DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2022/389 DER KOMMISSION

vom 8. März 2022

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Anwendung der Richtlinie (EU) 2019/2034 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf das Format, den Aufbau, das Inhaltsverzeichnis und den Zeitpunkt der jährlichen Veröffentlichung der von den zuständigen Behörden offenzulegenden Angaben

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Richtlinie (EU) 2019/2034 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über die Beaufsichtigung von Wertpapierfirmen und zur Änderung der Richtlinien 2002/87/EG, 2009/65/EG, 2011/61/EU, 2013/36/EU, 2014/59/EU und 2014/65/EU ([1]), insbesondere auf Artikel 57 Absatz 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) In der Richtlinie (EU) 2019/2034 ist festgelegt, dass die zuständigen Behörden bestimmte Informationen offenlegen müssen, um die Wirksamkeit des Binnenmarkts für Wertpapierfirmen zu verbessern und ein angemessenes Maß an Transparenz für die breite Öffentlichkeit zu gewährleisten. Der Richtlinie zufolge müssen die offengelegten Informationen so umfassend und genau sein, dass sie einen aussagekräftigen Vergleich zwischen den von den zuständigen Behörden der Mitgliedstaaten angewandten Ansätzen ermöglichen.

(2) Um diesen Vergleich zu erleichtern, sollten die Informationen der zuständigen Behörden in einem einheitlichen Format veröffentlicht und regelmäßig aktualisiert werden und unter einer einzigen elektronischen Zugangsadresse abrufbar sein. Daher sollten das Format, der Aufbau, das Inhaltsverzeichnis und der Zeitpunkt der jährlichen Veröffentlichung der Angaben festgelegt werden. Auch wenn sich die aufsichtlichen Offenlegungspflichten gemäß Titel V der Richtlinie (EU) 2019/2034 auf das gesamte Spektrum der Aufsichtsvorschriften erstrecken, sollten zuerst die Aufsichtspflichten in den Blick genommen werden, die sich aus der genannten Richtlinie und der Verordnung (EU) 2019/2033 des Europäischen Parlaments und des Rates ([2]) ergeben.

(3) Die vorliegende Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Umsetzungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Bankenaufsichtsbehörde nach Konsultation der Europäischen Wertpapier- und Börsenaufsichtsbehörde übermittelt wurde.

(4) Die Europäische Bankenaufsichtsbehörde hat zu diesem Entwurf öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 des Europäischen Parlament und des Rates ([3]) eingesetzten Interessengruppe Bankensektor eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Rechts- und Verwaltungsvorschriften und allgemeine Empfehlungen

Wenn die zuständigen Behörden gemäß Artikel 57 Absatz 1 Buchstabe a der Richtlinie (EU) 2019/2034 den Wortlaut der Rechts- und Verwaltungsvorschriften und allgemeinen Empfehlungen, die in ihrem Mitgliedstaat gemäß jener Richtlinie verabschiedet wurden, veröffentlichen, verwenden sie dafür jeweils die in Anhang I aufgeführten Meldebögen.

([1]) ABl. L 314 vom 5.12.2019, S. 64.

([2]) Verordnung (EU) 2019/2033 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 27. November 2019 über Aufsichtsanforderungen an Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnungen (EU) Nr. 1093/2010, (EU) Nr. 575/2013, (EU) Nr. 600/2014 und (EU) Nr. 806/2014 (ABl. L 314 vom 5.12.2019, S. 1).

([3]) Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Bankenaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/78/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 12).

Artikel 2

Optionen und Ermessensspielräume

Wenn die zuständigen Behörden gemäß Artikel 57 Absatz 1 Buchstabe b der Richtlinie (EU) 2019/2034 Angaben zur Art und Weise, wie Optionen und Ermessensspielräume genutzt werden, veröffentlichen, verwenden sie dafür jeweils die in Anhang II aufgeführten Meldebögen.

Artikel 3

Allgemeine Kriterien und Methoden für die aufsichtliche Überprüfung und Bewertung

Wenn die zuständigen Behörden gemäß Artikel 57 Absatz 1 Buchstabe c der Richtlinie (EU) 2019/2034 die allgemeinen Kriterien und Methoden, nach denen sie bei der aufsichtlichen Überprüfung und Bewertung gemäß Artikel 36 jener Richtlinie verfahren, veröffentlichen, verwenden sie dafür den in Anhang III aufgeführten Meldebogen.

Artikel 4

Aggregierte statistische Daten

Wenn die zuständigen Behörden gemäß Artikel 57 Absatz 1 Buchstabe d der Richtlinie (EU) 2019/2034 aggregierte statistische Daten zu zentralen Aspekten der Umsetzung des Aufsichtsrahmens veröffentlichen, verwenden sie dafür die in Anhang IV aufgeführten Meldebögen.

Artikel 5

Zeitpunkt der jährlichen Veröffentlichung

(1) Die zuständigen Behörden veröffentlichen die in Artikel 57 Absatz 1 der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannten Angaben erstmals zum 30. Juni 2022 unter einer einzigen elektronischen Zugangsadresse.

(2) Die zuständigen Behörden aktualisieren die in Artikel 57 Absatz 1 Buchstabe d der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannten Angaben bis zum 30. Juni jeden Jahres auf der Grundlage der zum 31. Dezember des Vorjahres erfolgten aufsichtlichen Meldungen.

(3) Die zuständigen Behörden aktualisieren die in Artikel 57 Absatz 1 Buchstaben a, b und c der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannten Angaben regelmäßig, spätestens jedoch bis zum 30. Juni jeden Jahres, es sei denn, bei den veröffentlichten Angaben hat sich keine Änderung ergeben.

Artikel 6

Inkrafttreten

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 8. März 2022

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN

ANHANG I

VORSCHRIFTEN UND LEITLINIEN

Liste der Meldebögen

TEIL 1	Umsetzung der Richtlinie (EU) 2019/2034
TEIL 2	Erlaubnis zur Verwendung eines Modells
TEIL 3	Spezifische Offenlegungspflichten von Wertpapierfirmen
TEIL 4	Aufsichtliche Meldungen

Allgemeine Anmerkungen zum Ausfüllen der Meldebögen in Anhang I

Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.

TEIL 1

Umsetzung der Richtlinie (EU) 2019/2034

	Umsetzung von Bestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034	Bestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034	Link(s) zur nationalen Rechtsvorschrift ([1])	Fundstelle(n) der nationalen Bestimmungen ([2])	Auf EN verfügbar (J/N)
010	**Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesen Meldebögen**		*(TT/MM/JJJJ)*		
020	I. **Gegenstand, Anwendungsbereich und Begriffsbestimmungen**	Artikel 1 bis 3			
030	II. **Zuständige Behörden**	Artikel 4 bis 8			
040	III **Anfangskapital**	Artikel 9 bis 11			
050	IV. **Beaufsichtigung**				
060	KAPITEL 1 - Grundsätze der Beaufsichtigung				
070	Abschnitt 1 - Zuständigkeiten und Pflichten des Herkunfts- und Aufnahmemitgliedstaats	Artikel 12 bis 14			
080	Abschnitt 2 - Geheimhaltung und Berichterstattungspflicht	Artikel 15 bis 17			
090	Abschnitt 3 - Sanktionen, Ermittlungsbefugnisse und Rechtsmittel	Artikel 18 bis 23			
100	KAPITEL 2 – Überprüfungsverfahren				
110	Abschnitt 1 – Beurteilung der Angemessenheit des internen Kapitals und interne Risiken	Artikel 24			
120	Abschnitt 2 - Interne Unternehmensführung, Transparenz, Umgang mit Risiken und Vergütung	Artikel 25 bis 35			
130	Abschnitt 3 - Aufsichtliches Überprüfungs- und Bewertungsverfahren	Artikel 36 bis 37			
140	Abschnitt 4 - Aufsichtsmaßnahmen und -befugnisse	Artikel 38 bis 45			
150	KAPITEL 3 - Beaufsichtigung von Wertpapierfirmengruppen				
160	Abschnitt 1 - Beaufsichtigung von Wertpapierfirmengruppen auf konsolidierter Basis und Überwachung der Einhaltung des Gruppenkapitaltests	Artikel 46 bis 50			
170	Abschnitt 2 - Investmentholdinggesellschaften, gemischte Finanzholdinggesellschaften und gemischte Holdinggesellschaften	Artikel 51 bis 56			
180	**TITEL V - VERÖFFENTLICHUNGEN DER ZUSTÄNDIGEN BEHÖRDEN**	Artikel 57			
190	**TITEL VI - DELEGIERTE RECHTSAKTE**	Artikel 58			
200	**TITEL VII – ÄNDERUNG ANDERER RICHTLINIEN**	Artikel 59 bis 64			
210	**TITEL VIII - SCHLUSSBESTIMMUNGEN**	Artikel 65 bis 69			

([1]) Hyperlink(s) zur Website, auf der die nationalen Rechtsvorschriften zur Umsetzung der betreffenden EU-Bestimmung veröffentlicht sind.
([2]) Genaue Fundstelle in den nationalen Bestimmungen wie Titel, Kapitel, Paragraph etc.

TEIL 2

Erlaubnis zur Verwendung eines Modells [1]

010	**Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen**	*(TT/MM/JJJJ)*
		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	*[Freitext]*
040	Beschreibung des von den zuständigen Behörden durchgeführten Bewertungsverfahrens (eigene Beurteilung, Beauftragung externer Prüfer oder Vor-Ort-Prüfung) und Hauptbewertungskriterien	*[Freitext]*
050	Form der Entscheidungen der zuständigen Behörden und Übermittlung der Entscheidungen an die Antragsteller	*[Freitext]*

TEIL 3

Spezifische Offenlegungspflichten von Wertpapierfirmen

	Richtlinie (EU) 2019/2034	Bestimmung	Von der zuständigen Behörde zu liefernde Angaben	
010	**Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen**			*(TT/MM/JJJJ)*
020	**Artikel 44 Buchstabe a**	Die zuständigen Behörden sind befugt, Wertpapierfirmen, die die in Artikel 12 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Bedingungen für die Einstufung als kleine und nicht verflochtene Wertpapierfirmen nicht erfüllen, und Wertpapierfirmen nach Artikel 46 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 dazu zu verpflichten, die in Artikel 46 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Angaben mehr als einmal jährlich zu veröffentlichen, und Fristen für diese Veröffentlichung zu setzen.	Häufigkeit der Veröffentlichung und Fristen für die Veröffentlichung durch die Wertpapierfirmen.	*[Freitext]*
030	**Artikel 44 Buchstabe b**	Die zuständigen Behörden können Wertpapierfirmen, die die in Artikel 12 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Bedingungen für die Einstufung als kleine und nicht verflochtene Wertpapierfirmen nicht erfüllen, und Wertpapierfirmen nach Artikel 46 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 dazu verpflichten, für andere Veröffentlichungen als den Jahresabschluss besondere Medien und Orte, insbesondere ihre Websites, zu nutzen.	Arten der von den Wertpapierfirmen zu nutzenden Medien.	*[Freitext]*

[1] Gilt ab dem 26. Juni 2026 oder ab dem Tag, an dem die Anforderungen gemäß Artikel 57 Absatz 1 der Verordnung

040	**Artikel 44 Buchstabe c**	Die zuständigen Behörden können Mutterunternehmen dazu verpflichten, jährlich entweder in Vollform oder durch einen Verweis auf gleichwertige Angaben eine Beschreibung ihrer rechtlichen Struktur und der Unternehmensführungs- und Organisationsstruktur der Wertpapierfirmengruppe gemäß Artikel 26 Absatz 1 der vorliegenden Richtlinie und Artikel 10 der Richtlinie 2014/65/EU zu veröffentlichen.	Rechtliche Struktur und Unternehmensführungs- und Organisationsstruktur des Mutterunternehmens der Wertpapierfirmengruppe.	*[Freitext]*

TEIL 4

Aufsichtliche Meldungen

010	**Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen**	(TT/MM/JJJJ)
020	**Umsetzung der Finanzberichterstattung gemäß der Durchführungsverordnung (EU) 2021/XXX der Kommission**	
030	Werden zur Übermittlung der Meldungen an die zuständige Behörde XBRL-Standards verwendet?	*[Ja/Nein]*

ANHANG II

OPTIONEN UND ERMESSENSSPIELRÄUME

Liste der Meldebögen

TEIL 1	Optionen und Ermessensspielräume gemäß der Richtlinie (EU) 2019/2034 und der Verordnung (EU) 2019/2033
TEIL 2	Anzahl der Wertpapierfirmen, die die Übergangsbestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 und der Verordnung (EU) 2019/2033 anwenden
TEIL 3	Elemente der variablen Vergütung (Artikel 32 der Richtlinie (EU) 2019/2034)

Allgemeine Anmerkungen zum Ausfüllen der Meldebögen in Anhang II

Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.

TEIL 1

Optionen und Ermessensspielräume gemäß der Richtlinie (EU) 2019/2034 und der Verordnung (EU) 2019/2033

	Richtlinie (EU)-2019/2034	Verordnung (EU) 2019/2033	Adressat	Bezeichnung	Beschreibung der Option oder des Ermessensspielraums	Genutzt? (J/N/Entfällt [1])	Nationale Vorschrift [2]	Fundstelle(n) [3]	Auf EN verfügbar (J/N)	Einzelheiten/Anmerkungen
010	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen							*(TT/MM/JJJJ)*		
020	Artikel 5 Absatz 1		Zuständige Behörde	Anwendung von CRD-Anforderungen	Die zuständigen Behörden können beschließen, die Verordnung (EU) Nr. 575/2013 auf Wertpapierfirmen anzuwenden, die in Anhang I Abschnitt A Nummern 3 und 6 der Richtlinie 2014/65/EU aufgeführte Tätigkeiten ausüben, wenn die konsolidierte Bilanzsumme der Wertpapierfirma einem Gesamtwert von 5 000 000 000 EUR oder mehr entspricht und die Bedingungen von Artikel 5 Absatz 1 der Richtlinie (EU) 2019/2034 erfüllt sind.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
030	Artikel 24 Absatz 2		Zuständige Behörde	Internes Kapital und liquide Aktiva	Die zuständigen Behörden können von kleinen und nicht verflochtenen Wertpapierfirmen verlangen, die in Artikel 24 der Richtlinie (EU) 2019/2034 festgelegten Anforderungen an internes Kapital und liquide Aktiva anzuwenden.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
040	Artikel 36 Absatz 2		Zuständige Behörde	Aufsichtliche Überprüfung und Bewertung	Die zuständigen Behörden entscheiden jeweils im Einzelfall, ob und in welcher Form die Überprüfung und Bewertung in Bezug auf kleine und nicht verflochtene Wertpapierfirmen durchgeführt werden.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
050	Artikel 40 Absatz 7		Zuständige Behörde	Zusätzliche Eigenmittelanforderung	Die zuständigen Behörden können kleinen und nicht verflochtenen Wertpapierfirmen im Einzelfall die in Artikel 40 der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannten zusätzlichen Eigenmittelanforderungen auferlegen.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
060	Artikel 41 Absatz 1		Zuständige Behörde	Zusätzliche Eigenmittelanforderung	Die zuständigen Behörden können von Wertpapierfirmen, die keine kleinen und verflochtenen Wertpapierfirmen sind, verlangen, dass ihre Eigenmittelausstattung ausreicht, um die potenziellen Auswirkungen konjunkturbedingter wirtschaftlicher Schwankungen abzudecken.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
070	Artikel 42 Absatz 1		Zuständige Behörde	Liquiditätsanforderungen	Die zuständigen Behörden schreiben Wertpapierfirmen die besonderen Liquiditätsanforderungen nach Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe k der Richtlinie (EU) 2019/2034 nur dann vor, wenn für diese Firmen die in Artikel 42 Absatz 1 der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannten Liquiditätsanforderungen gelten.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
080	Artikel 46 Absatz 6		Zuständige Behörde	Ausnahme von den Kriterien für die Gruppenaufsicht	Die zuständigen Behörden können für die Ausübung der Überwachung auf konsolidierter Basis eine andere als die in Artikel 46 Absatz 6 der Richtlinie (EU) 2019/2034 genannte Behörde benennen.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
090		Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe c	Zuständige Behörde	Anwendung von Anforderungen der Eigenmittelverordnung (Verordnung (EU) Nr. 575/2013)	Die zuständige Behörde kann beschließen, Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gemäß Artikel 1 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 auf Wertpapierfirmen anzuwenden, die in Anhang I Abschnitt A Nummern 3 und 6 der Richtlinie 2014/65/EU genannte Tätigkeiten ausüben und bei denen der Gesamtwert der konsolidierten Bilanzsumme der Wertpapierfirma 15 000 000 000 EUR oder mehr beträgt.	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		

100		Artikel 1 Absatz 5	Zuständige Behörde	Anwendung von Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Die zuständigen Behörden können gestatten, Anforderungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 auf Wertpapierfirmen anzuwenden, die in Anhang I Abschnitt A Nummern 3 und 6 der Richtlinie 2014/65/EU genannte Tätigkeiten ausüben, wenn die Wertpapierfirma ein Tochterunternehmen eines Kreditinstituts, einer Finanzholdinggesellschaft oder einer gemischten Finanzholdinggesellschaft im Sinne von Artikel 1 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 ist.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
110		Artikel 6 Absatz 1	Zuständige Behörde	Erfüllung der Anforderungen auf Einzelbasis	Die zuständigen Behörden können Wertpapierfirmen von der Anwendung des Artikels 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 in Bezug auf die Teile 2, 3, 4, 6 und 7 ausnehmen, wenn alle Bedingungen des Artikels 6 Absatz 1 erfüllt sind.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
120		Artikel 6 Absatz 2	Zuständige Behörde	Erfüllung der Anforderungen auf Einzelbasis	Die zuständigen Behörden können Wertpapierfirmen von der Anwendung des Artikels 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 in Bezug auf Teil 6 ausnehmen, wenn alle Bedingungen des Artikels 6 Absatz 2 erfüllt sind.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
130		Artikel 6 Absatz 3	Zuständige Behörde	Erfüllung der Anforderungen auf Einzelbasis	Die zuständigen Behörden können Wertpapierfirmen von der Anwendung des Artikels 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 in Bezug auf Teil 5 ausnehmen, wenn alle Bedingungen des Artikels 6 Absatz 3 erfüllt sind.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
140		Artikel 7 Absatz 4	Zuständige Behörde	Anwendung der Anforderungen auf konsolidierter Basis	Die zuständigen Behörden können das Mutterunternehmen von der Einhaltung der in Teil 5 festgelegten Pflichten auf konsolidierter Basis ausnehmen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
150		Artikel 8 Absatz 1	Zuständige Behörde	Anwendung der Anforderungen auf konsolidierter Basis	Die zuständigen Behörden können die Anwendung von Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2033 gestatten, wenn die Gruppenstruktur hinreichend einfach ist und von der Wertpapierfirmengruppe als Ganzes keine wesentlichen Risiken für Kunden oder für den Markt ausgehen, die andernfalls eine Beaufsichtigung auf konsolidierter Basis erfordern würden.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
160		Artikel 8 Absatz 4	Zuständige Behörde	Anwendung der Anforderungen auf konsolidierter Basis	Die zuständigen Behörden können einem Mutterunternehmen gestatten, einen niedrigeren Eigenmittelbetrag als den gemäß Artikel 8 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2033 berechneten Betrag zu halten, sofern dieser Betrag nicht niedriger ist als die Summe aus den auf Einzelbasis geltenden Eigenmittelanforderungen an ihre Tochterunternehmen, bei denen es sich um Wertpapierfirmen, Finanzinstitute, Anbieter von Nebendienstleistungen oder vertraglich gebundene Vermittler handelt, und dem Gesamtbetrag der Eventualverbindlichkeiten zugunsten dieser Unternehmen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
170		Artikel 9 Absatz 4	Zuständige Behörde	Eigenmittel	Die zuständigen Behörden können gestatten, dass für Wertpapierfirmen, die kleine und nicht verflochtene Wertpapierfirmen oder keine juristischen Personen oder Aktiengesellschaften sind, weitere Instrumente oder Mittel als Eigenmittel gelten.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
180		Artikel 10 Absatz 2	Zuständige Behörde	Qualifizierte Eigenmittelbeteiligungen	Die zuständigen Behörden können einer Wertpapierfirma das Halten der in Artikel 10 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten qualifizierten Beteiligungen, deren Betrag den dort festgesetzten prozentualen Anteil an Eigenmitteln überschreitet, untersagen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
190		Artikel 11 Absatz 3	Zuständige Behörde	Eigenmittel	Die zuständigen Behörden können verlangen, dass eine Wertpapierfirma andere Eigenmittelanforderungen erfüllt als die in Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Anforderungen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		

200		Artikel 13 Absatz 2	Zuständige Behörde	Eigenmittel. Anforderung für fixe Gemeinkosten	Die zuständigen Behörden können den Betrag der in Artikel 13 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Anforderung für fixe Gemeinkosten anpassen, wenn ihrer Ansicht nach eine wesentliche Änderung der Geschäftstätigkeiten einer Wertpapierfirma eingetreten ist.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
210		Artikel 15 Absatz 4	Zuständige Behörde	Eigenmittel	Die zuständigen Behörden können den Betrag eines relevanten K-Faktors anpassen, wenn ihrer Ansicht nach eine wesentliche Änderung der Geschäftstätigkeiten einer Wertpapierfirma eingetreten ist.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
220		Artikel 17 Absatz 2	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-AUM (verwaltete Vermögenswerte)	Die zuständige Behörde kann fehlende historische Datenpunkte durch Regulierungsfeststellungen ersetzen, die auf den gemäß Artikel 7 der Richtlinie 2014/65/EU vorgelegten Geschäftsprognosen der Wertpapierfirma beruhen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
230		Artikel 18 Absatz 2	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-CMH (gehaltene Kundengelder)	Die zuständige Behörde kann fehlende historische Datenpunkte durch Regulierungsfeststellungen ersetzen, die auf den gemäß Artikel 7 der Richtlinie 2014/65/EU vorgelegten Geschäftsprognosen der Wertpapierfirma beruhen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
240		Artikel 19 Absatz 3	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-ASA (verwahrte und verwaltete Vermögenswerte)	Die zuständige Behörde kann fehlende historische Datenpunkte durch Regulierungsfeststellungen ersetzen, die auf den gemäß Artikel 7 der Richtlinie 2014/65/EU vorgelegten Geschäftsprognosen der Wertpapierfirma beruhen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
250		Artikel 20 Absatz 3	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-COH (bearbeitete Kundenaufträge)	Die zuständige Behörde kann fehlende historische Datenpunkte durch Regulierungsfeststellungen ersetzen, die auf den gemäß Artikel 7 der Richtlinie 2014/65/EU vorgelegten Geschäftsprognosen der Wertpapierfirma beruhen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
260		Artikel 30 Absatz 1	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-TCD	Die zuständigen Behörden können die Volatilitätsanpassung für bestimmte Arten von Waren ändern, für die es verschiedene Volatilitätsniveaus bei Preisen gibt.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
270		Artikel 33 Absatz 4	Zuständige Behörde	K-Faktoren. K-DTF (täglicher Handelsstrom)	Die zuständige Behörde kann fehlende historische Datenpunkte durch Regulierungsfeststellungen ersetzen, die auf den gemäß Artikel 7 der Richtlinie 2014/65/EU vorgelegten Geschäftsprognosen der Wertpapierfirma beruhen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
280		Artikel 38 Absatz 2	Zuständige Behörde	Konzentrationsrisiko	Die zuständigen Behörden können Wertpapierfirmen einen begrenzten Zeitraum bis zur Erfüllung der in Artikel 37 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannten Obergrenze für das Konzentrationsrisiko und die Überschreitung des Risikopositionswerts einräumen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
290		Artikel 41 Absatz 2	Zuständige Behörde	Konzentrationsrisiko	Die zuständigen Behörden können in Artikel 41 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannte Risikopositionen ganz oder teilweise von der Anwendung des Artikels 37 der Verordnung (EU) 2019/2033 ausnehmen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		
300		Artikel 43 Absatz 1	Zuständige Behörde	Liquiditätsanforderungen	Die zuständigen Behörden können kleine und nicht verflochtene Wertpapierfirmen von der Anwendung der Liquiditätsanforderungen nach Artikel 43 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 ausnehmen.	[J/N/ Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld		

(1) „J" (Ja) bedeutet, dass die zuständige Behörde oder der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum genutzt hat.
„N" (Nein) bedeutet, dass die zuständige Behörde bzw. der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum nicht genutzt hat.
„Entfällt" bedeutet, dass die Option nicht genutzt werden kann oder der Ermessensspielraum nicht besteht.

(2) Wortlaut der betreffenden nationalen Rechtsvorschrift.

(3) Fundstelle im nationalen Rechtsakt und Hyperlink(s) zur Website, auf der die nationalen Rechtsvorschriften zur Umsetzung der betreffenden EU-Bestimmung veröffentlicht sind.

TEIL 2

Anzahl der Wertpapierfirmen, die die Übergangsbestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 und der Verordnung (EU) 2019/2033 anwenden

	Richtlinie (EU) 2019/2034	Verordnung (EU) 2019/2033	Adressat	Geltungsbereich	Bezeichnung	Beschreibung der Option oder des Ermessensspielraums	Jahr	Genutzt? (J/N/Entfällt) (1)	Anzahl der Wertpapierfirmen, die die Übergangsbestimmung anwenden
	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen						*(TT/MM/JJJJ)*		
010		Artikel 57 Absatz 3	Wertpapierfirmen	Eigenmittel	Anwendung geringerer Eigenmittelanforderungen	In Artikel 57 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannte Wertpapierfirmen dürfen für einen Zeitraum von fünf Jahren ab dem 26. Juni 2021 geringere Eigenmittelanforderungen anwenden.	[Jahr]	[J/N/Entfällt]	
020		Artikel 57 Absatz 4	Wertpapierfirmen	Eigenmittel	Anwendung geringerer Eigenmittelanforderungen	In Artikel 57 Absatz 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannte Wertpapierfirmen dürfen für einen Zeitraum von fünf Jahren ab dem 26. Juni 2021 geringere Eigenmittelanforderungen anwenden.	[Jahr]	[J/N/Entfällt]	
030		Artikel 57 Absatz 6	Wertpapierfirmen, die für eigene Rechnung handeln	Eigenmittel	Anwendung geringerer Eigenmittelanforderungen	Wertpapierfirmen, die für eigene Rechnung handeln und in Artikel 57 Absatz 6 der Verordnung (EU) 2019/2033 genannt werden, dürfen ihre Eigenmittelanforderungen für einen Zeitraum von fünf Jahren ab dem 26. Juni 2021 auf mindestens 250 000 EUR beschränken; dies gilt vorbehaltlich einer jährlichen Erhöhung um mindestens 100 000 EUR während dieses Fünfjahreszeitraums.	[Jahr]	[J/N/Entfällt]	

(1) „J" (Ja) bedeutet, dass die zuständige Behörde oder der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum genutzt hat.
„N" (Nein) bedeutet, dass die zuständige Behörde bzw. der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum nicht genutzt hat.
„Entfällt" bedeutet, dass die Option nicht genutzt werden kann oder der Ermessensspielraum nicht besteht.

TEIL 3

Elemente der variablen Vergütung (Artikel 32 der Richtlinie (EU) 2019/2034)

	Richtlinie (EU) 2019/2034	Adressat	Bestimmungen	Offenzulegende Information	Genutzt? (J/N/Entfällt)	Verweise	Auf EN verfügbar (J/N)	Einzelheiten/ Anmerkungen
010	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen			(TT/MM/JJJJ)				
020	Artikel 30 Absatz 2	Mitgliedstaaten	Die Mitgliedstaaten beschreiben, wie sie sicherstellen, dass Wertpapierfirmen ein angemessenes Verhältnis zwischen dem variablen und dem festen Bestandteil der Gesamtvergütung festlegen.	[Freitext/Wert]	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld	
030	Artikel 32 Absatz 3	Mitgliedstaaten oder zuständige Behörden	Beschreibung etwaiger Einschränkungen bezüglich Art und Ausgestaltung von Instrumenten oder Verbote von Instrumenten, die für die Zwecke der variablen Vergütung verwendet werden können.	[Freitext/Wert]	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld	

040	Artikel 32 Absatz 5	Mitgliedstaaten	Andere als die in Artikel 32 Absatz 4 genannten Schwellenwerte, die die zuständige Behörde für bestimmte Wertpapierfirmen heraufgesetzt hat.	[Wert in EUR]	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld	
050	Artikel 32 Absatz 6	Mitgliedstaaten	Andere als die in Artikel 32 Absatz 4 genannten Schwellenwerte, die die zuständige Behörde für bestimmte Wertpapierfirmen herabgesetzt hat.	[Wert in EUR]	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld	
060	Artikel 32 Absatz 7	Mitgliedstaaten	Beschreibung von Besonderheiten des Marktes oder der Art der Aufgaben und des Stellenprofils von Mitarbeitern, die Anspruch auf eine jährliche variable Vergütung haben, die nicht über 50 000 EUR hinausgeht und nicht mehr als ein Viertel der jährlichen Gesamtvergütung der betreffenden Person ausmacht, und für die die Ausnahme nach Artikel 32 Absatz 4 nicht gilt.	[Freitext/Wert]	[J/N/Entfällt]	Wenn J, Pflichtfeld	Wenn J, Pflichtfeld	

(1) „J“ (Ja) bedeutet, dass die zuständige Behörde oder der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum genutzt hat.

„N“ (Nein) bedeutet, dass die zuständige Behörde bzw. der zuständige Mitgliedstaat die betreffende Option bzw. den Ermessensspielraum nicht genutzt hat.

„Entfällt“ bedeutet, dass die Option nicht genutzt werden kann oder der Ermessensspielraum nicht besteht.

(2) Fundstelle im nationalen Rechtsakt und Hyperlink(s) zur Website, auf der die nationalen Rechtsvorschriften zur Umsetzung der betreffenden EU-Bestimmung veröffentlicht sind.

ANHANG III

AUFSICHTLICHE ÜBERPRÜFUNG UND BEWERTUNG (SREP)

Liste der Meldebögen

Allgemeine Anmerkungen zum Ausfüllen der Meldebögen in Anhang III

Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.

AUFSICHTLICHE ÜBERPRÜFUNG UND BEWERTUNG (SREP) [1]

010	Datum der letzten Aktualisierung der Angaben in diesem Meldebogen		*(TT/MM/JJJJ)*
020	**Anwendungsumfang der SREP** (Artikel 36 IFD)	Beschreibung des Ansatzes der zuständigen Behörde für den Anwendungsumfang der SREP, insbesondere: — Arten von Wertpapierfirmen, die unter die SREP fallen/davon ausgenommen sind; — umfassender Überblick über die Art und Weise, wie die zuständige Behörde dem Grundsatz der Verhältnismäßigkeit Rechnung trägt, wenn sie den SREP-Anwendungsumfang und die Häufigkeit der Bewertung verschiedener SREP-Elemente erwägt [1].	*[Freitext, Fundstelle der einschlägigen Leitlinien oder entsprechender Link]*
030	**Bewertung von SREP-Elementen** (Artikel 36 IFD)	Beschreibung des Ansatzes der zuständigen Behörde für die Bewertung einzelner SREP-Elemente, insbesondere: — umfassender Überblick über den Bewertungsprozess und die zur Bewertung von SREP-Elementen angewandten Methoden, einschließlich i) Geschäftsmodellanalyse, ii) Bewertung der internen Unternehmensführung und firmenweiter Kontrollen, iii) Bewertung der Kapitalrisiken und iv) Bewertung der Liquiditätsrisiken; — allgemeine Darstellung der Art und Weise, wie die zuständige Behörde bei der Bewertung der einzelnen SREP-Elemente den Grundsatz der Verhältnismäßigkeit berücksichtigt [2].	*[Freitext, Fundstelle der einschlägigen Leitlinien oder entsprechender Link]*
040	**Überprüfung und Bewertung von ICAAP und ILAAP** (Artikel 24 und 36 IFD)	Beschreibung des Ansatzes der zuständigen Behörde für die Überprüfung und Bewertung der zusätzlichen Eigenmittel- und spezifischen Liquiditätsanforderungen im Rahmen der SREP, insbesondere für die Beurteilung der Zuverlässigkeit der Berechnung zusätzlicher Eigenmittel und der Liquiditätsberechnungen im Hinblick auf die Bestimmung zusätzlicher Eigenmittel- und Liquiditätsanforderungen, einschließlich [3]: — Überblick über die von der zuständigen Behörde angewandte Methode zur Überprüfung des Verfahrens zur Beurteilung der Angemessenheit des internen Kapitals (Internal Capital Adequacy Assessment Process, ICAAP) und des Verfahrens zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität (Internal Liquidity Adequacy Assessment Process, ILAAP) von Wertpapierfirmen;	*[Freitext, Fundstelle der einschlägigen Leitlinien oder entsprechender Link]*

[1] In den Zeilen 020 bis 040 ist anzugeben, welche Kriterien und Methoden die zuständigen Behörden anwenden, und in Zeile 050, wie sie bei der Gesamtbewertung verfahren; dies jeweils in Form eines erläuternden Vermerks in der zweiten Spalte.

		— Informationen über/Verweis auf die Anforderungen der zuständigen Behörde für die Übermittlung von ICAAP- und ILAAP-bezogenen Angaben, insbesondere welche Angaben zu übermitteln sind; — Informationen dazu, ob von den Wertpapierfirmen eine unabhängige Überprüfung des ICAAP und des ILAAP verlangt wird.	
050	**SREP-Gesamtbewertung und Aufsichtsmaßnahmen** (Artikel 38 und 39 IFD)	Beschreibung des Ansatzes der zuständigen Behörde für die SREP-Gesamtbewertung (Zusammenfassung) und die Anwendung von Aufsichtsmaßnahmen auf der Grundlage der SREP-Gesamtbewertung ([4]). Beschreibung der Art und Weise, wie die SREP-Ergebnisse mit der Anwendung von Frühinterventionsmaßnahmen nach Artikel 27 der Richtlinie 2014/59/EU verbunden werden, und der Kriterien, nach denen entschieden wird, ob die Wertpapierfirm als „ausfallend oder wahrscheinlich ausfallend“ im Sinne von Artikel 32 der genannten Richtlinie erachtet werden kann ([5]).	*[Freitext, Fundstelle der einschlägigen Leitlinien oder entsprechender Link]*

([1]) Sowohl auf Ebene der Wertpapierfirma als auch in Bezug auf deren Eigenmittel zu erwägender Anwendungsumfang. Die zuständigen Behörden beschreiben den Ansatz, nach dem die Wertpapierfirmen für SREP-Zwecke unterschiedlichen Kategorien zugeordnet werden, wobei zu erläutern ist, wie quantitative und qualitative Kriterien zum Einsatz kommen und wie sich die betreffende Kategorisierung auf die Finanzstabilität und andere übergeordnete Aufsichtsziele auswirkt. Die zuständigen Behörden beschreiben außerdem, wie die Kategorisierung in die Praxis umgesetzt wird, um bei den SREP-Bewertungen ein Mindestmaß an Überwachung sicherzustellen; dabei ist auch zu beschreiben, wie häufig die einzelnen SREP-Elemente bei den verschiedenen Kategorien von Wertpapierfirmen bewertet werden.

([2]) Anzugeben sind insbesondere Arbeitsinstrumente wie z. B. Vor-Ort-Prüfungen und anderweitige Verfahren, qualitative und quantitative Kriterien sowie statistische Daten, die bei den Bewertungen herangezogen werden. Hinzuzufügen sind Links zu etwaigen auf der Website enthaltenen Leitlinien.

([3]) Von den zuständigen Behörden ist auch zu erläutern, wie dafür gesorgt wird, dass die Bewertung des Verfahrens zur Beurteilung der Angemessenheit des internen Kapitals (ICAAP) und des Verfahrens zur Beurteilung der Angemessenheit der internen Liquidität (ILAAP) dem Grundsatz des Mindestmaßes an Überwachung genügt, der auf Basis der SREP-Kategorien zur Wahrung der Verhältnismäßigkeit angewandt wird, und wie der Grundsatz der Verhältnismäßigkeit bei der Festlegung aufsichtlicher Erwartungen an die Einhaltung der ICAAP und ILAAP angewandt wird; dabei sind insbesondere etwaige Leitlinien oder Mindestanforderungen zu nennen, die die zuständigen Behörden für ICAAP und ILAAP ausgegeben haben.

([4]) Ansatz, nach dem die zuständigen Behörden zur SREP-Gesamtbewertung gelangen und diese den Wertpapierfirmen mitteilen. Die Gesamtbewertung der zuständigen Behörden beruht auf einer Überprüfung sämtlicher in den Zeilen 020 bis 040 angegebener Elemente samt aller sonstigen relevanten Informationen über die Wertpapierfirma, die sich die zuständige Behörde beschaffen kann.

([5]) Die zuständigen Behörden können auch die Grundsätze angeben, anhand deren sie über Aufsichtsmaßnahmen (im Sinne von Artikel 18 IFD) und Frühinterventionsmaßnahmen (im Sinne von Artikel 27 der Richtlinie über die Sanierung und Abwicklung von Kreditinstituten (BRRD)) entscheiden, wenn ihre Bewertung bei einer Wertpapierfirma Schwächen oder Defizite aufzeigt, die ein Eingreifen der Aufsichtsbehörden erfordern. Dabei könnten insbesondere auch interne Leitlinien oder sonstige Dokumente veröffentlicht werden, in denen allgemeine Aufsichtspraktiken beschrieben werden. Der Vertraulichkeit halber werden keine Angaben zu Entscheidungen verlangt, die einzelne Wertpapierfirmen betreffen.

Außerdem können die zuständigen Behörden angeben, welche Konsequenzen drohen, wenn eine Wertpapierfirma gegen die einschlägigen Rechtsvorschriften verstößt oder aufsichtlichen bzw. Frühinterventionsmaßnahmen, die infolge der SREP-Ergebnisse ergriffen werden, keine Folge leistet; beispielsweise können die bestehenden Durchsetzungsverfahren angeführt werden (soweit anwendbar).

ANHANG IV

AGGREGIERTE STATISTISCHE DATEN

Liste der Meldebögen

TEIL 1	Individualdaten pro zuständiger Behörde
TEIL 2	Daten zu Marktrisiken
TEIL 3	Daten zu Aufsichtsmaßnahmen und Verwaltungssanktionen
TEIL 4	Daten zu Ausnahmen

Allgemeine Hinweise zum Ausfüllen der Meldebögen in Anhang IV

1) Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.

2) Zahlenfelder dürfen nur Zahlen enthalten. Es dürfen keine nationalen Währungen angegeben werden. Alle Beträge sind in Euro auszuweisen; im Falle nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörender Länder sind die nationalen Währungen unter Verwendung der EZB-Wechselkurse (zum üblichen Stichtag, d. h. dem letzten Tag des betreffenden Jahres) in Euro umzurechnen, wobei Millionenbeträge mit einer Dezimalstelle anzugeben sind.

3) Geldbeträge sind in Millionen Euro (Mio. EUR) auszuweisen.

4) Prozentwerte sind mit zwei Dezimalstellen anzugeben.

5) Werden Daten nicht ausgewiesen, ist der Grund unter Verwendung der EBA-Nomenklatur anzugeben, d. h. N/A für „nicht verfügbar“ (not available) oder C für „vertraulich“ (confidential).

6) Auszuweisen sind aggregierte Daten, die nicht auf einzelne Wertpapierfirmen schließen lassen.

7) Daten sind nur für Wertpapierfirmen zu erheben, die der Richtlinie (EU) 2019/2034 unterliegen. Wertpapierfirmen, die der Richtlinie (EU) 2019/2034 nicht unterliegen, sind somit von der Datenerhebung ausgenommen.

TEIL 1

Individualdaten pro zuständiger Behörde (Jahr 20XX)

			Betreffender Meldebogen	Daten	
	Anzahl und Größe der Wertpapierfirmen				
010	Anzahl der Wertpapierfirmen			[Zahlenwert]	
020	Gesamtvermögen aller Wertpapierfirmen im Mitgliedstaat (in Mio. EUR) ([1])			[Zahlenwert]	
	Anzahl und Größe von Wertpapierfirmen aus Drittländern ([2])				
030	Aus Drittländern	Anzahl der Zweigniederlassungen ([3])		[Zahlenwert]	
040		Anzahl der Tochterunternehmen ([4])		[Zahlenwert]	
	Zusammensetzung der Eigenmittel in Bezug auf die Eigenmittelanforderungen			**Daten, in Mio. EUR**	**Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen ([6]) (in %)**
050	Hartes Kernkapital insgesamt ([5])		I 01.00 Zeile 0030	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
060	Zusätzliches Kernkapital insgesamt ([5])		I 01.00 Zeile 0300	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
070	Ergänzungskapital insgesamt ([5])		I 01.00 Zeile 0420	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
080	Eigenmittel insgesamt ([6])		I 01.00 Zeile 0010	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
	Eigenmittelanforderungen insgesamt, nach Art			**Daten, in Mio. EUR**	**Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen ([6]) (in %)**
090	Daten zu den Eigenmittelanforderungen	Anforderung für fixe Gemeinkosten ([7])	I 02.00 Zeile 0030	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
100		Permanente Mindestkapitalanforderung ([8])	I 02.00 Zeile 0020	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
110		K-Faktor-Anforderung ([9])	I 02.00 Zeile 0040	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
120		davon Kundenrisiko (RtC) ([10])	I 04.00 Zeile 0020	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
130		davon Marktrisiko (RtM) ([11])	I 04.00 Zeile 0090	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
140		davon Firmenrisiko (RtF) ([12])	I 04.00 Zeile 0120	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]

(1) Das Gesamtvermögen entspricht der Summe der Vermögenswerte aller Wertpapierfirmen in einem Mitgliedstaat, berechnet nach geltenden Rechnungslegungsstandards, ohne verwaltete Vermögenswerte.
(2) Ohne EWR.
(3) Anzahl der Zweigniederlassungen im Sinne von Artikel 3 Absatz 1 Nummer 3 der Richtlinie (EU) 2019/2034. Hat eine Wertpapierfirma mit Sitz in einem Drittland in einem Land mehrere Betriebsstellen errichtet, so werden diese als eine einzige Zweigniederlassung betrachtet.
(4) Anzahl der Tochterunternehmen im Sinne von Artikel 3 Absatz 1 Nummer 29 der Richtlinie (EU) 2019/2034. Tochterunternehmen eines Tochterunternehmens werden als Tochterunternehmen des an der Spitze dieser Unternehmen stehenden Mutterunternehmens betrachtet.
(5) Kapital im Sinne von Artikel 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033.
(6) Eigenmittelanforderungen insgesamt im Sinne von Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2033.
(7) Anforderung für fixe Gemeinkosten im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2019/2033.
(8) Permanente Mindestkapitalanforderung im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2019/2033.
(9) K-Faktor-Anforderung im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2019/2033.
(10) Eigenmittelanforderungen für Kundenrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2019/2033. In der Spalte „Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen (in %)“ ist die Gesamtkapitalquote anzugeben.
(11) Eigenmittelanforderungen für Marktrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2019/2033.
(12) Eigenmittelanforderungen für Firmenrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2019/2033.

TEIL 2

Daten zu Marktrisiken (1) (Jahr 20XX)

Daten zu Marktrisiken			Ansatz	Betreffender Meldebogen	Daten	
010	**Eigenmittelanforderungen für Marktrisiken**					
020	**Aufschlüsselung nach Ansätzen**	Anzahl der Wertpapierfirmen, die den jeweiligen Ansatz verwenden, bezogen auf die Gesamtzahl der Wertpapierfirmen (1)	K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko	IF 04.00 Zeile 0100	[Zahlenwert]	
030			davon Standardansatz		[Zahlenwert]	
040			davon alternativer Standardansatz		[Zahlenwert]	
050			davon alternativer auf internen Modellen basierender Ansatz		[Zahlenwert]	
060			davon jeder K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko (2)		[Zahlenwert]	
070			K-Faktoransatz für den geleisteten Einschuss	IF 04.00 Zeile 0110	[Zahlenwert]	
080			Sowohl K-Faktor für den geleisteten Einschuss als auch K-Faktor für das Nettopositionsrisiko		[Zahlenwert]	

(1) Aufzunehmen sind Angaben zu allen Wertpapierfirmen, nicht nur zu Wertpapierfirmen mit Positionen im Zusammenhang mit dem K-Faktor für das Nettopositionsrisiko.

090					**Daten, in Mio. EUR**	**Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen** ([3]) (in %)
100		Gesamte Eigenmittelanforderungen nach jedem Ansatz ([1])	K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko	IF 04.00 Zeile 0100	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
110			davon Standardansatz		[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
120			davon alternativer Standardansatz		[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
130			davon alternativer auf internen Modellen basierender Ansatz ([2])		[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
140			davon jeder K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko ([2])		[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
150			K-Faktoransatz für den geleisteten Einschuss	IF 04.00 Zeile 0110	[Zahlenwert]	[Zahlenwert]
160			Sowohl K-Faktor für den geleisteten Einschuss als auch K-Faktor für das Nettopositionsrisiko		[Zahlenwert]	[Zahlenwert]

([1]) Bestimmte Wertpapierfirmen können mehr als einen Ansatz anwenden, sodass sich die Summe der Positionen 020 bis 060 von der Gesamtzahl der Wertpapierfirmen, die den K-Faktor für das Nettopositionsrisiko berechnen, unterscheiden kann.

([2]) Verwenden Wertpapierfirmen mehr als einen Ansatz für den K-Faktor für das Nettopositionsrisiko: Standardansatz, alternativer Standardansatz, alternativer auf internen Modellen basierende Ansatz.

([3]) Eigenmittelanforderungen im Sinne von Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2033.

TEIL 3

Daten zu Aufsichtsmaßnahmen und Verwaltungssanktionen ([2]) (Jahr 20XX)

	Aufsichtsmaßnahmen		Daten
010	Aufsichtsmaßnahmen nach Artikel 38 Buchstabe a	Anzahl der Aufsichtsmaßnahmen nach Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034	[Zahlenwert]
020		in Bezug auf das Halten von über die Mindestanforderungen hinausgehenden Eigenmitteln [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe a]	[Zahlenwert]
030		in Bezug auf die Verstärkung der Unternehmensführung und der Strategien für das interne Kapital und liquide Aktiva [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe b]	[Zahlenwert]
040		in Bezug auf die Vorlage eines Plans für die Rückkehr zur Erfüllung der Aufsichtsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe c]	[Zahlenwert]
050		in Bezug auf die Anwendung einer bestimmten Rückstellungspolitik oder die Behandlung der Vermögenswerte [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe d]	[Zahlenwert]
060		in Bezug auf die Einschränkung oder Begrenzung von Geschäftsbereichen oder Tätigkeiten [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe e]	[Zahlenwert]
070		in Bezug auf eine Verringerung der mit den Tätigkeiten, Produkten und Systemen verbundenen Risiken, einschließlich des mit ausgelagerten Tätigkeiten verbundenen Risikos [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe f]	[Zahlenwert]
080		in Bezug auf die Begrenzung der variablen Vergütung [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe g]	[Zahlenwert]
090		in Bezug auf den Einsatz von Nettogewinnen zur Stärkung der Eigenmittel [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe h]	[Zahlenwert]
100		in Bezug auf die Einschränkung oder Untersagung von Ausschüttungen oder Zinszahlungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe i]	[Zahlenwert]
110		in Bezug auf die Auferlegung zusätzlicher Meldepflichten oder häufigerer Meldungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe j]	[Zahlenwert]
120		in Bezug auf die Vorschreibung besonderer Liquiditätsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe k]	[Zahlenwert]
130		in Bezug auf die Auferlegung ergänzender Informationsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe l]	[Zahlenwert]
140		in Bezug auf die Verringerung der Risiken für die Sicherheit der Netzwerke und Informationssysteme von Wertpapierfirmen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe m]	[Zahlenwert]
150		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht unter Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Aufsichtsmaßnahmen	[Zahlenwert]

([2]) Grundlage für die Angaben ist das Datum des Beschlusses. Aufgrund von Abweichungen zwischen den nationalen Regulierungsvorschriften sowie Aufsichtspraktiken und -ansätzen der zuständigen Behörden lassen die in dieser Tabelle enthaltenen Daten unter Umständen keinen aussagekräftigen Vergleich zwischen Rechtsräumen zu. Schlussfolgerungen, die ohne Rücksicht auf diese Abweichungen gezogen werden, könnten daher irreführend sein.

160	Aufsichtsmaßnahmen nach Artikel 38 Buchstabe b sowie anderen Bestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 oder der Verordnung (EU) Nr. 2019/2033	Anzahl der Aufsichtsmaßnahmen nach Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034	[Zahlenwert]
170		in Bezug auf das Halten von über die Mindestanforderungen hinausgehenden Eigenmitteln [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe a]	[Zahlenwert]
180		in Bezug auf die Verstärkung der Unternehmensführung und der Strategien für das interne Kapital und liquide Aktiva [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe b]	[Zahlenwert]
190		in Bezug auf die Vorlage eines Plans für die Rückkehr zur Erfüllung der Aufsichtsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe c]	[Zahlenwert]
200		in Bezug auf die Anwendung einer bestimmten Rückstellungspolitik oder die Behandlung der Vermögenswerte [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe d]	[Zahlenwert]
210		in Bezug auf die Einschränkung oder Begrenzung von Geschäftsbereichen oder Tätigkeiten [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe e]	[Zahlenwert]
220		in Bezug auf eine Verringerung der mit den Tätigkeiten, Produkten und Systemen verbundenen Risiken, einschließlich des mit ausgelagerten Tätigkeiten verbundenen Risikos [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe f]	[Zahlenwert]
230		in Bezug auf die Begrenzung der variablen Vergütung [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe g]	[Zahlenwert]
240		in Bezug auf den Einsatz von Nettogewinnen zur Stärkung der Eigenmittel [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe h]	[Zahlenwert]
250		in Bezug auf die Einschränkung oder Untersagung von Ausschüttungen oder Zinszahlungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe i]	[Zahlenwert]
260		in Bezug auf die Auferlegung zusätzlicher Meldepflichten oder häufigerer Meldungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe j]	[Zahlenwert]
270		in Bezug auf die Vorschreibung besonderer Liquiditätsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe k]	[Zahlenwert]
280		in Bezug auf die Auferlegung ergänzender Informationsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe l]	[Zahlenwert]
290		in Bezug auf die Verringerung der Risiken für die Sicherheit der Netzwerke und Informationssysteme von Wertpapierfirmen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe m]	[Zahlenwert]
300		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht unter Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Aufsichtsmaßnahmen	[Zahlenwert]

	Verwaltungssanktionen [1]		**Daten**
010	Verwaltungssanktionen (für sonstige Verstöße gegen Anforderungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 oder der Verordnung (EU) 2019/2033)	Anzahl der im Einklang mit Artikel 18 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 verhängten Verwaltungssanktionen	[Zahlenwert]
020		betreffend die öffentliche Bekanntmachung der Art des Verstoßes und des Namens der für den Verstoß verantwortlichen natürlichen oder juristischen Person [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe a]	[Zahlenwert]
030		betreffend Anordnungen, wonach die verantwortliche natürliche oder juristische Person die Verhaltensweise einzustellen und von einer Wiederholung abzusehen hat [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe b]	[Zahlenwert]

040		betreffend das vorübergehende Verbot für eine natürliche Person, in Wertpapierfirmen Aufgaben wahrzunehmen [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe c]	[Zahlenwert]
050		betreffend natürlichen oder juristischen Personen auferlegte Bußgelder [Artikel 18 Absatz 2 Buchstaben d bis f]	[Zahlenwert]
060		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht in Artikel 18 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Verwaltungssanktionen	[Freitext]

([1]) Aufsichtsmaßnahmen oder Beschlüsse, die sich an bestimmte Wertpapierfirmen richten, dürfen von den zuständigen Behörden nicht veröffentlicht werden. Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.

Von zuständigen Behörden verhängte Verwaltungssanktionen. Die zuständigen Behörden geben alle Verwaltungssanktionen an, gegen die in ihrem Rechtsraum bis zum Meldestichtag keine Rechtsmittel eingelegt werden konnten. Zuständige Behörden von Mitgliedstaaten, in denen Sanktionen auch dann veröffentlicht werden dürfen, wenn Rechtsmittel wurden, geben die betreffenden Sanktionen ebenfalls an, es sei denn, der Rechtsbehelf hat zur Aufhebung der betreffenden Sanktion geführt.

TEIL 4

Daten zu Ausnahmen ([3]) (Jahr 20XX)

	Ausnahmen für Wertpapierfirmen	**Gesamtzahl der gewährten Ausnahmen**	**Artikel 9**
010	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf die Teile 2, 3, 4, 6 und 7 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 1 (Ausnahmen für Tochterunternehmen) ([1]))	[Zahlenwert]	
020	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf Teil 6 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 2 (Ausnahmen für Tochterunternehmen) ([1]))	[Zahlenwert]	
030	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf Teil 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 3 (Ausnahme von den Liquiditätsanforderungen für Tochterunternehmen))	[Zahlenwert]	
040	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen auf konsolidierter Basis in Bezug auf Teil 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 7 Absatz 4 (aufsichtliche Konsolidierung))		

([3]) Bei ihren Angaben zur Ausnahmepraxis legen die zuständigen Behörden die Gesamtzahl der von der zuständigen Behörde gewährten Ausnahmeregelungen, die noch wirksam bzw. in Kraft sind, zugrunde. Die Angaben sind auf Unternehmen zu beschränken, denen eine Ausnahme gewährt wurde. Sind die entsprechenden Informationen nicht verfügbar, d. h. nicht Bestandteil der regelmäßigen Meldungen, so ist „N/A “ anzugeben.

050	Gesamtzahl der erteilten Erlaubnisse	[Zahlenwert]	
060	Gesamtbetrag der auf konsolidierter Basis ermittelten, in Tochterunternehmen in Drittländern gehaltenen Eigenmittel (in Mio. EUR)	[Zahlenwert]	
070	Prozentsatz der gesamten auf konsolidierter Basis ermittelten, in Tochterunternehmen in Drittländern gehaltenen Eigenmittel (in %)	[Zahlenwert]	
080	Prozentsatz der auf konsolidierter Basis ermittelten Eigenmittelanforderungen, die auf Tochterunternehmen in Drittländern entfallen (in %)	[Zahlenwert]	

([1]) Die Zahl der Ausnahmen wird anhand der Zahl der Wertpapierfirmen ermittelt, denen eine Ausnahme gewährt wurde.