

Genel Mektup : 1650

İstanbul, 22/10/2020

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 (BDDK), 23.10.2015 tarihli Resmi Gazete'de yayımlanarak 31.03.2016 tarihinde yürürlüğe giren Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmelik'in (Yönetmelik) 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 MKT 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 mevzuatı (4 No.lu Ek) çerçevesinde 'nitelikli işlem' olarak değerlendirilebileceği hususundaki görüşlerinin, 25.03.2016 tarih ve 3558 sayılı yazıları ile BDDK'ya 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, 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 kullanılacaktır.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BENF45KSN> 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, 30.09.2020 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olađanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2020 yılının Aralık 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)

VIOP, ÖPP, BİAŞ Para Piyasası, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası, BİAŞ SWAP Piyasası ve Merkezi Takasa Konu Tezgahestü Türev İşlemlere İlişkin MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30/09/2020)

Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30.09.2020)	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	867,000 TL	10,000 TL	71,989,000 TL	91,187,000 TL	1,607,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	105,303,924 TL	10,542,786 TL	12,193,493 TL	1,369,853,488 TL	1,320,046,253 TL	40,428,969 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	131,552,523 TL	11,004,294 TL	11,441,150 TL	1,409,985,430 TL	1,335,802,039 TL	37,993,072 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	1,571,700 TL	202,745 TL	381,040 TL	15,928,528 TL	37,715,607 TL	2,021,448 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	67	52	32	86	35	20
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0	0	0	0	0	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıtılabilir ve yoğunlaşma düzeltilmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	163,457 TL	16,220 TL	18,290 TL	2,140,794 TL	1,991,384 TL	58,218 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.2695	0.4314	0.9935	0.8673	0.6616	0.4451
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.198%	0.223%	0.309%	0.295%	0.257%	0.215%