

Genel Mektup : 1742

İstanbul, 15/12/2021

PİYASALAR BÖLÜMÜ

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

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

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere Takasbank, teminata konu varlık sınıflarına yönelik belirlemiş olduğu değerlendirme katsayılarını periyodik olarak gözden geçirmekte ve gerekli görülen durumlarda katsayıları revize etmektedir. Bu kapsamda yapılan çalışmalar neticesinde, TPP, TEFAS ve BEFAS için teminat değerlendirme katsayılarında revizyona gidilecektir.

TPP Prosedürü'nde yapılan güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ile TEFAS ve BEFAS'ta kullanılacak teminat değerlendirme katsayıları ekte yer almakta olup, ilgili değişiklikler **20/12/2021** 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 Yardımcısı

Ek :

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

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSEB51CH94> 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

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:

| Teminat Grubu | Teminat Tipi | Vade Kalan Süre | Değerleme Katsayısı | Grup Üst Limit Oran (%) | Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%) |
|---------------|---|-----------------|---------------------|-------------------------|-----------------------------------|
| 1 | Altın | | 0,88 | 25,00 | 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 |
| | | 1-5 yıl | 0,91 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,91 | | |
| 4 | Eurotahvil - USD Ödemeli | 0-5 yıl | 0,92 | 100,00 | 100,00 |
| | | 5-10 yıl | 0,93 | | |
| | | 10-30 yıl | 0,90 | | |
| | | 30 yıl üzeri | 0,88 | | |
| | | 0-5 yıl | 0,92 | | |
| | | 5-10 yıl | 0,87 | | |

YENİ HALİ

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:

| Teminat Grubu | Teminat Tipi | Vade Kalan Süre | Değerleme Katsayısı | Grup Üst Limit Oran (%) | Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%) |
|---------------|---|-----------------|---------------------|-------------------------|-----------------------------------|
| 1 | Altın | | 0,88 | 25,00 | 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 |
| | | 1-5 yıl | 0,91 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,91 | | |
| 4 | Eurotahvil - USD Ödemeli | 0-5 yıl | 0,92 | 100,00 | 100,00 |
| | | 5-10 yıl | 0,93 | | |
| | | 10-30 yıl | 0,90 | | |
| | | 30 yıl üzeri | 0,88 | | |
| | | 0-5 yıl | 0,92 | | |
| | | 5-10 yıl | 0,87 | | |

| | | | | | |
|----|---------------------------------------|--------------|------|--------|--------|
| 4 | Eurotahvil / EUR Ödemeli | 10-30 yıl | 0,80 | 100,00 | 100,00 |
| | | 30 yıl üzeri | 0,80 | | |
| 5 | Kira Sertifikası | 0-1 yıl | 0,94 | 100,00 | 100,00 |
| | | 1-5 yıl | 0,89 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,89 | | |
| 6 | Pay | | 0,84 | 90,00 | 20,00 |
| 7 | Nakit EUR | | 0,92 | 100,00 | 100,00 |
| 7 | Nakit USD | | 0,93 | 100,00 | 100,00 |
| 8 | Nakit TL | | 1,00 | 100,00 | 100,00 |
| 9 | Banka Bonosu / Tahvili | | 0,73 | 50,00 | 40,00 |
| 10 | Teminat Mektubu | | 1,00 | 100,00 | 100,00 |
| 11 | Varlığa Dayalı Menkul Kıymet | 0-1 yıl | 0,94 | 50,00 | 40,00 |
| | | 1-5 yıl | 0,89 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,89 | | |
| 12 | Yatırım Fonu Katılma Belgesi | | 0,84 | 50,00 | 20,00 |

| | | | | | |
|----|---------------------------------------|--------------|--------|--------|--------|
| 4 | Eurotahvil / EUR Ödemeli | 10-30 yıl | 0,80 | 100,00 | 100,00 |
| | | 30 yıl üzeri | 0,80 | | |
| 5 | Kira Sertifikası | 0-1 yıl | 0,94 | 100,00 | 100,00 |
| | | 1-5 yıl | 0,89 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,89 | | |
| 6 | Pay | | 0,84 | 90,00 | 20,00 |
| 7 | Nakit EUR | | 0,92 | 100,00 | 100,00 |
| 7 | Nakit USD | | 0,9391 | 100,00 | 100,00 |
| 8 | Nakit TL | | 1,00 | 100,00 | 100,00 |
| 9 | Banka Bonosu / Tahvili | | 0,73 | 50,00 | 40,00 |
| 10 | Teminat Mektubu | | 1,00 | 100,00 | 100,00 |
| 11 | Varlığa Dayalı Menkul Kıymet | 0-1 yıl | 0,94 | 50,00 | 40,00 |
| | | 1-5 yıl | 0,89 | | |
| | | 5 yıl üzeri | 0,89 | | |
| 12 | Yatırım Fonu Katılma Belgesi | | 0,84 | 50,00 | 20,00 |

TEFAS'ta Kullanılacak Teminat Değerleme Katsayıları

| TEMİNAT TÜRÜ | MEVCUT TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI | 20/12/2021'DEN İTİBAREN UYGULANACAK TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI |
|---|---|--|
| ALTIN | 0.88 | 0.88 |
| USD | 0.93 | 0.91 |
| EURO | 0.92 | 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 %91 | 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 |

BEFAS'ta Kullanılacak Teminat Değerleme Katsayıları

| TEMİNAT TÜRÜ | MEVCUT TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI | 20/12/2021'DEN İTİBAREN UYGULANACAK TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI |
|---|---|--|
| ALTIN | 0.88 | 0.88 |
| USD | 0.93 | 0.91 |
| EURO | 0.92 | 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 %91 | 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 |