

Genel Mektup : 1399

İstanbul, 16/01/2018

TEMİNAT İZLEME ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu Bankaların Merkezi Karşı Taraflar ile yaptıkları nitelikli işlemlere ilişkin riskler için sermaye yükümlülüğü hesaplamasında kullanacakları değerler hk.

İlgili Aracı Kurumlar, Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Malumları olduğu üzere 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8'nci Maddesi ile 'Merkezi Takas Kuruluşu' statüsü kazanan Bankamız, Sermaye Piyasası Kurulu tarafından 6362 Sayılı Kanun'un 78'nci Maddesi çerçevesinde, Takasbank Ödünç Pay Piyasası (ÖPP) ile Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda (VİOP) merkezi karşı taraf hizmeti verme hususunda yetkilendirilmiştir. Ayrıca Takasbank, Borsa İstanbul Para Piyasası'nda da merkezi karşı taraf (MKT) hizmeti vermektedir. Bu kapsamda kurumumuz ÖPP'de, VİOP'da ve BİST Para Piyasası'nda eşleşen emirlere ilişkin yükümlülüklerin yerine getirilmesini MKT sıfatıyla taahhüt etmektedir.

Diğer taraftan Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu'nca, 23 Ekim 2015 tarihli Resmi Gazete'de yayımlanarak 31 Mart 2016 tarihinde yürürlüğe giren Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmeliğin 4 No.lu Ekinde merkezi karşı taraflardan kaynaklanan riskler için sermaye yükümlülüğünün hesaplanması ve hesaplamada kullanılacak veriler, bunların bildirim usulleri ile merkezi karşı taraflarla yapılan işlemlerin nitelikli olarak değerlendirilebilmesi için gerekli olan kriterler açıklanmış bulunmaktadır.

Türkiye'de MKT hizmetleri ile ilgili yürürlüğe sokulan mevzuat ve kurallar ile Takasbank tarafından sunulan MKT hizmetlerinin CPMI-IOSCO Finansal Altyapı Kuruluşları İçin Temel Prensiplere (PFMI) uyumu Sermaye Piyasası Kurulu'nca (Kurul) değerlendirilmiş ve Kurul Karar Organı'nın 23.03.2016 tarihli toplantısında Takasbank'ın 'nitelikli MKT' koşullarını taşıdığı kanaatine ulaşılmış ve Kurul'un değerlendirmesi aynı gün kamuya açıklanmıştır. Sermaye Piyasası Kurulu'nun Bankamızı muhatap 28.03.2016 tarihli yazısında, Takasbank'ın BIS (Bank for International Settlements)'in Basel 3 düzenlemeleri çerçevesinde 'nitelikli MKT' olarak değerlendirilmesi sebebiyle, Türkiye'de bankaların Takasbank ile yaptıkları işlemlerin Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu mevzuatı (4 No.lu Ek) çerçevesinde 'nitelikli işlem' olarak değerlendirilebileceği hususundaki kanaatlerinin 25.03.2016 tarih ve 3558 sayılı yazıları ile Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumuna iletildiği bildirilmiştir.

Bu çerçevede, Türkiye'de kurulu Bankaların, Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası, Takasbank Ödünç Pay Piyasası ile Borsa İstanbul Para Piyasasında yaptıkları nitelikli işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/envision-external/belgedogrulama.aspx?V=BE6PSRSS>

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +09 212 315 25 25 F +90 212 315 25 26 www.takasbank.com.tr Kep Adresi : takasbank.haberlesme@hs03.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmeliğin 4 No.lu Eki çerçevesinde belirlediğimiz veriler, EK 1, Ek 2 ve Ek 3'teki tablolarda sunulmaktadır. Ekte sunduğumuz veriler BIS Basel 3 düzenlemeleri ile de uyumlu olup, gerektiği takdirde, yurtdışında kurulu bankalarca kurulu bulundukları ülkelerin denetim otoritelerinin diğer ülke denetim otoritelerinin 'Nitelikli MKT' duyurularını doğrudan kabul etmeleri halinde solo veya konsolide sermaye yükümlülüğü hesaplamalarında kullanılabilecektir.

Hesaplamalar, 29.12.2017 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olağanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın Mart ayının son iş günü itibariyle yapılması planlanmaktadır.

Bilgi edinilmesini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (VİOP,ÖPP,BİAŞ PP) (2 sayfa)

1. Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	57,425,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	157,833,502 TL
TF^* , Ortalama 2 üye kuruluşun temerrüdü varsayımı altında, temerrüde düşmemiş üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu katkı payları + MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermaye tutarı	210,748,973 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	2,254,764 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	70
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	245,318 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.5484
$C \text{ çarpanı}$, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.243%

2. Takasbank Ödünç Pay Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Veriler

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	2,824,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	3,073,000 TL
TF^* , Ortalama 2 üye kuruluşun temerrüdü varsayımı altında, temerrüde düşmemiş üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu katkı payları + MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermaye tutarı	5,781,038 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	57,981 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	53
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0 TL
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	4,731 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.3108
$C \text{ çarpanı}$, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.204 %

3. Borsa İstanbul Para Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	957,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	5,590,000 TL
TF^* , Ortalama 2 üye kuruluşun temerrüdü varsayımı altında, temerrüde düşmemiş üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu katkı payları + MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermaye tutarı	6,197,625 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	174,688 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	32
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0 TL
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıştırılma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	8,385 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.8955
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.293% %