

Genel Mektup : 1729

İstanbul, 12/10/2021

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 kullanılabilir.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSUBDAKS54> 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, 30.09.2021 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olađanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2021 yılının Aralık ayının son iş günü itibarıyla yapılması planlanmaktadır.

Bilgi edinilmesini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Verilen Piyasalara İlişkin Sermaye Yükümlülüđü 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 (30/09/2021)

Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30.09.2021)	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	25,900,000 TL	1,164,000 TL	457,000 TL	79,020,000 TL	111,560,000 TL	2,779,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	154,461,856 TL	18,836,087 TL	7,395,709 TL	1,337,834,596 TL	1,555,195,652 TL	44,350,273 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	175,818,860 TL	19,289,291 TL	7,404,484 TL	1,386,449,265 TL	1,590,892,450 TL	42,905,437 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	2,271,498 TL	355,397 TL	224,112 TL	15,202,665 TL	37,931,601 TL	2,111,917 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	68	53	33	88	41	21
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	239,870 TL	29,000 TL	11,116 TL	2,091,887 TL	2,366,932 TL	64,202 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.5578	0.3328	0.9974	0.4187	0.8285	0.5148
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.245%	0.207%	0.310%	0.223%	0.285%	0.227%