jusline®
»» Recht. Schnell

Sie können die QR Codes nützen um später wieder auf die neuste Version eines Gesetzestexts zu gelangen.

§ 89 InvFG 2011 Berechnung des Gesamtrisikos

InvFG 2011 - Investmentfondsgesetz 2011

Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 24.07.2024

1. (1)Die Verwaltungsgesellschaft hat das Gesamtrisiko eines verwalteten OGAW im Sinne von§ 73 Abs. 5 und 6 mindestens einmal täglich als eine der folgenden Größen zu berechnen:
    1. 1.zusätzliches Risiko und zusätzlicher Leverage, die der verwaltete OGAW durch die Nutzung derivativer Finanzinstrumente einschließlich eingebetteter Derivate im Sinne von § 73 Abs. 6 erzeugt und die den Gesamtbetrag des OGAW-Nettoinventarwerts nicht übersteigen dürfen;
    2. 2.Marktrisiko des OGAW-Portfolios.
2. (2)Das Gesamtrisiko ist, je nach Zweckdienlichkeit, nach dem Commitment-Ansatz, dem Value-at-Risk-Modell oder einem fortgeschrittenen Messansatz zu ermitteln. „Value at Risk“ bezeichnet in diesem Zusammenhang den bei einem gegebenen Konfidenzniveau über einen bestimmten Zeitraum maximal zu erwartenden Verlust. Die zur Messung des Gesamtrisikos gewählte Methode muss der vom OGAW gewählten Anlagestrategie sowie der Art und Komplexität der genutzten derivativen Finanzinstrumente und dem Anteil derivativer Finanzinstrumente am OGAW-Portfolio angemessen sein. Geschäfte gemäß § 83 und gemäß § 84 sind bei der Berechnung des Gesamtrisikos ebenfalls zu berücksichtigen.

In Kraft seit 01.07.2011 bis 31.12.9999

© 2025 JUSLINE
JUSLINE® ist eine Marke der ADVOKAT Unternehmensberatung Greiter & Greiter GmbH.
www.jusline.at