



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

Änderung vom 23. November 2016

*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 aufsichtsrechtlich festgelegten 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

¹ SR 952.03

Art. 62 Abs. 5

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

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 Abs. 2

² Bei einer Umrechnung nach dem Standardansatz gemäss den Artikeln 56 Absatz 1 Buchstabe a und 57 haben Banken der Kategorien 1–3 nach Anhang 3 BankV² die FINMA unter Angabe der Auswirkungen auf die Klumpenrisiken in Kenntnis zu setzen.

Gliederungstitel vor Art. 148g

3. Abschnitt: Übergangsbestimmung zur Änderung vom 23. November 2016

Art. 148g

¹ Die Kreditäquivalente von Derivaten sind für die Ermittlung der erforderlichen Eigenmittel spätestens zwölf Monate ab dem Inkrafttreten der Änderung vom 23. November 2016 gemäss den Artikeln 56–59 zu berechnen.

² Die Gewichtung der Positionen innerhalb der Positionsklasse nach Artikel 63 Absatz 3 Buchstabe f^{bis} hat spätestens zwölf Monate ab dem Inkrafttreten der Änderung vom 23. November 2016 gemäss Artikel 66 Absatz 3^{bis} zu erfolgen.

³ Bis zum 31. Dezember 2018 kann die Umrechnung von Derivaten in ihr Kreditäquivalent im Rahmen des 4. Titels auch nach der Marktwertmethode oder der Standardmethode gemäss den Artikeln 56–58 in der Fassung vom 1. Juli 2016³ erfolgen. Die FINMA kann diese Frist erstrecken.

² SR 952.02

³ AS 2012 5441

Anhang 4 Ziff. 1.2 und 1.3

Aufgehoben

II

Diese Verordnung tritt am 1. Januar 2017 in Kraft.

23. November 2016

Im Namen des Schweizerischen Bundesrates

Der Bundespräsident: Johann N. Schneider-Ammann

Der Bundeskanzler: Walter Thurnherr

