

Genel Mektup : 1685

İstanbul, 19/03/2021

PIYASALAR BÖLÜMÜ

Konu : Takasbank Para Piyasası'nda (TPP) ve Türkiye Elektronik Fon Alım Satım Platformu'nda (TEFAS) Yapılacak Teminat Değerleme Katsayısı Değişiklikleri Hk.

İlgili : Aracı Kurumlar
Bankalar
Katılım Bankaları
Portföy Yönetim Şirketleri
Finansal Kurumlar
Sigorta, Hayat ve Emeklilik Şirketleri
Varlık Yönetim Şirketleri

Sayın Genel Müdür,

Takasbank tarafından teminata kabul edilen varlıkların değerleme katsayıları periyodik olarak gözden geçirilmekte, gerekli görülen durumlarda revize edilmektedir. Bu kapsamda yapılan çalışmalar neticesinde, TPP ve TEFAS için teminat değerleme katsayılarında revizyona gidilecektir.

TPP Prosedürü'nde yapılan güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ve TEFAS'ta kullanılacak teminat değerleme katsayıları ekte yer almakta olup, ilgili değişiklikler **23/03/2021** tarihinden itibaren uygulamaya alınacaktır. Aynı tarih itibarı ile değişiklikleri içeren Takasbank Para Piyasası Prosedürü'ne Takasbank internet sitesinden (www.takasbank.com.tr) ulaşılabilecektir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Emre KOÇBEY
Direktör

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür V.
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :

- 1- TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (2 sayfa)
- 2- TEFAS'ta Kullanılacak Teminat Değerleme Katsayıları (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEND41PSL> 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		0,9088	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 – TL, USD ve EUR ödemeli	0-1 yıl	0,96	100,00	100,00	3	Devlet İç Borçlanma Senedi – TL, USD ve EUR ödemeli	0-1 yıl	0,96	100,00	100,00
		1-5 yıl	0,91					1-5 yıl	0,91		
		5 yıl üzeri	0,88					5 yıl üzeri	0,8891		
4	Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,92	100,00	100,00	4	Eurotahvil -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	0,8990		
		30 yıl üzeri	0,86					30 yıl üzeri	0,8688		
		0-5 yıl	0,92					0-5 yıl	0,92		
		5-10 yıl	0,91					5-10 yıl	0,9187		

TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	10-30 yıl	0,82	100,00	100,00	4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	10-30 yıl	0, 82 80	100,00	100,00
		30 yıl üzeri	0,85					30 yıl üzeri	0, 85 80		
5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,94	100,00	100,00	5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,94	100,00	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 84	90,00	20,00
7	Nakit EUR		0,94	100,00	100,00	7	Nakit EUR		0, 94 92	100,00	100,00
7	Nakit USD		0,94	100,00	100,00	7	Nakit USD		0, 94 93	100,00	100,00
8	Nakit TL		1,00	100,00	100,00	8	Nakit TL		1,00	100,00	100,00
9	Banka Bonosu / Tahvili		0,73	50,00	40,00	9	Banka Bonosu / 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	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

TEFAS'ta Kullanılacak Teminat Değerleme Katsayıları

TEMİNAT TÜRÜ	MEVCUT TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI	23.03.2021'DEN İTİBAREN UYGULANACAK TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI
ALTIN	0.90	0.88
USD	0.94	0.93
EURO	0.94	0.92
T.C. HAZİNE VARLIK KİRALAMA A.Ş. TARAFINDAN İHRAÇ EDİLEN KİRA SERTİFİKALARI	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89
DEVLET İÇ BORÇLANMA SENETLERİ	0-1 Yıl %96 1-5 Yıl %91 5 Yıl ve üzeri %88	0-1 Yıl %96 1-5 Yıl %91 5 Yıl ve üzeri %91
VARLIĞA DAYALI MENKUL KIYMETLER	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89