



MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.

FORM AÇIKLAMA DOKÜMANI

FORM ADI: YATIRIMCI RİSK TAKİP SİSTEMİ - YRTS

FORMUN AMACI:

Bu form, Yatırım Kuruluşları müşterilerinin (yatırımcıların) kredili alım, açığa satış ve ödünç menkul kıymet işlemlerine ilişkin risklerinin izlenmesi amacıyla hazırlanmıştır.



İÇİNDEKİLER

A. RAPORLAMA YÜKÜMLÜLÜĞÜ	7
B. RAPORLAMA KAPSAMI	7
C. KAPSAM TARİHİ	9
D. SİSTEM ÖZELLİKLERİ	8
E. FORM ADI	9
F. PARA BİRİMİ	9
G. FORMUN AMACI	9
H. FORMUN DOLDURULMA ZAMANLARI	9
I. FORMA İLİŞKİN GENEL AÇIKLAMALAR	10
J. FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI RİSK AKTARIM SERVİSİ)	11
1. İşlem referansı	11
2. Üye kodu	11
3. Raporlama Tarihi	11
4. Yatırımcı Bilgisi	11
5. Toplam tahsis edilen kredi limiti	11
(a) Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti	12
(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit	12
(c) Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit	12
(d) Toplam tahsis edilen limit	12
(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti	12
6. Toplam kullanılabilir kredi limiti	12
(a) Kredili alım işlemi için kullanılabilir kredi limiti	12
(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit	12
(c) Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit	12
(d) Toplam kullanılabilir limit	12
(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam kullanılabilir kredi limiti	13
7. Toplam kullanılan kredi	13
(a) Kredili Alım İşlemi için kullanılan kredi	13
(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri	13
(c) Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri	13
(d) Toplam risk tutarı	13
(e) Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı	13
8. Değerlenmiş Teminat Tutarı	14



(a)	Değerlenmiş Teminat Tutarı	14
(b)	Banka aracılığıyla kullanılan kredi karşılığında teminat olarak verilen menkul kıymetlerin piyasa değeri	15
9.	Temerrüt Durumu	15
(a)	Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı	15
(b)	Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)	15
(c)	Ödünç alınan menkul kıymetlerden temerrütte bulunanların cari piyasa değeri	16
(d)	Banka aracılığıyla kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı	16
10.	Özkaynak tamamlama bildirimleri	16
(a)	Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı	16
(b)	Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı	16
11.	Net açığa satış pozisyonu- menkul kıymet	17
(a)	Kıymete ait ISIN kodu	17
(b)	Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon nominal değeri	17
(c)	Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon cari değeri	17
12.	Ödünç Menkul Kıymet Verileri	17
(a)	Kıymete ait ISIN kodu	18
(b)	Menkul kıymet miktarı	18
(c)	Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri	18
(d)	Ödünç işlem tarihi	18
(e)	Ödünç valör tarihi	18
(f)	Ödünç vade tarihi	18
K.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK SORGU SERVİSİ)	18
1.	İşlem referansı	18
2.	Üye kodu	19
3.	Sorgu Tipi (T/Y)	19
4.	Yatırımcı Bilgisi	19
(a)	Yatırımcı MKK Sicil Numarası	19
(b)	Yatırımcı TCKN	19
(c)	Yatırımcı VKN	19
L.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI RİSK RESPONSE SERVİSİ)	19
1.	İşlem referansı	19
2.	Yatırımcı Bilgisi	20
	Yatırımcı MKK Sicil Numarası	20
3.	Kurumlardaki toplam tahsis edilen kredi limiti	20



(a)	Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti	20
(b)	Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit	20
(c)	Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit	20
(d)	Toplam tahsis edilen limit	20
(e)	Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti	20
4.	Toplam kullanılabilir kredi limiti	20
(a)	Kredili Alım İşlemi için kullanılabilir kredi limiti	20
(b)	Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit	20
(c)	Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit	20
(d)	Toplam kullanılabilir limit	20
(e)	Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için kullanılabilir kredi limiti	20
5.	Toplam kullanılan kredi	21
(a)	Kredili alım işlemi için kullanılan kredi	21
(b)	Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri	21
(c)	Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri	21
(d)	Toplam risk tutarı	21
(e)	Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı	21
6.	Kredi Limiti Veren Toplam Kurum Sayısı	21
7.	Temerrüt Durumu	21
(a)	Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)	21
(b)	Ödünç alınan menkul kıymetlerden temerrütte bulunanların cari piyasa değeri (faiz dahil)	21
(c)	Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)	21
(d)	Banka aracılığıyla Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı	21
8.	6 ay nakde zorlanma cezası	22
(a)	6 ay nakde zorlanma cezası başlangıç tarihi	22
(b)	6 ay nakde zorlanma cezası bitiş tarihi	22
9.	İşlem Yasağı Listesi	22
(a)	İşlem yasağı Kurul karar tarihi	22
(b)	Pay senedi bilgisi	22
10.	Borsa Tedbir Listesi	22
(a)	Uygulanan tedbir kodu	22
(b)	Uygulanan tedbir adı	22
(c)	Tedbir başlangıç tarihi	22
(a)	Tedbir bitiş tarihi	23



11.	Diğer Tedbirler ve İşlem Yasakları Listesi	23
(a)	Tedbir başlangıç tarihi	23
(b)	Tedbir bitiş tarihi	23
(c)	Pay senedi bilgisi	23
(d)	Tedbir nedeni	23
12.	Türev Verileri (VIOP)	23
(a)	Sözleşme Türü	23
(b)	Varlık Sınıfı	23
(c)	Sözleşmelerin toplam piyasa değeri	23
(d)	Sözleşmelerin toplam teminat değeri	24
(e)	VIOP raporlama tarihi	24
13.	Kaldıraçlı Alım Satım Bilgileri (KASİ)	24
(a)	Net kar-zarar	24
(b)	Kaldıraçlı alım satım teminat tutarı	24
(c)	İşlem tarihi	24
14.	Yatırımcının hacizde kıymeti olup olmadığı bilgisi	24
15.	Tüm kurumlardaki bakiyeli hesap sayısı	24
16.	Tüm kurumlardaki toplam hesap sayısı	24
17.	İflas	24
18.	Özkaynak tamamlama bildirimleri	25
(a)	Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı	25
(b)	Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı	25
M.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (ÖDÜNÇ & AÇIĞA SATIŞ SORGU)	25
1.	İşlem referansı	25
2.	Üye kodu	25
N.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (ÖDÜNÇ & AÇIĞA SATIŞ RESPONSE)	25
1.	İşlem referansı	25
2.	Ödünç Menkul Kıymet Verileri	25
(a)	Kıymete ait borsa kodu	25
(b)	Menkul kıymet miktarı	25
(c)	Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri	26
(d)	Ödünç işlem tarihi	26
(e)	Ödünç valör tarihi	26
(f)	Ödünç vade tarihi	26
3.	Açığa Satış Verileri	26



(a)	Menkul kıymet borsa kodu	26
(b)	Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı	26
(c)	Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı	26
O.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA SORGU)	26
1.	İşlem referansı	26
2.	Üye kodu	26
P.	FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA RESPONSE)	26
1.	Kredi Alım Yoğunlaşma Verileri	26
(a)	Borsa Kodu	26
(b)	Nominal değer (Rehin/Teminat Miktarı)	27
(c)	Oran	27

A. RAPORLAMA YÜKÜMLÜLÜĞÜ

Yatırımcı Risk Takip Sistemi (YRTS) sermaye piyasalarında, kredili alım işlemi açığa satış, ödünç menkul kıymet ve/veya yerine getirilmemiş takas yükümlülükleri kaynaklı riskleri, sermaye piyasaları, aracı kurum, menkul kıymet, yatırımcı bazında ölçümleyen risk takip sistemi kurulmasını ve yatırımcıların risk ve teminat bilgilerini tek bir sistem üzerinden takip edilmesini sağlayan bir uygulamadır.

- YRTS'ye veri sağlayacak kurumlar: Yatırım kuruluşları, Sermaye Piyasası Kurulu (SPK), Borsa İstanbul, Takasbank, Merkezi Kayıt Kuruluşu (MKK) ve mevzuatla belirlenmiş diğer kurum ve kuruluşlardır.
- YRTS'den veri alabilecek Kurumlar: Yatırım Kuruluşları, SPK ve mevzuat tarafından yetkilendirilen diğer kurum ve kuruluşlardır.

B. RAPORLAMA KAPSAMI

Aracı Kurum müşterilerinin kredili alım işlemi, açığa satış ve ödünç menkul kıymet kaynaklı risklere ilişkin işlemleri raporlama kapsamında yer almaktadır. Aracı kurumun raporlama kapsamına giren herhangi bir işlem bulunmadığı takdirde bildirim yapılmasına gerek bulunmamaktadır.

Aracı Kurumlar tarafından YRTS'ye aktarılabilecek veri listesi aşağıdaki alt detaylardan oluşacaktır:

- Yatırımcıya tahsis edilen toplam kredi limiti¹
- Yatırımcının toplam kullandırılabilir kredi limiti
- Yatırımcının kullanılan toplam kredi tutarı
- Değerlenmiş teminat tutarı
- Yatırımcı temerrüt durumu (Kredili işlemler ve ödünç menkul kıymet işlemleri)
- Yatırımcı temerrüt durumu (Yerine getirilmemiş takas yükümlülükleri)
- Öz kaynak tamamlama bildirimleri
- Yatırımcının hisse senedi bazında net açığa satış pozisyonu (net kısa pozisyon)
- Yatırımcının tezgah üstü piyasalarda gerçekleştirdiği Ödünç Menkul Kıymet Verileri

YRTS tarafından aracı kurumlara iletilecek veri listesi aşağıdaki alt detaylardan oluşacaktır. 2

- Yatırımcılara tahsis edilen kredi limiti
- Kurumlardaki toplam kullandırılabilir kredi limiti
- Kurumlardaki toplam kullanılan kredili alım tutarı
- Değerlenmiş teminat tutarı
- Kredi limiti veren toplam kurum sayısı

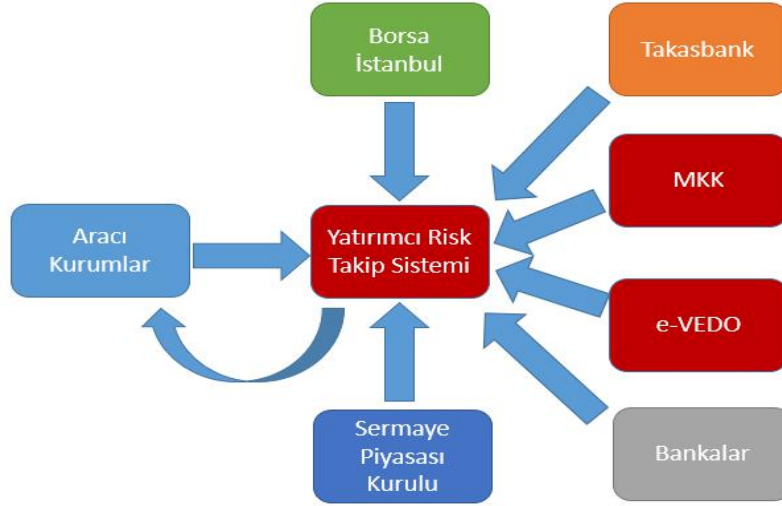
¹ Tüm limit ve tutarlar "Toplam", "Kredili Alım", "Ödünç Menkul Kıymet" ve "Açığa Satış" için ayrı bir şekilde iletilecektir.

² Sermaye Piyasası Kurulu tarafından alınacak karar çerçevesinde ilgili uygulama başlatılacaktır. Konuya ilişkin detaylar ayrıca duyurulacaktır.



- Pay senedi/endeks bazında yoğunlaşma
- Yatırımcı temerrüt durumu
- 6 ay nakde zorlanma cezası
- SPK işlem yasağı ve tedbir uygulanan yatırımcı listesi
- Borsa İstanbul tedbir uygulanan yatırımcı listesi
- Haciz bilgileri
- Öz kaynak tamamlama bildirimleri
- İflas bilgileri
- Türev verileri (VIOP)
- Kaldıraçlı Alım Satım Verileri
- Bakiyeli Hesap Sayısı
- Toplam Hesap Sayısı
- Takasbank Ödünç Pay Senedi Piyasası Verileri
- Borsa İstanbul Pay Piyasası'nda açığa satış olarak yapılan işlemlerin tutarı
- Kredili Alım Yoğunlaşma Verileri

Veri akış şeması aşağıda yer almaktadır:



Veri Akış Şeması

C. KAPSAM TARİHİ

Araç kurumlar, 30.09.2020 tarihinden itibaren YRTS'ye veri aktarımına başlamıştır.

D. SİSTEM ÖZELLİKLERİ

Uygulamanın teknik özellikleri aşağıda yer almaktadır;



• YRTS, Yatırım Kuruluşları ile web servisler üzerinden iletişim kuran mesaj tabanlı bir uygulamadır. Bu iletişimde REST servisler ve JSON formatı kullanılır.

• Sistemde;

- AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK AKTARIM SERVİSİ
- AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK SORGU SERVİSİ
- AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK RESPONSE SERVİSİ
- ÖDÜNÇ & AÇIĞA SATIŞ RESPONSE
- KREDİ ALIM YOĞUNLAŞMA SERVİSİ

olmak üzere toplamda 5 adet servis bulunmaktadır. Mevcut süreçte üyeler tarafından yalnızca AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK AKTARIM SERVİSİ kullanıldığı için sadece bu servis özelinde yetki verilmektedir.

• Yatırım Kuruluşlarının sistem saatleri içerisinde veri aktarımı yapabilmeleri, YRTS tarafından yatırım kuruluşlarının iletmış olduğu yatırımcılara ilişkin konsolide veri geri dönüşleri, yatırım kuruluşunun yatırımcı bazında sorgu yapabilmeleri uygulamanın temel özelliklerindendir.

• YRTS, mesaj akışının SSL olarak gerçekleştiği bir uygulamadır.

• YRTS, IP kısıtlaması olan kapalı bir uygulamadır, servise yalnızca izni tanımlanan IP adresleri erişim sağlayabilir.

E. FORM ADI

YATIRIMCI RİSK TAKİP SİSTEMİ – YRTS

F. PARA BİRİMİ

TL, ORJİNAL PARA

G. FORMUN AMACI

YRTS, Aracı Kurum müşterilerinin (yatırımcıların) kredili alım işlemi, açığa satış ve ödünç menkul kıymet kaynaklı risklere ilişkin işlemlerinin takibini kapsamaktadır. Bu form, YRTS kapsamında yapılacak aktarım ve sorguların sorunsuz bir şekilde iletebilmesi amacıyla oluşturulmuştur.

H. FORMUN DOLDURULMA ZAMANLARI

YRTS kapsamında belirtilen işlemlerin, işlem günü içinde MKK'ya aktarılması gerekmektedir. Aktarım ve/veya sorgu işlemleri yalnızca iş günlerinde yapılabilecektir. Hafta sonları ve tatil günlerinde aktarım gerçekleştirilemeyecektir. Üyeler Cuma gününe ait risk aktarımını Pazartesi sabah 06:00'ya kadar yapabilecektir.

Aktarımların, işlemin gerçekleştirildiği gün (T+0 günü) veya T+1 günü yapılması gerekmektedir. Aracı kurumların T+0 günü gerçekleştirdikleri işlemler en geç T+1 günü saat 06:00'ya kadar MKK'ya aktarılmalıdır. T+0 gününe ilişkin sorguların T+1 günü 09:00'dan sonra yapılması gerekmektedir.

Aktarım sürecinde dikkat edilmesi gereken kontroller aşağıda belirtilmiştir:

- T+1 günü 09:00'dan sonra yapılan aktarımların Raporlama tarihi T+1 günü olmalıdır.
- T+1 günü 06:00'dan önce yapılan aktarımların Raporlama tarihi T+0 gününe ait olmalıdır.
- Hafta sonuna ilişkin olarak sistem Cuma gecesi 00:00 ile Pazar gecesi 00:00 saatleri arasında kapalıdır. Bu nedenle, Cuma gününe ait veriler en geç Cuma 00:00'a kadar aktarılmalı, aktarım gerçekleşmezse Pazartesi 06:00'ya kadar tamamlanmalıdır.

T+2 gününde müşterinin borcunu ödememesi durumunda ortaya çıkacak temerrüt veya kredi tutarı henüz uygulama kapsamında yer almamaktadır. Aracı Kurumların kurulacak sisteme "kullanılan kredi" olarak iletecekleri bilgilerin içerisinde valörlü işlemlere ilişkin veriler olmamalıdır. T günü verilen ve T+2 gününe kadar riskin aracı kurum üzerinde kaldığı işlemlere ilişkin kredi verileri, T+2 günü aktarılmalıdır.

Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değerleri ilgili alana girilmelidir. Ayrıca, gün sonu itibarıyla, menkul kıymet ve müşteri bazında, uzun pozisyonları aşan kısa pozisyonlar "net kısa pozisyon" olarak raporlanmalıdır. Sistemin sorunsuz çalışması için, açığa satışı yapılan işlemler T ve T+1 günleri için "Açığa Satış Yapılan Menkul Kıymetlerin Piyasa Değeri" alanında bildirilmelidir. T+2 gününde ise bu işlemler "Ödünç Alınan Menkul Kıymetler" alanında raporlanmalıdır. Net kısa pozisyon alanında, açığa satışı yapılan kıymetler T ve T+1 günleri için detaylı bir şekilde raporlanmalıdır. Ancak, işlemin açığa satış olup olmadığı T+2 gününe kadar belirlenemiyorsa ya da mevcut muhasebe sistemleri T günü açığa satışın raporlanmasına izin vermiyorsa, gün sonundaki kısa pozisyonlar doğrudan "Net Kısa Pozisyon" alanında belirtilebilir.

I. FORMA İLİŞKİN GENEL AÇIKLAMALAR

Yatırım Kuruluşları tarafından YRTS'ye ilişkin aşağıdaki hususlara dikkat edilmesi gerekmektedir:

- Her bir kurumdan tek bir sabit IP adresi bilgisi iletilmelidir.
- Yazılım şirketlerinden destek alan kurumların ilgili yazılım şirketlerinin IP bilgisini iletmeleri gerekmektedir. (Sistem testleri için)
- YRTS, IP kısıtlaması olan kapalı bir uygulamadır, servise yalnızca izni tanımlanan IP adresleri erişim sağlayabilecektir.
- Üyelere iletilecek olan token içerisinde bu IP bilgisi yer alacaktır.
- Aktarım yapan Aracı Kurumun IP bilgisi, üye tarafından iletilen ve YRTS üye tablosuna da yer alan IP bilgisi ile aynı olmalıdır.
- Aktarım yapan Aracı Kurumun üye kodu bilgisi, token/lisans içerisindeki üye kodu bilgisi ile aynı olmalıdır.
- Token/Lisans içerisindeki üye kodu ile yapılan istek içerisindeki üye kodu aynı olmalıdır.
- Tokenlarda servis bazlı yetki bulunmaktadır. Erişilmek istenen servise yetki olmadığında hata mesajı ile karşılaşılar.



- Sorğu yapan Aracı Kurum durumunun aktif olmaması durumunda hata mesajı ile karşılaşılabacaktır.
- Aktarımlar arasında tekillik; işlem referansı ile sağlanmaktadır.
- Yatırımcı bazında aktarımlar MKK Sicil No ile yapılmaktadır.
- Başarılı şekilde sisteme yüklenen (şema validasyonuna takılmayan) dosyalar için yatırımcı bazında Success/Error mesajı dönülecektir.
- Aracı kurum aynı yatırımcı için birden fazla risk aktarımında bulunamayacaktır.
- Gün içinde gönderilen son bildirimler sistemde geçerli olacaktır. Dolayısıyla, raporlama gününe ait düzeltme bildirimi yapılırken tüm bildirimler dikkate alınarak nihai tüm bildirimlerin aktarılması gerekmektedir.

J. FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI RİSK AKTARIM SERVİSİ)

Aktarım esnasında aracı kurumlardan alınacak bilgilere ilişkin açıklamalar aşağıda yer almaktadır:

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.

2. Üye kodu

Bu alana raporlama işlemini gerçekleştiren üyenin (aracı kurum) 3 haneli Merkezi Kaydi Sistem (MKS) üye kodu bilgisi girilmelidir.

3. Raporlama Tarihi

Raporlamanın gerçekleştirildiği tarih bilgisidir.

4. Yatırımcı Bilgisi

Yatırımcının MKK Sicil Numarası raporlanacaktır.

- Veli, vekil ya da vasi ye sahip olan yatırımcılar için portföy sahibinin MKK Sicil Numarası kullanılacaktır.

- Kredili işlem, açığa satış, ödünç işlemi olan ve bildirim kapsamına giren ortak portföylerde her ortak için ayrı bir bildirim yapılacaktır. Bildirimlere konu olan verilerin dağılımında kurumlardaki ortaklık oranı dikkate alınacaktır.

5. Toplam tahsis edilen kredi limiti

Kredili alım, açığa satış ve ödünç işlemler için ayrı ya da ayrıştırılan bir limitin olmaması ve tahsis edilen toplam limit (çatı limit) bulunması durumunda; tahsis edilen limitin diğer alanlara da yazılması gerekmektedir. Raporlama alanları boş ya da "sıfır" olarak (ilgili kontrol, takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt ile net açığa satış pozisyonu (net kısa pozisyon) bildirimlerinde uygulanmayacaktır.) raporlanmamalıdır. Tüm limitler ayrı değerlendirilmektedir. Çatı limitin bulunmaması durumunda ise, Tebliğ kapsamında bir limit tanımlanması gerektiğinden, risklerin tahsis edilen limite yazılması gerekmektedir.



(a) Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti

Kredili alım işlemi için üye tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir. Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit

Ödünç alınan menkul kıymetler için üye tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir. Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(c) Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit

Açığa satış işlemi için üye tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir. Açığa satış işlemi için üye tarafından tahsis edilen toplam limit, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır. Açığa satış limitinin günlük değişen parametrelere bağlı olması durumunda, günlük olarak değişen limit bildirilmelidir.

(d) Toplam tahsis edilen limit

Üye tarafından tahsis edilen toplam çatı limitini ifade etmektedir. Tahsis edilen toplam limit TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti

Banka aracılığıyla sermaye piyasası için kredili alım kapsamında, toplam tahsis edilen limiti ifade etmektedir. Bu alan üye tarafından bilinmiyor ise, banka aracılığıyla kullanılan sermaye piyasası kredisi işlemleri için toplam kullanılan kredi yazılmalıdır.

6. Toplam kullanılabilir kredi limiti

Kullanılabilir limitler, her bir işlem türü için ayrı ayrı ve toplam tahsis edilen kredi limitlerinden, kullanılan kredi miktarlarının çıkarılması ile bulunur. Her bir işlem türü kendi içinde hesaplama dahil edilmekte olup, ilgili detaylar mevcut dokümanda sayfa 13'te belirtilmiştir.

(a) Kredili alım işlemi için kullanılabilir kredi limiti

Kredili alım işlemi için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir. Kredili alım işlemi için kullanılabilir kredi limiti, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit

Ödünç alınan menkul kıymetler için TL cinsinden tanımlanmış toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir. Bu değer 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(c) Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit

Açığa satış işlemleri için TL cinsinden tanımlanmış toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir. Bu değer 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(d) Toplam kullanılabilir limit

Üye tarafından toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.



(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam kullandırılabilir kredi limiti

Banka aracılığıyla kullandırılan sermaye piyasası kredi işlemleri kapsamında, kredili alım için toplam kullandırılabilir kredi limitini ifade etmektedir. Bu alan üye tarafından bilinmiyor ise, bu alana 0 yazılmalıdır.

7. Toplam kullanılan kredi

(a) Kredili Alım İşlemi için kullanılan kredi

Kredili alım işlemleri kapsamında kullanılan toplam kredi tutarını ifade etmektedir. Değer, TL cinsinden 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Ödünç alınan menkul kıymetlerin TL cinsinden cari piyasa değerini ifade etmektedir. Değer 0 veya 0'dan büyük olmalıdır. Eğer bu değer 0'dan farklıysa, "Ödünç Menkul Kıymet Verileri" alanlarının doldurulması zorunludur.

Piyasa değeri hesaplamasında, raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

(c) Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin TL cinsinden cari piyasa değerini ifade etmektedir. Değer 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

(d) Toplam risk tutarı

Kullanılan toplam kredi tutarını ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı

Banka aracılığıyla kullandırılan sermaye piyasası kredi işlemleri kapsamında, toplam kullanılan krediyi ifade etmektedir.

Aracı kurumlar tarafından yatırımcı limit ve kredi bilgilerine ilişkin aktarım yapılırken aşağıdaki kurallar dikkate alınmalıdır:

- Toplam tahsis edilen limit, kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam tahsis edilen limit, ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam tahsis edilen limit, açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Kredili alım için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Ödünç için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Açığa satış için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Toplam tahsis edilen limit, toplam kullanılan krediden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti, kredili alım için toplam kullanılan krediden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit, Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değerinden büyük ya da eşit olmalıdır.



- Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit, Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değerinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam kullanılan kredi; Kredili alım için toplam kullanılan kredi tutarı, ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri ve açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri toplamına eşit olmalıdır.

Üyelerimizden gelen geri bildirimler çerçevesinde, "Kullanılabilir Alan" bölümündeki kontroller kaldırılmış olup, aracı kurumlara ilgili alana negatif değer bildirim yapma imkanı getirilmiştir. Ancak üyelerimizin bu alanlara ilişkin bildirim yaparken limit aşımı hususlarında hassasiyet göstermeleri beklenmektedir.

Banka aracılığıyla kullanılan ve aracı kurumlar tarafından bildirilen sermaye piyasası kredilerine ilişkin olarak, aşağıdaki kurallar dikkate alınmalıdır:

- Bilindiği takdirde, Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam kullandırılabilir kredi limiti (TL), Banka aracılığıyla sermaye piyasası için kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti (TL) ve Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı (TL) bilgileri yazılmalıdır.
- Eğer Banka aracılığıyla kullanılan kredili alım için toplam kullandırılabilir kredi limiti ve tahsis edilen kredi limiti bilinmiyorsa, tahsis edilen kredi limiti bilgisine, Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı yazılmalıdır.
- Tüm limit alanlarına ilişkin olarak; (Toplam tahsis edilen kredi limiti, Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti, Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit, Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit, Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti) kullanılan kredi/risk olmasa dahi limitlere ilişkin bildirim yapılması gerekmektedir.
- Sözleşme ile belirlenmiş olan genel çatı limiti bildirim kapsamına olup, kullanılan kredi/risk olmasa dahi bu bilgi toplam tahsis edilen kredi limiti alanında belirtilmelidir.
- Kredili alım, açığa satış ve ödünç işlemler için ayrı ya da ayrıştırılan bir limitin olmaması ve tahsis edilen toplam limit (çatı limit) bulunması durumunda; tahsis edilen limitin diğer alanlara da yazılması gerekmektedir.

8. Değerlenmiş Teminat Tutarı

(a) Değerlenmiş Teminat Tutarı

Aracı Kurumlar tarafından gerçekleştirilen tüm işlemler (kredili alım, açığa satış ve ödünç menkul kıymet) karşılığında teminat olarak verilen tüm sermaye piyasası araçlarının piyasa değerini (nominal adet* fiyat) ifade etmektedir. Kurul yada aracı kurum tarafından belirtilen değerlendirme katsayıları kullanılmayacak olup, teminatta bulunan varlıkların piyasa değeri yazılacaktır.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.



(b) Banka aracılığıyla kullanılan kredi karşılığında teminat olarak verilen menkul kıymetlerin piyasa değeri

Banka aracılığıyla kullanılan kredi karşılığında teminat olarak verilen tüm ürünlerin piyasa değerini (nominal adet* fiyat) ifade etmektedir. Hesaplama için cari piyasa değeri olarak bildirilecektir. Banka tarafından ya da Kurul tarafından belirtilen değerleme katsayıları kullanılmayacak olup, teminatta bulunan varlıkların piyasa değeri yazılacaktır.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

9. Temerrüt Durumu

(a) Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı

Aracı kurumlar tarafından, kredili alım işlemine ilişkin oluşan güncel nakit temerrüt tutarını ifade etmektedir. Temerrüt faizi ayrıca yazılmayacak olup, toplam tutarın içine dahil edilecektir.

Bu dokümanın 10 (a) bölümünde belirtilen, özkaynak tamamlama bildirimlerine ilişkin üç (3) iş günü içerisinde aksiyon alınmaması durumunda temerrüde konu olan tutarı ifade etmektedir

Kredili alımın temerrüdü durumunda bu alanına temerrüde konu olan fark tutarı değil temerrüde konu tüm tutarın yazılması gerekmektedir, başka bir deyişle ilgili kredinin tamamına ait risk, faizi ile beraber temerrüt alanına yazılacaktır. Bu durumda ilgili risk, kullanılan kredi/risk/kullanılanKrediKA alanından temerrüt alanına transfer edilecektir.

(b) Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)

Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı değerini ifade etmektedir. Temerrüt faizi ayrıca yazılmayacak olup, toplam tutarın içine dahil edilecektir. Bu alan sadece kredili alım müşterileri değil, organize piyasalara ilişkin olarak temerrüdü bulunan tüm yatırımcılar için geçerlidir.

Nakit yükümlülüklerin yerine getirilmemesi durumunda oluşan temerrütlerin bu alanda bildirilmesi gerekmektedir. Kredili alıma ilişkin temerrütlerin, “Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı - temerrutTutariKA” bölümünde bildirimi yapılacağından bu alanda yer almamalıdır. Kredili alım limiti olan yatırımcının, bu işlem dışında oluşan nakit yükümlülüğü nedeniyle temerrüde düşmesi durumunda, bu bilgi ilgili alanda bildirilmelidir. Karşılığında limit bulunmayan ve cari hesapta oluşan eksi bakiye, temerrüt olarak raporlanacaktır.

Krediye dönüşen temerrüt durumu söz konusu ise, ilgili tutarın krediye dönüştüğü gün itibari ile temerrüt alanından çıkarılarak, ilgili kredili alım alanına yazılması beklenmektedir. Mevzuatta yer alan üçüncü iş günü hükmüne istinaden, ilgili tutar takas tarihinden itibaren önce temerrüt olarak, sonrasında kredili alım işlemine dönüşmesi durumunda ise kredi olarak raporlama yapılması gerekmektedir. Aşağıda bu konuya ilişkin bir örnek yer almaktadır:



Müşteri 100.000 TL'lik bir takas yükümlülüğünü yerine getiremezse ve 3. iş gününde krediye dönüştürülmesi isteniyorsa;

Takas günü: “temerrutTutariTakas:” alanına 100.000 TL +faiz

Takas günü+1: “temerrutTutariTakas:” alanına 100.000 TL +faiz

Takas günü+2: “temerrutTutariTakas:” alanına 100.000 TL +faiz

Takas günü+3: “kullanilanKrediKA ise Kredili alım için toplam kullanılan kredi (TL)” alanına 100.000+faiz yazılmalıdır.

(c) Ödünç alınan menkul kıymetlerden temerrütte bulunanların cari piyasa değeri

Ödünç alınan menkul kıymetlerin iadesinin gerçekleşmemesi nedeniyle oluşan temerrüdün takip edilmesi için bu alan kullanılacaktır. Temerrütte bulunan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir. Temerrüt faizi ayrıca yazılmayacak olup, toplam tutarın içine dahil edilecektir.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

Ödünç alınan menkul kıymetlere ilişkin bir temerrüt durumu olduğunda, ilgili risk “Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri - kullanilanKrediOD” alanından bu alana transfer edilecektir.

(d) Banka aracılığıyla kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı

Banka aracılığıyla kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarını ifade etmektedir. Temerrüt faizi ayrıca yazılmayacak olup, toplam tutarın içine dahil edilecektir.

10. Özkaynak tamamlama bildirimleri

(a) Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı

Aracı Kurumlar tarafından, kredili alım işlemine ilişkin ilgili müşteriye gönderilen özkaynak tamamlama bildirimleri tutarını ifade etmektedir. Bir yatırımcı için, ilgili kurumdaki hesaplardaki özkaynak durumu hesap bazında yerine, konsolide olarak dikkate alınmalıdır.

(b) Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı

Aracı Kurumlar tarafından ödünç işlemlerine ilişkin ilgili müşteriye gönderilen özkaynak tamamlama bildirimleri tutarını ifade etmektedir.

Özkaynak tamamlama bildirimleri için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir:

- Aracı kurumlardan raporlama tarihi itibari ile MKK sicil no bazında açık olan toplam özkaynak tamamlama bildirimleri tutarı alınacaktır.
- İlgili bildirimler sadece kredili alım ve ödünç işlemlerine ilişkindir, nakit yükümlülüğünün yerine getirilmemesine ilişkin bildirimler kapsam dahilinde değildir.
- Tutar bildirilirken özkaynak tamamlama çağrısının yapıldığı fark tutarı belirtilmelidir. Örneğin, %35 olması gereken özkaynak değerlendirme oranı, ilgili oranın altına düştüğü takdirde, tamamlanması gereken oransal değişim için hesaplanan fark tutarı bildirilecektir. Özkaynak tamamlama bildirimleri, aracı kurumların kendi değerlendirme katsayılarına göre hesaplanarak yapılmalıdır.
- Özkaynak tamamlama bildirimlerine ilişkin aktarım yapılırken kurul oranları baz alınacaksa güncel mevzuatta yer alan özkaynak değerlendirme oranı dikkate alınmalıdır.



Mevzuatta bir değişiklik olması durumunda revize değerlendirme oranları dikkate alınmalıdır. Bu çerçevede, mevcut durumda özkaynak tamamlama oranı %35 olarak uygulanmalıdır.

11. Net açığa satış pozisyonu- menkul kıymet

Bu alan ayrı bir blok olarak yer almaktadır, ilgili blok ya tamamen çıkarılarak aktarım yapılacaktır ya da ekleniyorsa bloğu oluşturan ilgili tüm alanlar doldurulacaktır.

Net açığa satış pozisyonu için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir:

- Net açığa satış pozisyonu ile kastedilen hisse senedi bazında net kısa pozisyonudur.
- Bu alana ilişkin olarak gün sonu itibarıyla menkul kıymet ve müşteri bazında ilgili menkul kıymette kısa pozisyonların uzun pozisyonları aşan kısmından oluşan “net kısa pozisyonların” nominal ve cari değerleri her gün itibarıyla bildirilecektir.
- Gün sonu net pozisyon “0” ise bildirim yapılmasına gerek yoktur.
- Bu alan açığa satış tuşundan bağımsız olarak doldurulmalıdır.
- Yatırımcının menkul kıymet bazında gün sonundaki net kısa pozisyonu ifade etmektedir ve aşağıdaki şekilde hesaplanabilir:

$T \text{ günü sonu net kısa pozisyon} = \text{mevcut stok} +/ - T-1 \text{ günü itibarıyla menkul kıymet pozisyonu} +/ - \text{gün içindeki değişimler}$

- OTC ve organize piyasa ayrımı olmaksızın tüm işlemlerin net açık pozisyonu raporlanmalıdır.

(a) Kıymete ait ISIN kodu

12 alfa numerik haneden oluşan bu alanda, işleme konu menkul kıymetin ISIN kodu- ISO 6166 (International Securities Identification Number) yazılacaktır.

ISIN geçerlilik kontrolü, sorgulama sırasında yapılmakta olup; ISIN aktif değilse hata mesajı verilecektir.

(b) Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon nominal değeri

Menkul kıymetlerin nominal değerleri nazım hesaplardan yararlanılmak suretiyle işlem miktarını ifade etmektedir.

(c) Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon cari değeri

Bu alan, her bir menkul kıymet için; raporlama tarihinde kapanış fiyatı üzerinden hesaplama yapılacaktır.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

12. Ödünç Menkul Kıymet Verileri

Ödünç Menkul Kıymet Verileri yatırımcı bazlıdır.

Bu alan, ayrı bir blok olarak yer almakta olup; ilgili blok ya tamamen çıkarılarak aktarım yapılmalı ya da eklenecekse bloğu oluşturan tüm alanlar eksiksiz doldurulmalıdır.

Tezgaüstü piyasalarda gerçekleştirilen ödünç işlemlerine ilişkin olarak menkul kıymet ve müşteri bazında sözleşme bilgileri işlemin gerçekleştirildiği gün itibarıyla bildirilecektir.

(a) Kıymete ait ISIN kodu

12 alfa numerik haneden oluşan bu alanda, işleme konu menkul kıymetin ISIN kodu- ISO 6166 (International Securities Identification Number) yazılacaktır.

ISIN geçerlilik kontrolü sorgulama sırasında yapılmaktadır ve ISIN aktif değilse hata mesajı ile karşılaşılabacaktır.

(b) Menkul kıymet miktarı

Menkul kıymetlerin nominal değerleri nazım hesaplardan yararlanılmak suretiyle işlem miktarını ifade etmektedir.

(c) Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri

Her bir menkul kıymet için, raporlama tarihinde kapanış fiyatı üzerinden hesaplama yapılacaktır.

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

(d) Ödünç işlem tarihi

İşlemin gerçekleştiği tarih yazılacaktır. Söz konusu tarihin raporlama tarihi ile aynı olması beklenmektedir. Ayrıca İşlem Tarihi, İşlemin Valör Tarihi'nden küçük ya da eşit olmalıdır.

(e) Ödünç valör tarihi

Valör tarihi, yükümlülüklerin başladığı tarihtir. Bu alana işlemin valör tarihi yazılacaktır. Valör tarihi, işlem tarihinden büyük ya da eşit olmalıdır.

(f) Ödünç vade tarihi

Vade tarihi yükümlülüklerin yerine getirildiği tarihtir. Vade Tarihi, İşlem Tarihi ve Valör Tarih'inden büyük ya da eşit olmalıdır.

Bu alan doldurulurken aşağıdaki kural dikkate alınmalıdır:

- Ödünç Menkul Kıymetler kullanılan kredi tutarı 0'dan farklı bir değer ise Ödünç Menkul Kıymet verilerinin bildirimi zorunludur.
- Vade tarihi farklı olan aynı menkul kıymete ait ödünç işlemleri ayrı olarak bildirilmelidir.

K. FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI GÜNCEL RİSK SORGU SERVİSİ)

Aracı kurumun bildirim yaptığı yatırımcılarına ilişkin YRTS'de yer alan bilgileri toplu ve/veya yatırımcı bazında sorguladığı servistir. Aracı kurumların, toplu sorgu ile yatırımcılarına ait konsolide verileri günlük olarak alma imkanı bulunmakta olup, toplu sorgu servisi çalıştırılmadan response servisi hizmet vermeyecektir.

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.



2. Üye kodu

Bu alana raporlama işlemini gerçekleştiren üyenin (Aracı Kurum) 3 haneli MKS üye kodu bilgisinin girilmesi beklenmektedir.

3. Sorgu Tipi (T/Y)

Bu alan aşağıdaki kodlar kullanılarak doldurulacaktır:

T=Toplu Sorgu
Y=Yatırımcı bazında sorgu

- Sorgu Tipi= T seçildiğinde aşağıdaki veriler doldurulmayacaktır.

4. Yatırımcı Bilgisi

Aşağıdaki Veriler; sadece Sorgu Tipi= Y olması durumunda doldurulacaktır.

(a) Yatırımcı MKK Sicil Numarası

Kimlik kodu türlerinden MKK Sicil Numarası ile sorgulama yapılacaktır. Yatırımcıya ait geçerli bir MKK Sicil Numarası olmalıdır.

(b) Yatırımcı TCKN

Kimlik kodu türlerinden T.C. Kimlik Numarası ile sorgulama yapılacaktır. Yatırımcıya ait geçerli bir TCKN olmalıdır.

(c) Yatırımcı VKN

Kimlik kodu türlerinden Vergi Kimlik Numarası ile sorgulama yapılacaktır. Yatırımcıya ait geçerli bir VKN olmalıdır.

Yatırımcı bilgisi doldurulurken aşağıdaki kurallar dikkate alınmalıdır:

- Sorgu Tipi "Y" ise Yatırımcı MKK sicil numarası, Yatırımcı TCKN ve Yatırımcı VKN alanlarından biri dolu olmalıdır.

L. FORM ALAN BAŞLIKLARI (AK YATIRIMCI RİSK RESPONSE SERVİSİ)

Yukarıdaki sorgu servisinin çalıştırılması sonucunda YRTS tarafından gönderilecek "Response Servisinde" kurum bazında bir veri paylaşılmayacak olup, konsolide veriler dönülecektir.

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.



2. Yatırımcı Bilgisi

Yatırımcı MKK Sicil Numarası

Sorgu servisinde sorgusu yapılan MKK Sicil Numarası bilgisidir.

3. Kurumlardaki toplam tahsis edilen kredi limiti

(a) Kredili alım işlemi için tahsis edilen toplam kredi limiti

Kredili alım işlemi için üyeler tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için tahsis edilen toplam limit

Ödünç alınan menkul kıymetler için üyeler tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir.

(c) Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit

Açığa satış işlemi için üyeler tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir.

(d) Toplam tahsis edilen limit

Üyeler tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti

Bankalar aracılığıyla sermaye piyasası için kredili alım kapsamında, toplam tahsis edilen limiti ifade etmektedir.

4. Toplam kullanılabilir kredi limiti

(a) Kredili Alım İşlemi için kullanılabilir kredi limiti

Kredili alım işlemi için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit

Ödünç alınan menkul kıymetler için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(c) Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit

Açığa satış işlemi için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(d) Toplam kullanılabilir limit

Kullanılabilir toplam kredi limitini ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için kullanılabilir kredi limiti

Banka aracılığıyla kullanılan sermaye piyasası kredi işlemleri kapsamında, kredili alım için toplam kullanılabilir kredi limitini ifade etmektedir.



5. Toplam kullanılan kredi

(a) Kredili alım işlemi için kullanılan kredi

Kredili alım işlemi için tüm üyelerde kullanılan toplam krediyi ifade etmektedir.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir.

(c) Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir.

(d) Toplam risk tutarı

Kullanılan toplam kredi tutarını ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı

Banka aracılığıyla kullandırılan sermaye piyasası kredisi işlemleri kapsamında, toplam kullanılan krediyi ifade etmektedir.

6. Kredi Limiti Veren Toplam Kurum Sayısı

Raporlama tarihi itibarıyla, ilgili yatırımcıya kredi limiti tahsis eden toplam aracı kurum sayısı raporlanacaktır.

7. Temerrüt Durumu

(a) Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)

Aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerden temerrütte bulunanların cari piyasa değeri (faiz dahil)

Aktarım servisinde, ödünç alınan menkul kıymetlere ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır.

(c) Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı (faiz dahil)

Aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir.

(d) Banka aracılığıyla Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı

Banka aracılığıyla Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarını ifade etmektedir.

Temerrüt durumu için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir:



Sorgu servisinde, bu alanlar için MKK Sicil No/TCKN/VKN bazında tüm üyelerden aktarılan temerrüt tutarı verisi toplanarak konsolide 4 alan dönülecektir. Üye sorgulama yapınca, raporlama tarihi itibarı ile açık olan toplam temerrüt tutarını tür bazında tek bir kalem olarak görecektir.

8. 6 ay nakde zorlanma cezası

(a) 6 ay nakde zorlanma cezası başlangıç tarihi

İlgili ceza durumunun başladığı tarih bilgisidir. Aktarım esnasında, Borsa İstanbul tarafından aktarımda 6 ay nakde zorlanma cezasının ilk “VAR” olarak raporlandığı tarih cezanın başlangıç tarihi olarak alınacaktır.

(b) 6 ay nakde zorlanma cezası bitiş tarihi

İlgili ceza durumunun bittiği tarih bilgisidir. Aktarım esnasında, Borsa İstanbul tarafından aktarımda 6 ay nakde zorlanma cezasının “YOK” olarak raporlandığı tarih cezanın bitiş tarihi olarak alınacaktır.

9. İşlem Yasağı Listesi

Aşağıda linki bulunan SPK Kurumsal Web Sayfasında yer alan İşlem Yasakları listesi kullanılacaktır.

<https://idariyaptirimlar.spk.gov.tr/IslemYasaklari>

(a) İşlem yasağı Kurul karar tarihi

Yasağın alındığı Kurul Karar Tarihi bilgisidir.

(b) Pay senedi bilgisi

Yasağın uygulandığı Pay Senedi bilgisidir.

10. Borsa Tedbir Listesi

Aşağıda linki bulunan Borsa İstanbul Kurumsal Web Sayfasında yer alan Borsa Tedbir Listesi kullanılacaktır.

https://www.borsaistanbul.com/erd/menkul_tedbir_listesi.csv

(a) Uygulanan tedbir kodu

İlgili tedbire ait tedbir kodu bilgisidir. Tedbir kodlarına ilişkin ilgili linkteki veriler kullanılacaktır.

(b) Uygulanan tedbir adı

İlgili tedbire ait tedbir adı bilgisidir. Uygulanan tedbir adlarına ilişkin ilgili linkteki veriler kullanılacaktır.

(c) Tedbir başlangıç tarihi

İlgili tedbirin başlangıç tarihi bilgisidir.



(d) Tedbir bitiş tarihi

İlgili tedbirin bitiş tarihi bilgisidir.

11. Diğer Tedbirler ve İşlem Yasakları Listesi

Aşağıda linki bulunan SPK Kurumsal Web Sayfasında yer alan İşlem Yasakları listesi kullanılacaktır.

<https://idariyaptirimlar.spk.gov.tr/IslemYasaklari>

(a) Tedbir başlangıç tarihi

İlgili tedbirin başlangıç tarihi bilgisidir.

(b) Tedbir bitiş tarihi

İlgili tedbirin bitiş tarihi bilgisidir.

(c) Pay senedi bilgisi

İlgili tedbirin uygulandığı Pay Senedi bilgisidir.

(a) Tedbir nedeni

İlgili tedbirin neden açıklamasıdır.

12. Türev Verileri (VIOP)

(a) Sözleşme Türü

Türev sözleşmesinin türünü ifade etmektedir.

Aşağıdaki alan kodları kullanılarak iletilecektir;

FU = Future
OP= Opsiyon

(b) Varlık Sınıfı

Türev sözleşmelerinin varlık sınıfını (dayanak varlığını) ifade etmektedir. Aşağıdaki alan kodları kullanılarak iletilecektir;

CO = Emtia
CR = Kredi
CU = Para birimi
EQ = Pay senedi
IR = Faiz oranı
OT = Diğer
SC = Diğer Menkul Kıymetler

(c) Sözleşmelerin toplam piyasa değeri

Sözleşmelerin toplam piyasa değerini ifade etmektedir.



(d) Sözleşmelerin toplam teminat değeri

Sözleşmelerin toplam piyasa değeri karşılığında alınan toplam teminat değerini göstermektedir.

(e) VIOP raporlama tarihi

VIOP işlemlerinin raporlamasının gerçekleştirildiği tarih bilgisidir. VIOP verileri T-2 gününde gerçekleşen işlemleri içermektedir.

13. Kaldıraçlı Alım Satım Bilgileri (KASİ)

Takasbank'ta yer alan Kaldıraçlı Alım Satım işlemlerine ilişkin veriler raporlanacaktır. Veriler, raporlama tarihinden bir iş günü öncesinin verisini içermektedir. (Resmi tatiller ve tatil günlerinden sonra ilk iş günü verisinde tatil günlerinde gerçekleşen işlemlerin de verisi yer alacaktır.)

(a) Net kar-zarar

Kaldıraçlı alım satım işlemleri için, yatırımcıya ait TL cinsinden kar/zarar değerini ifade etmektedir.

(b) Kaldıraçlı alım satım teminat tutarı

Yatırımcıya ait TL cinsinden teminat değerini ifade etmektedir.

Bir yatırımcının 'Net kar-zarar' bilgisi mevcut değilse KASİ alanları (netKarZarar, teminatTutari, islemTarihi) Response datasında yer almayacaktır.

(c) İşlem tarihi

YRTS sistemine bildirilen işlemlere ilişkin işlem tarihini ifade etmektedir.

14. Yatırımcının hacizde kıymeti olup olmadığı bilgisi

Yatırımcının sahip olduğu menkul kıymetlerde herhangi bir haciz olup olmadığı bilgisinin yer aldığı alandır. Aşağıdaki alan kodları kullanılarak iletilecektir:

VAR= Haciz var
YOK= Haciz yok

15. Tüm kurumlardaki bakiyeli hesap sayısı

Yatırımcının tüm kurumlardaki toplam bakiyeli hesap sayısı raporlanacaktır.

16. Tüm kurumlardaki toplam hesap sayısı

Yatırımcının tüm kurumlardaki toplam hesap sayısı raporlanacaktır.

17. İflas

Yatırımcının iflas bilgisinin verildiği alandır. Aşağıdaki alan kodları kullanılarak iletilecektir:



VAR= İflas var

YOK= İflas yok

18. Özkaynak tamamlama bildirimleri

(a) Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı

Bu alan aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen özkaynak tamamlama tutarının yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır.

(b) Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı

Bu alan aktarım servisinde, ödünç işlemlerine ilişkin bildirilen özkaynak tamamlama tutarının yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır.

M. FORM ALAN BAŞLIKLARI (ÖDÜNÇ & AÇIĞA SATIŞ SORGU)

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.

2. Üye kodu

Bu alana raporlama işlemini gerçekleştiren üyenin (Aracı Kurum) 3 haneli MKS üye kodu bilgisinin girilmesi beklenmektedir.

N. FORM ALAN BAŞLIKLARI (ÖDÜNÇ & AÇIĞA SATIŞ RESPONSE)

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.

2. Ödünç Menkul Kıymet Verileri

Ödünç Verileri Servisi borsa kodları bazında Takasbank Ödünç Pay Senedi Piyasasında gerçekleştirilen işlemlerin toplam menkul kıymet miktarını gösteren servistir ve yatırımcı bazlı değildir.

Her gün itibarıyla, o gün için açık olan tüm işlemler bildirilecektir.

(a) Kıymete ait borsa kodu

Borsada işlem gören menkul kıymetler için 4 veya 5 haneli menkul kıymet kodudur.

(b) Menkul kıymet miktarı

Menkul kıymetlerin nominal değerleri ilgili alanda raporlanacaktır.



(c) Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri

Menkul kıymetin raporlama günündeki ağırlıklı ortalama fiyatı kullanılarak hesaplanacaktır.

(d) Ödünç işlem tarihi

İşlemin gerçekleştiği tarih yer alacaktır.

(e) Ödünç valör tarihi

Valör tarihi yükümlülüklerin başladığı tarih yer alacaktır.

(f) Ödünç vade tarihi

Vade tarihi yükümlülüklerin yerine getirildiği tarihtir.

3. Açığa Satış Verileri

Açığa Satış Verileri Servisi, Borsa İstanbul Pay Senedi Piyasasında gerçekleşen açığa satış işlemlerinin borsa kodları bazında toplam menkul kıymet miktarını gösteren servistir. Açığa Satış Verileri isteği gönderen aracı kurumlara aşağıdaki veri setini içeren cevap mesajı dönecektir. Aşağıdaki blok borsa kodu bazında çoklanacaktır.

(a) Menkul kıymet borsa kodu

Borsada işlem gören menkul kıymetler için 4 veya 5 haneli menkul kıymet kodudur.

(b) Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı

Açığa satış işlemlerinin toplam işlem miktarı iletilecektir.

(c) Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı

Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem değeri iletilecektir.

O. FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA SORGU)

1. İşlem referansı

Bu referans her bir mesaj için özel olarak üretilir ve bir daha kullanılamaz.

2. Üye kodu

Bu alana raporlama işlemini gerçekleştiren üyenin (Aracı Kurum) 3 haneli MKS üye kodu bilgisinin girilmesi beklenmektedir.

P. FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA RESPONSE)

1. Kredi Alım Yoğunlaşma Verileri

BIST30 endeksinde yer alan pay senetlerinin kredili alım işlemlerindeki yoğunlaşmasını raporlayan servistir.

(a) Borsa Kodu

Borsada işlem gören menkul kıymetler için 4 veya 5 haneli menkul kıymet kodudur.



(b) Nominal değer (Rehin/Teminat Miktarı)

MKS'deki rehin teminat modülü üzerinden sermaye piyasası işlemleri nedeniyle verilen rehin/teminatların nominal değeridir.

(c) Oran

Hisse senedindeki Rehin/Teminat Miktarının, hisse senedinin borsa işlem görebilir payların toplam miktarına bölünmesi sonucunda hesaplanan değerdir. Raporlama tarihi itibarıyla BİST30'da yer alan hisse senetleri için verilecektir.

Nominal oran hesaplanırken aşağıdaki formül dikkate alınmıştır:

$REHIN_NOMINAL^* / TOPLAM\ NOMİNAL\ DEĞER^{**}$

*REHIN_NOMINAL = Sermaye piyasası işlemleri nedeniyle verilen rehin/teminatların nominal değeri

**TOPLAM NOMİNAL DEĞER = Hisse Senedi'nin Borsada İşlem Görebilir Paylarının Toplam Nominal Değeri

Veriler, % olarak ve virgülden sonra 2 basamak şeklinde gösterilecektir.

