

§ 23 4. DeRiMV Quantitative Voraussetzungen

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

⌚ Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

1. (1) Die Stresstests haben alle Risiken abzudecken, die den Wert oder die Wertschwankungen eines OGAW in wesentlichem Maße beeinflussen. Insbesondere jene Risiken, die durch den VaR-Ansatz nicht vollständig erfasst werden, sind zu berücksichtigen.
2. (2) Die Stresstests sind so zu konfigurieren, dass Marktsituationen analysiert werden können, bei denen der Einsatz von signifikantem Leverage zum Totalverlust des Vermögens des OGAW führen kann.
3. (3) Stresstests haben besonders auf solche Risiken zu achten, welche unter normalen Umständen keine besondere Gefahr darstellen, jedoch in Stresssituationen zu einer Gefahr werden könnten, wie insbesondere Korrelationsänderungen, Illiquidität von Märkten in Extremsituationen oder komplexe strukturierte Produkte mit Liquiditätsproblemen.

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