



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

## BERECHNUNG SCR-SCHOCK PARAMETER FENION GMBH



**Stefan Fischer MSc**

Managing Partner  
Mobile: +43 664 49 79 111



**Mag. Nikolaus Sernetz**

Managing Partner  
Mobile: +43 664 39 39 993



**DI Alexander Adamenko**

Managing Partner  
Mobile: +43 660 70 58 943





Mit der Capital Requirements Regulation (CRR) soll die Eigenkapitalausstattung von Banken erhöht und das systemische Risiko im Finanzsektor reduziert werden. Die CRR hat unmittelbaren Einfluss auf Kapitalverwaltungsgesellschaften, welche ihre Produkte an Banken vertreiben wollen. Für die Durchführung der Berechnungen wurden in der Industrie verschiedene Reporting-Templates erstellt, welche Fenion für seine Kunden erstellt.

# CRR II REPORTING.

## CRR II REPORTING SERVICE

- Erstellung aller benötigten Reporting Templates (WM Templates)**

**Kalkulation der risikogewichteten Aktiva (RWA)**

**Erstellung des GroMiKV Reports (bei Bedarf Anreicherung von Stammdaten)**
- Erstellung eines Fenion Disclosure Formats** um ein externes Audit zu ermöglichen

**Kalkulation des Gegenpartei-Ausfallrisikos (SA-CCR Ansatz)**

**Lieferung an den Kunden und Upload bei WM-Daten**

## CRR II

CRR bildet die BASEL III Regeln hinsichtlich der Eigenkapitalanforderungen ab und gibt an, wieviel liquides Kapital eine Bank für bestimmte Finanzinstrumente hinterlegen muss.

## REPORTING TEMPLATES

- Antizyklischer Puffer
- Eigenkapitalabzugspositionen
- Risikogewicht nach Ländern
- Fremdwährungsbericht
- GroMiKV
- Fenion Disclosure

Eigenkapitalabzugspositionen und CVA-Risiko gem. CRR  
an: solva@wmdata.com

Datum	WKN	ISIN	Gewicht Kapitalklasse hartes Kernkapital (in %)	KSA-Wert der Abzugspositionen Kapitalklasse hartes Kernkapital (in %)	Gewicht Kapitalklasse erweitertes Kernkapital (in %)	KSA-Wert der Abzugspositionen Kapitalklasse erweitertes Kernkapital (in %)	Gewicht Kapitalklasse Ergänzungskapital (in %)	KSA-Wert der Abzugspositionen Kapitalklasse Ergänzungskapital (in %)	CVA-Risiko Betrag (in %)
-------	-----	------	---	---	--	--	--	--	--------------------------

### Risikogewichte nach Ländern zur Ermittlung des antizyklischen Puffers nach 10d KWG n.F. - ausschließlich zur Übermittlung an WM Datenservice -

WM Datenservice			keine länderbezogenen Angaben bekannt		länderbezo
			-> Bitte nur Länderkürzel angeben, die für die gemeldeten Fonds relevant sind. Nicht benötigte Länderkürzel bleiben unbelegt		
			maximal 60 belegte Positionen -->	1	2
			Bemessungsgrundlage/ Ermittlungsansatz (Belegung siehe 2. Arbeitsblatt)	das der Risikoposition zugrundeliegende Schuldnerland kann nicht oder nur mit unverhältnismäßigem Aufwand ermittelt werden (Herkunftsland gem. Art. 2(5) a oder Art. 4(3) Del. VO (EU) 1152/2014)	Risikogewicht resultiert aus den Risikopositionen bestimmter privilegierter Forderungsklassen (wie z.B. Zentralregierungen gem. Artikel 140 (4) CRD IV befreit)
Datum	WKN	ISIN			CN



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

## KONTAKT



### ADRESSE

Mariahilfer Straße 136, 1150 Wien



### TELEFON

+43 (1) 908 11 80



### EMAIL

office@fenion.at



**Mag. Nikolaus Sernetz**  
Managing Partner

## IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

### KONTAKT

**Fenion GmbH**  
Mariahilfer Straße 136  
1150 Wien  
**Bereich:** IT-Dienstleistungen  
**UID:** ATU72994405  
**FN:** 483557p  
**FB-Gericht:** Wien  
**E-Mail:** office@fenion.at

### SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

