Genel Mektup : 2175 İstanbul, 15/10/2026

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 ve 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 hesaplamaya ve Yönetmelik'in EK-4 bölümünde belirtilen bildirim usullerine uygun olarak açıklamaya başlamıştır.

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.
Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul
T +90 212 315 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 bulundukları ülkelerin denetim otoritelerinin diğer ülke denetim otoritelerinin 'Nitelikli MKT' duyurularını doğrudan kabul etmeleri halinde solo veya konsolide sermaye yükümlülüğü hesaplamalarında da kullanılabilecektir.

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

Halka Açık (Tasnif Dışı)

VİOP, ÖPP, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası, BİAŞ SWAP Piyasası ve Merkezi Takasa Konu Tezgahüstü Türev İşlemlere İlişkin MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (30/09/2026)

Sermaye Yükümlülüğü Verileri-TL (30/09/2026)	**BİAŞ Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası**	**Takasbank Ödünç Pay Piyasası**	**BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası Repo İşlemleri**	**BİAŞ SWAP Piyasası**	**Tezgahüstü Türev İşlemler Piyasası**
TF_{MKT}, MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	807,366,200	6,043,900	772,713,900	97,772,300	4,639,000
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	6,026,501,210	140,355,000	2,546,642,718	1,147,981,830	27,265,087
$S_{MKT,}$ MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	20,336,967	0	0	7,319,995	900,457

Halka Açık (Tasnif Dışı)