



11/11/2020

Bilindiği üzere, 25/09/2020 tarihli basın açıklamamızda, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurulu'nun(Kurul) 25/09/2020 tarihli ve 9169 sayılı Kararı ile 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 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
 - o Vadesine 7 gün kalan işlemler için %2 olarak,
 - o Vadesine 30 gün kalan işlemler için %5 olarak,
 - o Vadesine 1 yıl kalan işlemler için %20 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 anlaşılardan vadeden önce bozulmak istenilmesi veya vadesinin uzatılmasının istenilmesi durumunda Kurumun yazılı onayının alınması yönünde karar alındığı hususu kamuoyu ile paylaşılmıştı.

Son dönemde atılan normalleşme adımlarının devamı niteliğinde olmak üzere, Kurulun 11/11/2020 tarihli ve 9248 sayılı Kararı ile,

- 25/9/2020 tarih ve 9169 sayılı Kurul Kararında yer alan diğer hususların geçerli olması kaydıyla bankaların konsolidasyona tabi yurt dışındaki kredi kuruluşu ve finansal kuruluş niteliğini haiz ortaklıklarıyla gerçekleştirdiği işlemler hariç, yurt dışı yerleşiklerle yapılan **vadede TL satım yönünde gerçekleştirecekleri** para swapı, forward, opsiyon ve diğer türev işlemlere ilişkin olarak; söz konusu işlem tutarları toplamının, bankaların en son hesaplanan yasal özkaynaklarına oranı olarak belirlenen sınırlamanın
 - o Vadesine 7 gün kalan işlemler için %2 yerine %5,
 - o Vadesine 30 gün kalan işlemler için %5 yerine %10,
 - o Vadesine 1 yıl kalan işlemler için %20 yerine %30

olarak yeniden belirlenmesine

karar verilmiştir.

Kamuoyuna saygı ile duyurulur.