

Dokumente & Literatur nach Institution / Themenfeld

Die * markierten Einträge sind neu hinzugekommen.

Das folgende Dokumenten- und Literaturverzeichnis sowie weitere kommentierte Links und finden Sie auch in unserem **Regulatorik-Tracker** auf www.marisk.academy/regulatory.tracker

Agenda der Aufsichtsbehörden und Risikoanalysen allgemein:

BaFin / Bundesbank:

BaFin (2018): Schwerpunkte der Aufsicht 2019, Bonn Frankfurt am Main, 18.12.2018

BaFin (2018a): Schwerpunkte der Bankenaufsicht 2019, Bonn & Frankfurt am Main, 18.12.2018

BaFin (2018b): Schwerpunkte des Bereichs Abwicklung 2019, Bonn & Frankfurt am Main, 18.12.2018

BaFin (2018c): Europäische Aufsichtsbehörden BaFin übernimmt grundsätzlich alle Leitlinien sowie Fragen und Antworten in ihre Verwaltungspraxis, in: BaFin-Journal Februar 2018, S. 5 (ohne Verfasser).

Deutsche Bundesbank (2018): Finanzstabilitätsbericht 2018; Frankfurt am Main, November 2018

European Banking Authority (EBA) & EZB Bankenaufsicht:

EBA (2018a): Work Programme 2019, London, 23.10.2018

EZB-Bankenaufsicht (2018a): Aufsichtsprioritäten des SSM im Jahr 2019, Frankfurt am Main 30.10.2018

EZB-Bankenaufsicht (2018b): Risikobewertung für 2019, Frankfurt am Main 30.10.2018

FSB:

FSB (2019): Work Programme 2019, Basel, 12.02.2019

Sanierungs- und Abwicklungsplanung:

BaFin:

*BaFin (2019): Entwurf eines Merkblattes zur externen Bail-in-Implementierung, Bonn, Frankfurt am Main, 25.04.2019 (Konsultation 10/2019)

*BaFin (2019): Referentenentwurf zur Rechtsverordnung zu den Mindestanforderungen an Sanierungspläne für Institute und Wertpapierfirmen (MaSan-Verordnung), Bonn, Frankfurt am Main, 25.04.2019

*BaFin (2019): Merkblatt zur Sanierungsplanung (Konsultationsfassung), Bonn, Frankfurt am Main, 25.04.2019

BaFin (2019): Entwurf des Rundschreibens zu den Mindestanforderungen zur Umsetzbarkeit eines Bail-in (MaBail-in), 01.02.2019

BaFin (2019): Entwurf eines Rundschreibens zur Meldung von Informationen für die Abwicklungsplanung (MIA), Bonn, 05.02.2019

BaFin (2019): Konsultation 04/2019, Entwurf eines Merkblattes zur insolvenzrechtlichen Behandlung bestimmter Verbindlichkeiten von CRR-Instituten, 15.02.2019

Financial Stability Board:

*FSB (2019): Thematic Review on Bank Resolution Planning, 29.04.2019

Single Resolution Board:

SRB (2018): Work Programme für 2019, Brüssel, 12.11.2018

SREP & Säule II inkl. Stresstesting:European Banking Authority (EBA) & EZB Bankenaufsicht:

EBA (2017): Leitlinien für die IKT-Risikobewertung im Rahmen des SREP, London, 11.09.2017 (EBA/GL/2017/05)

EBA (2018): Leitlinien zur internen Governance, London, 15.03.2018 (EBA/GL/2017/11)

EBA (2018): Überarbeitete Leitlinien zu gemeinsamen Verfahren und Methoden für den aufsichtlichen Überprüfungs- und Bewertungsprozess (Supervisory Review and Evaluation Process, SREP) sowie für die aufsichtlichen Stresstests, zur Änderung der EBA/GL/2014/13 vom 19. Dezember 2014, London, 19.07.2018 (EBA/GL/2018/03 – Hinweis: Dieses Dokument enthält lediglich die Änderungen der ursprünglichen Leitlinien, die neue konsolidierte Fassung der SREP-Guidelines liegt Stand 15.02.2019 nur in englischer Sprache vor)

EBA (2018): Leitlinien zu den Stresstests der Institute, London, 19.07.2018 (EBA/GL/2018/04)

EBA (2018): Leitlinien zur Steuerung des Zinsänderungsrisikos bei Geschäften des Anlagebuchs, London, 19.07.2018 (EBA/GL/2018/02)

European Banking Authority (2018): Guidelines on the revised common procedures and methodologies for the supervisory review and evaluation process (SREP) and supervisory stress testing, Final Report London, 19.07.2018 (EBA/GL/2018/03, final report bzw. EBA/GL/2014/13 consolidated version)

EBA (2018): 2018 EU-wide Stresstest Results, London, 02.11.2018

EZB-Bankenaufsicht (2019): ECB Sensitivity analysis of Liquidity Risk – Stress Test 2019 Methodological note, Frankfurt am Main, 06.02.2019

EZB-Bankenaufsicht (2019): SSM-wide stress test 2018 Final results, Frankfurt am Main, 01.02.2019

EZB Banking Supervision (2019): SSM SREP Methodology Booklet, - 2018 SREP decisions applicable in 2019 -, Frankfurt am Main, 08.04.2019

Basel Committee:

Basel Committee (2018): Stress Testing Principles, Basel, 17.10.2018

BaFin/Bundesbank:

BaFin (2019): Konsultation 06/2019 BaFin Entwurf der Neufassung des Rundschreibens 9/2018 (BA) für Zinsänderungsrisiken im Anlagebuch, Bonn, Frankfurt am Main, 29.03.2019

Deutsche Bundesbank (2019): Sicherstellung der Risikotragfähigkeit bei weniger bedeutenden Instituten (LSI) Range of Practice 2015 bis 2017, Frankfurt am Main, 06.02.2019

Deutsche Bundesbank (2019): Keine Kanonen auf Spatzen: Der LSI-Stresstest als Integration von risikoorientiertem aufsichtlichem Informationsmanagement und bewusster Aufwandsbegrenzung für Banken und Sparkassen; Präsentation vom Thomas Kick im Rahmen der Konferenz: Verhältnismäßigkeit und Subsidiarität in der Bankenaufsicht und -regulierung am 24.01.2019 in Bonn

IT-RegulierungBaFin/Bundesbank:

BaFin (2018): Bankaufsichtliche Anforderungen an die IT (BAIT), Rundschreiben 10/2017 (BA) in der Fassung vom 14.09.2018, www.bafin.de

BaFin (2018): Orientierungshilfe zu Auslagerungen an Cloud-Anbieter, Bonn, Frankfurt am Main, 08.11.2018

BaFin (2018): Big Data trifft auf künstliche Intelligenz, Studie der BaFin in Zusammenarbeit mit der Fraunhofer Gesellschaft und Boston Consulting, Bonn, Frankfurt am Main, 15.06.2018

BaFin (2019): Kapitalverwaltungsaufsichtliche Anforderungen an die IT (KAIT), Konsultationsentwurf, Bonn, Frankfurt am Main, 08.04.2019

Röseler, Raimund / Steinbrecher, Ira (2019) Wenn Banken IT-Dienstleistungen auslagern, BaFin-Perspektiven, Ausgabe 01/2019, Bonn & Frankfurt am Main, 28.02.2019, S. 43-51

BSI:

BSI (2017): Anforderungskatalog Cloud Computing (C5), Stand September 2017

BSI (2019): IT-Grundschutzkompendium, 2. Edition 2019, 18.02.2019

BMI:

BMI (2019): Referentenentwurf zum IT-Sicherheitsgesetz 2.0 vom 27.03.2019 (unauthorisierte Veröffentlichung des Entwurfs in diversen Medien im Internet Anfang April 2019)

BMI (2017): Verordnung zur Bestimmung Kritischer Infrastrukturen nach dem BSI-Gesetz, Berlin 21.06.2017

Basel Committee / Financial Stability Board /G7:

Basel Committee on Banking Supervision (2018a): Progress in adopting the principles for effective risk data aggregation and reporting, Basel, 21.06.2018

Basel Committee on Banking Supervision (2018b): Cyber-Resilience. Range of Practices, Basel 04.12.2018

Basel Committee on Banking Supervision (2017a): Identification and Management of Step-in Risk, Basel 25.10.2017

Financial Stability Board (2018): Cyber Lexicon, Basel, 12.11.2018

G7 (2018a): Fundamental Elements for Threat-Led Penetration Testing, October 2018:

<https://www.bundesbank.de/de/aufgaben/themen/g7-staaten-verabschieden-berichte-zur-cyber-sicherheit-764580>

G7 (2018b): Fundamental Elements for Third Party Cyber Risk Management in the Financial Sector, Oktober 2018: <https://www.bundesbank.de/de/aufgaben/themen/g7-staaten-verabschieden-berichte-zur-cyber-sicherheit-764580>

European Commission / European Banking Authority:

EBA (2018): Leitlinien zu Sicherheitsmaßnahmen bezüglich der operationellen und sicherheitsrelevanten Risiken von Zahlungsdiensten gemäß der Richtlinie (EU) 2015/2366 (PSD2) (EBA/GL/2017/17), London, 12.01.2018

EBA (2018): EBA Draft Guidelines on Outsourcing arrangements (EBA/CP/2018/11), London, 22.06.2018

EBA (2018): EBA Draft Guidelines on ICT and Security Risk Management (EBA/CP/2018/15), London, 13.12.2018

EBA (2018): Empfehlungen zur Auslagerung an Cloud-Anbieter, London, 28.03.2018

EBA (2019): Revised Guidelines on Outsourcing Arrangements, London, 25.02.2019

Joint Committee of European Supervisory Authorities:

Joint Committee of European Supervisory Authorities (2019): Joint Advice on the need for legislative improvements relating to Information and Communication Technology (ICT) risk management requirements in the European Union (EU) financial sector; Paris, Frankfurt am Main, 10.04.2019

Joint Committee of European Supervisory Authorities (2019): Joint Advice on the costs and benefits of a coherent cyber resilience testing framework for significant market participants and infrastructures within the EU financial sector; Paris, Frankfurt am Main, 10.04.2019

EZB Bankenaufsicht:

European Central Bank (2018c): Report on the Thematic Review on effective risk data aggregation and risk reporting, 08.05.2018.

EZB (in Zentralbankfunktion):

EZB (2018): TIBER-EU: How to implement the European Framework for Threat Intelligence based Ethical Red-Teaming, Frankfurt am Main, 02.05.2018

EZB (2018): TIBER-EU Services Procurement Guidelines, Frankfurt am Main, 18.08.2018

EZB (2018): TIBER EU White Team Guidance, Frankfurt am Main 17.12.2018

Basel III / EU-BankenpaketBasel Committee:

Basel Committee on Banking Supervision (2018c): Pillar 3 Disclosure Requirements, updated framework, Basel, 11.12.2018

European Commission / Europäischer Rat:

European Commission (2018): Call for advice to the EBA for the purposes of revising the own fund requirements for credit, operational, market and credit valuation adjustment risk, Brüssel 04.05.2018

Europäischer Rat (2019): Bankenunion: EU-Botschafterinnen und -Botschafter billigen Gesamtpaket von Risikominderungsmaßnahmen, Pressemitteilung vom 15.02.2019 (mit Entwürfen von CRR, CRD, BRRD und SRMO-VO nach der politischen Einigung)

BaFin:

BaFin (2018): Europäische Aufsichtsbehörden: BaFin übernimmt grundsätzlich alle Leitlinien sowie Fragen und Antworten in ihre Verwaltungspraxis, in: BaFin-Journal Februar 2018

Operationelles RisikoEBA/ EU-Kommission:

Delegierte Verordnung (EU) Nr. 529/2014 der Kommission vom 12. März 2014 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die Beurteilung der Wesentlichkeit von Erweiterungen und Änderungen des auf internen Beurteilungen basierenden Ansatzes und des fortgeschrittenen Messansatzes veröffentlicht im Amtsblatt der Europäischen Union, 20.05.2018

Delegierte Verordnung (EU) 2018/959 der Kommission vom 14. März 2018 zur Ergänzung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Beurteilungsmethode, nach der die zuständigen Behörden Instituten die Verwendung fortgeschrittener Messansätze für operationelle Risiken gestatten, veröffentlicht im Amtsblatt der Europäischen Union, 06.07.2018

EBA (2018): EBA-Leitlinien zur Meldung von Betrugsfällen nach der zweiten Zahlungsdiensterichtlinie (PSD2) (EBA/GL/2018/05), London, 17.09.2018

SekundärliteraturPraxisbezogene Fachdarstellungen:

Buchmüller, Patrik / Igl, Andreas (Hrsg.): Handbuch ICAAP/ILAAP. Die Neuen Vorgaben zur Risikotragfähigkeit von EZB und BaFin, Bank-Verlag, Januar 2019

<http://www.bank-verlag-shop.de/neuerscheinungen/handbuch-icaapilaap-p-25251.html>

Lackhoff (2017): Single Supervisory Mechanism. A Practitioner's Guide, Nomos-Verlag, 2018

Kommentare:

Simitis / Hornung / Spiecker gen. Döhmman (2018): Datenschutzrecht. DSGVO mit BDSG. Großkommentar, Nomos-Verlag 2018

Ehmann / Selmayr (2018): Datenschutz-Grundverordnung: DS-GVO Kommentar, 2. Aufl. C.H.Beck-Verlag, 2018