

## İstatistik Adı

## BIS – Tezgahestü Döviz ve Türev Piyasaları Anketi

### Veri: Kapsam, Dönemsellik ve Zamanlılık

#### Kapsam karakteristikleri

**Çalışmanın amacı:** Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS) tarafından, bankalarca tezgahestü (Over the counter-OTC) piyasalarda gerçekleştirilen döviz ve türev işlemlerinin büyüklüğünün ve yapısının görülebmesidir.

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

#### 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 Haizran ayı sonundaki brüt piyasa değerleridir.

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

	<p><b>Sınıflamalar:</b> Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS)'nin Triennial Central Bank Survey of Foreign Exchange and OTC Derivatives Markets Kılavuzu (2022)'nda yer alan sınıflamalardır.</p> <p><b>Hedef kitle:</b> 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.</p> <p><b>Coğrafi kapsam:</b> Türkiye</p> <p><b>Coğrafi düzey:</b> Yoktur.</p> <p><b>Sektörel kapsam:</b> Türkiye'de yerleşik bankalardır.</p> <p><b>Zaman kapsamı:</b> Raporlama yılı için İşlem Hacimleri anketi için Nisan ayı ve İşlem Bakiyeleri Anketi için Haziran ayıdır.</p>				
	<p><b>Diğer kapsam:</b> Yoktur</p> <p><b>Kapsamdaki sınırlılıklar:</b> Yoktur.</p> <p><b>İstatistiksel birim:</b> Raporlama yapan birimdir.</p> <p><b>Temel dönem/yıl:</b> Yoktur.</p> <p><b>Referans dönemi:</b> Nisan ayı işlem hacimleri ve Haziran aysonu işlem bakiyeleri ölçülmektedir.</p> <p><b>Ölçü birimi:</b></p> <table><thead><tr><th>Değişken/Gösterge</th><th>Ölçü Birimi</th></tr></thead><tbody><tr><td>Tüm Değişkenler</td><td>Milyon ABD doları</td></tr></tbody></table>	Değişken/Gösterge	Ölçü Birimi	Tüm Değişkenler	Milyon ABD doları
Değişken/Gösterge	Ölçü Birimi				
Tüm Değişkenler	Milyon ABD doları				
<b>Dönemsellik</b>	<p><b>Verinin toplama sıklığı:</b> Üç yılda bir.</p> <p><b>Verinin yayımlama sıklığı:</b> Üç yılda bir.</p>				
<b>Zamanlılık</b>	<p><b>Yayımlanan her veri için ortalama üretim süresi:</b> 9 ay</p> <p><b>İlk sonuçların yayımlandığı tarih ile referans döneminin son tarihi arasındaki fark (gün):</b> 145 gün</p> <p><b>Nihai sonuçların yayımlandığı tarih ile referans döneminin son tarihi arasındaki fark (gün):</b> Bulunmamaktadır. Gerektiğinde geriye dönük dönemler için düzeltme yapılabilmektedir.</p>				
<b>Kamuoyunun Bilgiye Erişimi</b>					
<b>Yayımlama takviminin önceden duyurulması</b>	<p><b>Veriye ilişkin yayımlama takvimi:</b> Yoktur.</p> <p><b>Veri yayımlama takviminin internet adresi:</b> Yoktur.</p> <p><b>Veri dağıtım politikası:</b> İnternet sayfasında yayın gerçekleştirildikten sonra bankamızın veri dağıtım sistemine üye kişi, kurum ve kuruluşlara ilgili tablonun yayımlandığına dair bilgi verilmektedir.</p>				
<b>Eş zamanlı yayımlama</b>	<p><b>Tüm kullanıcılar ile aynı anda paylaşılıp paylaşılmadığı:</b> Paylaşıyor.</p>				

**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 Veri Yönetişimi ve 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:** Konsolide Bankacılık İstatistikleri verilerinin toplanması için Veri Yönetişimi ve İstatistik Genel Müdürlüğü bünyesindeki Parasal ve Finansal Veriler Müdürlüğü'nde dokuz çalışan, verilerin işlenmesi, analizi, yayımı, dağıtımı ve koordinasyon faaliyetleri için Ödemeler Dengesi Müdürlüğü'nde üç çalışan vardır. Çalışanların hepsi üniversite/yüksek lisans mezunudur. Bilişim kaynakları açısından bir sorun bulunmamaktadır. Tablo hazırlama sürecinde herhangi bir teknik sorunla karşılaşıldığında Bankamız Bilişim Teknolojileri 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 kaynaklardan 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:** Yoktur.

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

	<b>İstatistiğin toplanması, işlenmesi ve dağıtılması süreçlerinde bağlayıcı olan mevzuat:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>1211 Sayılı Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Kanunu (25.4.2001 tarih, 4651 sayılı Kanun ile değiştirilen şekli) Madde 43</li><li>Türk Parası Kıymetini Koruma Hakkında 32 sayılı Karar</li></ul>
<b>Yayımlanmadan önce veriye devlet birimlerinin içeriden erişimi</b>	Yoktur.
<b>İstatistiklerin yorumlanarak yayımlanması</b>	İstatistikler yorum yapılmadan yayımlanmaktadır.
<b>Yenileme ve yöntemdeki büyük değişikliklerin önceden bildirimi</b>	<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. <b>İlk verinin ve revize edilmiş verinin tanımlanması:</b> Düzenli revizyon yapılmamaktadır. <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.
<b>Kalite</b>	
<b>İstatistiklerin hazırlanmasında kullanılan yöntem ve kaynaklara ait dokümantasyonun yayımlanması</b>	İstatistiklerin hazırlanmasında kullanılan yöntem ve kaynaklara ilişkin açıklamalar bu metaveri dokümanında yer almaktadır.
<b>Bileşen detayının, ilgili veri ile uyumlaştırmanın, kabul edilebilirliğinin güvencesini sağlayan ve istatistiksel çapraz sorguları destekleyen istatistiksel çerçevenin yayımlanması</b>	<b>Verinin içsel tutarlılığı:</b> İstatistikler veri seti içerisinde birbirleriyle tutarlıdır. <b>Verinin zamansal tutarlılığı:</b> Karşılaştırılabilir zaman serileri, 2001 yılından başlamaktadır. <b>Verinin sektörler arası ve alanlar arası tutarlılığı:</b> BIS-Tezhagüstü Döviz ve Türev Piyasaları Anketi verileri, diğer veri kaynakları veya istatistikler ile uyumludur.
<b>Notlar</b>	
<b>Metaverinin son güncellenme tarihi</b>	30/10/2024

**“Bank for International  
Settlements (BIS)  
Tezgahst Dviz ve  
Trev Piyasaları  
Anketi”ne  
İlişkin Yntemsel  
Açıklama**

Veri Ynetiřimi ve İstatistik Genel  
Mdrlę  
demeler Dengesi Mdrlę

Uluslararası Ödemeler Bankası (BIS) 1989 yılından itibaren, bankalarca borsalar dışında (Over the counter-OTC) gerçekleştirilen döviz ve türev piyasalarındaki büyüklüğü ölçmeyi hedefleyen ve 3 yılda bir tekrarlanan bir anket düzenlemektedir.

**Amaç:** BIS Anketin amacı döviz ve OTC türev piyasalarının büyüklüğü ve yapısı hakkında kapsamlı ve uluslararası standartlara uygun bilgi elde etmektir.

**Yöntem:** Ankette toplanılan veriler, geleneksel döviz piyasası işlemleri (spot döviz işlemleri, outright forwardlar, döviz swapları) ile para ve faiz türev işlemlerini içermektedir. Anket, iki bölümden oluşmaktadır. İlk bölüm Nisan ayında yapılmakta olup, bankalarca kendi nam ve hesaplarına ya da kendileri namına ancak müşterileri hesabına gerçekleştirilen döviz ve türev işlemlerin ay içindeki günlük işlem hacmini (turnover) ölçmeyi hedeflemektedir. Haziran ayında yapılan ikinci bölümde ise, söz konusu türev işlemlerin bakiyeleri ölçülmektedir. Haziran ayı anketi bankaların yurtiçi ve yurtdışı şubeleriyle konsolide verilerini içermekte, Nisan ayı anketi ise konsolide olmayan veriler üzerinden hazırlanmaktadır.