

İstanbul,12/10/2016

Genel Mektup: 1307
Borçlanma Araçları Takas Ekibi

KONU: Borsa İstanbul Para Piyasası takas işlem ve ücretleri

İlgili: Aracı Kurumlar
Bankalar
Katılım Bankaları
Kolektif Yatırım Kuruluşları

Sayın Genel Müdür,

Sermaye Piyasası Kurulu'nun 07/10/2016 tarih ve 27 sayılı toplantısında onaylanan "İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul Para Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Yönergesi" çerçevesinde Bankamız Borsa İstanbul Para Piyasası'nda Merkezi Karşı Taraf olarak hizmet vermeye başlayacak olup Piyasa'nın uygulamaya geçiş tarihi 14/10/2016 olarak belirlenmiştir.

Borsa İstanbul Para Piyasası'nda T günü gerçekleşen işlemler için T+1 günü belirlenen takas ve teminat işlemlerine ilişkin saatler aşağıdaki gibidir.

İşlem Türü	Saat
Takas başlangıç saati	15:00
Takas son saat	16:30
Teminat tamamlama son saati	15:00

Üyelerimizin Piyasa'da işlem yapabilmeleri için 07/10/2016 tarih ve 1306 sayılı Genel Mektubumuz ile duyurulan üyelik prosedürlerini yerine getirmesi gerekmektedir.

Söz konusu prosedürleri yerine getiren ve Bankamızca Borsa Para Piyasası MKT üyeliğine kabul edilen kurumlara tahsis edilen üst işlem limitleri yazılı olarak bildirilecektir. Üyeliğe kabul edilen kurumların asgari garanti fonu katkı payı yükümlülüğünü de yerine getirmesi gereklidir. Piyasada asgari garanti fonu katkı payı büyüklüğü 50.000 TL olarak belirlenmiştir. Ayrıca piyasada emir öncesi risk yönetimi uygulaması yapılacağından, emir iletiminin sağlanabilmesi için üyelerin teminat hesaplarında yeterli serbest bakiyenin bulunması gereklidir. Üyeler, 14.10.2016 tarihinde yatırdıkları teminat olarak değerlendirilmiş tutarın, işlem öncesi risk parametresine bölünmesi suretiyle bulunan işlem limiti kadar piyasaya emir iletimi gerçekleştirebileceklerdir. Piyasada uygulanacak risk ve teminat yönetimi parametreleri Ek:1'de yer almaktadır. Teminat yatırma ve çekme süreçleri ile risk ve teminat hesaplamalarına ilişkin olarak tereddüt edilen hususlar için Ek:2'de verilen telefonlardan bilgi alınabilecek ya da sorular belirtilen elektronik posta adreslerine iletebilecektir.

Piyasaya ilişkin takas ve teminat işlemleri aşağıda detayı verilen ve Borçlanma Araçları Menüsü altında yer alan menüler üzerinden gerçekleştirilecek ve raporlanabilecektir.

- *Borçlanma Araçları İşlemleri/ BİAŞ Para Piyasası Teminat İşlemleri*
- *Borçlanma Araçları İşlemleri/ BİAŞ Para Piyasası Garanti Foru*
- *Borçlanma Araçları İşlemleri/ BİAŞ Para Piyasası Takas İşlemleri*

Diğer taraftan; Bankamızca yapılacak ikinci bir duyuruya kadar bu Piyasa için verilecek mahsup talimatlarının Prosedürde yer alan süreler gözetilerek yazılı olarak 0212 315 22 15 nolu faksa ya da bat@takasbank.com.tr elektronik posta adresine iletilmesi gerekmektedir.

Sermaye Piyasası Kurulu tarafından onaylanan "İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul Para Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Yönergesi" ile iş kurallarını ve uygulama esaslarını belirleyen "İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul Para Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü" Bankamız internet sitesi (www.takasbank.com.tr) üzerinden yayımlanmıştır.

Piyasa'nın açılması ile birlikte yürürlüğe girecek olan ve Bankamız 23/08/2016 tarih ve 310 sayılı Yönetim Kurulunda kabul edilen ve Sermaye Piyasası Kurulu'nun 07/10/2016 tarih ve 27 sayılı toplantısında onaylanan takas ve teminat saklama ücretine ilişkin tablo aşağıda yer almaktadır.

Hizmet Adı	Ücret Bazı	Ücret/Oran*	Açıklamalar
Borsa İstanbul Para Piyasası Takas Ücreti	İşlem hacmi	Milyonda 1 x vade süresi	-Ücret Alıcı ve Satıcı taraftan olmak üzere ayrı ayrı tahsil edilir -Hesaplama işlemin başlangıç valöründe vade süresi de dikkate alınarak yapılır. -Ücret işlemin başlangıç valöründe tahakkuk eder. -Tahsilat tahakkuku izleyen ay yapılır.
Borsa İstanbul Para Piyasası Teminat Saklama Ücreti	Nominal değer/tutar (Yıllık)	% 0,01 (On binde bir)	-Döviz cinsinden alınan teminatların saklama ücreti hesaplanırken TCMB tarafından ayın son iş gününe ait döviz alış kuru baz alınır. -Tahsilat tahakkuku izleyen ay yapılır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.


Gökhan ELİBOL
 Genel Müdür Yardımcısı


Mahmut KAYACIK
 Genel Müdür
 Yönetim Kurulu Üyesi

Ek 1: Borsa İstanbul Para Piyasası'nda risk ve teminat yönetimi hesaplamalarında uygulanması öngörülen parametre tablosu
Ek 2: İrtibat bilgileri

Ek:1

PARA PİYASASI İŞLEMLERİNDE KULLANILACAK RİSK VE TEMİNAT PARAMETRELERİ	
1) İŞLEM ÖNCESİ RİSK PARAMETRESİ	
İŞLEM ÖNCESİ RİSK PARAMETRESİ	5%
2) BAŞLANGIÇ TEMİNATI RİSK PARAMETRESİ	
BAŞLANGIÇ TEMİNATI RİSK PARAMETRESİ	5%
3) TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYILARI	
TL	100%
DÖVİZ	95%
DİBS-KİRA SERTİFİKALARI (0-3 YIL)	95%
DİBS-KİRA SERTİFİKALARI (3+ YIL)	90%
4) TEMİNAT DÖNÜŞÜM PARAMETRESİ	
TEMİNAT DÖNÜŞÜM PARAMETRESİ	5%
5) ALACAK DAĞITIM PARAMETRESİ	
ALACAK DAĞITIM PARAMETRESİ	10%
6) GF KATKI PAYI HESAPLAMASINDA KULLANILAN RİSK KATSAYISI	
GF KATKI PAYI HESAPLAMASINDA KULLANILAN RİSK KATSAYISI	0.50%



Ek:2

İrtibat Bilgileri:

Konu	İlgili Ekip	Telefon No	Mail Adresi
Risk ve Teminat Hesaplama, Garanti fonu	Merkezi Karşı Taraf Bölümü	0212 315 22 66 0212 315 22 51	mkt@takasbank.com.tr
Takas, Teminat Yatırma ve çekme	Borçlanma Araçları Takas Ekibi	0212 315 20 67 0212 315 20 76 0212 315 21 78 0212 315 23 12	bat@takasbank.com.tr