

**Basler Ausschuss  
für  
Bankenaufsicht**

---

**Änderung der Basler Eigenkapitalvereinbarung vom Juli 1988**

Der Basler Ausschuss für Bankenaufsicht hat beschlossen, die Basler Eigenkapitalvereinbarung mit sofortiger Wirkung dahingehend zu ändern, dass die Risikogewichtung für Forderungen gegenüber einer Aufsicht unterstehenden Wertpapierhäusern unter bestimmten Bedingungen, die im beigefügten offiziellen Text der Änderung dargelegt sind, reduziert wird. Bei dieser Gelegenheit wurde an mehreren Stellen des Textes ausserdem das Wort "Kredite" durch das Wort "Forderungen" ersetzt.

7. April 1998

## Änderung der Eigenkapitalvereinbarung

Der folgende Wortlaut ersetzt die bisherige Aufstellung der Aktiva (Anlage 2 der Eigenkapitalvereinbarung), die mit einem Risikogewicht von 20 % belegt werden:

- 20%**
- a) Forderungen an multilaterale Entwicklungsbanken (IBRD, IADB, AsDB, AfDB, EIB, EBRD)<sup>1</sup> und durch solche Banken verbürgte oder durch Wertpapiere, die von ihnen begeben wurden, besicherte Forderungen<sup>2</sup>
  - b) Forderungen an Banken mit Sitz in der OECD und durch solche Banken verbürgte Forderungen<sup>2</sup>
  - c) Forderungen an Wertpapierhäuser mit Sitz in der OECD, sofern vergleichbare Aufsichtsregelungen bestehen, insbesondere risikoabhängige Eigenkapitalanforderungen<sup>3</sup>, und durch solche Wertpapierhäuser verbürgte Forderungen
  - d) Forderungen an Banken mit Sitz ausserhalb der OECD, mit einer Restlaufzeit von bis 1 Jahr, und Forderungen mit einer Restlaufzeit von bis 1 Jahr, die durch solche Banken verbürgt werden
  - e) Forderungen an nicht inländische Institutionen des öffentlichen Sektors von OECD-Ländern, unter Ausschluss der Zentralregierungen, und durch solche Institutionen verbürgte Forderungen<sup>2</sup>
  - f) Barposten, die gerade eingetrieben werden

---

<sup>1</sup> Forderungen an andere multilaterale Entwicklungsbanken, an deren Aktienkapital die Länder der Zehnergruppe beteiligt sind, können nach Ermessen jedes Landes ebenfalls mit 20 % gewichtet werden.

<sup>2</sup> Teilweise von solchen Institutionen verbürgte kommerzielle Forderungen erhalten für jenen Teil der Forderung, der voll gedeckt ist, die gleiche niedrige Gewichtung. Ebenso erhalten Forderungen, die zum Teil durch Barmittel oder durch von Zentralregierungen der OECD und multilaterale Entwicklungsbanken begebene Wertpapiere gesichert sind, eine niedrige Gewichtung für jenen Teil, der voll gedeckt ist.

<sup>3</sup> Gemeint sind Eigenkapitalanforderungen vergleichbar denen für Banken gemäss der vorliegenden Vereinbarung sowie ihrer Änderung zur Einbeziehung der Marktrisiken. Der Ausdruck "vergleichbar" setzt implizit voraus, dass das Wertpapierhaus (jedoch nicht unbedingt seine Muttergesellschaft) einer konsolidierten Aufsicht gemeinsam mit etwaigen Tochtergesellschaften untersteht.