

ANHANG IV

AGGREGIERTE STATISTISCHE DATEN

Liste der Meldebögen

TEIL 1	Individualdaten pro zuständiger Behörde
TEIL 2	Daten zu Marktrisiken
TEIL 3	Daten zu Aufsichtsmaßnahmen und Verwaltungssanktionen
TEIL 4	Daten zu Ausnahmen

TEIL 1

Individualdaten pro zuständiger Behörde (Jahr 2024)

		Betreffender Meldebogen	Daten	
Anzahl und Grösse der Wertpapierfirmen				
010	Anzahl der Wertpapierfirmen		92	
020	Gesamtvermögen aller Wertpapierfirmen im Mitgliedstaat (in Mio. EUR ⁽¹⁾)		n/a	
Anzahl und Grösse von Wertpapierfirmen aus Drittländern ⁽²⁾				
030	Aus Dritt- län- dern	Anzahl der Zweigniederlassungen ⁽³⁾	0	
040		Anzahl der Tochterunternehmen ⁽⁴⁾	0	
Zusammensetzung der Eigenmittel in Bezug auf die Eigenmittelanforderungen			Daten, in Mio. EUR	Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen ⁽⁶⁾ (in %)
050	Hartes Kernkapital insgesamt ⁽⁵⁾	I 01.00 Zeile 0030 und I 01.01 Zeile 0030	n/a	n/a
060	Zusätzliches Kernkapital insgesamt ⁽⁵⁾	I 01.00 Zeile 0300 und I 01.01 Zeile 0300	n/a	n/a
070	Ergänzungskapital insgesamt ⁽⁵⁾	I 01.00 Zeile 0420 und I 01.01 Zeile 0420	n/a	n/a
080	Eigenmittel insgesamt ⁽⁶⁾	I 01.00 Zeile 0010 und I 01.01 Zeile 0010	n/a	n/a
Eigenmittelanforderungen insgesamt, nach Art			Daten, in Mio. EUR	Daten, als Anteil an den gesamten

					Eigenmittelanforderungen ⁽⁶⁾ (in %)
090	Daten zu den Eigenmittelanforderungen	Anforderung für fixe Gemeinkosten ⁽⁷⁾	I 02.01 Zeile 0030 und I 02.03 Zeile 0030	n/a	n/a
100		Permanente Mindestkapitalanforderung ⁽⁸⁾	I 02.01 Zeile 0020 und I 02.03 Zeile 0020	n/a	n/a
110		K-Faktor-Anforderung ⁽⁹⁾	I 02.01 Zeile 0040	n/a	n/a
120		davon Kundenrisiko (RtC) ⁽¹⁰⁾	I 04.00 Zeile 0020	n/a	n/a
130		davon Marktrisiko (RtM) ⁽¹¹⁾	I 04.00 Zeile 0090	n/a	n/a
140	davon Firmenrisiko (RtF) ⁽¹²⁾	I 04.00 Zeile 0120	n/a	n/a	

⁽¹⁾ Das Gesamtvermögen entspricht der Summe der Vermögenswerte aller Wertpapierfirmen in einem Mitgliedstaat, berechnet nach geltenden Rechnungslegungsstandards, ohne verwaltete Vermögenswerte.

⁽²⁾ Ohne EWR.

⁽³⁾ Anzahl der Zweigniederlassungen im Sinne von Artikel 3 Absatz 1 Nummer 3 der Richtlinie (EU) 2019/2034. Hat eine Wertpapierfirma mit Sitz in einem Drittland in einem Land mehrere Betriebsstellen errichtet, so werden diese als eine einzige Zweigniederlassung betrachtet.

⁽⁴⁾ Anzahl der Tochterunternehmen im Sinne von Artikel 3 Absatz 1 Nummer 29 der Richtlinie (EU) 2019/2034. Tochterunternehmen eines Tochterunternehmens werden als Tochterunternehmen des an der Spitze dieser Unternehmen stehenden Mutterunternehmens betrachtet.

⁽⁵⁾ Kapital gemäss Artikel 9 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽⁶⁾ Eigenmittelanforderungen insgesamt im Sinne von Artikel 11 der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽⁷⁾ Anforderung für fixe Gemeinkosten im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽⁸⁾ Permanente Mindestkapitalanforderung im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽⁹⁾ K-Faktor-Anforderung im Sinne von Artikel 11 Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽¹⁰⁾ Eigenmittelanforderungen für Kundenrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2019/2033. In der Spalte „Daten, als Anteil an den gesamten Eigenmittelanforderungen (in %)“ ist die Gesamtkapitalquote anzugeben.

⁽¹¹⁾ Eigenmittelanforderungen für Marktrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2019/2033.

⁽¹²⁾ Eigenmittelanforderungen für Firmenrisiken im Sinne von Artikel 15 Absatz 1 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2019/2033.

TEIL 2

Daten zu Marktrisiken (1) (Jahr 2024)

Daten zu Marktrisiken		Ansatz	Betreffender Meldebogen	Daten	
010	Eigenmittelanforderungen für Marktrisiken				
020	Aufschlüsselung nach Ansätzen Anzahl der Wertpapierfirmen, die den jeweiligen Ansatz verwenden, bezogen auf die Gesamtzahl der Wertpapierfirmen (2)	K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko	04.00 Zeile 0100	n/a	
030		davon Standardansatz		n/a	
040		davon alternativer Standardansatz		n/a	
050		davon alternativer auf internen Modellen basierender Ansatz		n/a	
060		davon jeder K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko (3)		n/a	
070		K-Faktoransatz für den geleisteten Einschuss	04.00 Zeile 0110	n/a	
080		Sowohl K-Faktor für den geleisteten Einschuss als auch K-Faktor für das Nettopositionsrisiko		n/a	
090					Daten, in Mio. EUR
100	Gesamte Eigenmittelanforderungen nach jedem Ansatz	K-Faktoransatz für das Nettopositionsrisiko	04.00 Zeile 0100	n/a	n/a

110			davon Standardansatz		n/a	n/a
120			davon alternativer Standardansatz		n/a	n/a
130			davon alternativer auf internen Modellen basierender Ansatz		n/a	n/a
140			davon jeder K-Faktoransatz für das Nettositionsrisiko ⁽³⁾		n/a	n/a
150			K-Faktoransatz für den geleisteten Einschuss	04.00 Zeile 0110	n/a	n/a
160			Sowohl K-Faktor für den geleisteten Einschuss als auch K-Faktor für das Nettositionsrisiko		n/a	n/a

(1) Aufzunehmen sind Angaben zu allen Wertpapierfirmen, nicht nur zu Wertpapierfirmen mit Positionen im Zusammenhang mit dem K-Faktor für das Nettositionsrisiko.

(2) Bestimmte Wertpapierfirmen können mehr als einen Ansatz anwenden, sodass sich die Summe der Positionen 020 bis 060 von der Gesamtzahl der Wertpapierfirmen, die den K-Faktor für das Nettositionsrisiko berechnen, unterscheiden kann.

(3) Verwenden Wertpapierfirmen mehr als einen Ansatz für den K-Faktor für das Nettositionsrisiko: Standardansatz, alternativer Standardansatz, alternativer auf internen Modellen basierende Ansatz.

(4) Eigenmittelanforderungen im Sinne von Artikel 9 der Verordnung (EU) 2019/2033.

TEIL 3

Daten zu Aufsichtsmassnahmen und Verwaltungssanktionen (1) (Jahr 2024)

		Aufsichtsmassnahmen	Daten
010	Aufsichtsmassnahmen nach Artikel 38 Buchstabe a	Anzahl der Aufsichtsmassnahmen nach Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034	0
020		in Bezug auf das Halten von über die Mindestanforderungen hinausgehenden Eigenmitteln [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe a]	0
030		in Bezug auf die Verstärkung der Unternehmensführung und der Strategien für das interne Kapital und liquide Aktiva [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe b]	0
040		in Bezug auf die Vorlage eines Plans für die Rückkehr zur Erfüllung der Aufsichtsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe c]	0
050		in Bezug auf die Anwendung einer bestimmten Rückstellungspolitik oder die Behandlung der Vermögenswerte [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe d]	0
060		in Bezug auf die Einschränkung oder Begrenzung von Geschäftsbereichen oder Tätigkeiten [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe e]	0
070		in Bezug auf eine Verringerung der mit den Tätigkeiten, Produkten und Systemen verbundenen Risiken, einschliesslich des mit ausgelagerten Tätigkeiten verbundenen Risikos [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe f]	0
080		in Bezug auf die Begrenzung der variablen Vergütung [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe g]	0
090		in Bezug auf den Einsatz von Nettogewinnen zur Stärkung der Eigenmittel [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe h]	0
100		in Bezug auf die Einschränkung oder Untersagung von Ausschüttungen oder Zinszahlungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe i]	0
110		in Bezug auf die Auferlegung zusätzlicher Meldepflichten oder häufigerer Meldungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe j]	0
120		in Bezug auf die Vorschreibung besonderer Liquiditätsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe k]	0
130		in Bezug auf die Auferlegung ergänzender Informationsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe l]	0
140		in Bezug auf die Verringerung der Risiken für die Sicherheit der Netzwerke und Informationssysteme von Wertpapierfirmen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe m]	0
150		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht unter Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Aufsichtsmassnahmen	0

160	Aufsichtsmassnahmen nach Artikel 38 Buchstabe b sowie anderen Bestimmungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 oder der Verordnung (EU) Nr. 2019/2033	Anzahl der Aufsichtsmassnahmen nach Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034	0
170		in Bezug auf das Halten von über die Mindestanforderungen hinausgehenden Eigenmitteln [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe a]	0
180		in Bezug auf die Verstärkung der Unternehmensführung und der Strategien für das interne Kapital und liquide Aktiva [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe b]	0
190		in Bezug auf die Vorlage eines Plans für die Rückkehr zur Erfüllung der Aufsichtsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe c]	0
200		in Bezug auf die Anwendung einer bestimmten Rückstellungspolitik oder die Behandlung der Vermögenswerte [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe d]	0
210		in Bezug auf die Einschränkung oder Begrenzung von Geschäftsbereichen oder Tätigkeiten [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe e]	0
220		in Bezug auf eine Verringerung der mit den Tätigkeiten, Produkten und Systemen verbundenen Risiken, einschliesslich des mit ausgelagerten Tätigkeiten verbundenen Risikos [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe f]	0
230		in Bezug auf die Begrenzung der variablen Vergütung [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe g]	0
240		in Bezug auf den Einsatz von Nettogewinnen zur Stärkung der Eigenmittel [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe h]	0
250		in Bezug auf die Einschränkung oder Untersagung von Ausschüttungen oder Zinszahlungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe i]	0
260		in Bezug auf die Auferlegung zusätzlicher Meldepflichten oder häufigerer Meldungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe j]	0
270		in Bezug auf die Vorschreibung besonderer Liquiditätsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe k]	0
280		in Bezug auf die Auferlegung ergänzender Informationsanforderungen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe l]	0
290		in Bezug auf die Verringerung der Risiken für die Sicherheit der Netzwerke und Informationssysteme von Wertpapierfirmen [Artikel 39 Absatz 2 Buchstabe m]	0
300		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht unter Artikel 39 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Aufsichtsmassnahmen	0

Verwaltungssanktionen ⁽¹⁾			Daten
010	Verwaltungssanktionen (für sonstige Verstösse gegen Anforderungen der Richtlinie (EU) 2019/2034 oder der Verordnung (EU) 2019/2033)	Anzahl der im Einklang mit Artikel 18 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 verhängten Verwaltungssanktionen	0
020		betreffend die öffentliche Bekanntmachung der Art des Verstosses und des Namens der für den Verstoß verantwortlichen natürlichen oder juristischen Person [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe a]	0
030		betreffend Anordnungen, wonach die verantwortliche natürliche oder juristische Person die Verhaltensweise einzustellen und von einer Wiederholung abzusehen hat [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe b]	0
040		betreffend das vorübergehende Verbot für eine natürliche Person, in Wertpapierfirmen Aufgaben wahrzunehmen [Artikel 18 Absatz 2 Buchstabe c]	0
050		betreffend natürlichen oder juristischen Personen auferlegte Bussgelder [Artikel 18 Absatz 2 Buchstaben d bis f]	0
060		Anzahl und Art sonstiger (d. h. nicht in Artikel 18 Absatz 2 der Richtlinie (EU) 2019/2034 aufgeführter) Verwaltungssanktionen	n/a
<p>(¹) Aufsichtsmaßnahmen oder Beschlüsse, die sich an bestimmte Wertpapierfirmen richten, dürfen von den zuständigen Behörden nicht veröffentlicht werden. Wenn die zuständigen Behörden bekanntgeben, nach welchen allgemeinen Kriterien und Methoden sie verfahren, dürfen sie keine Informationen über einzelne an bestimmte Wertpapierfirmen gerichtete Aufsichtsmaßnahmen preisgeben; dies gilt unabhängig davon, ob es sich um einzelne Wertpapierfirmen oder um Wertpapierfirmengruppen handelt.</p>			

TEIL 4

Daten zu Ausnahmen ⁽¹⁾ (Jahr 2024)

	Ausnahmen für Wertpapierfirmen	Gesamtzahl der gewährten Ausnahmen
010	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf die Teile 2, 3, 4, 6 und 7 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 1 (Ausnahmen für Tochterunternehmen) ⁽¹⁾)	0
020	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf Teil 6 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 2 (Ausnahmen für Tochterunternehmen) ⁽²⁾)	0
030	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen des Artikels 5 auf Einzelbasis in Bezug auf Teil 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 6 Absatz 3 (Ausnahme von den Liquiditätsanforderungen für Tochterunternehmen))	0
040	Ausnahme von der Anwendung der Aufsichtsanforderungen auf konsolidierter Basis in Bezug auf Teil 5 der Verordnung (EU) 2019/2033 (Artikel 7 Absatz 4 (aufsichtliche Konsolidierung))	
050	Gesamtzahl der erteilten Erlaubnisse	0
060	Gesamtbetrag der auf konsolidierter Basis ermittelten, in Tochterunternehmen in Drittländern gehaltenen Eigenmittel (in Mio. EUR)	0
070	Prozentsatz der gesamten auf konsolidierter Basis ermittelten, in Tochterunternehmen in Drittländern gehaltenen Eigenmittel (in %)	0
080	Prozentsatz der auf konsolidierter Basis ermittelten Eigenmittelanforderungen, die auf Tochterunternehmen in Drittländern entfallen (in %)	0

(1) Bei ihren Angaben zur Ausnahmepaxis legen die zuständigen Behörden die Gesamtzahl der von der zuständigen Behörde gewährten Ausnahmeregelungen, die noch wirksam bzw. in Kraft sind, zugrunde. Die Angaben sind auf Unternehmen zu beschränken, denen eine Ausnahme gewährt wurde. Sind die entsprechenden Informationen nicht verfügbar, d. h. nicht Bestandteil der regelmässigen Meldungen, so ist „N/A“ anzugeben.

(2) Die Zahl der Ausnahmen wird anhand der Zahl der Wertpapierfirmen ermittelt, denen eine Ausnahme gewährt wurde.