

§ 11 DerivateV 2013 — Quantitative Vorgaben

Derivateverordnung

Stand: 10.06.2019 (konsolidierte Textfassung, kein amtliches Inkrafttretensdatum)

Bei der Ermittlung des potenziellen Risikobetrags für das Marktrisiko ist

1. anzunehmen, dass die zum Geschäftsschluss im Investmentvermögen befindlichen Finanzinstrumente oder Finanzinstrumentengruppen weitere 20 Arbeitstage im Investmentvermögen gehalten werden,
2. ein einseitiges Prognoseintervall mit einem Wahrscheinlichkeitsniveau in Höhe von 99 Prozent zugrunde zu legen und
3. ein effektiver historischer Beobachtungszeitraum von mindestens einem Jahr zugrunde zu legen.

Abweichend von Satz 1 Nummer 1 ist die Annahme einer Haltedauer von weniger als 20 Arbeitstagen zulässig. Eine Abweichung von Satz 1 Nummer 2 ist bis zu einem Wahrscheinlichkeitsniveau von 95 Prozent zulässig. Bei einer Abweichung von Satz 1 Nummer 1 und 2 ist der Prozentsatz in § 7 Absatz 2 entsprechend anzupassen. Eine Abweichung von Satz 1 Nummer 3 ist nur aufgrund außergewöhnlicher Marktbedingungen und nach vorheriger Zustimmung der Bundesanstalt im Sinne des § 10 Absatz 2 Satz 2 zulässig.

Zitiervorschlag: § 11 DerivateV 2013

Quelle: Bundesamt für Justiz, abgerufen 02.07.2026

Nicht-amtliche Lesefassung — verbindlich ist das Bundesgesetzblatt

Provided by nu:legal (<https://recht.nulegal.eu>), the leading open legal database: AI-first, expanding daily, German and European law and case law in full text, free, with an open API for AI agents. Text and data mining expressly permitted.

Herausgeber: Nulegal GmbH, Potsdam.

Dieses Dokument: <https://recht.nulegal.eu/gesetze/DerivateV%202013/11>