

Risikoanalyse Finanzmarktinfrastrukturen

Anhang 16 zum FINMA-RS 13/3; Version vom 4. November 2020; anwendbar ab 1. Januar 2021

Bewilligungsträger / Gruppe, Domizil:	
Aufsichtskategorie:	
Prüfungsgesellschaft:	
Leitender Prüfer:	
Prüfungsjahr (prospektiv):	

	Ankreuzen
Nur Einzelstufe	
Einzel- und Konzernstufe (Stammhausstruktur)	
Nur Gruppenstufe (Holdingstruktur / atypische Struktur)	

Allgemeine Risikoeinschätzung:

--

Finanzmarktinfrastruktur-Typ						Prüfgebiete	Beschreibung des Risikos	Ausmass / Umfang	Eintrittswahrscheinlichkeit	Inhärentes Risiko (brutto)	Rangordnung der Risiken (brutto, Top 10)	Kontrollrisiko	Nettorisiko	Rangordnung der Risiken (netto, Top 10)
Handelsplätze	Zentrale Gegenparteien	Zentralverwahr	Transaktionsregister	Zahlungssysteme	Einzelstufe									
X	X	X	X	X	X	Mindestkapital, Eigenmittel und Risikoverteilung								
	X	X			X	Liquidität								
X						Handel: Selbstregulierung und Überwachung								
X						Handel: Organisation und Sicherstellung eines ordnungsgemässen und transparenten Handels								
X	X	X	X	X	X	Zulassung von Teilnehmern: Operationell								
	X	X				Zulassung von Teilnehmern: Finanzielle Voraussetzungen								
X						Zulassung von Effekten								
	X	X			X	Collateral- und Margin-Management: Prozess Einforderung und Management								
	X	X			X	Risikomodelle Collateral- und Margin-Management inkl. Stressmodelle, Haircut etc.								
	X	X				Default-Management-Prozess								
	X	X				Segregierung und Übertragbarkeit								
	X	X			X	Abwicklung								
		X				Verwahrfunktion								

Finanzmarktinfrastruktur-Typ					Prüfgebiete	Beschreibung des Risikos	Ausmass / Umfang	Eintrittswahrscheinlichkeit	Inhärentes Risiko (brutto)	Rangordnung der Risiken (brutto, Top 10)	Kontrollrisiko	Nettorisiko	Rangordnung der Risiken (netto, Top 10)
Handelsplätze	Zentrale Gegenparteien	Zentralverwahrer	Transaktionsregister	Zahlungssysteme	Einzelstufe								
			X		Datenmanagement								
X	X	X	X	X	Besondere Anforderungen in Bezug auf die Ausübung von Nebendienstleistungen								
X	X	X	X	X	Anderer Risiken aus dem Rechts-, Prozess- und Compliancebereich								
X	X	X	X	X	Allgemeine Verhaltensregeln								
X	X	X	X	X	Corporate Governance								
X	X	X	X	X	Qualitative Anforderungen an das Management operationeller Risiken								
X	X	X	X	X	Risikokontrollfunktion								
X	X	X	X	X	Compliance-Funktion								
X	X	X	X	X	Interne Revision								
X	X	X	X	X	Informatik (IT)								
X	X	X	X	X	Outsourcing								
X	X	X	X	X	BCM (business continuity management)								
	X	X		X	Einhaltung Geldwäschereivorschriften und von weiteren aufsichtsrechtlichen Vorschriften								
X	X	X	X	X	Einhaltung der Meldepflichten								
X					Einhaltung der Pflichten bei zusätzlichem Betrieb eines organisierten Handelssystems								

Finanzmarktinfrastruktur-Typ						Prüfgebiete	Beschreibung des Risikos	Ausmass / Umfang	Eintrittswahrscheinlichkeit	Inhärentes Risiko (brutto)	Rangordnung der Risiken (brutto, Top 10)	Kontrollrisiko	Nettorisiko	Rangordnung der Risiken (netto, Top 10)
Handelsplätze	Zentrale Gegenparteien	Zentralverwahrer	Transaktionsregister	Zahlungssysteme	Einzelstufe									
Konsolidierte Aufsicht														
Qualitative Elemente														
X	X	X	X	X	Corporate Governance auf Gruppenstufe									
X	X	X	X	X	Gruppenfunktionen zur Risikokontrolle und Risikominderung									
X	X	X	X	X	Gruppeninterne Revision									
	X	X		X	Konzernweite Massnahmen zur Geldwäschereibekämpfung und zur Einhaltung von weiteren schweiz. und ausl. aufsichtsrechtlichen Vorschriften									
	X	X		X	Konzernweite Massnahmen zur Einhaltung der Liquiditätsvorschriften sowie Liquiditätsmanagement									
X	X	X	X	X	Konzernweite Vorkehrungen zur Einhaltung der Eigenmittel- und Risikoverteilungsvorschriften									
X	X	X	X	X	Intragroup-Finanzierungsstrukturen und Eventualverpflichtungen									
Quantitative Elemente														
X	X	X	X	X	Einhaltung der Eigenmittel- und Risikoverteilungsvorschriften									
	X	X		X	Einhaltung der Liquiditätsvorschriften									
X	X	X	X	X	Einhaltung der konsolidierten Meldepflichten									
Ergänzende Elemente*														
X	X	X	X	X	Geschäftsrisiken aus Kreditrisiken (inkl. Risikokonzentrationen)									
X	X	X	X	X	Geschäftsrisiken aus Marktrisiken (inkl. Risikokonzentrationen)									
X	X	X	X	X	Geschäftsrisiken aus operationellen Risiken (inkl. Risikokonzentrationen)									
X	X	X	X	X	Geschäftsrisiken aus anderen Risiken (inkl. Risikokonzentrationen)									

*Siehe Wegleitung für Prüfgesellschaften von Finanzmarktinfrastrukturen: Kapitel I, Abschnitt "Generelle Bemerkungen zur Risikoanalyse Finanzmarktinfrastrukturen"