

Genel Mektup : 1951

İstanbul, 23/01/2024

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 Finansman 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 "Teminat yatırma, çekme ve değiştirme" başlıklı 27. Madde'de mevzuat yeknesaklığı kapsamında değişiklik yapılmıştır.

TPP Prosedürü'nde gerçekleştirilen güncellemelere ilişkin karşılaştırma tablosu ekte yer almakta olup, ilgili değişiklikler **24/01/2024** 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

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :TAKASBANK PARA PİYASASI (TPP) PROSEDÜRÜ KARŞILAŞTIRMA TABLOSU (4 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSDKPKDF25> Pin Kodu :

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +90 212 315 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



TAKASBANK PARA PİYASASI (TPP) PROSEDÜRÜ
KARŞILAŞTIRMA TABLOSU

Mevcut Hali	Yeni Hali
<p>Teminat yatırma, çekme ve değiştirme MADDE 27- ...</p> <p>(8) Pay, yatırım fonu katılma belgesi, banka bono/tahvil, varlığa dayalı menkul kıymet ve Borsa payı teminat işlemleri, MKK nezdindeki hesaplar üzerinde virman hareketi yaratır. Bu varlıklara ilişkin teminat yatırma işlemi yapılabilmesi için ilgili üyenin MKK nezdinde portföy hesabı (4 hesap sınıflı) veya yatırımcı hesabı (1 hesap sınıflı) bulunması gerekir.</p>	<p>Teminat yatırma, çekme ve değiştirme MADDE 27- ...</p> <p>(8) Pay, yatırım fonu katılma belgesi, banka bono/tahvil, varlığa dayalı menkul kıymet ve Borsa payı teminat işlemleri, MKK nezdindeki hesaplar üzerinde virman hareketi yaratır. Bu varlıklara ilişkin teminat yatırma işlemi yapılabilmesi için ilgili üyenin MKK nezdinde portföy hesabı (4 hesap sınıflı) veya yatırımcı hesabı (1 hesap sınıflı) bulunması gerekir.</p> <p><u>(9) Sabit getirili menkul kıymetlerin teminata kabulü için, menkul kıymetin tamamını temsil eden anapara ve kuponlarının birlikte teminata yatırılması gerekmektedir. Ayrıştırılmış sabit getirili menkul kıymetler teminata kabul edilmez. İtfa ve kupon ödemelerindeki operasyonel süreçler dikkate alınarak teminat seviyesinin korunması üyenin sorumluluğundadır.</u></p>

TAKASBANK PARA PİYASASI (TPP) PROSEDÜRÜ
KARŞILAŞTIRMA TABLOSU

Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları

MADDE 28-

Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/Endeks	Değerleme Katsay
1	Altın		0,87
2	Borsa Payları		1,00
3	Devlet İç Borçlanma Senedi – TL, USD ve EUR ödemeli	0-1 yıl	0,96
		1-5 yıl	0,84
		5 yıl üzeri	0,78
4	Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89
		5-10 yıl	0,89
		10-30 yıl	0,88
		30 yıl üzeri	0,86
4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,89
		5-10 yıl	0,85
		10-30 yıl	0,72
		30 yıl üzeri	0,72
5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	0,95
		1-5 yıl	0,82
		5 yıl üzeri	0,82
6	Pay	BIST-30	0,83

Teminat grupları, değerlendirme katsayıları ve üst limit oranları

MADDE 28-

Teminat Grubu	Teminat Tipi	Vade Kalan Süre/Endeks	Değerleme Katsayısı
1	Altın		0,87
2	Borsa Payları		1,00
3	Devlet İç Borçlanma Senedi – TL, USD ve EUR ödemeli	0-1 yıl	<u>0,9694</u>
		1-5 yıl	<u>0,8480</u>
		5 yıl üzeri	0,78
4	Eurotahvil -USD Ödemeli	0-5 yıl	0,89
		5-10 yıl	0,89
		10-30 yıl	0,88
		30 yıl üzeri	0,86
4	Eurotahvil / EUR Ödemeli	0-5 yıl	0,89
		5-10 yıl	0,85
		10-30 yıl	<u>0,7271</u>
		30 yıl üzeri	<u>0,7271</u>
5	Kira Sertifikası	0-1 yıl	<u>0,9592</u>
		1-5 yıl	<u>0,8278</u>
		5 yıl üzeri	<u>0,8276</u>
6	Pay	BIST-30	<u>0,8380</u>

TAKASBANK PARA PİYASASI (TPP) PROSEDÜRÜ
KARŞILAŞTIRMA TABLOSU

		BIST-100	0,79			BIST-100	0,79
7	Nakit EUR		0,89	7	Nakit EUR		0,89
7	Nakit USD		0,90	7	Nakit USD		0,90
7	Nakit TL		1,00	7	Nakit TL		1,00
8	Banka Bonosu / Tahvili		0,73	8	Banka Bonosu / Tahvili		0,73
9	Teminat Mektubu		1,00	9	Teminat Mektubu		1,00
10	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,95	10	Varlığa Dayalı Menkul Kıymet	0-1 yıl	0,9592
		1-5 yıl	0,82			1-5 yıl	0,8278
		5 yıl üzeri	0,82			5 yıl üzeri	0,8276
11	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,89	11	Yatırım Fonu Katılma Belgesi		0,89

TAKASBANK PARA PİYASASI (TPP) PROSEDÜRÜ KARŞILAŞTIRMA TABLOSU

Teminatlardan doğan haklar

MADDE 32-

...

(7) İtfa tarihinde teminat hesabında bulunan TL ödemeli devlet tahvili ve hazine bonoları, kira sertifikaları, varlığa dayalı menkul kıymetler ile banka bono ve tahvillerinin itfaları, teminat hesabında gerçekleştirilir ve itfa bedelleri üyenin teminat hesabına aktarılır. Döviz ödemeli devlet tahvili ve hazine bonolarının itfa bedelleri ise 11YP-Üye Serbest Hesabı'na aktarılır.

(8) Üyenin teminatında bulunan TL ödemeli devlet tahvili ve hazine bonoları, kira sertifikaları, banka bono ve tahvilleri, varlığa dayalı menkul kıymetler ile Euro tahvillerin kupon ödemeleri üyenin teminat hesabına aktarılır. Döviz ödemeli devlet tahvili ve hazine bonolarının kupon ödemeleri ise 11YP-Üye Serbest Hesabı'na aktarılır.

Teminatlardan doğan haklar

MADDE 32-

...

(7) İtfa tarihinde teminat hesabında bulunan TL ödemeli devlet tahvili ve hazine bonoları, kira sertifikaları, varlığa dayalı menkul kıymetler ile banka bono ve tahvillerinin itfaları, teminat hesabında gerçekleştirilir ve itfa bedelleri üyenin teminat hesabına aktarılır. Döviz ödemeli devlet tahvili ve hazine bonolarının itfa bedelleri ise 11YP-Üye Serbest Hesabı'na aktarılır. İtfa ödemelerindeki operasyonel süreçler dikkate alınarak teminat seviyesinin korunması üyenin sorumluluğundadır.

(8) Üyenin teminatında bulunan TL ödemeli devlet tahvili ve hazine bonoları, kira sertifikaları, banka bono ve tahvilleri, varlığa dayalı menkul kıymetler ile Euro tahvillerin kupon ödemeleri üyenin teminat hesabına aktarılır. Döviz ödemeli devlet tahvili ve hazine bonolarının kupon ödemeleri ise 11YP-Üye Serbest Hesabı'na aktarılır. Kupon ödemelerindeki operasyonel süreçler dikkate alınarak teminat seviyesinin korunması üyenin sorumluluğundadır.