



25/09/2020

Bilindiği üzere, 12/04/2020 tarihli basın açıklamamızda, 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

- Vadede TL alım yönünde gerçekleştirecekleri para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlere ilişkin olarak; söz konusu işlem tutarları toplamının, bankaların en son hesapladıkları yasal özkaynaklarına oranının %1 olarak;
- Vadede TL satım yönünde gerçekleştirecekleri para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlere ilişkin olarak; her bir takvim günü için sağlanması gereken ve söz konusu işlem tutarları toplamının, bankaların en son hesaplanan yasal özkaynaklarına oranının
 - Vadesine 7 gün kalan işlemler için %1 olarak,
 - Vadesine 30 gün kalan işlemler için %2 olarak,
 - Vadesine 1 yıl kalan işlemler için %10 olarak

belirlendiği ve söz konusu oranların günlük olarak solo ve konsolide bazda hesaplanacağı, opsiyon işlemlerinin hesaplamada delta eşdeğeri ile dikkate alınacağı, valör tarihi işlem tarihinden sonra olan (ileri valörlü) türev işlemlerin, hesaplamada valör tarihi itibarıyla dikkate alınacağı, mevcut aşımın giderilinceye kadar aşım bulunan vade aralığında işlem yapılmayacağı ve her ne sebeple olursa olsun söz konusu işlemlerin anlaşılma vadeden önce bozulmak istenilmesi veya vadesinin uzatılmasının istenilmesi durumunda Kurumun yazılı onayının alınması yönünde karar alındığı hususu kamuoyu ile paylaşılmıştı.

COVID-19 salgını nedeniyle küresel piyasalardaki belirsizliklerin ve risklerin arttığı dönemde alınan söz konusu Kararın normalleşme adımları çerçevesinde tekrar değerlendirilmesi sonucunda, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurulu'nun 25/09/2020 tarihli ve 9169 sayılı Kararı ile, bankaların konsolidasyona tabi yurtdışındaki kredi kuruluşu ve finansal kuruluş niteliğini haiz ortaklıklarıyla gerçekleştirdiği işlemler hariç, yurt dışı yerleşiklerle yapılan

- **Vadede TL alım yönünde gerçekleştirecekleri** para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlere ilişkin olarak, söz konusu işlem tutarları toplamının, bankaların en son hesapladıkları yasal özkaynaklara oranı şeklinde belirlenmiş %1 olan sınırlamanın, **%10** olarak yeniden belirlenmesine,
- **Vadede TL satım yönünde gerçekleştirecekleri** para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlere ilişkin olarak; her bir takvim günü için sağlanması gereken ve söz konusu işlem tutarları toplamının, bankaların en son hesapladıkları yasal özkaynaklarına oranı olarak belirlenmiş sınırlamanın
 - Vadesine 7 gün kalan işlemler için %1 yerine **%2**,
 - Vadesine 30 gün kalan işlemler için %2 yerine **%5**,
 - Vadesine 1 yıl kalan işlemler için %10 yerine **%20**

olarak yeniden belirlenmesine ve bu hesaplamada valör tarihi işlem tarihinden sonra olan (ileri valörlü) türev işlemlerin, hesaplamada valör tarihi itibarıyla dikkate alınmasına,

- 12/04/2020 tarihli ve 8989 sayılı Kararında yer verilen ve yukarıda belirtilen diğer hususların aynen uygulanmaya devam edilmesine

karar verilmiştir.

Kamuoyuna saygı ile duyurulur.