

Türev İşlemlerinin İletilmesi

Alan Bilgileri:

Alan İsmi	Tipi	Uzunluk	Zorunlu / Opsiyonel	Ek Özellikler
EMİR SIRA NUMARASI	N	Max.17	Z	
MÜŞTERİNİN KİMLİK KODU TÜRÜ	A	Max 4	Z	TCKN, VKN, BIC değerlerinden biri olmalıdır.
MÜŞTERİNİN KİMLİK KODU	A	Max 11	Z	TCKN nümerik 11 karakterden oluşmalı, Vergi No nümerik 10 veya 11 karakterden oluşmalı, BIC 11 karakterden oluşmalıdır.
MÜŞTERİ ADI	A	Max 150	O	Seçilen kimlik kodu türüne göre müşteri adı veya ünvanının yer aldığı alandır.
SEKTÖR VE OFF SHORE KODU	A	3	O	Ek.deki gibidir.
İŞLEM TÜR KODU	A	4	Z	Ek.deki gibidir.
ÜLKE KODU	A	2	Z	Geçerli Ülke Kodu olmalıdır
PARA KODU	A	3	Z	Geçerli Para Kodu olmalıdır
ORJİNAL PARA TUTARI- BİN	N	Max 20	Z	Raporlama dönemi itibarıyla bakiyesi olan işlemler, muhasebe kayıtlarında yer alan orjinal para cinsi üzerinden bu sütunda gösterilecektir.
TL KARŞILIĞI - BİN	N	Max 20	O	İşlem tutarının cari dönem bakiyesi Türk Lirası cinsinden bin TL olarak bu sütuna yazılacaktır.
REFERANS FAİZ ORANI	A	Max 15	O	Referans Faiz Oranı bilgisi girilecektir.
FAİZ ORANI	N	Max 3.2	Z	Faiz oranı bilgisi girilecektir.
İŞLEM TARİHİ	D		Z	GG-AA-YYYY formatında olmalıdır.
VADE TARİHİ	D		O	GG-AA-YYYY formatında olmalıdır.
KARŞI PARA KODU	A	3	O	Geçerli Para Kodu olmalıdır
SPOT KUR	N	Max 9.5	O	Spot Kur bilgisi girilecektir.
FORWARD KUR	N	Max 9.5	O	Forward Kur bilgisi girilecektir.
DEPOZİT (MARGIN/PREMIUM):	N	Max 14.6	O	Depozit bilgisi girilmelidir.
REESKONT TUTARI	N	Max 14.6	Z	Reeskont tutarı girilecektir.
CARİ PİYASA DEĞERİ	N	Max 14.6	O	Cari piyasa değeri girilecektir.
DELTA	A	Max 10	O	Alım opsiyonunun deltası 0 ile 1 arasında, satım opsiyonunun deltası -1 ile 0 arasında olmalıdır.
GAMA	A	Max 9	Z	
İŞLEM AMACI	N	1	Z	Ek.deki gibidir.
KARŞI TARAFIN İŞLEM AMACI	N	1	Z	Ek.deki gibidir.
ALT TÜR KODU	N	3	O	Ek.deki gibidir.
OPSİYON ŞARTI	A	1	O	Bir türev işlem (Opsiyonlara ait işlem tür kodları hariç) aynı zamanda bir opsiyon veya koşul içeriyorsa bu sütuna "O" yazılacaktır. Herhangi bir opsiyon veya koşul içermeyenler için bu sütun boş bırakılacaktır.
ORJİNAL PARA TUTARI DEĞİŞİMİ	A	1	Z	İlgili satırda "Orjinal Para Tutarı" sütununda raporlanan tutarın, işlemin vadesi içerisinde değişmesi söz konusu ise orjinal tutarın vadesi içerisinde değişebileceğini gösteren

				"D" kodu yazılacaktır. Eğer işlemin vadesi boyunca söz konusu orjinal para tutarında değişiklik olmayacak ise bu alan boş bırakılacaktır.
İŞLEMİN YAPILDIĞI PİYASA	N	1	Z	Ek.deki gibidir.
İŞLEM NO	A	Max 52	Z	Bu alana raporlanan işleme ilişkin banka tarafından verilmiş ayırt edici kodlar alfanumerik olarak tanımlanmış bu alana yazılacaktır. İşlemin farklı satırlarda yer alan bacalarının tümüne, aynı işlem den kaynaklandığının tespit edilebilmesi amacıyla aynı işlem no'su yazılacaktır.
VALÖR TARİHİ	D		Z	GG-AA-YYYY formatında olmalıdır.
İŞLEMİN YAPILIŞ AMACI	N	1	O	Ek.deki gibidir.
TEMİNAT PORTFÖYÜ 1	N	Max 14.6	O	
TEMİNAT PORTFÖYÜ 2	N	Max 14.6	O	
TEMİNAT PORTFÖYÜ 3	N	Max 14.6	O	
TOPLAM TEMİNAT PORTFÖYÜ	N	Max 14.6	O	
MÜŞTERİ LİMİTİ	N	Max 14.6	Z	
EKLEME/SİLME	A		Z	Ekleme işlemi için I, silme işlemi için D girilecektir.

Örnek CSV Formatları

TCKN BİLGİSİ İLE KAYIT EKLEME

15,TCKN,2435888666,KULLANICI AD,OBA,VDAL,TR,TRY,10,10,10,10.05,15-05-2018,15-05-2019,USD,6.5,1,10,20.15,1000,0.5,0.5,1,1,100,O,D,1,1A,15-05-2019,1,10000.25,20000,1000,40000.5,2000000.25,I

VKN BİLGİSİ İLE KAYIT EKLEME

155,VKN,4358886666,TEST A.S.,OBA,VDAL,TR,TRY,10,10,10,10.05,15-05-2018,15-05-2019,USD,6.5,1,10,20.15,1000,0.5,0.5,1,1,100,O,D,1,1A,15-05-2019,1,10000.25,20000,1000,40000.5,2000000.25,I

BIC BİLGİSİ İLE KAYIT EKLEME

1555,BIC,CAYTTRIS001,TEST A.S.,OBA,VDAL,TR,TRY,10,10,10,10.05,15-05-2018,15-05-2019,USD,6.5,1,10,20.15,1000,0.5,0.5,1,1,100,O,D,1,1A,15-05-2019,1,10000.25,20000,1000,40000.5,2000000.25,I

KAYIT SİLME

1555,BIC,CAYTTRIS001,TEST A.S.,OBA,VDAL,TR,TRY,10,10,10,10.05,15-05-2018,15-05-2019,USD,6.5,1,10,20.15,1000,0.5,0.5,1,1,100,O,D,1,1A,15-05-2019,1,10000.25,20000,1000,40000.5,2000000.25,D

1
64

EK

SEKTÖR VE OFF SHORE KODU:

OBA: Off-shore'da faaliyet gösteren bankalar
OBD: Off-shore'da faaliyet gösteren banka dışı mali kesim
OGK: Off-shore'da faaliyet gösteren gerçek kişiler
ODT: Off-shore'da faaliyet gösteren diğer tüzel kişiler
SBA: Off-shore dışındaki yerlerde faaliyet gösteren bankalar
SBD: Off-shore dışındaki yerlerde faaliyet gösteren banka dışı mali kesim
SGK: Off-shore dışındaki yerlerde faaliyet gösteren gerçek kişiler
SDT: Off-shore dışındaki yerlerde faaliyet gösteren diğer tüzel kişiler

İŞLEM TÜR KODU:

Vadeli Döviz Alım	VDAL
Vadeli Döviz Satım	VDSA
Vadeli Faiz Sözleşmesi Alım	VFAL
Vadeli Faiz Sözleşmesi Satım	VFSA
Vadeli Hisse Senetleri Alım	VHAL
Vadeli Hisse Senetleri Satım	VHSA
Vadeli Kıymetli Maden Alım	VKMA
Vadeli Kıymetli Maden Satım	VKMS
Vadeli Emtia Alım	VEAL
Vadeli Emtia Satım	VESA
Vadeli Endeks Alım	VENA
Vadeli Endeks Satım	VENS
Vadeli Kira Sertifikaları Alım	VKSA
Vadeli Kira Sertifikaları Satım	VKSS
Vadeli Diğer Alım	VDGA
Vadeli Diğer Satım	VDGS
Swap Para Alım	SPAL
Swap Para Satım	SPSA
Swap Faiz Alım	SFAL
Swap Faiz Satım	SFSA
Swap Hisse Senetleri Alım	SHAL
Swap Hisse Senetleri Satım	SHSA
Swap Kredi Temerrüt Alım	SKAL
Swap Kredi Temerrüt Satım	SKSA
Swap Toplam Getiri Alım	SGAL
Swap Toplam Getiri Satım	SGSA
Swap Kıymetli Maden Alım	SKMA
Swap Kıymetli Maden Satım	SKMS
Swap Emtia Alım	SEAL
Swap Emtia Satım	SESA
Swap Endeks Alım	SENA

✓
OL

Swap Endeks Satım	SENS
Swap Diğer Alım	SDGA
Swap Diğer Satım	SDGS
Futures Para Alım	FPAL
Futures Para Satım	FPSA
Futures Faiz Alım	FFAL
Futures Faiz Satım	FFSA
Futures Hisse Senetleri Alım	FHSA
Futures Hisse Senetleri Satım	FHSS
Futures Kıymetli Maden Alım	FKMA
Futures Kıymetli Maden Satım	FKMS
Futures Emtia Alım	FEAL
Futures Emtia Satım	FESA
Futures Endeks Alım	FENA
Futures Endeks Satım	FENS
Futures Diğer Alım	FDGA
Futures Diğer Satım	FDGS
Para Alım Opsiyonu (Satıcı)	PAOS
Para Satım Opsiyonu (Satıcı)	PSOS
Faiz Alım Opsiyonu (Satıcı)	FAOS
Faiz Satım Opsiyonu (Satıcı)	FSOS
Para Alım Opsiyonu (Alıcı)	PAOA
Para Satım Opsiyonu (Alıcı)	PSOA
Faiz Alım Opsiyonu (Alıcı)	FAOA
Faiz Satım Opsiyonu (Alıcı)	FSOA
Menkul Değer Alım Opsiyonu (Satıcı)	MAOS
Menkul Değer Satım Opsiyonu (Satıcı)	MSOS
Menkul Değer Alım Opsiyonu (Alıcı)	MAOA
Menkul Değer Satım Opsiyonu (Alıcı)	MSOA
Kıymetli Maden Alım Opsiyonu (Satıcı)	KAOS
Kıymetli Maden Satım Opsiyonu (Satıcı)	KSOS
Kıymetli Maden Alım Opsiyonu (Alıcı)	KAOA
Kıymetli Maden Satım Opsiyonu (Alıcı)	KSOA
Emtia Alım Opsiyonu (Satıcı)	EAOS
Emtia Satım Opsiyonu (Satıcı)	ESOS
Emtia Alım Opsiyonu (Alıcı)	EAOA
Emtia Satım Opsiyonu (Alıcı)	ESOA
Endeks Alım Opsiyonu (Satıcı)	NAOS
Endeks Satım Opsiyonu (Satıcı)	NSOS
Endeks Alım Opsiyonu (Alıcı)	NAOA
Endeks Satım Opsiyonu (Alıcı)	NSOA
Diğer Alım Opsiyonu (Satıcı)	UAOS
Diğer Satım Opsiyonu (Satıcı)	USOS
Diğer Alım Opsiyonu (Alıcı)	UAOA
Diğer Satım Opsiyonu (Alıcı)	USOA
Diğer Türev Alım	DGRA
Diğer Türev Satım	DGRS

7
04

Menkul Değerler Alım Taahhütlerimiz	VMAT
Menkul Değerler Satım Taahhütlerimiz	VMST
Döviz Alım Taahhütlerimiz	VDAT
Döviz Satım Taahhütlerimiz	VDST
Vadeli Mevduat Alım Taahhütlerimiz	MVAT
Vadeli Mevduat Satım Taahhütlerimiz	MVST
Diğer Valörlü Alım	DVAL
Diğer Valörlü Satım	DVSA

İŞLEM AMACI:

- 1 - Alım-Satım amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar.
- 2 - Riskten korunma (Hedging) amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar.

KARŞI TARAFIN İŞLEM AMACI

- 1 - Alım-Satım amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar.
- 2 - Riskten korunma (Hedging) amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar.

ALT TÜR KODU:

ALT TÜR KODU AÇIKLAMASI

ALT TÜR KODU	ALT TÜR KODU AÇIKLAMASI
100	Para Swabı
101	Çapraz Para Swabı-(Cross Currency Swap)-düz-vanilla
102	Çapraz Para Swabı-Katılımlı Kredi Koruması-yapılandırılmış
103	Çapraz Para Swabı-Esnek Kredi Koruması-yapılandırılmış
104	Altın Swabı
105	Faiz Swabı (IRS)
106	Faiz Swabı - basis swap
107	Faiz Swabı - forward rate agreement
108	Faiz Swabı - step up swap
109	Faiz Swabı - flexi period swap
110	Faiz Swabı - flexi notional swap
111	Faiz Swabı - forward starting swap
112	Kredi temerrüt swabı (CDS-Credit Default Swap)
113	Total Return Swap
114	CMS- (Constant Maturity swap - Sabit vade swabı)
115	CMCDS (CDS indexed constant maturity swap- Kredi temerrüt swabına endeksli menkul kıymet)
116	Gösterge Tahvile Endeksli Swap
117	Emtia Swabı
118	Commodity Asian Swap
119	Equity Swap
199	Diğer Swaplar
200	Forward - Vadeli Döviz
201	Kıymetli Maden forward
202	Commodity NDF (Non-Deliverable Frwd)
299	Diğer Vadeli İşlemler
300	Yapılandırılmış Mevduat DCD (Dual Currency Deposit)
301	Yapılandırılmış Mevduat DCR (Dual Currency Repo)
302	Diğer Yapılandırılmış Mevduat (Structured deposits)
303	Yapılandırılmış Kredi (Structured loans)
304	FX Range Accrual

4
04

305	Interest Range Accrual
306	Commodity Range Accrual
307	Düz Avrupa Tipi Opsiyon
308	Düz Amerikan Tipi Opsiyon
309	Bariyerli Opsiyon
310	Swaption
311	Dijital Opsiyonlar
312	Binary Opsiyonlar
313	Faiz Opsiyonu (Cap)
314	Faiz Opsiyonu (Floor)
315	Tahvil-Bono Opsiyonu
316	Hisse Senedi Opsiyonu
317	Futures Opsiyonu
318	Varant
399	Diğer Opsiyonlar
400	Döviz
401	Faiz
402	Emtia
403	Endeks
404	US Treasury Futures
499	Diğer Futures İşlemleri
500	CLN (Credit Link Note)
600	Spot Döviz İşlemi (Valörlü İşlemler)
900	Diğer işlemler

İŞLEMİN YAPILDIĞI PİYASA:

- 1-Organize Piyasa
- 2-Tezgah Üstü Piyasa (OTC)

İŞLEMİN YAPILIŞ AMACI:

1. Müşteri İşlemleri
2. Müşteri işlemlerini hedge etmek amacıyla gerçekleştirilen işlemler
3. Aktif-pasif yönetimi amacıyla gerçekleştirilen işlemler
4. Alım-satım amaçlı veya bunları hedge etmek amaçlı işlemler

El Sivan