

İŞLEM KODU ÜRETİMİ GENEL KURALLARI:

- 1) Taraf Kodu 1: (3 karakter): Alfabetik olarak ilk gelen kurumun MKK üye kodu girilir. (Üye kodları listesi ekte yer almaktadır.)
- 2) İşlem Tarihi (8 karakter): İşlemin yapıldığı tarih (YYYYMMGG) – ExecutionDate girilir.
- 3) Taraf Kodu 2: (3 karakter): Alfabetik olarak ikinci gelen kurumun MKK üye kodu girilir. (Üye kodları listesi ekte yer almaktadır.)
- 4) Dayanak Varlık Detayı (5 karakter) Varlık Sınıfına göre aşağıdaki şekilde girilir.

a. Varlık sınıfı: Para Birimi

Kur/Oran/Paritenin (forwardExchangeRate) ilk 5 karakteri alınır. Yuvarlama yapılmaz. Eğer 5 karakter yok ise olmayan karakterlerin yerine "0" (sıfır) yazılır.

Örnek 1: 5,784568 forward kuru olan bir işlem için 57845 yazılır.

Örnek 2: 5,7 forward kuru olan bir işlem için 57000 yazılır.

b. Varlık Sınıfı: Faiz Oranı

b.1. Varsa sabit bacağı (fixedRateOfLeg1) faiz oranı yüze bölünmeksizin yukarıdaki prensibe göre yazılır. Eğer 5 karakter yok ise olmayan karakterlerin yerine "0" (sıfır) yazılır.

Örnek 1: % 2,25 ise 22500 yazılır.

Örnek 2: %0,25 ise 02500 yazılır.

b.2. İki Sabit bacaklı faize dayalı ürün olması durumunda; ilk sabit bacağı (fixedRateOfLeg1) faiz oranı yüze bölünmeksizin yukarıdaki prensibe göre yazılır. Eğer 5 karakter yok ise olmayan karakterlerin yerine "0" (sıfır) yazılır.

b.3. Faize dayalı ürünlerde sabit bacak yoksa, referans endeksin alfabetik sıraya göre ilk belirlenen bacağı faiz oranı yüze bölünmeksizin yukarıdaki prensibe göre yazılır.

c. Varlık Sınıfı: Emtia

Baz Emtia Kodu ve Emtia Detayı aşağıdaki tablo kullanılarak yazılır. Son 1 basamağa "0" eklenir.

Baz Emtia (commodityBase):

AG= Tarım

EN= Enerji

FR=Navlun

ME= Metal

IN= Endeks

EV= Çevresel

EX= Egzotik

OT= Diğer

Emtia Detayları (commodityDetails):

Baz Emtia "Tarım" ise;

GO = Buğday ve Tahıl,

DA = Süt ürünleri,
LI = Canlı hayvan,
FO = Orman ürünleri,
SO = Yumuşaklar(Pamuk, kahve, meyve gibi..)

Baz Emtia "Enerji" ise;
OI = Petrol
NG =Doğalgaz,
CO = Kömür,
EL = Elektrik,
IE = Enerjiler arası(Inter-energy)

Baz Emtia "Metaller" ise;
PR = Kıymetli olanlar,
NP = Kıymetli olmayanlar

Baz Emtia "Çevresel" ise;
WE = Hava,
EM = Emisyon

Baz Emtia "Diğer" ise;
OT = Diğer

d. Varlık Sınıfı: Kredi

Öncelik (seniority) bilgisi yazılır. Öncelik kodu için aşağıdaki tablo kullanılır. Sonuna "0" gelir.
SNDB = Üst dereceli, öncelikli teminatsız borçlar (şirket/finansal), yabancı para ülke borçları (devlet) gibi
SBOD = İkincil dereceli, ikincil dereceli ya da ikinci katman borçları (bankalar) gibi
OTHR = Diğer, tercihli paylar ya da birinci katman sermaye (bankalar) ya da diğer kredi türevleri gibi

e. Varlık Sınıfı: Pay Senedi

Sadece EQ yazılır. Sonuna "000" eklenir.

f. Varlık Sınıfı: Diğer

Sadece OT yazılır. Sonuna "000" eklenir.

g. Varlık Sınıfı: Diğer Menkul Değerler

Sadece SC yazılır. Sonuna "000" eklenir.

5) Sözleşme Türü (2 karakter) Sözleşme Türü kodu için aşağıdaki tablo kullanılır:

CD = Fark sözleşmeleri
FR = Forward oran sözleşmeleri
FU = Future
FW = Forward
OP = Opsiyon
SW = Swap
ST = Swap Opsiyon
OT = Diğer

6) Varlık Sınıfı (2 karakter) Varlık Sınıfı kodu için aşağıdaki tablo kullanılır:

CO = Emtia

CR = Kredi

CU = Para birimi

EQ = Pay senedi

IR = Faiz oranı

OT = Diğer

SC = Diğer Menkul Kıymetler

7) Nominal Tutar (12 karakter): Nominal tutar(notional) yazılacaktır. Virgülden sonraki tutar yazılmayacaktır. Yuvarlama yapılmayacaktır. 12 karakterden az olan tutarların başına 12 ye tamamlayacak kadar "0" gelecektir.

8) Vade Tarihi (8 karakter): İşlemin vade tarihi (YYYYMMGG) (maturityDate) girilir.

9) İşlem Numarası (3 karakter): Aynı yatırım kuruluşu ilk 8 adımdaki karakterlerin aynı olduğu birden fazla işlem var ise işlem tarihindeki işlem numarası yazılır. (Eğer sadece bir işlem var ise 001 yazılacaktır.)

Örnk: 001, 002, 003, ... şeklinde 999'a kadar girilir.