

Risikoanalyse Finanzmarktinfrastrukturen

Anhang 16 zum FINMA-RS 13/3; Version vom 20. Juni 2018; anwendbar ab 1. Januar 2019

Bewilligungsträger / Gruppe, Domizil:	
Aufsichtskategorie:	
Prüfgesellschaft:	
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	Zentralverwahrer	Transaktionsregister	Zahlungssysteme	Einzelstufe								
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	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								

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	X		X	Abwicklung								
		X			Verwahrfunktion								
			X		Datenmanagement								
X	X	X	X	X	Besondere Anforderungen in Bezug auf die Ausübung von Nebendienstleistungen								
X	X	X	X	X	Andere 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): Entwicklung								
X	X	X	X	X	Informatik (IT): Betrieb								
X	X	X	X	X	Informatik (IT): Zugriff								
X	X	X	X	X	Informatik (IT): Konzept und Risikomanagement								
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								

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					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"