



TAKASBANK

**SN.GENEL MÜDÜR, SERMAYE PİYASALARI VE FON
YÖNETİCİLERİNİN DİKKATLERİNE**

**Genel Mektup:963
Türev İşlemleri Piyasaları Takası
ve Teminat Yönetimi Müdürlüğü**

İstanbul, 02/07/2009

Değerli Üyemiz, Ortaklarımız,

Konu: Teminat tamamlama çağrısı yükümlülüğü karşılığı olarak Vadeli İşlem ve Opsiyon Borsası (VOB) hesaplarında bloke edilen kar alacaklarının çözülmesine ilişkin uygulama esaslarında yapılan değişiklik hk.

İlgi: 16/03/2006 tarih, 880 sayılı genel mektubumuz.

İlgi genel mektubumuzun hesap güncelleştirme, teminat tamamlama ve temerrüt işlemleri başlığı altında, teminat tamamlama yükümlülüğü olan üyelerin kar eden hesaplarına, ilgili teminat tamamlama çağrısı miktarı kadar bloke konulacağı ve kar alacaklarının yükümlülük tamamlanana kadar ödenmeyeceği belirtilmiştir.

Vadeli İşlem ve Opsiyon Borsası'nın (VOB) 01/07/2009 tarih ve 2009/89 No'lu Genelgesine uygun olarak, blokeli kar alacakları dağıtımına ilişkin aşağıdaki değişiklikler yapılmıştır:

VOB 2005/5 sayılı Takas ve Temerrüt Esasları Genelgesi "Hesapların Açılması" başlıklı 4. maddesi uyarınca, teminat tamamlama yükümlülüğü bulunan takas üyelerinin, blokeli kar alacaklarının serbest hale getirilmesini ve kar alacaklarının ilgili hesaplara dağıtılmasını sağlamak amacıyla, Takasbank nezdinde "Bloke Hesabı" adı verilen yeni bir hesap açılmıştır. Söz konusu hesap, Takasbank sisteminde üye detayı bazında "VKBLK" hesap tipinde tanımlanmıştır.

VOB 2005/6 sayılı Teminatlandırma ve Diğer Risk Yönetimi Esasları Genelgesinin "Nakit Teminatların Nemalandırılması" ile ilgili 8. maddesinde yapılan değişikliğe göre "bloke hesabı"ndaki nakit teminatlar nemalandırılmayacaktır.

İMKB TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

120

VOB 2005/5 sayılı Takas ve Temerrüt Esasları Genelgesinin “Hesap Güncelleştirme İşlemleri” başlıklı 6. maddesine eklenen v. bende göre üyelerimiz, blokeli kar tutarlarının çözülmesini sağlamak amacıyla “**Bloke Hesabı**”na nakit yatırabilirler. Bloke hesabına nakit yatırıldıkça, kar tutarının üzerindeki blokaj, bloke hesabındaki bakiye kadar kaldırılır ve bloke konulmuş kar alacakları ilgili hesaplara aktarılır. Bloke hesap kullanılarak yapılacak kar alacaklarının aktarımı, 6. madde iii ve iv no’lu bentlerinde belirlenen sıralamaya uygun olarak gerçekleştirilir.

Üyelerin “önceki margin call” (ÖMC) yükümlülüğü devam ettikçe, bloke hesaptan ÖMC değeri kadar nakit tutar çekilmesine izin verilmez.

Aynı Genelgenin “Genel Temerrüt Esasları” ile ilgili 7.1 no’lu maddesine eklenen i bendi ve 2005/7 sayılı “Garanti Fonu Kullanım Esasları Genelgesi”nin 5. maddesi uyarınca, üye bloke hesabındaki bakiye, portföy veya müşteri hesaplarının temerrüt yükümlülüğünün kapatılmasında Takasbank tarafından re’sen kullanılabilir.

Üyelerimiz, blokeli kar alacakların çözülmesine ilişkin revizyonları içeren ve aşağıda belirtilen yeni yazılımı 02/07/2009 tarihinden itibaren “Yükle_ASE 4.0” programını kullanarak veya internetten “www.takasbank.com.tr” adresinden yükleyebileceklerdir. 06/07/2009 tarihinden itibaren yeni yazılımlar kullanılacağından, üyelerimizin işlemlerde sorun yaşanmaması için, 06/07/2009 tarihine kadar yeni yazılımları kendi terminallerine aktarmış olmaları gerekmektedir.

Paket İsmi	Açıklaması
VOB43	Bloke İşlemleri

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İ.M.K.B.
TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Dr. Emin ÇATANA Dr. Sezai BEKGÖZ
Genel Müdür Genel Müdür Yrd.

Yönetim Kurulu Üyesi