

 MERKEZİ KAYIT İSTANBUL	MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.		
	Tarih 07/09/2018	GENEL MEKTUP No:834	Referans Raporlama İşlemleri
KONU : Tezgahüstü Türev İşlem Verilerinin Raporlanması hk.			

**İLGİLİLER:-SAYIN GENEL MÜDÜR ve SERMAYE PİYASALARI YÖNETİCİLERİ
(ARACI KURUMLAR VE PORTFÖY YÖNETİM ŞİRKETLERİ)**

Sermaye Piyasası Kurulu (Kurul) tarafından sistematik riskin etkin gözetimi ve yönetimi amacıyla aracı kurumlar ve portföy yönetim şirketleri tarafından gerçekleştirilen veya aracılık edilen türev işlemlerinin Kuruluşumuza bildirilmesi kararı alınmıştır. Bu çerçevede;

a. Aracı kurum ve portföy yönetim şirketleri tarafından gerçekleştirilen veya aracılık edilen tezgahüstü türev işlemleri (tüm açık işlem bilgileri) genel mektup ekinde yer alan Rapor Formu (Ek-1), Rapor Formu Açıklamaları (Ek-2) kapsamında 11.09.2018 tarihinden itibaren (10.09.2018 tarihindeki açık pozisyonların raporlanması) Merkezi Kaydi Sistem Uygulamasında CSV Dosya Aktarım İşlemlerinden " TH-Türev İşlemleri İletimi CSV" mesaj işlevi seçilerek dosya aktarımı şeklinde iletilmesi gerekmektedir.

b. Aracı kurumların ve portföy yönetim şirketlerinin yurt içi bankalarla gerçekleştirdikleri tezgahüstü türev işlemlerine ait bilgileri işlem tarafı olan bankanın ilgili işlemi BD111GS "Türev Finansal Araçlar ve Valörlü İşlemler- Müşteriler İtibariyle" formu ile Bankacılık Düzenleme ve Denetleme Kurumu'na (BDDK) bildirmesi halinde, mükerrerlik olmaması için Kuruluşumuza bildirim yapılmasına gerek bulunmamaktadır.

c. Portföy yönetim şirketlerinin aracı kurumlar ile gerçekleştirdikleri tezgahüstü türev işlemleri mükerrer olmaması için sadece aracı kurumlar tarafından Kuruluşumuza bildirilecektir.

d. Kaldıraçlı işlemlere ilişkin olarak Kuruluşumuza herhangi bir bildirim yapılmayacaktır.

e. Yatırımcıların gün sonu itibariyle açık pozisyonları Kuruluşumuza raporlanacaktır.

f. Kuruluşumuza bildirim yapılacak açık pozisyonlu tezgahüstü türev işlemlerinin, en geç bir sonraki gün saat 21:00'a kadar iletilmesi gerekmektedir.

g. Raporlamaya ilişkin format ekte yer almaktadır. (Ek-3)



h. Dięer taraftan, Sermaye Piyasası Kanunu'nun 87 nci maddesi çerçevesinde türev işlemlerin yurt dışı uygulamalara uyumlu bir format dahilinde "e-VEDO: Elektronik Veri Deposu" projesi kapsamında Kuruluşumuza raporlanması ile ilgili çalışmalar da devam etmekte olup, konuyla ilgili ayrıca duyuru yapılacaktır.

Tezgahüstü türev işlemlerinin raporlanmasına ilişkin soruların turev@mkk.com.tr e-posta adresine gönderilmesi uygun olacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

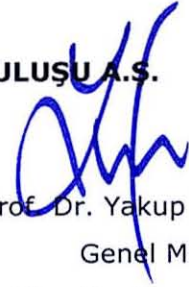
Saygılarımızla;

MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.



Dr. Özgür UYSAL

Veri Depolama ve Raporlama Müdürü



Prof. Dr. Yakup ERGİNCAN

Genel Müdür

Yönetim Kurulu Üyesi

Ek-1: Rapor Formu

Ek-2: Rapor Formu Açıklamaları

Ek 3: Raporlama Formatı

Bilgi İçin: Setenay YAĞANOĞLU 0212 334 5789
Tuba KAYNAK 0212 334 7433
Bilgehan KAVLAK 0212 334 5700/7483