

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. Přímo 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 kterékoli 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 námitky.

Účinnost

Toto opatření obecné povahy nabývá účinnosti dnem 22. června 2018.

otisk úředního razítka

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

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

Postup vydání

Toto opatření obecné povahy bylo zveřejněno 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.