

2020 2. Dönem Finansed Takas Saklama Operasyon İşlemleri Kitabı Güncellemeleri

Sayfa	Açıklama	Yeni Hali																																												
8	2.1.3. Yatırım kuruluşu hesabı ekleme	Yabancı saklama global hesabı , yurtdışında yerleşik hak sahiplerine ait sermaye piyasası araçlarının yabancı merkezi saklama kuruluşları (YMSK) ve genel saklama yetkisi bulunan yatırım kuruluşları nezdinde hak sahibi ismine açılmaksızın toplu olarak tutulduğu hesaplardır. Bu hesaplarda toplu olarak izlenecek sermaye piyasası araçları ile bu hesapların hangi hak sahipleri için açılabileceğine ilişkin esaslar Kurulca belirlenir.																																												
8	ekleme	<p>2.1.5. Yabancı Merkezi Saklama Kuruluşu (YMSK) Hesabı</p> <p>Yabancı merkezi saklama kuruluşu hesabı (YMSK);</p> <ul style="list-style-type: none"> ➤ yabancı saklama global hesabı ve ➤ yatırımcı hesabından oluşur. <p>Yabancı saklama global hesabı; yurtdışında yerleşik hak sahiplerine ait sermaye piyasası araçlarının hak sahibi ismine açılmaksızın toplu olarak tutulduğu hesaplardır. Bu hesaplarda toplu olarak izlenecek sermaye piyasası araçları ile bu hesapların hangi hak sahipleri için açılabileceğine ilişkin esaslar Kurulca belirlenir.</p> <p>Yatırımcı hesabı, hak sahibi adına açılmış, hakların izlendiği hesaptır.</p>																																												
16	ekleme	<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">Takasbank'ın Takas Hizmeti Sunduğu Piyasalar</th> </tr> <tr> <th>Piyasayı İşleten</th> <th>Piyasa Adı</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Takasbank</td> <td>Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası</td> </tr> </tbody> </table>	Takasbank'ın Takas Hizmeti Sunduğu Piyasalar		Piyasayı İşleten	Piyasa Adı	Takasbank	Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası																																						
Takasbank'ın Takas Hizmeti Sunduğu Piyasalar																																														
Piyasayı İşleten	Piyasa Adı																																													
Takasbank	Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası																																													
17	ekleme	<table border="1"> <thead> <tr> <th colspan="2">Takasbank'ın Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Sunduğu Piyasalar</th> </tr> <tr> <th>Piyasayı İşleten</th> <th>Piyasa Adı</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Takasbank</td> <td>Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası</td> </tr> </tbody> </table>	Takasbank'ın Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Sunduğu Piyasalar		Piyasayı İşleten	Piyasa Adı	Takasbank	Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası																																						
Takasbank'ın Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Sunduğu Piyasalar																																														
Piyasayı İşleten	Piyasa Adı																																													
Takasbank	Tezgah Üstü Türev İşlemler Piyasası																																													
53	Güncelleme	<table border="1"> <tbody> <tr> <td>Nema Dağıtım</td> <td>07:30</td> </tr> <tr> <td>Teminat Yatırma-Çekme Başlangıç Saati</td> <td>08:00</td> </tr> <tr> <td>Bir önceki iş günü eksi nakit nedeniyle dağıtılmayan karın dağıtım başlangıç saati</td> <td>08:15 (T+1)</td> </tr> <tr> <td>Eksi nakit kapama son saati</td> <td>11:00</td> </tr> <tr> <td>Marjin Kapama Son Saati (Temerrüt Başlangıç Saati)</td> <td>15:00</td> </tr> <tr> <td>TL Teminat Çekme Son Saati</td> <td>15:40</td> </tr> <tr> <td>Nemalandırma Son Saati</td> <td>15:40</td> </tr> <tr> <td>Nemalandırma Talimatı Verme Son Saati</td> <td>15:40</td> </tr> <tr> <td>ELÜS Fiziki Teslimat Son Saati (Tem. Başlangıç Saati)</td> <td>17:00</td> </tr> <tr> <td>TL Dışı Teminat Çekme Son Saati</td> <td>19:00</td> </tr> <tr> <td>Teminat Yatırma Son Saati</td> <td>19:00</td> </tr> <tr> <td>MKK'da açılan hesapların BISTECH'e gönderilme son saati</td> <td>18:15</td> </tr> <tr> <td>Uzlaşma Fiyatı İlanı</td> <td>19:00</td> </tr> <tr> <td>Opsiyon Kullanım Talimatı Son Saati</td> <td>19:20</td> </tr> <tr> <td>Otomatik Opsiyon Kullanımını Reddetme Son Saati</td> <td>19:20</td> </tr> <tr> <td>BISTECH Hesap Açma/İlişkilendirme Son Saati</td> <td>19:20+</td> </tr> <tr> <td>Kesinleşmiş Kar/Zarar Hesaplama Saati (Günsonu döngüsü)</td> <td>19:20+</td> </tr> <tr> <td>Akşam döngüsü başlangıcı</td> <td>19:30</td> </tr> <tr> <td>Hesap Güncellemesi (Karların Eklenmesi/Zarar Tahsilatı) (Akşam döngüsü sonunda)</td> <td>19:30+</td> </tr> <tr> <td>Teminat Tamamlama Çağrısı (Akşam döngüsü sonunda)</td> <td>19:30+</td> </tr> <tr> <td>Çoklu Hesaplara Ait Pozisyonların Bildirilmesi</td> <td>21:00</td> </tr> <tr> <td>Takas Ekranındaki (TVİS) Gün Sonu İşlemleri</td> <td>21:30+</td> </tr> </tbody> </table>	Nema Dağıtım	07:30	Teminat Yatırma-Çekme Başlangıç Saati	08:00	Bir önceki iş günü eksi nakit nedeniyle dağıtılmayan karın dağıtım başlangıç saati	08:15 (T+1)	Eksi nakit kapama son saati	11:00	Marjin Kapama Son Saati (Temerrüt Başlangıç Saati)	15:00	TL Teminat Çekme Son Saati	15:40	Nemalandırma Son Saati	15:40	Nemalandırma Talimatı Verme Son Saati	15:40	ELÜS Fiziki Teslimat Son Saati (Tem. Başlangıç Saati)	17:00	TL Dışı Teminat Çekme Son Saati	19:00	Teminat Yatırma Son Saati	19:00	MKK'da açılan hesapların BISTECH'e gönderilme son saati	18:15	Uzlaşma Fiyatı İlanı	19:00	Opsiyon Kullanım Talimatı Son Saati	19:20	Otomatik Opsiyon Kullanımını Reddetme Son Saati	19:20	BISTECH Hesap Açma/İlişkilendirme Son Saati	19:20+	Kesinleşmiş Kar/Zarar Hesaplama Saati (Günsonu döngüsü)	19:20+	Akşam döngüsü başlangıcı	19:30	Hesap Güncellemesi (Karların Eklenmesi/Zarar Tahsilatı) (Akşam döngüsü sonunda)	19:30+	Teminat Tamamlama Çağrısı (Akşam döngüsü sonunda)	19:30+	Çoklu Hesaplara Ait Pozisyonların Bildirilmesi	21:00	Takas Ekranındaki (TVİS) Gün Sonu İşlemleri	21:30+
Nema Dağıtım	07:30																																													
Teminat Yatırma-Çekme Başlangıç Saati	08:00																																													
Bir önceki iş günü eksi nakit nedeniyle dağıtılmayan karın dağıtım başlangıç saati	08:15 (T+1)																																													
Eksi nakit kapama son saati	11:00																																													
Marjin Kapama Son Saati (Temerrüt Başlangıç Saati)	15:00																																													
TL Teminat Çekme Son Saati	15:40																																													
Nemalandırma Son Saati	15:40																																													
Nemalandırma Talimatı Verme Son Saati	15:40																																													
ELÜS Fiziki Teslimat Son Saati (Tem. Başlangıç Saati)	17:00																																													
TL Dışı Teminat Çekme Son Saati	19:00																																													
Teminat Yatırma Son Saati	19:00																																													
MKK'da açılan hesapların BISTECH'e gönderilme son saati	18:15																																													
Uzlaşma Fiyatı İlanı	19:00																																													
Opsiyon Kullanım Talimatı Son Saati	19:20																																													
Otomatik Opsiyon Kullanımını Reddetme Son Saati	19:20																																													
BISTECH Hesap Açma/İlişkilendirme Son Saati	19:20+																																													
Kesinleşmiş Kar/Zarar Hesaplama Saati (Günsonu döngüsü)	19:20+																																													
Akşam döngüsü başlangıcı	19:30																																													
Hesap Güncellemesi (Karların Eklenmesi/Zarar Tahsilatı) (Akşam döngüsü sonunda)	19:30+																																													
Teminat Tamamlama Çağrısı (Akşam döngüsü sonunda)	19:30+																																													
Çoklu Hesaplara Ait Pozisyonların Bildirilmesi	21:00																																													
Takas Ekranındaki (TVİS) Gün Sonu İşlemleri	21:30+																																													

59 63	Güncelleme	Teminat Çeşidi		Değerleme Katsayısı
		Nakit Türk Lirası		%100
		Konvertibl Döviz(USD)		%94
		Konvertibl Döviz(EUR)		%94
		Konvertibl Döviz(GBP)		%93
		Devlet İç Borçlanma Senedi		0-1 Yıl %96 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %91
		T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-USD)		5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %89 30 ve üzeri %86
		T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond-EUR)		5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %91 10-30 Yıl %88 30 ve üzeri %85
		T.C. Hazinesi Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları		0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89
		BIST 100 endeksinde bulunan pay senetleri		BIST 30 %85 BIST 100 %80
		Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları		%89
		Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları		%84
		Borsalarda İşlem Gören Standartta Altın		%90
		İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipoteye dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler		0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89
		Borsa İstanbul A.Ş. payları		%100
67	Ekleme	<i>Borsa İstanbul Vadeli İşlemler ve Opsiyon Piyasası, Borçlanma Araçları Piyasası, Pay Piyasası ve Tezgaah Üstü Türev Araç Piyasası'nda</i> başlangıç teminatı hesaplamaları BISTECH Marjin Yöntemi ile yapılır . BISTECH Marjin Yöntemi, portföy bazlı risk yönetimi algoritmasını baz alır.		
69	Ekleme	Piyasa bazında Asgari Garanti Fonu Katkı Payı (TL)		
		Vadeli İşlem Opsiyon Piyasası	300.000	
		Pay Piyasası	100.000	
		Borçlanma Araçları Piyasası	150.000	
		BİAŞ Para Piyasası	50.000	
		Takasbank Ödünç Pay Piyasası	5.000	
		SWAP Piyasası	50.000	
		Tezgaah Üstü Türev Araç Piyasası	500.000	

10.3.5. Tezgah Üstü Türev Araçlar Piyasası'nda Teminata Kabul Edilen Varlıklar ve Kompozisyon Sınırları

Varlık Türü	Grup Limit	Alt Grup Limit (Grup Limiti Yüzdesi Olarak)	Değerleme Kat Sayısı	Garanti Fonu Kabul
Nakit Türk Lirası	En Fazla % 100	-	% 100	✓
Konvertibl Döviz (USD)	En Fazla % 100	-	% 94	✓
Konvertibl Döviz (EUR)	En Fazla % 100	-	% 94	✓
Konvertibl Döviz (GBP)	En Fazla % 100	-	% 93	✓
Devlet İç Borçlanma Senedi	En Fazla % 100	% 35 (ISIN Bazında)	0-1 Yıl %96 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %91	✓
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond - USD)	En Fazla % 100	% 25 (ISIN Bazında)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %89 30 ve üzeri %86	✓
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond - EUR)	En Fazla % 100	% 25 (ISIN Bazında)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %91 10-30 Yıl %88 30 ve üzeri %85	✓
T.C. Hazinesi Varlık Kiralama A.Ş. kira sertifikaları	En Fazla % 50	% 25 (ISIN Bazında)	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89	✓
İTMK, İDMK, VTMK, VDMK	En Fazla %50	%25	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89	✓
ABD tarafından ihraç edilen iç borçlanma senetleri	En Fazla %50	%50	5 Yıla kadar %93 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %91 30 ve üzeri %88	✓
Almanya tarafından ihraç edilen iç borçlanma senetleri	En fazla %50	%50	5 Yıla kadar %93 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %91 30 ve üzeri %90	✓

Tezgah Üstü Türev Araçlar Piyasası'nda G7 ülkeleri tarafından ihraç edilen iç borçlanma senetleri ile Euro tahviller arasından yalnızca ABD ve Almanya ülkelerinden ihraç edilen iç borçlanma senetleri ve Euro tahviller teminat olarak kabul edilecektir. Tezgah Üstü Türev Araçlar Piyasası'nda garanti fonu katkı payı olarak bulunması gereken katkı payı toplamının % 100'ü Nakit, Konvertibl Döviz, Devlet İç Borçlanma Senedi ve T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond) ile tesis edilebilir. Diğer varlık grupları içinse ise yukarıda tabloda yer alan kompozisyon sınırları geçerlidir.

Teminat Çeşidi	Teminat Değerleme Katsayısı
Nakit Türk Lirası	%100
Konvertibl Döviz (USD)	% 94
Konvertibl Döviz (EUR)	% 94
Konvertibl Döviz (GBP)	% 93
Devlet İç Borçlanma Senedi	0-1 Yıl %96 1-5 Yıl %91 5 ve üzeri %91
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond - USD)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %89 30 ve üzeri %86
T.C. Hazine ve Maliye Bakanlığı tarafından ihraç edilen Euro tahvil (Eurobond - EUR)	5 Yıla kadar %92 5-10 Yıl %91 10-30 Yıl %88 30 ve üzeri %85
T.C. Hazinesi Varlık Kiralama A.Ş. tarafından ihraç edilen kira sertifikaları	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89
BIST 100 endeksinde bulunan pay senetleri	BIST 30 %85 BIST 100 %80
Hisse Senedi Şemsiye Fonu Payları	%89
Borçlanma Araçları Şemsiye Fonu Payları	%84
Borsada İşlem Gören Standartta Altın	%90
İpotek teminatlı menkul kıymetler, ipotège dayalı menkul kıymetler, varlık teminatlı menkul kıymetler ve varlığa dayalı menkul kıymetler	0-1 Yıl %94 1-5 Yıl %89 5 Yıl ve üzeri %89
Borsa İstanbul A.Ş. payları	% 100
Teminat Mektubu	% 100
ABD tarafından ihraç edilen iç borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %93 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %91 30 ve üzeri %88
Almanya tarafından ihraç edilen iç borçlanma senetleri	5 Yıla kadar %93 5-10 Yıl %93 10-30 Yıl %91 30 ve üzeri %90