

İstanbul, 17/02/2014

Genel Mektup: 1155
Türev Araçlar Takas Ekibi

Konu: Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Geçişi ve Takasbank Ekranları

İlgili: Aracı Kurumlar
Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere Bankamız, 3 Mart 2014 tarihinden itibaren Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasasında (VİOP) "Merkezi Karşı Taraf" hizmetini vermeye başlayacaktır. VİOP'a ilişkin Bankamız nezdinde yürütülen takas, teminat ve risk yönetimi çalışmaları tamamlanmış, üyelik işlemleri ve iş kurallarına ait değişiklikler 07.01.2014 tarihli, 1150 No'lu Genel Mektup ile duyurulmuştur.

Hizmete ilişkin olarak, riske maruz değer (RMD) bazlı limit kontrolünün yapılabilmesi için her üyenin mutlaka bir portföy hesabı bulunması gerektiğinden, üyelerimizin;

- Portföy hesapları yoksa mutlaka bir adet portföy hesabı açmaları,
- Halihazırda birden fazla portföy hesapları varsa, herhangi bir pozisyon ve teminat bulunmayan portföy hesaplarını kapatmaları,
- Pozisyon bulunmayan fakat teminat bakiyesi olan portföy hesaplarını, teminat çıkış işlemlerini gerçekleştirdikten sonra kapatmaları,
- Pozisyon ve teminat bulunan portföy hesaplarının aktarılacağı, kendi sicillerine ait bir çoklu (global) hesap açmaları (üye siciline ait en az bir çoklu hesap mevcut değilse),
- Aktarıma konu olacak portföy hesabı numaraları ile aktarımın yapılacağı çoklu hesap numarasını belirten yazılı ve ıslak imzalı talimatı Türev Araçlar Takas Ekibi'ne iletmeleri,
- Aktarılan pozisyonların alt hesap bazında dağıtımının yapılabilmesi için, Merkezi Kayıt Kuruluşu (MKK) nezdinde, hesap numaraları kapatılan ya da aktarıma konu olan portföy hesabı numaralarından farklı olacak şekilde yeni hesaplar açmaları ve MKK nezdinde açılan yeni hesapların aktarıma konu olan çoklu hesabın alt hesapları şeklinde tanımlanması,
- Pozisyon ve teminat aktarımlarının Bankamız tarafından gerçekleştirilmesini takiben, çoklu hesapta yer alan pozisyonların alt hesaplara aktarılması işlemini gerçekleştirmeleri (Takasbank ekranlarını kullanarak Dosya ile Çoklu Hesap Pozisyon Aktarım ya da ekrandan Çoklu Hesap Pozisyon Bildirim işlemleri yoluyla),
- Yazılı talimatın gönderilmesini müteakip yukarıda belirtilen işlemleri 28 Şubat 2014 tarihi itibarıyla tamamlamaları gerekmektedir.

Bununla birlikte, VİOP'ta kullanılacak Bankamız yazılımlarında aşağıda belirtilen güncellemeler yapılmış olup, revize edilen ekranlara ilişkin bilgiler ana hatlarıyla aşağıda belirtilmiştir:

1. Garanti Fonu İşlemleri

- Özsermayesi 10.000.000 TL'sından daha az olan üyelerin, ilave garanti fonu teminatı yükümlülüklerini takip edebilmeleri amacıyla, Garanti Fonu Teminat İzleme Detay Ekranı'na "TL Ek Teminat" ve "Diğer Ek teminat" alanları eklenmiştir.

9

2. Piyasa İşlemleri

- Üyelerimizin, Bankamız tarafından tahsis edilmiş olan RMD bazlı risk limitini aşmaları durumunda talep edilecek ilave teminat tutarını takip edebilmeleri amacıyla, hesap bazındaki ve üye bazındaki Netleştirme Durum Raporu'na "Ek Teminat" bilgisini içeren sütun eklenmiştir.
- Üyeye ait bulunması gereken teminat detayı (SPAN teminatı, opsiyon kullanım teminatı ve ek teminat) ile RMD bazlı risk limitini gösteren Teminat Gereksinim Raporu eklenmiştir.
- Hesap Risk Durum Log Raporu'ndaki "Bulunması Gereken Teminat" kolon başlığı "Sürdürme Teminatı" olarak değiştirilmiştir.
- Teminat Yatırma/Çekme ve Dosya Aktarım işlemlerinde istenen virman şifreleri kaldırılmıştır.
- Global Hesap Fark Raporu'nda sütun başlık isimleri (BİAŞ Uzun, BİAŞ Kısa) değiştirilmiştir.
- Kontrat İzleme Raporu'na yeni kısıt alanları olarak "Kontrat Tipi" ve "Dayanak Varlık" seçenekleri eklenmiştir.
- İşlem Bilgileri Raporu'na "Büyükük" ve "Durum" bilgilerini içeren sütunlar eklenmiştir.

Üyelerimizin, hazırlanan IVP32 paketini, <https://www.takasbank.com.tr/yukle> internet adresinde yer alan IVP32.exe dosyasını indirerek yüklemeleri gerekmektedir. Üyelerimiz belirtilen adrese web uygulamalarında kullandıkları kullanıcı ve şifreleri ile girebilirler. Kullanıcı kodu **takasdom\kullanıcı kodu** şeklinde girilmelidir.

Bahse konu paketi yüklemeyen üyelerimizin, 24/02/2014 tarihinden itibaren eski sürüm üzerinden çalışmaları mümkün olmayacaktır. IVP32 paketi 20/02/2014 tarihinden itibaren yüklenebilir. Yüklenecek paket ismi ve açıklaması aşağıda belirtilmiştir.


Paket İsmi	Açıklaması
IVP32	IVP MKT Revizyonları

Takasbank uygulamalarına ilişkin kullanıcı kılavuzlarına, www.takasbank.com.tr adresinde yer alan "Takas Web Giriş/Özel İşlemler" bölümünden ya da ube@takasbank.com.tr mail adresinden ulaşılabilir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.


Sezai BEKGÖZ
Genel Müdür Yardımcısı


Murat ULUS
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi