

İstanbul, 27/01/2017

Genel Mektup: 1334
Merkezi Karşı Taraf Bölümü

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

Sayın Genel Müdür,

Malumları olduğu üzere 6362 sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun Geçici 8'nci Maddesi ile 'Merkezi Takas Kuruluşu' statüsü kazanan Bankamız, Sermaye Piyasası Kurulu tarafından 6362 Sayılı Kanun'un 78'nci Maddesi çerçevesinde, Takasbank Ödünç Pay Piyasası (ÖPP) ile Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda (VİOP) merkezi karşı taraf hizmeti verme hususunda da yetkilendirilmiştir. Bankamız ÖPP'de 2 Eylül 2013, VİOP'da ise 3 Mart 2014 tarihinden bu yana piyasalarda eşleşen emirlere ilişkin yükümlülüklerin yerine getirilmesini merkezi karşı taraf (MKT) sıfatıyla taahhüt etmektedir.

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 kapsamda, Türkiye'de kurulu Bankaların, Takasbank Ödünç Pay Piyasası ile Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasasında yaptıkları nitelikli işlemler dolayısıyla maruz kaldıkları risklere ilişkin Bankaların Sermaye Yeterliliğinin Ölçülmesine ve Değerlendirilmesine İlişkin Yönetmeliğin 4 No.lu Eki çerçevesinde belirlediğimiz veriler, EK 1 ve Ek 2'deki tablolarda sunulmaktadır. Ekte 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.

1

Hesaplamalar, 30.12.2016 tarihli piyasa verileri dikkate alınarak yapılmış olup, olağanüstü bir gelişme yaşanmaması halinde, bir sonraki hesaplamanın Mart ayının son iş günü itibariyle yapılması planlanmaktadır.

Bilgi edinilmesini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.



N. Burak AKAN
Müdür



Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

EK 1:

Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri*	
TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	49,353,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	173,479,000 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	218,079,151 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	2,376,425 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	73
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltilmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	269,962 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.3522
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.212%

* 30/12/2016 tarihli veriler esas alınarak hesaplanmıştır. Bir sonraki hesaplamanın 31/03/2017 tarihli veriler ile yapılması planlanmaktadır.

EK:2

Takasbank Ödünç Pay Piyasası MKT Sermaye Yükümlülüğü Verileri*	
TF_{MKT} , MKT'nin karşılanmış riskler için tahsis edilen sermayesi	2,115,000 TL
$TF_{ÜK}$, Toplam garanti fonu tutarı	2,128,000 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	4,167,000 TL
TF_i , üye kuruluşların fonlanmış garanti fonu tutarlarının ortalaması	38,000 TL
N , Piyasadaki üye kuruluş sayısı	56
S_{MKT} , MKT'nin hipotetik sermaye yükümlülüğü	0 TL
$S_{ÜK}$, Tüm üye kuruluşlar için, garanti fonu ayrıntılandırma ve yoğunlaşma düzeltilmesi öncesi toplam sermaye yükümlülüğü	3,283 TL
β , Yoğunlaşma faktörü	0.5290
C çarpanı, Üye kuruluşun sermaye yükümlülüğünü hesaplamada kullanılacak risk ağırlığı	0.239%

*30/12/2016 tarihli veriler esas alınarak hesaplanmıştır. Bir sonraki hesaplamanın 31/03/2017 tarihli veriler ile yapılması planlanmaktadır.