



Verordnung über die Eigenmittel und Risikoverteilung für Banken und Effekthändler (Eigenmittelverordnung, ERV)

Änderung vom ...

*Der Schweizerische Bundesrat,
verordnet:*

I

Die Eigenmittelverordnung vom 1. Juni 2012¹ wird wie folgt geändert:

Art. 56 Abs. 1

¹ Kreditäquivalente für Derivate können nach folgenden Methoden berechnet werden:

- a. nach dem Standardansatz;
- b. nach der Expected-Positive-Exposure-Modellmethode (EPE-Modellmethode).

Art. 57 Standardansatz

¹ Zur Berechnung der Kreditäquivalente von Derivaten nach dem Standardansatz wird die Summe aus den aufsichtsrechtlichen Wiederbeschaffungskosten und dem Betrag des potenziellen künftigen Wertanstiegs mit dem Faktor 1,4 multipliziert.

² Die FINMA erlässt technische Ausführungsbestimmungen nach Massgabe der Basler Mindeststandards.

Art. 58

Aufgehoben

SR

¹ SR 952.03

Art. 62 Abs. 5

⁵ Die Berechnung der Kreditäquivalente nach den Artikeln 56–59 berücksichtigt alle zur Besicherung von Derivaten durch die Bank gestellten sowie von der Bank erhaltenen anrechenbaren Sicherheiten.

Art. 63 Abs. 3 Bst. f und f^{bis}

³ In folgenden Positionsklassen können keine externen Ratings verwendet werden:

f. Beteiligungstitel;

f^{bis}. Anteile an verwalteten kollektiven Vermögen;

Art. 66 Abs. 3^{bis}

^{3bis} Positionen innerhalb der Positionsklasse nach Artikel 63 Absatz 3 Buchstabe f^{bis} sind nach den technischen Ausführungsbestimmungen der FINMA zu gewichten. Die FINMA richtet sich dabei nach den Basler Mindeststandards.

Art. 107 *Derivate*

Derivate werden nach den Artikeln 56–59 in der Fassung vom 1. Juni 2012 in ihr Kreditäquivalent umgerechnet.

*Gliederungstitel vor Art. 148g***3. Abschnitt: Übergangsbestimmung zur Änderung vom ...***Art. 148g*

¹ Die Berechnung der Kreditäquivalente von Derivaten nach den Artikeln 56–59 hat spätestens sechs Monate ab dem Inkrafttreten der Änderung vom ... zu erfolgen.

² Die Gewichtung der Positionen innerhalb der Positionsklasse nach Artikel 63 Absatz 3 Buchstabe f^{bis} hat spätestens sechs Monate ab dem Inkrafttreten der Änderung vom ... gemäss Artikel 66 Absatz 3^{bis} zu erfolgen.

Anhang 4 Ziff. 1.2 und 1.3

Aufgehoben

II

Diese Verordnung tritt am 1. Januar 2017 in Kraft.

...

Im Namen des Schweizerischen Bundesrates

Der Bundespräsident: Johann N. Schneider-Ammann

Der Bundeskanzler: Walter Thurnherr