

Genel Mektup : 1783

İstanbul, 17/03/2022

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Sunulan Piyasa Prosedürlerinde Gerçekleştirilen Değişiklikler Hk.

İlgili : Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere Takasbank, teminata konu varlık sınıflarına yönelik belirlemiş olduğu değerlendirme katsayılarını periyodik olarak gözden geçirmekte, geriye yönelik testler ile sınamakta ve gerekli görülen durumlarda katsayıları revize etmektedir. Bu doğrultuda yapılan çalışmalar neticesinde merkezi karşı taraf (MKT) hizmeti verilen piyasalar için teminat değerlendirme katsayılarında revizyona gidilmiştir.

22.03.2022 günü ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olması öngörülen ve karşılaştırma tabloları ekte yer alan değişikliklerin işlendiği güncel prosedürlere web sitemizde yer alan "Mevzuat" başlığı altındaki "Prosedürler" bölümünden erişilebilecektir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :MKT Hizmeti Verilen Piyasa Prosedürleri Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (12 Sayfa)
(12 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSNBZN53UP> 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



İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Borçlanma Araçları Piyasası Takas ve Merkezi
Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali		Madde İçeriği – Yeni Hali		Gerekçe
Değerleme katsayıları MADDE 51- (3)		Değerleme katsayıları MADDE 51- (3)		Takasbank Merkezi Karşı Taraf Teminat Yönetimi Esasları Yönergesi Madde 11-(3) gereğince.
Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	
Türk Lirası	%100	Türk Lirası	%100	
Konvertible Döviz(USD)	%91	Konvertible Döviz(USD)	%91	
Konvertible Döviz(EUR)	%91	Konvertible Döviz(EUR)	%91	
Konvertible Döviz(GBP)	%91	Konvertible Döviz(GBP)	%91	
DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Borçlanma Araçları Piyasası Takas ve Merkezi
Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteye dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteye dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%90	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%88	
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%94	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%93	
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

<

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

İpotek teminatl� menkul kıymetler, ipoteęe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatl� menkul kıymetler ve varlıęa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve �zeri %83	İpotek teminatl� menkul kıymetler, ipoteęe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatl� menkul kıymetler ve varlıęa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve �zeri %83
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82
Hisse Senedi Őemsiye Fonu Payları	% 90	Hisse Senedi Őemsiye Fonu Payları	%88
Boręlanma Araęları Őemsiye Fonu Payları	% 94	Boręlanma Araęları Őemsiye Fonu Payları	%93
Borsalarda İşlem G�ren Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem G�ren Standartta Altın	%88

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Pay Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali		Madde İçeriği – Yeni Hali		Gerekçe Takasbank Merkezi Karşı Taraf Teminat Yönetimi Esasları Yönergesi Madde 11-(3) gereğince.
Değerleme katsayıları		Değerleme katsayıları		
MADDE 52- (3)		MADDE 52- (3)		
Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	
Türk Lirası	%100	Türk Lirası	%100	
Konvertible Döviz(USD)	%91	Konvertible Döviz(USD)	%91	
Konvertible Döviz(EUR)	%91	Konvertible Döviz(EUR)	%91	
Konvertible Döviz(GBP)	%91	Konvertible Döviz(GBP)	%91	
DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	

**İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Pay Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf
Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu**

İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipotēge dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipotēge dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	% 90	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%88	
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	% 94	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%93	
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul SWAP Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti
Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali		Madde İçeriği – Yeni Hali		Gerekçe
Değerleme katsayıları MADDE 31- (3)		Değerleme katsayıları MADDE 31- (3)		Takasbank Merkezi Karşı Taraf Teminat Yönetimi Esasları Yönergesi Madde 11-(3) gereğince.
Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	
Türk Lirası	%100	Türk Lirası	%100	
Konvertible Döviz(USD)	%91	Konvertible Döviz(USD)	%91	
Konvertible Döviz(EUR)	%91	Konvertible Döviz(EUR)	%91	
Konvertible Döviz(GBP)	%91	Konvertible Döviz(GBP)	%91	
DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
		İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteğe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul SWAP Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti
Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

İpotek teminatl� menkul kıymetler, ipoteg� dayalı menkul kıymetler, varlık teminatl� menkul kıymetler ve varlığ� dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve �zeri %83	ve varlığ� dayalı menkul kıymetler	1-5 Yıl %89 5 Yıl ve �zeri %83
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%90	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%88
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%94	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%93
Borsalarda İşlem G�ren Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem G�ren Standartta Altın	%88
ABD tarafından ihraç edilen i� borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %90 5-10 Yıl %90 10-30 Yıl %89 30 ve �zeri %88	ABD tarafından ihraç edilen i� borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %90 5-10 Yıl %90 10-30 Yıl %89 30 ve �zeri %88
Almanya tarafından ihraç edilen i� borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %90 5-10 Yıl %90 10-30 Yıl %90 30 ve �zeri %89	Almanya tarafından ihraç edilen i� borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %90 5-10 Yıl %90 10-30 Yıl %90 30 ve �zeri %89

**İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Para Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf
Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu**

Madde İçeriği – Eski Hali		Madde İçeriği – Yeni Hali		Gerekçe
Değerleme katsayıları MADDE 29 - (3)		Değerleme katsayıları MADDE 29 - (3)		Takasbank Merkezi Karşı Taraf Teminat Yönetimi Esasları Yönergesi Madde 11-(3) gereğince.
Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	
Türk Lirası	%100	Türk Lirası	%100	
Konvertible Döviz(USD)	%91	Konvertible Döviz(USD)	%91	
Konvertible Döviz(EUR)	%91	Konvertible Döviz(EUR)	%91	
Konvertible Döviz(GBP)	%91	Konvertible Döviz(GBP)	%91	
DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
		İpotek teminatl menkul kıymetler, ipotége dayalı menkul kıymetler, varlık teminatl menkul kıymetler	0-1 Yıl %95	

**İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Para Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf
Hizmeti Esasları Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu**

İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteğe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	ve varlığa dayalı menkul kıymetler	1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	% 90	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%88	
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	% 94	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%93	
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Takasbank Ödünç Pay Piyasası Uygulama Esasları Prosedürü

Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali		Madde İçeriği – Yeni Hali		Gerekçe
Değerleme katsayıları MADDE 31- (1)		Değerleme katsayıları MADDE 31- (1)		Takasbank Merkezi Karşı Taraf Teminat Yönetimi Esasları Yönergesi Madde 11-(3) gereğince.
Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı	
Türk Lirası	%100	Türk Lirası	%100	
Konvertible Döviz(USD)	%91	Konvertible Döviz(USD)	%91	
Konvertible Döviz(EUR)	%91	Konvertible Döviz(EUR)	%91	
Konvertible Döviz(GBP)	%91	Konvertible Döviz(GBP)	%91	
DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	DİBS	0-1 Yıl %97 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %85	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %92 10-30 Yıl %90 30 ve üzeri %87	
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %87 10-30 Yıl %79 30 ve üzeri %79	
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
		İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteğe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95	

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Takasbank Ödünç Pay Piyasası Uygulama Esasları Prosedürü

Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteğe dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %95 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	ve varlığa dayalı menkul kıymetler	1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %83	
Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	Pay senetleri (BIST100)	BIST 30 %84 BIST 100 %82	
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	% 90	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%88	
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	% 94	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%93	
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	%88	