

Genel Mektup : 1525

İstanbul, 22/02/2019

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BİAŞ Swap Piyasası Prosedür Değişikliği Hk
İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul A.Ş. Swap Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü'nde güncellemeler yapılmıştır.

Prosedür'de gerçekleştirilen güncellemeler ek'teki karşılaştırma tablosunda yer almaktadır.

Prosedürün son haline web sitemizde "Mevzuat" başlığı altındaki "Prosedürler" bölümünden erişilebilmektedir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
DİREKTÖR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek : Prosedür Değişiklik Karşılaştırma Tablosu (3 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BELC3NSSD>

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@hs01.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Swap Piyasası Takas ve Merkezi
Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali	Madde İçeriği – Yeni Hali																				
Takas tarihi ve süresi MADDE 13- (1) Takas işlemleri aşağıdaki belirtilen saatler içerisinde gerçekleştirilir. Takas süreleri içerisinde yerine getirilmeyen yükümlülükler için herhangi bir bildirim gerekliliği kalmaksızın temerrüt hükümleri uygulanır. <table><tr><th>İşlem Türü</th><th>Saat</th></tr><tr><td>Teminat Tamamlama</td><td></td></tr><tr><td>Teminat tamamlama son saati</td><td>13:00</td></tr><tr><td>Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü</td><td>12:30</td></tr></table>	İşlem Türü	Saat	Teminat Tamamlama		Teminat tamamlama son saati	13:00	Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü	12:30	Takas tarihi ve süresi MADDE 13- (1) Takas işlemleri aşağıdaki belirtilen saatler içerisinde gerçekleştirilir. Takas süreleri içerisinde yerine getirilmeyen yükümlülükler için herhangi bir bildirim gerekliliği kalmaksızın temerrüt hükümleri uygulanır. <table><tr><th>İşlem Türü</th><th>Saat</th></tr><tr><td>Teminat Tamamlama</td><td></td></tr><tr><td>Teminat tamamlama son saati</td><td>13:00</td></tr><tr><td>Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü</td><td>12:30</td></tr><tr><td><u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati</u></td><td><u>13:00</u></td></tr><tr><td><u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati- Yarım iş günü</u></td><td><u>12:30</u></td></tr></table>	İşlem Türü	Saat	Teminat Tamamlama		Teminat tamamlama son saati	13:00	Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü	12:30	<u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati</u>	<u>13:00</u>	<u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati- Yarım iş günü</u>	<u>12:30</u>
İşlem Türü	Saat																				
Teminat Tamamlama																					
Teminat tamamlama son saati	13:00																				
Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü	12:30																				
İşlem Türü	Saat																				
Teminat Tamamlama																					
Teminat tamamlama son saati	13:00																				
Teminat Tamamlama Son Saati-Yarım iş günü	12:30																				
<u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati</u>	<u>13:00</u>																				
<u>Garanti fonu katkı payı tamamlama son saati- Yarım iş günü</u>	<u>12:30</u>																				
Başlangıç Teminatı, İşlem Anı ve Sonrası Risk Yönetimi MADDE 26 (7)Rutin olarak yapılan günsonu teminat yeterliliği kontrolleri yanısıra, teminat yetersizliği bulunan hesaplara gün içi teminat tamamlama çağrısı da yapılabilir. Gün içerisinde teminat tamamlama çağrısı yapılan üyelerin iki saat içerisinde teminat hesaplarında yeterli bakiyeyi bulundurması gerekir. Belirlenen saate kadar teminat yükümlülüğünü yerine getirmeyen	Başlangıç Teminatı, İşlem Anı ve Sonrası Risk Yönetimi MADDE 26 (7)Rutin olarak yapılan günsonu teminat yeterliliği kontrolleri yanısıra, teminat yetersizliği bulunan hesaplara gün içi teminat tamamlama çağrısı da yapılabilir. <u>Gün sonu risk hesaplamalarında üyelerin ertesi iş günü vadesi dolacak olan sözleşmeleri hesaplama dışı bırakılabilir.</u> Gün içerisinde teminat tamamlama çağrısı yapılan üyelerin iki saat içerisinde teminat hesaplarında yeterli bakiyeyi bulundurması gerekir. Belirlenen																				

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Swap Piyasası Takas ve Merkezi
Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Karşılaştırma Tablosu

üyeler için temerrüt hükümleri uygulanır.	saate kadar teminat yükümlülüğünü yerine getirmeyen üyeler için temerrüt hükümleri uygulanır.
Garanti fonunun büyüklüğü ve üyelerce yapılacak katkı payı miktarı MADDE 40 (12)Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülükleri, üyelere Takasbank tarafından sağlanan üye ekranlarına mesaj, raporlama veya elektronik posta yoluyla yapılır. Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülük bildiriminin sistem aracılığı ile gönderilmesi durumunda, başkaca bir ihbar ve bildirim gerekliliği kalmaksızın üyenin çağrısı kabul edilir. Üyenin sorumluluğu, Takasbank tarafından yapılan çağrısının üyeye ulaştığı anda başlar. Çağrıya konu yükümlülüğün yerine getirilme süresi 1 iş günüdür. İlgili yükümlülük süresi içinde yerine getirilmez ise üye temerrüde düşmüş sayılır.	Garanti fonunun büyüklüğü ve üyelerce yapılacak katkı payı miktarı MADDE 40 (12)Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülükleri, üyelere Takasbank tarafından sağlanan üye ekranlarına mesaj, raporlama veya elektronik posta yoluyla yapılır. Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülük bildiriminin sistem aracılığı ile gönderilmesi durumunda, başkaca bir ihbar ve bildirim gerekliliği kalmaksızın üyenin çağrısı kabul edilir. Üyenin sorumluluğu, Takasbank tarafından yapılan çağrısının üyeye ulaştığı anda başlar. Çağrıya konu yükümlülüğün yerine getirilme süresi 1 iş günüdür. İlgili yükümlülük süresi içinde yerine getirilmez ise üye temerrüde düşmüş sayılır.
Garanti fonuna katkı payı olarak kabul edilebilecek varlıklar ve katkı payı tamamlama yükümlülüğü MADDE 41 (2)Garanti fonu katkı payı olarak kullanılan nakit dışı varlıkların, güncel piyasa fiyatları ile değerlendirilmelerini teminen, Takasbank tarafından belirlenen fiyat üzerinden teminatlar gün sonunda değerlemeye tabi tutulur. Günlük olarak yapılan değerlendirme sonucunda Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülükleri, üyelere Takasbank tarafından sağlanan üye	Garanti fonuna katkı payı olarak kabul edilebilecek varlıklar ve katkı payı tamamlama yükümlülüğü MADDE 41 (2)Garanti fonu katkı payı olarak kullanılan nakit dışı varlıkların, güncel piyasa fiyatları ile değerlendirilmelerini teminen, Takasbank tarafından belirlenen fiyat üzerinden teminatlar gün sonunda değerlemeye tabi tutulur. Günlük olarak yapılan değerlendirme sonucunda Garanti Fonu Katkı Payı yükümlülükleri, üyelere Takasbank tarafından sağlanan üye

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul A.Ş. Swap Piyasası Takas ve Merkezi

Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedür Karşılaştırma Tablosu

ekranlarına mesaj, raporlama veya elektronik posta yoluyla iletilir. Garanti Fonu Katkı Payı tamamlama yükümlülüğü olan üyeye bildirimin sistem aracılığı ile gönderilmesi durumunda, başkaca bir ihbar ve bildirim gerekliliği kalmaksızın üyenin çağrısı kabul edilir. Üyenin sorumluluğu, Takasbank tarafından yapılan çağrısının üyeye ulaştığı anda başlar. Çağrıya konu yükümlülüğün yerine getirilme süresi 3 iş günüdür. İlgili yükümlülük süresi içinde yerine getirilmez ise üye temerrüde düşmüş sayılır.	ekranlarına mesaj, raporlama veya elektronik posta yoluyla iletilir. Garanti Fonu Katkı Payı tamamlama yükümlülüğü olan üyeye bildirimin sistem aracılığı ile gönderilmesi durumunda, başkaca bir ihbar ve bildirim gerekliliği kalmaksızın üyenin çağrısı kabul edilir. Üyenin sorumluluğu, Takasbank tarafından yapılan çağrısının üyeye ulaştığı anda başlar. Çağrıya konu yükümlülüğün yerine getirilme süresi 3 iş günüdür. İlgili yükümlülük süresi içinde yerine getirilmez ise üye temerrüde düşmüş sayılır.
---	--