



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

Genel Mektup: 1074
Türev Araçlar Takas Müdürlüğü

İstanbul, 13/07/2012

Değerli Üyemiz, Ortaklarımız,

Konu : Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri kapsamında, piyasa yapıcı kurumlar ile işlem aracı kurumlar arasındaki iş akışlarına ve operasyonel süreçlere imkan verecek yapıya ilişkin güncellemeler ve TakasMenuWeb uygulaması hk.

Sermaye Piyasası Kurulu (SPK)'nın Seri: V No:125 sayılı "*Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri ve Bu İşlemleri Gerçekleştirebilecek Kurumlara İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ*"'inin 2'inci maddesinin birinci fıkrasının (a) bendi kapsamında piyasa yapıcılığı kapsamında faaliyette bulunacak aracı kurumlar ve bu aracı kurumlar ile aynı fıkranın (b) bendi kapsamında işlem aracılığı faaliyetinde bulunacak aracı kurumların müşterilerine ait hesapların açılması, teminat yatırma/çekme hareketlerinin gerçekleştirilmesi ve işlem bildirimlerinin iletilmesini sağlamak amacıyla Takasbank nezdinde yapılan çalışmalar sonlandırılmıştır.

16/07/2012 tarihinde yapılacak geçiş ile birlikte teminat yatırma/çekme işlemlerinde ve işlem bildirimlerinde mevcut dosya düzenleri kullanılmayacak olup, hali hazırda işlemlerine devam eden üyelerimizin de, operasyonel süreçlerde kullanılacak olan dosyaları, örnekleri sunulan düzenler kapsamında oluşturmaları gerekmektedir. İşlem aracı kurumlar ve piyasa yapıcı kurumlar arasında gerçekleştirilmesi gereken iş akışı aşağıda yer almaktadır.

A. Yapılacak Revizyonlar Sonucunda Piyasa Yapıcı Kurumlar ile İşlem Aracı Kurumlar Arasında Gerçekleşecek Olan Süreç

- 1) İşlem aracı kurum, müşterilerine ait hesapları öncelikle Merkezi Kayıt Kuruluşu (MKK) nezdinde açarak, sicil tanımlama işlemini gerçekleştirir. MKK'da tanımlanan hesabın Bankamız'a ulaşması için "*Vadeli İşlem Yetkisi*"nin "Y" (Evet) olarak seçilmesi zorunludur. İşlem aracı kurum daha sonra MKK'dan gelen sicil ve hesap bilgilerini kullanarak yatırımcı adına gerekli hesabı, Bankamız KASİ sisteminde kendi üye kodu altında açacaktır.
- 2) Piyasa yapıcısı kurum, işlem aracı kurum adına MKK'da tüzel bir kimlik ile eşleştirdiği hesaplar ile Takasbank KASİ sisteminde global hesap/hesaplar açacaktır.

- 3) İşlem aracı kurum, kaldıraçlı alım satım işlemi yapmak isteyen yatırımcılara ait hesap numaralarının hangi piyasa yapıcı global hesabına bağlı çalışacağı bilgisini eşleştirme talimatı dosyası ile sisteme tanımlayacaktır. Talimat doğrulaması işleme aracı üye tarafından yapılacak, piyasa yapıcı üye onayından sonra ilgili eşleşme işlemi gerçekleşmiş olacaktır. Eşleştirme tanımlama işlemi “G” Giriş; mevcut eşleştirmenin iptali ise “I” İptal işlem tipi ile gerçekleştirilecektir. Piyasa yapıcı üyeye ait bir global hesap sadece bir işleme aracı üyenin hesap/hesapları ile eşleştirilebilir.
- 4) İşlem aracı kurum, yatırımcılara ait işlem teminatlarını toplu halde, piyasa yapıcı kuruma iletecek, piyasa yapıcı kurum, kendi nezdindeki global hesapların teminat bakiyelerini güncelleyecektir. Yatırımcıların yaptığı tüm işlemlere ait elektronik kayıtlar da piyasa yapıcısı kurum tarafından Bankamız’a iletilecektir. Piyasa yapıcı kurum ilgili bildirimleri ve teminat hareketlerini gerçekleştirirken, Takasbank KASİ sistemi ekranları aracılığı ile okutacağı dosyalarda, işlem aracı kurum ait global hesap numarası ile, yatırımcıya ait alt hesap numaralarına da yer verecektir.
- 5) Piyasa yapıcısı kurumun gerçekleştirdiği teminat hareketlerine ve işlem bildirimlerine ait kayıtlar, işlem aracı kurum adına, sistem tarafından otomatik olarak kaydedilecektir. Bu sayede, işlem aracı kurumlar Takasbank ekranları aracılığı ile piyasa yapıcı kurumda gerçekleştirdikleri işlem ve teminat bilgilerini, yatırımcılar ise Takasnet üzerinden piyasa yapıcı kurum nezdindeki global hesapta bulunan kendilerine ait teminat bilgilerini raporlayabileceklerdir.

B. Geçiş Sonrasında Kullanılması Gereken Dosya Düzenlerine İlişkin Örnekler

1. Hesap Eşleştirme Dosyası

Saha Sıralaması: Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Üye Hesap No, Talimat Tipi

Alan Açıklamaları:

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Eşleşmeye konu piyasa yapıcı üyenin TVS nezdindeki kodu. Giriş zorunludur.

Piyasa Yapıcı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Eşleşmeye konu piyasa yapıcı üye müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Eşleşmeye konu işleme aracı üyenin TVS nezdindeki kodu. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Eşleşmeye konu işleme aracı üye müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

Talimat Tipi: (1 karakter, alfabetik) İlgili eşleşme işleminin tipi. G:Giriş, I:İptal. Giriş zorunludur.

Örnek: Dosya Adı: FEYYAAGG.XXX

YYY,1,XXX, 2, G

ZZZ, 2, XXX, 1, G

ZZZ, 3, XXX, 4, I

2. Teminat Yatırma Çekme Dosyası:

Saha Sıralaması : Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Hesap No, Teminat Tipi, Teminat Kodu, Grup, Adet/Tutar, İşlem Kodu

Örnek: Dosya Adı: FTYYAAGG.ABC

ABC,1,XYZ,12486,DVZ,USD,,1547.51,Y

ABC,1,XYZ,12486,DVZ,EUR,,2152.87,C

3. İşlem Bildirimi Dosyası:

Saha Sıralaması : Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Hesap No, İşlem No, İşlem Türü, İşlem Tarihi, İşlem Tipi, İşlem Tutarı, Lot Sayısı, Dönüşüm Oranı, İşlem Hacmi, Kaldıraç Oranı, Teminat Tipi, Varlık, Fiyat, Sistem Fiyatı, Fiyat Alt Limit, Fiyat Üst Limit, Pozisyon Kapanış Tarihi, Kapanış Fiyatı, Komisyon, Vergi, Swap, Kar/Zarar

Örnek : Dosya Adı: FIYYAAGG.ABC

ABC,1,XYZ,12486,111,PA,20120611 17:52:05,1,10000,1,1.2561,12561,USD,
EURUSD,.....

Alan Açıklamaları (yeni eklenen alanlar için):

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: Piyasa yapıcı aracı kurum kodu,

Piyasa Yapıcı Hesap No: Piyasa yapıcı aracı kurum nezdindeki, ilgili işlem aracısı kurum adına açılmış global hesabın numarası,

İşleme Aracı Üye Kodu: İşlem aracısı kurum kodu,

İşleme Aracı Hesap No: İşlem aracısı kurumun müşterisine ait hesap numarası.

4. Müşteri ve Portföy Hesapları İçin Kullanılması Gereken Düzen

Teminat Yatırma / Çekme İşlemleri:

ABC,888,ABC,888,DVZ,USD,,1354.46,Y

İşlem Bildirimi:

ABC,888, ABC,888,222,PA,20120611 15:05:10,1,10000,1,1.2611,12111,USD,EURUSD, ...

C. TakasMenuWeb Uygulaması

Bununla beraber, 16/07/2012 tarihinde yapılacak geçiş ile birlikte **Takasbank terminallerindeki (Takasmenu23) Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Uygulaması kullanılmayacak olup,** yalnızca Takasbank Intranet ağına bağlı **(TakasMenuWeb)**

bilgisayarlardan Takasbank Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Web Uygulamasına erişim mümkün olacaktır.

Takasbank Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Web Uygulamasını kullanabilmek için daha önce 1037 ve 1044 numaralı Genel Mektuplar ile duyurulmuş genel şartların yerine getirilmiş olması gerekmektedir. Genel şartlar yerine getirilmiş ve masaüstünde **TakasMenuWeb** ikonu yer alıyor ise herhangi bir işlem yapılması gerekmemektedir.

PC'nizin masaüstünde **TakasMenuWeb** kısayolundan bağlanarak Takasbank Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Web uygulamasına erişim sağlanacaktır.

TakasMenuWeb kısayolundan sistemimize daha önce **bağlanılmamış** ise öncelikle mevcut (**Takasmenu23**) ikonundan kullanıcı kodu ile şifre değiştirme işleminin gerçekleştirilmesi zorunludur. Yeni oluşturulacak şifrenin **en az 8 karakterli** olması, şifre içinde **en az 3 rakam**, **en az bir büyük harf** ve **en az bir küçük harfin** yer alması gerekmektedir. **Takasmenu23**'te oluşturulan yeni şifre ile (Takasmenu23'ün yeni şifresi olarak kalacaktır) **TakasMenuWeb** ikonundan giriş yapılacak ve tekrar şifre değiştirme ekranına yönlendirme yapılarak uygun şartlarda (en az 8 karakterli olması şifre içinde en az 3 rakam, en az bir büyük harf, en az bir küçük harf) şifre yaratma işlemi gerçekleştirildikten sonra menüye giriş sağlanabilecektir.

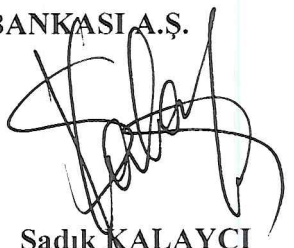
Kaldıraçlı alım satım işlemlerine ilişkin üye ekranları kullanıcı kılavuzuna; internetten <http://www.takasbank.com.tr/> adresinde Üyelik İşlemleri/Özel İşlemler adımı takip edilerek Üye Girişinden ulaşılabilir veya helpdesk@takasbank.com.tr adresine e-posta gönderilerek talepte bulunulabilir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

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


Sezai BEKGÖZ
Genel Müdür Yrd.


Sadık KALAYCI
Türev Araçlar Takas
Müdürü