

İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.'NİN KALDIRAÇLI ALIM SATIM İŞLEMLERİ TEMİNAT VE RAPORLAMA HİZMETİ PROSEDÜRÜ

Prosedür deęişikliklerine ilişkin liste:

1. 23.11.2016 tarihli ve 1313 sayılı Genel Mektubumuzda yayımlanmıştır.
2. 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektubumuzda yayımlanmıştır.

BİRİNCİ BÖLÜM

Amaç, Kapsam, Dayanak, Tanımlar ve Kısaltmalar

Amaç

MADDE 1- Bu Prosedürün amacı; Sermaye Piyasası Kurulu tarafından yetkilendirilmiş kurumların kaldıraçlı alım satım işlemlerine ilişkin almış oldukları müşteri teminatlarının İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. nezdinde saklamasına ve yetkili kuruluşların müşterileri ile gerçekleştirdikleri işlemlerin Sermaye Piyasası Kurulu'na raporlanmak üzere İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'ye bildirilmesine ilişkin usul ve esasları düzenlemektir.

Kapsam

MADDE 2- (1) Yetkilendirilmiş kurumların müşterileri ile gerçekleştirdikleri kaldıraçlı alım satım işlemlerinin İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'ye bildiri ve müşteri teminatlarının İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'de saklanması, İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. tarafından Sermaye Piyasası Kurulu'na raporlanması, ücretlendirme ve bu hizmete ilişkin diğer hususlar bu Prosedür kapsamındadır.

Dayanak

MADDE 3- (1) Bu Prosedür; İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'nin görevlendirilmesine ilişkin Sermaye Piyasası Kurulu'nun 18.08.2011 tarih ve 27 sayılı toplantısında alınan karar ile 11/07/2013 tarihli ve 28704 sayılı Resmi Gazete'de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği'nin Dördüncü Bölümünde yer alan kaldıraçlı işlemlere ilişkin düzenlemelere dayanılarak hazırlanmıştır.

Tanımlar ve kısaltmalar

MADDE-4 (1) Bu Prosedürün uygulanmasında;

a) (Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) **Brüt Varlık:** Kaldıraçlı alım satım işlemlerinde müşteriler tarafından yatırılan ve çekilen teminatlar ile yalnızca kapanan pozisyonların kar/zarar tutarları dikkate alınarak hesaplanan bakiyeyi,

b) **İşlem aracı kurum:** 11/07/2013 tarihli ve 28704 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği’nin 8 inci maddesinde tanımlanan kısmi yetkili aracı kurumu,

c) **KASİ, kaldıraçlı alım satım işlemi:** 11/07/2013 tarihli ve 28704 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği’nde tanımlanan, yatırılan teminat tutarı karşılığında, döviz ve kıymetli madenler ile Sermaye Piyasası Kurulu tarafından belirlenen diğer varlıkların kaldıraçlı olarak elektronik ortamda oluşturulmuş bir platformda alım satımı işlemi,

ç) **MKK:** Merkezi Kayıt Kuruluşu Anonim Şirketi’ni,

d) (Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) **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,

e) **Piyasa yapıcı kurum:** 11/07/2013 tarihli ve 28704 sayılı Resmi Gazete’de yayımlanan Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği’nin 8. maddesinde tanımlanan geniş yetkili aracı kurumu,

f) **SPK:** Sermaye Piyasası Kurulu’nu,

g) **Takasbank:** İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.’yi,

ğ) **TAT Ekibi:** İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Türev Araçlar Takas Ekibi’ni,

h) **TCMB:** Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası’nı,

ı) **Yetkili kuruluş:** Kaldıraçlı işlem hizmet ve faaliyetlerini gerçekleştirmek üzere Kurul tarafından yetkilendirilen aracı kurumları

ifade eder.

İKİNCİ BÖLÜM

Üyeliğe İlişkin Esaslar

Üyelik işlemleri

MADDE 5- (1) Üye olmak isteyen yatırım kuruluşlarının SPK tarafından kaldıraçlı alım satım işlemlerinde bulunmak üzere yetkilendirilmiş olması veya SPK tarafından yapılan yetkilendirmenin kaldıraçlı alım satım işlemlerini de içermesi zorunludur.

(2) Yetkili kuruluşlar üyelik talebini içeren bir yazı ile birlikte aşağıda belirtilen belgeleri Takasbank'ın Üye İşleri Bölümü'ne göndermeleri gerekmektedir.

a) İlgili kuruluşların söz konusu faaliyette bulunabileceğine ilişkin izin belgesi

b) Üyelik Taahhütnamesi (Ek.1) ve taahhütnameye ilişkin Sözleşme Öncesi Bilgi Formu,

c) Noter Tasdikli İmza Sirküleri,

(3) Üye tarafından işlemlere başlanabilmesi için Takasbank tarafından istenen gerekli teknik altyapıyı oluşturması ve işlerliğinin sağlanması için gerekli tedbirleri almış olması zorunludur.

(4) Üyelik başvurusunun tam ve eksiksiz olarak yapılmasını müteakip kuruluşun Takasbank kaldıraçlı işlem sisteminde gerekli tanımlamaları en geç ertesi iş günü yapılır.

Üyeliğin sona erdirilmesi

MADDE 6- (1) SPK tarafından kaldıraçlı alım satım işlemlerinde bulunulmasına ilişkin verilen iznin iptali halinde ilgili kuruluşların üyeliği sona erdirilir.

ÜÇÜNCÜ BÖLÜM

Hesap ve Bildirim İşlemleri

Müşteri teminat hesapları

MADDE 7- (1) Kaldıraçlı işlem yapacak bir yatırımcı için yetkili kuruluş tarafından Takasbank nezdinde hesap açılabilmesi için ilgili kuruluş tarafından öncelikle yatırımcı adına MKK nezdinde hesap açılması ve bu hesaba ilişkin sicil tanımlama işleminin gerçekleştirilmesi gerekir. MKK'da tanımlanan hesabın Takasbank'a ulaşması için, MKK'daki tanımlamalarda bu hesap için "Türev (VOB)" alanının "Y" (Evet) olarak seçilmesi zorunludur. Bu işlemlerin ardından, MKK'dan gelen sicil ve hesap bilgileriyle Takasbank nezdinde yatırımcı adına gerekli teminat hesabı açılır. Takasbank nezdindeki hesaplar "müşteri", "portföy" veya "çoklu (global)" olmak üzere üç tipte açılabilir.

(2) Yetkili kuruluşlar müşterileri için birden fazla hesap açabilirler.

(3) Müşteri teminat hesaplarının durumları "Açık", "Kapalı" ve "Geçici Durdurulmuş" olarak takip edilebilir.

(4) Takasbank nezdindeki müşteri hesapları yetkili kuruluş tarafından Takasbank'a yazılı talimat gönderilmesine gerek olmadan Takasbank KASİ üye ekranları vasıtasıyla kapatılır.

(5) Yeni açılan teminat hesapları, eğer hiçbir teminat hareketine ya da işlem bildirimine konu olmamış ise, açıldıkları gün içinde olmak kaydı ile Takasbank üye ekranları vasıtasıyla yetkili kuruluşlar tarafından silinebilir.

(6) Kaldıraçlı işlemi yapan yatırımcıya Kurul tarafından işlem yasağı getirilmesi veya yetkili kurumlar tarafından haklarında iflas, haciz kararı alınan yatırımcıların Takasbank'a bildirilmesi durumunda, ilgili hesapların ve teminatlarının takibi SPK mevzuatı çerçevesinde yapılır.

Piyasa yapıcı kurumların hesap işlemleri

MADDE 8- (1) İşlem aracısı kurum, müşterilerine ait hesapları 7 nci maddenin birinci fıkrası çerçevesinde açar. Piyasa yapıcısı kurum, işlem aracısı kurum adına MKK'da tüzel bir kimlik ile eşleştirdiği hesap/hesaplar ile Takasbank KASİ ekranlarında çoklu (global) hesap açar.

(2) İşlem aracısı kurum, kaldıraçlı işlem yapmak isteyen yatırımcılara ait hesap numaralarının hangi piyasa yapıcı çoklu (global) hesabına bağlı alt hesap olarak çalışacağı bilgisini eşleştirme talimatı dosyası ile sisteme tanımlar. Talimat doğrulaması işleme aracı kurum tarafından yapılacak, piyasa yapıcı kurum onayından sonra ilgili eşleşme işlemi gerçekleşmiş olacaktır. Eşleştirme tanımlama işlemi "G- Giriş"; mevcut eşleştirmenin iptali ise "I- İptal" işlem tipi ile gerçekleştirilecektir. Piyasa yapıcı kuruma ait bir çoklu hesap sadece bir işlem aracısı kurumun müşteri hesabı/hesapları ile eşleştirilebilir.

(3) İşlem aracısı kurum yatırımcılara ait işlem teminatlarını toplu halde, Takasbank KASİ sistemi dışında piyasa yapıcı kuruma ileticek, piyasa yapıcı kurum, kendi nezdindeki global hesapların alt hesaplarına ait teminat bakiyelerini güncelleyecektir. İşlem aracısı kurum yatırımcılarının yaptığı işlemlere ait elektronik kayıtlar Takasbank KASİ sistemine piyasa yapıcısı kurum tarafından iletilir. Piyasa yapıcı kurum ilgili işlem ve teminat bildirimlerini, Takasbank KASİ sistemi aracılığı ile okutacağı dosyalarda, işlem aracısı kuruma ait global hesap numarası ile birlikte, yatırımcıya ait alt hesap numaralarına da yer vermek suretiyle gerçekleştirir.

(4) *(Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile)* Piyasa yapıcı kurumlar için Takasbank tarafından otomatik olarak üye bazında YEDEKTEM adı verilen teminat yedekleri hesabı açılmaktadır.

(5) *(Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile)* Piyasa yapıcılara yönelik hesap eşleştirme dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.

DÖRDÜNCÜ BÖLÜM

Bildirime Konu Varlıklar ve İşlem Bildirim Esasları

Bildirim kapsamındaki varlıklar

MADDE 9- (1) Döviz ve kıymetli madenler ile Kurul tarafından belirlenen diğer varlıklara ilişkin gerçekleştirilen kaldıraçlı alım satım işlemleri ile söz konusu işlemler nedeniyle müşterilerden alınan teminatlar ve bu teminatların hesap bazında hareketi bildirim kapsamındadır.

(2) Kaldıraçlı işlemlere konu edilebilecek varlıkların fiziki alım satımı ile bankalar arasında yapılan işlemler ve bankalar tarafından aracı kurumlara likidite sağlanması amacıyla yapılan işlemler bildirim kapsamında değildir.

(3) Piyasa yapıcısı kurumun işlem aracısı kurumun müşterileri adına gerçekleştirdiği teminat ve işlem bildirimlerine ait kayıtlar, işlem aracısı kurum adına, sistem tarafından otomatik olarak kaydedilir. İşlem aracısı kurumlar Takasbank KASİ sistemi aracılığı ile piyasa yapıcı kurumda gerçekleştirdikleri işlem ve teminat bilgilerini, yatırımcılar ise Takasbank internet sitesindeki "Takas web giriř" üzerinden Takasbank Bilgilendirme Sistemine giriř yaparak piyasa yapıcı kurum nezdindeki global hesapta bulunan kendilerine ait teminat bilgilerini raporlayabilir.

Varlık tanımlama

MADDE 10- (1) Üyeler tarafından Takasbank'a bildirilen kaldıraçlı işleme konu varlıkların listesi Takasbank web sitesinde yayımlanır.

(2) Bildirime konu edilecek yeni dayanak varlıklar, ilgili varlıkların yetkili üye temsilcileri tarafından TAT Ekibi e-posta adresine (tat@takasbank.com.tr) bildirilmesini takiben 9 uncu maddedeki esaslar çerçevesinde Takasbank KASİ sistemine Takasbank tarafından tanımlanır. Takasbank sisteminde gerekli alt yapı değişikliklerin yapılabilmesini teminen, söz konusu talebin, yeni dayanak varlıkların işleme konu edilmeden en az 5 iş günü öncesinde yapılması zorunludur. Üyeler, yeni dayanak varlığa ilişkin bildirimlerin zamanında yapılmasından sorumludurlar.

İşlem detaylarının bildirilmesi

MADDE 11-(1) Yetkili kuruluşlar her işgününe ait yaptıkları işlemleri Takasbank tarafından belirlenen detayları ile Takasbank'a göndermek zorundadır.

(2) Takasbank tarafından bildirimlerde bulunması gerekli asgari unsurlar olarak belirlenen bilgiler ve yetkili kuruluşlar tarafından Takasbank ekranlarından sisteme yüklenecek işlem bildirim dosya örneği ekte (Ek.2) yer almaktadır.

(3) Yetkili kuruluşlar her gün bir önceki güne ait işlem detaylarını bildirmekle yükümlüdürler. Bildirimde bulunulmaması halinde, buna ilişkin gerekçenin de TAT Ekibi e-posta

adresine (tat@takasbank.com.tr) gönderilmesi zorunludur. Bildirim yapmama durumu tekrarlandığı durumda Kurul'a durum hakkında bilgi verilir. İşlem bildirimleri Yedinci Bölümde belirtilen saatlerde yapılır.

(4) (Eklene: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) Örnek işlem bildirim dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.

Bildirilen işlem detaylarının değiştirilmesi

MADDE 12- (1) Yetkili kuruluşların Takasbank sistemi üzerinden gerçekleştirdiği işlem bildirimlerine ilişkin değişiklik ve silme talepleri ile söz konusu değişikliğin gerekçeleri yazılı olarak TAT Ekibi'ne iletir. TAT Ekibi söz konusu talebi değerlendirdikten sonra gerekli değişiklik/silme işleminin sonucunu yetkili kuruluşa bildirir.

BEŞİNCİ BÖLÜM

Teminat İşlemleri

Müşteri teminatlarının Takasbank'a yatırılması ve çekilmesi

MADDE 13- (1) Yetkili kuruluşlar nezdinde bulunan teminatların Takasbank'ta müşteri detayında takibi ve bildirim zorunludur. Teminat işlemleri Takasbank KASİ sistemi üzerinden yetkili kuruluşlar tarafından gerçekleştirilir.

(2) Teminat güncellemesi Takasbank ekranlarına dosya okutmak suretiyle iki aşamada (Giriş ve Onay) gerçekleştirilir. Söz konusu dosyada yetkili kuruluş nezdindeki müşteri teminat hesaplarındaki teminat artış ve azalış bilgileri yer alır.

(3) Teminat bildirimlerinde bulunması gereken asgari unsurlar ekte (Ek.3) verilmektedir.

(4) (Değişik: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) Teminat yatırma/çekme dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.

Teminat güncelleme işlemleri

MADDE 14- (1) Kaldıraçlı işlem yapan yatırımcının ilgili işlemler sonrasında kar/zarar etmesi durumunda, yetkili kuruluşlar Takasbank nezdindeki müşteri teminatlarını günceller. Müşteri teminatlarının güncellenebilmesi için yetkili kuruluşların Takasbank nezdindeki serbest hesap bakiyeleri müsait hale getirilmelidir. Bakiye yetersizliği nedeniyle gerçekleştirilemeyen işlemler için, eğer müşteri teminat hesabında bakiye yoksa ilgili müşteri kayıtlarına, Serbest Cari Hesaptaki (TL veya döviz) bakiye yetersiz ise tüm kayıtlara ilişkin hata alınır ve işlemler gerçekleştirilmez. Yetkili kuruluş tarafından ilgili hesaplarda gerekli bakiyeler yaratıldıktan sonra hatalı kayıtlar tekrar onaylanabilir.

(2) (Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) Müşterilerden alınan teminat tutarlarının raporlama anı itibarıyla;

(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,

(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.

Brüt ve Net Varlık tutarlarının Takasbank'a bildirilmesi (Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile)

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.

(2) Bildirimin en geç teminat çağrısı yapılmadan önce yapılması gerekmektedir.

(3) Bildirim gün içinde birden çok yapılabilir ancak teminat tamamlama çağrısı hesabında en son bildirilen tutarlar ve teminat yedekleri hesabındaki bakiye esas alınır.

(4) Brüt/net varlık bildirimlerinde bulunması gereken asgari unsurlar ekte (Ek.4) verilmektedir.

(5) Brüt/net teminat dosyası içeriği ekte (Ek.5) verilmektedir.

Teminat yedekleri hesabında eksik kalan tutarların tamamlanması ve fazla tutarların çekilmesi (Eklenen: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile)

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.

(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.

(3) Teminat yedekleri hesabındaki brüt varlık tutarlarının net varlık tutarları arasındaki farkın %50'sini aşan tutar yetkili kuruluş tarafından çekilebilir.

(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.

ALTINCI BÖLÜM

Yatırımcı Bilgilendirme ve Üyelerin Sorumluluğu

Yatırımcı bilgilendirme

MADDE 17- (1) Yetkili kuruluşların yatırımcıları Takasbank’ın internet sitesindeki “Takas web girişi” üzerinden Takasbank Bilgilendirme Sistemi ekranına ulaşmak suretiyle Takasbank nezdinde mevcut teminat bakiyesi ve teminat yatırma/çekme işlemlerine ilişkin detaylara ulaşabilir. Bu konuda yetkili kuruluşlar yatırımcılara gerekli bilgilendirmede bulunur.

(2) Kaldıraçlı işlemlerin yapısı gereği teminatların yetkili kuruluş nezdinde anlık olarak değişiyor olması nedeniyle, Takasbank nezdindeki teminat bakiyesinin yetkili kuruluş nezdindeki teminat bakiyesinden farklılık arz edebileceği hususu ilgili sorgulama ekranında bilgi amaçlı yer alır.

Üyelerin sorumluluğu

MADDE 18 - (1) Yapılan bildirimlerin doğruluğundan ilgili yetkili kuruluş sorumludur. Yetkili kuruluşlar, işlem ve teminat bildirimlerini, Prosedür ekinde yer alan şekil ve içeriğe uygun olarak gerçekleştirmek; yapılan bildirimlerin gerçek durumu göstermesi konusunda gerekli hassasiyeti göstermek zorundadırlar. Yetkili kuruluşlar ayrıca, Takasbank sisteminde yer alan bilgiler ile kendi sistemlerinde yer alan bilgileri tutarlılığı açısından kontrol etmek zorundadırlar.

YEDİNCİ BÖLÜM

Çalışma Gün ve Saatleri

İşlemlerin bildirim zamanı

MADDE 19- (1) *(Değişik: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile)* Takasbank kaldıraçlı işlemler sistemine teminat ve işlem bildirimleri, resmi tatil günleri dışında hafta içi her gün aşağıda verilen zaman diliminde gerçekleştirilir. Gerekli görülmesi halinde söz konusu saatler Takasbank tarafından değiştirilebilir.

	Tam İş Günü*		Yarım İş Günü*	
	Başlangıç Saati	Bitiş Saati	Başlangıç Saati	Bitiş Saati
Teminat yatırma (Türk Lirası)	08.00	19.00	08.00	11.40
Teminat yatırma (Döviz)	08.00	19.00	08.00	11.40
Teminat çekme (Türk Lirası)	08.00	19.00	08.00	11.40
Teminat çekme (Döviz)	08.00	19.00	08.00	11.40
İşlem Bildirimi	08.00	21.00	08.00	15.00

(*) Teknik nedenlerden dolayı Takasbank tarafından saatlerde değişiklik yapılması durumunda söz konusu değişen saatler esas alınır.

(2) (Değişik: 23.11.2016 tarihli ve 1313 sayılı Genel Mektup ile) Teminat yatırma/çekmeye ilişkin son saatler Takasbank nezdindeki hesaplar arasında aktarım içindir. Takasbank dışı işlemler için Takasbank nakit operasyon iş kuralları uygulanır.

(3) Gerçekleştirilen tüm işlemlerde Takasbank kaldıraçlı işlemler sistemi "sistem saati" esas alınır.

Tatil gününde yapılan işlemlerin bildirimi

MADDE 20- (1) (Değişik: 20.12.2017 tarihli ve 1389 sayılı Genel Mektup ile) Resmi tatil günleri ve hafta sonlarında herhangi bir teminat yatırma/çekme işlemi, brüt/net varlık ve işlem bildirimi yapılmaz. Bu günlerde yapılan teminat güncelleme işlemleri ve işlem bildirimleri izleyen ilk iş günü gerçekleştirilir.

SEKİZİNCİ BÖLÜM

Çeşitli ve Son Hükümler

Ücretler

MADDE 21- (1) Kaldıraçlı işlemlere yetkili kuruluşlar tarafından Takasbank'da saklanan döviz ve TL teminatları toplamı üzerinden teminat saklama komisyonu alınır. Döviz cinsinden teminatlar TCMB tarafından saat 15.30'da ertesi gün için ilan edilen TCMB döviz satış kuru üzerinden TL'ye çevrilir. Döviz ve TL cinsinden mevcut diğer teminatları ile birlikte toplam bakiye üzerinden hesaplanacak komisyon Yönetim Kurulu tarafından belirlenerek Takasbank internet sitesinde yayınlanır.

(2) Kaldıraçlı işlemlere yetkili kuruluşlar tarafından Takasbank'a yapılacak teminat ve işlem detaylarına ilişkin bildirimlerin saklanması ve raporlanması hizmetleri karşılığında veri depolama ve raporlama hizmet komisyonu alınır. Üyelerden tahsil edilecek komisyon tutarı, Yönetim Kurulu tarafından belirlenerek Takasbank internet sitesinde yayınlanır.

(3) Kaldıraçlı işlemlere yetkili kuruluşların serbest cari hesabı (TL ve/veya döviz) ile müşteri teminat hesapları arasındaki hareketler üzerinden teminat yatırma/çekme işlem komisyonu alınır. İşlem bazında tahsil edilecek komisyon Yönetim Kurulu tarafından belirlenerek Takasbank internet sitesinde yayınlanır.

(4) Ücret tahakkuku ayda bir defa yapılarak Takasbank tarafından tahsil edilir.

(5) Ücretlerde yapılan değişiklikler Takasbank internet sitesinde duyurulur.

Yürürlük

MADDE 22- (1) Bu Prosedür yayınlandığı tarihte yürürlüğe girer.

Yürütme

MADDE 23- (1) Bu Prosedür hükümlerini Genel Müdür yürütür.

Ek.1: Kaldıraçlı Alım Satım İşlemleri Taahhünamesi

KALDIRAÇLI ALIM SATIM İŞLEMLERİ TAAHHÜTNAMESİ

İşbu taahhüname ile, adresinde faaliyet gösteren kaldıraçlı alım satım işlemi gerçekleştiren yetkili kurum (Bundan böyle "KURUM" olarak adlandırılacaktır), müşterilerinin, kaldıraçlı alım satım işlemi yapmak üzere ilgili KURUM'a yatırmış olduğu tüm teminatlar İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.'ye (Bundan böyle "TAKASBANK" olarak anılacaktır) tevdi edilecek, söz konusu teminatlar KURUM hesabında, müşteri bazında takip edilecektir. Kaldıraçlı alım satım işlemlerine ilişkin detaylar her iş günü ilgili KURUM tarafından TAKASBANK'a gönderilecektir.

Bu çerçevede;

1- İlgili KURUM, nezdindeki müşteri teminat bakiyelerinde meydana gelebilecek her türlü artış ve azalışı, her işgünü TAKASBANK tarafından duyurulan saatler arasında, TAKASBANK terminalleri aracılığıyla TAKASBANK'taki müşteri teminat hesaplarına yansıtmayı ve bu bakiyeleri güncellemeyi,

2- KURUM'un nezdindeki müşteri teminat bakiyelerinde meydana gelen değişiklikleri TAKASBANK'a bildirimine kadar olan süreçte teminat bakiyeleri açısından KURUM kayıtları ile TAKASBANK kayıtları arasında farklılık olabileceğini ve bu sebeple TAKASBANK'ın sorumlu tutulamayacağını bildiğimizi ve bu durum hakkında tüm müşterilerimizin bildilendirildiğini,

3- Müşterilerin ilgili KURUM nezdinde gerçekleştirdiği işlemlere ilişkin olarak Sermaye Piyasası Kurulu (Bundan böyle "SPK" olarak anılacaktır.) tarafından asgari unsurları belirlenen ve TAKASBANK tarafından duyurulan işlem bilgilerini TAKASBANK terminalleri aracılığıyla her gün göndermeyi,

4- KURUM'un müşterilerinin gerçekleştirdiği işlemlere ilişkin olarak bildirimlerin bir sonraki iş gününde TAKASBANK'a iletilmemesi durumunda ve KURUM'un TAKASBANK'a halihazırda iletmış olduğu işlem bilgilerini TAKASBANK terminalleri aracılığıyla değiştirmek/düzeltilmek amacıyla aynı gün içerisinde silmesi ya da TAT Ekibi'ne yazılı talimat ileterek değiştirmek/düzeltilmek amacıyla sildirmesi durumunda, konuyla ilgili detaylı gerekçenin TAKASBANK'a yazılı olarak sunulacağını,

5- Müşterilerin Takasbank'ın internet sitesindeki "Takas web girişi" "Yatırımcı Girişi" bağlantısı üzerinden Takasbank Bilgilendirme Sistemi ekranına ulaşmak suretiyle Takasbank nezdinde mevcut teminat bakiyesi ve teminat yatırma/çekme işlemlerine ilişkin detaylara ulaşabilecekleri konusunda bilgilendirileceğini,

6- TAKASBANK ekranları vasıtasıyla gerçekleştirilecek teminat ve işlem bilgilerini SPK ve TAKASBANK tarafından duyurulan saatlerde gerçekleştirmeyi,

7- TAKASBANK'ın sorumluluğunun KURUM tarafından müşteri detayında yatırılan teminatların saklanması için KURUM'a sistem sağlamaktan ibaret olduğunu, yatırılan teminatlarla ilgili tüm sorumluluğun kendisinde olduğunu ve TAKASBANK'ın sorumluluğunun ekranlar aracılığıyla gerçekleştirilen teminat ve işlem bilgilerinin SPK'ya aynen raporlanması ile sınırlı olduğunu,

8- TAKASBANK'ın KURUM tarafından gönderilen bilgilerin doğruluğunu araştırma ve kontrol etme yükümlülüğünün bulunmadığını, bu bilgilerin eksik, hatalı veya usulsüz bildirim veya bildirimden hiç yapılmaması sebebiyle üçüncü kişilerin uğrayacakları doğrudan ya da dolaylı zararlardan hiç bir şekilde sorumlu tutulamayacağını,

9- Müşteriler tarafından gerçekleştirilen işlemler neticesinde oluşan teminat azalışı nedeniyle gerçekleştirilecek teminat tamamlama çağrısının KURUM tarafından yapılacağını ve bu konuda TAKASBANK'ın sorumlu olmadığını,

10- Teminat güncellemesi yapılmak üzere TAKASBANK'a gönderilen hesap bakiyelerinin müsait olmaması durumunda, gerekli teminatın TAKASBANK hesabına yatırılmasından bizzat kurum olarak sorumlu olduğumuzu ve bu nedenle de bildirim yapılan tüm teminat güncellemelerinin geçersiz olacağını bildiğimizi,

11- TAKASBANK tarafından sunulacak teminat saklama ve veri bildirim hizmetleri karşılığında tahakkuk ettirilecek TAKASBANK komisyonlarını zamanında yatırmayı,

12- TAKASBANK sistemleri üzerinden gerçekleştirilen işlemlerin TAKASBANK kayıtları ile kanıtlanacağını, bunların kesin delil sayılacağını, kayıtların bağlayıcılığı nedeniyle borç altına girebileceğimizi, bu taahhüdümüzün Hukuk Muhakemeleri Kanunu'nun 193. Maddesine göre münhasır delil sözleşmesi niteliğinde bulunduğunu,

13- İhtilafların çözümünde İstanbul Merkez Mahkemeleri ve İcra Dairelerinin yetkili olduğunu,

14- Piyasa yapıcısı sıfatıyla bu Taahhütnamenin tüm hükümleriyle bağlı olduğumuzu, işlem aracı sıfatıyla ise Taahhütnamenin 2., 7., 8., 9., 11., 12., 13. ve 14. maddelerinin tarafımızı bağladığını, kabul, beyan ve taahhüt ederiz.

Kurum Unvanı:

Adres:

Tarih:

Kaşe-İmza

Ek.2: İşlem Bildirimlerinde Asgari Unsurlar

- Piyasa Yapıcı Üye Kodu,
- Piyasa Yapıcı Hesap No,
- İşleme Aracı Üye Kodu,
- İşleme Aracı Hesap No
- İşlem No,
- İşlem Türü (PA: Pozisyon Açma, PK: Pozisyon Kapama, IP: İptal, DG: Değişirme, T1: Teminat İşlemleri, EM: Emir Girişi, AP: Açık Pozisyon),
- İşlem Tarihi,
- İşlem Tipi (1: Alış, 2: Satış, 3: Limitli Alış, 4: Limitli Satış, 5: Son Satış Fiyatı, 6: Son Alış Fiyatı, 7: Teminat Yatırma, 8: Teminat Çekme, 9: Piyasa Emri, 10: Değerleme)
- İşlem Tutarı,
- Lot Sayısı,
- Dönüşüm Oranı,
- İşlem Hacmi,
- Kaldıraç Oranı,
- Teminat Tipi (TL, USD, EUR veya 3 harfli diğer konvertibl döviz kodları),
- Varlık Kodu (Takasbank tarafından tanımlanan dayanak varlık kodları dahilinde),
- Fiyat,
- Sistem Fiyatı,
- Fiyat Alt Limit,
- Fiyat Üst Limit,
- Pozisyon Kapanış Tarihi,
- Kapanış Fiyatı,
- Komisyon,
- Vergi,
- Swap,
- Kar/Zarar

Ek.3: Teminat Yatırma Çekmede Asgari Unsurlar

- Piyasa Yapıcı Üye Kodu
- Piyasa Yapıcı Üye Hesap No
- İşleme Aracı Üye Kodu
- İşleme Aracı Üye Hesap No
- Teminat Tipi (“TL” için “TL”, Döviz için “DVZ”)
- Teminat Kodu (EUR, USD, TL veya yetkili kuruluşlarca talep edilmesi halinde, TCMB tarafından günlük alım satım kurları ilan edilen diğer konvertibl yabancı para birimlerinin üç haneli kodu)
- Grup
- Teminat Adet (Yatırma/Çekmeye konu tutar bilgisi)
- İşlem kodu (Yatırma için “Y”, Çekme için “Ç”)

Ek.4: Brüt/Net Teminat Dosya Aktarımında Asgari Unsurlar

- Piyasa Yapıcı Üye Kodu
- Piyasa Yapıcı Üye Hesap No
- İşleme Aracı Üye Kodu
- İşleme Aracı Üye Hesap No
- Teminat Kodu (EUR, USD, TL veya yetkili kuruluşlarca talep edilmesi halinde, TCMB tarafından günlük alım satım kurları ilan edilen diğer konvertibl yabancı para birimlerinin üç haneli kodu)
- Teminat Tarihi
- Brüt Teminat Tutarı
- Net Teminat Tutarı

Ek.5: Piyasa Yapıcı Kurumlarla İşlemlere İlişkin Dosya Düzeni ve Bildirim Esasları

1. Hesap Eşleştirme Dosyası

Saha Sıralaması: Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Üye Hesap No, Talimat Tipi

Alan Açıklamaları:

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Eşleşmeye konu piyasa yapıcı üyenin TVS nezdindeki kodu. Teminat işlemleri(TI) dışında giriş zorunludur.

Piyasa Yapıcı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Eşleşmeye konu piyasa yapıcı üye müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Eşleşmeye konu işleme aracı üyenin TVS nezdindeki kodu. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Eşleşmeye konu işleme aracı üye müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

Talimat Tipi: (1 karakter, alfabetik) İlgili eşleşme işleminin tipi. G:Giriş, I:İptal. Giriş zorunludur.

Örnek: Dosya Adı: FEYYAAGG.XXX

YYY,1,XXX, 2, G

ZZZ, 2, XXX, 1, G

ZZZ, 3, XXX, 4, I

2. Teminat Yatırma Çekme Dosyası:

Saha Sıralaması : Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Hesap No, Teminat Tipi, Teminat Kodu, Grup, Adet/Tutar, İşlem Kodu

Örnek: Dosya Adı: FTYYAAGG.ABC

ABC,1,XYZ,12486,DVZ,USD,,1547.51,Y

ABC,1,XYZ,12486,DVZ,EUR,,2152.87,C

Alan Açıklamaları:

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Teminat yatıran piyasa yapıcı üyenin TVS nezdindeki kodu, giriş zorunludur.

Piyasa Yapıcı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Teminat yatırılan piyasa yapıcı üyesi müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Üye Kodu: (3 karakter, alfabetik) Teminat yatıran işleme aracı üyenin TVS nezdindeki kodu, giriş zorunludur.

İşleme Aracı Hesap No: (15 karakter, alfanümerik) Teminat yatırılan işleme aracı üye müşterisine ait hesap numarası. Giriş zorunludur.

Teminat Tipi: (3 karakter, alfabetik)Yatırılan teminatın tipi. Yatırılan teminatın tipi TL, DVZ olabilecektir, giriş zorunludur.

Teminat Kodu: (29 karakter, alfanümerik) Yatırılan teminatın kodu, giriş zorunludur.

Grup: (1 karakter, alfabetik) Teminatın grubu. HS için grup alanı zorunludur. Diğer teminat tipleri için boş geçilir.

Tutar/nominal: (15 karakter, nümerik) Yatırılan teminata ait adet ya da tutar bilgisinin girildiği alan, giriş zorunludur.

İşlem Kodu: (1 karakter, alfabetik) . Yatırma/çekme kodu, giriş zorunludur. Yatırma işlemi için "Y" , Çekme işlemi için "C" kodu kullanılır.

3. İşlem Bildirimi Dosyası:

Saha Sıralaması : Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Hesap No, İşlem No, İşlem Türü, İşlem Tarihi, İşlem Tipi, İşlem Tutarı, Lot Sayısı, Dönüşüm Oranı, İşlem Hacmi, Kaldıraç Oranı, Teminat Tipi, Varlık Kodu, Fiyat, Sistem Fiyatı, Fiyat Alt Limit, Fiyat Üst Limit, Pozisyon Kapanış Tarihi, Kapanış Fiyatı, Komisyon, Vergi, Swap, Kar/Zarar

Örnek : Dosya Adı: FIYYAAGG.ABC

ABC,1,XYZ,12486,111,PA,20120611 17:52:05,1,10000,1,1.2561,12561,USD, EURUSD,.....

Alan Açıklamaları

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: (3 hane, karakter) İşlem yapan piyasa yapıcı üyenin TVS sistemindeki kodu, giriş zorunludur.

Piyasa Yapıcı Hesap No: (15 hane, karakter) İşlem yapan piyasa yapıcı üyenin hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Üye Kodu: (3 hane, karakter) İşlem yapan işleme aracı üyenin TVS sistemindeki kodu, giriş zorunludur.

İşleme Aracı Hesap No: (15 hane, karakter) İşlem yapan işleme aracı üyenin hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşlem No: (15 Hane, numerik) İşlem yapan üyenin işlem numarası. Giriş zorunludur. 0(sıfır)'dan büyük bir tamsayı girilmesi gerekmektedir.

İşlem: (2 hane, karakter) İşlem yapan üyenin yaptığı işlem tipi. İşlemler: PA (Pozisyon Açma), PK (Pozisyon Kapatma), IP (İptal), DG (Değiştirme), TI (Teminat İşlemleri), EM (Emir girişi), AP (Açık Pozisyon) olabilir. Giriş zorunludur.

İşlem Tarihi: (datetime) İşlemin yapıldığı tarih. Giriş zorunludur. Belli bir tarihten (KASİ işlemlerinin başladığı tarih=05/09/2011) küçük giriş yapılmasına izin verilmez. yyyyymmdd HH:mm:ss formatında giriş yapılmalıdır.

İşlem Tipi: (int) İşleme ait emir tipi. Emir tipleri: 1(alış), 2(satış), 3(alış limit), 4(satış limit), 5(satış son), 6(alış son), 7(yatırma), 8(çekme), 9(piyasa emri), 10(Değerleme) olabilir. Giriş zorunludur.

İşlem Tutarı: (20 Hane, numerik) Yapılan işlemin tutarı. Giriş zorunludur. Teminat hareketleri dışındaki işlemler için (lot sayısı x sözleşme büyüklüğü) tutarı girilmelidir. 0(sıfır)'dan farklı bir değer girilmelidir.

Lot Sayısı: İşlem tutarı alanındaki tutar hesaplamasına konu olan lot sayısıdır. Teminat hareketleri için boş bırakılır. PA (Pozisyon Açma), PK (Pozisyon Kapatma) ve AP (Açık Pozisyon) işlemleri için 0(sıfır)'dan büyük bir değer girilmelidir.

Dönüşüm Oranı:PK, PA ve AP türü işlemler için, işleme konu varlığın pozisyonu açmak için kullanılan teminat tipi cinsinden fiyatıdır. PA (Pozisyon Açma), PK (Pozisyon Kapatma) ve AP (Açık Pozisyon) işlemleri için 0(sıfır)'dan büyük bir değer girilmelidir.

İşlem Hacmi: PK, PA ve AP türü işlemler için İşlem Tutarı x Dönüşüm Oranı bilgisidir. PA (Pozisyon Açma), PK (Pozisyon Kapatma) ve AP (Açık Pozisyon) işlemleri için 0(sıfır)'dan büyük bir değer girilmelidir.

Kaldıraç Oranı: (20 hane, numeric) Yapılan işleme ait kaldıraç oranı. Giriş zorunlu değildir.

Teminat Tipi: (3 hane, karakter) Yapılan işleme ait teminat tipi. Teminat tipleri: TL, USD, EUR gibi KASI piyasasında tanımlı olan teminat tipleri olabilir. Giriş zorunludur.

Varlık: (6 hane, karakter) İşleme ait varlık kodu (Örnek: EURUSD, EURTRY, XAUJPY). TI-Teminat işlemleri dışında giriş zorunludur.

Fiyat: (20 hane, numerik) İşleme ait fiyat bilgisi. Giriş zorunlu değildir.

Sistem Fiyatı: (20 hane, numerik) Emrin iletildiği anda elektronik işlem platformundaki mevcut fiyat bilgisi. Giriş zorunlu değildir.

Fiyat Alt Limit: (20 hane, numerik) Emir tipine göre eğer pozisyon kapatma için alt veya üst limitler verilmiş ise bu alanlar dolu olur. Giriş zorunlu değildir.

Fiyat Üst Limit: (20 hane, numerik) Emir tipine göre eğer pozisyon kapatma için alt veya üst limitler verilmiş ise bu alanlar dolu olur. Giriş zorunlu değildir.

Pozisyon Kapanış Tarihi: (datetime) Pozisyon kapatma işlemi için kapanış tarihi. Giriş zorunlu değildir. Boş geçilmemişse yyyyymmdd HH:mm:ss formatında giriş yapılmalıdır.

Kapanış Fiyatı: (20 hane, numerik) İşlem pozisyon kapatma işlemi ise bu alanda pozisyon kapanış fiyatı yer alır. Pozisyon açık ise geçici kar/zarar hesabının yapıldığı fiyat bilgisidir. Giriş zorunlu değildir.

Komisyon: (20 hane, numerik) İşleme ait komisyon tutarı. Giriş zorunludur.

Vergi: (20 hane, numerik) İşleme ait vergi tutarı. Giriş zorunludur.

Swap: (20 hane, numerik) İşleme ait swap bilgisi. Negatif değer olabilir. Giriş zorunludur.

Kar/Zarar: (20 hane, numerik) Bildirim itibari ile eğer pozisyon kapanmış ise açık olan pozisyonun gerçekleşen kar/zarar bilgisi, pozisyon açık ise geçici kar/zarar bilgisi. Negatif değer olabilir. Giriş zorunludur.

4. Müşteri ve Portföy Hesapları İçin Kullanılması Gereken Düzen

Teminat Yatırma / Çekme İşlemleri:

ABC,888,ABC,888,DVZ,USD,,1354.46,Y

İşlem Bildirimi:

ABC,888, ABC,888,222,PA,20120611 15:05:10,1,10000,1,1.2611,12111,USD,EURUSD, ...

5. Brüt/Net Teminat Dosyası

Saha Sıralaması: Piyasa Yapıcı Üye Kodu, Piyasa Yapıcı Üye Hesap No, İşleme Aracı Üye Kodu, İşleme Aracı Hesap No, Teminat Kodu, Teminat Tarihi, Brüt Teminat, Net Teminat

Örnek Dosya Adı : FB170725.ABC

ABC,123456,XYZ,1234,TL,20170725,1500.55,1450.45

Alan Açıklamaları:

Piyasa Yapıcı Üye Kodu: (3 hane, karakter) Teminat bildirimini yapan piyasa yapıcı üyenin TVS sistemindeki kodu, giriş zorunludur.

Piyasa Yapıcı Üye Hesap No: (15 hane, karakter) Teminat bildirimini yapan piyasa yapıcı üyenin hesap numarası. Giriş zorunludur.

İşleme Aracı Üye Kodu: (3 hane, karakter) Teminat bildirimine konu işleme aracı üyenin TVS sistemindeki kodu, giriş zorunludur.

İşleme Aracı Hesap No: (15 hane, karakter) Teminat bildirimine konu işleme aracı üyenin hesap numarası. Giriş zorunludur.

Teminat Kodu: (29 hane, karakter) Bildirime konu teminat kodudur. Teminat kodları: TL, USD, EUR gibi KASİ piyasasında tanımlı olan teminat kodları olabilir. Giriş zorunludur.

Teminat Tarihi: (8 hane, karakter) Bildirime konu teminatın tarihi. Giriş zorunludur. Güncel tarihten büyük tarih girişine izin verilmez. yyymmdd formatında giriş yapılmalıdır.

Brüt Teminat: (20 hane, numerik) Brüt teminat adedi. Giriş zorunludur.

Net Teminat: (20 hane, numerik) Net teminat adedi. Giriş zorunludur. Negatif değer girişine izin verilmez.