

RETTIFICHE

Rettifica del regolamento delegato (UE) 2016/101 della Commissione, del 26 ottobre 2015, che integra il regolamento (UE) n. 575/2013 del Parlamento europeo e del Consiglio per quanto riguarda le norme tecniche di regolamentazione per la valutazione prudente a norma dell'articolo 105, paragrafo 14

(Gazzetta ufficiale dell'Unione europea L 21 del 28 gennaio 2016)

Pagina 58, articolo 9, paragrafo 4, lettere b) e c):

anziché «b) Ciascuno degli input di valutazione di cui alla lettera a), punto i), è trattato separatamente. Quando l'input di valutazione è costituito da una matrice di parametri, gli AVA sono calcolati sulla base delle esposizioni oggetto di valutazione relative a ciascun parametro di tale matrice. Quando l'input di valutazione non si riferisce a strumenti negoziabili, gli enti collegano l'input di valutazione e la relativa esposizione oggetto di valutazione ad un insieme di strumenti negoziabili sul mercato. Gli enti possono ridurre il numero di parametri dell'input di valutazione ai fini del calcolo degli AVA utilizzando una metodologia adeguata a condizione che i parametri ridotti soddisfino tutti i seguenti requisiti:

i) il valore totale dell'esposizione oggetto di valutazione ridotta è pari al valore totale dell'esposizione oggetto di valutazione originaria;

ii) la serie ridotta di parametri può essere collegata ad una serie di strumenti negoziabili sul mercato;

iii) il rapporto tra la misura della varianza 2 definita di seguito e la misura della varianza 1 definita di seguito sulla base dei dati storici degli ultimi 100 giorni di negoziazione è inferiore a 0,1.

c) Ai fini del presente paragrafo, per "misura della varianza 1" si intende la varianza del profitto e della perdita dell'esposizione oggetto di valutazione sulla base dell'input di valutazione non ridotto, e per "misura della varianza 2" la varianza del profitto e della perdita dell'esposizione oggetto di valutazione sulla base dell'input di valutazione non ridotto meno l'esposizione oggetto di valutazione basata sull'input di valutazione ridotto. Se ai fini del calcolo degli AVA è utilizzato un numero ridotto di parametri, la determinazione che i criteri di cui alla lettera b) sono soddisfatti è soggetta a riesame della metodologia di netting e convalida interna da parte della funzione di controllo indipendente su base almeno annuale.»

leggasi «b) Ciascuno degli input di valutazione di cui alla lettera a), punto i), è trattato separatamente. Quando l'input di valutazione è costituito da una matrice di parametri, gli AVA sono calcolati sulla base delle esposizioni oggetto di valutazione relative a ciascun parametro di tale matrice. Quando l'input di valutazione non si riferisce a strumenti negoziabili, gli enti collegano l'input di valutazione e la relativa esposizione oggetto di valutazione ad un insieme di strumenti negoziabili sul mercato. Gli enti possono ridurre il numero di parametri dell'input di valutazione ai fini del calcolo degli AVA utilizzando una metodologia adeguata a condizione che i parametri ridotti soddisfino tutti i seguenti requisiti:

i) il valore totale dell'esposizione oggetto di valutazione ridotta è pari al valore totale dell'esposizione oggetto di valutazione originaria;

ii) la serie ridotta di parametri può essere collegata ad una serie di strumenti negoziabili sul mercato;

iii) il rapporto tra la misura della varianza 2 definita di seguito e la misura della varianza 1 definita di seguito sulla base dei dati storici degli ultimi 100 giorni di negoziazione è inferiore a 0,1.

Ai fini del presente paragrafo, per "misura della varianza 1" si intende la varianza del profitto e della perdita dell'esposizione oggetto di valutazione sulla base dell'input di valutazione non ridotto, e per "misura della varianza 2" la varianza del profitto e della perdita dell'esposizione oggetto di valutazione sulla base dell'input di valutazione non ridotto meno l'esposizione oggetto di valutazione basata sull'input di valutazione ridotto.

- c) Se ai fini del calcolo degli AVA è utilizzato un numero ridotto di parametri, la determinazione che i criteri di cui alla lettera b) sono soddisfatti è soggetta a riesame della metodologia di netting e convalida interna da parte della funzione di controllo indipendente su base almeno annuale.»
-

Rettifica del regolamento di esecuzione (UE) 2015/1501 della Commissione, dell'8 settembre 2015, relativo al quadro di interoperabilità di cui all'articolo 12, paragrafo 8, del regolamento (UE) n. 910/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio in materia di identificazione elettronica e servizi fiduciari per le transazioni elettroniche nel mercato interno

(Gazzetta ufficiale dell'Unione europea L 235 del 9 settembre 2015)

Pagina 3, articolo 4, seconda frase:

anziché «I risultati della mappatura sono comunicati alla Commissione utilizzando il modello di notifica stabilito nella decisione di esecuzione (UE) 2015/1505 della Commissione (*)

(*) Decisione di esecuzione (UE) 2015/1505 della Commissione, dell'8 settembre 2015, che stabilisce le specifiche tecniche e i formati relativi agli elenchi di fiducia di cui all'articolo 22, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 910/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio in materia di identificazione elettronica e servizi fiduciari per le transazioni elettroniche nel mercato interno (cfr. la pagina 26 della presente Gazzetta ufficiale).»

leggasi «I risultati della mappatura sono comunicati alla Commissione utilizzando il modello di notifica stabilito nella decisione di esecuzione (UE) 2015/1984 della Commissione (*)

(*) Decisione di esecuzione (UE) 2015/1984 della Commissione, del 3 novembre 2015, che definisce le circostanze, i formati e le procedure della notifica di cui all'articolo 9, paragrafo 5, del regolamento (UE) n. 910/2014 del Parlamento europeo e del Consiglio in materia di identificazione elettronica e servizi fiduciari per le transazioni elettroniche nel mercato interno (GU L 289 del 5.11.2015, pag. 18).»
