

Genel Mektup : 1656

İstanbul, 11/11/2020

PARA PİYASASI EKİBİ

Konu : Takasbank Para Piyasası'nda (TPP) Teminat Değerlemesinde Kullanılan Değerleme Katsayıları ve Üst Limit Oranı Değişiklikleri Hk.
İlgili : Aracı Kurumlar
Bankalar
Finansal Kurumlar
Sigorta, Hayat ve Emeklilik Şirketleri
Varlık Yönetim Şirketleri

Sayın Genel Müdür,

TPP'de kullanılmakta olan teminata konu varlıkların değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları periyodik olarak gözden geçirilmekte, gerekli görülen durumlarda revize edilmektedir. Bu kapsamda yapılan çalışmalar neticesinde, Takasbank tarafından merkezi karşı taraf hizmeti sunulan piyasalar ile uyum sağlamak üzere teminata konu varlıkların değerlendirme katsayılarında ve üst limit oranlarında değişiklikler yapılacaktır.

Yapılan güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ekte olup, ilgili değişiklikler **12/11/2020** tarihinde uygulamaya alınacaktır. Aynı tarih itibarı ile değişiklikleri içeren Takasbank Para Piyasası Prosedürü'ne Takasbank internet sitesinden (www.takasbank.com.tr) ulaşılabilecektir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Emre KOÇBEY
DİREKTÖR

Serkan AŞKAR
GENEL MÜDÜR YRD.

Ek :TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (4 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BENF4KA7E> 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



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	100,00	3	Devlet İç Borçlanma Senedi	0-1 yıl	0,96	100,00	100,00
		1-5 yıl	0,91					1-5 yıl	0,91		
		5 yıl üzeri	0,91					5 yıl üzeri	0,91 <u>0,88</u>		
4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - USD Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	100,00	4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - USD Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	100,00
		5-10 yıl	0,93					5-10 yıl	0,93		
		10-30 yıl	0,89					10-30 yıl	0,89 <u>0,82</u>		
		30 yıl üzeri	0,86					30 yıl üzeri	0,86		

TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	100,00	4	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi - EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	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	100,00	100,00	5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,94	50100,00	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
10	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00	10	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00
11		0-1 yıl	0,94	50,00	40,00	11		0-1 yıl	0,94	50,00	40,00
		1-5 yıl	0,89					1-5 yıl	0,89		

TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	5 yıl üzeri	0,89				Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	5 yıl üzeri	0,89		
12	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,84	50,00	20,00		Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,84	50,00	20,00

MADDE 36- Garanti fonu katkı payı olarak kabul edilebilecek varlıklar

(1) Garanti Fonu katkı payı olarak kabul edilecek varlıklar aşağıda tabloda gösterilmektedir. Takasbank garanti fonu katkı payı olarak kabul edilecek varlıkların kompozisyon limitlerini piyasa koşullarına göre değiştirmeye ve yeni varlıklar için kompozisyon limitleri belirlemeye yetkilidir. Teminat mektubu garanti fonu katkı payı olarak kabul edilmemektedir.

Garanti Fonu'na Kabul Edilebilecek Varlıklar	Vade Kalan Süre	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)
Altın		25,00	100,00
Borsa Payları		100,00	100,00
	0-1 yıl	100,00	35,00
	1-5 yıl		

MADDE 36- Garanti fonu katkı payı olarak kabul edilebilecek varlıklar

(1) Garanti Fonu katkı payı olarak kabul edilecek varlıklar aşağıda tabloda gösterilmektedir. Takasbank garanti fonu katkı payı olarak kabul edilecek varlıkların kompozisyon limitlerini piyasa koşullarına göre değiştirmeye ve yeni varlıklar için kompozisyon limitleri belirlemeye yetkilidir. Teminat mektubu garanti fonu katkı payı olarak kabul edilmemektedir.

Garanti Fonu'na Kabul Edilebilecek Varlıklar	Vade Kalan Süre	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)
Altın		25,00	100,00
Borsa Payları		100,00	100,00
	0-1 yıl	100,00	35,00
	1-5 yıl		

TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Devlet İç Borçlanma Senedi	5 yıl üzeri			Devlet İç Borçlanma Senedi	5 yıl üzeri		
Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi –USD ve EUR ödemeli	0-5 yıl	100,00	35,00	Eurotahvil / Devlet İç Borçlanma Senedi –USD ve EUR ödemeli	0-5 yıl	100,00	35,00
	5-10 yıl				5-10 yıl		
	10-30 yıl				10-30 yıl		
	30 yıl üzeri				30 yıl üzeri		
Kira Sertifikası	0-1 yıl	50,00	40,00	Kira Sertifikası	0-1 yıl	50 100,00	40 25,00
	1-5 yıl				1-5 yıl		
	5 yıl üzeri				5 yıl üzeri		
Pay		90,00	20,00	Pay		90,00	20,00
Nakit EUR		100,00	100,00	Nakit EUR		100,00	100,00
Nakit USD		100,00	100,00	Nakit USD		100,00	100,00
Nakit TL		100,00	100,00	Nakit TL		100,00	100,00
Banka Bonosu / Tahvili		50,00	40,00	Banka Bonosu / Tahvili		50,00	40,00
Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	50,00	40,00	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	50,00	40,00
	1-5 yıl				1-5 yıl		
	5 yıl üzeri				5 yıl üzeri		
Yatırım Fonu Katılma Belgesi		50,00	20,00	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		50,00	20,00