

Genel Mektup : 1540

İstanbul, 28/03/2019

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu Borçlanma Araçları Piyasası Prosedür Değişikliği Hk.
İlgili Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

MKT hizmeti sunulan BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası'nda önümüzdeki dönemde başlanacak gün içi teminat tamamlama çağrılarına ilişkin sürecin detaylarının mevzuata derç edilmesi amacıyla Borsa İstanbul A.Ş. Borçlanma Araçları Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü'nde (Prosedür) revizyon yapılmıştır. Yapılan revizyona ilişkin karşılaştırma tablosu ekte olup, 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 : Borçlanma Araçları Piyasası'nda Uygulanacak Gün İçi Teminat Tamamlama Çağrılar (2 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEL93A5RV>

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



EK-1 BİAŞ Borçlanma Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

Madde İçeriği – Eski Hali	Madde İçeriği – Yeni Hali
Gün İçi Teminat Tamamlama Çağrısı MADDE 48- (1) Gün içerisinde bir hesaba ilişkin teminat yetersizliğinin Takasbank tarafından belirlenen kriterleri aşması durumunda, söz konusu aşımın giderilmesini teminen Takasbank tarafından gün içi teminat tamamlama çağrısı yapılabilir. Teminat tamamlama çağrısı sistem aracılığıyla yapılır; üyeye telefon ve/veya elektronik posta yoluyla bildirimde bulunulur. (2) Yapılması halinde teminat tamamlama çağrısına konu yükümlülüklerin, 2 saat içerisinde yerine getirilmesi gerekir. Bu süre zarfında yerine getirilemeyen yükümlülükler için temerrüt hükümleri uygulanır. (3) Gün içi teminat tamamlama çağrısına ilişkin kriter, Takasbank tarafından piyasa şartları, marjin konsantrasyonu, teminat tamamlama çağrısının faiz değişimi kaynaklı olup olmadığı ve hesabın nominal/oransal teminat eksikliği miktarları gibi hususlar göz önüne alınarak belirlenir. (4) Gün içi teminat tamamlama çağrısına konu hesaplar, teminat yatırma ve/veya bulunması gereken teminat değerini azaltıcı işlem yapılması yoluyla gün içi teminat tamamlama çağrısı statüsünden çıkabilirler. (5) Gün için teminat tamamlama çağrısını takip eden 2 saat içerisinde gerçekleşen risk hesaplama anlarının herhangi birinde teminat eksikliği bulunmayan hesaplar, gün içi teminat tamamlama yükümlülüğünü sona erdirmiş sayılır. Ayrıca, yatırılan toplam teminatın, risk hesaplama anlarındaki değerlenmiş tutarının, gün içi teminat tamamlama yükümlülüğü tutarından fazla olması durumunda veya gün için teminat tamamlama çağrısını takip eden 2 saat içerisindeki risk hesaplama anlarında hesaplanan	Gün İçi Teminat Tamamlama Çağrısı MADDE 48- (1) Gün içerisinde bir hesaba ilişkin teminat yetersizliğinin Takasbank tarafından belirlenen kriterleri aşması durumunda, söz konusu aşımın giderilmesini teminen Takasbank tarafından gün içi teminat tamamlama çağrısı yapılabilir. Teminat tamamlama çağrısı sistem aracılığıyla yapılır; üyeye telefon ve/veya elektronik posta yoluyla bildirimde bulunulur. (2) Yapılması halinde teminat tamamlama çağrısına konu yükümlülüklerin, 2 saat içerisinde yerine getirilmesi gerekir. Bu süre zarfında yerine getirilemeyen yükümlülükler için temerrüt hükümleri uygulanır. (3) Gün içi teminat tamamlama çağrısına ilişkin kriter, Takasbank tarafından piyasa şartları, marjin konsantrasyonu, teminat tamamlama çağrısının faiz değişimi kaynaklı olup olmadığı ve hesabın nominal/oransal teminat eksikliği miktarları gibi hususlar göz önüne alınarak belirlenir. (4) Gün içi teminat tamamlama çağrısına konu hesaplar, teminat yatırma <u>yoluyla</u> ve/veya bulunması gereken teminat değerini azaltıcı işlem yapılması yoluyla <u>ve/veya risk hesaplama anlarında teminat eksikliğinin bulunmaması durumunda</u> gün içi teminat tamamlama çağrısı statüsünden çıkabilirler. (5) Gün için teminat tamamlama çağrısını takip eden 2 saat içerisinde gerçekleşen risk hesaplama anlarının herhangi birinde teminat eksikliği bulunmayan <u>hesaplar, teminat yatırılması ve/veya bulunması gereken teminat değerini azaltıcı işlem yapılması akabinde anlık risk-teminat hesaplama sonucu teminat eksikliği bulunmadığı belirlenen hesaplar ve yatırılan toplam teminatın risk hesaplama anlarındaki değerlenmiş tutarının gün içi teminat tamamlama yükümlülüğü tutarından fazla olan</u>

EK-1 BİAŞ Borçlanma Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü Değişiklik Karşılaştırma Tablosu

bulunması gereken teminat tutarında gerçekleşen azalış tutarı ile değerlendirilmiş teminat tutarında gerçekleşen artışın toplamının söz konusu gün içi teminat tamamlama yükümlülüğünden fazla olması durumunda teminat tamamlama çağrısı kapatılmış sayılır.	<u>hesaplar teminat tamamlama çağrısını kapatmış sayılır. Ayrıca, 2 saat süresince teminat tamamlama çağrısını tamamlayamamış hesaplar için bu sürenin sonunda güncel fiyat ve pozisyonlar ile yapılan değerlendirme sonucunda teminat eksikliği bulunmadığı belirlenen hesaplar da teminat tamamlama çağrılarını yerine getirmiş sayılır. Teminat tamamlama çağrısının sonlandığı bilgisi üyeye elektronik posta veya telefon aracılığıyla bildirilir. , gün içi teminat tamamlama yükümlülüğünü sona erdirmiş sayılır. Ayrıca, yatırılan toplam teminatın, risk hesaplama anlarındaki değerlendirilmiş tutarının, gün içi teminat tamamlama yükümlülüğü tutarından fazla olması durumunda veya gün için teminat tamamlama çağrısını takip eden 2 saat içerisindeki risk hesaplama anlarında hesaplanan bulunması gereken teminat tutarında gerçekleşen azalış tutarı ile değerlendirilmiş teminat tutarında gerçekleşen artışın toplamının söz konusu gün içi teminat tamamlama yükümlülüğünden fazla olması durumunda teminat tamamlama çağrısı kapatılmış sayılır.</u>
(6) Takasbank teminat tamamlama çağrısına konu tutarın belirlediği kriterleri aştığı durumlarda, çağrıya konu hesaplar üzerinden pozisyon artırıcı emir iletimini engelleyebileceği gibi bekleyen emirleri de iptal edebilir.	(6) Takasbank teminat tamamlama çağrısına konu tutarın belirlediği kriterleri aştığı durumlarda, çağrıya konu hesaplar üzerinden pozisyon artırıcı emir iletimini engelleyebileceği gibi bekleyen emirleri de iptal edebilir.