

EU-Bankrecht: EU-BankR

2. Auflage 2025
ISBN 978-3-406-83397-7
Beck im dtv

schnell und portofrei erhältlich bei
beck-shop.de

Die Online-Fachbuchhandlung beck-shop.de steht für Kompetenz aus Tradition. Sie gründet auf über 250 Jahre juristische Fachbuch-Erfahrung durch die Verlage C.H.BECK und Franz Vahlen. beck-shop.de hält Fachinformationen in allen gängigen Medienformaten bereit: über 12 Millionen Bücher, eBooks, Loseblattwerke, Zeitschriften, DVDs, Online-Datenbanken und Seminare. Besonders geschätzt wird beck-shop.de für sein umfassendes Spezialsortiment im Bereich Recht, Steuern und Wirtschaft mit rund 700.000 lieferbaren Fachbuchtiteln.

Sachverzeichnis

Die fetten Zahlen bezeichnen die Nummer eines Textes in dieser Ausgabe; die mageren Zahlen bezeichnen die jeweiligen Paragraphen oder Artikel.

- Abflüsse** aus Kredit- und Liquiditätsfazilitäten 7 424; bei Privatkundeneinlagen 7 421; bei sonstigen Verbindlichkeiten 7 422; zusätzliche 7 423
- Absicherungsgeschäfte** anerkennungsfähige 7 386
- Abwicklung** 12 14 ff.; 13 21 ff.; von Finanzinstituten und Mutterunternehmen 12 16
- Abwicklung von Kreditinstituten-VO** 12
- Abwicklungsausschuss** der ESMA 13 5
- Abwicklungsbarmittelabruf** 13 31
- Abwicklungsbefugnisse** 13 48 ff.
- Abwicklungsfähigkeit** 13 15 ff.; Bewertung 12 10
- Abwicklungsfonds**, einheitlicher 12 67 ff.
- Abwicklungsinstrumente** 13 27 ff.; allgemeine Grundsätze 12 22
- Abwicklungskollegien** 13 4
- Abwicklungskonzept** 12 23
- Abwicklungs-/Lieferisiko** 7 378
- Abwicklungspläne** 12 9
- Abwicklungsplanung** nach SRM-VO 12 8 ff.
- Abwicklungsverfahren** 12 18
- Abwicklungsziele** 13 21
- Abzug** von der künftigen Rentabilität 7 38; immaterieller Vermögenswerte 7 37; von Positionen in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche und bei Überkreuzbeteiligung eines Instituts 7 58
- Aktienindizes** 7 344
- Aktieninstrumente** 7 341 ff.; allgemeines Risiko 7 343; Nettopositionen 7 341; spezifisches Risiko 7 342
- Aktualisierung** künftiger Liquiditätsanforderungen 7 426
- Allgemeine Bestimmungen** 2 42
- Allgemeine Grundsätze** für eine Abwicklung 13 23
- Allgemeine Untersuchungen** 4 11
- Alternative** zum Risikogewicht von 1 250 % 7 90
- Alternativer Standardansatz** 7 319 ff.
- Amortisation** von Posten, die als Ergänzungskapitalposten bestandsgeschützt sind 7 488
- Anerkennung** von Absicherungen über Erstaussfall-Kreditderivate und n-ter-Aussfall-Kreditderivate 7 347; von Absicherungen über Kreditderivate 7 346
- Anfangskapitalanforderung** an bereits bestehende Unternehmen 7 93
- Anforderung** für K-Faktoren 8 15 ff.
- Anforderungen** an die Risikomessung 7 367
- Angekaufte Forderungen** Anforderungen 7 184
- Anlagebasisinformationsblatt** 9 23 f.
- Anlagestrategie** im IFR 8 52
- Anlegerschutz** 9 19 ff.
- Anpassungspflicht** der Mitgliedstaaten 1 131
- Anrechenbaren Eigenmittel** Begriffsbestimmung 7 517
- Anwendbarkeit** der Übergangsbestimmungen 2 50
- Anwendung** strengerer Anforderungen durch Institute 7 3
- Anzeige** der Ausübung des Niederlassungsrechts 4a 13
- Aufrechnung (Netting)** 8 31
- Aufsichtliche Anforderungen** 7 459
- Aufsichtliche Konsolidierung** 7 11 ff.; Anwendung der Anforderungen 7 11 ff.; Aufsichtlicher Konsolidierungskreis 7 19 ff.
- Aufsichtliche Korrekturposten** 7 32 ff.
- Aufsichtlicher Formelansatz** 7 262
- Aufsichts- und Untersuchungsbefugnisse** 4 9
- Aufsichtsanforderungen** 9 11; auf konsolidierter Basis, wenn Wertpapierfirmen Mutterunternehmen sind 7 10a; an Wertpapierfirmen 8
- Aufsichtsbefugnisse** 4 16; 7 2
- Aufsichtsgebühren** 4 30
- Aufsichtsgremium** 4 26
- Aufsichtskollegien** 5 21
- Ausfallquoten**, Offenlegung 9 20
- Ausfallwahrscheinlichkeit (PD)** 7 160, 163
- Ausgabe** von Banknoten und Münzen 1 128
- Auskunftersuchen** 10 37
- Auslagerung** 9 9
- Ausnahmeregelung** für Mitgliedsstaaten 1 139

Sachverzeichnis

Fette Zahlen = Gesetzesnummern

Ausschlüsse aus Modellen für das spezifische Risiko 7 371

Aussetzung der Eigenmittelanforderungen 7 380

Bail-in-Instrument 12 27

Bankenaufsicht Allgemeine Grundsätze 7 6; Innenrevision 7 191; Konsolidierung auf Einzelbasis 7 9; Methoden der aufsichtlichen Konsolidierung 7 18; Nichterfüllung der Bedingungen 7 30; Posten des harten Kernkapitals 7 26; Steuerüberzahlungen 7 39; Unternehmensführung 7 189; Verbriefte Aktiva 7 32

Bankenaufsichtf., Ausnahmen 7 7

Banknoten 2 16

Basel-I-Untergrenze Übergangsbestimmungen 7 500

Basisindikatoransatz 7 315 f.

Bearbeitung von Beschwerden 9 7

beaufsichtigte Unternehmen, Liste 4a 49

Beaufsichtigung von Wertpapierfirmen 7 17

Beaufsichtigung bedeutender beaufsichtigter Unternehmen, Verfahren 4a 89 ff.

Beaufsichtigung Unternehmen auf konsolidierter Basis 4a 8; weniger bedeutender beaufsichtigter 4a 7

Beaufsichtigung weniger bedeutender beaufsichtigter Unternehmen, Verfahren 4a 96 ff.

Befugnisse der Behörden des Aufnahmemitgliedstaats und Zusammenarbeit bei der Beaufsichtigung auf konsolidierter Basis 4 17

Befugnisübertragung 9 44

Begriffsbestimmungen 6 2

Bekanntgabe von Beschlüssen zu gemeinsamen Verfahren 4a 88

Beratender Fachausschuss 6 13

Beratender Wissenschaftlicher Ausschuss 6 12

Berechnung des allgemeinen Risikos durationsbasiert 7 340; laufzeitbezogen 7 339

Berufsgeheimnis 9 35; 12 88

Beschlussfassungsverfahren 5 39

Beschränkungen des Bestandsschutzes bei Posten innerhalb von Posten des harten Kernkapitals, des zusätzlichen Kernkapitals und des Ergänzungskapitals 7 486

Beschwerdeausschuss 5 58 f.; 12 85

Beschwerdeverfahren nach der Überweisungs-VO 2021 11 9

Besondere Meldepflichten 7 101

Bestandsschutz für Instrumente der staatlichen Beihilfe 7 483; für Kapitalinstrumente 7 483 ff.

Bestandsschutzfähige Posten, die nach den nationalen Maßnahmen zur Umsetzung der Richtlinie 2006/48/EG als Eigenmittel gelten 7 484

Beteiligung von Drittländern 5 75

Beteiligungspositionen 7 167

Beteiligungsrisikopositionen 7 133

Betrugsbekämpfungsmaßnahmen 5 66

Beurteilung des Erwerbs von qualifizierten Beteiligungen 4 15

Bewertung 13 24 ff.; für Abwicklungszwecke 12 20; der Besicherung 7 239; von Vermögenswerten in der Bankenaufsicht 7 24

Beziehungen zu Drittländern 13 76 ff.

Bonitätsbeurteilung von Emittenten und Emissionen 7 139

Bonitätsbeurteilungen lang- und kurzfristig 7 140

Bonitätsbeurteilungen von ECAI 7 135 f.

Brücken-CCP 13 42 ff.

CCPRR-VO 13; Behörden, Abwicklungskollegium und Verfahren 13 3 ff.

CCR-Management Organisationsstrukturen 7 287; Überprüfung des Systems 7 288

Covid-19 7 468, 500a ff.

CVA-Methoden Alternative für die Berechnung der Eigenmittelanforderungen 7 385

CVA-Risiko 7 381 ff.; Offenlegung 7 445a

Datenschutz 5 71; 9 36; 10 56; 12 89

Delegierte Rechtsakte 7 456; 10 57; im IFR 8 56

Delta-Faktor- und Vega-Risiken, Eigenmittelanforderungen 7 383b

Delta-Risikosensitivitäten 7 383i

Der Erweiterte Rat der EZB 2 44

Derivate Zinsrisiko 7 331

Direkte Beaufsichtigung durch die EZB, Beginn und Ende 4a 45 ff.

DORA 10; allgemeine Bestimmungen 10 1 ff.; Lernprozesse und Weiterentwicklung 10 13

EBA, Aufgaben und Befugnisse 5 8 ff.; Begriffsbestimmungen 5 4; Errichtung und Rechtsstellung 5 1 ff.; Fragen und Antworten 5 16b; interne Ausschüsse 5 41; Leitlinien und Empfehlungen 5 16; Organisation 5 40 ff.; Rechtsstellung 5 5; Sitz 5

7; Systemrisiken **5** 22; Zusammensetzung **5** 6

EBA-VO 5

ECAI **7** 135 ff.; Inanspruchnahme **7** 444

ECSP-VO 9; Allgemeine Bestimmungen **9** 1 f.; Begriffsbestimmungen **9** 2

Eigenkapitalunterstützung, staatlich **13** 46

Eigenmittel **7** 25 ff., 72, 437; Anwendung der Mindestanforderung **12** 12 ff.; Anwendung und Berechnung **12** 12a; Ausnahme von der Mindestanforderung **12** 12b; Ausnahmeregelung in Bezug auf die Mindestanforderung **12** 12b; Berechnung und Meldepflichten **7** 99 ff.; auf der Grundlage der fixen Gemeinkosten **7** 97; Festlegung der Mindestanforderung **12** 12d f.; IFR **8** 9 ff.; Mindestanforderung **12** 12; Mindesthöhe **7** 92 ff.; Verstöße gegen die Mindestanforderung **12** 12j; von Wertpapierfirmen auf konsolidierter Basis **7** 98

Eigenmittelanforderung **7** 315 ff.; für das Korrelationshandelsportfolio **7** 338; und Risikoquantifizierung **7** 186; für Schuldtitel, die keine Verbriefungspositionen darstellen **7** 336; für Verbriefungspositionen **7** 337

Eigenmittelanforderungen **7** 92 ff., 438; für das Abwicklungsrisiko **7** 378 ff.; für das Positionsrisiko **7** 326; für Delta-Faktor- und Vega-Risiken **7** 383b; bei der Verwendung interner Modelle **7** 364; gegenüber einer zentralen Gegenpartei **7** 300 ff.; für das Fremdwährungsrisiko **7** 351 ff.; für gedeckte Schuldverschreibungen **7** 496; für Handelsrisikopositionen **7** 306; an Institute **7** 92 ff.; für das Kreditrisiko **7** 107 ff.; für OGA **7** 348; für das operationelle Risiko **7** 312 ff.; für das Positionsrisiko **7** 326 ff.; Risikogewichte **7** 114 ff.; für Risikopositionen gegenüber zentralen Gegenparteien **7** 497; für Risikopositionen gegenüber ZGP, die bestimmte Bedingungen nicht mehr erfüllen **7** 311; für Risikopositionen in Form gedeckter Schuldverschreibungen **7** 503; Standardansatz **7** 111 ff.; Verwendung interner Modelle **7** 362 ff.; für vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds einer nicht qualifizierten ZGP und für nicht vorfinanzierte Beiträge zu einer nicht qualifizierten ZGP **7** 309; für vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds einer qualifizierten ZGP **7** 308; für vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds einer ZGP **7** 307; für das Warenpositionsrisiko **7** 355 ff.; an Wertpapierfirmen **7** 95 ff.; an

Wertpapierfirmen mit beschränkter Zulassung für die Erbringung von Finanzdienstleistungen **7** 95; an Wertpapierfirmen mit einem Anfangskapital in der in Artikel 28 Absatz 2 der Richtlinie 2013/36/EU festgelegten Höhe **7** 96

Eigenmittelanforderungen für das CVA-Risiko, Ansätze für die Berechnung **7** 382a

Eigenmittelinstrumente Ausschüttungen **7** 73

Eigenmittelqualität Kontinuierliche Prüfung **7** 80

Einhaltung der Liquiditätsanforderungen **7** 414

Einholen von Informationen **5** 35

Entgelte für grenzüberschreitende Zahlungen **11** 3; für Währungsumrechnungen kartengebundenen Zahlungsvorgängen **11** 4 f.

Erbringung von Schwarmfinanzierungsdienstleistungen **9** 3

Erbringung von Dienstleistungen zur Verwahrung des Kundenvermögens und von Zahlungsdiensten **9** 10

Ergänzende Rechtsvorschriften **2** 41

Ergänzungskapital **7** 62 ff.; Abzüge **7** 66 ff.; Abzüge von Posten **7** 476; Amortisierung von Instrumenten **7** 64; Instrumente **7** 63; Nichterfüllung der Bedingungen **7** 65; Posten **7** 62

Ergänzungskapitalposten Abzüge **7** 477; mit einem Tilgungsanreiz **7** 490

Erstausfall-Kreditderivate **7** 240

ESMA, Betrieb einer zentralen Datenbank **13** 84

ESRB, Aufgaben **6** 15 ff.; Organisation **6** 4 ff.; Struktur **6** 4; Verhältnis **5** 36; Verwaltungsrat **6** 6; Vorsitzender und stellvertretende Vorsitzende **6** 5

ESRB-VO 6

ESZB Aufgaben **2** 3; Aufgaben der Beschlussorgane **2** 12; Aufsicht **2** 25; Beratende Funktionen **2** 4; Berichtspflichten **2** 15; Direktorium **2** 11; Internationale Zusammenarbeit **2** 6; Jahresbericht **1** 284; Offenmarkt- und Kreditgeschäfte **2** 18; Präsident **2** 13; Sonstige geldpolitische Instrumente **2** 20; Struktur, Satzung **1** 129; Unabhängigkeit **2** 7; Ziele **2** 2; Ziele und Aufgaben **1** 127

Euro im internationalen Währungssystem **1** 138

Euro-Gruppe Tagungen **1** 137

Europäische Zentralbank **2** 9

Europäischer Bankenausschuss **7** 464

Europäisches System der Bankenabwicklungs- und Finanzierungsregelungen **5**

Sachverzeichnis

Fette Zahlen = Gesetzesnummern

- 27; der Einlagensicherungssysteme 5 26, 27
- Exekutivdirektor** 5 51 ff.
- EZB**, Aufsichtsbeschlüsse 4a 33 ff.; Befugnisse 4 9 ff.; Besondere Aufsichtsbefugnisse 4 14 ff.; und die NCAs als Mitglieder eines Aufsichtskollegiums 4a 10; Erweiterter Rat 1 141; Geheimhaltung 2 37; Gerichtliche Kontrolle 2 35; Kapital 2 28; Organisatorische Grundsätze 4 19 ff.; Personal 2 36; übertragene Aufgaben 4 4; Übertragung von Währungsreserven 2 30; Unterschriftsberechtigte 2 38; Untersuchungsbefugnisse 4 10 ff.; Vorrechte und Befreiungen 2 39; als Vorsitzende des Aufsichtskollegiums 4a 9; Vorübergehende Aufgaben 2 43
- EZB-Aufsichtsverfahren** 4a 25 ff.; Akten-einsicht 4a 32
- EZB-MindestreservspflichtVO**, Begriffsbestimmungen 3 2
- EZB-Rat** 2 10
- Festsetzung** der jährlichen Aufsichtsgebühr 4b 7 ff.
- Feststellung** der Bedeutung auf Basis der Bedeutung der grenzüberschreitenden Tätigkeiten 4a 59 ff.; der Bedeutung auf Basis der Größe 4a 50 ff.; der Bedeutung auf Basis des Kriteriums, dass das beaufsichtigte Unternehmen eines der drei bedeutendsten ist 4a 65 ff.; der Bedeutung auf Basis eines Antrags auf öffentliche finanzielle Unterstützung durch den ESM 4a 61
- Finanzholdinggesellschaft** Bankenaufsicht 7 12
- Finanzkonglomerate**, zusätzliche Beaufsichtigung 4a 18
- Finanzregelung** 5 65
- Finanzsicherheiten** Anforderungen 7 207
- Finanzvorschriften** 5 62 ff.
- Forderungen** Anforderungen 7 209; Rangfolge 12 17
- Fremdwährungsrisikoabsicherungen** der Kapitalquoten 7 104c
- Fristen** 4a 130 ff.
- Frühintervention** 12 13
- Frühzeitiges Eingreifen** 13 18 ff.
- Garantien** zusätzliche Anforderungen 7 215
- Garantien und Kreditderivate** Anforderungen 7 213
- Gebührensschuldner** 4b 4
- Gegenparteiausfallrisiko** 7 271 ff., 439; und Ursprungsrisikomethode 7 514
- Geheimhaltung** 2 37; 6 8; 13 73; und Informationsaustausch 4 27
- Gemeinsame Aufsichtskultur** 5 29
- Gemeinsame Aufsichtsteams** 4a 3; Einrichtung und Zusammensetzung 4a 3
- Gemeinsame Gremien** der Europäischen Aufsichtsbehörden 5 54 ff.
- Gerichtliche Genehmigung** 4 13; Kontrolle und damit verbundene Angelegenheiten 2 35
- Geschäfte** mit nicht linearem Risikoprofil 7 278
- Geschäftsordnung** des Erweiterten Rates 2 45
- Globale Systemrelevanz** Indikatoren 7 441
- Großkredit** Begriffsbestimmung 7 392; Kapazitäten zur Ermittlung und Verwaltung 7 393
- Großkredite** 7 387 ff., 507; Berechnung zusätzlicher Eigenmittelanforderungen 7 397; der Einhaltung der Anforderungen 7 396; Obergrenze 7 395
- Gruppenkapitaltest** 8 8
- G-SRI**, Konsolidierte Berechnung mit mehreren Abwicklungseinheiten 7 12a
- Haftung** der Behörde 5 69
- Handelsbuch** 7 102 ff.; Einbeziehung 7 104; Führung 7 103
- Hartes Kernkapital** 7 26 ff.; Abzüge von den Posten 7 36; Abzüge von Posten 7 469; Ausnahmen vom Abzug von Posten 7 470; Instrumente 7 52; Posten 7 51
- Haushalt** und Jahresabschlüsse 4 29
- Haushaltsdisziplin**, Grundzüge der Wirtschaftspolitik 1 136
- Hedging-Sätze** 7 282
- Hybride** Instrumente mit Kündigungsmöglichkeit und Tilgungsanreiz 7 489
- IFR 8**; Anwendung strengerer Anforderungen durch Wertpapierfirmen 8 3; Anwendungsebenen 8 5 ff.; Aufsichtliche Konsolidierung und Ausnahmen für eine Wertpapierfirmengruppe 8 7 ff.; Aufsichtsbefugnisse 8 2; Begriffsbestimmungen 8 4; Berichte und Überprüfungen 8 60; Delegierte Rechtsakte 8 56 ff.; Eigenmittelanforderungen 8 50; Gegenstand und Anwendungsbereich 8 1; Liquidität 8 43 ff.; Übergangsbestimmungen 8 57 ff.; Vergütungspolitik und -praxis 8 51
- IKT-bezogene Vorfälle**, Behandlung, Klassifizierung und Berichterstattung 10 17 ff.
- IKT-Drittparteienrisiko**, Management 10 28 ff.

IKT-Risikomanagement 10 5 ff.
IKT-Risikomanagementrahmen 10 6;
 vereinfacht 10 16
IKT-Systeme, -Protokolle und -Tools
 10 7
Immobilienicherheiten Anforderungen
 7 208
Inanspruchnahme des Fonds 12 76 ff.
Informationsaustausch zu Eignung und
 Zuverlässigkeit 5 31a
Informationsersuchen 4 10
Institutioneller Rahmen 12 42 ff.
Instrument der Ausgliederung von Ver-
 mögenswerten 12 26; des Brückeninstituts
 12 25; der Unternehmensveräußerung 12
 24
Instrumente des harten Kernkapitals 7 28
Interessengruppe Bankensektor 5 37
Interessenkonflikte 9 8
Internationale Beziehungen 4 8
**Internationale Rechnungslegungsvor-
 schriften** erstmalige Anwendung 7 466
Interne Modelle Verwendung 7 455
Internes IRC-Modell Anerkennung von
 Absicherungen 7 375; Anwendungs-
 bereich 7 373; besondere Anforderungen
 7 376; Parameter 7 374
IRB-Ansatz 7 142 ff., 143 ff.; Anforderun-
 gen 7 169 ff.; Kreditrisikominderung 7
 264; Ratingsysteme 7 169 ff.; Risikoquan-
 tifizierung 7 178 ff.
IRB-Ansatzes auf Kreditrisiken Anwen-
 dung 7 452
Jahresabschlüsse 2 26
**JST-Koordinator und Unterkoordinato-
 ren** 4a 6
Kapital der EZB 2 28
Kapitalanforderungen 8 11 ff.
Kapitalinstrumente von Gegenseitigkeits-
 gesellschaften, Genossenschaften, Sparkas-
 sen und ähnlichen Instituten 7 29; Herab-
 schreibung oder Umwandlung 12 21; In-
 dexpositionen 7 76
Kapitalpuffer 7 440
K-CMG, Berechnung 8 23
K-CON, Berechnung 8 39
Kernkapital 7 25
K-Faktoren, Anforderung 8 15 ff.
K-NPR, Berechnung 8 22
Kombination verschiedener Ansätze 7 314
Konsolidierung Ausnahmen 7 10
Konsolidierungsmethode 4a 54
Konten bei der EZB 2 17
Konvergenz von aufsichtlichen Überprü-
 fungsverfahren 5 20a
Konvergenzbericht 1 140

Konzentrationsrisiko 8 35 ff.; Obergren-
 zen 8 37; Überwachungspflicht 8 35
Koordinatorfunktion 5 31
Koordinierungsgruppen 5 45b
Korrelationen des Fremdwährungsrisikos 7
 383o
Korrelationsrisiko 7 291
Kreditbewertung, Anpassung 8 32
Kreditderivate 7 332; zusätzliche Anforde-
 rungen 7 216
Kreditportfolio, individuelle Verwaltung 9
 6
Kreditrisiko Definition des Ausfalls 7 506
Kreditrisikoanpassungen 7 442
Kreditrisikominderung 7 192 ff.; Anfor-
 derungen 7 205 ff.; Berechnung der Aus-
 wirkungen 7 218 ff.; für Verbriefungsposi-
 tionen, die dem Standardansatz unterlie-
 gen 7 257; Zulässige Formen 7 195 ff.
Kreditrisikominderungstechniken 7
 399; Berechnung der Wirkung 7 401;
 Verwendung 7 453
Kreditrisikoüberwachung 7 190
Kreditvergabekriterien 7 408
Kryptowerte, spezifische Begriffsbestim-
 mungen 7 5a
K-TCD, Berechnung 8 26
Kundengarantien 8 45
Langfristige Finanzierungen 7 516
Laufzeit der Kreditbesicherung 7 238
Laufzeitbandverfahren 7 359 ff.
Laufzeitinkongruenz bei der Bankenauf-
 sicht 7 237
Lenkungsausschuss 6 11
LGD-Schätzungen besondere Anforde-
 rungen 7 181
Liquide Aktiva Bewertung 7 418; Mel-
 dung 7 416; operative Anforderungen an
 den Bestand 7 417; Währungen mit be-
 grenzter Verfügbarkeit 7 419
Liquidität 7 411 ff., 460; im IFR 8 43 ff.
Liquiditätsabflüsse 7 420
Liquiditätsanforderungen 7 509
Liquiditätsdeckungsanforderung 7 412;
 Überprüfung der schrittweisen Einfüh-
 rung der 7 461
Liquiditätsfazilitäten 7 263
Liquiditätsmeldungen 7 415 ff.
Makroaufsicht Vorschriften 7 513
Makroprudenzielle Aufgaben und Instru-
 mente 4 5
**Management des Gegenparteiausfall-
 risikos (CCR)** 7 286 ff.
Marketingmitteilungen 9 27 f.; Anforde-
 rungen 9 27
Marktbewertungsmethode 7 274

Sachverzeichnis

Fette Zahlen = Gesetzesnummern

Marktrisiko 7 445
Maßgeblicher Indikator 7 316
Maßnahmen im Krisenfall 5 18
Meldepflicht und Meldeformat 7 415
Meldepflichten 11 7; bei Großkrediten 7 394
Meldewesen 4a 140 f.
Meldung über Eigenmittelanforderungen und Finanzinformationen 7 99; von Verstößen 4 23
Meldungen von Wertpapierfirmen 8 54 ff.
Minderheitsbeteiligungen 7 81 ff.
Mindestreserve, indirekte Haltung 3 10; Verzinsung 3 9
Mindestreservebasis 3 5; Aggregierte Meldung 3 11
Mindestreserve-Erfüllungsperiode 3 8
Mindestreserven 2 19; Haltung 3 3
Mindestreservepflicht, Befreiungen 3 4
Mindestreserve-Soll, Berechnung 3 6; Meldung 3 7; Überprüfung 3 14
Mitteilungspflichten 9 34

Nationale Parlamente 4 21
Netting von Bilanzpositionen 7 195, 219; -Rahmenvereinbarungen 7 196
Netto-Fremdwährungsposition Berechnung 7 352
Nettopositionen in Schuldtiteln 7 334
notleidende Risikopositionen 7 269a
NPE-Verbriefungen 7 506b
N-ter-Ausfall-Kreditderivate 7 241

Obergrenze der Eigenmittelanforderung für eine Nettoposition 7 335
Offenlegung gegenüber Anlegern 7 409; von Ausfallquoten 9 20; des CVA-Risikos 7 445a; von Eigenmitteln 7 492; 8 49; Häufigkeit 7 433; durch Institute 7 431 ff.; Mittel 7 434; von Risikopositionen in Kryptowerten 7 451b; von Wertpapierfirmen 8 46 ff.
Offenlegungspflichten auf konsolidierter Basis 7 13
OGA 7 506a; allgemeine Anforderungen 7 349; Fremdwährungsrisiko 7 353; spezifische Methoden 7 350
Operationelles Risiko 7 519e
Optionen und Optionsscheine 7 329
Originatoren und Sponsoren 7 252

PD, LGD und Laufzeit 7 159a
PD-Schätzungen Besondere Anforderungen 7 180
Peer Reviews 5 30
Personal 2 36; und Austausch von Personal 4 31
Plenarsitzung des Ausschusses 12 49 ff.

Plötzliche Zahlungsbilanzkrise Schutzmaßnahmen 1 144
Positionen in der Landeswährung und in ausländischer Währung 7 141; die eine stabile Refinanzierung bieten 7 427; im Handelsbuch 7 299; die stabile Refinanzierung erfordern 7 428
Präsidiumssitzung des Ausschusses 12 53 ff.
Prüfung langfristiger Finanzierungen 7 505
Prüfungen vor Ort 4 12
Qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors 7 89 ff.
Qualifiziertes zusätzliches Kernkapital, Kernkapital, Ergänzungskapital und qualifizierte Eigenmittel 7 82

Rat der Aufseher 5 40 ff.
Ratingbasierter Ansatz 7 261
Ratingssysteme Datenpflege 7 176; Dokumentierung 7 175; Struktur 7 170; Zuordnung 7 171
Rechenschaftspflicht der Behörden 5 3; und Berichterstattung 4 20
Rechnungshof 12 92
Rechnungsprüfung 2 27
Rechtsakte 2 34; betreffend den Euro 1 133
Rechtsbehelf 5 60 ff.
Regulatorisches CVA-Modell 7 383a
Reorganisationsplans 13 36 ff.
Resilienz, Testen der digitalen operationellen 10 24 ff.
Ressourcen 4 28
Risiko aus nicht im Handelsbuch enthaltenen Beteiligungspositionen 7 447; operationelles 7 446; aus Verbriefungspositionen 7 449
Risikofaktoren des Aktienkursrisikos 7 383g; des egenpartei-Kreditspreadrisikos 7 383e; des Fremdwährungsrisikos 7 383d; des Referenz-Kreditspreadrisikos 7 383f; des Warenpositionsrisikos 7 383h; des Zinsrisikos 7 383c
Risikogewicht, zusätzliches 7 407
Risikogewichte 7 251
Risikogewichtete Positionsbeträge 7 154 ff.; für das Gegenpartei-Kreditspreadrisiko 7 383p
Risikogewichts-Unterklassen für das Aktienkursrisiko 7 383v; für das Warenpositionsrisiko 7 383x
Risikogewichtung 7 89
Risikomanagement-Prozess und -Kontrollen 7 187
Risikomanagementsystem Anforderungen 7 293

Risikomanagementziele und -politik 7 435

Risikopositionen die aus Hypothekendarlehen resultieren 7 402; gegenüber beurteilten Instituten 7 120; in Form gedeckter Schuldverschreibungen 7 129; aus Grunderwerb, Erschließung und Bau 7 126a; gegenüber Instituten 7 119; gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung 7 131; gegenüber internationalen Organisationen 7 118; aus dem Mengengeschäft 7 123; gegenüber multilateralen Entwicklungsbanken 7 117; gegenüber öffentlichen Stellen 7 116; gegenüber regionalen oder lokalen Gebietskörperschaften 7 115; aus übertragenden Kreditrisiken 7 512; gegenüber unbeurteilten Instituten 7 121; gegenüber Unternehmen 7 122; gegenüber Unternehmen, Instituten, Zentralstaaten und Zentralbanken sowie Risikopositionen aus dem Mengengeschäft 7 166; in Form von Anteilen an OGA 7 132; mit Währungsinkongruenz 7 123a; gegenüber Zentralstaaten oder Zentralbanken 7 114; Zuordnung 7 172 f.

Risikopositionsklassen 7 112

Risikopositionswert 7 111, 246, 284; Berechnung 7 390; 8 27; Ermittlung 7 271; Methoden zur Berechnung 7 273; bei Netting-Sätzen mit Nachschussvereinbarung 7 285; potenzieller künftiger 8 29

RtC-K-Faktoren 8 16 ff.

RtF-K-Faktoren 8 24 ff.

RtM-K-Faktoren 8 21 ff.

Rückbürgschaften von Staaten und anderen öffentlichen Stellen 7 214

Sanierungs- und Abwicklungsplanung 13 9 ff.

Sanierungs- und Abwicklungsverfahren 5 25

Sanierungspläne, Vorgaben 13 Anh.

Sanktionen 12 38 ff.; Meldung an die ES-MA 9 43; nach der Überweisungs-VO 2021 11 12; verwaltungsrechtliche 9 39 ff.

Sanktionserlöse 4a 137

Schätzungen Allgemeine Anforderungen 7 179

Schlüssel für die Kapitalzeichnung 2 29

Schuldnerausfall 7 178

Schutz von Hinweisgebern 5 17a

Schutzbestimmungen 13 60 ff.

Schutzmaßnahmen 5 38

Schwarmfinanzierungsdienstleister 9 12 ff.; Beaufsichtigung 9 15; Berichterstattung 9 16; Entzug der Zulassung 9 17;

Forum 9 25; Umfang der Zulassung 9 13; Verzeichnis 9 14; Zulassung 9 12

Schwarmfinanzierungsdienstleistungen 9 3 ff.; grenzüberschreitende Erbringung 9 18

Schwelle für die Relevanz für die nationale Volkswirtschaft 4a 56

Schwellenwert und Gewichtung für das Fremdwährungsrisiko 7 351

Selbstbehalt des Emittenten 7 405

Sicherungsgeschäfte für Zahlungsströme und Wertänderungen 7 33

Sitzabkommen 5 74

Sonderverwaltung 13 50

Sonstige Finanzierungsmechanismen 13 44

Sonstige Sachsicherheiten Anforderungen 7 210

Sorgfaltsprüfung 7 406

Sprachenregelung 5 73

SRM-VO 12; Abwicklungsplanung 12 8 ff.; Anwendungsbereich 12 2; Begriffsbestimmungen 12 3; Teilnehmende Mitgliedsstaaten 12 4

SSM, allgemeine Bestimmungen für die Arbeitsweise 4a 19 ff.; Ausgaben und Kosten 4b 5; Berichterstattung 4b 17; Einstufung als bedeutend oder weniger bedeutend 4a 39 ff.; enge Zusammenarbeit in Bezug auf bedeutende beaufsichtigte Unternehmen 4a 115 f.; enge Zusammenarbeit in Bezug auf die Teile III, IV, V, VIII, X und XI 4a 109 ff.; enge Zusammenarbeit in Bezug auf weniger bedeutende beaufsichtigte Unternehmen 4a 117 ff.; freier Dienstleistungsverkehr von Kreditinstituten 4a 12; Gemeinsame Aufsichtsteams 4a 3; gemeinsame Verfahren 4a 73; Meldung von Verstößen 4a 36 ff.; Niederlassungsrecht von Kreditinstituten 4a 11; Organisation 4a 3; Rechnungsstellung 4b 12 ff.; Verfahren für die enge Zusammenarbeit 4a 106 ff.

SSM-GebVO 4b; Allgemeine Bestimmungen 4b 1 ff.; Begriffsbestimmungen 4b 2

SSM-Rahmenverordnung 4a; Begriffsbestimmungen 4a 2; Gegenstand und Ziel 4a 1

SSM-VO, Durchführungsbefugnisse 12 93 ff.; Finanzvorschriften 12 57 ff.; Sanktionen 12 38 ff.; Untersuchungsbefugnisse 12 34 ff.; Zusammenarbeit 12 30 ff.

Staatliche Beihilfen 12 19

Staatliche Stabilisierungsinstrumente 13 45 ff.

Staatliche Übernahme 13 47

Stabile Refinanzierung 7 413

Sachverzeichnis

Fette Zahlen = Gesetzesnummern

Standardmethode-Zinsrisikopositionen 7 281

Straftaten 4a 136

Strategische Aufsichtsprioritäten 5 29a

Stresstests 7 290; zur Beurteilung der Angemessenheit der Eigenmittelausstattung 7 177

Substitutionsansatz 7 403

Swaps 7 330

Synthetische Unternehmensanleihen 7 218

Systemrisiko, dauerhafte Fähigkeit zur Reaktion 5 24; Ermittlung und Messung 5 23

Technische Durchführungsstandards 5 15

Technische Regulierungsstandards 5 10; Einwände 5 13

Teilkonsolidierung von Unternehmen in Drittländern 7 22

Trennung von der geldpolitischen Funktion 4 25

Übergangsbestimmungen für Anforderungen an die Neubewertung von Immobilien 7 495f; für anrechenbare Eigenmittel 7 494; für bedingungslos kündbare Zusagen 7 495d; für bestimmte öffentliche Garantieregelungen 7 495g; für Beteiligungsrisikopositionen 7 495a; für das Kapital der EZB 2 47; für ECAI-Bonitätsbeurteilung von Instituten 7 495e; für Großkredite 7 493; für Leasingrisikopositionen als Kreditrisikominderungsverfahren 7 495c

Überprüfung 4 32

Überprüfungsausschuss, Administrativer 4 24

Überprüfungsklausel 10 58

Übertragung von Währungsreserven auf die EZB 2 30

Übertragung von Befugnissen, Einführung des Euro 3 13

Überwachung durch den Ausschuss 12 28; und Evaluierung 7 515; vertraglicher Vereinbarungen, die keine Zusagen sind 7 110a

Überwachungsgebühren 10 43

Überwachungsrahmen für kritische IKT-Drittdienstleister 10 31 ff.

Überweisungs-VO 11; außergerichtliche Beschwerde- und Rechtsbehelfsverfahren 11 10

Umtausch von auf Währungen der Mitgliedstaaten lautenden Banknoten 2 49

Unabhängigkeit 4 19; von EZB und nationalen Zentralbanken 1 130

Unparteilichkeit 6 7

Unternehmen in Drittländern 7 88b

Unternehmensveräußerung als Instrument 13 40 ff.; Verfahrensvorschriften 13 41

Unterschriftsberechtigte 2 38

Ursprungsrisikomethode 7 275

Validierung und Dokumentierung 7 188; interner Schätzungen 7 185

Validierungsanforderungen 7 294

Vega-Risikosensitivitäten 7 383j

Verantwortlichkeiten des Erweiterten Rates 2 46

Verbriefung synthetisch 7 244; traditionell 7 243

Verbriefungspositionen 7 130

Vereinbarungen über den Austausch von Informationen 10 45 ff.

Vereinfachte Anforderungen für bestimmte Institute 12 11

Vereinfachtes Änderungsverfahren 2 40

Verfahrenspflichten 13 70 ff.

Vergütungspolitik 7 450

Verhältnismäßigkeit 7 519f

Verletzung von Unionsrecht 5 17

Verlustereignisse Klassifizierung 7 324

Verlustquote bei Ausfall (LGD) 7 161, 164

Veröffentlichung von Entscheidungen 9 42

Verrechnungs- und Zahlungssysteme 2 22

Verringerung der risikogewichteten Positionsbeträge 7 258

Verringerung der Eigenmittel Bedingungen 7 77; Erlaubnis der Aufsichtsbehörden 7 78

Verschuldung 7 429 ff., 511

Verschuldungsquote Berechnung 7 429

Verteilung der monetären Einkünfte der nationalen Zentralbanken 2 32; der Nettogewinne und Verluste der EZB 2 33

Vertragliches Netting 7 295 ff.

Verwaltung des Fonds 12 75

Verwaltungsmaßnahmen und -Sanktionen 13 81 ff.

Verwaltungsrat 5 45 ff.; des ESRB 6 6

Verwaltungsanktionen 4 18; 4a 120 ff.; Verfahrensregeln 4a 123 ff.

Volatilitätsanpassungen 7 224 ff.

Voraussetzungen für eine Abwicklung 13 22

Vor-Ort-Prüfungen 4a 143 ff.

Vorrechte und Befreiungen 2 39

Vorsichtsmaßnahmen 9 37

Vorübergehende Aufgaben der EZB 2 43

Währungsreserven der nationalen Zentralbanken 2 31

Wechselkurspolitik 1 142

Wiederbeschaffungskosten (RC) 8 28

Wirtschafts- und Finanzausschuss 1 134

Zahlungsabwicklung, Maßnahmen zur Erleichterung 11 6

Zahlungsbilanzschwierigkeiten 1 143

Zeitwertbilanzierte nicht realisierte Gewinne 7 468; nicht realisierte Verluste 7 467

Zentralbanken, Nationale 2 14

Zinsrisiko aus nicht im Handelsbuch enthaltenen Positionen 7 448

Zinsterminkontrakte und Terminpositionen 7 328

Zuflüsse 7 425

Zugang zu Informationen, Berichterstattung, Untersuchungen und Vor-Ort-Prüfungen 4a 138 ff.

Zulassung 4 14

Zurückgestellte Einzahlungen von Kapital, Reserven und Rückstellungen der EZB 2 48

Zusammenarbeit 4 3; in Bezug auf den Erwerb qualifizierter Beteiligungen 4a 85 ff.; zwischen der EZB, den NCAs und NDAs 4a 101 ff.; beim Entzug der Zulassung 4a 80 ff.; innerhalb des einheitlichen Aufsichtsmechanismus 4 6; mit den NCAs 4b 11

Zusätzliches Kernkapital 7 51 ff.; Abzüge von Posten 7 474; Allgemeine Anforderungen 7 73 ff.

Zuständige Behörden und ESMA 9 29 ff.

Zyklische Effekte von Eigenmittelanforderungen 7 502


beck-shop.de
DIE FACHBUCHHANDLUNG



beck-shop.de
DIE FACHBUCHHANDLUNG