DEUTSCHE BUNDESBANK EUROSYSTEM

MFI-Nummer _____

Kreditinstitut _____

Adresse _____

_____

MACCs

Deutsche Bundesbank
Zentralbereich Märkte
Kreditforderungsmanagement
Postfach 11 12 32
60047 Frankfurt

MACCs (Mobilisation and Administration of Credit Claims) Nutzung eines Sekundären Bonitätsbeurteilungssystems - Mitteilung über Rangstufen und Ausfallwahrscheinlichkeiten eines IRB-Ratings

Das in MACCs als Sekundäres Bonitätsbeurteilungssystem für notenbankfähige Sicherheiten verwendete, auf unserem internen Ratingsystem basierende IRB-Bonitätsbeurteilungsverfahren verfügt über die auf Seite 2 dieses Vordrucks dargelegten Ratingstufen.

Dabei beginnt unsere Ratingskala in Position 1 mit „PD bis“ 0,01 und endet in der letzten individuellen Institutsposition mit „PD bis“ 100,00.

Bitte ankreuzen, falls zutreffend:

☐ Da in unserem IRB-System keine Rangstufen, sondern individuelle Ausfallwahrscheinlichkeiten vorliegen, haben wir zehn „Rangstufen“ für den notenbankfähigen Bereich eingetragen mit einer PD von 0,01 bis 0,10 im Abstand von jeweils einem Basispunkt sowie eine Rangstufe für den nicht notenbankfähigen Bereich mit einer PD bis 100,00.

Ort, Datum

Firma/Firmenstempel und Unterschrift(en)

MFI-Nummer _____

Kreditinstitut _____

Adresse _____

_____

Ratingskala

Rangstufe	Ausfallwahrscheinlich-keit in Prozent p.a.	Bezeichnung
	PD bis	
1		
2		
3		
4		
5		
6		
7		
8		
9		
10		
11		
12		
13		
14		
15		
16		
17		
18		
19		
20		
21		
22		
23		
24		
25		
26		
27		
28		
29		
30		