

EK-1

VADELİ İŞLEM VE OPSİYON PİYASASI İŞLEMLERİ MKK UYGULAMA ESASLARI

A- HESAP İŞLEMLERİ

- 1- Mevcut açık hesapların veya yeni açılacak hesapların İMKB Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasasında işlem görebilmesi için MKS’de hesapların “VOB” durumunun “Evet” olarak tanımlanması gerekmektedir.

B- DAYANAK VARLIK KAYDI ÖDEME İŞLEMLERİ

- 1- İMKB Vadeli İşlemler Piyasasında işlem görecekt vadeli işlem sözleşmelerinin vadesinde ,opsiyon sözleşmelerinin vadesinde ve vadesinden önce kullanılması sonucunda, doğacak dayanak varlık kaydi ödeme sürecine ilişkin hesap bazında netleştirilmiş borç/alacak bilgileri, işlem tarihi akşamı Takasbank tarafından MKK’ya bildirilir. İşlemlerin takası T+3 günü gerçekleştirilir.
- 2- T günü akşamı borç/alacak bilgileri Merkezi Keydi Sisteme ’ e (MKS) işlendiğinde hesap bazında borç kapatma, alacak aktarım talimatları otomatik olarak oluşturulur. Hesap bazında borç alacak bilgileri, “RP314 -Yatırımcı Bazında VİP Fiziki Teslimat Borç Alacak Raporundan”, üye bazında borç alacak bilgileri “RP313 - Üye Bazında VİP Fiziki Teslimat Borç Alacak Raporundan” izlenir.
- 3- MKS’de yapılacak hesap kontrolü sonucunda hata alan hesapların işlemleri AKHATAP hesabına yönlendirilmekte olup, hata alan hesaplar “RP315 - VİP Hatalı Emirler Raporu’ndan” izlenir.
- 4- Yatırımcı hesaplarından borç kapatılırken kıymetler aracı kuruluşların takas amaçlı virman blokaj tercihleri doğrultusunda TAVB (Takas Amaçlı Virman Blokaj Alt Hesabı)hesabına aktarılır.
- 5- MKS’de borç kapatma ve alacak aktarımlarının sağlanabilmesi için aracı kuruluşlar altında yer alan havuz niteliğindeki OPTAH (Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Takas Havuz Hesabı) ve Takasbank (TVS) altındaki TOTAH (Takasbank Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Takas Havuz Hesabı) hesapları kullanılır.
- 6- Pay senedi piyasasına ait yatırımcı ve üye bazında borç talimatlarına Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasasına ait borç talimatlarına göre öncelik verilecektir. Üyeler bu talimatlar arasında önceliği değiştirebileceklerdir.
- 7- MKS’de otomatik oluşturulan talimatlar ile borçlu olunan menkul kıymetler, yatırımcı hesaplarının SERB (serbest) alt hesabından TAVB (takas amaçlı virman blokaj) alt hesabına, sonrasında üyenin OPTAH hesabına uğratarak TVS altında yer alan TOTAH hesabına aktarılır. Üye tarafından öncelik değiştirilmemişse, Takas borç kapatma talimatları önceliklidir. Üye bazında borç kapatma bilgisi MKS tarafından Takasbank sistemine iletilir.
- 8- Takasbank, üye bazında alacak aktarım bilgisini MKS’ye iletir. İletilen bilgi doğrultusunda kıymetler, MKS’de TVS altındaki TOTAH hesabından aracı kuruluşun OPTAH hesabına aktarılır. Yatırımcı bazında oluşturulan alacak talimatları doğrultusunda kıymetler yatırımcı hesaplarına otomatik olarak aktarılır. Alacak aktarım talimatları için üyelerce öncelik belirlenebilir. Belirlenmediyse küçük miktarda talimattan başlanarak talimat miktarına göre alacaklar aktarılır.

C- TEMERRÜT İŞLEMLERİ

- 1- Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasasına ilişkin takası gerçekleşmeyen borç alacak 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 TOTEH (Takasbank Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Temerrüt Havuz Hesabı) hesapları kullanılacaktır.
- 3- Takas günü akşamı Takasbank tarafından aracı kuruluş bazında temerrüt bilgileri MKS'ye iletilecek olup, bu bilgiler MKS'de "RP154 - VIP Fiziki Teslimat Temerrüt Raporundan" izlenir.
- 4- Temerrüt borcu aracı kuruluşların altında yer alan AKTEMHES hesabı üzerinden kapatılacaktır. Aracı kuruluşlarca kıymetlerin, borçlu hesaplardan kıymetler kıymet transferi yoluyla AKTEMHES hesabına aktarılması gerekmektedir. Kıymetler ilgili hesaptan TVS üyesi altında yer alan TOTEH hesabına otomatik olarak aktarılarak temerrüt borcu kapatılır. Temerrüt borç kapatma bilgisi MKS tarafından Takasbank'a bildirilir.
- 5- Takasbank temerrüt alacaklısı aracı kurumlara temerrüt alacağı aktardığında alacaklı olunan hisse senetleri MKS'de TVS altındaki TOTEH hesabından aracı kurumun AKTEMHES hesabına aktarılır. Aracı kuruluş AKTEMHES hesabından temerrüt alacaklısı yatırımcı hesabına kıymetleri aktarır.