

Entwurf

Anlage 1

zur Wertpapierfirmen-Stammdatenmeldeverordnung – WPF-StDMV

Ausweis zur Wertpapierfirma auf Soloebene

Teil I
Grunddaten

Position	Gegenstand	Ausprägung
I.1.	Ausweisart	[1; 2], wobei gilt (1) „1“ für Erstanzeige; (2) „2“ für Veränderungsanzeige
I.2.	Datum des Wirksamwerdens	[dd/mm/yy]

Teil II
Unternehmensdaten

Position	Gegenstand	Ausprägung
II.1.	Firmenwortlaut	alphanumerisch
II.2.	Unternehmensname kurz	alphanumerisch; max. 50 Zeichen
II.3.	Unternehmenscodetyp	[LEI; NC], wobei gilt (1) „LEI“ für LEI-Code; (2) „NC“ für Nationaler Code
II.4.	Unternehmenscode	alphanumerisch (gemäß ISO 17442:2012, wenn zutreffend)
II.5.	Klasse	[Klasse 1-Minus; Klasse 2; Klasse 3]
II.6.	Charakterisierung zum Zwecke des Art. 1 Abs. 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 und des Art. 4 Abs. 1 Nr. 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	1. Ausprägung: Tätigkeit gemäß § 3 Abs. 2 Z 7 WAG 2018 [j; n] 2. Ausprägung: Tätigkeit gemäß § 3 Abs. 2 Z 8 WAG 2018 [j; n] 3. Ausprägung: Erreichen / Überschreiten der Bilanzsummengrenze gemäß Art. 55 Abs. 1 und 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 [j; n]
II.7.	Größenklasse nach Größe und Komplexität	[groß; normal; klein], wobei gilt:

		(1) „groß“ ist ein Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 146 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013; (2) „klein“ ist ein Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 145 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013) (3) „normal“ ist ein sonstiges Institut
II.8.	Relevanzklasse nach Systemrelevanz	[G-SRI; SRI; n], wobei gilt: (1) „G-SRI“ ist ein global Systemrelevantes Institut gemäß § 2 Z 23 BWG; (2) „SRI“ ist ein Systemrelevantes Institut gemäß § 2 Z 25 BWG; (3) „n“ ist ein Institut, das weder § 2 Z 23 noch § 2 Z 25 BWG erfüllt
II.9.	Verschiedenheit der Sitzstaaten von Unternehmen und Heimatlandaufsichtsbehörde	[j; n]

Teil III Gruppendaten

Position	Gegenstand	Ausprägung
III.1.	Wertpapierfirmengruppe gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 25 der Verordnung (EU) 2019/2033 unter Aufsicht der FMA gemäß § 38 WPFGE	[j; n]
III.2.	Mutterunternehmen gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 15 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 eines EWR- oder Drittlandinstituts	[j; n]
III.3.	ranghöchstes Unternehmen im EWR	[j; n]
III.4.	ranghöchstes Unternehmen in Österreich	[j; n]
III.5.	Unternehmenscodetyp des obersten Mutterunternehmens im EWR	[LEI; NC], wobei gilt (1) „LEI“ für LEI-Code; (2) „NC“ für Nationaler Code
III.6.	Unternehmenscode (LEI-Code oder hilfsweise Nationaler Code) des obersten Mutterunternehmens im EWR	alphanumerisch (gemäß ISO 17442:2012, wenn zutreffend)
III.7.	Mutterunternehmen einer Liquiditätsgruppe gemäß Art. 8 Abs. 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	[j; n]
III.8.	Unternehmenscodetyp des Mutterunternehmens einer Liquiditätsgruppe	[LEI; NC], wobei gilt (1) „LEI“ für LEI-Code; (2) „NC“ für Nationaler Code
III.9.	Unternehmenscode (LEI-Code oder hilfsweise Nationaler Code) des Mutterunternehmens einer Liquiditätsgruppe	alphanumerisch (gemäß ISO 17442:2012, wenn zutreffend)
III.10.	Mutterunternehmen für den Gruppenkapitaltest	[j/n]
III.11.	Unternehmenscodetyp des Mutterunternehmens für den Gruppenkapitaltest	[LEI; NC], wobei gilt (1) „LEI“ für LEI-Code; (2) „NC“ für Nationaler Code
III.12.	Unternehmenscode (LEI-Code oder hilfsweise Nationaler Code) des obersten Mutterunternehmens im EWR für den Gruppenkapitaltest	alphanumerisch (gemäß ISO 17442:2012, wenn zutreffend)

Teil IV Daten zur Rechnungslegung

Position	Gegenstand	Ausprägung
IV.1.	Rechnungslegungsstandard	[IFRS; UGB/BWG]
IV.2.	Bilanzstichtag	[dd/mm]

Teil V Daten zu Risikoansätzen

Position	Gegenstand	Ausprägung
V.1.	Kreditrisikoansatz	[SA; IRB]
V.2.	Kreditrisiko-Verbriefungsansatz	[SA; IRB; n/a]
V.3.	IRB-Ansatz für Beteiligungspositionen	[IM; PD/LGD; SRW; n/a]
V.4.	Ansatz für operationelles Risiko	[AMA; ASA; BIA; TSA]
V.5.	Marktrisikoansatz	[SA; IM, n/a]
V.6.	IM für Marktrisiko	[(VaR, SVaR); (VaR, SVaR, IRC); (VaR, SVaR, IRC, CT)]
V.7.	genehmigtes internes Modell für das Kreditrisiko	1. Ausprägung: LDP [j; n] 2. Ausprägung: HDP [j; n]

wobei gilt:

1. „SA“ ist der jeweilige Standardansatz;
2. „IRB“ ist ein auf internen Einstufungen basierender Ansatz gemäß Art. 143 Abs. 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Internal Ratings Based Approach, IRB approach);
3. „IM“ ist ein auf internen Modellen beruhender Ansatz gemäß Teil 3 Titel IV Kapitel 5 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013;
4. „PD/LGD“ ist ein auf der Ausfallwahrscheinlichkeit gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 54 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Probability of Default, PD) und der Verlustquote gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 55 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Loss Given Default, LGD) basierender Ansatz;
5. „SRW“ ist der einfache Risikogewichtungsansatz gemäß Art. 155 Abs. 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Simple Supervisory Risk Weight Approach, SRW approach);
6. „AMA“ ist ein fortgeschrittener Messansatz gemäß Teil 3 Titel III Kapitel 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Advanced Measurement Approach, AMA), der auf einem eigenen System für die Messung des operationellen Risikos basiert;
7. „ASA“ ist der alternative Standardansatz gemäß Art. 319 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Alternative Standardised Approach, ASA);
8. „BIA“ ist der Basisindikatoransatz für das Marktrisiko gemäß Teil 3 Titel III Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Basic Indicator Approach, BIA);
9. „TIA“ ist der herkömmliche Standardansatz gemäß Art. 317 und 318 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Traditional Indicator Approach, TIA);
10. „VaR“ ist der Risikopotentialansatz (Value-at-Risk, VaR);
11. „SVaR“ ist ein Marktrisikoansatz unter Berücksichtigung des Risikopotentials unter Stressbedingungen (stressed Value-at-Risk, SVaR);
12. „IRC“ ist ein Marktrisikoansatz unter Berücksichtigung eines inkrementellen Risikoaufschlags für Migrations- und Ausfallrisiken (Incremental Risk Charge for Migration and Default Risk, IRC);
13. „CT“ ist ein Marktrisikoansatz unter Berücksichtigung extremer Bedingungen (Conditional Tail Expectation, CT expectation);
14. „LDP“ ist ein Modell in Bezug auf Portfolios, für die keine oder nur sehr geringe Ausfalldaten vorliegen (Low Default Portfolios, LDP);
15. „HDP“ ist ein Modell in Bezug auf Portfolios mit hohem Ausfallrisiko (High Default Portfolios, HDP).