

Genel Mektup: 1825

İstanbul, 21/10/2022

PARA PİYASASI EKİBİ

Konu: Takasbank Para Piyasası (TPP) Garanti Fonu Parametre Revizyonu hk.

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

Sayın Genel Müdür,

TPP’de temerrüt yönetim kaynaklarının kuvvetlendirilmesi ve esnekliğinin artırılması amacıyla piyasada halihazırda sabit %99,75 güven düzeyi baz alınarak hesaplanan garanti fonu parametresinin yükseltilmesi kararlaştırılmıştır.

Yeni dönemde % 99,9 güven düzeyinin kullanılması öngörülmektedir. Kullanılacak parametre ile birlikte piyasada gerçekleşecek olan garanti fonu tutarlarındaki artışın piyasaya olan etkisinin azaltılması adına ilgili artış önümüzdeki iki hesaplama dönemine paylaştırılarak hesaplamalara yansıtılacaktır.

Bu doğrultuda TPP Prosedürü’nde yapılan değişikliği içeren karşılaştırma tablosu Ek’te yer almakta olup, güncel prosedüre Takasbank internet sitesinden (www.takasbank.com.tr) ulaşılabilir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Zehra Zeynep ÖÇAL
Direktör

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Ek: TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSF5B4TK3S> 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 Deęişiklik Karşılaştırma Tablosu

MEVCUT HALİ	YENİ HALİ
<p>Garanti fonunun büyüklüğü ve üyelerce yapılacak katkı payı miktarı MADDE 35-</p> <p>(1) Garanti fonunun büyüklüğü en fazla alış borcu olan üye ile ikinci ve üçüncü en fazla alış borcu olan üyenin stres koşullarında birlikte temerrüdü halinde ortaya çıkacak kaynak ihtiyacının büyük olanından az olamaz. Kaynak ihtiyacı üyelerin risklerinin belli bir güven düzeyinde teminatlar ile karşılanamayan bölümünden oluşur. Stres koşullarındaki riskin istatistiksel yöntemlerle tahmininde sırasıyla güven düzeyi %99,75, elde tutma süresi de 2 iş günü olarak dikkate alınır. Takasbank piyasa şartlarını, teminat yoğunlaşmalarını ve temerrüt yönetimi kaynaklarının yeterlilik düzeyini gözeterek, asgari garanti fonu yükümlülüğünü, istatistiksel olarak hesaplanan yükümlülüğünden daha yüksek belirleyebilir.</p>	<p>Garanti fonunun büyüklüğü ve üyelerce yapılacak katkı payı miktarı MADDE 35-</p> <p>(1) Garanti fonunun büyüklüğü en fazla alış borcu olan üye ile ikinci ve üçüncü en fazla alış borcu olan üyenin stres koşullarında birlikte temerrüdü halinde ortaya çıkacak kaynak ihtiyacının büyük olanından az olamaz. Kaynak ihtiyacı üyelerin risklerinin belli bir güven düzeyinde teminatlar ile karşılanamayan bölümünden oluşur. Stres koşullarındaki riskin istatistiksel yöntemlerle tahmininde sırasıyla <u>asgari</u> güven düzeyi %99,75, elde tutma süresi de 2 iş günü olarak dikkate alınır. Takasbank piyasa şartlarını, teminat yoğunlaşmalarını ve temerrüt yönetimi kaynaklarının yeterlilik düzeyini gözeterek, asgari garanti fonu yükümlülüğünü, istatistiksel olarak hesaplanan yükümlülüğünden daha yüksek belirleyebilir.</p>