



Ordinanza sui fondi propri e sulla ripartizione dei rischi delle banche e dei commercianti di valori mobiliari

(Ordinanza sui fondi propri, OFoP)

Modifica del ...

*Il Consiglio federale svizzero
ordina:*

I

L'ordinanza del 1° giugno 2012¹ sui fondi propri è modificata come segue:

Art. 56 cpv. 1

¹ Gli equivalenti di credito per i derivati possono essere calcolati a scelta secondo uno dei seguenti metodi:

- a. approccio standard; o
- b. metodo del modello «expected positive exposure» (metodo del modello EPE).

Art. 57 Approccio standard

¹ Per il calcolo degli equivalenti di credito dei derivati secondo l'approccio standard, la somma dei costi di sostituzione conformemente alla legislazione sulla vigilanza e dell'importo del potenziale futuro incremento di valore è moltiplicata per il fattore 1,4.

² La FINMA emana disposizioni tecniche di esecuzione secondo gli standard minimi di Basilea.

Art. 58

Abrogato

RS

¹ **RS 952.03**

Art. 62 cpv. 5

⁵ Il calcolo degli equivalenti di credito ai sensi degli articoli 56–59 tiene conto di tutte le garanzie computabili emesse dalla banca o ricevute dalla banca ai fini della collateralizzazione di derivati.

Art. 63 cpv. 3 lett. f e f^{bis}

³ Nelle seguenti classi di posizione non possono essere applicati rating esterni:

- f. titoli di partecipazione;
- f^{bis} quote di patrimoni collettivi gestiti;

Art. 66 cpv. 3^{bis}

^{3bis} Le posizioni della classe di posizione di cui all'articolo 63 capoverso 3 lettera f^{bis} devono essere ponderate secondo le disposizioni tecniche di esecuzione emanate dalla FINMA. A tale scopo essa si fonda sugli standard minimi di Basilea.

Art. 107 Derivati

I derivati sono convertiti nel loro equivalente di credito conformemente agli articoli 56–59 nella versione del 1° giugno 2012.

*Titolo prima dell'art. 148g***Sezione 3: Disposizione transitoria della modifica del ...***Art. 148g*

¹ Il calcolo degli equivalenti di credito dei derivati ai sensi degli articoli 56–59 deve essere effettuato entro sei mesi dall'entrata in vigore della modifica del ...

² La ponderazione delle posizioni della classe di posizione di cui all'articolo 63 capoverso 3 lettera f^{bis} deve avvenire conformemente all'articolo 66 capoverso 3^{bis} entro sei mesi dall'entrata in vigore della modifica del ...

*Allegato 4 n. 1.2 e 1.3**Abrogati*

II

La presente ordinanza entra in vigore il 1° gennaio 2017.

... In nome del Consiglio federale svizzero:

Il presidente della Confederazione, Johann N. Schneider-Ammann
Il cancelliere della Confederazione, Walter Thurnherr

CONSULTAZIONE