

Genel Mektup : 1625

İstanbul, 14/04/2020

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Bankaların Merkezi Karşı Taraflar ile yaptıkları nitelikli işlemlere ilişkin riskler için sermaye yükümlülüğü hesaplamasında kullanacakları değerler hk.
İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Malumları olduğu üzere 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8'nci Maddesi ile Bankamız, merkezi karşı taraf hizmeti verme hususunda yetkilendirilmiştir.

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 İşlem ve Opsiyon Piyasası, Takasbank Ödünç Pay Piyasası, Borsa İstanbul Para Piyasası, Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası, Borsa İstanbul SWAP Piyasası'nda ve merkezi takasa konu Tezgaüstü Türev Ürünlerde 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 denetim otoritelerinin diğer ülke denetim otoritelerinin 'Nitelikli MKT' duyurularını doğrudan kabul etmeleri halinde solo veya konsolide sermaye yükümlülüğü hesaplamalarında kullanılabilir.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEKR3VEAD> Pin Kodu :

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



Hesaplamalar, 31.03.2020 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olađanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2020 yılının Haziran ayının son iş günü itibarıyla yapılması planlanmaktadır.

Bilgi edinilmesini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Serkan AŞKAR
GENEL MÜDÜR YRD.

Gökhan ELİBOL
GENEL MÜDÜR VEKİLİ
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek : VIOP, ÖPP, BİAŞ Para Piyasası, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası, Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası ve BİAŞ SWAP Piyasası'na ilişkin MKT Sermaye Y... (1 sayfa)

Sermaye Yükümlülüğü Verileri (31.03.2020)	BİAŞ Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası	Takasbank Ödünç Pay Piyasası	BİAŞ Para Piyasası	BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası-Repo İşlemleri	SWAP Piyasası	Tezgahestü Türev İşlemler
TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	57,264,000 TL	1,789,000 TL	805,000 TL	68,001,000 TL	38,546,000 TL	15,500,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	55,226,412 TL	10,409,175 TL	12,357,830 TL	1,462,296,676 TL	1,360,096,781 TL	35,607,459 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	110,841,862 TL	11,797,822 TL	12,390,466 TL	1,495,890,695 TL	1,318,655,088 TL	47,359,306 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	824,275 TL	200,176 TL	386,182 TL	17,203,490 TL	40,002,846.49 TL	1,874,077 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	67	52	32	85	34	19
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0	0	0	3,740 TL	0	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	85,725 TL	16,014 TL	18,537 TL	2,284,624 TL	2,048,146 TL	50,975 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.4230	1.000	0.9993	0.6096	0.4386	0.4810
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.223%	0.314%	0.310%	0.254%	0.221%	0.220%