

§ 29 WPFG Zusätzliche Eigenmittelanforderung

WPFG - Wertpapierfirmengesetz

⌚ Berücksichtigter Stand der Gesetzgebung: 13.08.2026

1. (1) Die FMA darf die in § 28 Abs. 2 Z 1 genannte zusätzliche Eigenmittelanforderung nur dann vorschreiben, wenn sie bei den gemäß den §§ 25 und 26 durchgeführten Überprüfungen feststellt, dass auf eine Wertpapierfirma eine der folgenden Gegebenheiten zutrifft:
 1. 1. Die Wertpapierfirma ist Risiken oder Risikokomponenten ausgesetzt oder stellt Risiken für andere dar, die wesentlich sind und von den Eigenmittelanforderungen, insbesondere Anforderungen für K-Faktoren, in den Teilen 3 oder 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 nicht oder nicht ausreichend abgedeckt sind;
 2. 2. Die Wertpapierfirma erfüllt die Anforderungen gemäß den §§ 14 und 16 nicht und andere Aufsichtsmaßnahmen werden voraussichtlich nicht innerhalb eines angemessenen Zeitraums zu einer ausreichenden Verbesserung der Regelungen, Verfahren, Mechanismen und Strategien führen;
 3. 3. Die Anpassungen bezüglich der vorsichtigen Bewertung des Handelsbuchs reichen nicht aus, um die Wertpapierfirma in die Lage zu versetzen, ihre Positionen innerhalb kurzer Zeit zu veräußern oder abzusichern, ohne dabei unter normalen Marktbedingungen wesentliche Verluste zu erleiden;
 4. 4. Die Überprüfung gemäß § 26 ergibt, dass die Nichterfüllung der Anforderungen für die Anwendung der zulässigen internen Modelle wahrscheinlich zu einer unzureichenden Höhe des Kapitals führen wird;
 5. 5. Die Wertpapierfirma versäumt es wiederholt, zusätzliche Eigenmittel in der in § 30 dargelegten angemessenen Höhe zu bilden oder beizubehalten.
2. (2) Für die Zwecke von Abs. 1 Z 1 gelten Risiken oder Risikokomponenten nur dann als von den Eigenmittelanforderungen in den Teilen 3 und 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 nicht oder nicht ausreichend abgedeckt, wenn das Kapital, das die zuständige Behörde nach der aufsichtlichen Überprüfung der von den Wertpapierfirmen gemäß § 14 Abs. 1 durchgeführten Bewertung für angemessen hält, hinsichtlich seiner Höhe, Art und Verteilung über der in den Teilen 3 oder 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 vorgesehenen Eigenmittelanforderung an die Wertpapierfirma liegt.
3. (3) Für die Zwecke von Abs. 2 kann das als angemessen betrachtete Kapital Risiken oder Risikokomponenten umfassen, die von den Eigenmittelanforderungen in den Teilen 3 oder 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 ausdrücklich ausgeschlossen sind.
4. (4) Die FMA hat die Höhe der gemäß § 28 Abs. 2 Z 1 erforderlichen zusätzlichen Eigenmittel als Differenz zwischen dem gemäß § 28 Abs. 2 als angemessen betrachteten Kapital und der in den Teilen 3 oder 4 der Verordnung (EU) 2019/2033 vorgesehenen Eigenmittelanforderung festzulegen.
5. (5) Die FMA hat den Wertpapierfirmen anzuordnen, die in § 28 Abs. 2 Z 1 genannte zusätzliche Eigenmittelanforderung folgendermaßen mit Eigenmitteln zu erfüllen:
 1. 1. Die zusätzliche Eigenmittelanforderung ist zu mindestens drei Vierteln mit Kernkapital zu erfüllen;
 2. 2. Das Kernkapital muss zu mindestens drei Vierteln aus hartem Kernkapital bestehen;
 3. 3. Diese Eigenmittel dürfen nicht zur Erfüllung einer der Eigenmittelanforderungen gemäß Art. 11 Abs. 1 Buchstabe a, b und c der Verordnung (EU) 2019/2033 verwendet werden.
6. (6) Die FMA hat ihre Entscheidung, gemäß § 28 Abs. 2 Z 1 eine zusätzliche Eigenmittelanforderung vorzuschreiben, schriftlich durch klare Darlegung der vollständigen Bewertung der in den Abs. 1 bis 5 genannten Komponenten zu begründen. In dem in Abs. 1 Z 4 genannten Fall hat dies auch eine gesonderte Begründung miteinzuschließen, warum die gemäß § 30 Abs. 1 festgelegte Kapitalausstattung nicht mehr als ausreichend betrachtet wird.
7. (7) Die FMA kann kleinen und nicht-verflochtenen Wertpapierfirmen gemäß Art. 12 Abs. 1 der Verordnung (EU) 2019/2033 auf Grundlage einer fallbezogenen Bewertung und sofern sie dies für gerechtfertigt hält, gemäß Abs. 1 bis 6 eine zusätzliche Eigenmittelanforderung vorschreiben.

In Kraft seit 01.02.2023 bis 31.12.9999