

İstanbul, 06 Mayıs 2016

2016/592

GENEL MEKTUP
No: 750

İlgili: Aracı Kurumlar

Bilgi: Bankalar
Portföy Yönetim Şirketleri
Yatırım Ortaklıkları

Konu : SerYet Sisteminde Yapılacak Değişiklikler Hk.

Aracı kurumların haftalık sermaye yeterliliği tablolarının yüklendiği Sermaye Piyasası Kurulu'nun (Kurul) "SerYet" sisteminde yapılan değişikliklere ve söz konusu değişikliklerin uygulanma sürecine ilişkin açıklamalar içeren Kurul'un 05.05.2016 tarih ve 32992422-299-E.5397 sayılı yazısı ve eki duyuru metni Genel Mektubumuz ekinde iletilmektedir.

Gereği için bilgilerinize sunarım.

Saygılarımla,

İlkay ARIKAN
Genel Sekreter

Ek: Kurul'un 05.05.2016 tarih ve 32992422-299-E.5397 sayılı yazısı.





T.C.
BAŞBAKANLIK
Sermaye Piyasası Kurulu
Aracılık Faaliyetleri Dairesi Başkanlığı

Sayı :32992422-299-E.5397

05.05.2016

Konu :SerYet sisteminde yapılacak değişiklikler hk.

TÜRKİYE SERMAYE PİYASALARI BİRLİĞİ
Büyükdere Caddesi No:173 1.Levent Plaza
A Blok Kat:4 34394 Levent/İSTANBUL

Bilindiği üzere, Seri:V, No: 34 sayılı Aracı Kurumların Sermayelerine Ve Sermaye Yeterliliğine İlişkin Esaslar Tebliği (Sermaye Yeterliliği Tebliği), 20.03.2015 tarih ve 29301 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Seri:V, No:135 sayılı "Aracı Kurumların Sermayelerine ve Sermaye Yeterliliğine İlişkin Esaslar Tebliğinde Değişiklik Yapılmasına Dair Tebliğ" ile değiştirilmiş olup, Seri:V, No:135 sayılı Tebliğ ile Sermaye Yeterliliği Tebliği’nin Ek/2 ve Ek/4’te yer alan açıklama kısımlarında değişiklikler yapılmış ve Sermaye Yeterliliği Tebliği’ne “Ek/6 Döviz Kuru Riski Hesaplama Tablosu” eklenmiştir.

Sermaye Yeterliliği Tebliği’nde yapılan söz konusu değişikliklerin aracı kurumların haftalık sermaye yeterliliği tablolarını yüklediği Kurulumuz "SerYet" sistemi ile uyumlu hale getirilmesi için yapılan çalışmalar tamamlanmıştır. SerYet sisteminde yapılan değişikliklere ve söz konusu değişikliklerin uygulanma sürecine ilişkin duyuru metnine Ek’te yer verilmekte olup, duyuru metninin üyelerinize duyurulması hususunda gereğini rica ederim.

e-İmzalıdır
Ali İhsan GÜNGÖR
Daire Başkanı

Ek: SerYet sisteminde yapılacak güncellemeye ilişkin duyuru metni

SER-YET SİSTEMİNDE YAPILAN GÜNCELLEMeye İLİŞKİN DUYURU

Bilindiği üzere, Seri:V, No: 34 sayılı Aracı Kurumların Sermayelerine Ve Sermaye Yeterliliğine İlişkin Esaslar Tebliği (Sermaye Yeterliliği Tebliği), 20.03.2015 tarih ve 29301 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Seri:V, No:135 sayılı "Aracı Kurumların Sermayelerine ve Sermaye Yeterliliğine İlişkin Esaslar Tebliğinde Değişiklik Yapılmasına Dair Tebliğ" ile değiştirilmiş olup, Seri:V No:135 sayılı Tebliğ ile Sermaye Yeterliliği Tebliği’nin Ek/2 ile Ek/4’te yer alan açıklama kısımlarında değişiklikler yapılmış ve Sermaye Yeterliliği Tebliği’ne “Ek/6 Döviz Kuru Riski Hesaplama Tablosu” eklenmiştir.

Sermaye yeterliliği tabanı olarak hesaplanan tutarın (*likit kabul edilen varlıkların*) Tebliğ’in 7’nci maddesinde belirlenmiş 2,10 ve 25 milyon TL’lik özsermaye rakamlarının %60’ından düşük olamayacağı yeni bir hüküm olarak eklenerek; asgari bir likidite düzeyi öngörülmüştür. Ayrıca, aracı kurumlar tarafından gerçekleştirilecek tezgahüstü türev araç işlemleri ile özellikle kaldıraçlı alım satım işlemlerine ilişkin döviz kuru riskinin takibinin etkin yapılabilmesini teminen; haftalık sermaye yeterliliği tablosu hazırlanırken söz konusu tablonun ekinde yer alan Döviz Kuru Riski Hesaplama Tablosunun da hazırlanması gerekmektedir.

Sermaye Yeterliliği Tebliği’nin söz konusu hükümlerine uyum sağlanması için aracı kurumların haftalık sermaye yeterliliği tablolarını yüklediği “SerYet” sistemi güncellenmiş olup, Ek/2 tablosundaki değişiklikler ile Ek/6 tablosu sisteme eklenmiştir. Güncellenmiş tabloların aracı kurumlar tarafından kullanılmasına 15.05.2016 tablo dönemi itibariyle başlanması gerekmekte olup, veri girişinin nasıl yapılacağına ilişkin talimatlara “SerYet” sistemi içinde yer verilecektir.

Konuya ilişkin ortaya çıkabilecek tüm teknik sorunlar için spkseryet@spk.gov.tr adresine elektronik posta gönderebilirsiniz.