

Genel Mektup : 1640

İstanbul, 21/07/2020

**TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ**

Konu : Bankaların Merkezi Karşı Taraflar ile Yaptıkları Nitelikli İşlemlere İlişkin Riskler İçin Sermaye Yükümlülüğü Hesaplamasında Kullanacakları Değerler Hk.  
İlgili : Bankalar  
Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Malumları olduğu üzere 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8 inci maddesi ile Takasbank Merkezi Karşı Taraf (MKT) 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 Ek'inde 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 açıklanmıştır.

Türkiye'de merkezi karşı taraf hizmetleri ile ilgili yürürlüğe sokulan mevzuat ve kurallar ile Takasbank tarafından sunulan MKT hizmetlerinin CPMI-IOSCO Finansal Altyapı Kuruluşları İçin Temel Prensipler'e (PFMI) uyumu Sermaye Piyasası Kurulu'nca (Kurul) değerlendirilmiş ve Takasbank'ın 'nitelikli MKT' koşullarını taşıdığına ilişkin görüş 23.03.2016 tarihi itibarıyla kamuya açıklanmıştır. Kurul'un Takasbank'ı muhatap 28.03.2016 tarihli yazısında; Takasbank'ın BIS (Bank for International Settlements) 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 görüşlerinin 25.03.2016 tarih ve 3558 sayılı yazıları ile Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu'na 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 tezgah üstü türev ürünlerde yaptıkları işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmelik çerçevesinde belirlediğimiz veriler, Ek'te sunulmaktadır. Bahse konu 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 da kullanılabilir.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE8V3Y4C1> 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, 30.06.2020 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olađanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2020 yılının Eylül 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 : Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Verilen Piyasalara İlişkin Sermaye Yükümlülüğü Verileri  
(1 sayfa)

Sermaye Yüklümlülüğü Verileri (30.06.2020)	BİAŞ Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası	Takasbank Ödünç Pay Piyasası	BİAŞ Para Piyasası	BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası-Repo İşlemleri	SWAP Piyasası	Tezgahestü Türev İşlemler Piyasası
$TF_{MKT}$ , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	29,392,000 TL	1,789,000 TL	805,000 TL	71,989,000 TL	38,564,000 TL	1,607,000 TL
$TF_{ÜK}$ , Toplam garanti fonu tutarı	67,081,896 TL	6,085,698 TL	13,077,493 TL	1,333,352,143 TL	1,411,016,450 TL	41,222,169 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	94,441,111 TL	7,640,632 TL	13,065,150 TL	1,373,968,152 TL	1,368,950,939 TL	38,706,952 TL
$TF_i$ , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	1,016,392 TL	117,033 TL	408,672 TL	15,686,496 TL	40,314,756 TL	2,061,108 TL
$N$ , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	66	52	32	85	35	20
$S_{MKT}$ , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0	0	0	0	0	0
$S_{ÜK}$ , Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	104,079 TL	9,363 TL	19,616 TL	2,083,167 TL	2,128,619 TL	59,360 TL
$\beta$ , Yoğunlaşma faktörü	0.4271	1.000	0.9844	0.4993	0.8649	0.3516
$C$ çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.223%	0.314%	0.308%	0.236%	0.289%	0.200%