

Genel Mektup : 1630

İstanbul, 07/05/2020

PARA PİYASASI EKİBİ

Konu : Takasbank Para Piyasası'nda Teminat Değerlemede Kullanılan "Kıymet Bazında Üst Limit Oranı" Değişiklikleri Hk.
İlgili : Aracı Kurumlar
Bankalar
Finansal Kurumlar
Sigorta, Hayat ve Emeklilik Şirketleri
Varlık Yönetim Şirketleri

Sayın Genel Müdür,

Bildiğiniz üzere Takasbank Para Piyasası'nda (TPP) 27 Nisan 2020 tarihinde devreye alınan yeni risk, teminat ve temerrüt yönetimi uygulaması kapsamında, üyelerimizin teminat mektubu haricinde zorunlu bir teminat bulundurması gerekmektedir.

Üyelerimizin yeni teminat yapısına adapte olabilmesi ve zorunlu teminatlarını tamamlayabilmesi için teminata kabul edilen varlıklar arasında yer alan devlet iç borçlanma senedi, eurotahvil ve kira sertifikasına ait "kıymet bazında üst limit oran"larında yalnızca zorunlu teminat kısmı için geçici bir süre için revizyona gidilmiştir.

Yapılan güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ekte olup, ilgili değişiklikler **08 Mayıs 2020** tarihinde uygulamaya alınacaktır. Aynı tarih itibarı ile değişiklikleri içeren Takasbank Para Piyasası Prosedürü'ne Bankamız internet sitesinden (www.takasbank.com.tr) ulaşılacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Serkan AŞKAR
GENEL MÜDÜR YRD.

Gökhan ELİBOL
GENEL MÜDÜR VEKİLİ
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek : TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (3 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE6E3VS5F> Pin Kodu :

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +09 212 315 25 25 F +90 212 315 25 26 www.takasbank.com.tr Kep Adresi : takasbank@hs01.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



Ek: TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

MEVCUT HALİ						YENİ HALİ					
MADDE 28- Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları						MADDE 28- Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları					
.....										
(3) Teminat değerlendirilmesinde kullanılacak teminat grup bilgileri, değerlendirme katsayıları, grup ve kıymet bazında üst limit oranları aşağıda belirtilmiştir:						(3) Teminat değerlendirilmesinde kullanılacak teminat grup bilgileri, değerlendirme katsayıları, grup ve kıymet bazında üst limit oranları aşağıda belirtilmiştir:					
Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)	Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)
1	Altın		0,90	25,00	100,00	1	Altın		0,90	25,00	100,00
2	Borsa Payları		1,00	100,00	100,00	2	Borsa Payları		1,00	100,00	100,00
3	Devlet İç Borçlanma Senedi	0-1 yıl	0,96	100,00	35,00	3	Devlet İç Borçlanma Senedi	0-1 yıl	0,96	100,00	35 100,00
		1-5 yıl	0,91					1-5 yıl	0,91		
		5 yıl üzeri	0,91					5 yıl üzeri	0,91		
4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - USD	0-5 yıl	0,92	100,00	35,00	4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - USD	0-5 yıl	0,92	100,00	35 100,00
		5-10 yıl	0,93					5-10 yıl	0,93		
		10-30 yıl	0,89					10-30 yıl	0,89		

Ek: TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

	Ödemeli	30 yıl üzeri	0,86				Ödemeli	30 yıl üzeri	0,86			
4	Eurotahvil / Devlet iç Borçlanma Senedi - EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	35,00		4	Eurotahvil / Devlet iç Borçlanma Senedi - EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	35 100,00
		5-10 yıl	0,91						5-10 yıl	0,91		
		10-30 yıl	0,88						10-30 yıl	0,88		
		30 yıl üzeri	0,85						30 yıl üzeri	0,85		
5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,94	50,00	40,00		5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,94	50,00	35 100,00
		1-5 yıl	0,89						1-5 yıl	0,89		
		5 yıl üzeri	0,89						5 yıl üzeri	0,89		
6	Pay		0,85	90,00	20,00		6	Pay		0,85	90,00	20,00
7	Nakit EUR		0,94	100,00	100,00		7	Nakit EUR		0,94	100,00	100,00
7	Nakit USD		0,94	100,00	100,00		7	Nakit USD		0,94	100,00	100,00
8	Nakit TL		1,00	100,00	100,00		8	Nakit TL		1,00	100,00	100,00
9	Banka Bonusu / Tahvili		0,73	50,00	40,00		9	Banka Bonusu / Tahvili		0,73	50,00	40,00

Ek: TPP Prosedürü Deęişiklik Karşılaştırma Tablosu

10	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00		10	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00	
11	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,94	50,00	40,00		11	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,94	50,00	40,00	
		1-5 yıl	0,89			1-5 yıl			0,89				
		5 yıl üzeri	0,89			5 yıl üzeri			0,89				
12	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,84	50,00	20,00		12	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,84	50,00	20,00	