

Genel Mektup :1589

İstanbul, 15/10/2019

MERKEZİ KARŞI TARAF BÖLÜMÜ

Konu : Bankaların Merkezi Karşı Taraflar ile yaptıkları nitelikli işlemlere ilişkin riskler için sermaye yükümlülüğü hesaplamasında kullanacakları değerler hk.
İlgili : 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, Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası (VİOP), Takasbank Ödünç Pay Piyasası (ÖPP), Borsa İstanbul Para Piyasası (BİAŞ PP), Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası (BAP) ve Borsa İstanbul SWAP Piyasası'nda (SWAP) merkezi karşı taraf hizmeti verme hususunda yetkilendirilmiştir. Bu kapsamda, kurumumuz VİOP, ÖPP, BİAŞ PP, BAP ve SWAP'ta 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, VİOP, ÖPP, BİAŞ PP, BAP ve SWAP Piyasası'nda yaptıkları nitelikli işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmeliğin 4 No.lu Eki çerçevesinde belirlediğimiz veriler, Ek'te sunulmaktadır. Ek'te sunduğumuz veriler BIS Basel 3 düzenlemeleri ile de uyumlu olup, gerektiği takdirde, yurtdışında kurulu bankalarca kurulu buldukları ülkelerin

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE5D3HUMD>

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@hs01.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



denetim otoritelerinin dięer lke denetim otoritelerinin 'Nitelikli MKT' duyurularını doęrudan kabul etmeleri halinde solo veya konsolide sermaye ykmllę hesaplamalarında kullanılabilecektir.

Hesaplamalar, 30.09.2019 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmıř olup, olaęanst bir geliřme yařanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2019 yılı Aralık ayının son iř gn itibariyle yapılması planlanmaktadır.

Bilgi edinilmesini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.ř.

SERKAN AřKAR
GENEL MDR YRD.

GKHAN ELİBOL
GENEL MDR VEKİLİ
YNETİM KURULU YESİ

Ek : VIOP, PP, BİAř Para Piyasası, BİAř Borlanma Araları Piyasası ve BİAř Swap Piyasası'na iliřkin MKT Sermaye Ykmllę Verileri (3 sayfa)

VIOP, ÖPP, BİAŞ Para Piyasası, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası ve BİAŞ SWAP Piyasası'na ilişkin MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30/09/2019)

a) Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	57,264,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	231,611,651 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	282,063,544 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	3,406,054 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	68
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	359,679 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.4514
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.228%

b) Takasbank Ödünç Pay Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Veriler

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	1,789,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	7,654,390 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	9,143,218 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	150,086 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	51
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	11,767 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.5566
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.243%

c) Borsa İstanbul Para Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	805,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	19,445,550 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	19,035,203 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	607,673 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	32
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	29,168 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.6698
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.257%

d) Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası Repo İşlemleri Kaynaklı MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	68,001,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	1,569,638,293 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	1,600,266,953 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	18,686,170 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	84
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	2, 451,626
β , Yoğunlaşma faktörü	0.7141
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.270%

e) Borsa İstanbul SWAP Piyasası İşlemleri Kaynaklı MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	38,564,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	1,232,903,294 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	1,194,410,838 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	38,528,227 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	32
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	1,849,355 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.7595
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.272%