Uluslararası Rezervler ve Döviz Likiditesi

(Veriler,sosyal güvenlik hariç parasal yetkililer ve diğer merkezi hükümet bilgilerini içermektedir)

(Milyon ABD Doları)

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

	Kasım 2009
A. Resmi rezerv varlıkları	75905
(1) Döviz varlıkları (konvertıbl dövizler)	69750
(a) Menkul kıymetler	65331
Bilgi için: merkezi Türkiye'de olan, yurt dışında yerleşik ihraççılar (issuer)	
(b) toplam nakit ve mevduatlar:	4419
(i) diğer merkez bankaları, BIS ve IMF	4276
(ii) merkezi Türkiye'de olan bankalar	3
Bilgi için: yurt dışında yerleşik	3
(iii) merkezi Türkiye'nin dışında olan bankalar	140
Bilgi için: Türkiye'de yerleşik	
(2) IMF rezerv pozisyonu	181
(3) SDR'lar	1559
(4) altın (altın mevduatlarını ve eğer uygunsa altın swaplarını içeren)	4415
— (saf) milyon troy ons	3,733
(5) diğer rezerv varlıkları	
—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	2-3 ay arası	4 ay-1 yıl arası
1. Döviz kredileri, menkul kıymetler ve mevduatlar [1]		-27883	-1046	-7761	-19076
—çıkışlar (-)	Anapara	-23135	-729	-6445	-15961
	Faiz	-4748	-317	-1316	-3115
—girişler (+)	Anapara				
	Faiz				
2. Yurtiçi para karşılığında döviz forward ve future'ların toplam kısa ve fazla pozisyon büyüklükleri (para swaplarının gelecekteki bacağını da kapsar)					
(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**	**2-3 ay arası**	**4 ay-1 yıl arası**
1.Şarta bağlı döviz yükümlülükleri	-17914			
(a) 1 yıl içinde ödenecek borçlar üzerindeki garantiler	-1105	-70	-74	-961
(b) Diğer şarta bağlı yükümlülükler [2]	-16809			
2. İçinde opsiyon hakkı ile ihraç edilen döviz menkul kıymetleri (puttable tahviller)				
3. Şartsız olarak sağlanan kullanılmamış kredi imkanları (credit lines) :				
(a) diğer ulusal para otoriteleri, BIS, IMF, ve diğer uluslararası kuruluşlar				
—diğer ulusal para otoriteleri (+)				
—BIS (+)				
—IMF (+)				
—Diğer uluslararası kuruluşlar (+)				
(b) merkezi Türkiye'de bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (+)				
(c) merkezi Türkiye dışında bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (+)				
4. 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 (-)				
—Diğer uluslararası kuruluşlar (-)				
(b) merkezi Türkiye'de bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (-)				
(c) merkezi Türkiye'nin dışında bulunan bankalar ve diğer mali kuruluşlar (-)				
5. Yurt içi 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)				
Ek Bilgi: Kardaki opsiyonlar (In-the-money options)				
(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) :	
(a) dövize endeksli kısa vadeli iç borçlanmalar	
(b) döviz cinsinden belirtilen ve diğer araçlarla (örneğin: ulusal para) ödenen mali araçlar	
—türevler (forwardlar, futurelar ve opsiyon sözleşmeleri)	
—açık pozisyonlar	
—fazla pozisyonlar	
—diğer araçlar	
(c) rehinli varlıklar	
—rezerv varlıklarına dahil edilen	
—diğer döviz varlıklarına dahil edilen	
(d) ödünç verilen veya repoya tabi menkul kıymetler	
—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))	
—forwardlar	
—futurelar	
—swaplar	
—opsiyonlar	
—diğer	
(f) Vadeye kalan süresi 1 yıldan uzun türevler (forward, future 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) En azından yılda bir kez gösterilenler	
(a) rezervlerin döviz kompozisyonu (para grupları ile)	75905
—SDR sepetindeki paralar	75799
—SDR sepetinde olmayan paralar	106
—bireysel paralar (opsiyonel)	

Kaynak: Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası, Hazine Müsteşarlığı.

Dipnotlar:

1. Yurtdışında yaşayan Türk Vatandaşları tarafından Merkez Bankası'nda tutulan Kredi Mektuplu Döviz Tevdiat Hesapları'ndan vadesi 1 yıl ve daha kısa olanları, Tablonun II-1 kısmında anapara ve faiz ayrımı yapılmış önceden belirlenmiş çıkışlar olarak raporlanmaktadır.

2. Vadesi 1 yıldan fazla olan Kredi Mektuplu Döviz Tevdiat Hesapları ile Merkez Bankası'nda tutulmakta olan ticari bankaların yabancı para cinsinden zorunlu karşılıkları, Tablonun III-1-b kısmında 'diğer şarta bağlı yükümlülükler' başlığı altında toplam olarak sınıflandırılmaktadır.