

**Corrección de errores del Reglamento Delegado (UE) 2022/2059 de la Comisión, de 14 de junio de 2022, por el que se completa el Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación que especifican los detalles técnicos de los requisitos en materia de pruebas retrospectivas y atribución de pérdidas y ganancias con arreglo a los artículos 325 *ter septies* y 325 *ter octies* del Reglamento (UE) n.º 575/2013**

(Diario Oficial de la Unión Europea L 276 de 26 de octubre de 2022)

En la página 56, en el artículo 10, apartado 1:

donde dice:

- « $SA_{ima}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** calculados de conformidad con el método estándar alternativo establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 bis, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para la cartera de todas las posiciones asignadas a las mesas de negociación para las que la entidad calcula los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;
- $IMA_{ima}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** calculados de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para la cartera de todas las posiciones asignadas a las mesas de negociación para las que la entidad calcula los requisitos de fondos propios de conformidad con la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.»

debe decir:

- « $SA_{ima}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** calculados de conformidad con el método estándar alternativo establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 bis, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para la cartera de todas las posiciones asignadas a las mesas de negociación para las que la entidad calcula los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;
- $IMA_{ima}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** calculados de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para la cartera de todas las posiciones asignadas a las mesas de negociación para las que la entidad calcula los requisitos de fondos propios de conformidad con la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.»

En la página 56, en el artículo 10, apartado 2:

donde dice:

- « $SA_i$  = los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** calculados de conformidad con el método estándar alternativo establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 bis, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para todas las posiciones atribuidas a la mesa de negociación “i”;
- $I \in NG$  = los índices de todas las mesas de negociación que se han clasificado como mesas de zona roja, naranja o amarilla de conformidad con el artículo 9 del presente Reglamento de entre aquellas para las que los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** se calculan de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;
- $I \in ima$  = los índices de todas las mesas de negociación para las que los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** se calculan de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.»

debe decir:

- «SA<sub>i</sub> = los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** calculados de conformidad con el método estándar alternativo establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 bis, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para todas las posiciones atribuidas a la mesa de negociación “i”;
- I  $\epsilon$  ima = los índices de todas las mesas de negociación que se han clasificado como mesas de zona roja, naranja o amarilla de conformidad con el artículo 9 del presente Reglamento de entre aquellas para las que los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** se calculan de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 ter, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;
- I  $\epsilon$  ima = los índices de todas las mesas de negociación para las que los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** se calculan de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 ter, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.».

En la página 56, en el artículo 10, apartado 3:

donde dice: «3. Las entidades que calculen los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 ter, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para las posiciones asignadas a las mesas de negociación que hayan sido clasificadas como mesas de zona roja o naranja de conformidad con el artículo 9 del presente Reglamento informarán de ello a la autoridad competente cuando comuniquen los resultados del requisito de atribución de pérdidas y ganancias de conformidad con el artículo 325 bis septvicies apartado 2, letra d), del Reglamento (UE) n.º 2013/575.».

debe decir: «3. Las entidades que calculen los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 ter, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para las posiciones asignadas a las mesas de negociación que hayan sido clasificadas como mesas de zona roja o naranja de conformidad con el artículo 9 del presente Reglamento informarán de ello a la autoridad competente cuando comuniquen los resultados del requisito de atribución de pérdidas y ganancias de conformidad con el artículo 325 bis septvicies, apartado 2, letra d), del Reglamento (UE) n.º 575/2013.».

En las páginas 58 y 59, en el artículo 16:

*donde dice:* «Las entidades que calculan los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para las posiciones asignadas a algunas de sus mesas de negociación calcularán los requisitos de fondos propios para todas las posiciones de su cartera de negociación y todas las posiciones de su cartera de inversión que están sujetas al riesgo de tipo de cambio o de materias primas como la suma de los resultados de las fórmulas establecidas en las letras a) y b), del siguiente modo:

a)  $\min\{IMA_{ima} + Capitalsurcharge + C_U ; SA_{alldesks}\}$

b)  $\max\{IMA_{ima} - SA_{ima}; 0\}$

siendo:

$IMA_{ima}$  =  $IMA_{ima}$  tal como se especifica en el artículo 10 del presente Reglamento;

$SA_{ima}$  =  $SA_{ima}$  tal como se especifica en el artículo 10 del presente Reglamento;

$Capitalsurcharge$  = el recargo de capital calculado de conformidad con el artículo 10 del presente Reglamento;

$C_U$  = los requisitos de fondos propios calculados de conformidad con la parte tercera, título IV, capítulo 1 *bis*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 en relación con la cartera de posiciones no asignadas a las mesas de negociación para las que las entidades calculan los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;

$SA_{alldesks}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgos de mercado** de todas las posiciones de la cartera de negociación y todas las posiciones de la cartera de inversión que están sujetas al riesgo de tipo de cambio o de materias primas, de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *bis*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.».

*debe decir:* «Las entidades que calculen los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 para las posiciones asignadas a algunas de sus mesas de negociación calcularán los requisitos de fondos propios para todas las posiciones de su cartera de negociación y todas las posiciones de su cartera de inversión que estén sujetas al riesgo de tipo de cambio o de materias primas como la suma de los resultados de las fórmulas establecidas en las letras a) y b), del siguiente modo:

a)  $\min\{IMA_{ima} + Capitalsurcharge + C_U ; SA_{alldesks}\}$

b)  $\max\{IMA_{ima} - SA_{ima}; 0\}$

siendo:

$IMA_{ima}$  =  $IMA_{ima}$  tal como se especifica en el artículo 10 del presente Reglamento;

$SA_{ima}$  =  $SA_{ima}$  tal como se especifica en el artículo 10 del presente Reglamento;

$Capitalsurcharge$  = el recargo de capital calculado de conformidad con el artículo 10 del presente Reglamento;

$C_U$  = los requisitos de fondos propios calculados de conformidad con la parte tercera, título IV, capítulo 1 *bis*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013 en relación con la cartera de posiciones no asignadas a las mesas de negociación para las que las entidades calculan los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *ter*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013;

$SA_{alldesks}$  = los requisitos de fondos propios por **riesgo de mercado** de todas las posiciones de la cartera de negociación y todas las posiciones de la cartera de inversión que están sujetas al riesgo de tipo de cambio o de materias primas, de conformidad con el método de modelos internos alternativos establecido en la parte tercera, título IV, capítulo 1 *bis*, del Reglamento (UE) n.º 575/2013.».