

OPATŘENÍ OBECNÉ POVAHY
k úpravě limitů na velikost vybraných expozic pro obchodníky s cennými papíry

ze dne 4. června 2018

Česká národní banka jako příslušný správní orgán vydává podle § 199 odst. 5 zákona č. 256/2004 Sb., o podnikání na kapitálovém trhu, ve znění zákona č. 135/2014 Sb. (dále jen „zákon o podnikání na kapitálovém trhu“) toto opatření obecné povahy k čl. 493 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 575/2013 ze dne 26. června 2013 o obezřetnostních požadavcích na úvěrové instituce a investiční podniky a o změně nařízení (EU) č. 648/2012, ve znění nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2017/2395 (dále jen „nařízení“):

Obchodník s cennými papíry podle § 8a odst. 1 zákona o podnikání na kapitálovém trhu může nabývat kterékoli z expozic uvedených v čl. 493 odst. 5 nařízení, jež splňují podmínky stanovené v čl. 493 odst. 6 nařízení, až do výše:

- a) 100 % svého kapitálu tier 1 do 31. prosince 2018;**
- b) 75 % svého kapitálu tier 1 do 31. prosince 2019;**
- c) 50 % svého kapitálu tier 1 do 31. prosince 2020.**

Tyto limity se uplatní na hodnoty expozic po zohlednění účinku snižování úvěrového rizika podle čl. 399 až 403 nařízení.

Odůvodnění

1. Podle § 199 odst. 5 zákona o podnikání na kapitálovém trhu může Česká národní banka vydat opatření obecné povahy na základě a v mezích přímo použitelného předpisu Evropské unie upravujícího obezřetnostní požadavky tam, kde tento přímo použitelný předpis umožňuje příslušnému orgánu udělit výjimku nebo upravit použití stanovených pravidel obchodníkům s cennými papíry nebo skupině druhově určených obchodníků s cennými papíry. Přímou použitelným předpisem Evropské unie upravujícím obezřetnostní požadavky je nařízení.

2. V souladu se zákonným zmocněním uplatňuje Česká národní banka pravomoc upravit na základě a v mezích nařízení použití stanovených pravidel, která se vztahují na investiční

podniky¹ nebo jiné osoby². Česká národní banka tímto opatřením obecné povahy uplatňuje pravomoc podle čl. 493 odst. 4 nařízení, který umožňuje příslušným orgánům dovolit institucím nabývat kterékoliv z expozic stanovených v čl. 493 odst. 5 nařízení, jež splňují podmínky stanovené v čl. 493 odst. 6 nařízení, až do výše stanovené v čl. 493 odst. 4 nařízení. Toto opatření reaguje na změnu podmínek a zmírňuje důsledky ukončení platnosti přechodného ustanovení v čl. 495 odst. 2 nařízení.

3. Expozice uvedené v čl. 493 odst. 5 nařízení, které byly nabyty před 12. prosincem 2017 a kterým byla k 31. prosinci 2017 podle čl. 495 odst. 2 nařízení přidělena riziková váha 0 %, jsou z uplatňování čl. 395 odst. 1 nařízení vyňaty podle čl. 493 odst. 7 nařízení.

4. Návrh tohoto opatření obecné povahy byl od 16. května 2018 do 31. května 2018 zveřejněn způsobem umožňujícím dálkový přístup, přičemž k návrhu nebyly uplatněny žádné připomínky ani námítky.

Účinnost

Toto opatření obecné povahy nabývá účinnosti dnem ~~1.2.~~ 1. června 2018.

otisk úředního razítka

Ing. Mojmír Hampl, MSc., Ph.D.
viceguvernér

elektronicky podepsáno

Ing. Pavel Hollmann, MBA
ředitel sekce regulace a mezinárodní
spolupráce na finančním trhu

elektronicky podepsáno

Postup vydání

Toto opatření obecné povahy bylo zveřejněno ~~7.~~ 7. června 2018.

¹ Čl. 4 odst. 1 bod 2 nařízení.

² Například finanční instituce podle čl. 4 odst. 1 bodu 26 nařízení nebo podnik pomocných služeb podle čl. 4 odst. 1 bodu 18 nařízení.