

Genel Mektup : 1431

İstanbul,07/05/2018

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BISTECH Geçiş Sonrasında Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası'nda Geçerli Olacak Gün Sonu Teminat Tamamlama Çağrısı Hakkında
İlgili Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Üyemiz,

Bilindiği üzere, Borsa İstanbul Borçlanma Araçları Piyasası'nda (BAP) BISTECH sisteminin devreye alınması ile beraber risk ve teminat yönetimi esaslarında köklü değişiklikler olacaktır. Bahse konu değişikliklerin başta gelenlerinden biri de gün sonu teminat yeterlilik kontrolü çerçevesinde yapılan teminat tamamlama çağrısı uygulamasıdır.

Bu kapsamda, BISTECH sistemine geçiş sonrası üyelerimizin teminat yeterlilik kontrollerini sorunsuz bir şekilde gerçekleştirebilmesi amacıyla, teminat tamamlama çağrısı uygulama çerçevesini açıklayan bir bilgilendirme dokümanı hazırlanmıştır. Dokümana <https://www.takasbank.com.tr/tr/hizmetler/verilen-hizmetler/merkezi-karsi-tarafmkt> adresindeki "Duyurular ve Kılavuzlar" alanından erişilebilecek olup, konu ile ilgili sorularınızı "mkt@takasbank.com.tr" elektronik posta adresine iletebilirsiniz.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :BAP Gün Sonu Teminat Tamamlama Çağrısı Takip Kılavuzu (4 sayfa)



BAP Gn Sonu Teminat Tamamlama aęrısı Takip Kılavuzu

Bilindięi zere, gn sonu teminat tamamlamasına iliřkin esaslar 06/04/2018 tarih ve 1416 sayılı genel mektubumuz ile duyurulan İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.ř. Borsa İstanbul A.ř. Borlanma Araları Piyasası Takas ve Merkezi Karřı Taraf Hizmeti Esasları Prosedr'nn 50 inci maddesinde dzenlenmiřtir.

Buna gre;

MADDE 50- (1) Deęerlenmiř teminat tutarı bulunması gereken teminat seviyesinin altına dřen hesaplar iin her iřgn sonunda teminat tamamlama aęrısı yapılır. yeler teminat tamamlama aęrısı ykmllklerini bir sonraki iř gn en ge saat 11:00'e kadar yerine getirmek zorundadırlar. Bu sre zarfında yerine getirilemeyen ykmllkler iin temerrt hkmleri uygulanır. Yarım iř gnlerinde teminat tamamlama son saati 10:00'dur.

(2) Takasbank tarafından hesaplanan teminat tamamlama aęrısı tutarı, takas terminalleri aracılıęı ile yelere bildirilir. Teminat tamamlama aęrısının sistem aracılıęı ile gnderilmesi durumunda, bařkaca bir ihbar ve bildirim gerek kalmaksızın yenin aęrısı aldıęı kabul edilir. yenin sorumluluęu, Takasbank tarafından yapılan teminat tamamlama aęrısının yeye ulařtıęı anda bařlar.

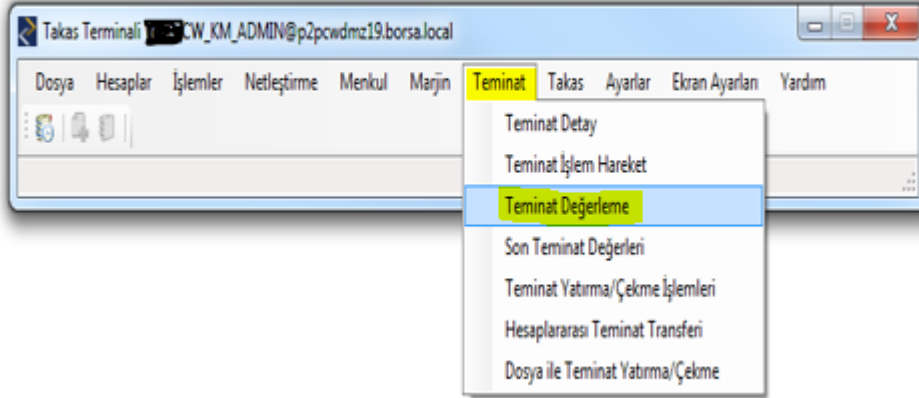
(3) Teminat tamamlama aęrısı bulunan veya teminat temerrdne dřmř hesaplar, teminat yatırma ve/veya bulunması gereken teminat deęerini azaltıcı iřlem yapılması yoluyla teminat tamamlama aęrısı veya temerrt statsnden ıkabilirler.

(4) Teminat tamamlama aęrısını takip eden iřgn, risk hesaplama anlarının herhangi birinde teminat eksięi bulunmayan hesaplar, teminat tamamlama veya temerrt ykmllęn sona erdirmiř sayılır. Ayrıca, yatırılan toplam teminatın deęerlenmiř tutarının, teminat tamamlama ykmllęnden fazla olması durumunda veya gn ierisinde bulunması gereken teminat tutarında gerekleřen azalıř tutarı ile deęerlenmiř teminat tutarında gerekleřen artıřın toplamının bir nceki iř gn sonunda hesaplanan teminat tamamlama ykmllęnden fazla olması durumunda, hesap gn ii tm risk hesaplama anlarında teminat yetersizlięinde bile olsa teminat tamamlama aęrısı ya da temerrt kapatılmıř sayılır.

(5) Takasbank teminat tamamlama aęrısına konu tutarın belirledięi kriterleri ařtıęı durumlarda, aęrıya konu hesaplar zerinden pozisyon artırıcı emir iletimini engelleyebileceęi gibi bekleyen emirleri de iptal edebilir.

Ařaęıda teminat tamamlama aęrısına konu tutarların izlenmesine ynelik olarak hazırlanan gn sonu teminat tamamlama aęrısı takip kılavuzuna iliřkin adımlar yer almaktadır.

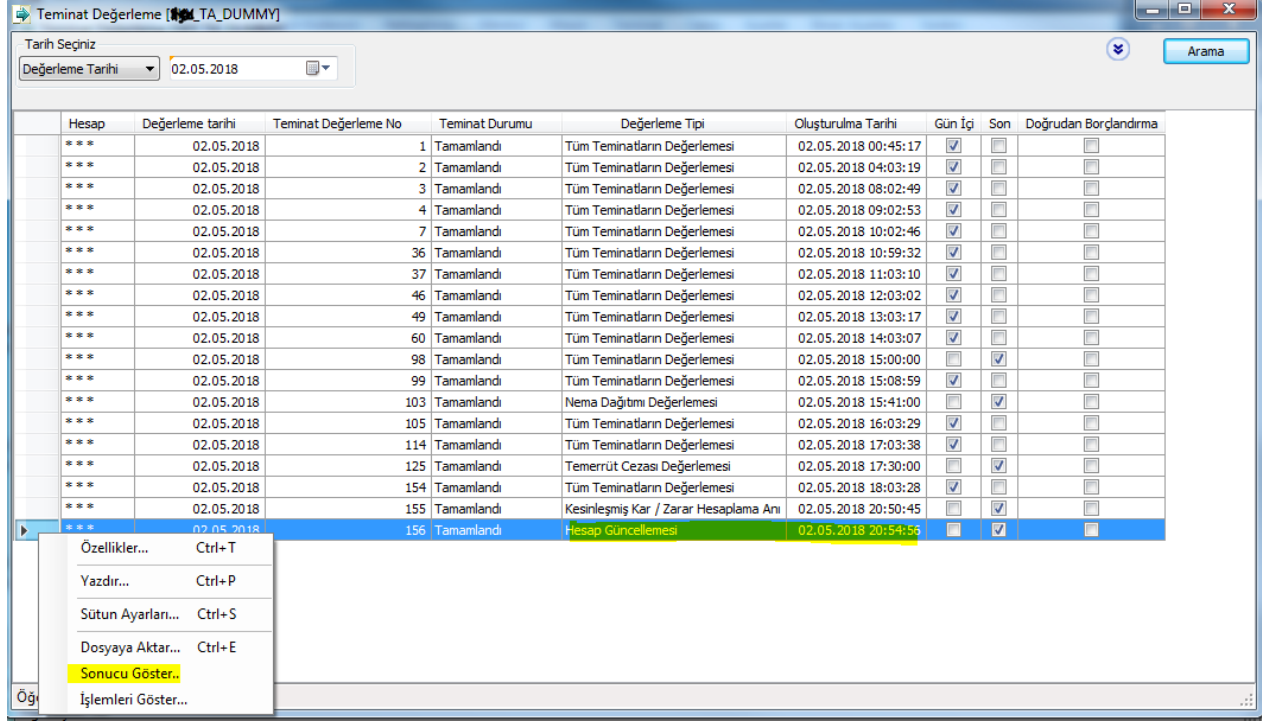
- 1) Takas Terminali'ndeki Teminat Menüsü'nden Teminat Değerleme sekmesine giriş yapılır.



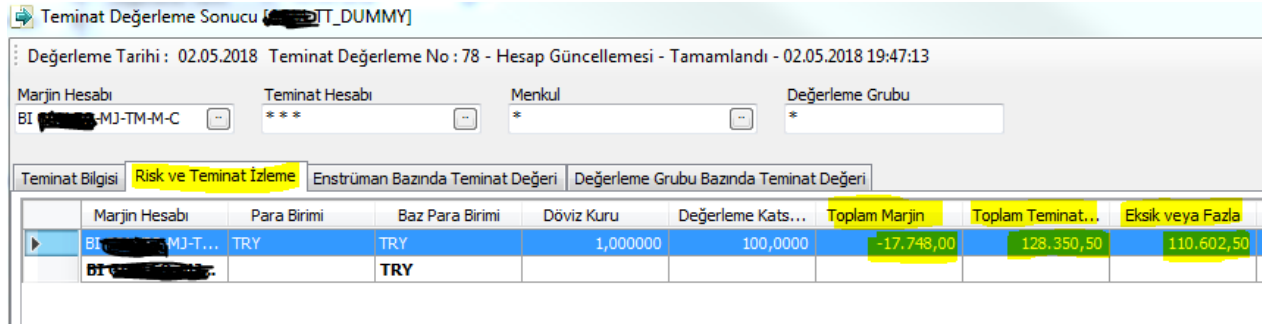
- 2) Teminat Değerleme sekmesinden “değerleme tarihi” olarak bir önceki iş günü seçilir (Örneğin; tarih 03.05.2018 ise 02.05.2018 seçilir) ve “Hesap Güncellemesi” risk hesaplama anına bakılır.

Hesap	Değerleme tarihi	Teminat Değerleme No	Teminat Durumu	Değerleme Tipi	Oluşturulma Tarihi	Gün İçi	Son	Doğrudan Borçlandırma
***	02.05.2018	1	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 00:45:17	☒	☐	☐
***	02.05.2018	2	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 04:03:19	☒	☐	☐
***	02.05.2018	3	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 08:02:49	☒	☐	☐
***	02.05.2018	4	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 09:02:53	☒	☐	☐
***	02.05.2018	7	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 10:02:46	☒	☐	☐
***	02.05.2018	36	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 10:59:32	☒	☐	☐
***	02.05.2018	37	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 11:03:10	☒	☐	☐
***	02.05.2018	46	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 12:03:02	☒	☐	☐
***	02.05.2018	49	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 13:03:17	☒	☐	☐
***	02.05.2018	60	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 14:03:07	☒	☐	☐
***	02.05.2018	98	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 15:00:00	☒	☒	☐
***	02.05.2018	99	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 15:08:59	☒	☐	☐
***	02.05.2018	103	Tamamlandı	Nema Dağıtım Değerlemesi	02.05.2018 15:41:00	☐	☒	☐
***	02.05.2018	105	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 16:03:29	☒	☐	☐
***	02.05.2018	114	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 17:03:38	☒	☐	☐
***	02.05.2018	125	Tamamlandı	Temerrüt Cezası Değerlemesi	02.05.2018 17:30:00	☐	☒	☐
***	02.05.2018	154	Tamamlandı	Tüm Teminatların Değerlemesi	02.05.2018 18:03:28	☒	☐	☐
***	02.05.2018	155	Tamamlandı	Kesinleşmiş Kar / Zarar Hesaplama Anı	02.05.2018 20:50:45	☐	☒	☐
***	02.05.2018	156	Tamamlandı	Hesap Güncellemesi	02.05.2018 20:54:56	☐	☒	☐

3) Sonrasında ilgili risk hesaplama anına sağ tıklayarak “Sonucu Göster” sekmesi seçilir.



4) Açılan ekranda “Risk ve Teminat İzleme” menüsü seçilir ve ilgili Üye hesabındaki “Toplam Marjın (TL)” ve “Toplam Teminat Değeri (TL)” kolonlarından Üye’nin eksik veya fazla teminat değeri görülebilir.



Örneğin, yukarıdaki resimde yer alan hesapta toplam 17.748,00 TL tutarında teminat yükümlülüğünün oluştuğu görülmektedir. Buna karşın hesapta 128.350,50 TL tutarında teminat

yer almakta olup bu hesabın teminat eksikî/fazlası $128.350,50 - 17.748,00 = 110.602,50$ TL olarak hesaplanmaktadır.