

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2013

Ausgegeben am 19. November 2013

Teil II

355. Verordnung: Änderung der 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung

355. Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA), mit der die 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung geändert wird

Auf Grund der §§ 73 Abs. 1 Z 2 und 152 des Investmentfondsgesetzes 2011 – InvFG 2011, BGBl. I Nr. 77, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 184/2013, wird verordnet:

Die Verordnung über die Risikoberechnung und Meldung von Derivaten – 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung, BGBl. II Nr. 266/2011, zuletzt geändert durch die Verordnung BGBl. II Nr. 102/2013, wird wie folgt geändert:

1. Nach § 2 wird folgender § 2a samt Überschrift eingefügt:

„Meldeformat

§ 2a. (1) Die Meldung ist im Extensible Markup Language (XML) – Format im Wege der Incoming-Plattform der FMA zu übermitteln. Die gesamte Meldung einer Verwaltungsgesellschaft hat in einer XML-Datei zu erfolgen. Die Meldung ist anhand der XML Schema Definition (XSD) – Vorgaben der FMA zu erstellen.

(2) Die Meldung umfasst folgende Daten:

1. Name der Verwaltungsgesellschaft;
2. Bankleitzahl der Verwaltungsgesellschaft;
3. International Securities Identification Number (ISIN) des Investmentfonds, maximal 12 Zeichen, alphanumerisch;
4. Name des Investmentfonds, maximal 100 Zeichen, alphanumerisch;
5. Risikoangabe in Prozent, maximal 3 Stellen, numerisch;
6. Maximale Risikoangabe der Berichtsperiode in Prozent, maximal 3 Stellen, numerisch;
7. Anwendung des relativen Value at Risk (VaR)-Ansatzes, eine Stelle, „J“/„j“ oder „N“/„n“;
8. Anwendung des absoluten VaR-Ansatzes, eine Stelle, „J“/„j“ oder „N“/„n“;
9. Besondere Anlagegrenzen laut Fondsbestimmungen (Maximales Gesamtrisiko derivativer Instrumente (Commitment Approach) oder maximal zuordenbarer Risikobetrag (VaR) laut Fondsbestimmungen), maximal 300 Stellen, alphanumerisch;

(3) Im Falle von Leermeldungen sind ISIN, Name des Investmentfonds und Risikoangabe zu übermitteln.“

2. § 27 Z 2 bis 4 lauten:

- „2. in einem Mitgliedstaat zugelassene Kreditinstitute gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012, ABl. Nr. L 176 vom 27.6.2013 S. 1;
3. ausländische Kreditinstitute gemäß § 2 Z 13 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. I Nr. 532/1993, in der Fassung des Bundesgesetzes BGBl. I Nr. 184/2013, mit dem Sitz in einem Zentralstaat, der gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mit einem Risikogewicht von höchstens 20 vH zu versehen wäre;
4. Wertpapierfirmen gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mit dem Sitz in einem Zentralstaat, der gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 mit einem Risikogewicht von höchstens 20 vH zu versehen wäre.“

3. Dem § 36 werden folgende Abs. 4 und 5 angefügt:

„(4) § 2a samt Überschrift und § 27 Z 2 bis 4 in der Fassung der Verordnung BGBI. II Nr. 355/2013 treten mit 1. Jänner 2014 in Kraft. § 2a ist erstmals auf Meldungen zum 31. März 2014 anzuwenden.

(5) Die Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Art der elektronischen Übermittlung der Meldung von Derivaten (Derivate-Meldesystemverordnung 2011 – DMV 2011), BGBI. II Nr. 267/2011, tritt mit Ablauf des 31. Dezember 2013 außer Kraft.“

Ettl Kumpfmüller