

Datum: 02.09.2020 | Kategorie: Sonstige

## Diverse RTS zum neuen regulatorischen Rahmenwerk für Wertpapierfirmen (IFR/IFD) (EBA/CP/2020/06)

Die EBA veröffentlicht einige RTS-Entwürfe zum neuen regulatorischen Rahmenwerk für Wertpapierfirmen (IFR/IFD) (EBA/CP/2020/06). Konsultationsbeginn war der 4. Juni 2020 und Ende der Konsultation ist der 4. September 2020.

Das von der EBA veröffentlichte Dokument umfasst drei RTS-Entwürfe über die Neuklassifizierung von bestimmten Wertpapierfirmen als Kreditinstitute (eines davon ist Bestandteil des Konsultationspapiers EBA/CP/2020/07), fünf RTS-Entwürfe über Kapitalanforderungen für Wertpapierfirmen auf Einzelebene und einen RTS-Entwurf über die aufsichtliche Konsolidierung für Wertpapierfirmen auf der Gruppenebene. Dabei geht es um die Sicherstellung des Proportionalitätsgrundsatzes zur Berücksichtigung der verschiedenen Klassen von Wertpapierfirmen.

Folgende Anforderungen für Wertpapierfirmen umfasst das Dokument:

- ? RTS zu Informationen, einschließlich des Geschäftsplans gemäß Art. 10 CRD, die das Unternehmen den zuständigen Behörden in dem Zulassungsantrag zu übermitteln hat (Art. 8a Abs. 6 Buchstabe a CRD)
- ? RTS zur Methode zur Berechnung der Schwellenwerte (Gesamtaktiva des Instituts oder Gruppe ? 30 Mrd. EUR) (Art. 8a Abs. 6 Buchstabe b CRD)
- ? RTS zur Festlegung der Berechnung der fixen Gemeinkosten und Bestimmung des Begriffs der wesentlichen Änderung (Art. 13 Abs. 4 IFR)
- ? RTS zur Festlegung der Methoden zur Messung der K-Faktoren (Art. 15 Abs. 5 Buchstabe a IFR)
- ? RTS zur Definition des Begriffs der getrennten Konten (Art. 15 Abs. 5 Buchstabe b IFR)
- ? RTS zur Festlegung der Anpassungen der K-DTF-Koeffizienten (Art. 15 Abs. 5 Buchstabe c IFR)
- ? RTS zur Spezifizierung der Berechnung des Betrags des geforderten Gesamteinschusses und der Methode zur Berechnung von K-CMG (Art. 23 Abs. 3 IFR)
- ? RTS zu Kriterien für die Anwendung der Anforderungen der CRR auf bestimmte Wertpapierfirmen (Art. 5 Abs. 6 IFD)
- ? RTS zur aufsichtsrechtlichen Konsolidierung von Wertpapierfirmen auf Gruppenebene (Art. 7 Abs. 5 IFR)

Die finalen Entwürfe sollen im Dezember an die EU-KOM übermittelt werden. Anzuwenden sind sie ab dem 26. Juni 2021.

Quellen / Verweise:

EBA/CP/2020/06