

DE - ANHANG I

Teil 2		
Erlaubnis zur Verwendung eines Modells		
010	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen	27.06.2024
		Beschreibung der Vorgehensweise
Vorgehensweise der Aufsichtsbehörden bei Erteilung der Erlaubnis, für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderungen für das Kreditrisiko den auf internen Beurteilungen basierenden Ansatz (IRB- Ansatz) zu verwenden		
020	Vom Institut, das die Verwendung des IRB-Ansatzes beantragt, mindestens bereitzustellende Unterlagen	<i>Die FMA legt für jeden Antrag auf Genehmigung einer Erstverwendung, einer umfassenderen Verwendung gemäß Einführungsplan („Roll-Out“) oder einer wesentlichen Modelländerung im Einzelfall eine detaillierte Liste an vorzulegenden Unterlagen fest. Eine Selbsteinschätzung sowie ein positiver Bericht der Internen Revision des Instituts sind dem Antrag jedenfalls anzuschließen.</i>
030	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	<i>Das Institut hat eine Selbsteinschätzung anhand eines standardisierten Fragebogens zu übermitteln. Unabhängig davon werden alle Bewilligungsvoraussetzungen im Zuge einer Vorort-Prüfung überprüft. Dabei werden die Delegierte Verordnung (EU) 2022/439 der Kommission (zur IRB Assessment Methodology) sowie die entsprechenden EBA Leitlinien in der jeweils gültigen Fassung berücksichtigt.</i>
040	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	<i>Die Entscheidung über den Antrag ergeht in Form eines schriftlichen Bescheides, wobei die Genehmigung zur Sicherstellung der Einhaltung der Vorschriften der CRR in der Regel nur unter Auflagen erteilt wird.</i>
Vorgehensweise der Aufsichtsbehörden bei Erteilung der Erlaubnis, für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderungen für das Marktrisiko den fortgeschrittenen Messansatz (AMA-Ansatz) zu verwenden		
050	Vom Institut, das die Verwendung des IMA-Ansatzes beantragt, mindestens bereitzustellende Unterlagen	<i>Die FMA legt für jeden Antrag auf Genehmigung einer wesentlichen Modelländerung im Einzelfall eine detaillierte Liste an vorzulegenden Unterlagen fest. Eine Selbsteinschätzung sowie ein positiver Bericht der Internen Revision des Instituts ist dem Antrag jedenfalls anzuschließen.</i>
060	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	<i>Das Institut hat eine Selbsteinschätzung anhand eines standardisierten Fragebogens zu übermitteln. Unabhängig davon werden alle Bewilligungsvoraussetzungen in einer Vorort-Prüfung überprüft. Dabei wird der "EBA final RTS on IRB assessment methodology" berücksichtigt.</i>
070	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	<i>Die Entscheidung über den Antrag ergeht in Form eines schriftlichen Bescheides, wobei die Genehmigung zur Sicherstellung der Einhaltung der Vorschriften der CRR in der Regel nur unter Auflagen erteilt wird.</i>
Vorgehensweise der Aufsichtsbehörden bei Erteilung der Erlaubnis, für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderungen für das Gegenparteiausfallrisiko eine auf einem internen Modell beruhende Methode (IMM) anzuwenden		
080	Vom Institut, das die Verwendung des IMM-Ansatzes beantragt, mindestens bereitzustellende Unterlagen	<i>Die FMA legt für jeden Antrag auf Genehmigung einer wesentlichen Modelländerung im Einzelfall eine detaillierte Liste an vorzulegenden Unterlagen fest. Eine Selbsteinschätzung sowie ein positiver Bericht der Internen Revision des Instituts ist dem Antrag jedenfalls anzuschließen.</i>
090	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	<i>Das Institut hat eine Selbsteinschätzung anhand eines standardisierten Fragebogens zu übermitteln. Unabhängig davon werden alle Bewilligungsvoraussetzungen in einer Vorort-Prüfung überprüft. Dabei wird der "EBA final RTS on IRB assessment methodology" berücksichtigt.</i>
100	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	<i>Die Entscheidung über den Antrag ergeht in Form eines schriftlichen Bescheides, wobei die Genehmigung zur Sicherstellung der Einhaltung der Vorschriften der CRR in der Regel nur unter Auflagen erteilt wird.</i>
Vorgehensweise der Aufsichtsbehörden bei Erteilung der Erlaubnis, für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderungen für das operationelle Risiko den fortgeschrittenen Messansatz (AMA-Ansatz) zu verwenden		
110	Vom Institut, das die Verwendung des AMA-Ansatzes beantragt, mindestens bereitzustellende Unterlagen	<i>Die FMA legt für jeden Antrag auf Genehmigung einer wesentlichen Modelländerung im Einzelfall eine detaillierte Liste an vorzulegenden Unterlagen fest. Eine Selbsteinschätzung sowie ein positiver Bericht der Internen Revision des Instituts ist dem Antrag jedenfalls anzuschließen.</i>
120	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	<i>Das Institut hat eine Selbsteinschätzung anhand eines standardisierten Fragebogens zu übermitteln. Unabhängig davon werden alle Bewilligungsvoraussetzungen in einer Vorort-Prüfung überprüft. Dabei wird der "EBA final RTS on IRB assessment methodology" berücksichtigt.</i>
130	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	<i>Die Entscheidung über den Antrag ergeht in Form eines schriftlichen Bescheides, wobei die Genehmigung zur Sicherstellung der Einhaltung der Vorschriften der CRR in der Regel nur unter Auflagen erteilt wird.</i>