

04.06.2007

Ausfüllhinweise zur Anforderungsliste Fortgeschrittene Messansätze (AMA)

Die Anforderungsliste AMA basiert inhaltlich auf der Solvabilitätsverordnung (SolvV), die die Anwendung eines AMA zur Ermittlung des Anrechnungsbetrages für operationelles Risiko regelt.

Die Anforderungsliste AMA enthält einen allgemeinen Teil mit Angaben zum Institut und eine Tabelle mit fünf Spalten. Davon sind die ersten drei Spalten (Nr., Referenz, Anforderungen) fest vorgegeben. Die weiteren Spalten sind für die Angaben des Instituts vorgesehen. Die Anforderungsliste AMA ist in drei Themengebiete gegliedert.

Die ausgefüllte Anforderungsliste AMA ist dreifach elektronisch auf gängigen Datenträgern einzureichen. Diese sind mit Institutsnamen und Antragsdatum zu beschriften. Die Anforderungsliste ist unter dem Dateinamen „Name Anforderungsliste AMA.doc“ zu speichern. Unter „Name“ ist die Institutsbezeichnung einzusetzen.

Nachfolgend sind die Erläuterungen zu den einzelnen Bestandteilen der Anforderungsliste AMA und Bearbeitungshinweise zu finden.

Allgemeine Angaben

Auf der Anforderungsliste AMA ist die Bezeichnung des Instituts bzw. der Institutsgruppe bzw. Finanzholding-Gesellschaft anzugeben, für den die Angaben zum AMA gemacht werden, sowie Ansprechpartner und Vertreter für Rückfragen zu den Angaben und den eingereichten Dokumenten.

Tabellenspalten

Nachfolgend werden Hinweise zu den einzelnen Tabellenspalten aufgeführt. Die Bezeichnung der Tabellenspalte ist den Hinweisen jeweils vorangestellt.

Nr.

Die Zeilennummerierung ist vorgegeben.

Referenz

Die entsprechenden Paragraphen der SolvV (Stand 01.01.2007), auf die sich die Anforderungen in Spalte 3 beziehen, werden in der Spalte „Referenz“ angegeben. Hinweise auf Erläuterungen zur SolvV werden nach deren Veröffentlichung eingefügt.

Anforderungen

Die einzelnen Anforderungen wurden aus dem Entwurf der SolvV abgeleitet. Sie decken alle zulassungsrelevanten Kriterien ab, zu denen Stellung zu nehmen ist. Die Anforderungen sind stichwortartig wiedergegeben. Die Quelle, aus der sich die jeweilige Anforderung ergibt, ist der Spalte „Referenz“ zu entnehmen.

Kurzdarstellung

Jede Zeile der Anforderungsliste AMA ist zu bearbeiten. Die Angaben sollten hinreichend umfassend und präzise sein, so dass eine Beurteilung, ob der jeweilige Sachverhalt den Anforderungen der SolvV entspricht, ermöglicht wird.

Soweit sich die Angaben zu einer Fragestellung direkt aus beigefügten Dokumenten ergeben, kann sich die Kurzdarstellung auf eine komprimierte Darstellung der Umsetzung unter Skizzierung der wesentlichen Aspekte beschränken.

Verweis auf Dokumentation

Die Angaben in der Kurzdarstellung sollen grundsätzlich für eine erste Beurteilung des Sachverhaltes ausreichend sein. Bei einigen Sachverhalten ist es jedoch notwendig, zusätzliche Dokumentationen beizufügen. In solchen Fällen ist auf die beigefügte Dokumentation unter Bezeichnung des Dokumentes, der Abschnitts- bzw. Kapitelnummer und der Seitenangabe zu verweisen. Das Merkblatt AMA enthält weitere Dokumentationsanforderungen, diese können sich mit den in der Anforderungsliste AMA geforderten Informationen überschneiden.