



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

GROMIKV REPORTING FENION GMBH



Stefan Fischer MSc

Managing Partner
Mobile: +43 664 49 79 111



Mag. Nikolaus Sernetz

Managing Partner
Mobile: +43 664 39 39 993



DI Alexander Adamenko

Managing Partner
Mobile: +43 660 70 58 943



Die Großkredit- und Millionenkreditverordnung (GroMiKV) ist eine Verordnung des Bundesministeriums für Finanzen für Kredit- und Finanzdienstleistungsinstitute. Für die Meldung der Großkredite an die Aufsicht, ist ein eigenes GroMiKV Template zu befüllen, in welchem die Konzernverflechtungen dargestellt werden und dem Kunden eine Darstellung auf Ultimate Parent Level ermöglichen.

GROMIKV REPORTING SERVICE

- Erstellung aller benötigten Reporting Templates (GroMiKV)
- Erstellung eines Fenion Disclosure Formats um ein externes Audit zu ermöglichen
- Kalkulation der risikogewichteten Aktiva (RWA)
- Kalkulation des Gegenpartei-Ausfallrisikos (SA-CCR Ansatz)
- Anreicherung zusätzlicher Stammdaten (Ultimate Parent, LEI)
- Lieferung an den Kunden in der gewünschten Frequenz

GROMIKV

Der deutsche Fondsverband BVI hat ein Template für die Meldung von Groß- und Millionenkrediten entwickelt auf dessen Basis Fonds im Look-Through-Approach gemeldet werden. Das Template ermöglicht die Zuordnung der einzelnen Issuer zum Ultimate Parent.

Stichtag	ISIN_Bestand	Berechnung	Hubs	Bemessungsgrundlage / PV	Risikoklassifizierung	GroMiKV Anrechnungssatz	ISA Risikogewicht	Ermittl. Berechnung	Konzern_Berechnung	Ermittl. LEI	Konzern_LEI
30.06.2021	KS234582362	0,25 Credit Suisse AG 21.05.2021-05.01.2026			0,01 bilanziell	1		0,5 Credit Suisse AG	Credit Suisse Group AG	ANG07YKNDL3XN3JPH8	5493005085ICRCH9V286
30.06.2021	KS235996217	0 Novartis Finance SA 23.09.2020-23.09.2028			0,00 bilanziell	1		0,5 NOVARTIS FINANCE SA	Novartis AG	549300710706227313	549300710706227313
30.06.2021	ES0305523005	0 Six Finance Luxembourg 02.12.2020-02.12.2025			0,00 bilanziell	1		0,5 SIX Finance (Luxembourg) S.A.	SIX Group AG	529900080514FRN0R82	529900080514FRN0R82
30.06.2021	KS234821794	0 Volkswagen Leasing GmbH 19.05.2021-19.07.2024			0,01 bilanziell	1		0,5 Volkswagen Leasing Gesellschaft mit beschränkter Haftung	VOLKSWAGEN AKTIENGESellschaft	5299004GLEUX885N874	5299004GLEUX885N874
30.06.2021	FR0014023257	0,01 Banque Fed Cred Mutuel 08.04.2021-11.05.2026			0,01 bilanziell	1		0,2 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL	CONFEDERATION NATIONALE CREDIT MUTUEL	W6H9KXFT70N6Z9NHT76	W6H9KXFT70N6Z9NHT76
30.06.2021	KS233354538	0,125 Coca-Cola 19.09.2020-15.03.2029			0,01 bilanziell	1		0,5 THE COCA-COLA COMPANY	THE COCA-COLA COMPANY	UW6KLFZJZQZ0W38Y53	UW6KLFZJZQZ0W38Y53
30.06.2021	KS2300313041	0,125 First Abu Dhabi Bank 16.02.2021-16.02.2026			0,01 bilanziell	1		0,2 FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C.	FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C.	213800273WMM6ZS9H0	213800273WMM6ZS9H0
30.06.2021	KS2051659915	0,125 Leaseplan Corporation NV 13.09.19-13.09.23			0,01 bilanziell	1		0,5 LeasePlan Corporation N.V.	Lincoln TopCo Pte Ltd	724500C0L930P4H584	724500C0L930P4H584
30.06.2021	KS2355099197	0,125 Natwest Markets Plc 18.06.2021-18.06.2026			0,00 bilanziell	1		0,5 NATWEST MARKETS PLC	Her Majesty's Treasury	9320002WV6P5C845078	ECT920VCE589VWY5K636
30.06.2021	KS2311216577	0,125 Santander Consumer Bank AG 14.04.2021-2026			0,00 bilanziell	1		0,2 SANTANDER CONSUMER BANK AS	Banco Santander SA	5493000A08LH29619H1	5493000A08LH29619H1
30.06.2021	KS2338958805	0,125 Toyota Motor Credit 06.05.2021-05.11.2027			0,01 bilanziell	1		0,5 TOYOTA MOTOR CREDIT CORPORATION	Toyota Motor Corp	22VZBHLMB7PWV93008	5493000W30J5LMLH888
30.06.2021	KS230940840	0,160 National Grid PLC 20.01.2021-20.01.2028			0,01 bilanziell	1		1 NATIONAL GRID PLC	NATIONAL GRID PLC	889520M2LJ05J200704	889520M2LJ05J200704
30.06.2021	KS2329345510	0,184 Mizuho Financial Group 12.04.2021-13.04.2026			0,01 bilanziell	1		0,5 Mizuho Financial Group, Inc.	Mizuho Financial Group, Inc.	953800CSL6D0A0X023	953800CSL6D0A0X023
30.06.2021	KS2049548444	0,2 General Motors Fin CO 03.09.2019-02.09.2022			0,01 bilanziell	1		1 General Motors Financial Company, Inc.	GENERAL MOTORS COMPANY	5493000B6R09U0L97	5493000B6R09U0L97
30.06.2021	KS2346225878	0,5 Metropolitan Life Clubs Fdg 17.05.2021-2029			0,00 bilanziell	1		0,2 Metropolitan Life Global Funding I	Republic of Korea	635400M50C0N0N2028	635400M50C0N0N2028
30.06.2021	KS2103203152	0,5 Procco EO Nucleo 17.01.2020-2024			0,00 bilanziell	1		1 Republic of Korea	REN - Redes Energeticas Nacion	5493001R05P01W0Q2717	5493001R05P01W0Q2717
30.06.2021	KS2332186001	0,5 REN Finance BV 16.04.2021-16.04.2029			0,00 bilanziell	1		0,5 REN Finance B.V.	REN - Redes Energeticas Nacion	5493001R05P01W0Q2717	5493001R05P01W0Q2717
30.06.2021	KS2358471246	0,5 Yorkshire Building 01.07.2021-2028			0,01 bilanziell	1		0,2 Yorkshire Building Society	Yorkshire Building Society	W00DEH0RP7H0N3157	W00DEH0RP7H0N3157
30.06.2021	KS2300176655	0,597 JP Morgan Chase & Co FRN 17.2.2021-17.2.2033			0,00 bilanziell	1		0,5 JPMORGAN CHASE & CO.	JPMORGAN CHASE & CO.	855200ZV5LJHJH748	855200ZV5LJHJH748
30.06.2021	KS2262798494	0,625 Arion Banki HF 27.11.2020-07.05.2024			0,01 bilanziell	1		0,5 Arion banki hf.	Arion banki hf.	RIL4VBP00M7Z3K05F19	RIL4VBP00M7Z3K05F19
30.06.2021	KS2357417257	0,625 Banco Santander S.A. 24.06.2021-24.06.2029			0,01 bilanziell	1		0,5 BANCO SANTANDER, S.A.	BANCO SANTANDER, S.A.	5493000G6MDF0MVIAM1	5493000G6MDF0MVIAM1
30.06.2021	F4400490602	0,625 Sanoma Oyj 18.03.2021-18.03.2024			0,00 bilanziell	1		1 Sanoma Oyj	Sanoma Oyj	743700XC24THP0203	743700XC24THP0203
30.06.2021	KS234833798	0,625 Saam SpA 30.06.2021-2031			0,01 bilanziell	1		1 SAAM S.P.A.	SAAM S.P.A.	8154000278520644K79	8154000278520644K79
30.06.2021	KS2325733413	0,625 Stellantis N.V. 30.03.2021-30.03.2027			0,01 bilanziell	1		1 Fiat Chrysler Automobiles N.V.	Fiat Chrysler Automobiles N.V.	5493000K19PW7Z8D31	5493000K19PW7Z8D31
30.06.2021	KS2348225203	0,625 Volkswagen Leasing 19.05.2021-19.07.2029			0,01 bilanziell	1		0,5 Volkswagen Leasing Gesellschaft mit beschränkter Haftung	VOLKSWAGEN AKTIENGESellschaft	5299004GLEUX885N874	5299004GLEUX885N874
30.06.2021	KS211187829	0,625 Yorkshire Building Soc. 21.09.2020-21.09.2025			0,01 bilanziell	1		0,2 Yorkshire Building Society	Yorkshire Building Society	W00DEH0RP7H0N3157	W00DEH0RP7H0N3157
30.06.2021	KS173462585	0,75 Autoliv Inc. 26.06.2018-26.06.2023			0,01 bilanziell	1		1 AUTOLIV, INC.	Autoliv, Inc.	A238UJXWAS683LTM26	A238UJXWAS683LTM26
30.06.2021	KS2178769076	1 Fresenius Medical Care KGAA 29.05.2020-2026			0,01 bilanziell	1		1 Fresenius Medical Care AG & Co. KGAA	Fresenius Medical Care AG & Co. KGAA	5493000C78N40JPR8Q40	5493000C78N40JPR8Q40
30.06.2021	KS1955199304	1 LeasePlan Corporation NV 29.02.2019-25.02.2022			0,00 bilanziell	1		0,5 LeasePlan Corporation N.V.	Lincoln TopCo Pte Ltd	724500C0L930P4H584	724500C0L930P4H584
30.06.2021	KS2796206068	1 Praxio Euro Finance LLC 16.02.2021-2041			0,01 bilanziell	1		0,5 PRAXIO EURO FINANCE LLC	Praxio Inc	5493000A01784P0406	5299000H19P073L636
30.06.2021	KS2348241048	1 Raiffeisenbank a.s. FR 09.06.2021-09.06.2028			0,01 bilanziell	1		0,2 Raiffeisenbank a.s.	Raiffeisenbank International AG	91510010000000004460	91510010000000004460
30.06.2021	KS2345996743	1 Telefonaktiebolaget LM Ericsson 26.05.2021-2029			0,01 bilanziell	1		1 Telefonaktiebolaget LM Ericsson	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	5493000W1PWS10X0F452	5493000W1PWS10X0F452
30.06.2021	KS1794596615	1,0 Arion Banki HF 20.03.2018 - 20.03.2023			0,01 bilanziell	1		0,5 Arion banki hf.	Arion banki hf.	RIL4VBP00M7Z3K05F19	RIL4VBP00M7Z3K05F19
30.06.2021	KS1876097715	1,058 Mibank SA 05.09.2018-05.09.2022			0,01 bilanziell	1		0,5 mBank Spółka Akcyjna	COMMERCIAL BANK	851WY00LQJL785Y856	851WY00LQJL785Y856
30.06.2021	KS234260360	1,106 Barclays Bank plc FRN 13.05.2021-05.12.2032			0,01 bilanziell	1		0,5 BARCLAYS PLC	BARCLAYS PLC	2138001B0A1Y9J2JH70	2138001B0A1Y9J2JH70
30.06.2021	FR0012508710	1,125 BNP Paribas S.A. FRN 17.02.2020-2028			0,01 bilanziell	1		0,5 BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	91510010000000004460	91510010000000004460
30.06.2021	KS2184283672	1,125 Infineon Technologies AG 24.06.2020-2026			0,02 bilanziell	1		1 infineon Technologies AG	Infineon Technologies AG	5192PMEPEETE0XK1J25	5192PMEPEETE0XK1J25
30.06.2021	KS1980828997	1,125 Islandbanki 12.04.2019-2022			0,01 bilanziell	1		0,5 Islandbanki hf.	Endlurin (Riskis)	5493000P2MFOR79Q07197	5493000P2MFOR79Q07197
30.06.2021	KS2346224806	1,125 SBB Treasury OYJ 26.05.2021-26.11.2029			0,01 bilanziell	1		1 SBB Treasury Oyj	Santahallintojojohtoyj	54930003H0CWF0M1274	54930003H0CWF0M1274
30.06.2021	AT0000427103	1,75 Voestalpine AG 10.04.2019-2026			0,00 bilanziell	1		1 voestalpine AG	voestalpine AG	54930000000000000000	52990000000000000000
30.06.2021	KS1822506272	1,403 Becton Dickinson & Co. 24.05.18-24.05.23			0,01 bilanziell	1		1 BECTON, DICKINSON AND COMPANY	BECTON, DICKINSON AND COMPANY	ICEZPE08P9QULV9291	ICEZPE08P9QULV9291
30.06.2021	KS2346927255	1,45 Novolipetsk Steel 02.06.2021-02.06.2026			0,01 bilanziell	1		1 STEEL FUNDING DESIGNATED ACTIVITY COMPANY	FLETCHER GROUP HOLDINGS LIMITED	5493000LJSHLXK0V089	5493000LJSHLXK0V089
30.06.2021	KS1967635621	1,5 Abertis Infrastr. 27.03.2019-27.06.2024			0,01 bilanziell	1		1 ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	ATLANTIA S.P.A.	54930006FVW0252532	81560006E731409C487



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

KONTAKT



ADRESSE

Mariahilfer Straße 136, 1150 Wien



TELEFON

+43 (1) 908 11 80



EMAIL

office@fenion.at



Mag. Nikolaus Sernetz
Managing Partner



Karin Ladinig
Product Manager Fund Data

IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

KONTAKT

Fenion GmbH
Mariahilfer Straße 136
1150 Wien
Bereich: IT-Dienstleistungen
UID: ATU72994405
FN: 483557p
FB-Gericht: Wien
E-Mail: office@fenion.at

SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

