

§ 15 4. DeRiMV Auswahl des VaR-Ansatzes

4. DeRiMV - 4. Derivate-Risikoberechnungs- und Meldeverordnung

⌚ Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

1. (1) Für die Berechnung des Gesamtrisikos kann der OGAW den relativen oder den absoluten VaR-Ansatz anwenden. Bei der Beurteilung des Gesamtrisikos anhand des relativen oder des absoluten VaR-Ansatzes hat der OGAW die festgelegten quantitativen und qualitativen Mindestanforderungen dieser Verordnung einzuhalten.
2. (2) Der OGAW ist dafür verantwortlich, den seinem Risikoprofil und seiner Investmentstrategie entsprechenden VaR-Ansatz zu wählen.
3. (3) Der OGAW muss jederzeit nachweisen können, dass der von ihm gewählte VaR-Ansatz seinem Risikoprofil und seiner Investmentstrategie angemessen ist, und hat darüber eine umfassende Dokumentation zu führen.
4. (4) Bei der Entscheidung, welcher VaR-Ansatz zur Berechnung des Gesamtrisikos herangezogen wird, muss konsistent vorgegangen werden.

In Kraft seit 01.09.2011 bis 31.12.9999

© 2026 JUSLINE

JUSLINE® ist eine Marke der ADVOKAT Unternehmensberatung Greiter & Greiter GmbH.

www.jusline.at