

1596

ROZPORZĄDZENIE MINISTRA FINANSÓW¹⁾

z dnia 20 listopada 2009 r.

w sprawie przeprowadzania badania i oceny nadzorczej domów maklerskich²⁾

Na podstawie art. 98i ust. 2 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 terminy, tryb, formę przeprowadzania badania i oceny nadzorczej domów maklerskich.

§ 2. Ilekcóż w rozporządzeniu jest mowa o:

- 1) ustawie — rozumie się przez to ustawę z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi;
- 2) Komisji — rozumie się przez to Komisję Nadzoru Finansowego.

§ 3. 1. Instrumentem pomocniczym przy przeprowadzaniu badania i oceny nadzorczej jest monitoring ostrożnościowy.

2. Monitoring ostrożnościowy obejmujący w szczególności adekwatność kapitałową wynikającą z wymogów kapitałowych w stosunku do ryzyka wynikającego z działalności domu maklerskiego przeprowadzany jest w sposób ciągły.

3. Monitoring ostrożnościowy obejmujący w szczególności:

- 1) profil i poziom ryzyka, na jakie narażony jest dom maklerski,
- 2) poziom kapitału pokrywającego ryzyko wynikające z działalności domu maklerskiego

— jest przeprowadzany co najmniej raz na pół roku.

4. Monitoring ostrożnościowy obejmujący w szczególności stopień narażenia domu maklerskiego na ryzyko koncentracji zaangażowań, w tym dużych zaangażowań, jest przeprowadzany co najmniej raz na kwartał.

§ 4. 1. Instrumentem podstawowym przeprowadzania badania i oceny nadzorczej jest nadzór analityczny.

2. W ramach nadzoru analitycznego Komisja analizuje dane przekazywane przez domy maklerskie oraz dane wynikające z monitoringu ostrożnościowego, w szczególności dotyczące:

- 1) poszczególnych, istotnych rodzajów ryzyka związanego z działalnością danego domu maklerskiego;
- 2) wymogów kapitałowych z tytułu poszczególnych rodzajów ryzyka oraz wymogów kapitałowych z tytułu przekroczenia limitów i naruszenia innych norm określonych przepisami regulującymi działalność domów maklerskich;
- 3) procesu szacowania i utrzymywania kapitału wewnętrznego.

3. Wykonywanie nadzoru o charakterze analitycznym obejmuje również monitorowanie wykonania decyzji, o której mowa w art. 98f ust. 1 ustawy.

4. Badanie i ocena nadzorcza mogą być realizowane także poprzez:

- 1) wizytę nadzorczą, o której mowa w art. 37a ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o nadzorze nad rynkiem kapitałowym (Dz. U. Nr 183, poz. 1537, z późn. zm.⁴⁾);
- 2) kontrolę, o której mowa w art. 26 ust. 1 pkt 1 ustawy wymienionej w pkt 1.

§ 5. 1. Komisja przeprowadza, w oparciu o przeprowadzone badanie, ocenę nadzorczą co najmniej raz na 12 miesięcy.

2. Przy ustalaniu terminu przeprowadzenia badania i oceny nadzorczej Komisja kieruje się w szczególności:

- 1) znaczeniem i wielkością domu maklerskiego;
- 2) wynikami analiz sytuacji ekonomiczno-finansowej;
- 3) wynikami poprzedniego badania i oceny nadzorczej.

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.

⁴⁾ Zmiany wymienionej ustawy zostały ogłoszone w Dz. U. z 2006 r. Nr 157, poz. 1119 i Nr 170, poz. 1217, z 2007 r. Nr 50, poz. 331 oraz z 2009 r. Nr 18, poz. 97 i Nr 165, poz. 1316.

3. W przypadku uzyskania informacji, które w ocenie Komisji mogą mieć wpływ na spełnianie przez dom maklerski wymogów z zakresu adekwatności kapitałowej, Komisja może dokonać uaktualnienia wcześniej przeprowadzonej oceny nadzorczej w terminie nie dłuższym niż 6 miesięcy od dnia uzyskania informacji.

4. Komisja informuje w formie pisemnej lub elektronicznej dom maklerski o wynikach badania i oceny nadzorczej.

§ 6. Pierwszą ocenę nadzorczą Komisja przeprowadza w terminie 18 miesięcy od dnia wejścia w życie niniejszego rozporządzenia.

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

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