

§ 30 4. DeRiMV Indizes

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

⌚ Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

Finanzindizes

1. (1) Finanzindizes gemäß § 73 Abs. 1 Z 1 InvFG 2011 müssen:
 1. hinreichend diversifiziert sein,
 2. eine adäquate Bezugsgrundlage für den Markt, auf den sie sich beziehen, darstellen und
 3. in angemessener Weise veröffentlicht werden.
2. (2) Finanzindizes sind gemäß Abs. 1 Z 1 hinreichend diversifiziert, wenn
 1. der Index so zusammengesetzt ist, dass seine Gesamtentwicklung durch Preisbewegungen oder Handelstätigkeiten bei einer einzelnen Komponente nicht über Gebühr beeinflusst wird;
 2. im Fall eines aus den in § 66 Abs. 1 InvFG 2011 bezeichneten Vermögenswerten zusammengesetzten Index seine Zusammensetzung mindestens gemäß § 75 InvFG 2011 diversifiziert ist;
 3. im Fall eines aus anderen als den in § 66 Abs. 1 InvFG 2011 bezeichneten Vermögenswerten zusammengesetzten Index seine Zusammensetzung in einer Weise diversifiziert ist, die der in § 75 InvFG 2011 vorgeschriebenen Diversifizierung gleichwertig ist.
3. (3) Finanzindizes stellen gemäß Abs. 1 Z 2 eine adäquate Bezugsgrundlage dar, wenn
 1. der Index die Entwicklung einer repräsentativen Gruppe von Basiswerten in aussagekräftiger und adäquater Weise misst;
 2. der Index regelmäßig überprüft und seine Zusammensetzung angepasst wird, damit er die Märkte, auf die er sich bezieht, stets nach öffentlich zugänglichen Kriterien widerspiegelt;
 3. die Basiswerte hinreichend liquide sind, so dass die Nutzer erforderlichenfalls den Index nachbilden können.
4. (4) Finanzindizes werden gemäß Abs. 1 Z 3 in angemessener Weise veröffentlicht, wenn
 1. ihre Veröffentlichung auf soliden Verfahren für die Erhebung von Preisen und für die Kalkulation und anschließende Veröffentlichung des Indexwerts beruht, einschließlich Preisermittlungsverfahren für die einzelnen Komponenten, falls kein Marktpreis verfügbar ist;
 2. wesentliche Informationen über Aspekte, wie die Methodik zur Indexberechnung und Anpassung der Indexzusammensetzung, Indexveränderungen oder operationelle Schwierigkeiten bei der Bereitstellung zeitnaher oder genauer Informationen, umfassend und unverzüglich zur Verfügung gestellt werden.
5. (5) Sind die in Abs. 1 bis 4 genannten Kriterien nicht erfüllt, so gelten diese Derivate, sofern sie die Kriterien nach § 73 Abs. 1 Z 1 bis 3 InvFG 2011 erfüllen, als Derivate auf eine Kombination aus Instrumenten im Sinne des § 66 Abs. 1 InvFG 2011 einschließlich Finanzinstrumenten, die eines oder mehrere Merkmale dieser Vermögenswerte aufweisen, Wechselkursen, Währungen und Zinssätzen.

© 2026 JUSLINE

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

www.jusline.at