

Genel Mektup : 1897

İstanbul, 28/07/2023

PARA PİYASASI EKİBİ

Konu : Takasbank Para Piyasası'nda (TPP) Teminat Değerleme Katsayı Değişikliği Hk.

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

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere Takasbank, teminata konu varlık sınıflarına yönelik belirlemiş olduğu değerlendirme katsayılarını periyodik olarak gözden geçirmekte ve uygun bulunması halinde katsayılar revize edilmektedir. Bu kapsamda gerçekleştirilen çalışmalar neticesinde, Takasbank Para Piyasası (TPP) teminat değerlemesinde kullanılan katsayılar güncellenmiştir. Bunun yanı sıra "Limitler ve işlem sınırları" başlıklı 11. Madde'de mevzuat yeknesaklığı kapsamında değişiklik yapılmıştır.

TPP Prosedürü'nde gerçekleştirilen güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ekte yer almakta olup, ilgili değişiklikler **31/07/2023** tarihinden itibaren uygulamaya alınacaktır. Aynı tarih itibarı ile değişiklikleri içeren Takasbank Para Piyasası Prosedürü'ne Takasbank internet sitesinden (**www.takasbank.com.tr**) erişim sağlanabilecektir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Zehra Zeynep ÖÇAL
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :TPP Prosedür Değişikliği karşılaştırma tablosu_28.07.2023 (3 Sayfa)



TPP Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

MEVCUT HALİ	YENİ HALİ																																																																												
<p>Limitler ve işlem sınırları</p> <p>MADDE 11-</p> <p>(1) Takasbank, üyelere “TPP limiti” ve üye talebine istinaden yatırım fonu ve yatırım ortaklıkları ile kamu kaynağı kullanımı için “Fon limiti” tahsis eder. Söz konusu limitler Takasbank’ın taahhüdü değildir.</p>	<p>Limitler ve işlem sınırları</p> <p>MADDE 11-</p> <p>(1) Takasbank, üyelere “TPP limiti” ve üye talebine istinaden yatırım fonu ve yatırım ortaklıkları ile kamu kaynağı kullanımı için “Fon limiti” tahsis eder. Söz konusu limitler Takasbank’ın taahhüdü değildir.</p>																																																																												
<p>Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları</p> <p>MADDE 28-</p> <p>.....</p> <p>(3) Teminat değerlendirilmesinde kullanılacak teminat grup bilgileri, değerlendirme katsayıları, grup ve kıymet bazında üst limit oranları aşağıda belirtilmiştir:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Teminat Grubu</th> <th>Teminat Tipi</th> <th>Vade Kalan Süre/End eks</th> <th>Değerleme Katsayısı</th> <th>Grup Üst Limit Oran (%)</th> <th>Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>Altın</td> <td></td> <td>0,87</td> <td>25,00</td> <td>100,00</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>Borsa Payları</td> <td></td> <td>1,00</td> <td>100,00</td> <td>100,00</td> </tr> <tr> <td rowspan="3">3</td> <td rowspan="3">Devlet İç Borçlanma Senedi – TL, USD ve EUR ödemeli</td> <td>0-1 yıl</td> <td>0,97</td> <td rowspan="3">100,00</td> <td rowspan="3">100,00</td> </tr> <tr> <td>1-5 yıl</td> <td>0,84</td> </tr> <tr> <td>5 yıl üzeri</td> <td>0,84</td> </tr> <tr> <td rowspan="2"></td> <td rowspan="2">Eurotahvil -USD Ödemeli</td> <td>0-5 yıl</td> <td>0,89</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>5-10 yıl</td> <td>0,89</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/End eks	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)	1	Altın		0,87	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	0,97	100,00	100,00	1-5 yıl	0,84	5 yıl üzeri	0,84		Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89			5-10 yıl	0,89			<p>Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları</p> <p>MADDE 28-</p> <p>.....</p> <p>(3) Teminat değerlendirilmesinde kullanılacak teminat grup bilgileri, değerlendirme katsayıları, grup ve kıymet bazında üst limit oranları aşağıda belirtilmiştir:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Teminat Grubu</th> <th>Teminat Tipi</th> <th>Vade Kalan Süre/End eks</th> <th>Değerleme Katsayısı</th> <th>Grup Üst Limit Oran (%)</th> <th>Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>Altın</td> <td></td> <td>0,87</td> <td>25,00</td> <td>100,00</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>Borsa Payları</td> <td></td> <td>1,00</td> <td>100,00</td> <td>100,00</td> </tr> <tr> <td rowspan="3">3</td> <td rowspan="3">Devlet İç Borçlanma Senedi – TL, USD ve EUR ödemeli</td> <td>0-1 yıl</td> <td>0,9796</td> <td rowspan="3">100,00</td> <td rowspan="3">100,00</td> </tr> <tr> <td>1-5 yıl</td> <td>0,84</td> </tr> <tr> <td>5 yıl üzeri</td> <td>0,8478</td> </tr> <tr> <td rowspan="2"></td> <td rowspan="2">Eurotahvil -USD Ödemeli</td> <td>0-5 yıl</td> <td>0,89</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>5-10 yıl</td> <td>0,89</td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/End eks	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)	1	Altın		0,87	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	0,9796	100,00	100,00	1-5 yıl	0,84	5 yıl üzeri	0,8478		Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89			5-10 yıl	0,89		
Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/End eks	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)																																																																								
1	Altın		0,87	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	0,97	100,00	100,00																																																																								
		1-5 yıl	0,84																																																																										
		5 yıl üzeri	0,84																																																																										
	Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89																																																																										
		5-10 yıl	0,89																																																																										
Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/End eks	Değerleme Katsayısı	Grup Üst Limit Oran (%)	Kıymet Bazında Üst Limit Oran (%)																																																																								
1	Altın		0,87	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	0,9796	100,00	100,00																																																																								
		1-5 yıl	0,84																																																																										
		5 yıl üzeri	0,8478																																																																										
	Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89																																																																										
		5-10 yıl	0,89																																																																										

4		10-30 yıl	0,88	100,00	100,00	4		10-30 yıl	0,88	100,00	100,00
		30 yıl üzeri	0,86					30 yıl üzeri	0,86		
4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,89	100,00	100,00	4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,89	100,00	100,00
		5-10 yıl	0,85					5-10 yıl	0,85		
		10-30 yıl	0,72					10-30 yıl	0,72		
		30 yıl üzeri	0,72					30 yıl üzeri	0,72		
5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,95	100,00	100,00	5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,95	100,00	100,00
		1-5 yıl	0,82					1-5 yıl	0,82		
		5 yıl üzeri	0,82					5 yıl üzeri	0,82		
6	Pay	BIST-30	0,83	90,00	50,00	6	Pay	BIST-30	0,83	90,00	50,00
		BIST-100	0,79					BIST-100	0,79		
7	Nakit EUR		0,89	100,00	100,00	7	Nakit EUR		0,89	100,00	100,00
7	Nakit USD		0,90	100,00	100,00	7	Nakit USD		0,90	100,00	100,00
7	Nakit TL		1,00	100,00	100,00	7	Nakit TL		1,00	100,00	100,00
8	Banka Bonosu / Tahvili		0,73	50,00	40,00	8	Banka Bonosu / Tahvili		0,73	50,00	40,00
9	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00	9	Teminat Mektubu		1,00	100,00	100,00
10	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,95	50,00	40,00	10	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,95	50,00	40,00
		1-5 yıl	0,82					1-5 yıl	0,82		

Gizlilik Seviyesi: Halka Açık (Tasnif Dışı)

		5 yıl üzeri	0,82					5 yıl üzeri	0,82				
11	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,89	50,00	20,00			11	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,89	50,00	20,00