

Formalprüfungen zu den Meldungen zum operationellen Risiko (E OPR / Q OPR)

Grundsätzlich gilt:

E OPR bzw. Q OPR Pos. 99901 = (aktuelles Jahr – 1) oder (aktuelles Jahr – 2) oder (aktuelles Jahr)

und Pos. 01007 > 0 oder Pos. 02007 > 0

bzw. Pos. 99901 = 0 und Pos. 13007 > 0 und Pos. 01007 = 0 und Pos. 02007 = 0

Zusätzliche Erläuterungen: Institute mit unterjährigem Bilanzstichtag dürfen die letzten vorliegenden Jahresabschlussdaten verwenden, somit ist in diesen Fällen die Angabe des aktuellen Geschäftsjahres möglich. Institute, die *nur* fortgeschrittene Messansätze (AMA) zur Bestimmung des regulatorischen Eigenkapitals für ihr operationelles Risiko anwenden, haben hier kein Geschäftsjahr anzugeben.

1. Formalprüfungen innerhalb der jeweiligen Meldebogen zum E OPR und Q OPR

Spalte 01 bis Spalte 06	Spalte 07	Spalte 08	Spalte 09	Spalte 11			
Pos. 11001 Wenn Pos. 11001 bis 11006 ≠ 0 Dann Pos. 11004 bis Pos. 11006 > 0	Pos. 01007 Wenn Pos. 01007 > 0 Dann Pos. 01001 > 0, Pos. 01002 > 0, Pos. 01003 > 0 Und	Pos. 13008 ≤ Pos. 13007	Pos. 13009 = 13007 - (-13010) - (-13011)	Pos. 13011 ≥ Pos. 13012			

<p>Und Pos. 06001 bis 06003 = 0</p>	<p>Pos. 01007 = (Pos. 01001 + Pos. 01002 + Pos. 01003) / 3 * 0,15</p>						
<p>Pos. 12001</p>	<p>Pos. 02007</p>						
<p>Wenn Pos. 12001 bis 12006 ≠ 0</p>	<p>Wenn Pos. 11001 bis Pos. 11006 = 0</p>						
<p>Dann Pos. 12004 bis 12006 > 0</p>	<p>Und Pos. 12001 bis Pos. 12006 = 0</p>						
<p>Und Pos. 07001 bis Pos. 07003 = 0</p>	<p>Dann Pos. 02007 = Max [0 oder (Teilsumme I + Teilsumme II + Teilsumme III) / 3 = Pos. 02007; negative Teilsummen werden nicht berücksichtigt;</p> <p><i>Rechenweg:</i> Teilsumme I (3. Jahr) (03001 * 0,18 +</p>						

04001 * 0,18 +
05001 * 0,12 +
06001 * 0,15 +
07001 * 0,12 +
08001 * 0,18 +
09001 * 0,15 +
10001 * 0,12)

+

Teilsumme II (2. Jahr)

(03002 * 0,18 +
04002 * 0,18 +
05002 * 0,12 +
06002 * 0,15 +
07002 * 0,12 +
08002 * 0,18 +
09002 * 0,15 +
10002 * 0,12)

+

Teilsumme III (1. Jahr)

(03003 * 0,18 +
04003 * 0,18 +
05003 * 0,12 +
06003 * 0,15 +
07003 * 0,12 +
08003 * 0,18 +
09003 * 0,15 +
10003 * 0,12)

Wenn

Pos. 11001 bis

Pos. 11006 ≠ 0

Und

Pos. 12001 bis

Pos. 12006 ≠ 0

Dann**Pos. 02007 =****Max.****[0 oder**

(Teilsumme I +

Teilsumme II +

Teilsumme III) / 3 =

Pos. 02007;

negative Teilsummen

werden nicht

berücksichtigt;

Rechenweg:

Teilsumme I (3. Jahr)

(03001 * 0,18 +

04001 * 0,18 +

05001 * 0,12 +

11004 * 0,035 * 0,15 +

12004 * 0,035 * 0,12 +

08001 * 0,18 +

09001 * 0,15 +

10001 * 0,12)

+

Teilsumme II (2. Jahr)

(03002 * 0,18 +

04002 * 0,18 + 05002 * 0,12 + 11005 * 0,035 * 0,15 + 12005 * 0,035 * 0,12 + 08002 * 0,18 + 09002 * 0,15 + 10002 * 0,12) + Teilsumme III (1. Jahr) (03003 * 0,18 + 04003 * 0,18 + 05003 * 0,12 + 11006 * 0,035 * 0,15 + 12006 * 0,035 * 0,12 + 08003 * 0,18 + 09003 * 0,15 + 10003 * 0,12) Pos. 13007 Wenn Pos. 13007 > 0 Und Pos. 01007 und 02007 = 0 Dann Pos. 13001 bis Pos. 13003 = 0 Und Pos. 13008 bis Pos. 13013 ≥ 0							
---	--	--	--	--	--	--	--

Stand: August 2008