RECTIFICATIFS

Rectificatif au règlement délégué (UE) 2017/653 de la Commission du 8 mars 2017 complétant le règlement (UE) n° 1286/2014 du Parlement européen et du Conseil sur les documents d'informations clés relatifs aux produits d'investissement packagés de détail et fondés sur l'assurance (PRIIP) par des normes techniques de réglementation concernant la présentation, le contenu, le réexamen et la révision des documents d'informations clés et les conditions à remplir pour répondre à l'obligation de fournir ces documents

(«Journal officiel de l'Union européenne» L 100 du 12 avril 2017)

Page 16, à l'annexe II, point 12:

au lieu de: «La valeur en risque dans le temps de retour est donnée par le développement de Cornish-Fisher:

$$\text{VaR}_{\text{RETURN SPACE}} = \sigma/\sqrt{N} * (-1,96 + 0,474 * \mu_1/\sqrt{N} - 0,0687 * \mu_2/N + 0,146 * \mu_1^2/N) - 0,5 \sigma^2 N$$

lire: «La valeur en risque dans l'espace des rendements est donnée par le développement de Cornish-Fisher:

$$\text{VaR}_{\text{ESPACE DES RENDEMENTS}} = \sigma/\sqrt{N} * (-1,96 + 0,474 * \mu_1/\sqrt{N} - 0,0687 * \mu_2/N + 0,146 * \mu_1^2/N) - 0,5 \sigma^2 N$$

Page 17, à l'annexe II, point 13, tel que rectifié à la page 31 du JO L 120 du 11.5.2017, la formule est remplacée par le texte suivant:

$$\text{«} \text{VEV} = \left\{ \sqrt{(3,842 - 2 * \text{VaR}_{\text{ESPACE DES RENDEMENTS}})} - 1,96 \right\} / \sqrt{T} \text{»}$$

Page 18, à l'annexe II, point 22 c), la formule est remplacée par le texte suivant:

$$\text{«Rendement} = E[\text{Rendement}_{\text{neutre en termes de risque}}] - E[\text{Rendement}_{\text{mesuré}}] - 0,5 \sigma^2 N - \rho \sigma \sigma_{\text{ccy}} N \text{»}.$$