

Genel Mektup : 1824

İstanbul, 18/10/2022

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,

Takasbank, 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8 inci maddesi ile Merkezi Karşı Taraf (MKT) hizmeti verme hususunda yetkilendirilmiştir. Ayrıca, Türkiye'de MKT hizmetlerine yönelik yürürlükte olan 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 ise 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 (EK-4) çerçevesinde 'nitelikli işlem' olarak değerlendirilebileceği hususundaki görüşlerinin, 25.03.2016 tarih ve 3558 sayılı yazıları ile BDDK'ya iletildiği bildirilmiştir.

Diğer taraftan, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu (BDDK), bankaların merkezi karşı taraflardan kaynaklanan riskleri için sermaye yükümlülüğünün hesaplanması ve hesaplamada kullanılacak veriler, bunların bildirim usulleri ile merkezi karşı taraflarla yapılan işlemlerin nitelikli olarak değerlendirilebilmesi için gerekli olan kriterleri 23.10.2015 tarihli ve 29511 sayılı Resmi Gazete duyurusu ile açıklamıştı. Bahsi geçen düzenleme olan Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmelik (Yönetmelik) 04.02.2022 tarihli ve 31740 sayılı Resmi Gazete'de açıklandığı üzere 01.07.2022 tarihinde yürürlüğe girecek şekilde tadil edilmişti.

Bu doğrultuda Takasbank, üçer aylık dönemlerde açıklamakta olduğu verileri 2022 yılı üçüncü çeyrek itibarıyla revize edilen nihai düzenleme çerçevesinde hesaplayacak ve Yönetmelik'in EK-4 bölümünde belirtilen bildirim usullerine uygun olarak açıklayacaktır.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSL547TT90> 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



Türkiye'de kurulu Bankaların kapsam dahilindeki piyasalarda yaptıkları işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin belirlenen veriler Ek'te yer almaktadır. Bahse konu veriler uluslararası düzenlemeler 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.

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 Yükümlülüğü Verileri (1 Sayfa)

VIOP, ÖPP, BİAŞ Para Piyasası, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası, BİAŞ SWAP Piyasası ve Merkezi Takasa Konu Tezgahüstü Türev İşlemlere İlişkin MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30/09/2022)

Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30.09.2022)	BİAŞ Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası	Takasbank Ödünç Pay Piyasası	BİAŞ Para Piyasası	BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası Repo İşlemleri	BİAŞ SWAP Piyasası	Tezgahüstü Türev İşlemler Piyasası
<i>TF_{MKT}</i> , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	52,126,000	3,252,100	586,600	103,382,700	169,109,800	3,702,600
<i>TF_{ÜK}</i> , Toplam garanti fonu tutarı	1,058,188,267	22,954,000	1,650,000	127,107,591	397,035,610	10,500,000
<i>S_{MKT}</i> , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	4,279,735	0	0	129,377	791,859	20,182