



Ordinanza sui fondi propri e sulla ripartizione dei rischi delle banche e dei commercianti di valori mobiliari (Ordinanza sui fondi propri, OFoP)

Modifica del 23 novembre 2016

*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 stabiliti 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 di esecuzione tecniche secondo gli standard minimi di Basilea.

Art. 58

Abrogato

¹ RS 952.03

Art. 62 cpv. 5

⁵ Nel calcolo degli equivalenti di credito secondo gli articoli 56–59 è tenuto conto di tutte le garanzie computabili emesse 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 di esecuzione tecniche della FINMA. A tale scopo la FINMA si fonda sugli standard minimi di Basilea.

Art. 107 cpv. 2

² In caso di conversione secondo l'approccio standard conformemente agli articoli 56 capoverso 1 lettera a e 57, le banche delle categorie 1–3 di cui all'allegato 3 OBCR² devono informarne la FINMA indicando le conseguenze che ne risultano per i grandi rischi.

*Titolo prima dell'art. 148g***Sezione 3: Disposizione transitoria della modifica del 23 novembre 2016***Art. 148g*

¹ Il calcolo degli equivalenti di credito dei derivati volto a determinare i fondi propri necessari deve essere effettuato conformemente agli articoli 56–59 entro dodici mesi dall'entrata in vigore della modifica del 23 novembre 2016.

² La ponderazione delle posizioni della classe di posizione di cui all'articolo 63 capoverso 3 lettera f^{bis} deve essere effettuata conformemente all'articolo 66 capoverso 3^{bis} entro dodici mesi dall'entrata in vigore della modifica del 23 novembre 2016.

³ Fino al 31° dicembre 2018 la conversione dei derivati nel loro equivalente di credito nell'ambito del titolo quarto può essere effettuata anche secondo il metodo del valore di mercato o il metodo standard conformemente agli articoli 56–58 nel tenore del 1° luglio 2016³. La FINMA può prorogare tale termine.

² RS **952.02**

³ RU **2012** 5441

Allegato 4 n. 1.2 e 1.3

Abrogati

II

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

23 novembre 2016

In nome del Consiglio federale svizzero:

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

