



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ
ΕΠΙΤΡΟΠΗ ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ
Ν.Π.Δ.Δ.

Α Π Ο Φ Α Σ Η

6/572/23.12.2010

του Διοικητικού Συμβουλίου

Θέμα: Τροποποίηση της απόφασης 6/459/27.12.2007 (ΦΕΚ Β/2456/31.12.2007) του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς «Κεφαλαιακές απαιτήσεις Επιχειρήσεων Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών έναντι του λειτουργικού κινδύνου»

**ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ ΤΗΣ ΕΠΙΤΡΟΠΗΣ
ΚΕΦΑΛΑΙΑΓΟΡΑΣ**

Λαμβάνοντας υπόψη:

α) την παράγραφο 2 του άρθρου 72 και το άρθρο 81 του Ν. 3601/1.8.2007 «Ανάληψη και άσκηση δραστηριοτήτων από τα πιστωτικά ιδρύματα, επάρκεια ιδίων κεφαλαίων των πιστωτικών ιδρυμάτων και των επιχειρήσεων παροχής επενδυτικών υπηρεσιών και λοιπές διατάξεις» (ΦΕΚ Α/178/1.8.2007),

β) τα άρθρα 102 έως 105 και το Παράρτημα Χ της Οδηγίας 2006/48/ΕΚ σχετικά με την ανάληψη και την άσκηση δραστηριότητας πιστωτικών ιδρυμάτων, όπως τροποποιήθηκε με την Οδηγία 2009/83/ΕΚ (L 196/28.07.2009),

γ) την απόφαση 6/459/27.12.2007 (ΦΕΚ Β/2456/31.12.2007) του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς «Κεφαλαιακές απαιτήσεις Επιχειρήσεων Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών έναντι του λειτουργικού κινδύνου»,

δ) το άρθρο 90 του ΠΔ 63/2005 «Κωδικοποίηση της νομοθεσίας για την Κυβέρνηση και τα κυβερνητικά όργανα» (ΦΕΚ Α/98/2005).

ΑΠΟΦΑΣΙΖΕΙ ΟΜΟΦΩΝΑ

Άρθρο 1

Η παράγραφος 4 του άρθρου 5 της απόφασης 6/459/27.12.2007 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«4. Στην τυποποιημένη μέθοδο, η κεφαλαιακή απαίτηση για λειτουργικό κίνδυνο ισούται με το μέσο όρο σε τριετή βάση των σταθμισμένων έναντι λειτουργικού κινδύνου Σχετικών Δεικτών (δηλαδή των Ακαθάριστων Λειτουργικών Εσόδων), που υπολογίζονται κατ' έτος για όλους τους επιχειρηματικούς τομείς του Πίνακα 1 του Παραρτήματος III της παρούσας απόφασης. Κατ' έτος, μια αρνητική κεφαλαιακή απαίτηση σε έναν επιχειρηματικό τομέα, προκύπτουσα από αρνητικό Σχετικό Δείκτη, μπορεί να καταλογισθεί στο σύνολο. Εάν η αθροισμένη κεφαλαιακή απαίτηση όλων των επιχειρηματικών τομέων εντός ενός δεδομένου έτους είναι αρνητική, τότε κατά τον υπολογισμό του μέσου όρου το σχετικό ποσό για το εν λόγω έτος θα είναι μηδέν.»

Άρθρο 2

Η περίπτωση (3) της παραγράφου (β) του τμήματος Β «Ελάχιστες προϋποθέσεις» του Παραρτήματος III της απόφασης 6/459/27.12.2007 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«(3) Η καταγραφή των γεγονότων λειτουργικού κινδύνου θα είναι συμβατή με τις κατηγορίες γεγονότων του Πίνακα 2 και τους επιχειρηματικούς τομείς του Πίνακα 1 του παρόντος παραρτήματος. Ζημίες που επηρεάζουν ολόκληρη την Επιχείρηση Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών μπορούν, λόγω εκτάκτων περιστάσεων, να καταλογισθούν σε πρόσθετο επιχειρηματικό τομέα με τίτλο «Εταιρικά Στοιχεία.»

Άρθρο 3

Η περίπτωση (β) της παραγράφου 3.2 «Εσωτερικά δεδομένα ζημιών» του Παραρτήματος IV της απόφασης 6/459/27.12.2007 του Διοικητικού Συμβουλίου της Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς αντικαθίσταται ως ακολούθως:

«β. Οι Επιχειρήσεις Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών πρέπει να είναι σε θέση να συσχετίζουν τα ιστορικά δεδομένα των ζημιών από λειτουργικό κίνδυνο με τους επιμέρους επιχειρηματικούς τομείς (Πίνακας 1, Παράρτημα III της παρούσας απόφασης) και με τις κατηγορίες γεγονότων λειτουργικού κινδύνου (Πίνακας 2, Παράρτημα III της παρούσας απόφασης). Τα στοιχεία αυτά θα πρέπει να είναι διαθέσιμα στην Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς όποτε ζητηθούν. Ζημίες που επηρεάζουν ολόκληρη την Επιχείρηση Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών μπορούν να καταλογισθούν, λόγω εκτάκτων περιστάσεων, σε πρόσθετο επιχειρηματικό τομέα με τίτλο «Εταιρικά Στοιχεία.»

Άρθρο 4

Τελικές διατάξεις

1. Η απόφαση αυτή ισχύει από τη δημοσίευση της στην Εφημερίδα της Κυβερνήσεως.

2. Από τις διατάξεις της παρούσας απόφασης δεν προκαλείται δαπάνη σε βάρος του Κρατικού Προϋπολογισμού.

3. Η απόφαση αυτή να δημοσιευθεί στην Εφημερίδα της Κυβερνήσεως (Τεύχος Β').

Ο Γραμματέας

Ο Πρόεδρος

Η Α' Αντιπρόεδρος

Ο Β' Αντιπρόεδρος

Αναστάσιος Θ. Γαβριηλίδης

Μαρίνα Σουγιουλτζή

Ξενοφών Αυλωνίτης

Τα μέλη

