

Genel Mektup :1609

İstanbul,16/01/2020

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Bankaların Merkezi Karşı Taraflar ile yaptıkları nitelikli işlemlere ilişkin riskler için sermaye yükümlülüğü hesaplamasında kullanacakları değerler hk.
İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Malumları olduğu üzere 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8'nci Maddesi ile Bankamız, merkezi karşı taraf 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 Ekinde 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 açıklanmış bulunmaktadır.

Türkiye'de MKT hizmetleri ile ilgili yürürlüğe sokulan mevzuat ve kurallar ile Takasbank tarafından sunulan MKT hizmetlerinin CPMI-IOSCO Finansal Altyapı Kuruluşları İçin Temel Prensiplere (PFMI) uyumu Sermaye Piyasası Kurulu'nca (Kurul) değerlendirilmiş ve Kurul Karar Organı'nın 23.03.2016 tarihli toplantısında Takasbank'ın 'nitelikli MKT' koşullarını taşıdığı kanaatine ulaşılmış ve Kurul'un değerlendirmesi aynı gün kamuya açıklanmıştır. Sermaye Piyasası Kurulu'nun Bankamızı muhatap 28.03.2016 tarihli yazısında, Takasbank'ın BIS (Bank for International Settlements)'in 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 kanaatlerinin 25.03.2016 tarih ve 3558 sayılı yazıları ile Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumuna 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 Tezgaüstü Türev Ürünlerde yaptıkları nitelikli işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmeliğin 4 No.lu Eki çerçevesinde belirlediğimiz veriler, Ek'te sunulmaktadır. Ek'te sunduğumuz 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 kullanılabilir.

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEKR3PR4L> 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, 31.12.2019 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olađanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın 2020 yılının Mart 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 : Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası, Takasbank Ödünç Pay Piyasası, Borsa İstanbul Para Piyasası, Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piya... (3 sayfa)

VIOP, ÖPP, BİAŞ Para Piyasası, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası ve BİAŞ SWAP Piyasası'na ilişkin MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri (31/12/2019)

a) Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	57,264,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	40,403,493 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	96,461,419 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	603,037 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	67
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	62,716 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.3991
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.219%

b) Takasbank Ödünç Pay Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Veriler

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	1,789,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	8,057,576 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	9,536,669 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	154,953 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	52
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	12,396 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.4749
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.230%

c) Borsa İstanbul Para Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	805,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	12,279,799 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	12,317,312 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	383,743 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	32
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	18,420 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.834
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.283%

d) Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası Repo İşlemleri Kaynaklı MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	68,001,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	1,588,453,088 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	1,619,078,721 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	18,687,683 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	85
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	2,481,724 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.6585
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.262%

e) Borsa İstanbul SWAP Piyasası İşlemleri Kaynaklı MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	38,564,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	1,316,422,407 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	1,277,549,795 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	38,718,306 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	34
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	1,982,377 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.8444
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.286%

f) Merkezi Takasa Konu Tezgahüstü Türev İşlemlerden Kaynaklanan MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri

TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	15,500,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	36,952,934 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	47,525,876 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	2,463,529 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	15
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	51,241 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.7637
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.261%