

Genel Mektup : 1403  
TÜREV ARAÇLAR ve ENERJİ EMTİA TAKAS BÖLÜMÜ

İstanbul, 06/02/2018

Konu İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'nin Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmeti ve Bu hizmete İlişkin Takas Esasları Prosedürü'nde Yapılan Değişiklikler  
İlgili Aracı Kurum ve Bankalar

Sayın Genel Müdür,

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'nin Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmeti ve Bu hizmete İlişkin Takas Esasları Prosedürü'nde (Prosedür) değişiklikler yapılmış olup, düzenlemeler 07.02.2018 tarihi itibarıyla uygulamaya alınacaktır.

Prosedür'de yapılan değişiklikler özet olarak ekte (Ek) verilmekte olup, Prosedür'ün son haline web sitemizden, Mevzuat başlığı altındaki Prosedürler bölümünden erişilebilmektedir (<https://www.takasbank.com.tr/tr/mevzuat/prosedurler>).

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 :VIOP Prosedür Degisikligi Tablosu\_06022018 (3 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/envision-external/belgedogrulama.aspx?V=BE8VUZ21>

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul 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: “İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.’nin Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası’nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmeti ve Bu hizmete İlişkin Takas Esasları Prosedürü” Değişiklik Tablosu**

Madde İçeriği – Mevcut	Madde İçeriği - Yeni																		
<p><b>Hesap Taşıma</b> <b>MADDE 18–</b> (6) Hesap taşıma işlemlerinde aktarıma konu olacak açık pozisyonlara ait kar ve zarar hesaplamaları, aktarımın yapıldığı iş gününde hesabı devreden Üyeye ait hesaplara, ilerleyen günlerde hesabı devralan Üyeye ait hesaplara yansıtılır.</p>	<p><b>Hesap Taşıma</b> <b>MADDE 18–</b> (6) Hesap taşıma işlemlerinde aktarıma konu olacak <b>teminatlara ait net nema tutarları, aktarım işlemi nemalandırma son saatinden sonra gerçekleştirilirse hesapları devreden Üyeye ait hesaplara, nemalandırma son saatinden önce gerçekleştirilirse hesapları devralan Üyeye ait hesaplara yansıtılır.</b></p>																		
<p><b>MADDE 32 - Risk limitleri</b> (8) Teminatların Üyenin kendisine ait olan veya üzerinde tasarruf hakkına sahip olduğu varlıklardan karşılanması zorunludur.</p>	<p><b>MADDE 32 - Risk Limitleri</b> 8) <b>İlave işlem teminatı hesabına teminat olarak kabul edilecek varlıklar ile teminat değerlendirme sürecinde bu varlıklara uygulanacak grup limitleri aşağıda verilmektedir.</b> Teminatların Üyenin kendisine ait olan veya üzerinde tasarruf hakkına sahip olduğu varlıklardan karşılanması zorunludur.</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th align="center">İlave İşlem Teminatı Hesabına Kabul Edilebilecek Varlıklar</th> <th align="center">Grup Limiti</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Nakit Türk Lirası</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>Konvertible Döviz(USD/EUR)</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>DİBS</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>Pay Senetleri(BIST100)</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> <tr> <td>Borsada İşlem Gören Standartta Altın</td> <td align="center">En Fazla %100</td> </tr> </tbody> </table>	İlave İşlem Teminatı Hesabına Kabul Edilebilecek Varlıklar	Grup Limiti	Nakit Türk Lirası	En Fazla %100	Konvertible Döviz(USD/EUR)	En Fazla %100	DİBS	En Fazla %100	T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	En Fazla %100	Pay Senetleri(BIST100)	En Fazla %100	Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %100	Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %100	Borsada İşlem Gören Standartta Altın	En Fazla %100
İlave İşlem Teminatı Hesabına Kabul Edilebilecek Varlıklar	Grup Limiti																		
Nakit Türk Lirası	En Fazla %100																		
Konvertible Döviz(USD/EUR)	En Fazla %100																		
DİBS	En Fazla %100																		
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	En Fazla %100																		
Pay Senetleri(BIST100)	En Fazla %100																		
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %100																		
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	En Fazla %100																		
Borsada İşlem Gören Standartta Altın	En Fazla %100																		
<p><b>Madde 44 - İşlem teminatı olarak kabul edilebilecek kıymetler</b></p>	<p><b>Madde 44 - İşlem teminatı olarak kabul edilebilecek kıymetler</b> 6) Teminata kabul edilen varlıklardan BISTECH sistemine tanımlı olanlar, entegrasyon kapsamında yer alan Geçerli Teminat Raporu aracılığı ile izlenir. Bu raporda yer almayan varlıkların teminata verilmek istenmesi durumunda, en az bir işgünü öncesinde ilgili varlığın sistemde tanımlanmasını teminen Takasbank’a bildirimde bulunulması gerekir. Takip sorumluluğu üyeye aittir.</p>																		

**Ek: “İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.’nin Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası’nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmeti ve Bu hizmete İlişkin Takas Esasları Prosedürü” Değişiklik Tablosu**

Madde İçeriği – Mevcut			Madde İçeriği - Yeni		
<b>MADDE 46- İşlem teminatlarının değerlerinin güncellenmesi</b>			<b>MADDE 46- İşlem teminatlarının değerlerinin güncellenmesi</b>		
<b>Değerleme</b>	<b>Değerleme Kriteri</b>	<b>Açıklama</b>	<b>Değerleme</b>	<b>Değerleme Kriteri</b>	<b>Açıklama</b>
Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	<b>Gün İçi:</b> Borsa KMTTP son işlem fiyatı. <b>Gün Sonu:</b> Borsa KMTTP günsonu bülten fiyatı.	Borsa Kıymetli Madenler ve Taşlar Piyasası'ndaki (KMTTP) risk hesaplama anı öncesindeki son işlem fiyatı.	Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın	<b>Gün İçi:</b> Hesaplama anı öncesinde BİAŞ KMTTP’de gerçekleşen son işlem fiyatı. <b>Gün Sonu:</b> BİAŞ KMTTP günsonu bülten fiyatı.	Borsa Kıymetli Madenler ve Taşlar Piyasası’nda T+0 valörlü işlemler için oluşan USD/ONS fiyatı ile önceki gün sonu TCMB döviz alış kuru kullanılarak hesaplanan fiyat ile değerlendirir. Eğer işlem gerçekleşmemişse, teorik fiyat yada bir önceki seansta oluşan ağırlıklı ortalama fiyat kullanılabilir.
Teminat yatırma veya çekme işlemleri MADDE 49 – (7) İşlem teminatı yatırma ve çekme son saatleri aşağıdaki gibidir.			Teminat yatırma veya çekme işlemleri MADDE 49 – (7) Döviz teminat yatırma çekme işlemleri için gerekli olan muhabir banka bilgileri aşağıdaki gibidir.		
<b>Teminat Türü</b>	<b>İşlem</b>	<b>Hesaba</b>	<b>Fiziken</b>	<b>Talimat Son Saati</b>	<b>Açıklama</b>
₺	Yatırma Çekme	17:30 15:40	14:00	14:00	Efektif- ₺ Teminat Yatırma Son-Saati
Döviz	Yatırma Çekme	17:30 17:00	Yok Yok	15:00	USD- için Citibank- NY 36892258 EUR- için Citibank- FF 411/5556/024
DİBS	Yatırma Çekme	17:30 17:30	Yok Yok		
Pay ve Borsa Yat. Fonu	Yatırma Çekme	17:30 17:30	Yok Yok		
Yatırım Fonu Kat. Belgesi	Yatırma Çekme	17:30 17:30	Yok Yok		
<b>Döviz Kodu</b>	<b>Muhabir Banka</b>	<b>Muhabir Banka SWIFT/BIC</b>	<b>Muhabir Banka Hesap No</b>		
EUR	Citigroup Global Markets Deutschland AG, Frankfurt am Main	CITIDEFFXXX	4115556024		
USD	Citibank NA, New York	CITIUS33XXX	36892258		

**Ek: “İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.’nin Borsa İstanbul A.Ş. Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası’nda Yürüteceği Merkezi Karşı Taraf Hizmeti ve Bu hizmete İlişkin Takas Esasları Prosedürü” Değişiklik Tablosu**

Madde İçeriği – Mevcut	Madde İçeriği - Yeni
<p><b>MADDE 54- Garanti fonunun büyüklüğü ve Üyelerce yapılacak katkı payı miktarı</b> <b>(1)</b> Garanti fonunun büyüklüğü, <del>en fazla bulunması gereken teminat yükümlülüğüne sahip Üye ile ikinci ve üçüncü en fazla bulunması gereken teminat yükümlülüğüne sahip olan</del> Üyenin stres koşullarında birlikte temerrüdü halinde ortaya çıkacak kaynak ihtiyacının büyük olanından az olamaz. Kaynak ihtiyacı üyelerin, stres koşulları altında hesaplanan stres koşulları altında hesaplanan değişim teminatlarının da eklenmesi suretiyle hesaplanan, risklerinin işlem teminatları ile karşılanabilen kısmı dışında kalan bölümünden oluşur. Stres koşullarındaki riskin istatistiksel yöntemlerle tahmininde sırasıyla %99,9 güven düzeyi ve 2 ila 5 işgünü arasında elde tutma süresi kullanılır. Takasbank piyasa şartlarını, teminat yoğunlaşmalarını ve temerrüt yönetimi kaynaklarının yeterlilik düzeyini gözeterek, asgari garanti fonu yükümlülüğünü, istatistiksel olarak hesaplanan yükümlülükten daha yüksek belirleyebilir.</p>	<p><b>MADDE 54- Garanti fonunun büyüklüğü ve Üyelerce yapılacak katkı payı miktarı</b> <b>(1)</b> Garanti fonunun büyüklüğü, <b>en büyük açık pozisyona</b> sahip Üye ile ikinci ve üçüncü büyük <b>açık pozisyona</b> sahip olan Üyelerin stres koşullarında birlikte temerrüdü halinde ortaya çıkacak kaynak ihtiyacının büyük olanından az olamaz. Kaynak ihtiyacı üyelerin, stres koşulları altında hesaplanan stres koşulları altında hesaplanan değişim teminatlarının da eklenmesi suretiyle hesaplanan, risklerinin işlem teminatları ile karşılanabilen kısmı dışında kalan bölümünden oluşur. Stres koşullarındaki riskin istatistiksel yöntemlerle tahmininde sırasıyla %99,9 güven düzeyi ve 2 ila 5 işgünü arasında elde tutma süresi kullanılır. Takasbank piyasa şartlarını, teminat yoğunlaşmalarını ve temerrüt yönetimi kaynaklarının yeterlilik düzeyini gözeterek, asgari garanti fonu yükümlülüğünü, istatistiksel olarak hesaplanan yükümlülükten daha yüksek belirleyebilir.</p>