

1574

ROZPORZĄDZENIE MINISTRA FINANSÓW¹⁾

z dnia 18 listopada 2009 r.

w sprawie warunków, jakim powinny odpowiadać wnioski o udzielenie zgody na stosowanie przez dom maklerski wybranych metod pomiaru ryzyka operacyjnego²⁾

Na podstawie art. 105c ust. 3 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (Dz. U. Nr 183, poz. 1538, z późn. zm.³⁾) zarządza się, co następuje:

§ 1. Rozporządzenie określa warunki, jakim powinny odpowiadać wnioski domów maklerskich o udzielenie zgody na stosowanie:

- 1) zaawansowanej metody pomiaru ryzyka operacyjnego do obliczania wysokości wymogów kapitałowych z tytułu ryzyka operacyjnego;
- 2) zaawansowanej metody pomiaru ryzyka operacyjnego, w połączeniu z metodą podstawowego wskaźnika lub metodą standardową, do obliczania wysokości wymogów kapitałowych z tytułu ryzyka operacyjnego.

§ 2. Ilekroć w rozporządzeniu jest mowa o:

- 1) rozporządzeniu o wymogach kapitałowych — rozumie się przez to rozporządzenie Ministra Finansów z dnia 18 listopada 2009 r. w sprawie zakresu i szczegółowych zasad wyznaczania całkowitego wymogu kapitałowego, w tym wymogów kapitałowych, dla domów maklerskich oraz określenia maksymalnej wysokości kredytów, pożyczek i wyemitowanych dłużnych papierów wartościowych w stosunku do kapitałów (Dz. U. Nr 204, poz. 1571);
- 2) metodzie podstawowego wskaźnika — rozumie się przez to metodę, o której mowa w rozdziale 2 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 3) metodzie standardowej — rozumie się przez to metodę, o której mowa w rozdziale 3 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 4) metodzie zaawansowanej — rozumie się przez to zaawansowaną metodę pomiaru, o której mowa w rozdziale 4 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych.

¹⁾ Minister Finansów kieruje działem administracji rządowej — instytucje finansowe, na podstawie § 1 ust. 2 pkt 3 rozporządzenia Prezesa Rady Ministrów z dnia 16 listopada 2007 r. w sprawie szczegółowego zakresu działania Ministra Finansów (Dz. U. Nr 216, poz. 1592).

²⁾ Niniejsze rozporządzenie dokonuje w zakresie swojej regulacji wdrożenia dyrektywy 2006/49/WE Parlamentu Europejskiego i Rady z dnia 14 czerwca 2006 r. w sprawie adekwatności kapitałowej firm inwestycyjnych i instytucji kredytowych (Dz. Urz. UE L 177 z 30.06.2006, str. 201).

³⁾ Zmiany wymienionej ustawy zostały ogłoszone w Dz. U. z 2006 r. Nr 104, poz. 708 i Nr 157, poz. 1119, z 2008 r. Nr 171, poz. 1056 oraz z 2009 r. Nr 13, poz. 69, Nr 42, poz. 341, Nr 77, poz. 649, Nr 78, poz. 659, Nr 165, poz. 1316, Nr 166, poz. 1317, Nr 168, poz. 1323 i Nr 201, poz. 1540.

§ 3. 1. Wnioski, o których mowa w § 1, zawierają informacje dotyczące:

- 1) charakterystyki domu maklerskiego oraz w przypadku domu maklerskiego działającego w grupie kapitałowej — charakterystyki tej grupy;
- 2) zakresu stosowania metody do obliczania wymogu kapitałowego z tytułu ryzyka operacyjnego oraz planu stopniowego wdrożenia metody zaawansowanej, jeżeli dom maklerski zamierza skorzystać z przepisów § 26 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 3) struktury i założeń wewnętrznego systemu pomiaru z uwzględnieniem norm określonych w rozdziale 4 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 4) źródeł, zarządzania i metod aktualizacji wykorzystywanych danych, w szczególności struktury systemów wykorzystywanych do gromadzenia i przetwarzania danych na potrzeby metody zaawansowanej oraz oceny i raportowania ryzyka w domu maklerskim, a także rozwiązań przyjętych przez dom maklerski w zakresie zarządzania bazami danych;
- 5) wewnętrznego procesu zatwierdzania systemu pomiaru ryzyka operacyjnego;
- 6) wykorzystywania ubezpieczenia i innych mechanizmów transferu ryzyka operacyjnego, zgodnie z § 22—24 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 7) zasad alokacji wymogu kapitałowego pomiędzy poszczególne podmioty grupy kapitałowej oraz sposobu uwzględniania efektów dywersyfikacji, w przypadku domów maklerskich działających w ramach grupy i zamierzających stosować metodę zaawansowaną, zgodnie z § 25 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych;
- 8) samooceny domu maklerskiego w zakresie spełniania norm, o których mowa w § 16—21 załącznika nr 11 do rozporządzenia o wymogach kapitałowych.

2. Do wniosków dom maklerski załącza zestawienie dokumentów dotyczących informacji, o których mowa w ust. 1, oraz kopie tych dokumentów na nośniku elektronicznym.

§ 4. Rozporządzenie wchodzi w życie z dniem 1 stycznia 2010 r.

Minister Finansów: w z. *E. Suchocka-Roguska*