

## Veri: Kapsam, Dönemsellik ve Zamanlılık

Kapsam  
karakteristikleri

**Çalışmanın amacı:** Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS) tarafından, bankalarca tezgahüstü piyasalarda gerçekleştirilen döviz ve türev işlemlerinin büyüklüğünün ve yapısının görülebilmesidir.

**Verinin tanımı:** Anket, bankalarca derlenen spot döviz işlemleri, outright forwardlar, döviz ve para swapları, opsiyonlar ile faiz ve diğer türev işlemlerini içermektedir.

**İstatistiksel kavramlar ve tanımlar:**

**İşlem Hacimleri:** Raporlama yapan bankaların ulusal/ uluslararası borsalar dışında Nisan ayı boyunca (işlem vadesi Nisan sonrasına taşmış olsa dahi) yurt içi ve yurt dışında banka ve diğer mali kuruluşlar ve mali olmayan müşterilerle gerçekleştirdiği spot döviz işlemleri ile döviz ve faize dayalı türev işlemlerinin sözleşme tutarlarıdır.

**İşlem Bakiyeleri:** Raporlama tarihi itibarıyla vadesi dolmamış işlemler esas alınarak raporlanan türev işlem bakiyeleridir.

**Döviz Dayalı Sözleşmeler**

**Spot İşlemler:** İki paranın belirli bir pariteden en fazla 2 iş günü sonra değişimi sözleşmeleridir.

**Outright Forwardlar:** İki paranın belirli bir tarihte ve belirli bir pariteden değişimi sözleşmeleridir.

**Döviz Swapları:** İki paranın önce spot piyasada belirli bir pariteden değişimi ve gelecekteki bir vadede belirli bir pariteden yeniden değişimi sözleşmeleridir.

**Para Swapları:** İki paraya ait faiz ödemelerinin belirli bir dönem için değişimi ve dönem sonunda anaparaların belirli bir pariteden değişimi sözleşmeleridir.

**OTC Opsiyonlar:** İki paranın belirli bir pariteden ve belirli bir vade dilimi için alış ya da satış hakkı sağlayan sözleşmelerdir.

**Tek Paranın Kullanıldığı Faiz Oranı Türev Sözleşmeleri**

**Forward Faiz Anlaşmaları:** Gelecek bir tarihte ortaya çıkacak belirli bir yükümlülükle ilgili olarak belirli bir sürede ödenecek ya da elde edilecek faizin sözleşmenin yapıldığı tarihte önceden belirlendiği vadeli faiz oranı sözleşmeleridir.

**Faiz Swapları:** Faiz oranlarıyla ilgili periyodik ödemeleri tek bir döviz üzerinden değiştirme sözleşmeleridir.

**Diğer Swaplar:** Belirli bir parayla ilgili sabit ya da değişken olarak belirlenmiş faiz ödemelerinin anapara tutarını etkilemeksizin birbiriyle değiştirilmesiyle ilgili sözleşmelerdir.

**OTC Faiz Opsiyonları:** Belirli bir anapara üzerinden belirli bir faiz oranının önceden belirlenmiş bir süre için ödenmesi ya da alınması hakkını veren sözleşmelerdir.

**Diğer Türev Sözleşmeleri**

**Hisse Senedine ve Emtiaya Dayalı Türevler:** Bir hisse senedi / emtianın, gelecekteki bir vadede belli bir fiyattan değişimi (forward), alış / satış hakkı (opsiyon) ve bir hisse senedi / emtianın ya da bunlara ilişkin endeksin sabit ya da değişken faizle değiştirildiği (swap) sözleşmelerdir.

**Kredi Temerrüt Swapları:** İki tarafın, bir referans varlığın temerrüte düşmesi olayına dayandırılmış belirli bir periyodik ücret değişimini sağlayan sözleşmelerdir.

**Brüt Pozitif / Negatif Piyasa Değerleri:** Yapılan türev sözleşmelerinin Haziran ayı sonundaki brüt piyasa değerleridir.

**Raporlayan Kuruluşlar:** BIS OTC Anket raporlamasına katılan ulusal/uluslararası finansal kuruluşlardır.

**Sınıflamalar:** Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS)'nin Triennial Central Bank Survey of Foreign Exchange and OTC Derivatives Markets Kılavuzu (2019)'nda yer alan sınıflamalardır.

**Hedef kitle:** Hazine ve Maliye Bakanlığı, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu (BDDK) gibi kamu kurum ve kuruluşları ile Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS), Uluslararası Para Fonu (IMF), Avrupa Merkez Bankası (ECB) gibi uluslararası kuruluşlar, akademik kullanıcılar ve diğer kullanıcılar.

**Coğrafi kapsam:** Türkiye

**Coğrafi düzey:** Yoktur.

**Sektörel kapsam:** Raporlayıcı Kuruluşlar, diğer mali kuruluşlar ve mali olmayan müşteriler.

**Zaman kapsamı:** Raporlama yılı için İşlem Hacimleri anketi için Nisan ayı ve İşlem Bakiyeleri Anketi için Haziran ayıdır.

**Diğer kapsam:** Yoktur.

**Kapsamdaki sınırlılıklar:** Yoktur.

**İstatistiksel birim:** Raporlama yapan birimdir.

**Temel dönem/yıl:** Yoktur.

**Referans dönemi:** Nisan ayı işlem hacimleri ve Haziran aysonu işlem bakiyeleri ölçülmektedir.

**Ölçü birimi:**

Değişken/Gösterge	Ölçü Birimi
Tüm Değişkenler	Milyon ABD doları

Dönemsellik	Verinin toplama sıklığı: Üç yılda bir Verinin yayımlama sıklığı: Üç yılda bir.
Zamanlılık	Yayımlanan her veri için ortalama üretim süresi: 9 ay İlk sonuçların yayımlandığı tarih ile referans döneminin son tarihi arasındaki fark (gün): 145 gün Nihai sonuçların yayımlandığı tarih ile referans döneminin son tarihi arasındaki fark (gün): Bulunmamaktadır. Gerektiğinde geriye dönük dönemler için düzeltme yapılabilmektedir.

## Kamuoyunun Bilgiye Erişimi

Yayımlama takviminin önceden duyurulması	Veriye ilişkin yayımlama takvimi: Yoktur. Veri yayımlama takviminin internet adresi: Yoktur. Veri dağıtım politikası: İnternet sayfasında yayın gerçekleştikten sonra bankamızın veri dağıtım sistemine üye kişi, kurum ve kuruluşlara ilgili tablonun yayımlandığına dair bilgi verilmektedir.
Eş zamanlı yayımlama	Tüm kullanıcılar ile aynı anda paylaşılıp paylaşılmadığı: Paylaşıyor. Basın veya diğer belirli kullanıcılar ile özel anlaşmalar kapsamında verinin önceden paylaşılıp paylaşılmadığı: Hayır

## Bütünlük

Resmi istatistiklerin üretilmesine ilişkin şartlar, koşullar ve gizlilik	İstatistiklerin toplanması, işlenmesi ve dağıtımına ilişkin sorumluluk: TCMB İstatistik Genel Müdürlüğü, Ödemeler Dengesi Müdürlüğü sorumludur. Veri üreten kuruluşlar ile veri paylaşımı ve koordinasyon: Veri üretildikten sonra Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS)'na raporlanmaktadır. Bireysel cevaplayıcılara ait verinin gizliliği: Söz konusu veriler, 1211 sayılı Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Kanununun 25 Nisan 2001 tarih ve 4651 sayılı Kanunla değiştirilen 43.maddesinin 5.fıkrasında yer alan "...Banka, toplanan istatistikî bilgilerden kişisel ve özel nitelikte olanları yayımlayamaz, açıklayamaz, Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu dışında resmi veya özel herhangi bir makama veremez. Bu bilgiler istatistiki amaçlar dışında ve ispat aracı olarak kullanılamaz" hükmü gereğince "gizlilik ilkesi" çerçevesinde değerlendirilecek ve üçüncü kişilere açıklanmayacaktır."
--	---

**İstatistik üretiminde çalışanlar, olanaklar, finansman:** Ödemeler Dengesi Müdürlüğü'nde BIS-Tezgaüstü Döviz ve Türev Piyasaları Anketi'nin derlenmesi, yayımı ve dağıtımı için beş çalışan vardır. Çalışanların hepsi üniversite/yüksek lisans mezunudur. Bilişim kaynakları açısından bir sorun bulunmamaktadır. Tablo hazırlama sürecinde herhangi bir teknik sorunla karşılaşıldığında Bankamız Bilişim birimi tarafından gerekli teknik destek sağlanmaktadır.

**Kullanıcı ihtiyaçlarının izlenmesi:** -

**Kalite politikası:** Verilerin uluslararası standartlarla tam uyumlu yayımlanması; zamanlılık ve tutarlılık açısından öncü ülkelerden biri olmak.

**Kalitenin izlenmesi:** Verilerin kalitesine ilişkin bir sorun bulunmamaktadır. Dolayısıyla, bu konuda planlanan herhangi bir girişim bulunmamaktadır.

**İstatistiklerin yansızlığı:** İlgili kaynaklarından sağlanan veriler, kontrol edilerek ve gerekli düzeltmeler yapılarak tablolara dönüştürülmektedir. İstatistikler yansızdır.

**Veri Kaynakları:** Türkiye'de yerleşik bankalar.

**Yöntem:** Veri kaynaklarından elde edilen bilgiler için herhangi bir örnekleme veya tahmin yöntemi kullanılmamaktadır.

**Dağıtım şekilleri:** Rapor ile birlikte veriler, excel olarak Bankamız Genel Ağ sitesinde yayımlanmaktadır.

**İstatistiklerin hatalı yorumlanması ve yanlış kullanımına ilişkin görüş belirtme/tekzip:** Veriler yayımlandıktan sonra yayım organlarında hatalı kullanımı önlemeye yönelik düzenli bir takip yapılmaktadır. Hatalı kullanım ve yorumlamaya ilişkin olarak TCMB Genel Ağ Sitesinde duyuru yayımlanabilmektedir.

**İstatistiksel veri toplama, işleme ve dağıtımdaki şartlar ve koşulların açıklanması:** Belirlenen yayım takvimine uygun olarak verilerin zamanında yayımlanması.

**Mevsimsel düzeltme:** Verilerde mevsimsel düzeltme yapılmamaktadır.

**İstatistiğin toplanması, işlenmesi ve dağıtılması süreçlerinde bağlayıcı olan mevzuat:**

- 1211 Sayılı Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Kanunu (25.4.2001 tarih, 4651 sayılı Kanun ile değiştirilen şekli) Madde 43
- Türk Parası Kıymetini Koruma Hakkında 32 sayılı Karar

Yayımlanmadan önce veriye devlet birimlerinin içeriden erişimi

Yoktur.

İstatistiklerin yorumlanarak yayımlanması

İstatistikler yorumsuz olarak yayımlanmaktadır.

Yenileme ve yöntemdeki büyük değişikliklerin önceden bildirimini	<p><b>Revizyon takvimi:</b> Veriler ilk yayımlandığında kesindir ve veri kaynaklarında bir değişiklik olmadığı müddetçe düzenli revizyona tabi değildir. Bunun dışında; istatistikleri oluşturan verilerde yüksek tutarlı değişiklik yapılması gerektiğinde, kamuoyuna bilgi verme kaydıyla, daha eski yıllara ait istatistikler güncellenebilmektedir.</p> <p><b>İlk verinin ve revize edilmiş verinin tanımlanması:</b> Düzenli revizyon yapılmamaktadır.</p> <p><b>Metodoloji, veri kaynağı ve istatistiksel tekniklere ilişkin büyük değişikliklerin önceden duyurulup duyurulmadığı:</b> Şu ana kadar büyük bir değişiklik olmamakla beraber, tabloda veya metodolojide gerçekleşecek değişiklikler önceden duyurulur.</p>
--	---

## Kalite

İstatistiklerin hazırlanmasında kullanılan yöntem ve kaynaklara ait dokümantasyonun yayımlanması	İstatistiklerin hazırlanmasında kullanılan yöntem ve kaynaklara ilişkin açıklamalar bu metaveri dokümanında yer almaktadır.
Bileşen detayının, ilgili veri ile uyumlaştırmanın, kabul edilebilirliğinin güvencesini sağlayan ve istatistiksel çapraz sorguları destekleyen istatistiksel çerçevenin yayımlanması	<p><b>Verinin içsel tutarlılığı:</b> İstatistikler veri seti içerisinde birbiriyle tutarlıdır.</p> <p><b>Verinin zamansal tutarlılığı:</b> Karşılaştırılabilir zaman serileri, 2001 yılından başlamaktadır.</p> <p><b>Verinin sektörler arası ve alanlar arası tutarlılığı:</b> BIS-Tezhagüstü Döviz ve Türev Piyasaları Anketi verileri, diğer veri kaynakları veya istatistikler ile uyumludur.</p>

## Notlar

Metaverinin son güncellenme tarihi	07/11/2019
------------------------------------	------------