

Stellungnahmen Comments on the Draft RTS on the specification of the assessment methodology for internal models for market risk and assessment of significant share

11. März 2016

Der RTS-Entwurf, zu dem die Deutsche Kreditwirtschaft Stellung genommen hat, setzt wichtige Vorgaben für die künftige Prüfungstätigkeit der Aufseher bei weiteren Überprüfungen und Beurteilungen der Marktrisikomodelle (IMA). Es geht um den kompletten Zulassungs- und Modellüberprüfungsprozess (Art. 364 Abs. 4 b) CRR). Außerdem wird die Bestimmung des „signifikanten Anteils in einer Risikokategorie“ (Art. 363 (4) c) CRR) behandelt.