Uluslararası Rezervler ve Döviz Likiditesi

(Veriler,sosyal güvenlik hariç parasal yetkililer ve diğer merkezi hükümet bilgilerini içermektedir) [1 2 3]

(Milyon ABD Doları)

I. Resmi rezerv varlıkları ve diğer döviz varlıkları (yaklaşık piyasa değeri) [4]

	Şubat 2008
A. Resmi rezerv varlıkları	78541
(1) Döviz varlıkları (konvertıbl dövizler)	74717
(a) Menkul kıymetler	69803
Bilgi için: merkezi Türkiye'de olan, yurt dışında yerleşik ihraççılar (issuer)	
(b) toplam nakit ve mevduatlar:	4914
(i) diğer merkez bankaları, BIS ve IMF	4119
(ii) merkezi Türkiye'de olan bankalar	3
Bilgi için: yurt dışında yerleşik	3
(iii) merkezi Türkiye'nin dışında olan bankalar	792
Bilgi için: Türkiye'de yerleşik	
(2) IMF rezerv pozisyonu	181
(3) SDR'lar	21
(4) altın (altın mevduatlarını ve eğer uygunsa altın swaplarını içeren) [5]	3622
— saf troy ons hacmi	3,733
(5) diğer rezerv varlıkları	0
—mali türevler	
—banka-dışı yerleşik olmayanlara açılan krediler	
—diğer	
B. Diğer döviz varlıkları	18
—resmi rezerv varlıklarına dahil edilmeyen menkul kıymetler	16
—resmi rezerv varlıklarına dahil edilmeyen mevduatlar	
—resmi rezerv varlıklarına dahil edilmeyen krediler	
—resmi rezerv varlıklarına dahil edilmeyen mali türevler	
—resmi rezerv varlıklarına dahil edilmeyen altın	
—diğer	2

II. Döviz varlıklarından önceden belirlenmiş kısa dönem net çıkışlar (nominal değer)

			Vade dağılımı (kalan vade)		
		Toplam	1 aya kadar	1-3 ay arası	3 ay 1 yıl arası
1. Döviz kredileri, menkul kıymetler ve mevduatlar [6]		-27666	-2817	-7154	-17695
—çıkışlar (-)	Anapara	-21920	-2235	-6262	-13423
	Faiz	-5746	-582	-892	-4272
—girişler (+)	Anapara				
	Faiz				
2. Yurtiçi para karşılığında döviz forward ve future'ların toplam kısa ve fazla pozisyon büyüklükleri (para swaplarının gelecekteki bacağını da kapsar) [7]					
(a) Açık pozisyonlar (-)					
(b) Fazla pozisyonlar (+)					
3. Diğer					
—repo bağlantılı çıkışlar (-)					
—ters repo bağlantılı girişler (+)					
—ticari krediler (-)					
—ticari krediler (+)					
—diğer borç hesapları (-)					
—diğer alacak hesapları (+)					

III. Döviz varlıklarından şarta bağlı kısa dönem net çıkışlar (nominal değer)

		Vade dağılımı (kalan vade,uygulandığı yerde)		
	Toplam	1 aya kadar	1-3 ay arası	3 ay 1 yıl arası
1.Şarta bağlı döviz yükümlülükleri	-22011	-142	-546	-933
(a) 1 yıl içinde ödenecek borçlar üzerindeki garantiler	-1621	-142	-546	-933
(b) Diğer şarta bağlı yükümlülükler	-20390			
2. İçinde opsiyon hakkı ile ihraç edilen döviz menkul kıymetleri (puttable tahviller) [8]				
3. Şartsız olarak sağlanan kullanılmamış kredi imkanları (credit lines) [9] :				
(a) diğer ulusal para otoriteleri, BIS, IMF, ve diğer uluslararası kuruluşlar				
—diğer ulusal para otoriteleri (+)				
—BIS (+)				
—IMF (+)				
(b) merkezi Türkiye'de bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (+)				
(c) merkezi Türkiye dışında bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (+)				
Şartsız olarak verilen kullanılmamış kredi imkanları (credit lines):				
(a) diğer ulusal para otoriteleri, BIS, IMF, ve diğer uluslararası kuruluşlar				
—diğer ulusal para otoriteleri (-)				
—BIS (-)				
—IMF (-)				
(b) merkezi Türkiye'de bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (-)				
(c) merkezi Türkiye'nin dışında bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (-)				
4. Yurt içi para karşılığında döviz opsiyonlarındaki toplam açık ve fazla pozisyon büyüklükleri [10]				
(a)Açık pozisyonlar				
(i) Satın alınan put opsiyonlar (Bought puts)				
(ii) Satılan call opsiyonlar (Written calls)				
(b) Fazla pozisyonlar				
(i) Satın alınan put opsiyonlar (Bought puts)				
(ii) Satılan call opsiyonlar (Written calls)				
Ek Bilgi: Kardaki opsiyonlar (In-the-money options) [11]				
(1) Cari döviz kurlarından				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				
(2) + 5 % (% 5 değer kaybı)				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				
(3) - 5 % (% 5 değer kazanımı)				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				
(4) +10 % (% 10 değer kaybı)				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				
(5) - 10 % (% 10 değer kazanımı)				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				
(6) Diğer				
(a) Açık pozisyon				
(b) Fazla pozisyon				

IV. Ek kalemler

(1) Standart dönemsellik ve zamanlama kapsamında kaydedilenler (Aylık olarak) : [12]	
(a) dövize endeksli kısa vadeli iç borçlanmalar	
(b) döviz cinsinden belirtilen ve diğer araçlarla (örneğin: ulusal para) ödenen mali araçlar [13]	
—teslimsiz forwardlar	
—Açık pozisyonlar	
—fazla pozisyonlar	
—diğer araçlar	
(c) rehinli varlıklar [14]	
—rezerv varlıklarına dahil edilen	
—diğer döviz varlıklarına dahil edilen	
(d) ödünç verilen veya repoya tabi menkul kıymetler [15]	
—ödünç verilen veya repoya tabi ve Kısım 1'e dahil edilen	
—ödünç verilen veya repoya tabi ve Kısım 1'e dahil edilmeyen	
—ödünç alınan veya kazanılmış ve Kısım 1'e dahil edilen	
—ödünç alınan veya kazanılmış ve Kısım 1'e dahil edilmeyen	
(e) mali türev varlıkları (net, piyasa fiyatı (marked to market)) [16]	
—forwardlar	
—futures	
—swaplar	
—opsiyonlar	
—diğer	
(f) Vadeye kalan süresi 1 yıldan uzun" margin calls" lara konu kalan türevler (forward, futures ve opsiyon kontratları)	
— Yurtiçi para karşılığında döviz forward ve future'ların toplam kısa ve fazla pozisyon büyüklükleri (para swaplarının gelecekteki durumunu da kapsar)	
(a) Açık pozisyonlar (–)	
(b) fazla pozisyonlar (+)	
—Yurtiçi para karşılığında döviz opsiyonlarındaki toplam açık ve fazla pozisyon büyüklükleri	
(a) Açık pozisyonlar	
(i) satın alınan put opsiyonlar (Bought puts)	
(ii) satılan call opsiyonlar (Written calls)	
(b) fazla pozisyonlar	
(i) satın alınan put opsiyonlar (Bought puts)	
(ii) satılan call opsiyonlar (Written calls)	
(2) Aylık dönemde gösterilenler	
(a) rezervlerin döviz kompozisyonu (para grupları ile)	78541
—SDR sepetindeki paralar	78423
—SDR sepetinde olmayan paralar	118
—bireysel paralar (opsiyonel)	

Dipnotlar:

1. Prensip olarak yalnızca yabancı para cinsinden düzenlenen ve ödenen (veya değerlemesi direkt olarak döviz kurlarına bağlı olan ve yabancı para cinsinden ödenen) araçlar, tablonun I., II. ve III. kategorilerine dahil edilmelidir. Yabancı para cinsinden düzenlenmiş ve diğer yollarla (ulusal para veya mal karşılığında) ödenen mali araçlar Kısım IV'teki not kalemler kısmına dahil edilmektedir.

2. Pozisyonların netleştirilmesi ancak aynı karşı tarafa ve aynı vadeye sahip pozisyonların bulunması ve bir netleşme anlaşmasının mevcudu halinde uygulanabilir. Ayrıca organize edilmiş piyasalardaki pozisyonlar da netleştirilebilir.

3. Parasal yetkililer, IMF Ödemeler Dengesi El Kitabı, Beşinici Baskı'ya göre tanımlamıştır.

4. Mevduatlar ve menkul kıymetler haricindeki araçlarda, kurumlararası (merkezi raporlandığı ülkede olan) büyük miktarlı pozisyon olması durumunda, bunlar ayrı kalemler olarak kaydedilmelidir.

5. Altın için değerleme esası gösterilmelidir; ideal olarak bu, fiyat ve hacimler gösterilerek yapılabilir.

6. İlgili zaman diliminde ödenmesi gereken faiz ödemelerini kapsar. Yerleşik olmayanlar tarafından merkez bankasında tutulan döviz mevduatları burada ayrıca kaydedilmelidir. Menkul kıymetler, parasal yetkililer ve merkezi hükümet tarafından ihraç edilenleri kapsar (sosyal güvenlik hariç tutulmuştur).

7. Vadeye kalan süresi 1 yıldan uzun, call marjlarına tabi forward ve futures pozisyonlar, Kısım IV altında ayrı olarak kaydedilmelidir.

8. Sadece vadeye kalan süreleri 1 yıldan uzun olan tahviller bu kaleme kaydedilmelidir. Daha kısa vadeli olanlar Kısım II'ye dahil edilecektir.

9. Raporlamalarda koşullu kredi imkanlarından doğan potansiyel giriş ve çıkışları ayrılmalıdır ve ayrı kalemler olarak ve belirlenmiş formatta kaydedilmelidir.

10. Vadeye kalan süresi 1 yıldan uzun, "margin calls" lara konu olan opsiyon pozisyonlarının bulunduğu durumda, bunlar Kısım IV altında ayrı olarak kaydedilmelidir.

11. Bu **stres testleri** tavsiye edilmektedir. Grafik şeklinde gösterilebilir. Kural olarak temsili değeri kaydedilmelidir. Fakat nakit-ödemeli opsiyonlarda tahmin edilen gelecekteki giriş ve çıkışlar gösterilmelidir. Karda olan veya kara geçmiş ve kara geçmesi mühtemel pozisyonlar varolan değerleri ile raporlanır.

12. Uygulandığı hallerde varlıklar ve yükümlülükler olarak ayırınız.

13. Araç türlerini tanımlayınız; değerleme prensipleri Kısım I-III ile aynı olmalıdır.. Uygulandığı hallerde, teslimsiz forward pozisyonların temsili değeri (notional value) Kısım II'teki teslime bağlı forward/ futures'ların nominal değeri için uygulanan formata göre gösterilmelidir.

14. Yalnız Kısım I'e dahil edilen rehinli varlıklar buraya kayedilmelidir.

15. Repoya tabi veya ödünç verilen varlıklar taslağın I. Kısmı'na dahil edilip edilmemesine bakılmaksızın bağlantılı yükümlülükler ile birlikte buraya kaydedilmelidir. Fakat bunlar, Kısım I içerisine dahil edilip edilmemesine bağlı olarak iki ayrı kategoride kaydedilmelidir. Aynı şekilde repo anlaşması çerçevesinde ödünç alınmış veya kazanılmış menkul kıymetler ayrı olarak kayedilmelidir ve simetrik olarak uygulanmalıdır. Piyasa değerleri kaydedilmelidir ve muhasebe uygulaması gösterilmelidir.

16. Araç türlerini tanımlayınız. Piyasa değerlerinin hesaplanması için kullanılan içsel modellerin ana özellikleri gösterilmelidir.