

Třídící znak							
2	0	7	2	1	5	6	0

## ÚŘEDNÍ SDĚLENÍ ČESKÉ NÁRODNÍ BANKY

ze dne 29. června 2021

### **k výkonu činnosti obchodníků s cennými papíry – uplatnění plošné diskrece orgánu dohledu k vyloučení expozic z limitu pro riziko koncentrace**

1. Česká národní banka má právní postavení orgánu dohledu podle nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2019/2033 ze dne 27. listopadu 2019 o obezřetnostních požadavcích na investiční podniky a o změně nařízení (EU) č. 1093/2010, (EU) č. 575/2013, (EU) č. 600/2014 a (EU) č. 806/2014 (dále jen „nařízení IFR“).
2. Podle nařízení IFR náleží orgánu dohledu pravomoc, aby ve vymezených oblastech v rámci své působnosti stanovil, od kdy a v jakém rozsahu mají investiční podniky<sup>1</sup> plnit povinnosti vyplývající z nařízení, popř. od plnění těchto povinností upustit (dále jen „plošná diskrece“).
3. Podle čl. 41 odst. 2 nařízení IFR Česká národní banka jako orgán dohledu přistupuje k vyloučení expozic z čl. 37 nařízení IFR takto:

Obchodník s cennými papíry, na kterého se použije nařízení IFR, (dále jen „obchodník“), vyloučí z působnosti čl. 37 nařízení IFR

- a) expozici v krytých dluhopisech podle čl. 41 odst. 2 nařízení IFR, a to do výše 75 % hodnoty této expozice; tím nejsou dotčeny účinky podle písmena b) bodů 1 a 2, a
  - b) jsou-li splněny podmínky podle čl. 41 odst. 2 písm. b) bodů i) a ii) nařízení IFR, tak i expozici vůči
    1. osobě se sídlem v České republice, která ovládá obchodníka a je úvěrovou institucí podle čl. 4 odst. 1 bodu 1 nařízení (EU) č. 575/2013, investičním podnikem podle čl. 4 odst. 1 bodu 2 nařízení (EU) č. 575/2013 nebo osobou podle čl. 11 odst. 2 písm. a) až c) nařízení (EU) č. 575/2013,
    2. osobě, která je ovládána obchodníkem a vztahuje se na ni společně s obchodníkem týž dohled na konsolidovaném základě podle čl. 7 nařízení IFR nebo týž dohled nad dodržováním skupinového kapitálového testu podle čl. 8 nařízení IFR,
    3. osobě, která je úvěrovou institucí podle čl. 4 odst. 1 bodu 1 nařízení (EU) č. 575/2013 nebo investičním podnikem podle čl. 4 odst. 1 bodu 2 nařízení (EU) č. 575/2013 a vztahuje se na ni společně s obchodníkem týž dohled na konsolidovaném základě podle nařízení (EU) č. 575/2013, týž dohled na konsolidovaném základě podle čl. 7 nařízení IFR, týž dohled nad dodržováním skupinového kapitálového testu podle čl. 8 nařízení IFR nebo obdobných právních předpisů platných v jiném než členském státě Evropské unie nebo státě, který je smluvní stranou Dohody o Evropském hospodářském prostoru, a to do výše 50 % hodnoty této expozice; tím nejsou dotčeny účinky podle písmena a) a bodů 1 a 2.
4. Úřední sdělení upravuje vyloučení expozic z čl. 37 ve smyslu čl. 41 odst. 2 nařízení IFR dočasně a bude nahrazeno opatřením obecné povahy poté, co nabude účinnosti novela zákona o podnikání na kapitálovém trhu, která jeho vydání předpokládá.<sup>2</sup>

<sup>1</sup> Článek 4 odst. 1 bod 22 nařízení IFR.

<sup>2</sup> Návrh zákona, kterým se mění některé zákony v oblasti finančního trhu zejména v souvislosti s implementací předpisů Evropské unie týkajících se unie kapitálových trhů (sněmovní tisk č. 1117).

5. Podle tohoto úředního sdělení se postupuje ode dne 26. června 2021.

Viceguvernér:  
Ing. Marek Mora, M.E. v. r.