

Medienmitteilung

Datum:
22. Dezember 2017

Sperrfrist:

Kontakt:
Vinzenc Mathys, Mediensprecher
Tel. +41 (0)31 327 19 77
vinzenc.mathys@finma.ch

FINMA revidiert Rundschreiben Kreditrisiken und Leverage Ratio

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA passt ihre an Banken gerichteten Rundschreiben Kreditrisiken und Leverage Ratio an die geänderte Eigenmittelverordnung an. Sie führt hierzu eine Anhörung bis zum 15. Februar 2018 durch.

Der Bundesrat änderte am 22. November 2017 die Eigenmittelverordnung, so dass Banken für zwei weitere Jahre die bisherige Marktwertmethode für Derivate sowie die bisherigen Regeln für die Eigenmittelunterlegung von Fondsinvestitionen anwenden können. Diese Änderung bedingt eine Anpassung des Rundschreibens 2017/7 „Kreditrisiken – Banken“ für die Berechnung der Mindesteigenmittel für den Ausfallfonds einer zentralen Gegenpartei. Die geänderte Eigenmittelverordnung schreibt ausserdem für alle Institute ab 1. Januar 2018 eine minimale Leverage Ratio auf dem Kernkapital von drei Prozent vor. Damit Banken für Derivate den Basel-III-Standardansatz auch im Rahmen der Leverage Ratio anwenden können, passt die FINMA ihr Rundschreiben 2015/3 „Leverage Ratio“ an. Sie berücksichtigt damit ein Anliegen der Branche. Die FINMA führt eine Anhörung zu diesen Anpassungen bis zum 15. Februar 2018 durch.