

HİSSE SENEDİ TERCİHLİ REPO PAZARI İŞLEMLERİ

İMKB Tahvil ve Bono Piyasası bünyesinde açılması planlanan Hisse Senedi Tercihli Repo Pazarında İMKB'nin belirlediği hisse senetlerinin geri alım vaadi ile satımı ve geri satım vaadi ile alımı yapılabilecek olup, işlem sonrası repocu ve ters repocu tarafların hisse senedi borçlandırılması/alacaklandırılması ve vade sonunda hisse senetlerinin müşteri hesabına teslimi süreçleri Merkezi Kaydi Sistem (MKS)'de Hisse Senedi Tercihli Repo Alım Satım Uygulamaları üzerinden sonuçlandırılacaktır. İşlemler Takasbank tarafından iletilen işlem bilgileri doğrultusunda oluşturulan talimatlarla sonuçlandırılacaktır. Ayrıca söz konusu pazardaki işlemlerin yeniden değerlemesi sonucunda istenebilecek değer düşüş karşılığı olan menkul kıymetlerin MKK nezdindeki Takasbank'ın ilgili hesabına aktarımı Takasbank sisteminden iletilen talimatla sağlanır.

A- HİSSE TERCİHLİ REPO ALIM SATIM İŞLEMLERİ

- 1- İMKB'deki ilgili pazarda müşteri, portföy ve fon detayında gerçekleşen sözleşme bilgileri İMKB tarafından Takasbank'a bildirilecek olup, hesap bazında netleştirilmiş alım satım bilgileri Takasbank tarafından MKS'ye iletilir.
- 2- Portföy adına yapılan işlemlerin hesap bilgisi aracı kuruluşların Takasbank'a iletecekleri MKS'de 4 sınıflı olarak açılmış AK portföy hesabı olmalıdır. Eğer Portföy hesabı Takasbank'a iletilmemiş ise hesap bilgisi AKHATAP hesabı (Aracı Kurum Hata Portföy Hesabı) olarak kabul edilir.
- 3- Müşteri detayında iletilen hesap numarası 15 karakterden büyük ise hesap bilgisi AKHATAP hesabı olarak kabul edilir.
- 4- Fon detayında iletilen sözleşmeler için hesap numara bilgisi fon kodu olarak belirlenir.
- 5- Takasbank tarafından müşteri (hesap) bazında netleştirme yapılacak olup, hesap numara bilgisi AKHATAP hesabı olan sözleşmeler kendi içerisinde netleştirilirler.
- 6- MKS'de yapılacak hesap kontrolü sonucunda hata alan hesapların işlemleri AKHATAP hesabına yönlendirilir.
- 7- Takasbank tarafından iletilen müşteri bazında net alım satım dosyasındaki hesap numara bilgisi fon kodu olarak iletilen işlemler için, MKS'de aracı kurumlar nezdindeki ilgili fon koduna tanımlanmış işlemci hesapları (8 sınıflı) kullanılır.
- 8- Hesap bazında borç kapatma, alacak aktarım talimatları ve aracı kurum bazında borç kapatma talimatları alım satım bilgileri MKS'ye işlendiğinde otomatik olarak oluşturulur.
- 9- Yatırımcı hesaplarından borç kapatılırken hisse senetleri TAVB (Takas Amaçlı Virman Alt Hesabı)'na aktarılmaz.
- 10- Hisse Senedi Tercihli Repo için Alım Satım onayı yapılmadan yatırımcı hesaplarından borç kapatma ve yatırımcı hesaplarına alacak aktarımı sağlanamaz.
- 11- MKS'de Borç kapatma ve alacak aktarımlarının sağlanabilmesi için aracı kuruluşlar altında yer alan havuz niteliğindeki RPTAH (Repo Takas Havuz Hesabı) ve Takasbank (TVS) altındaki OTH (Özel Sektör Tahvili Takas Havuz Hesabı) hesapları kullanılır.
- 12- MKS'de otomatik oluşturulan talimatlar ile hisse senetleri yatırımcı hesaplarının SERB (serbest) alt hesabından üyenin RPTAH hesabına ve sonrasında TVS altında yer alan OTH hesabına aktarılır. Üye bazında aktarım bilgisi Takasbank sistemine iletilir.
- 13- Takasbank üye bazında alacak aktarım bilgisini MKS'ye iletir. İletilen bilgi doğrultusunda kıymetler, MKS'de TVS altındaki OTH hesabından aracı kuruluşun RPTAH hesabına aktarılır.

Yatırımcı bazında oluşturulan alacak talimatları doğrultusunda kıymetler yatırımcı hesaplarına otomatik olarak aktarılır.

- 14- MKS’de hata olarak AKHATAP hesabına yönlendirilen alım satım bilgileri RP133 Hatalı Emirler Raporundan, yatırımcı bazında borç/alacak bilgileri RP147 Yatırımcı Bazında Alım/Satım Raporundan ve aracı kurum bazında net borç/alacak bilgileri RP146 Aracı Kurum Anlık Net Borç/Alacak Raporundan Takas Tipi “Hisse Repo” seçeneği ile izlenir.
- 15- Otomatik olarak oluşturulan talimatlara ilişkin öncelikler üyeler tarafından değiştirilebilir.

B- PİYASALAR ARASI AKTARIM İŞLEMLERİ

- 1- Piyasalar arası aktarım işlemleri ile yatırımcıların aynı hesap ve aynı takas tarihine ait Hisse Senetleri Piyasasından alacakları ile Hisse Senedi Tercihli Repo Pazarına borçları veya Hisse Senedi Tercihli Repo Pazarından alacakları ile Hisse Senedi Piyasası borçları kapatılabilecektir.
- 2- Acente kurumlar tarafından piyasalar arası aktarım yapılmaz.
- 3- Brüt takas borç ve alacakları piyasalar arası aktarım işlemlerine konu olmaz.
- 4- AKHATAP hesabı için talimat iletilmez.
- 5- Hisse Tercihli Repo pazarı alım satım bilgileri Takasbank tarafından MKS’ye iletilmeden piyasalar arası aktarım talebi iletilmez.
- 6- Aracı kurumların piyasalar arası aktarım talebi iletebilmeleri için her iki piyasaya ilişkin AS30 alım satım onayını yapmaları gerekmektedir.
- 7- Piyasalar arası aktarım tanımlama ve tanımlanan aktarım taleplerinin iptali MKS’de HTR22 Piyasalar Arası Aktarım Tanımlama/İptal ekranından tek aşamalı işlem şeklinde iletilir.
- 8- Alacaklı hesaplar için bir piyasadaki aktarım talebi iletebilmesi için, talep iletilen hesabın ve talebi ileten üyenin aktarım talep adedi kadar aynı hisse senedinden diğer piyasaya net borcu bulunması gerekmektedir.
- 9- Piyasalar arası aktarım hareketleri ilgili hesapların MBLK (Piyasalar Arası Aktarım Blokaj) alt hesapları üzerinden sağlanır.
- 10- Piyasalar arası aktarım talimatı doğrultusunda üyenin ilgili işlemlere ilişkin talimatları otomatik olarak oluşturulur/güncellenir. Gerçekleşen aktarım bilgisi MKS’de hareket raporlarından izlenebilir.
- 11- Piyasalar arası aktarım işlemlerine ilişkin gerçekleşmemiş talimatlar OR28 Talimat Öncelik Değiştirme ekranından izlenebilir.
- 12- Gerçekleşmiş aktarım işlemleri iptal edilemez.
- 13- Saat 15:30’dan sonra piyasalar arası aktarım talebi iletilmez.

C- TEMERRÜT İŞLEMLERİ

- 1- Hisse Senedi Tercihli Repo Pazarına ilişkin yatırımcı bazında alım satım talimatları takas günü akşamı iptal edilecek olup, temerrüt süreci yatırımcı bazında takip edilmeyecektir.
- 2- Üye bazında sonuçlandırılacak temerrüt sürecinde aracı kuruluşlar altında yer alan AKTEMHES hesabı ve MKS’de TVS (Takasbank) üyesi altında yer alan TRTEH (Takasbank Hisse Repo Temerrüt Havuz Hesabı) hesabı kullanılacaktır.
- 3- Takas günü akşamı Takasbank tarafından aracı kurum bazında temerrüt bilgileri MKS’ye iletilecek olup, bu bilgiler doğrultusunda aracı kurumların AKTEMHES hesabından TVS’nin TRTEH hesabına temerrüt borç kapatma talimatları oluşturulacaktır. Temerrüt borçlusu hesaplardan AKTEMHES hesabına kıymet transferi yoluyla borçlu olunan hisse senedi aktarıldığında kurumun temerrüt borcu otomatik olarak kapatılacaktır.
- 4- Takasbank temerrüt alacaklısı aracı kurumlara temerrüt alacağı aktardığında alacaklı olunan hisse senetleri TVS altındaki TRTEH hesabından aracı kurumun AKTEMHES hesabına aktarılacaktır. Aracı kurum AKTEMHES hesabından temerrüt alacaklısı yatırımcı hesabına hisse senetlerini kıymet transferi yoluyla aktarması gerekecektir.
- 5- Aracı kurumun günbaşı net temerrüt borç alacak bilgisi RP152 AK Temerrüt Raporundan Temerrüt tipi : “Hisse Repo” seçeneği ile izlenebilecektir.