

DE
ANHANG I

TEIL 2 Erlaubnis zur Verwendung eines Modells¹		
010	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen	<i>(12/06/2023)</i>
		Beschreibung der Vorgehensweise
020	Vorgehensweise der Aufsichtsbehörden bei Erteilung der Erlaubnis, für die Berechnung der Mindesteigenmittelanforderungen für das Marktrisiko den auf einem alternativen internen Modell beruhenden Ansatz (A-IMA) zu verwenden	
030	Von der Wertpapierfirma, die die Verwendung des A-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. Ein positiver Bericht der internen Revision (soweit einzurichten) und eine Selbsteinschätzung der Antragstellerin ist jedenfalls anzuschließen.</i>
040	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	<i>Die Antragstellerin hat eine Selbsteinschätzung anhand eines standardisierten Fragebogens zu übermitteln. Unabhängig hiervon werden alle Bewilligungsvoraussetzungen in einer Vorort-Prüfung überprüft.</i>
050	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	<i>Die Entscheidung ergeht in Form eines schriftlichen Bescheides wobei die Genehmigung zur Sicherstellung der Einhaltung der Vorschriften der IFR in der Regel nur unter Auflagen erteilt wird.</i>