



ΠΡΟΣ : Κυπριακές Επιχειρήσεις Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών
ΑΠΟ : Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς
ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ : 22 Μαΐου 2008
ΑΡ. ΕΓΚΥΚΛΙΟΥ : ΕΓ144-2008-10
ΑΡ. ΦΑΚΕΛΟΥ : Ε.Κ. 6.1.14
ΘΕΜΑ : Δημοσιοποίηση των εντύπων για τον υπολογισμό της κεφαλαιακής επάρκειας των ΕΠΕΥ

Η Επιτροπή Κεφαλαιαγοράς (‘η Επιτροπή’) επιθυμεί με την παρούσα εγκύκλιο να ενημερώσει τις Κυπριακές Επιχειρήσεις Παροχής Επενδυτικών Υπηρεσιών (‘οι ΚΕΠΕΥ’) για τα ακόλουθα:

1. Τα Έντυπα της παραγράφου 39(2), Υπό - Κεφάλαιο Β, Κεφάλαιο 7 του Μέρους Γ της Οδηγίας ΟΔ144-2007-05 της Επιτροπής αναφορικά με την κεφαλαιακή επάρκεια των ΕΠΕΥ (η ‘Οδηγία’), έχουν αναρτηθεί στο διαδικτυακό τόπο της Επιτροπής (http://www.cysec.gov.cy/licence_members_5_gr.aspx) και φέρουν αριθμό ‘Έντυπο 144-05-06’. Στο παρόν στάδιο τα Έντυπα είναι διαθέσιμα μόνο στην Αγγλική γλώσσα.
2. Για ευκολία κατανόησης των Εντύπων, η Επιτροπή έχει επίσης αναρτήσει, στο διαδικτυακό της τόπο, επεξηγηματικό κείμενο για το περιεχόμενο των Εντύπων.
3. Το ‘Έντυπο 144-05-06’ υποδιαιρείται σε υπό-Έντυπα (Form.144-05-06.1, Form.144-05-06.2, Form.144-05-06.3) τα οποία συμπληρώνονται κατά περίπτωση και ανάλογα με τη μέθοδο που η ΚΕΠΕΥ επιλέγει να χρησιμοποιεί για τον υπολογισμό των απαιτούμενων της κεφαλαίων.

Για παράδειγμα, εάν μια ΕΠΕΥ επιλέξει να χρησιμοποιεί τη θεμελιώδη μέθοδο (standardized approach) για τον υπολογισμό του πιστωτικού κινδύνου και του κινδύνου αγοράς και οποιαδήποτε μέθοδο για τον υπολογισμό του λειτουργικού κινδύνου τότε οφείλει να συμπληρώνει και να αποστέλλει στην Επιτροπή μόνο το υπό-Έντυπο 144-05-06.1 (Form.144-05-06.1.TSA (CR&MRK) & All methods (OPR)).

Τα υπό-Έντυπα 144-05-06.4 μέχρι 144-05-06.10 είναι υποστηρικτικά των υπό-Εντύπων 144-05-06.1 μέχρι 144-05-06.3. Για παράδειγμα το υπό-Έντυπο 144-05-06.7 (Form.144-05-06.7.Credit Risk References_Standardised Approach) περιέχει

πληροφορίες βοηθητικές για τη συμπλήρωση του υπό-Εντύπου 144-05-06.1 για ότι αφορά τον πιστωτικό κίνδυνο.

4. Η συχνότητα υποβολής των Εντύπων καθορίζεται στην παράγραφο 39, Υπό - Κεφάλαιο Β, Κεφάλαιο 7 του Μέρους Γ της Οδηγίας. Η ημερομηνία έναρξης υποβολής των Εντύπων θα ανακοινωθεί σε μεταγενέστερο στάδιο.
5. Τα Έντυπα υποβάλλονται στην Επιτροπή στην πρωτότυπη τους μορφή, καθώς επίσης και σε ηλεκτρονική μορφή στην ηλεκτρονική διεύθυνση investmentfirms@cysec.gov.cy.

Με εκτίμηση

Γιώργος Χαραλάμπους
Πρόεδρος Επιτροπής Κεφαλαιαγοράς

9 -10 June, 2008