

Ek1

Alım/Satım ve Temerrüt İşlemleri;

1. Borsa işlemlerinin Takasına yönelik mevcut oluşturulan otomatik talimatlarla sürecin yönlendirilmesi şeklindeki işleyişte değişiklik bulunmamaktadır.
2. Takas işlemleri ve temerrüt işlemleri Takasbank tarafından MKK sistemindeki Takasbank Takas Havuz hesabından (TBTAH) sonuçlandırılacaktır.
3. Takas ve temerrüt işlemlerinin aynı Takas havuzundan sonuçlandırılacak olması nedeniyle, Takas süreçleri için oluşturulan talimat işleyişinde sorun yaşanmaması için T+2 gün sonunda kapanmayan yatırımcı bazında borç alacak talimatları iptal edilecek, ilgili talimatlar karşılığı yatırımcı bazında temerrüt talimatları oluşturulmayacaktır.
4. Takasbank tarafından MKK'ya bildirilen üye bazında temerrüt borç/alacak bilgileri doğrultusunda, üyenin Aracı Kurum Temerrüt Hesabından (AKTEMHES) Takasbank'ın TBTAH hesabına ya da üyenin Aracı Kurum Takas Havuz hesabından (AKTAH) AKTEMHES hesabına talimatlar oluşturulacaktır. Temerrüt hesabına yönelik bilgi üyeler tarafından T+3 sabahı itibariyle MKS'den RP147 Yatırımcı Pay Takası Bilgi Raporu (RP147) ve RP146 Yatırım Kuruluşu Pay Takası Bilgi Raporundan (RP146) raporlanabilecektir. Temerrüt borcunun kapatılması üye tarafından borçlu olunan kıymetin AKTEMHES hesabına kıymet transferinin yapılması ile sağlanacaktır. Temerrüt alacağı nedeniyle AKTEMHES hesabına aktarılan kıymetlerin yatırımcı hesaplarına transferi de yine üyelerimiz tarafından yapılacak kıymet transferi ile sağlanacaktır. AKTEMHES ile Takas havuz hesapları arası hareketler de aynı gün içinde yine üyeler tarafından RP146 ve RP147 raporlarından izlenebilecektir.
5. Takasbank sisteminde, üyenin aynı kıymete ilişkin takas alacağı ile temerrüt borcu veya temerrüt alacağı ile takas borcu kapatılabilecektir. Bu durumda AKTAH'tan yatırımcı yönlü oluşturulmuş (YBALC) ve AKTEMHES yönlü oluşturulmuş (HTEMA) alacak aktarım talimatları ve yatırımcı hesabından AKTAH yönlü oluşturulmuş (YBSAC) ile AKTEMHES'ten TBTAH yönlü oluşturulmuş (ATETK) borç kapatma talimatları açıkta kalabilecektir. İşlemleri hesap bazında sonuçlandırılmayan kayıtlar üyelerimiz tarafından RP146 ve RP147 raporlarından izlenebilecektir. Aynı gün içerisinde açıkta kalan talimatların sonuçlandırılmaması durumunda, üyenin Takasbank sistemindeki borç alacak kayıtları dikkate alınarak ilgili hesaplar arasındaki transferler üyelerimiz tarafından sağlanmalıdır.

6. Takas işlemleri ve temerrüt işlemlerinin aynı havuz hesabında sonuçlandırılacak olması sebebiyle, üyenin AKTAH-AKTEMHES yönlü temerrüt alacak talimatlarının önceliği Takas alacak talimatlarından öncelikli olacak şekilde oluşturulacaktır. Üyeler bu önceliği takas alacaklarının önce aktarılması doğrultusunda değiştirebileceklerdir.
7. Temerrüt işlemlerinin sonuçlandırılmasına yönelik olarak Takasbank nezdinde bloke edilen kıymetlerin MKS'de Takasbank hesaplarından üyelerin AKTEMHES hesapları aracılığıyla TBTAH hesabına aktarımları, Takasbank tarafından gerçekleştirilir. Gerçekleştirilen işlemlere ilişkin hareketler RP146 raporundan izlenebilecektir.
8. Temerrüt amacıyla Pay Piyasası temerrüt işlem sırasında aynı gün valörlü gerçekleştirilen işlemlerin kıymet takası MKS'de AKTEMHES hesapları üzerinden sonuçlandırılacak olup, işlem sonuçları RP146 ve RP147 Raporundan izlenebilecektir. Aynı işlemler RP085 Müşteri Bazında Kıymet Hareket Raporundan da borç kapatmalar için ATETK, alacak aktarımları için ise HTEMA talimat kodu ile izlenebilecektir.
9. Brüt takas işlemlerinde Takasbank'ın TBTAH hesabı altında yer alan BRUT alt hesabı yerine SERB alt hesabı kullanılacaktır.
10. Mevcut uygulamada varolan pay piyasası ve pay senedi repo pazarı arasındaki piyasalar arası aktarım işlemleri uygulamadan kaldırılacaktır.

Normal Şartlı Virman, Takasa Tanımlı Şartlı Virman ve Zincir Şartlı Virman İşlemleri;

1. Mevcut şartlı virman işlemleri, talimat yapıları ve raporlamasına ilişkin değişiklik bulunmamaktadır.
2. İleri valörlü şartlı virman sözleşme bilgileri, Takasbank tarafından MKS'ye valör günü iletilecek olup, şartlı virman blokaj ve gerçekleştirme talimatları valör gününde MKS'den izlenebilecektir.
3. Takas Borcunun şartlı virman kıymet alacakları ile kapatılması durumunda Takasbank kendisine iletilen takas tanımlı eşleşen talimatları MKK' ya ilettiğinde takasa tanımlanan kıymet miktarı hem yatırımcı bazında hem de üye bazında net takas borç kayıtlarıyla karşılaştırılacaktır. Takasa tanımlanan miktar, yatırımcı ve üye bazında net takas borç bilgisine eşit ya da küçük ise takasa tanımlılık kayıtları oluşturulacaktır. Takasa tanımlanan miktar, yatırımcı ve üye bazında net takas borç bilgisinden fazla ise blokaj mesajlarına hata dönülecektir.



İS

4. Şartlı virman borcunun takas kıymet alacakları ile kapatılması durumunda Takasbank kendisine iletilen takas tanımlı eşleşen talimatları MKK' ya ilettiğinde takasa tanımlanan kıymet miktarı hem yatırımcı bazında hemde üye bazında net takas alacak kayıtlarıyla karşılaştırılacaktır. Takasa tanımlanan miktar yatırımcı ve üye bazında net takas alacak bilgisine eşit ya da küçük ise takasa tanımlılık kayıtları oluşturulacaktır. Takasa tanımlanan miktar yatırımcı ve üye bazında net takas alacak bilgisinden fazla ise blokaj mesajlarına hata dönülecektir.
5. Takasbank tarafından MKS'ye iletilmiş eşleşen talimatların, zincir işlemine daha sonra konu olması durumunda önceden gelen normal şartlı virman blokaj talimatlarına Takasbank'tan iptal mesajı gönderilecek olup daha sonra zincire konu şartlı virman blokaj mesajlarının gönderilmesi ile blokaj ve takas talimat süreci zincir şartlı virman için başlatılacaktır.
6. Takasbank tarafından MKS'ye iletilecek olan zincir şartlı virman blokaj mesajlarının bir ya da daha fazlasının hesap hatası aldığı durumlarda , hatasız blokaj mesajları MKS'de tutulmaya devam edilecek olup, sadece hatalı mesaj için Takasbank sisteminden düzeltme mesaj bildirimini gönderilmesi beklenecektir. Düzeltme mesajlarının gelmesiyle blokaj işlemlerine devam edilecektir.



İS