



Ordonnance sur les fonds propres et la répartition des risques des banques et des négociants en valeurs mobilières (Ordonnance sur les fonds propres, OFR)

Modification du ...

*Le Conseil fédéral suisse,
arrête:*

I

L'ordonnance du 1^{er} juin 2012 sur les fonds propres¹ est modifiée comme suit:

Art. 56, al. 1

¹ Les équivalents-crédit des dérivés peuvent être calculés selon les méthodes suivantes:

- a. l'approche standard;
- b. la méthode des modèles relative à l'exposition positive attendue (méthode des modèles EPE).

Art. 57 Approche standard

¹ Le calcul des équivalents-crédit des dérivés selon l'approche standard est effectué en multipliant, par le facteur 1,4, la somme des coûts de remplacement conformément au droit de surveillance et du montant de l'augmentation de valeur potentielle future.

² La FINMA édicte les dispositions d'exécution techniques selon les standards minimaux de Bâle.

Art. 58

Abrogé

Art. 62, al. 5

⁵ Le calcul des équivalents-crédit selon les art. 56 à 59 tient compte de toutes les sûretés éligibles émises ou reçues par la banque en garantie des dérivés.

RS

¹ **RS 952.03**

Art. 63, al. 3, let. f et f^{bis}

³ Les classes de positions suivantes ne peuvent pas être pondérées au moyen des notations externes:

- f. les titres de participation;
- f^{bis}. les parts de patrimoines gérés collectivement;

Art. 66, al. 3^{bis}

^{3bis} Les positions attribuées à la classe de positions selon l'art. 63, al. 3, let. f^{bis}, sont pondérées conformément aux dispositions d'exécution techniques de la FINMA. Elle se fonde à cet égard sur les standards minimaux de Bâle.

Art. 107 Dérivés

Les dérivés sont convertis en leur équivalent-crédit selon les art. 56 à 59 dans leur teneur du 1^{er} juin 2012.

Titre précédant l'art. 148g

Section 3 Disposition transitoire relative à la modification du ...

Art. 148g

¹ Le calcul des équivalents-crédit de dérivés selon les art. 56 à 59 doit être effectué au plus tard six mois après l'entrée en vigueur de la modification du

² La pondération des positions attribuées à la classe de positions selon l'art. 63, al. 3, let. f^{bis}, doit être effectuée au plus tard six mois après l'entrée en vigueur de la modification du ... conformément à l'art. 66, al. 3^{bis}.

Annexe 4, ch. 1.2 et 1.3

Abrogés

II

La présente ordonnance entre en vigueur le 1^{er} janvier 2017.

...

Au nom du Conseil fédéral suisse:

Le président de la Confédération, Johann N.
Schneider-Ammann

Le chancelier de la Confédération, Walter Thurnherr