



SFS 2011:753

Utkom från trycket
den 21 juni 2011

Lag om ändring i lagen (2006:1372) om införande av lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar;

utfärdad den 9 juni 2011.

Enligt riksdagens beslut¹ föreskrivs² i fråga om lagen (2006:1372) om införande av lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar dels att 5, 8 och 9 §§ ska ha följande lydelse, dels att det i lagen ska införas två nya paragrafer, 11 och 12 §§, av följande lydelse.

5 § Ett institut som enligt 4 kap. 7 § lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar har tillstånd att tillämpa en internmetod för att beräkna kapitalkravet för kreditrisker eller för motpartsrisker som ingår i marknadsrisker, ska från den 30 juni 2011 till och med det datum som regeringen bestämmer ha en kapitalbas som motsvarar minst 80 procent av kapitalkraven för

1. kreditrisker och marknadsrisker enligt 2 kap. 2, 3 och 5 §§ lagen (1994:2004) om kapitaltäckning och stora exponeringar för kreditinstitut och värdepappersbolag, och

2. exponeringar som överskrider gränsvärdena för stora exponeringar enligt 5 kap. 6 § samma lag.

Ett institut som enligt 6 kap. 6 § lagen om kapitaltäckning och stora exponeringar har tillstånd att tillämpa en internmätningmetod för att beräkna kapitalkravet för operativa risker ska ha en kapitalbas som från den 30 juni 2011 till och med det datum som regeringen bestämmer motsvarar minst 80 procent av summan av kapitalkraven enligt första stycket 1 och 2.

¹ Prop. 2010/11:110, bet. 2010/11:FiU40, rskr. 2010/11:273.

² Jfr Europaparlamentets och rådets direktiv 2006/48/EG av den 14 juni 2006 om rätten att starta och driva verksamhet i kreditinstitut (omarbetning), (EUT L 177, 30.6.2006, s. 1, Celex 32006L0048) samt Europaparlamentets och rådets direktiv 2006/49/EG av den 14 juni 2006 om kapitalkrav för värdepappersföretag och kreditinstitut (omarbetning), (EUT L 177, 30.6.2006, s. 201, Celex 32006L0049), senast ändrade genom Europaparlamentets och rådets direktiv 2010/78/EU av den 24 november 2010 om ändring av direktiven 98/26/EG, 2002/87/EG, 2003/6/EG, 2003/41/EG, 2003/71/EG, 2004/39/EG, 2004/109/EG, 2005/60/EG, 2006/48/EG, 2006/49/EG och 2009/65/EG, vad gäller befogenheterna för Europeiska tillsynsmyndigheten (Europeiska bankmyndigheten), Europeiska tillsynsmyndigheten (Europeiska försäkrings- och tjänstepensionsmyndigheten) och Europeiska tillsynsmyndigheten (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), (EUT L 331, 15.12.2010, s. 120, Celex 32010L0078).

Ett institut som från och med den 1 januari 2010 eller senare efter tillstånd enligt 4 kap. 7 § lagen om kapitaltäckning och stora exponeringar tillämpar en internmetod för att beräkna kapitalkravet för kreditrisker eller för motpartsrisker som ingår i marknadsrisker, får efter tillstånd av Finansinspektionen ha en kapitalbas som motsvarar minst 80 procent av kapitalkravet för kreditrisker enligt 4 kap. 1 § första stycket, 4, 6, och 12–15 §§ samma lag i dess lydelse den 29 juni 2011.

Ett institut som från och med den 1 januari 2010 eller senare har tillstånd enligt 6 kap. 6 § lagen om kapitaltäckning och stora exponeringar att tillämpa en internmätningmetod för att beräkna kapitalkravet för operativa risker, får efter tillstånd av Finansinspektionen ha en kapitalbas som motsvarar minst 80 procent av kapitalkravet för operativa risker enligt 6 kap. 2–5 §§ eller 2 kap. samma lag.

Första–fjärde styckena gäller både när kapitalkravet beräknas för det individuella institutet och för en finansiell företagsgrupp.

Regeringen eller den myndighet som regeringen bestämmer får meddela föreskrifter om hur kapitalbasen ska beräknas enligt denna paragraf.

8 §³ Ett värdepappersbolag som tillhandahåller investeringstjänster eller utför investeringsverksamhet avseende sådana finansiella instrument som anges i 1 kap. 4 § första stycket 5 b–d, f och g lagen (2007:528) om värdepappersmarknaden, får till och med år 2014 efter tillstånd av Finansinspektionen överskrida de gränsvärden som anges i 7 kap. 3 § lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar utan att beräkna något särskilt kapitalkrav enligt 7 kap. 8 § samma lag. Regeringen eller den myndighet som regeringen bestämmer får meddela föreskrifter om vilka villkor som ska vara uppfyllda för tillståndet.

9 §⁴ Till och med år 2014 tillämpas inte bestämmelserna om kapitalkrav som avser värdepappersbolag i lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar för sådana värdepappersbolag vars huvudsakliga verksamhet är att tillhandahålla investeringstjänster eller utföra investeringsverksamhet avseende sådana finansiella instrument som anges i 1 kap. 4 § första stycket 5 b–d, f och g lagen (2007:528) om värdepappersmarknaden.

11 § Till utgången av 2012 ska den tidsperiod som anges i 10 kap. 6 a § lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar vara sex månader.

12 § 7 a kap. lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar ska tillämpas på värdepapperiseringar som emitteras från och med den 30 juni 2011.

7 a kap. samma lag ska från och med den 1 januari 2015 tillämpas på värdepapperiseringar som emitterats före den 30 juni 2011, om nya underliggande exponeringar har tillkommit eller ersatts efter den 31 december 2014.

³ Senaste lydelse 2007:571.

⁴ Senaste lydelse 2007:571.

Denna lag träder i kraft den 30 juni 2011.

På regeringens vägnar

PETER NORMAN

Mats Walberg
(Finansdepartementet)

