

<b>YÖNERGE</b>			
<b>Konu</b>	Takasbank Tezgahestü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu Uygulama Esasları Yönergesi		
<b>İlgili Birim</b>	Teminat ve Temerrüt Yönetimi Ekibi		
<b>Doküman No</b>	YNR.TTY.001	V:1.0	<b>Kurum İçi</b>



# **TAKASBANK TEZGAHÜSTÜ TÜREV ÜRÜNLER TEMERRÜT YÖNETİM GRUBU UYGULAMA ESASLARI YÖNERGESİ**

**DOKÜMAN TARİHÇESİ**

<b>Ver. No</b>	<b>Tarih</b>	<b>Hazırlayan/ Değişiklik Yapan</b>	<b>Onaylayan</b>	<b>Açıklama</b>
V1.0	26/11/2021	Merkezi Karşı Taraf Bölümü	Yönetim Kurulu	İlk Versiyon

# İÇİNDEKİLER

<b>BİRİNCİ BÖLÜM</b> .....	<b>3</b>
<b>Amaç, Kapsam, Dayanak, Tanımlar ve Kısaltmalar</b> .....	<b>3</b>
MADDE 1- Amaç .....	3
MADDE 2- Kapsam .....	3
MADDE 3- Dayanak.....	3
MADDE 4- Tanımlar ve kısaltmalar .....	3
<b>İKİNCİ BÖLÜM</b> .....	<b>4</b>
<b>Genel Emlaklar</b> .....	Error! Bookmark not defined.
MADDE 5- Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nun Yapısı .....	4
MADDE 6- Üye Temsilcilerinin Belirlenmesi ve Temsilci Olma Şartları .....	4
MADDE 7- Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu Üyelerinin Görev Süresi .....	5
MADDE 8- Görev, Yetki ve Sorumluluk.....	5
MADDE 9- Toplantı Sıklığı ve Tutanaklar.....	5
<b>ÜÇÜNCÜ BÖLÜM</b> .....	<b>6</b>
<b>Çeşitli ve Son Hükümler</b> .....	<b>6</b>
MADDE 10- Yürürlük .....	6
MADDE 11- Yürütme .....	6

# TAKASBANK TEZGAHÜSTÜ TÜREV ÜRÜNLER TEMERRÜT YÖNETİM GRUBU UYGULAMA ESASLARI YÖNERGESİ

## BİRİNCİ BÖLÜM

### Amaç, Kapsam, Dayanak, Tanımlar ve Kısaltmalar

#### MADDE 1- Amaç

(1) Bu Uygulama Esasları Yönergesinin amacı, İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi'nin, Merkezi Karşı Taraf (MKT) olarak hizmet verdiği tezgaüstü türev araçlarında meydana gelen temerrüt sürecinin yönetilmesinde MKT Temerrüt Yönetim Komitesi'ne destek verecek gruba ilişkin usul ve esasları düzenlemektir.

#### MADDE 2- Kapsam

(1) MKT olarak hizmet verilen tezgaüstü türev araçlarında meydana gelen temerrüdün yönetilmesinde görev alacak Temerrüt Yönetim Grubu'ndaki üyelerin belirlenmesi, görev ve sorumlulukları, görev süreleri ve görevden ayrılmaları, toplanma ve karar alma usul ve esasları bu Uygulama Esasları Yönergesi kapsamındadır.

#### MADDE 3- Dayanak

(1) Bu Uygulama Esasları Yönergesi; Merkezi Takas Kuruluşlarının Kuruluş ve Çalışma Esasları Hakkında Genel Yönetmeliğin 13 üncü maddesine dayanılarak hazırlanmıştır.

#### MADDE 4- Tanımlar ve kısaltmalar

(1) Bu Uygulama Esasları'nın uygulanmasında;

- Garanti fonu:** Merkezi karşı taraf hizmeti verilen piyasa veya sermaye piyasası araçları ile ilgili takas yükümlülüklerinin yerine getirilmemesi durumunda kullanılmak amacıyla MKT üyelerinin katkı paylarıyla oluşturulan fonu/fonları,
- Grup:** Takasbank Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nu,
- İlgili mevzuat:** Sermaye Piyasası Kanunu, Merkezi Takas Kuruluşlarının Kuruluş ve Çalışma Esasları Hakkında Yönetmelik, İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi Merkezi Takas Yönetmeliği, İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi Merkezi Karşı Taraf Yönetmeliği, piyasa yönerge ve prosedürleri ile ilgili diğer mevzuatı,
- Merkezi karşı taraf hizmeti:** Takasbank'ın, Sermaye Piyasası Kurulu tarafından uygun görülen piyasa veya sermaye piyasası araçları bazında açık teklif, sözleşme yenileme veya hukuken bağlayıcılığı olan başka bir yöntemle alıcıya karşı satıcı, satıcıya karşı da alıcı rolünü üstlenerek takasın tamamlanmasını taahhüt ettiği faaliyeti,
- MKT:** Merkezi karşı tarafı,
- MTK Temerrüt Yönetim Komitesi (TYK):** İlgili mevzuat ve üyelik sözleşmeleriyle çizilen sınırlar dâhilinde temerrüt sürecini yönetmekle görevli ve yetkili Komite'yi,
- Piyasa:** Takasbank'ın takas ve Merkezi Karşı Taraf hizmeti verdiği Tezgaüstü Türev Araçlar İşlemlerini,
- Takasbank:** İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi'ni,

ifade eder.

## İKİNCİ BÖLÜM

### Yönetim Grubu'nun Yapısı, Çalışma Esasları, Görev ve Yetkileri

#### MADDE 5- Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nun Yapısı

- (1) MKT hizmeti verilen tezgaüstü türev araçlarındaki temerrüt yönetim süreçlerinde MTK Temerrüt Yönetim Komitesi'ne (TYK) destek vermek üzere Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu (Grup) kurulur.
- (2) Grup;
  - a) MKT ve Mali Hizmetlerden sorumlu Genel Müdür Yardımcısı, Merkezi Karşı Taraf Bölümü Direktörü ve Türev Araçlar Takas Ekibinin bağlı olduğu Direktör ile,
  - b) Tezgaüstü Türev Araçlar Piyasası üyelerinin çalışmanı olan üç Asil Üye Temsilcisi ve iki Yedek Üye Temsilcisi'nden oluşur.
- (3) Grup Başkanı, MKT ve Mali Hizmetlerden sorumlu Genel Müdür Yardımcısı; Başkan Vekili ise Merkezi Karşı Taraf Bölümü Direktörü'dür. Başkan'ın yokluğunda vekili, onun da yokluğunda Türev Araçlar Takas Ekibinin bağlı olduğu Direktör Grup'a başkanlık yapar.
- (4) Grup Başkanı tarafından uygun bulunan, Grup üyesi olmayan Takasbank veya üye personeli ile bağımsız Piyasa uzmanları veya profesyonel danışmanlar da istişare mahiyette görüş bildirmek üzere Grup toplantılarına dahil edilebilir.

#### MADDE 6- Üye Temsilcilerinin Belirlenmesi ve Temsilci Olma Şartları

- (1) Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nda görev alacak Üye Temsilcilerinin belirlenmesinde aşağıdaki yöntem izlenir:
  - a) Asil Üye Temsilcileri, temsilcilerin belirlendiği takvim yılından önceki bir yıllık dönemde Tezgaüstü Türev Araçlar Piyasası garanti fonu için ortalama olarak en yüksek katkı payı gereksinimi bulunan ilk üç üyenin yetkili organları tarafından önerilen birer personelden oluşur. Üyelerin, ilgili personelin mazereti nedeniyle Grup toplantılarına katılamaması halinde yerine görev yapacak alternatif bir ismi Alternatif Asil Üye Temsilcisi olarak bildirmesi gerekir.
  - b) Yedek Üye Temsilcileri, temsilcilerin belirlendiği takvim yılından önceki bir yıllık dönemde Tezgaüstü Türev Araçlar Piyasası garanti fonu için ortalama olarak en yüksek katkı payı gereksinimi bulunan üçüncü ve dördüncü üye tarafından önerilen birer personelden oluşur. Üyelerin, ilgili personelin mazereti nedeniyle Grup toplantılarına katılamaması halinde yerine görev yapacak alternatif bir ismi Alternatif Yedek Üye Temsilcisi olarak bildirmesi gerekir.
  - c) Söz konusu MKT üyelerinin herhangi bir sebeple Grup için aday üye bildirememesi durumunda temsilciler garanti fonu için en yüksek katkı payı gereksinimi bulunma sırasına göre diğer üyelerin göstereceği adaylar arasından belirlenir.
- (2) Temerrüt eden üyenin personeli Grup'ta görev alamaz.
- (3) Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nda görev alacak üye temsilcilerinin asgari 5 yıllık mesleki veya akademik tecrübeye sahip olması gerekir.
- (4) Takasbank, herhangi bir üye temsilcisinin görevinin gerektirdiği yükümlülükleri yerine getiremediğine kanaat getirmesi halinde ilgili temsilcinin görevi sonlandırılabilir. Bu durumda Takasbank, görev iptalini

yazılı olarak ilgili üyeye bildirir. Boşalan pozisyon için işbu Uygulama Esasları Yönergesi ile belirlenen yöntemlere göre görevlendirme yapılır.

### **MADDE 7- Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu Üyelerinin Görev Süresi**

- (1) Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu temsilcilerinin görev süresi iki yıldır.
- (2) Mevcut bir Üye Temsilcisi, diğer koşulları da sağlaması şartıyla üye tarafından tekrar önerilebilir.
- (3) Grup'ta görev yapan bir temsilcinin istifa, emeklilik, azil veya sair sebeplerle görevine devam edememesi halinde Grup Başkan'ı ilgili üyeden yeni bir temsilci iletmesini isteyebilir.

### **MADDE 8- Görev, Yetki ve Sorumluluk**

- (1) Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu tezgaüstü türev araçlarda meydana gelen temerrütlerin çözümlenmesinde, uygulanabilir olduğu ölçüde, riskleri ve ekonomik etkileri azaltacak aksiyonların alınması konularında TYK tarafından alınan kararların uygulama mercii olarak görev yapar.
- (2) Tezgaüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu;
  - a) Tezgaüstü Türev Ürünler pozisyonlarının tasfiyesine ve temerrüt yönetim sürecinde uygulanabilecek yöntemlere ilişkin TYK'ya tavsiye vermek,
  - b) İhale düzenlenmesi kararı alınması halinde ihaleye konu olacak pozisyonları veya gruplamaları belirlemek,
  - c) İhaleye gelen teklifleri değerlendirmek,
  - ç) İhale sonrasında portföylerin risk düzeylerini belirlemek ve analiz etmek,
  - d) Dönemsel olarak gerçekleştirilen temerrüt yönetim testlerine katılmak,
  - e) Grup Başkan'ı tarafından tevdi edilen diğer görevleri yerine getirmekile görevlidir.
- (3) Grup üyeleri, alınan kararlarda ve mütalaa edilen görüşlerde dürüst ve tarafsız olmak ve Grup toplantılarında vakıf olabilecekleri, ifşa edilmesi mevzuat veya meslek etiğine aykırı sırları saklamakla yükümlüdürler. Grup üyeleri vakıf oldukları iş ve işlem sırlarını kendilerine, çalışanı oldukları üyeye veya herhangi bir üçüncü merciiye menfaat sağlamak amacıyla kullanamazlar.
- (4) Grup toplantılarına asil üyelerin şahsen katılmaları esas olup, mazereti nedeniyle katılamayacak olanlar, toplantı öncesinde yazılı olarak veya elektronik posta ile Grup başkanına iletir. Bu durum toplantı tutanağında belirtilir. Asil Üye Temsilcisinin toplantıya katılamaması halinde Grup'un oluşumu sırasında belirlenen Asil Üye Yedek Temsilcisi toplantılara katılır. Onun da katılamaması halinde Yedek Üye Temsilcisi toplantılara davet edilir.

### **MADDE 9- Toplantı Sıklığı ve Tutanaklar**

- (1) Toplantılar Takasbank Genel Müdürlük binasında yapılır. Fiziken toplanmanın mümkün olmadığı koşullarda Grup toplantıları her türlü teknolojik yöntemle uzaktan erişim ile de yapılabilir.
- (2) Grup, tezgaüstü türev araç pozisyonu bulunan bir üyenin temerrüt etmesi halinde derhal toplanır. Devam eden toplantılar temerrüt yönetim sürecinin etkin olarak yürütülmesini teminen yeterli sıklıkta gerçekleştirilir.
- (3) Grup toplantılarını Başkan yönetir. Grup, üyelerin salt çoğunluğu ile toplanır ve kararlar toplantıya katılanların salt çoğunluğu ile alınır. Oyların eşitliği halinde toplantı başkanının oyu doğrultusunda karar alınır.

- (4) Toplantı karar ve sonuçları müteselsil sıra numaralı olarak bir rapor veya tutanak ile tespit ve imza edilir.
- (5) Temerrüt yönetim sürecine ilişkin gerçekleştirilen aksiyonlar ve varsa tavsiyeler, söz konusu sürecin tamamlanmasını müteakip bir sonraki TYK toplantısında Merkezi Karşı Taraf Bölümü'nce raporlanır.
- (6) Grup'un sekretarya hizmetleri Merkezi Karşı Taraf Bölümü tarafından yürütülür.
- (7) Grup'un dönemsel olarak gerçekleştirilen temerrüt yönetim testlerine katılımı zorunludur.
- (8) Grup ayrıca, temerrüt halleri dışında Başkan'ın daveti üzerine sair amaçlarla da toplanabilir.

## **ÜÇÜNCÜ BÖLÜM**

### **Çeşitli ve Son Hükümler**

#### **MADDE 10- Yürürlük**

- (1) Bu Uygulama Esasları Yönergesi, Yönetim Kurulu tarafından onaylandığı tarihte yürürlüğe girer.

#### **MADDE 11- Yürütme**

- (1) Bu Uygulama Esasları Yönergesi hükümlerini Yönetim Kurulu yürütür.