

20.9.2005

A6-0257/684

ENMIENDA 684

presentada por Alexander Radwan, en nombre del Grupo del PPE-DE, Harald Ettl, en nombre del Grupo del PSE y Wolf Klinz, en nombre del Grupo ALDE

Informe

A6-0257/2005

Alexander Radwan

1º Acceso a la actividad de las entidades de crédito

2º Adecuación del capital de las empresas de inversión y las entidades de crédito

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0155(COD)))

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0159(COD)))

Texto de la Comisión

Enmienda del Parlamento

Enmienda 684

Anexo VIII, parte 3, apartado 16, letra i bis (nueva)

i bis) los modelos internos se ajustarán a los requisitos establecidos en el Anexo III, parte 6, apartados 40 a 42.

Or. en

ENMIENDA 685

presentada por Alexander Radwan, en nombre del Grupo del PPE-DE, Harald Ettl, en nombre del Grupo del PSE y Wolf Klinz, en nombre del Grupo ALDE

Informe**A6-0257/2005****Alexander Radwan**

1º Acceso a la actividad de las entidades de crédito

2º Adecuación del capital de las empresas de inversión y las entidades de crédito

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0155(COD)))

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0159(COD)))

Texto de la Comisión

Enmienda del Parlamento

Enmienda 685

Anexo VIII, parte 3, apartado 20 y cuadro 1

20. Se exigirá a toda entidad de crédito que emplee el método de modelos internos la comprobación de sus resultados en una muestra de 20 contrapartes, identificadas por periodos anuales. Entre dichas contrapartes se contarán las 10 de mayor tamaño, decididas por cada entidad de crédito con arreglo a su propia metodología de medición de riesgos, y otras 10 seleccionadas de forma aleatoria. Para cada día y cada contraparte, la entidad de crédito deberá comparar la variación real del valor de la exposición frente a la contraparte a lo largo de un día con la variación estimada del valor de exposición, empleando el método de modelos internos, calculado al cierre del día anterior. Se producirá una excepción en cada observación en la cual la variación real de la exposición supere a la estimación del modelo interno. Dependiendo del número de excepciones registradas en las observaciones correspondientes a las 20 contrapartes durante los 250 últimos días hábiles (5 000 observaciones en total), el

suprimido

resultado estimado del modelo interno se incrementará mediante la utilización del multiplicador recogido en el cuadro 1.

Cuadro 1

Zona	Número de excepciones Multiplicador
Zona verde	0-99
	1
	100-119
	1,13
Zona amarilla	120-139
	1,17
	140-159
	1,22
Zona roja	160-179
	1,25
	180-199
	1,28
Zona roja	200 o más
	1,33

En el marco de la comprobación de resultados, la entidad de crédito confirmará que las excepciones no se concentren en sus exposiciones frente a una o más contrapartes.

Or. en

20.9.2005

A6-0257/686

ENMIENDA 686

presentada por Alexander Radwan, en nombre del Grupo del PPE-DE, Harald Ettl, en nombre del Grupo del PSE y Wolf Klinz, en nombre del Grupo ALDE

Informe

A6-0257/2005

Alexander Radwan

1º Acceso a la actividad de las entidades de crédito

2º Adecuación del capital de las empresas de inversión y las entidades de crédito

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0155(COD)))

Propuesta de directiva ((COM(2004)0486 - C6-0141/2004 - 2004/0159(COD)))

Texto de la Comisión

Enmienda del Parlamento

Enmienda 686

Anexo VIII, parte 3, apartado 21, párrafo 2

$E^* = \max \{0, [(\sum E - \sum C) + (\text{resultado } \mathbf{x}$
estimado de los modelos internos \mathbf{x}
multiplicador en su caso})]\}

$E^* = \max \{0, [(\sum E - \sum C) + (\mathbf{VaR}$ resultado
de los modelos internos)]\}

Or. en