



**18/12/2019**

Bankaların, konsolidasyona tabi yurtdışındaki kredi kuruluşu ve finansal kuruluş niteliğini haiz ortaklıklarıyla gerçekleştirdiği işlemler hariç, yurtdışı yerleşiklerle yaptıkları bir bacağı döviz diğer bacağı TL olan ve **vadesine yedi gün veya daha kısa süre kalan, vadede TL satım** yönündeki para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlem tutarları toplamı, en son hesapladıkları yasal özkaynaklarının %10'unu geçmeyecek olup söz konusu oran günlük olarak solo ve konsolide bazda hesaplanacaktır. Opsiyon işlemleri hesaplamada delta eşdeğeri ile dikkate alınacak olup valör tarihi işlem tarihinden sonra olan (ileri valörlü) türev işlemler, hesaplamada valör tarihi itibarıyla dikkate alınacaktır. Bu minvalde, mevcut aşım giderilinceye kadar aşım bulunan vade aralığında işlem yapılmayacaktır.

Öte yandan, 17.09.2018 tarihinde yapılan basın açıklamamızda yer verilen, bankaların yurtdışı yerleşiklerle yaptıkları bir bacağı döviz diğer bacağı TL olan ve **vadede TL alım** yönünde gerçekleştirecekleri para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlerin toplamının bankaların en son hesapladıkları yasal özkaynaklarının %25'i ile sınırlandırılması uygulamamızda herhangi bir değişiklik söz konusu olmayıp aynen devam etmektedir.

Kamuoyuna saygı ile duyurulur.