem Bewertungsbericht

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Wohnfläche	Dynamisch	Numerisch	Vermietbare Wohnfläche in Quadratmetern der Immobilie, die als Sicherheit für den Kredit dient, gemäß aktuellem Bewertungsbericht
Währung der Finanzdaten	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits

Finanzdaten seit Jahresbeginn bis dato der Immobilie

Aktueller zugewiesener Kreditanteil	Dynamisch	Numerisch	Kreditanteil, der der Immobilie zuzurechnen ist, am Kreditzahlungsdatum, wenn der Kredit durch mehrere Immobilien besichert wird. Die Summe aller Anteile sollte 100 % ergeben. Dies kann im Kreditvertrag festgelegt sein.
Aktueller zugewiesener Endkreditbetrag	Dynamisch	Numerisch	Anwendung des aktuellen Prozentsatzes (Anteils) auf den tatsächlich offenen Saldo des Kredits
Letzte Finanzdaten zum Startdatum	Dynamisch	Datum	Erster Tag der Finanzdaten, die für die letzte Ergebnisrechnung verwendet wurden (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate)
Letzte Finanzdaten zum Enddatum	Dynamisch	Datum	Enddatum der Finanzdaten, die für die letzte Ergebnisrechnung verwendet wurden (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate)
Letzter Monat des Jahres für Finanzberichterstattung	Dynamisch	Text/Numerisch	Angabe des Monats, in dem die Finanzdaten für jedes Jahr (letzter, vorangegangener und vorvergangener Monat) enden
Letzter Finanzindikator	Dynamisch	Liste	Mit diesem Feld wird die Periode beschrieben, auf die sich die letzten Finanzdaten beziehen.
Letzte Einnahmen	Dynamisch	Numerisch	Summe der Einnahmen für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für alle Immobilien. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte zu addieren.
Letzte Betriebskosten	Dynamisch	Numerisch	Summe der Betriebskosten für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für alle Immobilien
Letztes Nettoergebnis	Dynamisch	Numerisch	Summe der Einnahmen abzüglich Betriebskosten für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird
Letzter Investitionsaufwand	Dynamisch	Numerisch	Gesamtinvestitionsaufwand (im Gegensatz zu Reparaturen und Instandhaltung) für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für alle Immobilien

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Letzter Nettofinanzstrom	Dynamisch	Numerisch	Gesamtnettoergebnis abzüglich Investitionsaufwand für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird
Letzter Schuldendienstbetrag	Dynamisch	Numerisch	Summe der planmäßig fälligen Kapital- und Zinszahlungen während der Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate)
Letzte Schuldendeckungsquote (Nettoergebnis)	Dynamisch	Numerisch	Berechnung der Schuldendeckungsquote basierend auf dem Nettoergebnis für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate)
Vertragliche Jahresmieteinnahmen	Dynamisch	Numerisch	Vertragliche Jahresmieteinnahmen, die aus der letzten Mieterliste des Kreditnehmers abgeleitet wurden

Angaben zur Immobiliennutzung

Nutzung zum Datum	Dynamisch	Datum	Datum der letzten erhaltenen Mieterliste (bei Gastgewerbe- (Hotels) und Gesundheitsimmobilien Angabe der durchschnittlichen Nutzung für die Periode, für die die Ergebnisse gemeldet werden.)
Physische Nutzung am Verbriefungsdatum	Dynamisch	Numerisch	Bei Verbriefung der verfügbare Prozentsatz der vermietbaren Fläche, die tatsächlich belegt ist (d. h. die von Mietern genutzt wird und nicht geräumt ist). Sollte aus einer Mieterliste oder einem anderen Dokument abgeleitet werden, woraus die Nutzung in Übereinstimmung mit den letzten Geschäftsjahresdaten hervorgeht.
Letzte physische Nutzung	Dynamisch	Numerisch	Aktueller verfügbarer Prozentsatz der vermietbaren Fläche, die tatsächlich belegt ist (d. h. die von Mietern genutzt wird und nicht geräumt ist). Sollte aus einer Mieterliste oder einem anderen Dokument abgeleitet werden, woraus die Nutzung in Übereinstimmung mit den letzten Geschäftsjahresdaten hervorgeht.
Verfügbare Mieterdaten	Dynamisch	Y/N	Sind die Mieterdaten auf Mieterbasis verfügbar?
Gewichtete durchschnittliche Mietdauer	Dynamisch	Numerisch	Gewichtete durchschnittliche Mietdauer in Jahren
Gewichtete durchschnittliche Mietdauer („First Break“)	Dynamisch	Numerisch	Gewichtete durchschnittliche Mietdauer (in Jahren) nach allen First-Break-Optionen

Angaben zu den drei größten Mietern

% der Einnahmen mit Ablauf in 1-12 Monaten	Dynamisch	Numerisch	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 1 bis 12 Monaten
% der Einnahmen mit Ablauf in 13-24 Monaten	Dynamisch	Numerisch	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 13 bis 24 Monaten

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
% der Einnahmen mit Ablauf in 25-36 Monaten	Dynamisch	Numerisch	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 25 bis 36 Monaten
% der Einnahmen mit Ablauf in 37-48 Monaten	Dynamisch	Numerisch	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 37 bis 48 Monaten
% der Einnahmen mit Ablauf in 49+ Monaten	Dynamisch	Numerisch	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 49 oder mehr Monaten
Größter Mieter nach Einnahmen (netto)	Dynamisch	Text/Numerisch	Name des größten aktuellen Mieters nach Nettomiete
Datum des Mietauslaufs des größten Mieters	Dynamisch	Datum	Auslaufdatum des Mietvertrags des größten aktuellen Mieters (nach Nettomiete)
Zahlbare Miete des größten Mieters	Dynamisch	Numerisch	Jahresmiete, die vom größten Mieter zu zahlen ist
Zweitgrößter Mieter nach Einnahmen (netto)	Dynamisch	Text/Numerisch	Name des zweitgrößten aktuellen Mieters (nach Nettomiete)
Datum des Mietauslaufs des zweitgrößten Mieters	Dynamisch	Datum	Auslaufdatum des Mietvertrags des zweitgrößten aktuellen Mieters (nach Nettomiete)
Zahlbare Miete des zweitgrößten Mieters	Dynamisch	Numerisch	Miete, die vom zweitgrößten aktuellen Mieter zu zahlen ist
Drittgrößter Mieter nach Einnahmen (netto)	Dynamisch	Text/Numerisch	Name des drittgrößten aktuellen Mieters (nach Nettomiete)
Datum des Mietauslaufs des drittgrößten Mieters	Dynamisch	Datum	Auslaufdatum des Mietvertrags des drittgrößten aktuellen Mieters (nach Nettomiete)
Zahlbare Miete des drittgrößten Mieters	Dynamisch	Numerisch	Miete, die vom drittgrößten aktuellen Mieter zu zahlen ist
Währung der Miete	Dynamisch	Liste	Währungsfestlegung der Miete

Angaben zur Zwangsvollstreckung

Datum der voraussichtlichen Auflösung oder Zwangsvollstreckung	Dynamisch	Datum	Voraussichtliches Datum der Auflösung, wie vom Special Servicer erwartet. Im Falle mehrerer Immobilien ist das letzte Datum der verbundenen Immobilien anzugeben. Bei Zwangsvollstreckung = voraussichtliches Datum der Zwangsvollstreckung oder bei Immobilieneigentum = voraussichtliches Veräußerungsdatum
Startdatum des Vollstreckungsverfahrens	Dynamisch	Datum	Datum, an dem ein Zwangsvollstreckungs- oder alternatives Vollstreckungsverfahren gegen den Kreditnehmer eingeleitet wurde oder vom Kreditnehmer genehmigt wurde
Datum der Zwangsverwaltung	Dynamisch	Datum	Datum, an dem das Eigentum (oder eine andere Form der effektiven Kontrolle und Verfügungsmöglichkeit) an der als Sicherheit genutzten Immobilie erworben wurde

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Allgemeine Angaben zur Anleihe			
Transaktionspool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung der Transaktion oder des Pools
Ausschüttungsdatum	Statisch	Datum	Datum der Zins- und Kapitalzahlung für die Anleihetranche
Bezugsrechtsstichtag	Statisch	Datum	Datum, bis zu dem die Anleiheklasse gehalten werden muss, um als Inhaber zu gelten
Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche eines durch kommerzielle Kredite besicherten strukturierten Finanzinstruments mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
CUSIP (Regel 144A)	Statisch	Text/Numerisch	Wertpapierkennnummer, die jeder Anleiheklasse oder -tranche gemäß den Standards zugewiesen wird, die durch das Committee on Uniform Security Identification Procedures (CUSIP) entsprechend den Anforderungen der Regel 144A festgelegt wurden, oder sonstige Wertpapierkennnummer, die von einer Börse oder einem sonstigen Unternehmen zugewiesen wurde
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Wertpapierkennnummer, die jeder Anleiheklasse oder -tranche gemäß den Standards zugewiesen wird, die durch die International Standards Organisation (ISIN) festgelegt wurden, oder sonstige Wertpapierkennnummer, die von einer Börse oder einem sonstigen Unternehmen zugewiesen wurde
Allgemeine Kennnummer (Regel 144A)	Statisch	Text/Numerisch	Neunstellige Kennnummer, die von CEDEL und Euroclear gemeinsam für jede Anleiheklasse oder -tranche ausgegeben wird.
Internationale Wertpapierkennnummer (Vorschrift S)	Statisch	Text/Numerisch	Wertpapierkennnummer, die jeder Anleiheklasse oder -tranche gemäß den Standards zugewiesen wird, die durch die International Standards Organisation (ISIN) entsprechend den Anforderungen der Vorschrift S festgelegt wurden, oder sonstige Wertpapierkennnummer, die von einer Börse oder einem sonstigen Unternehmen zugewiesen wurde
Allgemeine Kennnummer (Vorschrift S)	Statisch	Text/Numerisch	Wertpapierkennnummer, die jeder Anleiheklasse oder -tranche gemäß den Standards zugewiesen wird, die durch das Committee on Uniform Security Identification Procedures (CUSIP) entsprechend den Anforderungen der Vorschrift S festgelegt wurden, oder sonstige Wertpapierkennnummer, die von einer Börse oder einem sonstigen Unternehmen zugewiesen wurde
Anleiheemissionsdatum	Statisch	Datum	Emissionsdatum der Anleihe
Gesetzliches Fälligkeitsdatum	Statisch	Datum	Datum, an dem die spezifische Anleiheklasse oder eine entsprechende Tranche zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Währung	Statisch	Liste	Währung, in der der Geldwert der Anleiheklasse oder Tranche angegeben wird
Ursprünglicher Kapitalsaldo	Statisch	Numerisch	Ursprünglicher Kapitalsaldo der spezifischen Anleiheklasse oder Tranche am Emissionsdatum

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben zum Anleihewert			
Nominell-Markierung	Statisch	Y/N	„Y“ für Nominell, „N“, wenn diese Anleihekategorie oder Tranche tilgungsfrei, d. h. ein Zinsstrip, ist
Anfänglicher Kapitalsaldo	Statisch	Numerisch	Offener Kapitalsaldo der Anleihekategorie oder Tranche am Anfang der aktuellen Periode
Planmäßiges Kapital	Statisch	Numerisch	Planmäßiges Kapital, das während der Periode an die Anleihekategorie oder Tranche gezahlt wird
Außerplanmäßiges Kapital	Dynamisch	Numerisch	Außerplanmäßiges Kapital, das während der Periode an die Anleihekategorie oder Tranche gezahlt wird
Gesamtkapitalausschüttung	Dynamisch	Numerisch	Gesamtkapital (planmäßig und außerplanmäßig), das während der Periode an die Anleihekategorie oder Tranche gezahlt wird
Tilgungsart	Statisch	Liste	Tilgungsmethode, nach der die Anleihekategorie oder Tranche periodisch gezahlt wird
Dauer der Tilgungsfreiheit	Statisch	Numerisch	Länge der tilgungsfreien Frist in Monaten
Kapitalisierte Zinsen	Dynamisch	Numerisch	Zinsen, die dem Saldo der Anleihekategorie hinzuaddiert werden, einschließlich negativer Tilgung
Kapitalverlust	Dynamisch	Numerisch	Gesamtkapitalverlust während der Berichterstattungsperiode
Kumulierte Kapitalverluste	Dynamisch	Numerisch	Kapitalverluste, die sich bis dato angesammelt haben
Kapitalendsaldo	Dynamisch	Numerisch	Offener Kapitalsaldo der Anleihekategorie oder Tranche am Ende der aktuellen Periode
Zahlungsfaktor der Anleihe	Dynamisch	Numerisch	Kapital, das auf die Anleihekategorie oder Tranche in der Berichterstattungsperiode gezahlt wurde, als Bruchteil des ursprünglichen (anfänglichen) Saldos der Anleihe oder Tranche ($0 < x < 1$), bis zu 12 Dezimalstellen
Endfaktor der Anleihe	Dynamisch	Numerisch	Endsaldo der Anleihekategorie oder Tranche nach den Zahlungen in der Berichterstattungsperiode als Bruchteil des ursprünglichen (anfänglichen) Saldos der Anleihe oder Tranche ($0 < x < 1$), bis zu 12 Dezimalstellen
Nächstes Anleihezahlsdatum	Dynamisch	Datum	Nächstes periodisches Zahlungs-/Ausschüttungsdatum der Anleihekategorie oder Tranche
Angaben zu den Anleihezinsen			
Indexzinssatzart	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinssatz gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen, der für die spezifische Anleihekategorie oder Tranche gilt. Aktueller Zinssatzindex
Aktueller Indexsatz	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Wert des Indexsatzes, der für die spezifische Anleihekategorie oder Tranche während der aktuellen Zuwachsperiode gilt, mit bis zu 5 Dezimalstellen.
Zuwachsmethode	Statisch	Liste	Zuwachsmethode, nach der die Anleihekategorie oder Tranche periodisch berechnet wird

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktuelle Zuwachstage	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Zuwachstage, die für die Berechnung der während der aktuellen Periode zu überweisenden Zinsen anwendbar sind
Aufgelaufene Zinsen	Dynamisch	Numerisch	Betrag der aufgelaufenen Zinsen
Geltender „Available Funds Cap“	Statisch	Y/N	Unterliegt die Anleiheklasse einem „Available Funds Cap“ (AFC)-Mechanismus?
Bewertungsabschlag	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Bewertungsabschlag, der dieser Klasse zugeordnet ist
Kumulierter Bewertungsabschlag	Dynamisch	Numerisch	Zugeordneter kumulierter Gesamtbewertungsabschlag
Sonstige Zinsausschüttung	Dynamisch	Numerisch	Sonstige spezifische Aufzinsung
Aktueller Zinsausfall	Dynamisch	Numerisch	Zinsausfall für diese Berichtszeitungsperiode für diese Klasse
Kumulierter Zinsausfall	Dynamisch	Numerisch	Kumulierter Zinsausfall bis dato
Gesamtzinsausschüttung	Dynamisch	Numerisch	Summe der geleisteten Zinszahlungen
Anfangssaldo der nicht gezahlten Zinsen	Dynamisch	Numerisch	Offener Zinssaldo am Anfang der aktuellen Periode
Kurzfristig nicht gezahlte Zinsen	Dynamisch	Numerisch	Zinsen, die in der aktuellen Periode aufgeschoben wurden und am nächsten Zahlungsdatum zahlbar sind
Langfristig nicht gezahlte Zinsen	Dynamisch	Numerisch	Zinsen, die in der aktuellen Periode aufgeschoben wurden und am Fälligkeitsdatum zahlbar sind
AFC-Trigger-Ereignis	Dynamisch	Y/N	Ist ein „Available Funds Cap (AFC)“-Trigger-Ereignis eingetreten?
Indexsatz der nächsten Periode	Dynamisch	Numerisch	Wert des Indexsatzes der nächsten Periode
Nächstes Indexanpassungsdatum	Dynamisch	Datum	Indexsatzanpassungsdatum der nächsten Periode

Angaben zur Liquiditätsfazilität

Liquiditätsfazilität — Anfangssaldo	Dynamisch	Numerisch	Anfangssaldo der Liquiditätsfazilität
Anpassungen der Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Numerisch	Anpassungen der Liquiditätsfazilität
Inanspruchnahmen der Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Numerisch	Höhe der Inanspruchnahme der Liquiditätsfazilität
Rückzahlungen in die Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Numerisch	Rückzahlungsbeträge in die Liquiditätsfazilität
Liquiditätsfazilität — Endsaldo	Dynamisch	Numerisch	Endsaldo der Liquiditätsfazilität
Währung der Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Liste	Währung der Liquiditätsfazilität

ANHANG III

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch KMU-Kredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

VERMÖGENSWERTE

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	Datum	Aktuelles Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios
Pool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung der Transaktion oder des Pools oder eindeutiger Name der Transaktion
Kreditkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für jeden Kredit
Originator	Statisch	Text	Kreditgeber, der den ursprünglichen Kredit vergeben hat
Servicer-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung pro Servicer, um anzugeben, welches Unternehmen den Kredit verwaltet
Name des Servicers	Dynamisch	Text	Name des Servicers
Kreditnehmerkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung je Kreditnehmer, sodass Kreditnehmer mit mehreren Krediten in dem Pool ermittelt werden können (z. B. weitere Kreditvergaben/sonstige Kredite werden als separate Einträge gezeigt)

Angaben zum Schuldner

Land	Statisch	Liste	Land der ständigen Niederlassung
Postleitzahl	Statisch	Text	Es müssen mindestens die ersten zwei oder drei Zeichen eingegeben werden. Nicht die vollständige Postleitzahl angeben.
Rechtsform/Geschäftsart des Schuldners	Statisch	Liste	
Basel III-Segment des Kreditnehmers	Statisch	Liste	
Verbunden mit Originator?	Statisch	Y/N	Ist der Kreditnehmer mit dem Originator verbunden?
Art des Vermögenswerts	Statisch	Liste	
Rang	Dynamisch	Liste	
Bankinterne Verlustquote bei Ausfall (LGD)	Dynamisch	Numerisch	Verlustquote bei Ausfall unter normalen Konjunkturbedingungen
NACE-Branchencode	Statisch	Text/Numerisch	NACE-Code der Branche des Kreditnehmers

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Eigenschaften des Mietvertrags			
Kreditvergabedatum	Statisch	Datum	Datum der ursprünglichen Kreditvergabe
Endgültiges Fälligkeitsdatum	Statisch	Datum	Endgültiges Fälligkeitsdatum des Kredits
Währungsfestlegung des Kredits	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits
Abgesicherter Kredit	Dynamisch	Y/N	Ist der betreffende Kredit gegen Währungsrisiken abgesichert?
Ursprünglicher Kreditsaldo	Statisch	Numerisch	Ursprünglicher Gesamtkreditsald.
Aktueller Saldo	Dynamisch	Numerisch	Höhe des offenen Kredits zum Cut-Off-Datum des Pools. Dies sollte sämtliche Beträge einschließen, die in der Transaktion als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Kreditsaldo beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Transaktion sind, sollten diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen.
Verbriefter Kreditbetrag	Statisch	Numerisch	Saldo des verbrieften Kredits zum Cut-Off-Datum
Kapitalzahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der Kapitalzahlungen, d. h. Anzahl der Monate zwischen Zahlungen
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Anzahl der Monate zwischen Zahlungen
Tilgungsart	Dynamisch	Liste	Tilgungsart
Art des Kredits	Statisch	Liste	
Schlussrate	Dynamisch	Numerisch	Höhe der Schlussrate
Zahlungsart	Dynamisch	Liste	
Zinssatz			
Aktueller Zinssatz	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Zinssatz (%)
Zinsscap	Dynamisch	Numerisch	Zinsscap (%)
Zinsfloor	Statisch	Numerisch	Zinsfloor (%)
Zinssatzart	Dynamisch	Liste	Zinssatzart
Aktueller Zinsindex	Dynamisch	Liste	Aktueller Zinsindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Kreditzinssatz festgelegt wird)

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktuelle Zinsmarge	Dynamisch	Numerisch	Aktuelle Zinsmarge (bei fest verzinslichen Krediten entspricht dies dem aktuellen Zinssatz, bei variabel verzinslichen Krediten entspricht dies der Marge über dem Indexsatz (oder darunter, sofern als negativ eingetragen)
Zinsanpassungsperiode	Statisch	Liste	

Angaben zur Performance

Zinsrückstände	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Saldo der Zinsrückstände
Zinsrückstand in Tagen	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Tage, mit denen dieser Kredit im Rückstand ist (zum Cut-Off-Datum des Pools) gemäß Festlegung des Emittenten
Kapitalrückstände	Dynamisch	Numerisch	Aktueller Saldo der Kapitalrückstände. Rückstände definiert als Summe der bis dato fälligen Kapitalzahlungen MINUS Summe der bis dato eingegangenen Kapitalzahlungen MINUS kapitalisierte Beträge
Kapitalrückstand in Tagen	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Tage, mit denen dieser Kredit im Rückstand ist (zum Cut-Off-Datum des Pools) gemäß Festlegung des Emittenten
Ausfall oder Zwangsvollstreckung bei Kredit gemäß Festlegung in Transaktion	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob bei dem Kredit ein Ausfall oder eine Zwangsvollstreckung gemäß Festlegung in der Transaktion vorliegt
Ausfall oder Zwangsvollstreckung auf Kredit gemäß Festlegung in Basel III	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob bei dem Kredit ein Ausfall oder eine Zwangsvollstreckung gemäß Festlegung in Basel III vorliegt
Ausfallgrund (Festlegung in Basel III)	Dynamisch	Liste	Angabe des Ausfallgrunds entsprechend der Festlegung in Basel III
Ausfalldatum	Dynamisch	Datum	Datum des Kreditausfalls gemäß Festlegung in der Transaktion
Ausfallbetrag	Dynamisch	Numerisch	Gesamtausfallbetrag (gemäß Festlegung in der Transaktion) vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	Numerisch	Summe der Rückflüsse, einschließlich aller Veräußerungserlöse. Nur relevant bei notleidenden oder zwangsvollstreckten Krediten
Zugewiesene Verluste	Dynamisch	Numerisch	Verluste, die bis dato zugewiesen wurden
Datum der Verlustzuweisung	Dynamisch	Datum	Datum, an dem der Verlust zugewiesen wurde

TILGUNGSPROFIL

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Offener Saldo Periode 1	Dynamisch	Numerisch	Tilgungsprofil mit 0 % vorzeitigen Rückzahlungen

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Datum des offenen Saldos Periode 1	Dynamisch	Datum	Datum, das mit dem Saldo von Periode 1 verknüpft ist
Offener Saldo Periode (2 bis 120)	Dynamisch	Numerisch	Tilgungsprofil mit 0 % vorzeitigen Rückzahlungen
Datum des offenen Saldos Periode (2 bis 120)	Dynamisch	Datum	Datum, das mit dem Saldo von Periode (2 bis 120) verknüpft ist

SICHERHEIT

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
----------	------------------------	----------	-------------------------------

Sicherheit

Kennung der Sicherheit	Statisch	Text	Eindeutige Kennung der Sicherheit für den Originator
Kreditkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kreditkennung, die mit der Sicherheit verknüpft ist. Diese sollte mit den Kennungen aus dem Feld „Kreditkennung“ übereinstimmen.
Art des Wertpapiers	Statisch	Liste	Unterliegen die Vermögenswerte festen oder schwebenden Sicherheitsrechten?
Art der Sicherheit	Statisch	Liste	Art der Sicherheit
Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Statisch	Numerisch	Immobilienwert zum Datum der letzten Kreditvergabe vor einer Verbriefung
Ursprüngliches Bewertungsdatum	Statisch	Datum	Datum der letzten Immobilienbewertung zum Zeitpunkt der letzten Kreditvergabe vor einer Verbriefung
Aktuelles Bewertungsdatum	Dynamisch	Datum	Dies sollte das Datum der letzten Bewertung sein.
Ursprünglicher Bewertungstyp	Statisch	Liste	Bewertungstyp bei Vergabe
Rang	Dynamisch	Text	
Postleitzahl der Immobilie	Statisch	Text	Es müssen mindestens die ersten 2 oder 3 Zeichen eingegeben werden.
Vergebender Kanal/arrangierende Bank oder Abteilung	Statisch	Liste	
Währung der Sicherheit	Statisch	Liste	Dies sollte die Währung in Bezug auf den Bewertungsbetrag in „Wert der Sicherheit“ sein.
Anzahl der Sicherheiten für Kredit	Dynamisch	Numerisch	Gesamtzahl der Sicherheiten zur Besicherung des Kredits. Die Anzahl sollte die Anzahl der sicherheitsbezogenen Berichte widerspiegeln, die für den Kredit in der aktuellen Datei vorgelegt werden.

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Felder bei Daten auf Wertpapier- oder Anleiheebene			
Berichtsdatum	Dynamisch	Datum	Datum, an dem Transaktionsbericht ausgegeben wurde
Emittent	Statisch	Text	Name des Emittenten und Emissionsserie, falls zutreffend
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Wenn die Transaktion mit einer Liquiditätsfazilität verbunden ist, Bestätigung, ob in dem Zeitraum, der am letzten Zinszahlungsdatum endet, eine Ziehung unter der Liquiditätsfazilität stattgefunden hat oder nicht
Felder bei Daten auf Sicherheitsebene			
Trigger-Bewertungen/Quoten	Dynamisch	Y/N	Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten? Status von verschiedenen Verzugs-, Verwässerungs-, Ausfall-, Verlust- und vergleichbaren sicherheitsbezogenen Bewertungen und Quoten in Verbindung mit der vorzeitigen Tilgung oder anderen Trigger-Ereignissen zum aktuellen Feststellungsdatum
Durchschnittliche konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	Dynamisch	Numerisch	Der Bericht sollte die durchschnittliche konstante vorzeitige Rückzahlungsrate der zugrunde liegenden Kredite beinhalten. Diese Rückzahlungsrate entspricht dem Betrag, der als annualisierter Prozentsatz des Kapitals ausgedrückt wird, das über die planmäßigen Rückzahlungen hinaus vorzeitig zurückgezahlt wird. Sie wird durch Division des aktuellen Kreditkapitalsaldos (d. h. des tatsächlichen Saldos) durch den planmäßigen Kreditkapitalsaldo berechnet, wobei davon ausgegangen wird, dass keine vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. nur planmäßige Rückzahlungen) vorgenommen wurden. Dieser Quotient wird dann potenziert, wobei der Exponent der Zahl 12 dividiert durch die Anzahl der Monate seit Emission entspricht. Dieses Ergebnis wird dann von 1 abgezogen und mit Hundert (100) multipliziert, um die durchschnittliche konstante vorzeitige Rückzahlungsrate zu berechnen.
Felder für die Kontaktinformationen für Transaktionsberichte			
Kontakt	Statisch	Text	Name der Abteilung oder der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Felder auf Tranchenebene			
Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von Anleihen mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Wertpapierkennnummer, die jeder KMU-Klasse gemäß den Standards zugewiesen wird, die durch die International Standards Organisation (ISIN) festgelegt wurden, oder sonstige Wertpapierkennnummer, die von einer Börse oder einem sonstigen Unternehmen zugewiesen wurde

Feldname	Statisch/ dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Periodisches Datum, an dem eine Zinszahlung an Inhaber einer bestimmten Tranche von Anleihen planmäßig erfolgt.
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	Datum	Letztes periodisches Datum, an dem eine Kapitalzahlung an Inhaber einer bestimmten Tranche von Anleihen planmäßig erfolgt
Währung der Anleihe	Statisch	Text	Währungsfestlegung der Anleihe
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen (z. B. Euribor 3 Monate), der für eine bestimmte Tranche von Anleihen gilt
Gesetzliche Fälligkeit	Statisch	Datum	Datum, an dem eine bestimmte Anleihetranche zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Anleiheemissionsdatum	Statisch	Datum	Datum, an dem die Anleihen ausgegeben wurden

ANHANG IV

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch Automobilkredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

VERMÖGENSWERTE

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
----------	--------------------	----------	-------------------------------

Transaktionsspezifische Angaben

Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios. Dies ist das Datum, auf das sich die zugrunde liegenden Anlagedaten innerhalb des Berichts beziehen.
Pool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Kennung des Pools oder Portfolios/Name der Transaktion
Name des Servicers	Dynamisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung pro Servicer, um anzugeben, welches Unternehmen den Kredit oder das Leasing verwaltet
Name des Backup-Servicers	Dynamisch	Text	Name des Backup-Servicers

Angaben auf Kredit- oder Leasingebene

Kredit- oder Leasingkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für den Kredit oder das Leasing. Die Kennung sollte sich während der Laufzeit der Transaktion nicht ändern.
Originator	Statisch	Text	Kreditgeber, der den ursprünglichen Kredit oder das ursprüngliche Leasing vergeben hat
Kreditnehmerkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für den Kredit- oder Leasingnehmer
Gruppenunternehmenskennung	Dynamisch	Text	Eindeutige Gruppenunternehmenskennung zur Bestimmung des Mutterunternehmens des Kreditnehmers
Währungsfestlegung des Kredits oder Leasings	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits oder Leasings
Beschäftigungsstatus des Kreditnehmers	Statisch	Liste	Beschäftigungsstatus des primären Antragstellers
Primäreinkommen	Statisch	9(11).99	Übernommenes jährliches Brutto-Primäreinkommen des Kreditnehmers
Währung des Primäreinkommens	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Einkommens
Tilgungsart	Dynamisch	Liste	Tilgungsart
Einkommensüberprüfung für Primäreinkommen	Statisch	Liste	Einkommensüberprüfung für das Primäreinkommen
Geografische Region	Statisch	Liste	Region, in der der Kreditnehmer zum Zeitpunkt des Abschlusses ansässig ist

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Vergabedatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum der ursprünglichen Kreditvergabe oder des Leasingbeginns
Voraussichtliche Kredit- oder Leasingfälligkeit	Dynamisch	JJJJ-MM	Voraussichtliches Fälligkeitsdatum des Kredits oder Ablaufdatum des Leasings
Ursprüngliche Kredit- oder Leasinglaufzeit	Statisch	Numerisch	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate)
Pool-Transferdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum, an dem der Kredit oder das Leasing an die Zweckgesellschaft (SPV) transferiert wurde
Ursprünglicher Kapitalsaldo	Statisch	9(11).99	Ausstehender Kreditsaldo des Kreditnehmers oder diskontierter Leasingsaldo (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Vergabe
Aktueller ausstehender Saldo	Dynamisch	9(11).99	Ausstehender Saldo des Kredits oder diskontierter Saldo des Leasings des Kreditnehmers zum Cut-Off-Datum des Pools. Dies sollte sämtliche Beträge umfassen, die gegen das Fahrzeug besichert sind. Wenn dem Saldo beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Transaktion sind, sollten diese hinzuge-rechnet werden.
Planmäßige Zahlungsfälligkeit	Dynamisch	9(11).99	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit (Zahlungsfälligkeit, sofern keine anderen Zahlungsvereinbarungen gelten).
Planmäßige Zahlungshäufigkeit	Dynamisch	Liste	Planmäßige Zahlungshäufigkeit.
Anzahlungsbetrag	Statisch	9(11).99	Höhe der Anzahlung bei Vergabe des Kredits oder Leasings (dies sollte den Wert von in Zahlung genommenen Fahrzeugen usw. einschließen)
Ursprüngliche Beleihung	Statisch	9(3).99	Beleihung des Fahrzeugs bei Vergabe; kann auf die nächsten 5 Prozent gerundet werden
Produktart	Statisch	Liste	Produktart
Preis bei Kaufoption	Statisch	9(11).99	Betrag, den der Kreditnehmer am Ende des Leasings oder Kredits zahlen muss, um das Fahrzeug zu übernehmen
Zinsanpassungsintervall	Statisch	9(2).99	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei dem Kredit oder Leasing
Aktueller Zins- oder Diskontsatz	Dynamisch	9(4).9(5)	Aktueller Gesamtzinssatz oder -diskontsatz (%), der auf den Kredit oder das Leasing anwendbar ist (kann auf das nächste halbe Prozent gerundet werden)
Aktuelle Zinssatzbasis	Dynamisch	Liste	Aktuelle Zinssatzbasis

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktuelle Zinsmarge	Dynamisch	9(4).9(5)	Aktuelle Zinsmarge (%) des Kredits oder Leasings (kann auf das nächste halbe Prozent gerundet werden). Bei fest verzinslichen Krediten entspricht dies dem aktuellen Zins- oder Diskontsatz. Bei variabel verzinslichen Darlehen ist dies die Marge über dem Indexsatz (oder unter dem Indexsatz, in welchem Fall dies als negativ anzugeben ist).
Diskontsatz	Statisch	9(4).9(5)	Diskontsatz, der beim Veräußerer an die Zweckgesellschaft (SPV) auf die Forderung angewandt wurde (kann auf das nächste halbe Prozent gerundet werden)
Fahrzeughersteller	Statisch	Text	Markenname des Fahrzeugherstellers
Fahrzeugmodell	Statisch	Text/Numerisch	Name des Fahrzeugmodell.
Neu- oder Gebrauchtfahrzeug	Statisch	Liste	Zustand des Fahrzeugs zum Zeitpunkt der Kredit- oder Leasingvergabe
Ursprünglicher Restwert des Fahrzeugs	Statisch	9(11).99	Geschätzter Restwert des Fahrzeugs am Datum der Kredit- oder Leasingvergabe. Angabe kann gerundet werden.
Verbriefter Restwert	Statisch	9(11).99	Restwert, der lediglich verbrieft wurde. Angabe kann gerundet werden.
Aktualisierter Restwert des Fahrzeugs	Dynamisch	9(11).99	Letzter geschätzter Restwert des Fahrzeugs am Vertragsende. Angabe kann gerundet werden.
Datum der aktualisierten Restwertbestimmung des Fahrzeugs	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die letzte aktualisierte Schätzung des Restwerts des Fahrzeugs durchgeführt wurde. Falls keine Aktualisierung erfolgt ist, ist das Datum der ursprünglichen Bewertung anzugeben.
Kudentyp	Statisch	Liste	Rechtsform des Kunden
Zahlungsmethode	Dynamisch	Liste	Gewöhnliche Zahlungsmethode (kann auf der letzten eingegangenen Zahlung basieren)
Streichungsdatum aus Pool	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem der Kredit oder das Leasing aus dem Pool gestrichen wurden, z. B. bei Rückkauf, Tilgung, vorzeitiger Rückzahlung oder Einziehungsende
Zinscap	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Obergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Obergrenze hier anzugeben (Prozentzeichen nicht eingeben).
Zinsfloor	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Untergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Untergrenze hier anzugeben (Prozentzeichen nicht eingeben).
Rückstandssaldo	Dynamisch	9(11).99	Aktueller Saldo der Rückstände
Rückstand in Monaten	Dynamisch	9(5).99	Anzahl der Monate, mit denen dieser Kredit oder dieses Leasing zum Cut-Off-Datum des Pools im Rückstand ist

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Ausfalldatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum des Ausfalls
Ausfallbetrag (brutto)	Dynamisch	9(11).99	Bruttoausfallbetrag bei diesem Konto
Veräußerungspreis	Dynamisch	9(11).99	
Veräußerungsverlust	Dynamisch	9(11).99	Bruttoausfall abzüglich der Veräußerungserlöse (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet)
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	9(11).99	Kumulierte Rückflüsse bei diesem Konto ohne Kosten
Tilgungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Konto getilgt wurde, oder Datum, an dem die Einziehung bei notleidenden Krediten abgeschlossen wurde
Restwertverluste	Dynamisch	9(11).99	Restwertverlust bei Rückgabe des Fahrzeugs
Kontostatus	Dynamisch	Liste	Aktueller Status des Kontos

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
----------	--------------------	----------	-------------------------------

Angaben auf Anleiheebene

Berichtsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem der Transaktionsbericht ausgegeben wurde, d. h. Datum der Absendung des ausgefüllten Bogens für Daten auf Anleiheebene an das Datenregister
Emittent	Statisch	Text	Name des Emittenten und Emissionsserie, falls zutreffend
Alle Rückstellungskonten mit Zielsaldo	Dynamisch	Y/N	Befinden sich alle Rückstellungskonten (Barreserve, Commingling Reserve, Set-Off-Reserve usw.) auf den geforderten Niveaus?
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Wurde die Liquiditätsfazilität genutzt, um Ausfälle in der am letzten Zinszahlungsdatum endenden Periode abzudecken?
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten?
Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsquote	Dynamisch	9(3).99	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsquote (CPR) der zugrunde liegenden Forderungen basierend auf der letzten periodischen CPR. Die periodische CPR entspricht der Summe der außerplanmäßigen Kapitalzahlungen in der letzten Periode dividiert durch den Kapitalsaldo am Anfang der Periode.
Summe der an SPV veräußerten Forderungen	Dynamisch	9(11).99	Gesamtkapitalbetrag der Forderungen, die bis dato an die Zweckgesellschaft (SPV) veräußert wurden (d. h. bei Abschluss und während der Wiederbeschaffungsperiode, falls zutreffend)

Feldname	Statisch/dynamisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Kumulierte Bruttoausfälle — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Bruttoausfälle seit Abschluss als Währungsbetra.
Kumulierte Rückflüsse — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Rückflüsse seit Abschluss ohne Kosten als Währungsbetrag
Enddatum der revolvierenden Periode	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die revolvierende Periode voraussichtlich endet oder tatsächlich geendet hat

Kontaktinformationen für Transaktionsberichte

Kontakt	Statisch	Text/Numerisch	Name der Abteilung und der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text/Numerisch	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Dynamisch/ Statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
----------	---------------------	----------	-------------------------------

Angaben auf Tranchenebene

Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von Anleihen mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Internationale Wertpapierkennnummer oder -nummern oder, falls keine ISIN, eine andere eindeutige Wertpapiernummer wie beispielsweise CUSIP, die dieser Tranche durch eine Börse oder ein sonstiges Unternehmen zugewiesen wurde. Im Falle mehrerer Nummern sind diese durch Kommata zu trennen.
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Zinszahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Kapitalzahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Währung der Anleihe	Statisch	Liste	Währungsfestlegung dieser Tranche
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen (z. B. Euribor 3 Monate), der für diese spezifische Tranche gilt
Gesetzliche Fälligkeit	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, vor dem diese spezifische Tranche zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Anleiheemissionsdatum	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem die Anleihen ausgegeben wurden.
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der bei dieser Tranche Zinsen fällig sind

ANHANG V

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch Verbraucherkredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

VERMÖGENSWERTE

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Transaktionsspezifische Angaben			
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios. Dies ist das Datum, auf das sich die zugrunde liegenden Anlagedaten innerhalb des Berichts beziehen.
Pool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Kennung des Pools oder Portfolios/Name der Transaktion
Name des Servicers	Dynamisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung pro Servicer, um anzugeben, welches Unternehmen den Kredit verwaltet
Name des Backup-Servicers	Dynamisch	Text	Name des Backup-Servicers
Angaben auf Kreditebene			
Kreditkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für einen bestimmten Kredit in dem Pool
Originator	Statisch	Text	Kreditgeber, der den ursprünglichen Kredit vergeben hat
Kreditnehmerkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für einen Kreditnehmer. Dies muss verschlüsselt werden (d. h. nicht die tatsächliche Identifikationsnummer ist anzugeben), um die Anonymität des Kreditnehmers sicherzustellen.
Währungsfestlegung des Kredits	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Kredits
Gesamtkreditlimit	Dynamisch	9(11).99	Bei Krediten mit flexiblen Neuzeichnungs-/Revolvierungseigenschaften — maximaler Kreditbetrag, der potenziell ausstehend sein könnte
Revolvierendes Enddatum — Kredit	Dynamisch	JJJJ-MM	Bei Krediten mit Neuzeichnungs-/Revolvierungseigenschaften — Datum, an dem die flexiblen Eigenschaften voraussichtlich auslaufen, d. h. wann die revolvierende Periode endet
Beschäftigungsstatus des Kreditnehmers	Statisch	Liste	Beschäftigungsstatus des primären Antragstellers
Primäreinkommen	Statisch	9(11).99	Übernommenes jährliches Brutto-Primäreinkommen des Kreditnehmers (ohne Miete). Sollte auf die nächsten 1 000 Einheiten gerundet werden.
Währung des Primäreinkommens	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Einkommens
Einkommensüberprüfung für Primäreinkommen	Statisch	Liste	Einkommensüberprüfung für das Primäreinkommen
Geografische Region	Statisch	Liste	Region, in der der Kreditnehmer ansässig ist
Vergabedatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum der ursprünglichen Kreditvergabe

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Voraussichtliche Kreditfälligkeit	Dynamisch	JJJJ-MM	Voraussichtliches Fälligkeitsdatum des Kredits
Ursprüngliche Kreditlaufzeit	Statisch	Numerisch	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate)
Pool-Transferdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum, an dem der Kredit an die Zweckgesellschaft (SPV) transferiert wurde
Ursprünglicher Kapitalsaldo	Statisch	9(11).99	Ursprünglicher Kapitalsaldo des Kredits (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Vergabe
Aktueller ausstehender Kapitalsaldo	Dynamisch	9(11).99	Ausstehender Kapitalsaldo des Kredits zum Cut-Off-Datum des Pools. Ausgenommen Zinsrückstände oder Strafsummen
Planmäßige Zahlungsfälligkeit	Dynamisch	9(11).99	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit (Zahlungsfälligkeit, sofern keine anderen Zahlungsvereinbarungen gelten)
Planmäßige Zahlungshäufigkeit	Dynamisch	Liste	Zahlungshäufigkeit
Rückzahlungsmethode	Dynamisch	Liste	Art der Kapitalrückzahlung
Zinsanpassungsintervall	Statisch	9(2).99	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen
Aktueller Zinssatz	Dynamisch	9(4).9(8)	Aktueller Gesamtzinssatz (%), der auf den Kredit anwendbar ist. Prozentzeichen nicht eingeben.
Aktuelle Zinssatzbasis	Dynamisch	Liste	Aktuelle Zinssatzbasis
Aktuelle Zinsmarge	Dynamisch	9(4).9(5)	Aktuelle Zinsmarge (%), die auf den Kredit anwendbar ist. Bei fest verzinslichen Krediten entspricht dies dem aktuellen Zins- oder Diskontsatz.
Anzahl der Kreditnehmer	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Kreditnehmer bei dem Kredit
Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen	Dynamisch	9(3).99	Höchster Prozentsatz des ausstehenden Saldos, der jährlich als vorzeitige Rückzahlung zulässig ist, ohne dass eine Vorfälligkeitsentschädigung anfällt. Prozentzeichen nicht eingeben.
Gebühren bei vorzeitiger Rückzahlung	Dynamisch	9(3).99	Prozentsatz des ausstehenden Saldos, der bei Überschreiten der Vorfälligkeitsgrenze als Gebühr zahlbar ist. Prozentzeichen nicht eingeben.
Kundentyp	Statisch	Liste	Kundentyp bei Vergabe
Zahlungsmethode	Dynamisch	Liste	Gewöhnliche Zahlungsmethode (kann auf der letzten eingegangenen Zahlung basieren)
Datum der Streichung aus Pool	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem der Kredit aus dem Pool gestrichen wurde, z. B. bei Rückkauf, Tilgung, vorzeitiger Rückzahlung oder Einziehungsende
Angestellter	Statisch	Y/N	Ist der Kreditnehmer ein Angestellter des Originators?

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Zinsscap	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Obergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Obergrenze hier anzugeben.
Zinsfloor	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Untergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Untergrenze hier anzugeben.

Angaben zur Performance

Rückstandssaldo	Dynamisch	9(11).99	Aktueller Saldo im Rückstand, definiert als Summe der Mindestzahlungen, die vertragsgemäß fällig sind, aber vom Kreditnehmer nicht geleistet wurden
Rückstand in Monaten	Dynamisch	9(5).99	Anzahl der Monate, mit denen dieser Kredit zum Cut-Off-Datum des Pools im Rückstand ist
Ausfalldatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum des Ausfalls
Ausfallbetrag (brutto)	Dynamisch	9(11).99	Bruttoausfallbetrag bei diesem Konto
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	9(11).99	Kumulierte Rückflüsse bei diesem Konto ohne Kosten
Tilgungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Konto getilgt wurde, oder Datum, an dem die Einziehung bei notleidenden Krediten abgeschlossen wurde
Kontostatus	Dynamisch	Liste	Aktueller Status des Kontos
Saldo der kapitalisierten Rückstände	Dynamisch	9(11).99	Summe der bis dato kapitalisierten Rückstände
Datum der letzten Kapitalisierung der Rückstände	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die Rückstände bei diesem Konto zuletzt kapitalisiert wurden

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
----------	------------------------	----------	-------------------------------

Angaben auf Wertpapier- oder Anleiheebene

Berichtsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem der Transaktionsbericht ausgegeben wurde, d. h. Datum der Absendung des ausgefüllten Bogens für Daten auf Anleiheebene an das Datenregister
Emittent	Statisch	Text	Name des Emittenten und Emissionsserie, falls zutreffend
Alle Rückstellungskonten mit Zielsaldo	Dynamisch	Y/N	Befinden sich alle Rückstellungskonten (Barreserve, Commingling Reserve, Set-Off-Reserve usw.) auf den geforderten Niveaus?
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Wurde die Liquiditätsfazilität genutzt, um Ausfälle in der am letzten Zinszahlungsdatum endenden Periode abzudecken?

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Trigger-Bewertungen/Quoten	Dynamisch	Y/N	Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten?
Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	Dynamisch	9(3).99	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsquote (CPR) der zugrunde liegenden Forderungen basierend auf der letzten periodischen CPR. Die periodische CPR entspricht der Summe der außerplanmäßigen Kapitalzahlungen in der letzten Periode dividiert durch den Kapitalsaldo am Anfang der Periode. Dies wird wie folgt annualisiert: $1 - ((1 - \text{Periodische CPR})^{\text{Anzahl der Perioden in einem Jahr}})$ Prozentzeichen nicht angeben.
Summe der an SPV veräußerten Forderungen	Dynamisch	9(11).99	Gesamtkapitalbetrag der Forderungen, die bis dato an die Zweckgesellschaft (SPV) veräußert wurden (d. h. bei Abschluss und während der Wiederbeschaffungsperiode, falls zutreffend)
Kumulierte Bruttoausfälle — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Bruttoausfälle seit Abschluss als Währungsbetrag
Kumulierte Rückflüsse — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Rückflüsse in den Pool seit Abschluss ohne Kosten als Währungsbetrag
Enddatum der revolvierenden Periode	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die revolvierende Periode voraussichtlich endet oder tatsächlich geendet hat

Kontaktinformationen für Transaktionsberichte

Kontakt	Statisch	Text/Numerisch	Name der Abteilung und der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text/Numerisch	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben auf Tranchenebene			
Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von Anleihen mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Internationale Wertpapierkennnummer oder -nummern oder, falls keine ISIN, eine andere eindeutige Wertpapiernummer wie beispielsweise CUSIP, die dieser Tranche durch eine Börse oder ein sonstiges Unternehmen zugewiesen wurde. Im Falle mehrerer Nummern sind diese durch Kommata zu trennen.
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Zinszahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist

Feldname	Dynamisch/ statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Kapitalzahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Währung der Anleihe	Statisch	Liste	Währungsfestlegung dieser Tranche
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen, der für diese spezifische Tranche gilt
Gesetzliche Fälligkeit	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, bis zu dem diese spezifische Tranche vollständig zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Emissionsdatum der Anleihen	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem die Anleihen ausgegeben wurden
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der bei dieser Tranche Zinsen fällig sind

ANHANG VI

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch Kreditkartenkredite besicherte strukturierte Finanzinstrumente

VERMÖGENSWERTE

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Transaktionsspezifische Angaben			
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios. Dies ist das Datum, auf das sich die zugrunde liegenden Anlagedaten innerhalb des Berichts beziehen.
Pool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Kennung des Pools oder Portfolios, z. B. Master Issuer plc oder SPV 2012-1 plc
Name des Servicers	Statisch	Text/Numerisch	Name des Servicers für das Konto
Name des Backup-Servicers	Dynamisch	Text/Numerisch	Name des Backup-Servicers
Veräußerer	Statisch	Text/Numerisch	Name des Veräußerers
Transaktionsart	Statisch	Liste	Eigenständig, Master Trust — Capitalist, Master Trust — Socialist oder Sonstige
Angaben auf Kreditebene			
Kontokennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für ein bestimmtes Konto in dem Pool; muss aus Datenschutzgründen verschlüsselt werden
Originator	Statisch	Text/Numerisch	Kreditgeber, der das Konto vergeben hat. Falls unbekannt, ist der Veräußerer anzugeben.
Kreditnehmerkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für einen bestimmten Kreditnehmer in dem Pool; muss aus Datenschutzgründen verschlüsselt werden. Dies kann mit der Kontokennung identisch sein.
Währungsfestlegung der Forderung	Statisch	Liste	Währung, in der die Forderung festgelegt ist
Pool-Transferdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Konto in den Pool transferiert wurde
Beschäftigungsstatus des Kreditnehmers	Statisch	Liste	Liste
Währung des Primäreinkommens	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Primäreinkommens
Einkommensüberprüfung für Primäreinkommen	Statisch	Liste	Einkommensüberprüfung für das Primäreinkommen
Geografische Region	Dynamisch	Liste	Region, in der der Kreditnehmer ansässig ist
Angestellter	Statisch	Y/N	Ist der Kreditnehmer ein Angestellter des Originators oder Veräußerers?
Kontoeröffnungsdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Konto eröffnet wurde

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Aktueller Gesamtsaldo	Dynamisch	9(11).99	Wie hoch ist der aktuelle Gesamtbetrag, den der Kreditnehmer bei dem Konto schuldet (einschließlich aller Gebühren und Zinsen)?
Gesamtkreditlimit	Dynamisch	9(11).99	Wie hoch ist das Kreditlimit des Kreditnehmers bei dem Konto?
Planmäßige Zahlungshäufigkeit	Dynamisch	Liste	Mit welcher Mindesthäufigkeit muss der Kreditnehmer Zahlungen leisten, wenn ein ausstehender Saldo besteht?
Nächste vertragliche Mindestzahlung	Dynamisch	9(11).99	Nächste planmäßige Mindestzahlung, die vom Kreditnehmer zu leisten ist
Aktueller gemischter Betrag	Dynamisch	9(3).99	Gewichteter durchschnittlicher Gesamtertrag, einschließlich aller anwendbaren Gebühren am letzten Rechnungsdatum (d. h. dies wird in Rechnung gestellt, keine Barrendite) (%)
Aktuelle Zinssatzbasis	Dynamisch	Liste	Aktuelle Zinssatzbasis
Kontostatus	Dynamisch	Liste	Aktueller Status des Kontos
Rückstandssaldo	Dynamisch	9(11).99	Aktueller Saldo im Rückstand, definiert als Summe der Mindestzahlungen, die vertragsgemäß fällig sind, aber vom Kreditnehmer nicht geleistet wurden
Saldo der kapitalisierten Rückstände	Dynamisch	9(11).99	Summe der bis dato kapitalisierten Rückstände
Datum der letzten Kapitalisierung der Rückstände	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die Rückstände bei dieser Kreditkarte zuletzt kapitalisiert wurden
Rückstand in Tagen	Dynamisch	Numerisch	Anzahl der Monate, mit denen das Konto zum Cut-Off-Datum des Pools im Rückstand ist
Zahlungsmethode	Dynamisch	Liste	Gewöhnliche Zahlungsmethode (kann auf der letzten eingegangenen Zahlung basieren)
Abbuchungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum des Ausfalls
Ursprünglicher Ausbuchungsbetrag	Dynamisch	9(11).99	Gesamtsaldo auf dem Konto am Ausbuchungsdatum
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	9(11).99	Kumulierte Rückflüsse — nur bei Konten mit Ausbuchung relevant. Bei Konten ohne Ausbuchung ist 0 anzugeben.

ANGABEN ZU POOL UND ANLEIHE

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Daten auf Sicherheitsebene (für alle Strukturen auszufüllen)			
Bruttoausbuchungen in der Periode	Dynamisch	9(11).99	Nennwert der Bruttoausbuchungen (d. h. vor Rückflüssen) für die Periode. Ausbuchung gemäß Festlegung in der Transaktion oder alternativ gemäß üblicher Praxis des Kreditgebers

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Rückflüsse in der Periode	Dynamisch	9(11).99	Eingegangene Bruttore Rückflüsse während der Periode
Zahlungsrückstände 30-59 Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Zahlungsrückstände 60-89 Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Zahlungsrückstände 90-119 Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Zahlungsrückstände 120-149 Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Zahlungsrückstände 150-179 Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Zahlungsrückstände 180+ Tage %	Dynamisch	9(3).99	Basierend auf Gesamtsaldo der Forderungen, nicht auf Anzahl der Konten (%)
Verwässerungen	Dynamisch	9(11).99	Gesamtminderungen bei Kapitalforderungen während der Periode, d. h. einschließlich Betrugsklagen
Einnahmeneinziehungen in der Periode	Dynamisch	9(11).99	Einziehungen, die als Einnahmen behandelt werden, in der Periode
Kapitaleinziehungen in der Periode	Dynamisch	9(11).99	Einziehungen, die als Kapital behandelt werden, in der Periode
Trigger-Ereignis?	Dynamisch	Y/N	Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten, das noch offen ist? Beispielsweise Auszahlungsereignis, Trigger basierend auf Rating des Originators, Status oder Wert von Zahlungsrückständen, Ertrag, Verwässerungen, Ausfälle usw.
SPV Größe — Wert	Dynamisch	9(11).99	Nennwert aller Forderungen (Kapital und Gebühren), an denen der Trust oder die SPV am Cut-Off-Datum Eigentumsansprüche haben
SPV Größe — Anzahl der Konten	Dynamisch	9(11).99	Anzahl der Konten, bei denen der Trust oder die SPV am Cut-Off-Datum Eigentumsansprüche haben
SPV Größe — Wert — Nur Kapital	Dynamisch	9(11).99	Nennwert aller Forderungen (nur Kapital), an denen der Trust oder die SPV am Cut-Off-Datum Eigentumsansprüche haben
Forderungssaldo	Dynamisch	9(11).99	Nennwert aller forderungsbesicherten Schuldtitel, die durch die Forderungen in dem Trust oder in der SPV abgesichert sind
Anteil des Übertragenden %	Dynamisch	9(3).99	Tatsächlicher Anteil des Übertragenden an dem Trust, ausgedrückt als Prozentsatz
Zinsüberschuss	Dynamisch	9(11).99	Restbetrag nach Schuldverschreibungszinsen und Aufstockung von Kapitalrücklagen
Berichtsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem der Transaktionsbericht ausgegeben wurde

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben auf Serienebene (nur bei Master Trusts)			
Name der Serie	Statisch	Text/Numerisch	Name der Serie, falls Teile eines Master Trust
Anlegeranteil an dieser Serie am Periodenende (%)	Dynamisch	9(3).9(5)	Anteil des Anlegers an dieser Serie in dem Trust, ausgedrückt als Prozentsatz
Dieser Serie zugewiesene Einnahmen	Dynamisch	9(11).99	Einnahmen, die dieser Serie von dem Trust zugewiesen wurden
Zinsüberschuss	Dynamisch	9(11).99	Restbetrag, nachdem die Einziehungen während der Periode vollständig zur Deckung der Pflichten des Emittenten gemäß der einnahmenbezogenen Wasserfallstruktur in den Transaktionsunterlagen angewandt wurden

Kontaktinformationen für Transaktionsberichte

Kontakt	Statisch	Text/Numerisch	Name der Abteilung und der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text/Numerisch	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben auf Tranchenebene (nur für diese Serie)			
Name der Anleiheklasse	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von Anleihen mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, z. B. Serie 2012 Klasse A1a usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Internationale Wertpapierkennnummer oder -nummern oder, falls keine ISIN, eine andere eindeutige Wertpapiernummer wie beispielsweise CUSIP, die dieser Tranche durch eine Börse oder ein sonstiges Unternehmen zugewiesen wurde. Im Falle mehrerer Nummern sind diese durch Kommata zu trennen.
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Zinszahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Kapitalzahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Währung der Anleihe	Statisch	Liste	Währungsfestlegung dieser Tranche
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung im Prospekt oder in den endgültigen Bedingungen, die für diese spezifische Tranche gelten

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Gesetzliche Fälligkeit	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, bis zu dem diese spezifische Tranche vollständig zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Emissionsdatum der Anleihen	Statisch	JJJJ-MM-TT	Emissionsdatum dieser Anleihe
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der bei dieser Tranche Zinsen fällig sind
Name der Serie	Statisch	Text/Numerisch	Name der Serie, falls Teil eines Muster Trust. Falls eigenständig, ist die Poolkennung anzugeben.

ANHANG VII

Daten auf Kreditebene — Meldebogen für durch Privat- oder Firmenleasing besicherte strukturierte Finanzinstrumente

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Transaktionsspezifische Angaben			
Cut-Off-Datum des Pools	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Cut-Off-Datum des Pools oder Portfolios. Dies ist das Datum, auf das sich die zugrunde liegenden Anlagedaten innerhalb des Berichts beziehen.
Pool-Kennung	Statisch	Text/Numerisch	Kennung des Pools oder Portfolios/Name der Transaktion
Name des Servicers	Dynamisch	Text/Numerisch	Name des Servicers
Name des Backup-Servicers	Dynamisch	Text	Name des Backup-Servicers
Angaben auf Leasingebene			
Leasingkennung	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für jedes Leasing, die zur Gewährleistung der Anonymität verschlüsselt sein sollte. Die Leasingkennung sollte sich während der Laufzeit der Transaktion nicht ändern.
Originator	Statisch	Text	Kreditgeber, der das ursprüngliche Leasing vergeben hat. Wenn der ursprüngliche Originator nicht bekannt ist, beispielsweise im Falle von Zusammenschlüssen, ist der Name des Veräußerers anzugeben.
Kennung des Leasingnehmers	Statisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung für jeden Leasingnehmer, die zur Gewährleistung der Anonymität verschlüsselt sein sollte (nicht Angabe des wirklichen Namens), sodass Leasingnehmer mit mehreren Leasingverträgen in dem Pool angegeben werden können
Gruppenunternehmenskennung	Dynamisch	Text/Numerisch	Eindeutige Kennung des Gruppenunternehmens
Währungsfestlegung des Leasings	Statisch	Liste	Währungsfestlegung des Leasings
Land	Statisch	Liste	Land der ständigen Niederlassung des Leasingnehmers
Geografische Region	Statisch	Liste	Region, in der der Schuldner zum Zeitpunkt des Abschlusses ansässig ist
Rechtsform/Geschäftsart des Leasingnehmers	Statisch	Liste	Rechtsform des Leasingnehmers
Basel III-Segment des Kreditnehmers	Statisch	Liste	Unternehmen (1).
Verbunden mit Originator?	Statisch	Y/N	Ist der Kreditnehmer mit dem Originator verbunden?
Syndiziert?	Statisch	Y/N	Ist das Leasing syndiziert?

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Bankinternes Rating	Dynamisch	99(3).99	Bankinterne Einjahresausfallwahrscheinlichkeit
Letzte interne Ratingüberprüfung des Schuldners	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum der letzten Überprüfung des Schuldners, wie in „Bankinternes Rating“ angegeben
Bankinterne geschätzte Verlustquote bei Ausfall (LGD)	Dynamisch	9(3).99	Verlustquote bei Ausfall unter normalen Konjunkturbedingungen. Prozentzeichen nicht eingeben.
NACE-Branchencode	Statisch	Text/Numerisch	NACE-Code der Branche des Kreditnehmers
Subventioniert	Dynamisch	Y/N	Ist das Leasing subventioniert (nach Ihrem besten Wissen)?
Datum der Streichung aus Pool	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Leasing aus dem Pool gestrichen wurde, z. B. bei Rückkauf, Tilgung, vorzeitiger Rückzahlung oder Einziehungs-ende

Eigenschaften des Leasings

Leasingvergabedatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum der Leasingvergabe
Datum der Leasingfälligkeit	Dynamisch	JJJJ-MM	Voraussichtliches Ablaufdatum der Leasingfälligkeit
Pool-Transferdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Leasing an die Zweckgesellschaft transferiert wurde. Bei allen Leasings in dem Pool zum Cut-Off-Datum des Pools
Leasinglaufzeit	Statisch	99(4).99	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate)
Ursprünglicher Kapitalsaldo	Statisch	9(11).99	Ursprünglicher Kapital- (oder diskontierter) Saldo des Leasings (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Vergabe
Aktueller ausstehender Kapitalsaldo	Dynamisch	9(11).99	Ausstehender Kapital- (oder diskontierter) Saldo des Leasings zum Cut-Off-Datum des Pools, einschließlich Beträgen, die dem Leasing hinzugefügt wurden und Teil des Kapitals in der Transaktion sind
Verbriefter Restwert	Statisch	9(11).99	Restwert, der lediglich verbrieft wurde
Rückzahlungsmethode	Statisch	Liste	Art der Kapitalrückzahlung
Kapitalzahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der Kapitalzahlungen, d. h. Anzahl der Monate zwischen Zahlungen

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Anzahl der Monate zwischen Zahlungen
Zahlungsfälligkeit	Dynamisch	9(11).99	Nächste periodische vertragliche Zahlungsfälligkeit (Zahlungsfälligkeit, sofern keine anderen Zahlungsvereinbarungen gelten)
Preis bei Kaufoption	Statisch	9(11).99	Betrag, den der Leasingnehmer am Leasingende zahlen muss, um den Vermögenswert zu übernehmen; nicht der Betrag, der im Feld „Verbrieft Restwert“ angegeben wird
Anzahlungsbetrag	Statisch	9(11).99	Höhe der Anzahlung bei Vergabe des Leasings (dies sollte den Wert von in Zahlung genommenen Geräten usw. einschließen)
Tilgungsart	Dynamisch	Liste	Tilgungsart
Zahlungsmethode	Dynamisch	Liste	Gewöhnliche Zahlungsmethode (kann auf der letzten eingegangenen Zahlung basieren)
Produktart	Statisch	Liste	Einstufung des Leasings gemäß den Festlegungen des Leasinggebers.
Aktualisierter Restwert des Vermögenswerts	Dynamisch	9(11).99	Letzter prognostizierter Restwert des Vermögenswerts am Ende der Leasinglaufzeit. Angabe kann gerundet werden
Datum der aktualisierten Restwertbestimmung des Vermögenswerts	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die letzte aktualisierte Schätzung des Restwerts des Vermögenswerts durchgeführt wurde

Zinssatz

Zinsanpassungsintervall	Statisch	9(2).99	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen
Aktueller Zins- oder Diskontsatz	Dynamisch	9(4).9(5)	Aktueller Gesamtzinssatz (%) oder Diskontsatz, der auf das Leasing anwendbar ist
Aktuelle Zinssatzbasis	Dynamisch	Liste	Aktuelle Zinssatzbasis
Aktuelle Zinsmarge	Dynamisch	9(4).9(5)	Aktuelle Zinsmarge (%), die auf das Leasing anwendbar ist
Diskontsatz	Statisch	9(4).9(5)	Diskontsatz, der bei Veräußerung an die Zweckgesellschaft (SPV) angewandt wurde
Zinscap	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Obergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Obergrenze hier anzugeben.
Zinsfloor	Dynamisch	9(4).9(8)	Wenn eine Untergrenze für den Zinssatz gilt, der bei diesem Konto belastet werden kann, ist diese Untergrenze hier anzugeben.

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben zur Performance			
Rückstandssaldo	Dynamisch	9(11).99	Aktueller Saldo der Rückstände. Rückstände definiert als Summe der bis dato fälligen Zahlungen MINUS Summe der bis dato eingegangenen Zahlungen MINUS aktivierte Beträge. Dies sollte keine für das Konto geltenden Gebühren einschließen.
Rückstand in Monaten	Dynamisch	9(5).99	Anzahl der Monate, mit denen dieses Leasing im Rückstand ist (zum Cut-Off-Datum des Pools) gemäß Festlegung des Emittenten
Ausfall oder Zwangsvollstreckung bei Leasing	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob bei dem Leasing ein Ausfall oder eine Zwangsvollstreckung gemäß Festlegung in der Transaktion oder alternativ gemäß der gewöhnlichen Festlegung des Leasinggebers vorliegt
Ausfall oder Zwangsvollstreckung bei Leasing gemäß Festlegung in Basel III	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob bei dem Leasing ein Ausfall oder eine Zwangsvollstreckung gemäß Festlegung in Basel III vorliegt
Ausfallgrund (Festlegung in Basel III)	Dynamisch	Liste	Angabe des Ausfallgrunds entsprechend der Festlegung in Basel III
Ausfalldatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Ausfalldatum des Leasings gemäß Festlegung in der Transaktion oder alternativ gemäß der gewöhnlichen Festlegung des Leasinggebers
Ausfallbetrag	Dynamisch	9(11).99	Gesamtausfallbetrag (gemäß Festlegung in der Transaktion oder alternativ gemäß der gewöhnlichen Festlegung des Leasinggebers) vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen
Kumulierte Rückflüsse	Dynamisch	9(11).99	Kumulierte Rückflüsse bei diesem Konto ohne Kosten
Zugewiesene Verluste	Dynamisch	9(11).99	Verluste, die bis dato zugewiesen wurden.
Tilgungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem das Konto getilgt wurde, oder Datum, an dem die Einziehung bei notleidenden Leasings abgeschlossen wurde
Datum der Verlustzuweisung	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem der Verlust zugewiesen wurde.
Kontostatus	Dynamisch	Liste	Aktueller Status des Kontos
Rückstände vor 1 Monat	Dynamisch	9(11).99	Rückstandssaldo (definiert gemäß „Rückstandssaldo“) für den Vormonat
Rückstände vor 2 Monaten	Dynamisch	9(11).99	Rückstandssaldo (definiert gemäß „Rückstandssaldo“) vor zwei Monaten

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Klage	Dynamisch	Y/N	Angabe, ob ein Gerichtsverfahren anhängig ist (wenn das Konto vollständig beglichen wurde und nicht mehr Gegenstand eines Gerichtsverfahrens ist, sollte dies auf „N“ zurückgesetzt werden)
Veräußerungspreis	Dynamisch	9(11).99	Preis, der bei der Veräußerung des Vermögenswerts im Falle der Zwangsvollstreckung erzielt wurde, in der gleichen Währungsfestlegung wie das Leasing
Veräußerungsverlust	Dynamisch	9(11).99	Gesamtverlust ohne Gebühren, angefallene Zinsen usw. nach Anwendung der Veräußerungserlöse (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet)
Restwertverluste	Dynamisch	9(11).99	Restwertverlust bei Rückgabe des Vermögenswerts

Sicherheit

Land des Vermögenswerts	Statisch	Liste	Land, in dem sich der Vermögenswert befindet
Hersteller des Vermögenswerts	Statisch	Text	Name des Herstellers
Name/Modell des Vermögenswerts	Statisch	Text	Name des Vermögenswerts/Modell
Neuer oder gebrauchter Vermögenswert	Statisch	Liste	Zustand des Vermögenswerts zum Zeitpunkt der Leasingvergabe
Ursprünglicher Restwert des Vermögenswerts	Statisch	9(11).99	Geschätzter Restwert des Vermögenswerts am Datum der Leasingvergabe
Art des Vermögenswerts	Statisch	Liste	Art des Vermögenswerts
Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Statisch	9(11).99	Bewertung des Vermögenswerts zum Zeitpunkt der Leasingvergabe
Ursprünglicher Bewertungstyp	Statisch	Liste	Bewertungstyp bei Leasingvergabe
Ursprüngliches Bewertungsdatum	Statisch	JJJJ-MM	Datum der Bewertung des Vermögenswerts bei Vergabe
Aktualisierter Bewertungsbetrag	Dynamisch	9(11).99	Letzte Bewertung des Vermögenswerts
Aktualisierter Bewertungstyp	Dynamisch	Liste	Bewertungstyp am letzten Bewertungsdatum
Aktualisiertes Bewertungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum der letzten Bewertung des Vermögenswerts. Falls seit der Vergabe keine erneute Bewertung erfolgt ist, ist das ursprüngliche Bewertungsdatum anzugeben.

ANGABEN ZUR ANLEIHE

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben auf Wertpapier- oder Anleiheebene			
Berichtsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem der Transaktionsbericht ausgegeben wurde, d. h. Datum der Absendung des ausgefüllten Bogens für Daten auf Anleiheebene an das Datenregister
Emittent	Statisch	Text	Name des Emittenten und Emissionsserie, falls zutreffend
Alle Rückstellungskonten mit Zielsaldo	Dynamisch	Y/N	Befinden sich alle Rückstellungskonten (Barreserve, Commingling Reserve, Set-Off-Reserve usw.) auf den geforderten Niveaus?
Ziehungen unter Liquiditätsfazilität	Dynamisch	Y/N	Wurde die Liquiditätsfazilität genutzt, um Ausfälle in der am letzten Zinszahlungsdatum endenden Periode abzudecken?
Trigger-Bewertungen/Quoten	Dynamisch	Y/N	Ist ein Trigger-Ereignis eingetreten?
Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	Dynamisch	9(3).99	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsquote (CPR) der zugrunde liegenden Forderungen basierend auf der letzten periodischen CPR. Die periodische CPR entspricht der Summe der außerplanmäßigen Kapitalzahlungen in der letzten Periode dividiert durch den Kapitalsaldo am Anfang der Periode.
Summe der an SPV veräußerten Forderungen	Dynamisch	9(11).99	Gesamtkapitalbetrag der Forderungen, die bis dato an die Zweckgesellschaft (SPV) veräußert wurden (d. h. bei Abschluss und während der Wiederbeschaffungsperiode, falls zutreffend)
Kumulierte Bruttoausfälle — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Bruttoausfälle seit Abschluss als Währungsbetrag
Kumulierte Rückflüsse — Pool	Dynamisch	9(11).99	Summe aller Bruttoausfälle seit Abschluss als Währungsbetrag
Enddatum der revolvingen Periode	Dynamisch	JJJJ-MM	Datum, an dem die revolvingen Periode voraussichtlich endet oder tatsächlich geendet hat

Kontaktinformationen für Transaktionsberichte

Kontakt	Statisch	Text/Numerisch	Name der Abteilung und der Kontaktperson(en) der Informationsquellen
Kontaktinformationen	Statisch	Text/Numerisch	Telefonnummer und E-Mail-Adresse

ANGABEN ZUR ANLEIHE NACH TRANCHE

Feldname	Dynamisch/statisch	Datentyp	Felddefinition und -kriterien
Angaben auf Tranchenebene			
Name der Anleihekategorie	Statisch	Text/Numerisch	Bezeichnung (normalerweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) einer Tranche von Anleihen mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften gemäß der Festlegung im Prospekt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.
Internationale Wertpapierkennnummer (ISIN)	Statisch	Text/Numerisch	Internationale Wertpapierkennnummer oder -nummern oder, falls keine ISIN, eine andere eindeutige Wertpapiernummer wie beispielsweise CUSIP, die dieser Tranche durch eine Börse oder ein sonstiges Unternehmen zugewiesen wurde
Zinszahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Zinszahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Kapitalzahlungsdatum	Dynamisch	JJJJ-MM-TT	Erstes Datum nach Meldung des Cut-Off-Datums des Pools, an dem die Ausschüttung von Kapitalzahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist
Währung der Anleihe	Statisch	Liste	Währungsfestlegung dieser Tranche
Referenzsatz	Statisch	Liste	Grundlegender Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen, der für diese spezifische Tranche von Anleihen gilt
Gesetzliche Fälligkeit	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, vor dem diese spezifische Tranche zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten
Emissionsdatum der Anleihen	Statisch	JJJJ-MM-TT	Datum, an dem die Anleihen ausgegeben wurden
Zinszahlungshäufigkeit	Statisch	Liste	Häufigkeit, mit der bei dieser Tranche Zinsen fällig sind

ANHANG VIII

Investorenberichte

Die Investorenberichte enthalten folgende Informationen:

- a) Performance des Vermögenswerts;
 - b) ausführliche Zuordnung der Zahlungsströme;
 - c) Liste aller Trigger der Transaktion und deren Status;
 - d) Liste aller an einer Transaktion beteiligten Gegenparteien, deren Rolle und Ratings;
 - e) Angaben zu den Geldmitteln, die vom Originator/Sponsor in die Transaktion eingebracht wurden, sowie zu sonstiger Unterstützung für die Transaktion, einschließlich Inanspruchnahme oder Nutzung von Liquiditäts- oder Kredithilfe sowie Unterstützung, die von Dritten bereitgestellt wird;
 - f) Beträge, die garantierten Beteiligungsverträgen und sonstigen Bankkonten gutgeschrieben wurden;
 - g) Angaben zu Swaps (z. B. Sätze, Zahlungen und Nominalwerte) und sonstige Absicherungsvereinbarungen für die Transaktion, einschließlich Buchung zugehöriger Sicherheiten;
 - h) Begriffsbestimmungen für zentrale Begriffe (wie z. B. Zahlungsrückstände, Ausfälle und vorzeitige Rückzahlungen);
 - i) LEI, ISIN und sonstige Wertpapier- oder Unternehmenskennungen des Emittenten und des strukturierten Finanzinstruments;
 - j) Kontaktdaten des Unternehmens, das den Investorenbericht erstellt.
-