

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2016

Ausgegeben am 7. Dezember 2016

Teil II

370. Verordnung: Sicherungseinrichtungen-Stresstestverordnung – SiEi-StrV

370. Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über den Inhalt und die Gliederung der von Sicherungseinrichtungen zu übermittelnden Ergebnisse ihrer Stresstests (Sicherungseinrichtungen-Stresstestverordnung – SiEi-StrV)

Auf Grund des § 2 Abs. 6 des Einlagensicherungs- und Anlegerentschädigungsgesetzes – ESAEG, BGBl. I Nr. 117/2015, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 159/2015, wird verordnet:

Zweck

§ 1. Diese Verordnung dient der Festlegung des Inhalts und der Gliederung der an die FMA zu übermittelnden Ergebnisse der von Sicherungseinrichtungen durchgeführten Stresstests gemäß § 2 Abs. 6 ESAEG.

Inhalt und Gliederung der Stresstestergebnisse

§ 2. (1) Sicherungseinrichtungen haben die Ergebnisse ihrer Stresstests gemäß § 2 Abs. 6 ESAEG gemäß der **Anlage** zu gliedern.

(2) Für jede der in der **Anlage** vorgesehenen Kategorien B bis E können die Sicherungseinrichtungen einen oder mehrere Tests durchführen. Wird mehr als ein prioritärer Test durchgeführt, sind die Ergebnisse in getrennten Spalten zu übermitteln.

Angabe von Stresstestergebnissen

§ 3. (1) Beträge sind in Tausend Euro mit zwei Nachkommastellen kaufmännisch gerundet anzugeben. Prozentsätze sind kaufmännisch gerundet mit zwei Nachkommastellen anzugeben.

(2) Fremdwährungspositionen sind unter Zugrundelegung des Euro-Referenzkurses der Europäischen Zentralbank (EZB) in Euro umzurechnen. Ist für eine Währung kein Euro-Referenzkurs der EZB verfügbar, so sind die Devisenmittelkurse heranzuziehen.

(3) Wenn in der Anlage eine Bewertung gefordert ist, ist folgende Bewertungsskala heranzuziehen:

A – optimal	In dem gemessenen Bereich sind keine Verbesserungen erforderlich.
B – angemessen	Der Bereich weist Schwachstellen auf, diese sind aber nur vereinzelt festzustellen und/oder können bei einem Ausfall leicht behoben werden und es ist unwahrscheinlich, dass sie sich auf die Fähigkeit der Sicherungseinrichtung zur Wahrnehmung ihrer Aufgaben nach den Bedingungen des ESAEG auswirken.
C – schlecht	Der Bereich weist Schwachstellen auf, die wahrscheinlich die Fähigkeit der Sicherungseinrichtung zur Wahrnehmung ihrer Aufgaben nach den Bedingungen des ESAEG negativ beeinflussen und für die Verbesserungen erforderlich sind. In diesem Fall ist anzugeben, welche Maßnahmen ergriffen wurden oder geplant sind.
E – sehr schlecht	Der Bereich weist schwerwiegende Mängel auf, aufgrund derer die Sicherungseinrichtung wahrscheinlich ihre Aufgaben nach den Bedingungen des ESAEG nicht wahrnehmen kann und für die unverzügliche Abhilfemaßnahmen erforderlich sind. In diesem Fall ist anzugeben, welche Maßnahmen ergriffen wurden oder geplant sind.

Inkrafttreten

§ 4. Diese Verordnung tritt mit 19. Dezember 2016 in Kraft.

Ettl Kumpfmüller