

İstanbul, 22 Nisan 2016

2016/494

## GENELGE No: 29

Konu: Piyasada Oluşan Özel Hallerin Raporlanmasına İlişkin Esaslar Hk.

SAYIN ÜYEMİZ,

Sermaye Piyasası Kurulu'nun (Kurul) III-37.1 sayılı Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri İle Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ'inin 29/A maddesi uyarınca **kaldıraçlı işlemlerde;**

- (a) Müşteri işlemlerinin yapılmasını engelleyecek düzeydeki aracı kurum elektronik işlem platformundan kaynaklanan teknik sorunların bildirimine,
- (b) İşlem yapılan varlıklarda meydana gelen olağandışı fiyat hareketleri, bu fiyat hareketleri sonucunda Birlik tarafından belirlenen oranları aşacak şekilde oluşan fiyat boşlukları ve bu olağandışı fiyat hareketleri sonucunda zarar ederek pozisyonu kapanan yatırımcı sayısı ile oluşan zarar tutarının bildirimine,

İlişkin Birliğimizce belirlenen usul ve esasların yer aldığı "*Piyasada Oluşan Özel Hallerin Raporlanmasına İlişkin Esaslar Hakkında Genelge*"yi yazımız ekinde gereği için bilgilerinize sunarım.

Saygılarımla,

İlkay ARIKAN  
Genel Sekreter

*Ek: Piyasada Oluşan Özel Hallerin Raporlanmasına İlişkin Esaslar Hakkında Genelge*



# Piyasada Oluşan Özel Hallerin Raporlanmasına İlişkin Esaslar Hakkında Genelge

## 1. Amaç ve Kapsam

- (1) Bu Genelge'nin amacı, **kaldıraçlı işlemlerde;**
  - (a) Müşteri işlemlerinin yapılmasını engelleyecek düzeydeki aracı kurum elektronik işlem platformundan kaynaklanan teknik sorunların bildirimini,
  - (b) İşlem yapılan varlıklarda meydana gelen olağandışı fiyat hareketleri, bu fiyat hareketleri sonucunda Birlik tarafından belirlenen oranları aşacak şekilde oluşan fiyat boşlukları ve bu olağandışı fiyat hareketleri sonucunda zarar ederek pozisyonu kapanan yatırımcı sayısı ile oluşan zarar tutarının bildirimini,ile ilgili usul ve esasların belirlenmesidir.

## 2. Dayanak

- (1) Genelge, Sermaye Piyasası Kurulu'nun III-37.1 sayılı Yatırım Hizmetleri Tebliği'nin 29/A maddesine dayanılarak düzenlenmiştir.

## 3. Tanımlar

- (1) Bu Genelge'de geçen;
  - (a) Birlik: Türkiye Sermaye Piyasaları Birliği'ni,
  - (b) Kurul: Sermaye Piyasası Kurulu'nu,
  - (c) Olağandışı Fiyat Hareketi: Son fiyat ile bir önceki fiyat arasında mutlak anlamda (yukarı ya da aşağı yönlü) %2 oranından fazla meydana gelen fiyat farklılıklarını,
  - (d) Üye Yönetim Sistemi (ÜYS): Birlik üyeleri tarafından yapılacak bildirimlerin elektronik imzalı olarak gerçekleştirilmesi amacıyla Birlik bünyesinde oluşturulmuş yazılım programını,
  - (e) Yatırım Hizmetleri Tebliği: Sermaye Piyasası Kurulu'nun III-37.1 Yatırım Hizmetleri ve Faaliyetleri İle Yan Hizmetlere İlişkin Esaslar Hakkında Tebliği'ni,ifade eder.

## 4. Kaldıraçlı İşlemlerde Müşteri İşlemlerinin Yapılmasını Engelleyecek Düzeydeki Elektronik İşlem Platformundan Kaynaklanan Teknik Sorunların Birliğe Bildirilmesi

- (1) Aracı kurumlar, kaldıraçlı işlemlerde müşterilerine sundukları hizmet sağlayıcı elektronik işlem platformlarında, müşteri işlemlerinin yapılmasını engelleyecek düzeyde meydana gelen teknik sorunları, Birliğin ÜYS'de yer alan "*Elektronik İşlem Platformundan Kaynaklanan Teknik Sorunların Bildirimi*" ekranı üzerinden elektronik imzalı olarak Birliğe bildirmek zorundadır.
- (2) Yapılacak bildirimde, teknik sorunun yaşandığı başlangıç ve bitiş zaman aralığı (gün, ay, yıl ve saat, dakika, saniye) ve teknik sorunun nedeni belirtilecektir.
- (3) Teknik sorununun meydana geldiği tarihi takiben 2 iş günü içerisinde bu bildirim yapılması gerekmektedir.

## 5. Kaldıraçlı İşlemlerde Olağandışı Fiyat Hareketlerinin Birliğe Raporlanması

- (1) Aracı kurumlar, kaldıraçlı alım satım işlemlerine konu varlıklarda meydana gelen olağandışı fiyat hareketleri (+,- %2) ile bu fiyat hareketleri neticesinde zarar ederek pozisyonu kapanan yatırımcı sayısını ve oluşan zarar tutarını, Birliğin ÜYS'de yer alan "*Olağandışı Fiyat Hareketleri Raporlama*" ekranı üzerinden elektronik imzalı olarak Birliğe bildirmek zorundadır.
- (2) Yapılacak bildirimde, olağandışı fiyat hareketlerinin meydana geldiği zaman aralığı (gün, ay, yıl ve saat, dakika, saniye) ve işleme konu varlık bilgisi ile fiyat hareketinin bilinebilen nedeni belirtilecektir.
- (3) Olağandışı fiyat hareketleri sonucunda zarar ederek pozisyonu kapanan yatırımcıların bulunması halinde, yatırımcı sayısı ve zarar tutarı da belirtilecektir.
- (4) Olağandışı fiyat hareketlerinin meydana geldiği tarihi takiben 2 iş günü içerisinde bu bildirim yapılması gerekmektedir.

## 6. Bildirim ve Raporlamaya İlişkin Süreler, Sorumluluk ve Diğer Hükümler

- (1) Aracı kurumlar bildirim yükümlülüklerini 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.