

Rakar Brigita

Von: Raunig, Jutta <jutta.raunig@bmf.gv.at>
Gesendet: Mittwoch, 4. September 2024 19:08
An: Begutachtung; Rakar Brigita; BAUER, Josef; TREFIL, Barbara
Cc: Wiedermann-Ondrej, Nadine; Part, Sigrid
Betreff: Stammdatenmeldungsverordnung 2016-StDMV 2016-
Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2024-09-04.docx, StDMV 2016-
Anlage 1-Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2024-09-04.docx,
StDMV 2016-Anlage 2-Begutachtungsentwurf-BMF-
Anmerkungen-2024-09-04.docx
Anlagen: Stammdatenmeldungsverordnung 2016-StDMV 2016-
Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2024-09-04.docx; StDMV 2016-
Anlage 1-Begutachtungsentwurf-BMF-Anmerkungen-2024-09-04.docx;
StDMV 2016-Anlage 2-Begutachtungsentwurf-BMF-
Anmerkungen-2024-09-04.docx

Stammdatenmeldungsverordnung 2016 – StDMV 2016

[FMA-LE0001.210/0005-INT/2024]

Mit der Bitte um Berücksichtigung der BMF-Anmerkungen.

Freundliche Grüße
Jutta Raunig

Bundesministerium für Finanzen

Sektion III – Wirtschaftspolitik und Finanzmärkte
Abteilung III/C/5 – Bankenrecht

Mag. Jutta Raunig

Tel.: +43 1 51433 503125
Mobil: +43 664 88219048
Johannessgasse 5, 1010 Wien
jutta.raunig@bmf.gv.at
www.bmf.gv.at

Entwurf

Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA), mit der die Stammdatenmeldungsverordnung 2016 geändert wird

Auf Grund des § 74 Abs. 2 in Verbindung mit § 74 Abs. 6 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 112/2024, wird mit Zustimmung des Bundesministers für Finanzen verordnet:

Die Stammdatenmeldungsverordnung 2016 – StDMV 2016, BGBl. II Nr. 371/2016, zuletzt geändert durch die Verordnung BGBl. II Nr. 433/2021, wird wie folgt geändert:

1. In § 3 Z 4 und 5 wird die Wortfolge „Art. 89 Abs. 1 Buchstaben a und b CRR“ jeweils durch die Wortfolge „Art. 89 Abs. 1 CRR“ ersetzt.
2. § 9 Abs. 2 lautet:

„(2) Teil A.3 der **Anlage 2** ist nur bis 31. Dezember 2029 zu melden.“
3. In § 9 Abs. 3 wird nach der Wortfolge „(IRB-Ansatz gemäß Art. 143 CRR“ das Zeichen „)“ *aeingefügt*.
4. § 10a samt Überschrift lautet:

„Verweise

§ 10a. Für Verweise auf Rechtsakte in dieser Verordnung sowie in den Anlagen dazu gilt Folgendes:

1. Soweit auf Bestimmungen des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, verwiesen wird, ist dieses in der Fassung des Bundesgesetzes BGBl. I Nr. 112/2024 anzuwenden;
2. soweit auf Bestimmungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, in dieser Verordnung CRR genannt, verwiesen wird, bezieht sich dies auf die 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 27.06.2013 S. 1, in der Fassung der Verordnung (EU) 2024/1623, ABl. Nr. L 2024/1623 vom 19.06.2024;
3. soweit auf Bestimmungen der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 verwiesen wird, bezieht sich dies auf die Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik, ABl. Nr. L 393 vom 30.12.2006 S. 1, in der Fassung der Delegierten Verordnung (EU) 2023/137, ABl. Nr. L 19 vom 20.01.2023 S. 5;
4. soweit auf Bestimmungen der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013 verwiesen wird, bezieht sich dies auf die Delegierte Verordnung (EU) Nr. 153/2013 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 in Bezug auf technische Regulierungsstandards für Anforderungen an zentrale Gegenparteien, ABl. Nr. L 52 vom 23.02.2013 S. 41, in der Fassung der Delegierten Verordnung (EU) 2024/818, ABl. Nr. L 2024/818 vom 06.03.2024.“

5. Dem § 11 wird folgender Abs. 5 angefügt:

„(5) § 9 Abs. 2 in der Fassung der Verordnung BGBl. II Nr. XXX/2024 tritt mit dem auf die Kundmachung folgenden Tag in Kraft. § 3 Z 4 und 5, § 9 Abs. 3, § 10a samt Überschrift sowie die **Anlagen 1, 2 und 3** in der Fassung der Verordnung BGBl. II Nr. XXX/2024 treten mit 1. Jänner 2025 in Kraft.“

6. Die **Anlagen 1, 2 und 3** lauten: (siehe Anlagen).

Begründung

Allgemeiner Teil

Mit der gegenständlichen Novelle wird mit Zustimmung des Bundesministers für Finanzen die Verordnungsermächtigung gemäß § 74 Abs. 6 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, ausgeübt. Es werden in der Stammdatenmeldungsverordnung 2016 – StDMV 2016, BGBl. II Nr. 371/2016, Änderungen 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 27.06.2013 S. 1, in der Fassung der Verordnung (EU) 2024/1623, ABl. Nr. L 2024/1623 vom 19.06.2024, ~~in diesem Dokument im Folgenden~~ CRR genannt, nachgebildet.

Besonderer Teil

Zu Z 1 (§ 3 Z 4 und 5) und Z 4 (§ 10a samt Überschrift):

Aktualisierung von Verweisen.

Zu Z 2 (§ 9 Abs. 2):

Die Meldungen zu den ausländischen Tochterinstituten werden nicht mehr benötigt, sodass die diesbezügliche Meldeverpflichtung entfällt. Für die Behandlung von Beteiligungen im Rahmen des IRB-Ansatzes gilt noch bis 31. Dezember 2029 das Übergangsregime gemäß Art. 495 CRR. Nach diesem Zeitpunkt sind die Meldeinhalte gemäß Teil A.3 der Anlage 2 nicht mehr relevant, sodass die Meldepflichtigen diese Daten dann nicht mehr übermitteln müssen.

Zu Z 3 (§ 9 Abs. 3):

Redaktionelle Anpassung.

Zu Z 5 (§ 11 Abs. 5):

Inkrafttretensbestimmung.

Zu den Anlagen:

Zu Anlage 1 (Unternehmensdaten gemäß § 8 StDMV 2016):

In **Anlage 1** entfällt die Abfrage der Telefax-Nummer, da diese Technologie inzwischen überholt und daher nicht mehr regelmäßig in Verwendung ist. In Teil E.2 werden die zur Auswahl stehenden Funktionsbezeichnungen an die Terminologie der deutschen Sprachfassung der CRR angepasst, ohne dass hiermit eine inhaltliche Änderung vorgenommen wird.

Zu Anlage 2 (Risikoansätze gemäß § 9 StDMV 2016):

In **Anlage 2** wurden Anpassungen an die geänderten Risikoansätze vorgenommen. In Teil A. wird berücksichtigt, dass die Anwendung des IRB-Ansatzes mit eigenen Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren für Risikopositionen gegenüber Instituten ab 1. Jänner 2025 nicht mehr zulässig sein wird. Für die Dauer des Übergangsregimes für die Behandlung von Beteiligungsrisikopositionen durch Institute, denen die Erlaubnis erteilt wurde, bei der Berechnung des risikogewichteten Positionsbetrags von Beteiligungsrisikopositionen den IRB-Ansatz anzuwenden (das heißt bis 31. Dezember 2029), wird Teil A.3. insofern modifiziert, als nunmehr der Umgang mit der Übergangsbestimmung gemäß Art. 495 Abs. 1 CRR abgebildet wird. Die Angaben zum Messansatz zur Berechnung der Eigenmittelanforderungen für das operationelle Risiko entfallen, da künftig einzig der neue Standardansatz zur Verfügung steht. Betreffend das Marktrisiko darf in Zukunft bei Unterschreitung des Schwellenwerts gemäß Art. 325a CRR auf den sog. vereinfachten Ansatz zurückgegriffen werden. Nachdem die Nutzung der neuen FRTB-Ansätze aktuell jedoch um ein Jahr verschoben wurde, wird bis auf Weiteres keine Änderung an der diesbezüglichen Stammdatenmeldung vorgenommen (außer der Neummerierung aufgrund des Entfalls der Angaben zum operationellen Risiko und der Aufnahme der CRR-Referenz in E.2.). In Teil F. werden die Bezeichnungen der Berechnungsansätze für die Ermittlung des CVA-Risikos an die Terminologie der CRR angepasst.

Zu Anlage 3 (Meldeinhalte zu § 10 StDMV 2016):

Die Abfragen der wirtschaftlichen Tätigkeit sowie nach der Eigenschaft als Meldeverpflichteter gemäß § 74 Abs. 2 BWG entfallen wegen Redundanz. Betreffend die Angabe der Institutsart kommt es zu einer Klarstellung dahingehend, dass unter „Person“ natürliche Personen zu verstehen sind.

Anlage 1

zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zur Stammdatenmeldung
(Stammdatenmeldeverordnung 2016 – StDMV 2016)

Meldeinhalte zu § 8 StDMV 2016 (Unternehmensdaten)

A. Hauptniederlassung des Meldeverpflichteten

OeNB Identnummer		
Firmenbuchnummer/Zusatz		
Firmenwortlaut		
Sitzadresse:	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Postadresse:	Postfach	
	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Bundesland		
SWIFT-Code		
SEPA-Routing BIC		
Telefonnummer		
E-Mail		
Homepage		
Länder ISO-Code der Heimatlandaufsichtsbehörde		
BLZ – IBAN		
BLZ – nicht IBAN		
BLZ – deaktivieren		
ULZ (Unternehmensleitzahl)		
LEI (Legal Entity Identifier)		
Rechnungslegungsstandard – unkonsolidiert		<i>[1 – UGB; 2 – IFRS]</i>
Rechnungslegungsstandard – konsolidiert		<i>[1 – UGB; 2 – IFRS]</i>
Finanzkonglomerat		<i>[1 – Ja; 2 – Nein]</i>
Größenklasse gemäß CRR – unkonsolidiert		<i>[1 – Großes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 146 CRR; 2 – Anderes Institut 3 – Kleines, nicht-komplexes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 145 CRR]</i>
Größenklasse gemäß CRR – konsolidiert ¹		<i>[1 – Großes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 146 CRR; 2 – Anderes Institut 3 – Kleines, nicht-komplexes Institut gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 145 CRR]</i>

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

B. Organwalter/innen und Funktionsträger/innen

OeNB Identnummer	
Funktion (gemäß Tabelle „Übersicht Funktionen“)	<i>[Funktionsnummer]</i>
E-Mail-Adresse (zu den Funktionsnummern 43, 46, 51, 52, 53 und 60 der Tabelle „Übersicht Funktionen“)	
Kennzeichnung des unabhängigen Mitgliedes gemäß § 28a Abs. 5b BWG (hinsichtlich der Funktionsnummern 62, 63 und 65)	

C. Mitarbeiter/innen

Stichtag	<i>[Datum]</i>
----------	----------------

C.1. Anzahl Mitarbeiter/innen

	Männlich	Weiblich	Insgesamt
Vollzeitbeschäftigte			
Teilzeitbeschäftigte			
Geringfügig Beschäftigte			
Insgesamt			
- hiervon karenziert			

C.2. Anzahl Mitarbeiter/innen nach Bundesländern/Ausland

Wien	
Steiermark	
Oberösterreich	
Salzburg	
Tirol	
Kärnten	
Vorarlberg	
Burgenland	
Niederösterreich	
Ausland	

D. Zweigstellen und Repräsentanzen

Die nachfolgenden Informationen sind anzugeben für:

- i. Inländische nichtprotokollierte Zweigstellen
- ii. Inländische protokollierte Zweigstellen
- iii. Ausländische Zweigstellen
- iv. Ausländische Repräsentanzen

OeNB Identnummer	
Firmenbuchnummer/Zusatz	
Firmenwortlaut	

Sitzadresse:	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Postadresse:	Postfach	
	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
Bundesland		
SWIFT-Code (Angabe bei Zweigstellen mit Sitz im Inland)		
SEPA-Routing BIC		
Telefonnummer		
E-Mail		
Homepage		
Länder ISO-Code		

E. Ausländische Tochterinstitute

E.1. Allgemeine Angaben

OeNB Identnummer		
Firmenwortlaut		
Rechtsform		
Postadresse:	Postfach	
	Straße	
	Ort	
	Postleitzahl	
SWIFT-Code		
Telefonnummer		
E-Mail		
Homepage		
Länder ISO-Code		
LEI (Legal Entity Identifier)		
NACE gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006		
Anzahl der Zweigstellen		
Anzahl der Mitarbeiter/innen		
Rechnungslegungsstandard – unkonsolidiert		<i>[1 – nationaler Rechnungslegungsstandard; 2 – IFRS]</i>

E.2. Organwalter/innen und Funktionsträger/innen ausländischer Tochterinstitute

OeNB Identnummer	
Funktion (gemäß Tabelle „Übersicht Funktionen“)	<i>[Funktionsnummer]</i>

Tabelle „Übersicht Funktionen“

Funktionsnummer	Funktionsbezeichnung
31	Vorstandsmitglied
37	Verwaltungsratsvorsitzende/r bzw. Verwaltungsratspräsident/in
38	Verwaltungsrat (Stellvertreter/in des/der Vorsitzenden)
40	Verwaltungsratsmitglied/Verwaltungsrat
43	Vorstand (Vorsitzende/r)
46	Vorstand (Stellvertreter/in des/der Vorsitzenden)
49	Obmann/frau (Genossenschaft)
50	Obmann/frau-Stellvertreter/in (Genossenschaft)
51	Geschäftsleiter/in (Genossenschaft)
52	Geschäftsführer/in
53	Geschäftsführer/in-Stellvertreter/in
60	Ständige/r Vertreter/in von Zweigstellen gemäß § 9 BWG
62	Aufsichtsrat (Vorsitzende/r)
63	Aufsichtsrat (Stellvertreter/in des/der Aufsichtsratsvorsitzenden)
65	Aufsichtsrat (Mitglied, außer Arbeitnehmervertreter/innen)
144	Aufsichtsrat (Arbeitnehmervertreter/innen)
103	Staatskommissär/in
104	Staatskommissär/in-Stellvertreter/in
109	Leiter/in der internen Revision
123	Abschlussprüfer
141	Risikovorstand gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013
142	Compliance-Vorstand gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013
143	Technologievorstand gemäß Art. 3 Abs. 3 der Delegierten Verordnung (EU) Nr. 153/2013

Anlage 2

zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zur Stammdatenmeldung
(Stammdatenmeldeverordnung 2016 – StDMV 2016)

Meldeinhalte zu § 9 StDMV 2016 (Risikoansätze)

A. Kreditrisiko gemäß Teil 3, Titel II, Kapitel 3 CRR

A.1. Auf internen Einstufungen basierender Ansatz (IRB-Ansatz, Teil 3 Titel II Kapitel 3 CRR)

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (IRB-Ansatz, Art. 143 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

A.2. Umfang der Bewilligung

Risikopositionsklassen gemäß Art. 147 Abs. 2 CRR	IRB-Ansatz mit eigenen Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 7 erster Satz und 9 CRR)	IRB-Ansatz ohne eigene Schätzungen der LGD und der Umrechnungsfaktoren (Art. 151 Abs. 8 CRR)	Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 148 CRR)	Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial Use“, Art. 150 CRR)	„Slotting-Ansatz“ (Art. 153 Abs. 5 CRR)
[jeweils: 1 – Ja; 2 – Nein]					
Buchstabe a (Zentralstaaten und Zentralbanken)					xxxxxxx
Buchstabe b (Risikopositionen gegenüber Instituten)	xxxxxxx				xxxxxxx
Buchstabe c (Risikopositionen gegenüber Unternehmen)					
Buchstabe d (Risikopositionen aus dem Mengengeschäft)		xxxxxxx			xxxxxxx

Kommentiert [RJ1]: Bitte auf eine einheitliche Schreibweise in der Anlage 2 achten. Siehe Fußnote 2 (Art. 495 Abs. 1 Buchstabe b CRR).

A.3. Behandlung von Beteiligungen im Rahmen des IRB-Ansatzes (bis zum 31.12.2029)

OeNB Identnummer			
		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Berechnung gemäß Art. 133 CRR		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Sofern keine Berechnung gemäß Art. 133 CRR erfolgt:	Einfacher risikogewichteter Ansatz (Art. 155 Abs. 2 CRR ²)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	PD/LGD-Ansatz (Art. 155 Abs. 3 CRR ²)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Internes Modell (Art. 155 Abs. 4 CRR ²)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Befristete Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Temporary Partial Use“, Art. 495 CRR ²)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Dauerhafte Verwendung des Kreditrisiko-Standardansatzes („Permanent Partial use“, Art. 150 Abs. 1 Buchstabe h und g CRR ²)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

B. Kreditrisikominderung gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 4 CRR

OeNB Identnummer			
		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Umfassende Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 223 bis 228 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf eigenen Schätzungen beruhende Volatilitätsanpassungen bei der umfassenden Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (Art. 225 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

C. Verbriefung gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 5 CRR

OeNB Identnummer			
		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (SEC-IRBA, Art. 258 bis 260 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Standardansatz (SEC-SA, Art. 261 bis 262 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf externen Beurteilungen basierender Ansatz (SEC-ERBA, Art. 263 bis 264 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Interner Bemessungsansatz (SEC-SIAA, Art. 265 bis 266 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Residualer Ansatz (SEC-other, Art. 254 Abs. 7 CRR)		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

D. Gegenparteausfallsrisiko gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 6 CRR

OeNB Identnummer	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Standardansatz (Art. 274 bis 280f CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Vereinfachter Standardansatz (Art. 281 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Ursprungsrisikomethode (Art. 282 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Auf einem internen Modell beruhende Methode (Art. 283 bis 294 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

E. Marktrisiko gemäß Teil 3 Titel IV CRR**E.1. Allgemeine Angaben**

OeNB Identnummer	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Nutzung der Ausnahmebestimmung gemäß Art. 94 CRR („kleines Handelsbuch“)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Erlaubnis zur Verwendung interner Modelle (Art. 363 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

E.2. Standardansatz

	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Schuldtitel (Teil 3 Titel IV Kapitel 2 Abschnitt 2 CRR):	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Laufzeitbezogene Berechnung (Art. 339 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
	- Durationsbasierte Berechnung (Art. 340 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]
Aktieninstrumente (Teil 3 Titel IV Kapitel 2 Abschnitt 3 CRR):	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fremdwährungsrisiko (Teil 3 Titel IV Kapitel 3 CRR):	Positionen des Bankbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Positionen des Handelsbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]
Warenpositionsrisiko (Teil 3 Titel IV Kapitel 4 CRR):	Laufzeitbandverfahren (Art. 359 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Vereinfachtes Verfahren (Art. 360 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Erweitertes Laufzeitbandverfahren (Art. 361 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]
Korrelationshandelsportfolio (Art. 338 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

E.3. Internes Marktrisikomodell (IMM Teil 3 Titel IV Kapitel 5 CRR)

		Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Schuldtitle:	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Aktieninstrumente:	Allgemeines Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Spezifisches Risiko	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Fremdwährungsrisiko:	Positionen des Bankbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
	Positionen des Handelsbuchs	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Warenpositionsrisiko:		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Korrelationshandelsaktivitäten (Art. 377 CRR):		[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

F. Risiko einer Anpassung der Kreditbewertung (CVA-Risiko) gemäß Teil 3 Titel VI CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Standardansatz (Art. 383 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Basisansatz (Art. 384 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]
Vereinfachter Ansatz (Art. 385 CRR)	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

G. Strukturelle Liquiditätsquote gemäß Teil 6 Titel IV CRR

OeNB Identnummer		
	Einzelinstitutsebene	Konsolidierte Ebene ¹
Vereinfachte strukturelle Liquiditätsquote (simplified NSFR) gemäß Teil 6 Titel IV Kapitel 6 CRR	[1 – Ja; 2 – Nein]	[1 – Ja; 2 – Nein]

¹ Nur anzugeben, wenn abweichend von Einzelinstitutsebene.

² Gemäß Art. 495 Abs. 1 Buchstabe b CRR bezieht der Verweis sich auf die vor dem 8. Juli 2024 gültige Fassung der CRR, somit auf 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 27.06.2013 S. 1, in der Fassung der Verordnung (EU) 2023/2869, ABl. Nr. L 2023/2869 vom 20.12.2023.