

İstanbul, 22 Nisan 2016

2016/493

GENELGE

No: 28

Konu: Tezgahüstü Türev İşlem Türleri ve İşlemlere Konu Dayanak Varlıkların İlanı ile Tezgahüstü Türev İşlemlerde Kullanılan İşlem Platformu, Program, Modül ve Eklentilerin Birliğe Bildirimine İlişkin Esaslar Hk.

SAYIN ÜYEMİZ,

Sermaye Piyasası Kurulu'nun III-37.1 sayılı "*Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri ile Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ*"inin 25/A maddesinin birinci fıkrası ve 29/B maddesinin birinci fıkrası uyarınca, işlem aracılığı veya portföy aracılığı faaliyeti kapsamında;

(a) Tezgahüstü türev işlemleri gerçekleştirecek **yatırım kuruluşlarınca (aracı kurumlar ve bankalar)** işlem yapacakları türev araç türlerine ve türev araç türlerine konu dayanak varlıklara ilişkin internet sitelerinde yayımlamak zorunda oldukları listenin oluşturulması ve bu listenin Birliğe bildirimine,

(b) **Aracı kurumların** tezgahüstü türev işlemlerde kullandıkları elektronik işlem platformları ile bu platformlarda kullanılan her türlü program, modül ve eklentiler ile bunlarda meydana gelen değişikliklerin bildirimine,

ilişkin Birliğimizce belirlenen usul ve esasların yer aldığı "*Tezgahüstü Türev İşlem Türleri ve İşlemlere Konu Dayanak Varlıkların İlanı ile Tezgahüstü Türev İşlemlerde Kullanılan İşlem Platformu, Program, Modül ve Eklentilerin Birliğe Bildirimine İlişkin Esaslar Hakkında Genelge*"yi yazımız ekinde gereği için bilgilerinize sunarım.

Saygılarımla,

İlkay ARIKAN
Genel Sekreter

Ek: "*Tezgahüstü Türev İşlem Türleri ve İşlemlere Konu Dayanak Varlıkların İlanı ile Tezgahüstü Türev İşlemlerde Kullanılan İşlem Platformu, Program, Modül ve Eklentilerin Birliğe Bildirimine İlişkin Esaslar Hakkında Genelge*"



Tezgahestü Türev İşlem Türleri ve İşlemlere Konu Dayanak Varlıkların İlanı ile Tezgahestü Türev İşlemlerde Kullanılan İşlem Platformu, Program, Modül ve Eklentilerin Birliğe Bildirimine İlişkin Esaslar Hakkında Genelge

1. Amaç ve Kapsam

- (1) Bu Genelge'nin amacı, işlem aracılığı veya portföy aracılığı faaliyeti kapsamında;
 - (a) Tezgahestü türev işlemleri gerçekleştirecek **yatırım kuruluşlarında (aracı kurumlar ve bankalar)** işlem yapacakları türev araç türlerine ve türev araç türlerine konu dayanak varlıklara ilişkin internet sitelerinde yayımlamak zorunda oldukları listenin oluşturulması ve bu listenin Birliğe bildirimini,
 - (b) **Aracı kurumların** tezgahestü türev işlemlerde kullandıkları elektronik işlem platformları ile bu platformlarda kullanılan her türlü program, modül ve eklentiler ile bunlarda meydana gelen değişikliklerin bildirimini, ile ilgili usul ve esasların belirlenmesidir.

2. Dayanak

- (1) Genelge, Sermaye Piyasası Kurulu'nun III-37.1 sayılı Yatırım Hizmetleri Tebliği'nin 25/A maddesinin birinci fıkrası ile 29/B maddesinin birinci fıkrasına dayanılarak düzenlenmiştir.

3. Tanımlar

- (1) Bu Genelge'de geçen;
 - (a) Birlik: Türkiye Sermaye Piyasaları Birliği'ni,
 - (b) Kurul: Sermaye Piyasası Kurulu'nu,
 - (c) Yatırım Hizmetleri Tebliği: Sermaye Piyasası Kurulu'nun III-37.1 Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri İle Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği,
 - (d) Üye Yönetim Sistemi (ÜYS): Birlik üyeleri tarafından yapılacak bildirimlerin elektronik imzalı olarak gerçekleştirilmesi amacıyla Birlik bünyesinde oluşturulmuş yazılım programını, ifade eder.

4. Tezgahestü Türev Araç İşlem Türleri ve İşlemlere Konu Dayanak Varlıklara İlişkin Listenin Yatırım Kuruluşları Tarafından İnternet Sitelerinde İlan Edilmesi ve Birliğe Bildirilmesi

- (1) İşlem aracılığı veya portföy aracılığı faaliyeti kapsamında tezgahestü türev araç işlemleri gerçekleştiren yatırım kuruluşları (aracı kurumlar ve bankalar), işlem yapacakları türev araç türlerini ve türev araç türlerine konu dayanak varlıkları işbu Genelge'de belirlenen esaslar kapsamında "*Tezgahestü Türev İşlem Türleri ve Dayanak Varlıklar*" başlıklı bir liste ile internet sitelerinin türev araç işlemleri ile ilgili sayfalarında ilan eder.
- (2) Yayınlanacak "*Tezgahestü Türev İşlem Türleri ve Dayanak Varlıklar Listesi*"nin işlem yapılacak tüm ürünleri kapsamaması gerekmektedir. Liste'de asgari olarak işbu Genelge ekinde (Ek-1) belirtilen işlem türleri ve dayanak varlıkların, işleme konu olması halinde, yer alması zorunludur.

- (3) Yatırım kuruluşları tarafından internet sitelerinde ilan edilen liste ile bunlarda meydana gelen her türlü değişiklik **internet sitelerinde ilanı takip eden 5 iş günü içerisinde** Birliğe bildirilir.
- (4) İlan edilen listeye ilişkin bildirimler, Birliğimizin ÜYS'de yer alan *"Tezgahestü Türev İşlem Türleri ve Dayanak Varlıklar Bildirimi"* ekranı üzerinden elektronik imzalı olarak yapılır.

5. Tezgahestü Türev İşlemlerde Kullanılan Platformlar, Program, Modül ve Eklentilerin Aracı Kurumlar Tarafından Birliğe Bildirilmesi

- (1) Aracı kurumlar, portföy aracılığı veya işlem aracılığı faaliyeti kapsamında tezgahestü türev işlemlerde kullandıkları elektronik işlem platformları, bu platformda kullanılan her türlü program, modül ve eklenti, bunların çalışma ve kullanım esasları ve amaçları ile bunlara ilave olarak yeni platform, program, modül ve eklenti kullanımı ve bunların değiştirilmesi hususlarını **kullanılmaya başlandıktan itibaren 10 gün içerisinde** Birliğe bildirir.
- (2) Bildirimler, Birliğimizin ÜYS'de *"Tezgahestü Türev İşlemler Platform, Program, Modül ve Eklenti Bildirimi"* ekranı üzerinden elektronik imzalı olarak yapılır. Platform, program, modül ve eklentilerin çalışma ve kullanım esasları ile amaçlarına ilişkin detaylı açıklamalar, bildirim yapılan ekran üzerinden ek doküman olarak gönderilir.
- (3) Birliğe bildirilenler dışında platform, program, modül ve eklenti kullanılamaz.

6. Bildirimlere İlişkin Süreler, Sorumluluk ve Diğer Hükümler

- (1) Aracı kurumlar ve bankalar bildirim yükümlülüklerini Tebliğ'de belirlenen ve yukarıda belirtilen süreler dâhilinde yerine getireceklerdir.
- (2) Bildirimler ÜYS üzerinden bildirimlere konu alanlara veri girişi yapılarak ve talep edilmesi halinde ek dosyalar eklenerek gerçekleştirilecek olup, ÜYS haricinde herhangi bir kaynaktan (yazılı, posta, faks, e-posta, telefon) bildirim kabul edilmeyecektir.
- (3) Bildirim yükümlülüklerinin üyelerimizce süresinde tam ve doğru bir şekilde yerine getirilmemesinin, Kurul'un ilgi tebliğlerine aykırılık oluşturabileceği göz önünde bulundurularak bu konuda üyelerimizce azami özenin gösterilmesi gerekmektedir.

7. Yürütme

- (1) Bu Genelge hükümlerini Birlik yürütür.

8. Yürürlük

- (1) Bu Genelge yayımlandığı tarihte yürürlüğe girer.

Ek 1: Tezgahestü Türev İşlem Türleri ve Dayanak Varlıklar Listesi

İŞLEM TÜRÜ	#	İŞLEME KONU DAYANAK VARLIK
SWAP	1	Para Swabı (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	2	Çapraz Para Swabı - (Cross Currency Swap) - düz / vanilla (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	3	Çapraz Para Swabı - Katımlı Kredi Koruması - yapılandırılmış (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	4	Çapraz Para Swabı - Esnek Kredi Koruması - yapılandırılmış (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	5	Çapraz Para Swabı - Cross Currency Swap with Cap
	6	Çapraz Para Swabı - European Knock Out Cross Currency Swap
	7	Altın Swabı (ONS / gr.)
	8	Menkul Kıymet Swabı
	9	Faiz Swabı (IRS)
	10	Faiz Swabı - Basis Swap
	11	Faiz Swabı - Forward Rate Agreement
	12	Faiz Swabı - Step up Swap
	13	Faiz Swabı - Flexi Period Swap
	14	Faiz Swabı - Flexi Notional Swap
	15	Faiz Swabı - Forward Starting Swap
	16	Kredi Temerrüt Swabı (CDS - Credit Default Swap)
	17	Toplam Getiri Swabı (Total Return Swap)
	18	CMS - (Constant Maturity Swap - Sabit Vade Swabı)
	19	CMCDS (CDS Indexed Constant Maturity Swap - Kredi Temerrüt Swabına Endeksli Menkul Kıymet)
	20	Gösterge Tahvile Endeksli Swap
	21	Kıymetli Maden Swabı (Altın, Platinyum, Gümüş, Paladyum, Diğer)
	22	Endeks Swabı (BIST-100, BIST-30, Dow Jones, Mini Dow Jones, S&P 500, E-mini S&P 500, Diğer)
	23	Emtia Swabı (Petrol, Bakır, Buğday, Pamuk, Mısır, Diğer)
	24	Commodity Asian Swap (Petrol, Bakır, Buğday, Pamuk, Mısır, Diğer)
	25	Currency Asian Swap (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	26	Pay Senedi Swabı (Equity Swap)
	27	Diğer Swaplar (Menkul Kıymet, Finansal Gösterge, Endeks, Diğer)
FORWARD	1	Forward - Vadeli Döviz (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	2	Kıymetli Maden Forward (Altın, Platinyum, Gümüş, Paladyum, Diğer)
	3	Commodity Forward (Petrol, Bakır, Buğday, Pamuk, Mısır, Diğer)
	4	Vadeli Faiz İşlemi (Forward Rate Agreement)
	5	Diğer Vadeli İşlemler (Menkul Kıymet, Finansal Gösterge, Endeks, Diğer)
OPSİYON	1	Para Alım - Satım Opsiyonu (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	2	Faiz Alım - Satım Opsiyonu (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	3	Yapılandırılmış Mevduat DCD (Dual Currency Deposit) (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)

İŞLEM TÜRÜ	#	İŞLEME KONU DAYANAK VARLIK
	4	Yapılandırılmış Mevduat DCR (Dual Currency Repo) (EURO/USD, Sterlin/USD, İsviçre Frankı/USD, Japon Yeni/USD, TL/EURO, TL/USD, TL/Sterlin, Diğer)
	5	Diğer Yapılandırılmış Mevduat (Structured Deposits)
	6	Yapılandırılmış Kredi (Structured Loans)
	7	FX Range Accrual
	8	Interest Range Accrual
	9	Commodity Range Accrual
	10	Düz Avrupa Tipi Opsiyon
	11	Düz Amerikan Tipi Opsiyon
	12	Bariyerli Opsiyon
	13	Flexi Par Forward
	14	Swaption (Swap Opsiyonu)
	15	Dijital Opsiyonlar
	16	Binary Opsiyonlar
	17	Tavan Faiz Opsiyonu (Cap)
	18	Taban Faiz Opsiyonu (Floor)
	19	TARN/TARF İşlemler
	20	Tahvil - Bono Opsiyonu
	21	Pay Senedi Opsiyonu
	22	Futures Opsiyonu
	23	Menkul Değer Alım - Satım Opsiyonu
	24	Kıymetli Maden Alım - Satım Opsiyonu (Altın, Platinyum, Gümüş, Paladyum, Diğer)
	25	Emtia Alım - Satım Opsiyonu (Petrol, Bakır, Buğday, Pamuk, Mısır, Diğer)
	26	Endeks Alım - Satım Opsiyonu (BIST-100, BIST-30, Dow Jones, Mini Dow Jones, S&P 500, E-mini S&P 500, Diğer)
	27	Varant
	28	Diğer Alım - Satım Opsiyonu
	29	Diğer Opsiyonlar (Menkul Kıymet, Finansal Gösterge, Endeks, Diğer)
<u>DiĞER TÜREV</u>	1	CLN (Credit Link Note)
	2	Diğer Türev Alım - Satım
	3	Diğer işlemler