

Genel Mektup : 1820

İstanbul, 20/09/2022

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Takasbank'ın Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmetine İlişki
Takas Esasları Prosedürü'nde Gerçekleştirilen Değişiklikler Hk.

İlgili : Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Takasbank'ın Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmetine İlişkin Takas Esasları Prosedürü'nün İşlem teminatı kompozisyonu ve değerlendirme katsayıları başlıklı 45 inci maddesinde değişiklik yapılmıştır.

21.09.2022 günü geçerli olacak ve karşılaştırma tablosu ekte yer alan değişikliklerin işlendiği güncel prosedüre web sitemizde yer alan "Mevzuat" başlığı altındaki "Prosedürler" bölümünden erişilebilir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Avşar R. SUNGURLU
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Değişiklik Karşılaştırma Tablosu_Pay Alt Grup Limiti (2 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSFBY6DFE0> 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 Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Uygulama Esasları
Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablo**

Mevcut			Önerilen		
<p>İşlem teminatı kompozisyonu ve değerlendirme katsayıları MADDE 45- (1) (Değişik: 29.03.2018 tarihli ve 1415 sayılı Genel Mektup ile, 08.03.2019 tarihli ve 1528 sayılı Genel Mektup ile ve 08.11.2019 tarihli ve 1595 sayılı Genel Mektup ile, 05.11.2020 tarihli ve 1654 sayılı Genel Mektup ile) Piyasa’da hesaplanan toplam teminat gereksiniminin en az % 50’sinin Türk Lirası teminattan oluşması gerekir. Yönetim Kurulu Piyasa’daki gelişmelere göre bu oranı değiştirmeye yetkilidir. Türk Lirası dışında teminata kabul edilecek diğer varlıklar ve bunlara ilişkin kompozisyon limitleri için aşağıda verilen tabloda belirtilen oranlar uygulanır. Kompozisyon limitleri, yatırılmış TL ve diğer teminat bakiyelerinin toplamı üzerinden uygulanır. Takasbank Yönetim Kurulu teminat olarak kabul edilecek yeni varlıklar için kompozisyon limitleri belirlemeye veya bu Prosedür ile belirlenmiş olanlar da dahil kompozisyon limitlerinde değişiklik yapmaya yetkilidir.</p>			<p>İşlem teminatı kompozisyonu ve değerlendirme katsayıları MADDE 45- (1) (Değişik: 29.03.2018 tarihli ve 1415 sayılı Genel Mektup ile, 08.03.2019 tarihli ve 1528 sayılı Genel Mektup ile ve 08.11.2019 tarihli ve 1595 sayılı Genel Mektup ile, 05.11.2020 tarihli ve 1654 sayılı Genel Mektup ile) Piyasa’da hesaplanan toplam teminat gereksiniminin en az % 50’sinin Türk Lirası teminattan oluşması gerekir. Yönetim Kurulu Piyasa’daki gelişmelere göre bu oranı değiştirmeye yetkilidir. Türk Lirası dışında teminata kabul edilecek diğer varlıklar ve bunlara ilişkin kompozisyon limitleri için aşağıda verilen tabloda belirtilen oranlar uygulanır. Kompozisyon limitleri, yatırılmış TL ve diğer teminat bakiyelerinin toplamı üzerinden uygulanır. Takasbank Yönetim Kurulu teminat olarak kabul edilecek yeni varlıklar için kompozisyon limitleri belirlemeye veya bu Prosedür ile belirlenmiş olanlar da dahil kompozisyon limitlerinde değişiklik yapmaya yetkilidir.</p>		
İşlem Teminatı Olarak Kabul Edilebilecek Varlıklar	Grup Limiti	Alt Grup Limiti (Grup Limiti Yüzdesi Olarak)	İşlem Teminatı Olarak Kabul Edilebilecek Varlıklar	Grup Limiti	Alt Grup Limiti (Grup Limiti Yüzdesi Olarak)
Nakit Türk Lirası	En Fazla %100	-	Nakit Türk Lirası	En Fazla %100	-
Konvertibl Döviz(USD/EUR/GBP)	En Fazla %50	-	Konvertibl Döviz(USD/EUR/GBP)	En Fazla %50	-
Devlet İç Borçlanma Senedi	En Fazla %50	%50(ISIN bazlı)	Devlet İç Borçlanma Senedi	En Fazla %50	%50(ISIN bazlı)
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond)	En Fazla %50	%50(ISIN bazlı)	T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond)	En Fazla %50	%50(ISIN bazlı)
T.C. Hazinesi Varlık Kiralama Anonim Şirketi tarafından ihraç edilen kira sertifikaları,	En Fazla %50	%25(ISIN bazlı)	T.C. Hazinesi Varlık Kiralama Anonim Şirketi tarafından ihraç edilen kira sertifikaları,	En Fazla %50	%25(ISIN bazlı)

**İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Uygulama Esasları
Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablo**

BIST 100 endeksinde bulunan pay senetleri	En Fazla %50	75%	BIST 100 endeksinde bulunan pay senetleri	En Fazla %50	75% 100%
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %50	20%	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %50	20%
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %50	20%	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %50	20%
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	En Fazla %25	-	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	En Fazla %25	-
İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteye dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	En Fazla %50	40%	İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteye dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	En Fazla %50	40%
Borsa İstanbul A.Ş. payları	En Fazla %50	-	Borsa İstanbul A.Ş. payları	En Fazla %50	-