

Genel Mektup : 1389
TÜREV ARAÇLAR TAKAS EKİBİ

İstanbul, 20/12/2017

Konu Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri (KASİ) Prosedürü'nde Yapılan
Değişiklikler Hk.
İlgili Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ değişikliği kapsamında İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'nin Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Teminat ve Raporlama Hizmeti Prosedürü'nde (Prosedür) güncellemeler yapılmıştır.

Prosedürde yapılan değişiklikler ekli tabloda (Ek) özet olarak verilmekte olup değişiklik sonrası Prosedürün son haline web sitemizde "Kaynaklar" başlığı altındaki Prosedürler bölümünden erişilebilmektedir (<http://www.takasbank.com.tr/tr/Sayfalar/Prosedurler.aspx>).

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

GÖKHAN ELİBOL
GENEL MÜDÜR YRD.

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :Prosedür Değişikliği Karşılaştırma Tablosu (4 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/envision-external/belgedogrulama.aspx?V=BEK4P2D3>

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi, Özborsa Caddesi, No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +09 212 315 25 25 F +90 212 315 25 26 www.takasbank.com.tr Kep Adresi : takasbank.haberlesme@hs03.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



Ek: Prosedür Değişikliği Karşılaştırma Tablosu

Mevcut	Yeni	Açıklama
Tanım ve kısaltmalar MADDE 4	Tanımlar ve kısaltmalar MADDE-4 (1) Bu Prosedürün uygulanmasında; a) Brüt Varlık: Kaldıraçlı alım satım işlemlerinde müşteriler tarafından yatırılan ve çekilen teminatlar ile yalnızca kapanan pozisyonların kar/zarar tutarları dikkate alınarak hesaplanan bakiyeyi, d) Net Varlık: Kaldıraçlı alım satım işlemlerinde müşteriler tarafından yatırılan ve çekilen teminatlar ile açık ve kapanan tüm pozisyonların kar/zarar tutarları dikkate alınarak hesaplanan varlığı,	20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete 'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ değişikliği kapsamında brüt/net varlık tanımları eklenmiştir.
Piyasa yapıcı kurumların hesap işlemleri MADDE 8	Piyasa yapıcı kurumların hesap işlemleri MADDE 8 (4) Piyasa yapıcı kurumlar için Takasbank tarafından otomatik olarak üye bazında YEDEKTEM adı verilen teminat yedekleri hesabı açılmaktadır. (5) Piyasa yapıcılara yönelik hesap eşleştirme dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.	20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete 'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ değişikliği kapsamında Teminat yedekleri hesabı dile getirilmiştir. Hesap eşleştirme dosya örneğini içeren ek bilgisi belirtilmiştir.
İşlem detaylarının bildirilmesi MADDE 11	İşlem detaylarının bildirilmesi MADDE 11 (4) Örnek işlem bildirim dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.	Örnek dosya bilgisi eklenmiştir.
Müşteri teminatlarının Takasbank'a yatırılması ve çekilmesi MADDE 13 (4) Piyasa yapıcılara yönelik hesap eşleştirme dosyası, teminat yatırma/çekme dosyası ve örnek işlem bildirim dosyası içeriği ekte (Ek.4) verilmektedir.	Müşteri teminatlarının Takasbank'a yatırılması ve çekilmesi MADDE 13 (4) Teminat yatırma/çekme dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.	Örnek dosya ek numarası revize edilmiştir. Diğer dosya örnekleri bilgisi ilgili bölümlere (bkz. Madde 8 ve Madde 11) eklenmek üzere silinmiştir.

<p>Teminat güncelleme işlemleri MADDE 14</p>	<p>Teminat güncelleme işlemleri MADDE 14</p> <p>(2) Müşterilerden alınan teminat tutarlarının raporlama anı itibarıyla;</p> <p>(a) Müşterilerin yatırılan ve çekilen teminatlar ile açık ve kapanan tüm pozisyonların kar/zarar tutarları dikkate alınarak hesaplanan net varlığı Takasbank nezdinde müşteriler adına açılan alt hesaplara,</p> <p>(b) Müşterilerin yatırılan ve çekilen teminatlar ile yalnızca kapanan pozisyonların kar/zarar tutarları dikkate alınarak hesaplanan brüt varlık tutarlarının net varlık tutarlarını aşan kısmı ise Takasbank nezdinde aracı kurumlar adına açılacak kaldıraçlı işlemler teminat yedekleri (YEDEKTEM) hesabına en geç ertesi iş günü içerisinde Takasbank tarafından belirlenen işlem saatlerine uygun şekilde günlük olarak aktarılır.</p>	<p>20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ’de, kaldıraçlı işlemlerde teminatların izlenmesi ve raporlanması bölümünde yapılan değişiklik yansıtılmıştır.</p>
	<p>Brüt ve Net Varlık tutarlarının Takasbank’a bildirilmesi</p> <p>MADDE 15- (1) Yetkili kuruluşlar alt hesap bazında brüt varlık tutarlarını ve açık pozisyonlarından kaynaklanan kar/zarar tutarlarının yansıtıldığı net varlık tutarlarını Takasbank sistemine günlük olarak bildirmekle yükümlüdür.</p> <p>(2) Bildirimin en geç teminat çağrısı yapılmadan önce yapılması gerekmektedir.</p> <p>(3) Bildirim gün içinde birden çok yapılabilir ancak teminat tamamlama çağrısı hesabında en son bildirilen tutarlar ve teminat yedekleri hesabındaki bakiye esas alınır.</p> <p>(4) Brüt/net varlık bildirimlerinde bulunması gereken asgari unsurlar ekte (Ek.4) verilmektedir.</p> <p>(5) Brüt/net teminat dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.</p>	<p>20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ ile yapılan değişiklik kapsamında brüt/net varlık bildirim iş akışı yeni bir madde olarak eklenmiştir.</p>

	<p>Teminat yedekleri hesabında eksik kalan tutarların tamamlanması ve fazla tutarların çekilmesi</p> <p>MADDE 16- (1) Takasbank nezdinde yetkili kuruluş adına açılacak teminat yedekleri hesabındaki tutar, üyenin toplam brüt varlık tutarlarının toplam net varlık tutarlarını aşan kısmının %50'sinden az olamaz.</p> <p>(2) Eksik tutar için Takasbank tarafından yetkili kuruluşa gün içinde 16:00'da teminat çağrısı yapılır. Teminat çağrısına konu tutar TL olarak raporlanır ancak eksik kalan tutarı tamamlama işlemi TL, USD ve EUR para birimlerinde yapılabilir. USD ve EUR para birimleri cinsinden kapatılan teminat çağrısı tutarı bir gün önce 15:30'da duyurulan TCMB alış kuru ile değerlendirilerek TL cinsinden raporlanır.</p> <p>(3) Teminat yedekleri hesabındaki brüt varlık tutarlarının net varlık tutarları arasındaki farkın %50'sini aşan tutar yetkili kuruluş tarafından çekilebilir.</p> <p>(4) Teminat tamamlama çağrısına konu yükümlülüklerin bildirildiği gün içerisinde teminat yedekleri hesabına yatırılması gerekir. Yatırma işlemlerinde Madde 19'da verilen teminat yatırma son saatleri dikkate alınır.</p>	<p>20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete 'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ ile yapılan değişiklik kapsamında teminat yedekleri hesabı için yapılan teminat çağrısı tutarı ve kapatılması ile ilgili iş akışı yeni bir madde olarak eklenmiştir.</p>
MADDE 15	MADDE 17	Madde numarası değişikliği
MADDE 16	MADDE 18	Madde numarası değişikliği
İşlemlerin Bildirim Zamanı MADDE 17	İşlemlerin bildirim zamanı MADDE 19 (*) Teknik nedenlerden dolayı Takasbank tarafından saatlerde değişiklik yapılması durumunda söz konusu değişen saatler esas alınır.	Madde numarası değişikliği yapılmıştır. Teknik sebeplerden dolayı olası bir aksaklık durumunda bildirim/güncelleme saatleri için açıklama getirilmiştir.
Tatil gününde yapılan işlemlerin bildirim MADDE 18- (1) Resmi tatil günleri ve hafta sonlarında herhangi bir teminat yatırma/çekme işlemi ve işlem bildirimini yapılmaz. Bu günlerde yapılan teminat güncelleme işlemleri ve işlem bildirimleri izleyen ilk iş günü gerçekleştirilir.	Tatil gününde yapılan işlemlerin bildirim MADDE 20- (1) Resmi tatil günleri ve hafta sonlarında herhangi bir teminat yatırma/çekme işlemi, brüt/net varlık ve işlem bildirimini yapılmaz. Bu günlerde yapılan teminat güncelleme işlemleri ve işlem bildirimleri izleyen ilk iş günü gerçekleştirilir.	20.10.2017 tarihli ve 30216 sayılı Resmi Gazete 'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ ile yapılan değişiklik kapsamında brüt/net varlık tutarı bildirim de diğer bildirimler gibi ele alınmıştır.

MADDE 19	MADDE 21	Madde numarası deęişikliği
MADDE 20	MADDE 22	Madde numarası deęişikliği
MADDE 21	MADDE 23	Madde numarası deęişikliği
	Ek.4: Brüt/Net Teminat Dosya Aktarımında Asgari Unsurlar	Brüt/Net Teminat Dosyası asgari unsurları Ek.4 olarak eklenmiştir.
Ek.4: Piyasa Yapıcı Kurumlarla İşlemlere İlişkin Dosya Düzeni ve Bildirim Esasları	Ek.5: Piyasa Yapıcı Kurumlarla İşlemlere İlişkin Dosya Düzeni ve Bildirim Esasları	Ek numarası deęişikliği yapılmıştır. Brüt/Net Teminat Dosyası örneęi eklenmiştir.