

Genel Mektup : 1747

İstanbul, 28/12/2021

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Takasbank Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetimi Grubu Uygulama Esasları Yönergesi Duyurusu

İlgili : Aracı Kurumlar,
Bankalar

Sayın Genel Müdür,

İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi Merkezi Karşı Taraf Yönetmeliği'nin 41 inci maddesi doğrultusunda hazırlanan ve Bankamız Yönetim Kurulunun 26/11/2021 tarihli toplantısında onaylanarak yürürlüğe giren Takasbank Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu Uygulama Esasları Yönergesi, Bankamız internet sitesi (www.takasbank.com.tr) üzerinden yayınlanmıştır.

Yönergede, İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi'nin, Merkezi Karşı Taraf (MKT) olarak hizmet verdiği tezgahüstü türev araçlarında meydana gelen temerrüt sürecinin yönetilmesinde üyelerin de katkı sağlamasına imkan verecek, Takasbank OTC Temerrüt Yönetim Grubu'nun oluşumu ve yapısı, çalışma usul ve esasları, görev ve yetkileri ile giderlerine ilişkin düzenlemeler yapılmaktadır.

Takasbank OTC Temerrüt Yönetim Grubu'nun MKT ve Mali Hizmetlerden sorumlu Genel Müdür Yardımcısı, Merkezi Karşı Taraf Bölümü Direktörü ve Türev Araçlar Takas Ekibi Direktörü ile Tezgahüstü Türev Araçlar Piyasası üyelerinin çalışanı olan üç Asil Üye Temsilcisi'nden oluşmasına karar verilmiştir.

Takasbank OTC Temerrüt Yönetim Grubu'nda temsil edilecek MKT üyelerinin aday gösterilmesi sürecinde, üyeler için garanti fonu büyüklüğü dikkate alınacaktır. Üyelerin temsilcileri, Yönergede yer alan kriterler esas alınarak belirlenen üyeler tarafından gösterilen adaylar arasından belirlenecektir. Komite'nin tavsiye ve kararları istişari mahiyette olacaktır.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Semanur CERRAHOĞLU
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Takasbank OTC TYK Yönergesi (7 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSUBK0CBTC> Pin Kodu :

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



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



TAKASBANK TEZGAHÜSTÜ TÜREV ÜRÜNLER TEMERRÜT YÖNETİM GRUBU UYGULAMA ESASLARI YÖNERGESİ

DOKÜMAN TARİHÇESİ

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

İÇİNDEKİLER

BİRİNCİ BÖLÜM.....	3
Amaç, Kapsam, Dayanak, Tanımlar ve Kısaltmalar.....	3
MADDE 1- Amaç.....	3
MADDE 2- Kapsam.....	3
MADDE 3- Dayanak.....	3
MADDE 4- Tanımlar ve kısaltmalar.....	3
İKİNCİ BÖLÜM.....	4
Genel Esaslar.....	4
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
ÜÇÜNCÜ BÖLÜM.....	6
Çeşitli ve Son Hükümler	6
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 tezgahüstü 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 tezgahüstü 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;
- a) **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,
 - b) **Grup:** Takasbank Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nu,
 - c) **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,
 - ç) **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,
 - d) **MKT:** Merkezi karşı tarafı,
 - e) **MTK Temerrüt Yönetim Komitesi (TYK):** İlgili mevzuat ve üyelik sözleşmeleriyle çizilen sınırlar dâhilinde temerrüt sürecini yönetmekle görevli ve yetkili Komite'yi,
 - f) **Piyasa:** Takasbank'ın takas ve Merkezi Karşı Taraf hizmeti verdiği Tezgahüstü Türev Araçlar İşlemlerini,
 - g) **Takasbank:** İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketi'ni,
- ifade eder.

İKİNCİ BÖLÜM

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

MADDE 5- Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu'nun Yapısı

- (1) MKT hizmeti verilen tezgahüstü türev araçlarındaki temerrüt yönetim süreçlerinde MTK Temerrüt Yönetim Komitesi'ne (TYK) destek vermek üzere Tezgahüstü 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) Tezgahüstü Türev Araçlar Piyasası üyelerinin çalışanı 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) Tezgahüstü 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 Tezgahüstü 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 Tezgahüstü 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) Tezgahüstü 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- Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu Üyelerinin Görev Süresi

- (1) Tezgahüstü 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 ilemesini isteyebilir.

MADDE 8- Görev, Yetki ve Sorumluluk

- (1) Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu tezgahüstü türev araçlarda meydana gelen temerrütlerin çözülmesinde, uygulanabilir olduğu ölçüde, riskleri ve ekonomik etkileri azaltacak aksiyonların alınması konularında TYK tarafından alınan kararların uygulama mercii olarak görev yapar.
- (2) Tezgahüstü Türev Ürünler Temerrüt Yönetim Grubu;
 - a) Tezgahüstü 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, tezgahüstü 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.