ZBIERKA ZÁKONOV
SLOVENSKEJ REPUBLIKY

Ročník 2011

Vyhlásené: 11.10.2011 Vyhlásená verzia v Zbierke zákonov Slovenskej republiky

Obsah tohto dokumentu má informatívny charakter.

317

OZNÁMENIE
Národnej banky Slovenska

Národná banka Slovenska vydala podľa § 99 ods. 2, § 100 ods. 9 a 10, § 102 ods. 7, § 104 ods. 7, § 105 ods. 6 a § 106 ods. 8 zákona č. 203/2011 Z. z. o kolektívnom investovaní (ďalej len „zákon“)

opatrenie z 27. septembra 2011 č. 11/2011 o rizikách a systéme riadenia rizík, meraní rizík a výpočte celkového rizika a rizika protistrany (ďalej len „opatrenie“).

Opatrením sa ustanovujú ďalšie riziká, ktoré sa rozlišujú na účely riadenia rizík podľa zákona, spôsob krytia záväzkov súvisiacich s finančnými derivátmi v majetku v štandardnom podielovom fonde, podrobnosti o systéme riadenia rizík pri správe majetku v štandardnom podielovom fonde podľa § 100 ods. 1 zákona a o funkcii riadenia rizík, dodatočné náležitosti predajného prospektu štandardného podielového fondu a ročnej správy o hospodárení s majetkom v štandardnom podielovom fonde týkajúce sa merania a riadenia rizík v štandardnom podielovom fonde, podrobnosti o vykonávaní spätného testovania podľa § 102 ods. 3 písm. b) zákona a podrobnosti o vykonávaní stresového testovania podľa § 102 ods. 3 písm. c) zákona, kvalitatívne a kvantitatívne požiadavky na stresové testovanie, metódy konverzie pozícií vo finančných derivátoch podľa § 104 ods. 2 zákona pre jednotlivé druhy finančných derivátov, kritériá na určenie finančných derivátov, ktoré nevytvárajú dodatočné zvýšenie úrovne rizika v majetku v štandardnom podielovom fonde podľa § 104 ods. 3 zákona, spôsoby zohľadnenia opatrení na zabezpečenie pred rizikom straty a opatrení na vzájomné započítanie podľa § 104 ods. 4 zákona pri výpočte celkového rizika záväzkovým prístupom, spôsoby zohľadnenia postupov a nástrojov podľa § 104 ods. 6 zákona pri výpočte celkového rizika záväzkovým prístupom, spôsob výpočtu celkového rizika metódou relatívnej hodnoty v riziku, spôsob výpočtu celkového rizika metódou absolútnej hodnoty v riziku, kvantitatívne a kvalitatívne požiadavky pre prístup hodnoty v riziku, maximálny limit, ktorý sa nemôže prekročiť pri používaní metódy absolútnej hodnoty rizika, iné podrobnosti o výpočte celkového rizika prístupom hodnoty v riziku, požiadavky na zábezpeku, prostredníctvom ktorej správcovská spoločnosť môže znížiť riziko protistrany a pravidlá na výpočet limitov podľa § 89 zákona.

Opatrenie nadobúda účinnosť 15. októbra 2011.

Opatrenie je uverejnené v čiastke 22/2011 Vestníka Národnej banky Slovenska a možno doň nazrieť vo všetkých organizačných zložkách Národnej banky Slovenska.

Vydavateľ Zbierky zákonov Slovenskej republiky a prevádzkovateľ právneho a informačného portálu Slov-Lex dostupného na webovom sídle www.slov-lex.sk je Ministerstvo spravodlivosti Slovenskej republiky, Župné námestie 13, 813 11 Bratislava, tel.: 02 571 01 000, e-mail: helpdesk@slov-lex.sk.