



TAKASBANK

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

**Genel Mektup: 845
Operasyon Müdürlüğü**

İstanbul, 23/09/2005

Değerli Üyemiz, Ortaklarımız,

KONU: Fon İşlemleri Menüsü'nde Yapılan Değişiklikler Hk.

Bankamız ile Sermaye Piyasası Kurulu arasında kurulan “Menkul Kıymet Yatırım ve Bireysel Emeklilik Fonları ile Yatırım ve Gayrimenkul Yatırım Ortaklıkları Veri Transfer Sistemi” çerçevesinde, Bankamıza yapılan bildirim uygulamaları ile Devlet İç Borçlanma Senetleri (DİBS) değerlendirme işlemlerinde bazı değişiklikler yapılmıştır. Yeni uygulamaya alınacak yazılımların kapsamı aşağıda detaylı olarak açıklanmıştır;

A. DEĞERLEME İŞLEMLERİ

- Saklamada bulunan DİBS işlemleri için İstanbul Menkul Kıymetler Borsası (İMKB) tarafından saat 14:00 bülteninde açıklanan büyük emirler pazarı ağırlıklı ortalama fiyatları, ileri valörlü DİBS ve Hazine İhalesi işlemlerinde ise 17:00 bülteninde açıklanan ağırlıklı ortalama fiyatları kullanılarak uygulama tarihindeki fiyatlar hesaplanacaktır.
- Döviz ödemeli DİBS'lerin değerlemesinde 17:00 bülteninde açıklanan ve işlem tarihi değerlendirme tarihi olan ağırlıklı ortalama fiyatları kullanılarak uygulama tarihindeki fiyatlar hesaplanacak, bu hesaplama yapılırken minimum valör (T+3) tespitinde, Türkiye ve ilgili döviz cinsinin yerel piyasasındaki tatil günleri dikkate alınacaktır.
- Ayrıştırılmış DİBS'lerin anapara ve kuponları ayrı ayrı piyasada oluşan ağırlıklı ortalama fiyat baz alınarak değerlendirilecektir. (Anapara ve kuponların tüm menkul kıymeti oluşturup, oluşturmadığı dikkate alınmayacaktır.)
- DİBS değişim ihalesi değerlendirme işlemlerinde, ileri valörlü işlem değerlemelerinde kullanılan hesaplama yöntemi kullanılacaktır.
- DİBS değerlendirme işlemlerinde, ağırlıklı ortalama fiyatlar üzerinden bileşik faiz bulunurken, faiz küsurat sayısı aşağıdaki şekilde olacaktır:

	Portföydeki Kıymetler	İleri Valörlü Alım/Satımlar ve Hazine İhalesi İşlemleri
Sabit Faizli ve Kuponlu DİBS'ler	<i>4 Küsuratlı</i>	<i>3 Küsuratlı</i>
Diğer DİBS'ler	<i>10 Küsuratlı</i>	<i>10 Küsuratlı</i>

İMKB TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Şişli Merkez Mah. Abide-i Hürriyet Cad. Mecidiyeköy Yolu Sk. No.286 34381 Şişli - İSTANBUL
Tel.: (0212) 315 25 25 Fax: (0212) 315 25 26 - Telex: 26643 TVSB TR - www.takasbank.com.tr

B. HAZİNE İHALESİ TEKLİF GİRİŞ İŞLEMLERİ : Takasmenü15\ Fon İşlemleri\ Bildirim İşlemleri\ İhale Bilgileri Bildirimleri\ İhale Teklif Bildirimleri (Manuel Giriş veya Disket Okutma)

Hazine İhalesi'ne katılan fonların, tekliflerinin, sistemimiz aracılığı ile Sermaye Piyasası Kurulu'na iletilmesini sağlayacak bu ekran aracılığı ile aşağıdaki işlemlerin bildirim yapılacaktır ve/veya oluşturulacak elektronik dosya aracılığı ile Bankamız sistemine aktarılacaktır:

- **Hazine İhalesi** teklif bildirimleri (Bildirim Türü "**İhale**"),
- **Değişim İhalesi** bildirimleri (Bildirim Türü "**Değişim**"),
- **Rekabetçi Olmayan Teklif (ROT)** bildirimleri (Bildirim Türü "**ROT**"),
- **Opsiyon** bildirimleri (Bildirim Türü "**Opsiyon**")

Hazine ihalesi tekliflerine ilişkin bildirimler ihalelerin yapıldığı gün saat **12:30'a** kadar gerçekleştirilebilecek, bu saatten sonra kayıt girişi ve/veya mevcut kayıtlar üzerinde değişiklik yapma imkanı olmayacaktır.

Değişim İhalesi bildirim yapılan kıymetler - ayrıca başka bir bildirim (sözleşme bildirim, hesap bildirim vs.) gerek kalmadan- ilgili fonun "Portföy Bakiye Fark ve Takas Yükümlülük Rapor"unda görülecektir. Ancak kıymetin değişken faizli bir DİBS olması durumunda 10 No'lu (Değişken faizli yurtiçi tahvil) Hesap Bildirimi yapılması gerekecektir.

C. KATILMA BELGESİ ALIM/SATIM BİLDİRİMLERİ : Takasmenü15\ Fon İşlemleri\ Bildirim İşlemleri\ Katılma Belgesi Alım Satım Bildirimleri (Doğrudan veya Dosya Aktarımı)

Fonlar, gerçekleştirmiş oldukları katılma belgesi işlemlerine ilişkin alım satım adetlerini ayrı ayrı ve katılma belgesi fiyatlarını bu ekrandan gireceklerdir ve/veya oluşturacakları elektronik dosya aracılığı ile Bankamız sistemine aktaracaklardır.

D. ÖDÜNÇ MENKUL KIYMET BİLDİRİM İŞLEMLERİ : Takasmenü15\ Fon İşlemleri\ Bildirim İşlemleri\ Hesap Bildirimleri (Doğrudan veya Dosya Aktarımı)

Bankamız sistemi dışında gerçekleştirilen Ödünç Menkul Kıymet İşlemlerine ilişkin bildirimler bu ekran kullanılarak bildirilecektir ve/veya elektronik dosya aracılığı ile Bankamız sistemine aktaracaklardır. Bildirim yapılırken aşağıdaki bildirim kodları kullanılacaktır:

- **Ödünç Alma (12),**
- **Ödünç Verme (13),**
- **Ödünç Alma işlemi karşılığında verilen teminatlar Verilen Teminatlar (7),**
- **Ödünç Verme işlemi karşılığında alınan teminatlar Alınan Teminatlar (14),**

E. DİĞER DEĞİŞİKLİKLER

- Takasmenü15\ Fon İşlemleri\ Bildirim İşlemleri\ Fon Şirket Bilgileri Bildirimi (Doğrudan veya Dosya Aktarımı) ekranına, günlük olarak bildirim yapılması gerekli olan "En Yüksek Pay Sayısı" alanı eklenmiştir. Bu alana yapılacak girişlerde:

- i. 22.04.2002 tarihinden itibaren tutar artırımını yapmamış fonlar için Kurul kaydında bulunan toplam pay sayısı,
- ii. 22.04.2002 tarihinden sonra ilk defa halka açılan bir başka deyişle birinci tertip katılma belgeleri Kurul kaydına alınan fonlar için Kurul kaydında bulunan toplam pay sayısı,
- iii. 22.04.2002 tarihinden sonra tutar artırımını yapılmış fonlar için Sermaye Piyasası Kurulunun Seri: VII No:10 sayılı Yatırım Fonlarına İlişkin Esaslar Tebliği'nin "Kurul Fonuna Yatırılacak Ücret" başlıklı 51. maddesi uyarınca hesaplanan daha önce tedavülde bulunmuş en yüksek pay sayısı,
- iv. Kurul'un 24.03.2005 tarih ve 12/387 sayılı kararı uyarınca 24.03.2005 tarihinden sonra dönüşen, birleşen veya kurucusu değişen fonlar için toplam pay sayısı

bilgisinin en yüksek pay sayısı olarak dikkate alınması gerekmektedir.

- Takasmenü15\ Fon İşlemleri\ Bildirim İşlemleri\ Hesap Bildirimi (Doğrudan veya Dosya Aktarımı) ekranından 3 no'lu bildirim kodu (Yabancı Menkul Kıymet) ile bildirilen Bankamız saklaması dışında olan yabancı menkul kıymetlerden borçlanma araçları için vadeye kalan gün sayısı (VKG) bilgisi girilecektir.

Revize edilen ve/veya yeni uygulamaya alınacak yazılımlara ilişkin elektronik dosya formatları ve örnek kayıt desenleri ise ekte bulunmaktadır.

Üyelerimizin Yeni Yazılımı içeren . "Fon22Pkt - Fon İşlemleri Menüsü Rvz" paketini 26 Eylül 2005. tarihinden itibaren "Yükle 4.0 Programını" kullanarak ya da İnternette <http://www.takasbank.com.tr> adresinden yüklemeleri gerekmektedir. 03 Ekim 2005 tarihinden itibaren eski versiyon üzerinden işlemlerin gerçekleştirilmesi mümkün olmayacağından üyelerimizin aktarım işlemlerini belirtilen tarihe kadar tamamlamış olmaları gerekmektedir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İ.M.K.B.
TAKAS MENKUL DEĞERLER SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Emin ÇATANA
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ahmet ÇAKIRSOY
Genel Müdür Yrd.

EK : Değişen ve/veya uygulamaya alınacak yazılımlara ilişkin dosya formatları ve örnek kayıt desenleri

EK : DEĞİŞEN VE/VEYA UYGULAMAYA ALINACAK YAZILIMLARA İLİŞKİN DOSYA FORMATLARI VE ÖRNEK KAYIT DESENLERİ

1 HESAP BİLDİRİM İŞLEMLERİ

• YENİ DOSYA FORMATI

Revize edilen dosya formatı aşağıdaki gibi olacaktır:

ALAN	ÖZELLİK	UZUNLUK
FON KODU	Alfanümerik	3
BİLDİRİM KODU	Nümerik	2
ÜLKE KODU	Alfanümerik	4
BANKA/SAKLAMACI	Alfanümerik	40
ŞUBE	Alfanümerik	40
HESAP NO	Alfanümerik	30
PİYASA	Alfanümerik	30
ISIN KODU	Alfanümerik	12
MENKUL TANIMI	Alfanümerik	150
MENKUL TÜRÜ	Alfanümerik	30
PARA BİRİMİ	Alfanümerik	3
BAKİYE	Decimal	21 (18,3)
FİYAT	Decimal	21(14,6)
VADE SONU/ VALÖR TARİHİ	Alfanümerik	10
VADE BAŞI / İŞLEM TARİHİ	Alfanümerik	10
FAİZ	Decimal	8(5,3)
SOZLESME BUYUKLUGU	Nümerik	10
VKG	Nümerik	6

• YENİ UYGULAMAYA ALINACAK BİLDİRİM KODLARI

(12)– Ödünç Alma İşlemleri :

Fon Kodu, Bildirim Kodu, Ülke Kodu, Banka/Saklamacı, Şube, Hesap No, ISIN Kodu, Menkul Tanımı, Menkul Türü, Para Birimi, Vade Sonu/Valör Tarihi, Vade Başı/İşlem Tarihi, Bakiye, Fiyat.

(13)– Ödünç Verme İşlemleri :

Fon Kodu, Bildirim Kodu, Ülke Kodu, Banka/Saklamacı, Şube, Hesap No, ISIN Kodu, Menkul Tanımı, Menkul Türü, Para Birimi, Vade Sonu/Valör Tarihi, Vade Başı/İşlem Tarihi, Bakiye, Fiyat.

(14)– Alınan Teminatlar :

Fon Kodu, Bildirim Kodu, Ülke Kodu, Banka/Saklamacı, Şube, Hesap No, Piyasa, ISIN Kodu, Menkul Tanımı, Menkul Türü, Para Birimi, Bakiye, Fiyat.

2 KATILMA BELGESİ ALIM SATIM BİLDİRİMLERİ

Dosya adı “KGGAAYY.XXX” şeklinde olacaktır. “GGAAYY” güncel tarihi, dosya uzantısı olan “XXX” de ekran sahibi üye kodunu belirtir.

Bildirime ilişkin dosya formatı aşağıdaki gibi olacaktır:

ALAN	ÖZELLİK	UZUNLUK
İŞLEM TARİHİ	Date	10
FON KODU	Alfanümerik	3
İŞLEM TİPİ	Alfanümerik	1
ADET	Decimal	21 (18,3)
FİYAT	Decimal	24 (18,6)

İşlem tipi alım için “A”, satım için “S” olacaktır.

Örnek Kayıt: ABC fonunun 18.07.2005 tarihinde okutacağı dosyanın ismi:K180705.ABC olacaktır ve içeriği:

18/07/2005, ABC,A,12345.678,123456.987054

3 ŞİRKET BİLGİLERİ BİLDİRİMİ YENİ DOSYA FORMATI

Revize edilen dosya formatı aşağıdaki gibi olacaktır:

ALAN	ÖZELLİK	UZUNLUK
FON KODU	Alfanümerik	3
SERMAYE	Decimal	22 (20,2)
NAKİT	Decimal	22 (20,2)
PORTFÖY DEĞERİ	Decimal	22 (20,2)
TAKASTAN ALACAKLAR	Decimal	22 (20,2)
TAKASA BORÇLAR	Decimal	22 (20,2)
DİĞER ALACAKLAR	Decimal	22 (20,2)
DİĞER BORÇLAR	Decimal	22 (20,2)
BPP DEĞERİ	Decimal	22 (20,2)
FON TOPLAM-YO NET AKTİF D.	Decimal	22 (20,2)
TOPLAM PAY-HİSSE SN. SAYISI	Decimal	21 (18,3)
TEDAVÜLDEKİ PAY SAYISI	Decimal	21 (18,3)
EN YÜKSEK PAY SAYISI	Decimal	21 (18,3)
KİŞİ SAYISI	Nümerik	10
BİRİM PAY DEĞERİ	Decimal	22 (18,6)
AÇIKLAMA	Karakter	100

4 FON İHALE TEKLİF BİLGİLERİ BİLDİRİMİ

Dosya adı “**IBGGAAYY.XXX**” şeklinde olacaktır. “**GGAAYY**” güncel tarihi, dosya uzantısı olan “**XXX**” de ekran sahibi üye kodunu belirtir.

Bildirime ilişkin dosya formatı aşağıdaki gibi olacaktır:

Alan Adı	ÖZELLİK	UZUNLUK	Açıklama
FON KODU	Karakter	5	Bildirimi yapılan fon kodudur.Zorunlu alandır.
İHALE NO	Integer		İhalenin numarasıdır. Zorunlu alandır.
İHALE TÜRÜ	Karakter	1	1=İhale; 2=Opsiyon; 3=Değişim,4=ROT. Zorunlu alandır.
MENKUL KODU	Karakter	29	İhaleye konu menkul kıymet kodudur. Zorunlu alandır.
FİYAT	Decimal	10,5	İhaleye verilen fiyat bilgisidir. İhale işlem bildirimini için zorunlu alandır. 1 nominal üzerinden giriş yapılır.
NOMİNAL	Decimal	20,0	İhaleye konu nominal bilgisidir. Zorunlu alandır.
DURUM	Karakter	1	İşlemin fon için durumunu gösteren bilgidir. G=Fona Giriş, C= Fondan Çıkış. Sadece değişim ihalesinde “C” olabilir. Zorunlu alandır.

Örnek Kayıt: ABC fonunun 18.07.2005 tarihinde okutacağı dosyanın ismi:**IB180705.ABC** olacaktır ve içeriği:

ABC;1005;1;TRT050408T18;0.88590;1000000;G