

MERKEZİ KAYIT İSTANBUL

TÜRKİYE SERMAYE PİYASALARI - MERKEZİ
SAKLAMA VE VERİ DEPOLAMA KURULUŞU



e-VEDO Platformu T+1 Raporlaması Bilgilendirme Kılavuzu



**MERKEZİ KAYIT
İSTANBUL**

Türkiye Sermaye Piyasaları - Merkezi
Saklama ve Veri Depolama Kuruluşu

e-VEDO Platformu T+1 Raporlaması Bilgilendirme Kılavuzu

İçindekiler

İçindekiler	i
e-VEDO Platformu Bilgilendirme Kılavuzu	1
1. Tanımlar	1
e-VEDO Platformu	3
1. Raporlamaya İlişkin Genel Bilgiler	3
1.1. Raporlama Kapsamı	3
1.2. Üyelik İşlemleri	7
1.3. Raporlama Yöntemleri	11
1.4. Raporlama Yükümlülükleri	23
1.5. Tüzel Kişi Kimlik Kodu-Legal Entity Identifier (LEI)	25
2. Raporlama Alanlarına İlişkin Bilgiler	29
3. Raporlama Alanlarına İlişkin Teknik Bilgiler	31
4. Eşleşme Sürecine İlişkin Bilgiler	40
4.1. Eşleşme kapsamı	40
4.2. Eşleşme Statüleri ve Eşleşme Alanlarının Tolerans Alanları ve Silme Bildirimine İlişkin Kurallar	42
5. e-VEDO Platformu Ekranları	44
5.1. Sözleşme Bildirim Ekranları	44
5.1.1. T+1 Sözleşme Bildirim Ekranı	44
5.1.2. T+0 Sözleşme Bildirim Ekranı	45
5.2. T+1 ve T+0 Bildirim İzleme Ekranları	48
5.2.1. T+1 Bildirim İzleme Ekranı	49
5.2.2. T+0 Bildirim İzleme Ekranı	49
5.2.3. Sözleşme İzleme Ekranı (T+1 Bildirimleri)	50
5.3. Açık Sözleşme Ekranları	50
5.4. Borçlanma Araçları Ekranları	52
5.4.1. Borçlanma Araçları Dosya Yükleme Ekranı	52
5.4.2. Borçlanma Araçları Bildirim İzleme Ekranı	53

5.5.	Tarih Kilit Kontrolleri Ekranı	54
5.5.1.	T+1 Tarih Kilit Kontrolleri	54
5.5.2.	T+0 Tarih Kilit Kontrolleri	55
5.5.3.	Geçmiş Bildirim Tarih Kilit Kontrolleri	55
5.6.	Yönetim Ekranı Menüleri:	56
5.6.1.	Kullanıcı Tanımlama:	56
5.6.2.	Kullanıcı Yetkilendirme:	57
5.6.3.	Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme:	58
5.6.4.	İletişim Adresi Tanımlama:	60
5.6.5.	Ücretlendirme Kontrol Ekranı	61
6.	Otomatik Giden Mailler ve Açıklamaları	61
6.1.	Kontrat Tipi Bazında Son 7 Günlük İşlem Sayıları Raporu	61
6.2.	Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu	61
6.3.	Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu	62
6.4.	Tüm İşlemleri İçeren Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu	62
6.5.	Karşı Taraf Kimlik Kodu LEI Dışında Bildirilen Sözleşmeler Raporu	63
6.6.	T+0 Raporlamayan Üyeler Otomatik Mail Raporu	64
6.7.	T+0 Raporlaması Bir Önceki Güne Ait Hatalı Bildirim Sayıları Raporu	64
6.8.	Taraf - Karşı Taraf Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu	65
6.9.	“Maximum Fatura Tutarına Ulaşıldı” Bildirimi	66
6.10.	“e-VEDO Platformu T+1 Raporlaması Bir Önceki Güne Ait Hatalı Bildirimler Hk.” Raporu	66
6.11.	Açık Sözleşmeler Hata İzleme Raporu	66
7.	TÜREV SÖZLEŞME RAPORLAMARINA İLİŞKİN ÖRNEK SORULAR VE CEVAPLAR	67

e-VEDO Platformu Bilgilendirme Kılavuzu

1. Tanımlar

Elektronik İmza: Elektronik imza, başka bir elektronik veriye eklenen veya elektronik veriyle mantıksal bağlantısı bulunan ve kimlik doğrulama amacıyla kullanılan elektronik veridir. E-imza olarak da bilinir. Elektronik ortamlarda imza yerine kullanılabilen yasal kimlik doğrulama sistemidir.

e-VEDO: Elektronik Veri Depolama Platformu (Platform)

e-VEDO Raporlaması: Kanunun 87’nci maddesi uyarınca Kurulca yetkilendirilen veri depolama kuruluşuna yapılacak bildirim

Kanun: 6362 Sayılı Sermaye Piyasası Kanunu

Kurul: Sermaye Piyasası Kurulu

LEI (Legal Entity Identifier): Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI), global finansal piyasalara katılan şirketlerin açık ve tek tanımlamasına izin veren temel referans bilgisine bağlayan 20 basamaklı, alfa nümerik bir koddur. LEI, Uluslararası Standartlar Örgütü tarafından geliştirilen ISO 17442 standardına dayanır.

MİM: MKK İletişim Merkezi

MKK: Merkezi Kayıt Kuruluşu A.Ş.

MKT: Merkezi karşı taraf

MKT Hizmeti: İstanbul Takas ve Saklama Bankası Anonim Şirketinin, Kurul tarafından uygun görülen piyasa veya sermaye piyasası araçları bazında açık teklif, sözleşme yenileme veya hukuken bağlayıcılığı olan başka bir yöntemle alıcıya karşı satıcı, satıcıya karşı da alıcı rolünü üstlenerek takasın tamamlanmasını taahhüt ettiği faaliyet

SPK: Sermaye Piyasası Kurulu

Takasbank: Takasbank-İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

TCMB: Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası

Tezgahestü Piyasa: Borsa ve Teşkilatlanmış diğer piyasalar haricinde kalan tüm işlem platformları “Tezgahestü Piyasa” olarak adlandırılmaktadır.

Türev Araç: Sermaye Piyasası Kanunu’nun 3’üncü maddesinde tanımlanan türev araçları

T+1 Raporlaması: Elektronik Veri Deposu Sistemi” yurt içi ve yurt dışı organize ve tezgahüstü piyasalarda gerçekleşen türev işlemlerinin ilgili sözleşme taraflarınca uluslararası standartlarda raporlandığı bir bildirim sistemidir.

T+0 Raporlaması: Yatırım kuruluşları ve tüzel kişilerin, yurtdışında yerleşik yabancı kurum/kişilerle gerçekleştirdikleri ve para birimlerinden bir tanesinin Türk Lirası olduğu Para Birimine Dayalı "Swap", "Forward" ve "Çapraz Para Swap" (Cross Currency Swaps) türev araç sözleşmeleri Günlük İşlem Raporu kapsamında e-VEDO Platformu’na raporlanmaktadır. Söz konusu raporlama yükümlülüğü 02.03.2020 tarihi itibarıyla açık olan tüm sözleşmeler ile bu tarihten sonra akdedilecek tüm sözleşmeleri kapsamaktadır.

VDK: Veri Depolama Kuruluşu (Kanunun 87’nci maddesi uyarınca Kurulca yetkilendirilen ve Kurulca belirlenen sermaye piyasası işlemlerine ilişkin verileri toplayan ve merkezi olarak tutan veri depolama kuruluşu)

VDK Raporlama (Raporlama): Kanunun 87’nci maddesi uyarınca Kurulca yetkilendirilen veri depolama kuruluşuna yapılacak bildirimi tanımlamaktadır.

ViOP: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası, Borsa İstanbul bünyesinde hizmet veren, sermaye piyasası araçları üzerine düzenlenmiş vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri ile diğer türev araçlarının elektronik ortamda alınıp satılabildiği, kaldıraçlı bir piyasadır. Vadeli İşlem Sözleşmeleri, sözleşmenin taraflarına, standartlaştırılmış miktar ve kalitedeki bir malı, kıymeti veya finansal göstergeyi, belirlenen ileri bir tarihte, bugünden üzerinde anlaşılan fiyattan alma veya satma yükümlülüğü veren sözleşmelerdir.

XML: World Wide Web Consortium (W3C) tarafından geliştirilmiş bir standarttır.

Yatırım Kuruluşu: Aracı kurumlar ile yatırım hizmeti ve faaliyetinde bulunmak üzere kuruluş ve faaliyet esasları Sermaye Piyasası Kurulu’nca belirlenen diğer sermaye piyasası kurumları ve bankaları ifade etmektedir.

e-VEDO Platformu

1. Raporlamaya İlişkin Genel Bilgiler

1.1. Raporlama Kapsamı

Soru: Raporlama neden MKK'ya Yapılmalıdır?

Yanıt: 6362 Sayılı Sermaye Piyasası Kanunu'nun 87'nci maddesinde yer alan

- 1) *“Sistemik riskin gözetimi ve finansal istikrarın korunması amacıyla, Kurul, sermaye piyasasında gerçekleştirilen işlemlere ilişkin olarak, bu işlemleri gerçekleştirenlerden, bu işlemlere ilişkin bilgilerin, belirleyeceği şekil ve içerikte, doğrudan kendisine veya yetkilendireceği bir veri depolama kuruluşuna bildirilmesini isteyebilir. Bu madde kapsamında, bildirim yapmakla yükümlü olanlar, özel mevzuatındaki gizlilik ve sır saklama yükümlülüklerini ileri sürerek talep edilen bilgileri vermekten imtina edemez.*
- 2) *Bildirimin Kurul tarafından yetkilendirilen bir veri depolama kuruluşuna yapılması durumunda, ilgili veri depolama kuruluşunun yükümlülüğü, bilgilerin hangi şekil ve ortamda tutulacağı ile bu madde kapsamındaki görevlerine yönelik faaliyet usul ve esasları Kurulca yapılacak düzenleme ile belirlenir.”*

hükümleri çerçevesinde sermaye piyasası işlemlerinin Kurul'a veya Kurul tarafından belirlenecek veri depolama kuruluşuna yapılması gerekmektedir. Kurul karar organının 03.04.2015 tarih ve 2015/427 sayılı toplantısında, Merkezi Kayıt Kuruluşu'nun (MKK) bu madde çerçevesinde veri depolama kuruluşu olarak yetkilendirilmesine karar verilmiştir.

Soru: Hangi işlemlerin e-VEDO Platformu'na raporlanması gerekmektedir?

Yanıt: İlgili mevzuat gereği yurtiçi yerleşiklerin, yurtiçi ve yurtdışı organize ve tezgahüstü piyasalarda gerçekleştirmiş oldukları türev işlemlerin e-VEDO Platformu'na raporlanması gerekmektedir. Raporlama yükümlülüklerinin kapsamı aşağıda belirtilmiştir:

- 1- Yurtiçi yatırım kuruluşlarının; yurtiçi kurumlar ile akdetmiş olduğu türev sözleşmeler,
- 2- Yurtiçi yatırım kuruluşlarının yurtdışı kurumlar ile akdetmiş olduğu türev sözleşmeler,
- 3- Merkezi Türkiye'de yerleşik olan yatırım kuruluşlarının, yurtdışında yerleşik olan şubelerinin (bilançoları Türkiye'de konsolide olan) akdettiği türev sözleşmeler,
- 4- Tüzel şirketlerin yurtiçi tezgahüstü piyasalarda akdetmiş olduğu türev sözleşmeler,
- 5- Tüzel şirketlerin yurtdışı organize piyasalar ve tezgahüstü piyasalarda akdetmiş olduğu türev sözleşmeler.

Raporlama Yükümlülük Tablosu aşağıda yer almaktadır;

Taraf	Karşı Taraf	Piyasa Yeri	Piyasa Türü	Sözleşmenin Yapılış Türü (Taraf)	Sözleşmenin Yapılış Türü (Karşı Taraf)	Raporlama Yükümlülüğü
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Yatırım Kuruluşu1, Yatırım Kuruluşu 2
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Müşteri	Yatırım Kuruluşu1, Yatırım Kuruluşu 2
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Portföy	Yatırım Kuruluşu1, Yatırım Kuruluşu 2
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Müşteri (Aracılık)	Yatırım Kuruluşu1, Yatırım Kuruluşu 2
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Organize	Portföy	Portföy	Takasbank
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Organize	Portföy	Müşteri	Takasbank
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Organize	Müşteri (Aracılık)	Portföy	Takasbank
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Organize	Müşteri (Aracılık)	Müşteri (Aracılık)	Takasbank
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Takasbank (MKT hizmeti alınıyorsa)
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Müşteri	Takasbank (MKT hizmeti alınıyorsa)
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Portföy	Takasbank (MKT hizmeti alınıyorsa)
Yatırım Kuruluşu 1	Yatırım Kuruluşu 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Müşteri (Aracılık)	Takasbank (MKT hizmeti alınıyorsa)
Yatırım Kuruluşu 1	Müşteri	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Müşteri	Yatırım Kuruluşu1
Yatırım Kuruluşu 1	Müşteri	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Müşteri	Yatırım Kuruluşu1
Yurtiçi Yerleşik Tüzel	Yatırım Kuruluşu 1	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Yatırım Kuruluşu1
Yurtiçi Yerleşik Tüzel1	Yurtiçi Yerleşik Tüzel2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Yurtiçi Yerleşik Tüzel1, Yurtiçi Yerleşik Tüzel 2
Yatırım Kuruluşu 1	Merkezi Karşı Taraf (Yurtiçi)	Yurtdışı	Organize	Portföy	MKT (Yurtdışı)	Yatırım Kuruluşu1
Yatırım Kuruluşu 1	Merkezi Karşı Taraf (Yurtdışı)	Yurtdışı	Organize	Müşteri (Aracılık)	MKT (Yurtdışı)	Yatırım Kuruluşu1
Yatırım Kuruluşu 1	Yurtdışı Yerleşik Tüzel	Yurtdışı	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Yatırım Kuruluşu1
Yatırım Kuruluşu 1	Yurtdışı Yerleşik Tüzel	Yurtdışı	Tezgaahüstü	Müşteri (Aracılık)	Portföy	Yatırım Kuruluşu1
Yurtiçi Yerleşik Tüzel1	Merkezi Karşı Taraf (Yurtdışı)	Yurtdışı	Organize	Portföy	MKT (Yurtdışı)	Yurtiçi Yerleşik Tüzel1
Yurtiçi Yerleşik Tüzel1	Yurtdışı Yerleşik Tüzel	Yurtdışı	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Yurtiçi Yerleşik Tüzel1
Gerçek Kişi 1	Gerçek Kişi 2	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Bildirim yükümlülüğü bulunmamaktadır.
Yurtiçi Yerleşik Tüzel1	Gerçek Kişi 1	Yurtiçi	Tezgaahüstü	Portföy	Portföy	Bildirim yükümlülüğü bulunmamaktadır.

<https://www.mkk.com.tr/veri-depolama-hizmetleri/e-vedo/turev-t1-raporlamasi>

Soru: Türev Araçlarını tanımlayabilir misiniz?

Yanıt: Sermaye Piyasası Kanunu'nda göre türev araçlar şu şekilde tanımlanmıştır:

- 1) Menkul kıymetleri satın alma veya satma veya birbirleri ile değiştirme hakkı veren türev araçlar,
- 2) Değeri, bir menkul kıymet fiyatına veya getirisine; bir döviz fiyatına veya fiyat değişikliğine; faiz oranına veya orandaki değişikliğe; bir kıymetli maden veya kıymetli taş fiyatına veya fiyat değişikliğine; bir mal fiyatına veya fiyat değişikliğine; Kurulca uygun görülen kurumlarca yayınlanan istatistiklere veya bunlardaki değişikliğe; kredi riski transferi sağlayan, enerji fiyatları ve iklim değişkenleri gibi ölçüm değerleri olan ve bu sayılanlardan oluşturulan bir endeks seviyesine veya seviyedeki değişikliğe bağlı olan türev araçları, bu araçların türevlerini ve sayılan dayanak varlıkları birbirleri ile değiştirme hakkı veren türevler,

3) Döviz ve kıymetli madenler ile Kurulca belirlenecek diğer varlıklar üzerine yapılacak kaldıraçlı işlemler.

Soru: Kaldıraçlı İşlemler e-VEDO Platformu'na raporlanacak mıdır?

Yanıt: Kaldıraçlı İşlemler gerçekleştirilirken türev sözleşmeler alınıyor veya satılıyor ise bu sözleşmeler Platform'a raporlanmalıdır. Sermaye piyasası düzenlemelerine göre kaldıraçlı işlem olarak Takasbank'a bildirilen fark sözleşmeleri Platform'a da bildirilecektir.

Soru: İleri Vadeli Taahhütler Platform'a raporlanacak mıdır?

Yanıt: İleri vadeli taahhütler türev işlemi kapsamında yer almadığı için Platform'a raporlanmayacaktır.

Soru: e-VEDO Platformu'na yapılacak raporlamanın içeriği müşteri ve banka işlemlerine ait tüm hazine işlemleri kapsamakta mıdır? (Spot, forward, swap, depo, bankalar arası kredi, IRS/XCS, opsiyon)

Yanıt: Raporlama, bankalar arası ve müşteriler ile yapılmış ve/veya yatırım kuruluşlarınca aracılık edilmiş yurtiçi tezgahüstü ve yurtdışı tezgahüstü ve organize piyasalarda gerçekleştirilen tüm türev işlemlerini kapsamaktadır. Spot, depo, bankalar arası kredi işlemleri mevcut durumda kapsam dışındadır.

Soru: Raporlama başlangıç tarihi nedir?

Yanıt: Raporlama yükümlülüğüne tabi taraflarca 5'inci madde kapsamındaki türev araç sözleşmelerinden, 30.11.2018 tarihinden itibaren akdedilenler VDK'ya raporlanır.

Akdedilme tarihlerine bakılmaksızın 30.11.2018 tarihi itibarıyla hala sonuçlandırılmamış olan sözleşmeler ile 01.01.2018 tarihinden sonra akdedilmiş ve 30.11.2018 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmeler VDK'ya raporlanır.

Soru: İşlemin gerçekleştirilme tarihinden sonra kaç gün içerisinde raporlama yapılması gerekmektedir?

Yanıt: İşlem tarihinden (T günü) itibaren en geç 1 iş günü (T+1) sonuna kadar raporlama yapılması gerekmektedir.

1.2. Üyelik İşlemleri

Soru: Sadece ViOP'ta işlem yapan yatırım kuruluşlarının e-VEDO Platform'una üye olması gerekli midir?

Yanıt: İlgili işlemler Merkezi Karşı Taraf (MKT) olan Takasbank tarafından raporlanacağından, sadece ViOP'ta işlem yapan yatırım kuruluşlarının Platform'a üye olmasına gerek bulunmamaktadır. Ancak bu kurumların tezgahüstü ve yurtdışı piyasalarda işlem yapmaları durumunda Platform'a üye olmaları zorunludur.

Soru: Yatırım Kuruluşları dışında hangi tüzel kişiler e-VEDO Platformu'na üye olmalıdır?

Yanıt: Yatırım Kuruluşları dışında aşağıdaki tüzel kişiler herhangi bir yatırım kuruluşu tarafından aracılıkta bulunulmaksızın türev işlemi yapmaları durumunda raporlama yapmak üzere Platforma üye olmak zorundadır.

- a. Sermaye Piyasası Kanunu kapsamındaki halka açık anonim ortaklıklar,
- b. Kolektif yatırım kuruluşları
- c. Portföy yönetim şirketleri,
- d. İpotek finansmanı kuruluşları
- e. Konut finansmanı ve varlık finansmanı fonları,
- f. Varlık kiralama şirketleri,
- g. 19.10.2005 tarihli ve 5411 sayılı Bankacılık Kanunu uyarınca yetkilendirilen finansal kuruluşlar,
- h. 03.06.2007 tarihli ve 5684 sayılı Sigortacılık Kanunu uyarınca ruhsat verilen sigorta ve reasürans şirketleri,
- i. 28.03.2001 tarihli ve 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu uyarınca ruhsat verilen emeklilik şirketleri,

- j. 21.11.2012 tarihli ve 6361 sayılı Finansal Kiralama, Faktoring ve Finansman Şirketleri Kanunu uyarınca yetkilendirilen finansal kiralama şirketleri, faktoring şirketleri ve finansman şirketleri,
- k. 17.02.2018 tarihli ve 30335 sayılı Resmî Gazete’de yayımlanan Döviz Pozisyonunu Etkileyen İşlemlerin Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası Tarafından İzlenmesine İlişkin Usul ve Esaslar Hakkında Yönetmelik uyarınca Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası’nca belirlenen firmalar.

Soru: e-VEDO Platformu üyelik türleri nelerdir?

Yanıt: e-VEDO Platformu’nda iki farklı üyelik tipi bulunmaktadır.

- a. **Genel Üyeler;** kendilerinin taraf oldukları veya aracılık ettikleri işlemlerin yanı sıra bu işlemlerden bağımsız olarak üçüncü taraflar adına da raporlama hizmeti sağlamaya yetkili kuruluşlardır.
- b. **Doğrudan Üyeler;** taraf oldukları işlemlere veya aracılık ettikleri işlemlere ilişkin raporlama yükümlülüklerini kendileri adına ve/veya aracılık edilen işlemin tarafı müşterileri adına yerine getiren kuruluşlardır.

Üyelikle ve üyelik evraklarıyla ilgili her türlü konu hakkında uyelik@mkk.com.tr adresinden e-posta aracılığıyla bilgi alabilirsiniz.

Soru: Raporlama yükümlüsü kurumların e-VEDO Platformu'na üyelik başvurusunda yerine getirmesi gereken şartlar nelerdir?

Yanıt: Üyelik başvurusunda Kuruluşumuz tarafından istenen belgeler aşağıda yer almaktadır.

İLETİLMESİ GEREKEN EVRAK / BİLGİ	DOĞRUDAN VDK ÜYE	GENEL VDK ÜYE*
MKK Üyelik Başvuru Formu	✓	✓
MKK Temsilci Bilgi Formu	✓	✓
e-VEDO Üyelik Sözleşmesi	✓	✓
LEI Kodu	✓	✓
İmza Sirküleri	✓	✓
Üyelik Giriş Ücreti Dekontu**	✓	✓

**Yatırım Kuruluşları dışında tüzel kişilerin genel üye statüsü için başvurması halinde aşağıdaki şartları tevsik edecek belgeleri de ayrıca üyelik başvuru evrakı ile iletmelidir.*

a) Tüzel kişinin Türkiye'de yerleşik olması (Noter tasdikli Ticaret Sicil Belgesi)

b) Raporlama işlemlerinin yapılmasını ve izlenmesini yürütecek personelden en az bir tanesinin

Türev Araçları Lisansına sahip olması (Noter tasdikli olmalıdır.)

c) Sermaye Piyasası Kurulu'nun Bilgi Sistemleri Bağımsız Denetim Tebliği (III-62.2) ile Bilgi Sistemleri Yönetimi Tebliği'ne (VII-128.9) tabi tüzel kişiler hariç olmak üzere ISO 27001 Bilgi Güvenliği Sertifikasına sahip olması

***Yönetim Kurulumuzun 24.05.2019 tarihli toplantısında alınan karar çerçevesinde, Piyasanın gelişimine katkıda bulunulması ve işlem taraflarının maliyetlerinin artırılmaması amacıyla*

Üyelikle ve üyelik evraklarıyla ilgili her türlü konu hakkında uyelik@mkk.com.tr adresine mail atarak bilgi alabilirsiniz.

Soru: e-VEDO Platformu’nda işlem yapacak temsilci türleri nelerdir?

Yanıt: Platform’da işlem yapacak 2 tip temsilci bulunmaktadır:

1) Şirket Ana Temsilcisi (Admin): Üyenin e-VEDO uygulamasında yetkilendirme onay yetkisine sahip temsilcisidir. En az bir kişi atanmalıdır. İlk Şirket Ana Temsilcisi Kuruluşumuz tarafından üyelik işlemleri altında yer alan ana temsilci formunun (MKK Temsilci Bilgi Formu) doldurulması ve ıslak imzalı olarak tarafımıza iletilmesi ile tanımlanacaktır. Diğer şirket yetkilileri ise, Kuruluşumuz tarafından yetkilendirilen “Şirket Ana Temsilcisi” tarafından tanımlanacaktır.

Şirket Ana Temsilcisi şirketten ayrılması durumunda; ayrılmadan önce tüm yetkilerini başka birine devretmelidir (Platform'da, “Yönetim” sekmesinin altında yer alan “Kullanıcı Yetkilendirme” ekranından yapılacaktır). Aksi takdirde, yeni ana temsilcisi için yukarıda belirtilen ıslak imzalı süreç yeniden işletilecektir.

2) Raporlama Yetkilisi: Üyenin e-VEDO’da operasyonel işlemlerini yerine getirecek temsilcilerdir. Genel üye türünde en az iki kişi, doğrudan üye türü için ise en az bir kişi atanmalıdır. Üyenin “Şirket Ana Temsilcisi” raporlama yetkililerini tanımlayacaktır (Kuruluşumuz tarafından raporlama yetkililerine ilişkin herhangi bir tanımlama yapılmayacaktır).

Şirketten ayrılan kişinin, Şirket Admini tarafından; “Kullanıcı Durumu”nun “İptal”e çekilmesi gerekmektedir (Platform’da, “Yönetim” sekmesinin altında yer alan “Kullanıcı Tanımlama” ekranından yapılacaktır).

Soru: e-VEDO Platform’una elektronik imza olmadan erişim sağlanabilir mi?

Yanıt: Hayır. Platform’a; ilgili şirket için tanımlamaları gerçekleşmiş olan ve e-imzası bulunan kullanıcılar erişebilmektedir.

Soru: e-VEDO Platformu’na işlemler elektronik imza kullanılarak mı yapılacaktır?

Yanıt: Evet. Platform’da işlemler yalnızca elektronik imzalı olarak yapılabilir.

Soru: Üyelik Sözleşmesini imzalayacak yetkililer kimler olmalıdır?

Yanıt: Platform'a yapılacak raporlamalar üyelerin sorumluluğunda, imza sirkülerinde sermaye piyasası işlemlerine ilişkin belgelerin, en üst düzey yetkililer tarafından imzalanması gerekmektedir. Ayrıca imza sirkülerinin de üyelik birimimize iletilmesi gerekmektedir.

Üyelikle ve üyelik evraklarıyla ilgili her türlü konu hakkında uyelik@mkk.com.tr adresine e-posta göndererek bilgi alabilirsiniz.

Soru: Yatırım Fonları ve Emeklilik Yatırım Fonları Platform Üyesi olmalı mıdır? Bu kurumlar raporlama yükümlülüklerini devredebilirler mi?

Yanıt: Yatırım Fonları ve Emeklilik Yatırım Fonları, Türkiye'de yerleşik herhangi bir yatırım kuruluşunun aracılığını kullanmadan yurtiçi tezgahüstü, yurtdışı organize veya tezgahüstü piyasalarda türev işlemi yapıyorlarsa Platform'a üye olmak zorundadırlar. Fonlar bu yükümlülüklerini, Portföy Yönetim Şirketlerine devredebilirler. Bu durumda, Portföy Yönetim Şirketinin Platform'a genel üye olarak başvurması gerekmektedir.

Üyelikle ve üyelik evraklarıyla ilgili her türlü konu hakkında uyelik@mkk.com.tr adresine, sisteme girişte hata yaşamanız durumunda mim@mkk.com.tr adresine e-posta göndererek bilgi alabilirsiniz.

1.3. Raporlama Yöntemleri

Soru: İşlemler hangi Platform üzerinden MKK'ya raporlanacaktır?

Yanıt: Raporlama yükümlüsü kurumlar; üyelik işlemlerinin tamamlanmasının akabinde <https://evedo.mkk.com.tr/> adresi üzerinden raporlamalarını yapabilecektir.

Soru: Raporlama yöntemleri nelerdir?

Yanıt: Raporlama yükümlüleri iki farklı şekilde raporlamalarını gerçekleştirebilecektir.

- a. Ekran üzerinden (Manual)
- b. XML dosyası yükleme (File upload)

Soru: Raporlamalar e-VEDO Platform'una ekran üzerinden mi aktarılacaktır?

Yanıt: Evet. Platform’da üyelerin raporlamalarını gerçekleştirebilmeleri adına “Sözleşme Bildirimi” isimli ekran yer almaktadır. Platform’a ilgili kurumlar için tanımlanmış olan Şirket Ana Temsilcisi (Admin) ve Raporlama Yetkilileri, elektronik imzaları ile Platform’a giriş yaptıktan sonra hazırladıkları ZIP formatındaki dosyayı ilgili ekranlar aracılığı ile aktarabileceklerdir. Sistem hafta sonları ve resmi tatil günlerinde kapalıdır. Dosya yükleme testlerinizi e-VEDO beta ortamından (<https://evedobeta.mkk.com.tr>) adresi üzerinden testlerinizi gerçekleştirebilirsiniz.

Soru: e-VEDO Platformu’na yüklenecek dosyaların formatı “.csv” mi olacaktır?

Yanıt: Hayır. XML formatında hazırlanmış olan dosya ZIP dosyası formatında yüklenecektir. Her bir eylem tipi için XML dönüştürücü web sitemizde Teknik Dokümanlar kısmında yer almaktadır. (<https://www.mkk.com.tr/veri-hizmetleri/e-vedo/turev-t1-raporlamasi>)

Her bildirimde dosya formatları kurallarına uygun farklı senderReference ile bildirim yapılmalıdır. Bir dosyada farklı bildirim tipleri olmayacaktır. Her bildirim tipi için ayrı sıkıştırılmış dosya üretilenektir.

Soru: Ekran yoluyla yapılan veri girişlerinde time out süresi kaç dakikadır?

Yanıt: Ekran yoluyla yapılan veri girişlerinde time out süresi 60 dakikadır.

Soru e-VEDO Platformu’na raporlama yapılırken kullanılacak Eylem Tipleri nelerdir?

Yanıt: T+1 raporlaması yapılırken kullanılacak Eylem Tipleri aşağıda yer almaktadır:

- 1) **N (Yeni Bildirim):** Platform’a yeni bir işlem veya pozisyonun raporlanmasında kullanılacak eylem tipidir (e-VEDO Platformu’nda yalnızca işlem bildirimleri raporlanmaktadır.)
- 2) **M (Güncelleme Bildirimi):** Platforma raporlanan bir işlem veya pozisyonun herhangi bir alanında değişiklik yapılmak istenmesi durumunda kullanılacaktır. Örneğin; sözleşmenin/pozisyonun vade tarihi bilgisi hatalı girilmiş ise veya vade tarihi bilgisi değişmiş ise Güncelleme Bildirimi (M) ile ilgili işleme ait bildirim uygulama üzerinden manual yöntemle veya dosya yükleme yöntemi ile güncellenebilir. Aşağıda M (Güncelleme Bildirimi) ile güncellenemeyen alanlar listelenmiştir. Bu alanlar ile ilgili

bilgiler yanlış girilmiş ise, sözleşme için E (Silme Bildirimi) yapılması ve ardından doğru bilgilerle tekrar N (Yeni Bildirim) yapılması gerekmektedir.

- Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu Türü (**counterpartyIdType**)
- Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu (**counterpartyId**)
- Sözleşmenin Karşı Tarafının Kimlik Kodu Türü (**otherCounterpartyIdType**)
- Sözleşmenin Karşı Tarafının Kimlik Kodu (**otherCounterpartyId**)
- Sözleşme Tarafının Yerleşik Bulunduğu Ülke (**countryTheCounterparty**)
- İşlem Kodu (**TradeID**)
- Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih (**executionDate**)
- Raporlamanın Gerçekleştirildiği Tarih (**eligibilityDate**)

3) **E (Silme Bildirimi)**: Hatalı bildirilen işlemler veya hatalı olarak raporlanan ve Güncelleme Bildirimi (M) ile güncellenemeyen (silinmesi ve yeniden bildirim yoluyla güncellenmesi gereken işlemler için) sözleşmelerin veya pozisyonların silinmesi için E (Silme Bildirimi) kullanılmalıdır.

Silme Bildirimine ilişkin Kurallar;

- “Eşleşti” statüsü (Ön Eşleşme Sağlanması + 25 adet Eşleşme alanının Eşleştirilmesi) sağlanan sözleşmeler silinemez.
- Sözleşmeniz ön eşleşmeden geçmiş ise; karşı tarafınız tarafından sonlandırılmış durumda olan sözleşmeler için silme bildirimi gerçekleştiremezsiniz.
- Sözleşmeniz ön eşleşmeden geçmiş ise ve her iki tarafın da sözleşmeleri açık statüde (henüz sonlandırma bildirimi yapılmamış) ise; bir tarafın işlem için silme bildirimi yapılması durumunda, işlem karşı tarafına bilgilendirme yapılacak ve işlem karşı tarafının bildiriminin eşleşme statüsü “Eşi Girilmedi (NF)” olarak güncellenecektir.

4) **C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)**: Sözleşme veya pozisyonun vade tarihinde veya vade tarihinden önce sonlandırılması (erken sonlandırma) durumunda bu eylem tipi kullanılır. (Açma Kapama Yöntemini kullanan üyelerin her gün açık işlem veya pozisyonlarını raporlayan yükümlülerin bir gün önce raporladıkları işlem veya

pozisyonları bu eylem tipi ile kapatmaları gerekmektedir. Açma – Kapama Yöntemi 01.04.2024 tarihi itibarıyla uygulanamayacaktır.)

NOT: “Eşi Girilmedi” statüsündeki sözleşmelere C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma Bildirimi) yapılamaz.

- 5) **Z (Sıkıştırma):** Var olan işlemleri netleştirerek veya sonlandırarak yerlerine ilgili işlemlerin tamamını veya bir kısmını kapsayacak daha az sayıda sözleşme oluşturmada kullanılan eylem tipidir. Örneğin taraf/karşı taraf/taraf nihai yararlanıcı/karşı taraf yararlanıcısı aynı olan

31.03.2019 vadeli 3 adet forward dolar alım sözleşmesinin (1.000.000, 500.000, 250.000) 1.750.000 Dolarlık tek bir sözleşme olarak bildirilmesi durumunda “Z (Sıkıştırma)” eylem tipi kullanılır.

- 6) **V (Değerleme Bildirimi):** Platformda açık olan sözleşmelere veya pozisyonlara günlük olarak yapılacak değerlemeler sonucunda sözleşmenin piyasa değerindeki (mark to market / mark to model) değişimler her iş günü için bu eylem tipi ile yapılacaktır.

- 7) **CL (Teminat Değerleme):** Platformda açık olan sözleşmelere ve pozisyonlara teminat alınmışsa, bu teminatların günlük değerlemeleri bu eylem tipi ile yapılacaktır. Sözleşmeye ilişkin ilave teminat alınması ve teminat iadesi olması durumunda da bu eylem tipi kullanılmalıdır.

- 8) **NBACK: (Geçmişe Yönelik Raporlama):** Tebliğ hükümlerine göre 30.11.2018 tarihi itibarıyla açık olan işlem/pozisyonlar ile 01.01.2018 tarihinden sonra akdedilmiş ve 30.11.2018 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmeler/pozisyonların raporlanması için kullanılacaktır.

T+0 raporlamasında sadece N (Yeni Bildirim) Eylem Tipi ile XML dosya yükleyerek raporlama yapılmakta olup manuel bildirim yapılmamaktadır. Platform’da üyeler tarafından en son iletilen dosya sistemde raporlanmış olarak tutulacaktır. Dolayısıyla, düzeltme işlemi yapılmak istendiğinde yüklenecek dosyada sadece düzeltilecek sözleşmeler değil, ilgili gün itibarıyla açık olan tüm sözleşmeler, son hali ile yer almalıdır.

Soru: N (Yeni) ve NBACK (Geçmişe Yönelik Raporlama) sözleşmelerine ilişkin örnek verebilir misiniz?

Yanıt:

Örnek1:

Sözleşme tarihi: 04.07.2023

Vade tarihi: 14.07.2023

N (Yeni Bildirim) eylem tipi ile 05.07.2023 (T+1 günü) tarihinden itibaren 14.07.2023 tarihine dek raporlanması gerekmektedir.

Raporlamanın T+1 günü yapılması gerekmektedir dolayısıyla vade tarihi 14.07.2023 olarak 05.07.2023’de raporlanmalıdır. Aradaki tarihlerdeki iş günleri için işlemin değerlendirme bildirimi (V) ve varsa teminatlandırma bildirimi (CL) yapılmalıdır.

Örnek 2:

Sözleşme tarihi: 01.01.2018

Vade tarihi: 01.03.2018

NBACK eylem tipi ile 01.01.2019 tarihine kadar raporlanması gerekmektedir.

Soru: 30.11.2018 itibariyle açık olan işlem/pozisyonların 04.12.2018’de raporlanması durumunda yukarıdaki eylem tiplerinden hangisi kullanılacaktır?

Yanıt: N (Yeni) Eylem tipi kullanılacak olup, 04.12.2018’de tüm açık işlem/pozisyonlarını bildiren üyelerimizin “30.11.2018 tarihi itibariyle açık olan işlem/pozisyonlar” tekrar **NBACK (Geçmişe Yönelik Raporlama)** olarak bildirmelerine gerek bulunmamaktadır.

Soru: Raporlamalarda giriş ve onay aşamaları bulunmakta mıdır?

Yanıt:

- a. Manual olarak Platform üzerinde “Bildirim Giriş” ekranından yapılan sözleşme veya pozisyon raporlamaları, “Sözleşme Girişi” ve “Onay” olmak üzere 2 aşamadan oluşmaktadır. İlgili sözleşme girişinin yapılmasının akabinde ilgili sözleşmenin bilgilerinin

doğruluğu kontrol edilerek “Bildirim İzleme” ekranından Şirket Admini veya Yetkisi bulunan kişi tarafından onaylanmalıdır (Bildirim Giriş -Yeni Bildirim-, Sözleşme Güncelleme ve Sözleşme Silme ekranlarında). 24 saat içerisinde onaylanmadığı takdirde sözleşme “Otomatik İptal” statüsüne düşecek olup gerçekleşmemiş olacaktır.

- b. XML olarak yapılan sözleşme veya pozisyon raporlamaları tek aşamalıdır.
- c. Manual olarak yapılan Değerleme Bildirimi ve Teminat Değerleme Bildirimleri tek aşamalıdır, herhangi bir onaya gitmemektedir.
- d. XML olarak yapılan Değerleme Bildirimi ve Teminat Değerleme Bildirimleri tek aşamalıdır, herhangi bir onaya gitmemektedir.

Soru: İşlem bazında ve pozisyon bazında raporlamaları açıklayabilir misiniz?

Yanıt: İşlem bazında bildirim, her bir sözleşme için ayrı bir raporlama yapılmasını ifade eder.

Pozisyon bazında bildirim, taraf/karşı taraf/taraf nihai yararlanıcı/karşı taraf yararlanıcısı/ürün/vade tarihi aynı olan birden fazla olan sözleşmenin net değerinin raporlanmasını ifade eder. Pozisyon bazında izlenen tek hesaba ait, raporlama parametreleri aynı olan işlemlerin (işlem parametreleri ilgili şekilde hesaplanacak şekilde) raporlanmasıdır.

Örnek 1: Bir yatırım kuruluşu ile müşterisi arasında 30.06.2019 vadeli 1.000.000, 500.000 ve 250.000 Dolarlık alım forward sözleşmeleri, sözleşme bazında 3 kayıt (1.000.000,500.000 ve 250.000) veya pozisyon bazında tek kayıt (1.750.000) olarak raporlanabilir.

Örnek 2: Bir yatırım kuruluşu ile müşterisi arasında 31.12.2019 vadeli 1.000.000 ve 500.000 Dolarlık alım ve 250.000 Dolarlık satım forward sözleşmeleri sözleşme bazında 3 kayıt (1.000.000 ve 500.000 Dolar alım, 250.000 Dolar satım) veya pozisyon bazında tek kayıt (1.250.000 Dolar alım) olarak raporlanabilir.

(Not: taraf/karşı taraf/taraf nihai yararlanıcı/karşı taraf yararlanıcısı/ürün/vade tarihi aynı olan aynı ancak işlem tarihi farklı olan işlemler de pozisyon olarak raporlanabilir. Bu durumlarda işlem tarihi alanı “son yapılan işlem tarihi” olarak doldurulmalıdır.)

Soru: İşlem Bazında raporlamalarda işlemin günlük mark-to-market ve teminat değerlemeleri günlük olarak nasıl bildirilecektir?

Yanıt: Bu konuda iki alternatif bulunmaktadır;

- a. Değerleme Yöntemi; Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihinden sonra gelen iş günü (T+1 Günü); **N (Yeni Bildiriminin)** yapılması ve vade tarihine dek her iş günü için **V (Değerleme Bildirimi)** ve **CL (Teminat Değerleme Bildirimi)** Eylem Tipleri ile bildirimlerinin yapılması ve vade tarihinde (Sözleşme erken sonlanmaz ise) **C (Sonlandırma Bildirimi)** yapılarak sözleşmenin kapatılması şeklinde açıklanabilir.
- b. Açma – Kapama Yöntemi; Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihinden sonra gelen iş günü (T+1 Günü); ilk olarak **N (Yeni Bildirim)** aksiyon tipi ile bildiriminin yapılması ve daha sonrasında **C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)** eylem tipi ile açık olan işlemin kapatılması ve bu sıralamanın vade tarihine dek her iş günü için günlük olarak N ve C bildirimleri yapılarak devam ettirilmesi şeklinde açıklanabilir. **(Açma – Kapama Yöntemi 01.04.2024 itibarıyla kullanılamamaktadır.)**

Soru: Pozisyon bazında raporlamalarda işlemin günlük mark-to-market ve teminat değerlemeleri günlük olarak nasıl bildirilecektir?

Yanıt: Bu konuda iki alternatif bulunmaktadır;

- a. Değerleme Yöntemi; Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihinden sonra gelen iş günü (T+1 Günü); **N (Yeni Bildiriminin)** yapılması ve vade tarihine dek her iş günü için **V (Değerleme Bildirimi)** ve **CL (Teminat Değerleme Bildirimi)** Eylem Tipleri ile bildirimlerinin yapılması ve vade tarihinde (Sözleşme erken sonlanmaz ise) **C (Sonlandırma Bildirimi)** yapılarak sözleşmenin kapatılması şeklinde açıklanabilir.
- b. Açma – Kapama Yöntemi; Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihinden sonra gelen iş günü (T+1 Günü); ilk olarak **N (Yeni Bildirim)** aksiyon tipi ile bildiriminin yapılması ve daha sonrasında bir iş günü sonra **C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)** eylem tipi ile açık olan işlemin kapatılması ve bu sıralamanın vade tarihine dek her iş günü için günlük olarak N ve

C bildirimleri yapılarak devam ettirilmesi şeklinde açıklanabilir. **(Açma – Kapama Yöntemi 01.04.2024 itibarıyla kullanılamamaktadır.)**

Not: e-VEDO Platformu'na gerçekleştirilen raporlamalar işlem bazlıdır.

Soru: Değerleme Yöntemi ve Açma Kapama Yöntemini örnek ile açıklayabilir misiniz?

Yanıt:

1. Değerleme Yöntemi

Değerleme Yöntemi Raporlama Süreci											
8.05.2023'de açılmış 17.05.2023 vade tarihli bir sözleşmenin işlem sırası aşağıda belirtilen sırayla gerçekleştirilmektedir. Değerleme yönteminde ilk gün işlem Yeni Bildirim ile açıldıktan sonra vade tarihine dek her iş günü değerlendirme bildirimi yapılmalıdır.											
İşlem Sırası	SystemDate (Sistem Tarihi)	ExecutionDate	EligibilityDate	Action Type	TerminationDate	ValuationDate	MaturityDate	OtherCounterpartyId	NameOfTheOtherCounterparty	TradeId	Açıklama
1	9.05.2023	8.05.2023	9.05.2023	N: Yeni Bildirim	-	8.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	T+1 günü 09.05.2023 tarihinde; 09.05.2023 eligibilityDate ile yeni bildirim yapılır.
2	10.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	9.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	10.05.2023 tarihinde; 09.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
3	11.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	10.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	11.05.2023 tarihinde; 10.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
4	12.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	11.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	12.05.2023 tarihinde; 11.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
5	15.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	12.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	15.05.2023 tarihinde; 12.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
6	16.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	15.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	16.05.2023 tarihinde; 15.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
7	17.05.2023	8.05.2023	-	V: Değerleme Bildirimi	-	16.05.2023	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	17.05.2023 tarihinde; 16.05.2023 tarihi için değerlendirme bildirimi yapılır.
8	18.05.2023	8.05.2023	-	C: Sonlandırma Bildirimi	17.05.2023	-	17.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	18.05.2023 tarihinde; sözleşmenin vade tarihi olan 17.05.2023 bilgisi TerminationDate alanına girilerek sözleşme sonlandırılır. (Erken sonlandırma söz konusu ise; sözleşmenin erken sonlandırma tarihi TerminationDate alanına girilerek sözleşme sonlandırılır.)

2. Açma – Kapama Yöntemi

Açma - Kapama Yöntemi Raporlama Süreci											
8.05.2023'de açılmış 16.05.2023 vade tarihli bir sözleşmenin işlem sırası aşağıda belirtilen sırayla gerçekleştirilmektedir. Açma kapama sisteminde ilk gün işlem açıldıktan sonra önceki güne ait işlem kapatılmalı sonrasında 1 gün önceye ait işlem değerlendirme tarihi ile açılmalıdır. Not: Yükleme sırası her zaman Yeni Bildirim - Sonlandırma şeklinde ilerlemelidir. Aksi halde; Üst üste 2 yeni bildirim atılırsa; "Sözleşme Bulunmaktadır", Üst üste 2 sonlandırma bildirimi atılırsa; "Sözleşme Bulunmadı", hatası ile karşılaşılır.											
İşlem Sırası	Systemdate	Executiondate	Eligibilitydate	Action Type	Terminationdate	Valuationdate	Maturitydate	OtherCounterpartyId	NameOfTheOtherCounterparty	TradeId	Açıklama
1	9.05.2023	8.05.2023	9.05.2023	N: Yeni Bildirim	-	8.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	09.05.2023'te; 08.05.2023 için yeni bildirim yapılır.
2	10.05.2023	8.05.2023	-	C: Sonlandırma	9.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	10.05.2023'te; 08.05.2023'da açılan işlem, 09.05.2023 terminationDate ile kapatılır.
3	10.05.2023	8.05.2023	10.05.2023	N	-	9.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	10.05.2023 aynı işlem 09.05.2023 için valuationDate bilgisi 09.05.2023 olarak açılır.
4	11.05.2023	8.05.2023	-	C	10.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	11.05.2023'te; 09.05.2023 valuationDate tarihli işlem, terminationDate bilgisi 10.05.2023 olarak kapatılır.
5	11.05.2023	8.05.2023	11.05.2023	N	-	10.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	11.05.2023'te; aynı işlem, 10.05.2023 valuationDate tarihi ile açılır.
6	12.05.2023	8.05.2023	-	C	11.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	12.05.2023'te; 10.05.2023 valuationDate tarihine sahip işlem, terminationDate bilgisi 11.05.2023 olarak kapatılır.
7	12.05.2023	8.05.2023	12.05.2023	N	-	11.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	12.05.2023'te; aynı işlem 11.05.2023 valuationDate tarihi ile açılır.
8	15.05.2023	8.05.2023	-	C	12.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	15.05.2023'te; 11.05.2023 valuationDate bilgisine sahip işlem, terminationDate bilgisi 12.05.2023 olarak kapatılır.
9	15.05.2023	8.05.2023	15.05.2023	N	-	12.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	15.05.2023'te; aynı işlem 12.05.2023 valuationDate ile açılır.
10	16.05.2023	8.05.2023	-	C	15.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	16.05.2023'te; 12.05.2023 valuationDate tarihli işlem terminationDate 15.05.2023 olarak kapatılır.
11	16.05.2023	8.05.2023	16.05.2023	N	-	15.05.2023	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	16.05.2023'te; aynı işlem 15.05.2023 değerlendirme tarihli açılır.
12	17.05.2023	8.05.2023	-	C	16.05.2023	-	16.05.2023	11111111	MKK A.Ş.	123MKK123	17.05.2023'te; 15.05.2023 valuationDate tarihli işlem, terminationDate 16.05.2023 olarak kapatılır.

Soru: Sözleşme ve Pozisyonlarda Piyasa Değeri (Mark To Market) ve Teminat Değerlemelerini sözleşme veya pozisyonun vade tarihine kadar yapılmalı mıdır?

Yanıt: Evet yapılmalıdır.

Soru: Vade tarihi gelen sözleşme ve pozisyonlar otomatik olarak sistem tarafından kapatılmakta mıdır?

Yanıt: Hayır, türev sözleşmelerin doğası gereği; vade tarihinden önce de sözleşmeyi sonlandırma söz konusu olabileceği için otomatik bir sözleşmeyi sonlandırma sistemi mevcut değildir.

Vade tarihinden önce sözleşmenin sonlandırılması gibi bir durum mevcut değil ise, üyelerin vade tarihinde sözleşmeyi C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) eylem tipi ile sonlandırma bildirimi yapması gerekmektedir.

Soru: Tebliğ’de yer alan “Sonlandırılmış” ve “Sonuçlandırılmış” kelimeleri neyi ifade etmektedir? Bu işlemler için hangi Eylem Tipi kullanılmalıdır?

Yanıt: “Sonlandırılmış” (Early Terminated) ifadesi sözleşmenin vadesinden önce erken sonlandırılmasını, “Sonuçlandırılmış” ifadesi ise sözleşmenin vade tarihinde sonlandığını ifade etmektedir. İki durumda da C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) eylem tipi ile raporlama yapılacaktır.

Soru: Sözleşme/Pozisyon Raporlamalarında taraf/nihai faydalanıcı olan gerçek kişilere ilişkin bildirimde hangi tanımlayıcı veri kullanılmalıdır?

Yanıt: Sözleşme/Pozisyon Raporlamalarında taraf/nihai faydalanıcı olan gerçek kişilerin olması durumunda öncelikle MKK Sicil Numarası, MKK Sicil Numarasının olmadığı durumlarda ise T.C. Kimlik Numarası veya yabancı kimlik numarası kullanılır. Bunlardan hiç birisinin bulunmadığı durumlarda ise CLC: Müşteri Numarası kullanılır.

Soru: İki yatırım kuruluşu tarafından raporlaması gereken türev sözleşmelerinde, bir yatırım kuruluşu işlem bazında, diğer yatırım kuruluşu ise pozisyon bazında raporlama yapabilir mi?

Yanıt: İki yatırım kuruluşu raporlanması gereken türev sözleşmeleri, eşleştirme sürecine tabi tutulmaktadır. Bu çerçevede, birden fazla sözleşmenin olduğu durumlarda iki tarafın da aynı seviyede (işlem veya pozisyon) raporlama yapması gerekmektedir. Bir taraf işlem bir taraf pozisyon bazında raporlama yaparsa ilgili işlemler eşleşmeyecektir (e-VEDO Platformu'na yapılacak bildirimler kapsamında; işlem bazında raporlama beklenmektedir).

ÖNEMLİ HATIRLATMA: 06.10.2023 tarihli ve 984 no'lu ve “e-VEDO Platformu T+1 Bildirimleri Açma-Kapama Yönteminin Kaldırılması Hk.” konulu genel mektupta duyurulduğu üzere Açma-Kapama yöntemi ile raporlamaya 1 Nisan 2024 tarihinden itibaren raporlama yapılamayacaktır. İlgili tarihe kadar bu süreçte gerekli olan tüm prosedürlerin tamamlanması üyelerin sorumluluğundadır.

Soru: Bankalarca türev işlemleri, BDDK raporlamasında alım ve satım bacaklarıyla iki satırda raporlanmaktadır. e-VEDO Platform'una yapılacak raporlamalarda işlemler alım/satım bacaklarıyla iki satırda mı raporlanmalıdır?

Yanıt: Hayır. Her bir işlem veya pozisyon tek bir satır olarak Platform'a raporlanmalıdır.

Soru: Herhangi bir türev işlemi olmayan yatırım kuruluşlarından boş raporlama yapması istenmekte midir?

Yanıt: Hayır. Türev işlemi olmayan kurumlardan Platform'a herhangi bir raporlama yapması beklenmemektedir.

Soru: 04.07.2023'te açılan 1 ay vadeli bir FX forward işlemi (Vade tarihi: 04.08.2023) 05.07.2023 tarihinde Eylem Tipi=N olarak raporlanacaktır. Bu işlemin vadesi boyunca yeniden raporlanmasını beklenmekte midir?

Yanıt: Bu işlem, vadesi boyunca Platformda açık bir işlem olarak yer alacaktır. Bu işlemin raporlama yöntemine göre iki farklı yaşam döngüsü bulunmaktadır.

1. Değerleme Yöntemi Yaşam Döngüsü:

- Tarih: 05.07.2023 Eylem Tipi = N (Yeni Bildirim)
- Tarih: 06.07.2023 Eylem Tipi = V (Değerleme Bildirimi) ve CL (Teminat Değerleme Bildirimi)
- Tarih Aralığı: 07.07.2023 – 03.08.2023 Eylem Tipi = V (Değerleme Bildirimi) ve CL (Teminat Değerleme)
- Tarih: 07.08.2023 Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)

2. Açma – Kapama Yöntemi Yaşam Döngüsü:

- Tarih: 05.07.2023 Eylem Tipi = N (Yeni Bildirim)
- Tarih: 06.07.2023 Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) ve ardından N (Yeni Bildirim)
- Tarih Aralığı: 07.07.2023 – 03.08.2023 Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) ve N (Yeni Bildirim)
- Tarih: 07.08.2023 Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)

Soru: e-VEDO Platform’una Dosya Yükleme konusunda dikkat edilecek hususlar nelerdir?

Yanıt: Platform’a Dosya Yükleme konusunda dikkat edilmesi gerekli hususlar aşağıda maddeler halinde yer almaktadır:

- Toplu bildirim yükleme alanından yalnızca ZIP formatında dosyalar sisteme aktarılır.
- ZIP dosyaları sadece XML formatında olabilir ve aynı bildirim tipini içermelidir.
- Bir bildirim dosyası (XML) **en fazla 3.000 adet** aynı tipine ait bildirim içerebilir. Bir ZIP dosyasında birden fazla dosya bulunabilir ancak ilgili dosyalardaki bildirim tipleri aynı olmalıdır.
- Dosya isimlendirmelerinde; standart bir prosedür söz konusu olmamakla birlikte, Türkçe karakter kullanılmamalıdır.
- XML dosya karakter kodlaması (Unicode standartlarına göre) UTF-8 without BOM olmalıdır.
- Her bildirim dosyası başlığında bulunan **senderReference** bilgisi gönderen üye bazında tekil olmalıdır. Her bildirim farklı senderReference (Gönderen Dosya Referansı) bilgisi ile yapılmalıdır.

- ZIP dosyalarının formatı Standart Windows ZIP olmalıdır (Windows’da context menüde gelen ZIP özelliği).
- Eğer yukarıdaki maddelerden bir veya birkaçında sorun oluşursa, ZIP dosyası tümüyle ret edilir.
- Yükleme sistemine aktarıldığı zaman; ekranda gözüken senderReference bilgisinin yanındaki “tik” işareti;
 - Yeşil ise; dosya içerisindeki tüm bildirimlerin “Onaylandı” statüsünde olduğunu,
 - Kırmızı ise; dosya içerisindeki bildirimlerinin bazılarının/tümünün “Hata Aldı” statüsünde olduğunu göstermektedir.
- Yükleme tamamlandıktan sonra; “Bildirim İzleme” ekranından statüleri (Onaylandı/Hata Aldı) kontrol edilmelidir.

Soru: Dosya yükleme ekranlarından yüklenen ZIP dosyasının başarılı bir şekilde yüklenmesi raporlama yükümlülüğünün yerine getirilmesi adına yeterli midir?

Yanıt: Hayır. ZIP dosyasının yüklenmesi; ilgili dosyada yer alan bildirimlerin şema kurallarından geçtiğini (Şema kuralları; <https://www.mkk.com.tr/veri-depolama-hizmetleri/e-vedo/turev-t1-raporlamasi> linkinde yer alan “Teknik Doküman” sayfasındaki “Dosya Formatları” dokümanında yer almaktadır.) ve Platform’a aktarıldığını göstermektedir. İlgili ZIP dosyasının sisteme aktarılması, bildirimde yer alan bilgilerin doğru olduğu anlamına gelmemektedir.

Hatalı / hatasız bildirimlerin öğrenilebilmesi için “Bildirim İzleme” ekranlarından ilgili kriterlerden biri seçilerek sorgulama yapılmalıdır. Sorgulama sonucunda ekranda toplamda 100 kayıt görünürken, bildirilen tüm kayıtlar (5.000 adet kayıt sınırı bulunmaktadır) “*excele aktar*” seçeneği ile detaylarıyla incelenebilmektedir.

Excele Aktar

“Excele Aktar” butonu; “Bildirim İzleme”, “Sözleşme İzleme” ve “Açık Sözleşme Raporları” ekranlarında kullanılabilmektedir.

Durumu “Onaylandı” statüsünde olan bildirimler Platform’a aktarılmıştır. Durumu “Hata Aldı” statüsünde olan bildirimler ise; hata açıklaması doğrultusunda hatanın kaynağı düzeltilip “Onaylandı” statülü olacak şekilde tekrar bildirilmesi gerekmektedir.

Soru: Geçmişe yönelik raporlama bildirimi (NBACK eylem tipi) yaparken işlemlerin dönemsel olarak bölünerek farklı dosyalarda gönderilmesi gerekir mi?

Yanıt: XML dosyasında yer alabilecek azami işlem sayısı göz önünde bulundurularak hepsi Nback eylem tipinde olduğu sürece aynı dosyada gönderilebilir (Yalnızca aynı eylem tiplerinde farklı tarihler için tek dosya hazırlamak mümkün olabilmektedir).

Soru: Manual ekranlarda “NBACK” eylem tipi bulunmamaktadır. Dosya yükleme seçeneği dışında geçmişe yönelik bildirimleri nasıl gerçekleştirilmektedir?

Yanıt: Dosya yükleme yoluyla yapılan geçmişe yönelik bildirimler, eylem tipi alanı (actiontype) “NBACK” seçilerek yapılabilmektedir. Manual ekranlarda ise NBACK için ayrı bir ekran yer almamakta olup, geçmişe yönelik bildirimler “Bildirim Giriş (N)” ekranları üzerinden gönderilmelidir. Sistemimiz, ilgili bildirimin N-NBACK ayrımını sözleşmenin gerçekleştirildiği tarih değeri üzerinden otomatik algılamaktadır.

1.4. Raporlama Yükümlülükleri

Soru: Yurtiçi organize piyasalarda yapılan türev işlemlerinin raporlama yükümlüsü hangi kurumdur?

Yanıt: Yurtiçi organize piyasalarda gerçekleşen işlemler MKT görevi nedeni ile Takasbank tarafından raporlanacaktır.

Soru: Merkez Bankası ile akdedilen türev sözleşmeler Platform’a raporlanacak mıdır?

Cevap: Evet. Sözleşmenin karşı tarafının Merkez Bankası olduğu işlemler Platform’a aktarılırken; natureofReportingOtherCounterparty (Sözleşmenin Karşı Tarafının Türü (Karşı Taraf)) alanının “O (Other)” olarak bildirilmesi gerekmektedir.

Soru: Bir yatırım kuruluşunun *emir iletimine aracılık* ederek gerçekleştirilen yurtiçi kurum ve yurtdışı kurumlar arasındaki akdedilen türev sözleşmelerde, raporlama yükümlülüğü kime aittir?

Cevap: Emir iletimine aracılık eden yatırım kuruluşu ilgili sözleşmeyi Platform’a raporlamalıdır. Platform’a raporlama yapılırken; “brokerIdType”, “brokerId” ve “brokerName” alanlarına emir iletimine aracılık eden yatırım kuruluşu kendi bilgilerini; taraf ve karşı taraf alanlarına ise ilgili taraf bilgilerini girmelidir.

Soru: Raporlama yükümlüsü taraflar, bu yükümlülüklerini devredebilirler mi?

Yanıt: Evet devredebilirler. Tebliğ hükümlerine göre;

(1) İki yatırım kuruluşu arasında akdedilen türev araç sözleşmeleri ile yatırım kuruluşları dışında tüzel kişiler arasında akdedilen türev araç sözleşmelerinde raporlama yükümlülüğünün sözleşmenin karşı tarafına ya da genel üye üçüncü bir kuruluşa devri mümkündür.

(2) Taraflardan yalnızca birinin yatırım kuruluşu olduğu türev araç sözleşmeleri ile yatırım kuruluşlarının sözleşmeye taraf olmamakla birlikte alım satım aracılığı faaliyeti kapsamında müşterileri adına karşı tarafı yurtiçinde veya yurtdışında yerleşik bir kuruluş olacak şekilde akdedilmesine aracılık ettikleri sözleşmelerde raporlama yükümlülüğünün yalnızca genel üye üçüncü bir kuruluşa devri mümkündür.

Örnek 1: X bankası ile Y bankasının arasında gerçekleşen bir opsiyon işlemi;

- 1) Her iki banka tarafından,
- 2) X ve Y Bankasının raporlama yükümlülüğünü devrettiği ve Platform’a genel üye olan Z kuruluşu tarafından (X ve Y Bankası adına iki taraf için de ayrı olarak),

3)Kurumların kendi aralarında anlaşmaları ve MKK'nın süreç hakkında bilgilendirilmesinin ardından MKK tarafından uygunluğun alınmasının ardından bir kurum diğer kurum adına da bothSideFlag alanı ile karşı kurum adına da raporlama yapabilir.

Örnek 2: X bankası ile A tüzel şirketi arasında gerçekleşen FX forward işlemi;

- a. X Bankası tarafından
- b. X Bankasının raporlama yükümlülüğünü devretmiş olduğu ve Platform'a genel üye olan Z kuruluşu tarafından, X Bankası adına raporlanabilir.

Not: Raporlama yükümlülüğünün devri, yükümlülüğün devredildiği taraflar arasında imzalanacak bir sözleşme ile gerçekleştirilir. Bu devir, yükümlülüğe tabi tarafın sorumluluğunu ortadan kaldırmayacak ve taraflar müteselsil sorumlu olacaklardır.

1.5. Tüzel Kişi Kimlik Kodu-Legal Entity Identifier (LEI)

Soru: Raporlamalarda Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) kullanımı zorunlu mudur? (Yatırım Kuruluşları)

Yanıt: Evet, zorunludur. Yatırım Kuruluşları e-VEDO Platformu'na üye olurken; kurumlarının güncel LEI kodu bilgisini paylaşmalıdırlar. Daha sonrasında Platform'a bildirim yapılırken LEI kodu bilgisi kullanılmalıdır.

Soru: Raporlamalarda Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) kullanımı zorunlu mudur? (Yatırım Kuruluşları dışındaki tüzel kişiler)

Yanıt: Bu kurumlar, e-VEDO Platformuna üyelik başvurusu sırasında LEI koduna almak zorundadır. Bu kurumların taraf veya nihai faydalanıcı oldukları işlem/pozisyonlarda ise raporlamanın başladığı tarihten itibaren bir ay içerisinde LEI kodu alması ve 5 (beş) iş günü içerisinde

Kuruluşumuza bildirmesi gerekmektedir. (Duyuru No: 1796, <https://www.mkk.com.tr/tr-tr/Duyurular/Sayfalar/e-VEDO-Platformu%E2%80%99na-Yapilan-Bildirimlere-Iliskin-Dikkat-Edilmesi-Gereken-Hususlar-hk.aspx>)

Soru: Yatırım kuruluşları dışındaki tüzel kişilerin LEI kodu alması zorunlu mudur?

Yanıt: Evet zorunludur.

Soru: Raporlama sırasında LEI kodu olmayan tüzel kişilerin LEI kodu alması için belirlenmiş bir süre var mıdır?

Yanıt: Tebliğ hükümlerine göre LEI olmayan tüzel kişiler, raporlama yapılan ilk tarihten itibaren bir ay içerisinde LEI kodu almaları ve beş iş günü içerisinde MKK'ya bildirmesi gerekmektedir. (Duyuru No: 1796, <https://www.mkk.com.tr/tr-tr/Duyurular/Sayfalar/e-VEDO-Platformu%E2%80%99na-Yapilan-Bildirimlere-Iliskin-Dikkat-Edilmesi-Gereken-Hususlar-hk.aspx>)

Soru: Karşı Taraf Kimlik Kodu alanında yurtdışı ve yurtiçi kurumlarla yapılan türev işlemlerde LEI kodları nerden öğrenilmelidir?

Yanıt: Karşı taraf kimlik kodu alanına girişi yapılacak LEI kodu türev sözleşmesinin doğrudan karşı tarafından öğrenilmelidir. LEI bilgisinin doğru girilmesi sorumluluğu raporlayan tarafa aittir.

Soru: LEI kodu alması zorunlu olan Tüzel Kişiler kimlerdir?

Yanıt: Türev sözleşmelerine taraf olan ve/veya nihai faydalanıcı olan tüm tüzel kişilerin LEI kodu almaları zorunludur.

Soru: Raporlama Tebliğinin “VDK'lara Raporlama Yükümlülüğü” başlıklı 6ncı maddesinin altın fıkrasında yer alan tüm tüzel kişiler LEI kodu almak zorunda mıdır?

Yanıt: Hayır tüm tüzel kişilerin LEI kodu alması gibir bir zorunluluk yoktur. Yalnızca türev sözleşmelerine taraf olan ve/veya nihai faydalanıcı olan tüm tüzel kişilerin LEI kodu almaları zorunludur.

Soru: LEI kodu yabancı tüzel kişiler için de zorunlu alan mıdır?

Yanıt: Evet. LEI kodu tüm tüzel kişiler için zorunlu alandır.

Soru: Taraf ve karşı taraf kodlarının sıralaması nasıl olmalıdır?

Yanıt: Tebliğ hükümlerine göre kodların sıralaması aşağıda yer almaktadır.

LEI=Tüzel Kişi Kimlik Kodu

MKK = MKK Sicil Numarası

VKN = Vergi Kimlik Numarası

BIC = İş Kimlik Kodu

TCKN = T.C. Kimlik Numarası

YKN = Yabancı Kimlik Numarası

CLC = Müşteri Numarası

Soru: Müşterilerimizin bu kodları temin etmeyi reddetmesi durumunda nasıl bir yol izlememiz gerekir?

Yanıt: Tebliğ ile Tüzel kişilerin LEI kodu kullanması zorunlu hale getirilmiştir. İlgili müşteriler ile iletişime geçilerek; 27.10.2018 tarihinde Resmi Gazete’de yayımlanarak yürürlüğe giren “Veri Depolama Kuruluşuna Yapılacak Raporlamalara İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ (IV-87.1)(Tebliğ)’inde yer alan sürelerle atıfta bulunulması gerekmektedir. Tebliğde belirtilen sürelerde LEI kodu almayan tüzel kişilere ilişkin Kurul’a bildirim yapılacaktır.

(<https://spk.gov.tr/duyurular/basin-duyurulari/2022/ihraccilarin-lei-kodu-legal-entity-identifier-tuzel-kisi-kimlik-kodu-almasi-hakkinda-duyuru>)

Soru: Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) olmayan tüzel kişilere ilişkin sözleşme/pozisyon raporlamalarında hangi veri kullanılacaktır?

Yanıt: LEI kodu olmayan kurumlar, LEI kodu alıncaya kadar taraf veya nihai faydalanıcı oldukları işlem/pozisyonlarda MKK Sicil Numarası, MKK Sicil Numarasının olmadığı durumlarda Vergi Kimlik Numarası (VKN); bunların bulunmadığı durumlarda, bu kişilere ait ISO 9362 ile uyumlu BIC Kodu, bu kodun da olmadığı durumlarda ise CLC: Müşteri Numarası kullanılır.

Soru: Yatırım Kuruluşları ve diğer tüzel kişiler LEI kodunu hangi kurumdan alabilirler?

Yanıt: Kurumlar LEI kodunu Takasbank'tan alabilirler. Bankanın <https://www.leiturkey.com/com.takasbank.tvs.lei.web/> adresli portalından LEI başvurusu yapılabilir. Konu ile ilgili iletişim adresi aşağıda yer almaktadır:

uie@takasbank.com.tr adresine e-posta gönderimi yapılması durumunda gerekli destek sağlanacaktır.

Soru: e-VEDO Platformu'na türev sözleşme bildirimi gerçekleştirirken; karşı taraf kimlik kodunu LEI dışındaki kodlardan biri ile bildirdiğim bir kurum LEI kodu edindi. Ne yapmam gerekir?

Yanıt: e-VEDO Platformu'nda "Yönetim" sekmesinin altında yer alan "Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme" ekranından; var olan bildirimlerinize ilişkin 'Karşı Taraf Kimlik Kodu', 'Sözleşmenin

Karşı Tarafının Kimlik Kodunun Türü' ve "Sözleşmenin Karşı Tarafının Unvanı" alanları güncellenebilmektedir.

İlgili güncellemeyi talep eden kurum tarafından kontroller sağlandıktan sonra; ilgili işlem onayımıza gelmekte ve kontroller sağlandıktan sonra onaylanmaktadır. Talepte bulunan

kullanıcı onay verilmesinin akabinde mail ile bilgilendirilmektedir. Ancak ilgili güncelleme süreci; tek bir sözleşme için değil, Platform'da var olan ilgili kimlik kodunu içeren tüm sözleşmeler için gerçekleşmektedir.

Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme

Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu
Güncellenecek Kayıtları Dosyada Gör			
Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodu	Sözleşmenin Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodunun Türü	Seçiniz
Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Ünvanı	Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Ünvanı		
☐ İlgili veritabanı güncellemesi talebine ait Excel çıktısını gördüm, onayladım.			
Güncellemek İçin Onaya Gönder			Temizle

2. Raporlama Alanlarına İlişkin Bilgiler

İlgili bilgiler T+1 Raporlaması Dosya Formatları dokümanında yer almaktadır. Raporların hazırlanması esnasında ilgili doküman detaylı şekilde incelenip, alanlar ilgili dokümanda yer alan bilgilere göre doldurulmalıdır.

Soru: Raporlanacak sözleşmelerde “Sözleşme Türü” ve “Varlık Sınıfı”na ilişkin örnekler verebilir misiniz?

Yanıt: Raporlama Tebliğine göre Sözleşme Türü ve Varlık Sınıfı Alanları aşağıdaki tabloda yer almaktadır.

Sözleşme Türü (ContractType)	Varlık Sınıfı (AssetClass)
CD = Fark sözleşmeleri	CO = Emtia
FU = Future	CR = Kredi
FW = Forward	CU = Para birimi
OP = Opsiyon	EQ = Pay senedi
SW = Swap	IR = Faiz oranı
ST = Swap Opsiyon	OT = Diğer
OT = Diğer	SC = Diğer Menkul Kıymetler

Varlık sınıfında bulunmayanlar için “Diğer”, pay senetleri dışında herhangi başka bir menkul kıymete dayalı ise “SC=Diğer Menkul Kıymetler”in seçilmesi beklenmektedir.

Soru: Cross Currency SWAP işlemleri için Sözleşme Türü, Varlık Sınıfı ve İşlem Detayı alanları nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Çapraz Para Swapları söz konusu ise; aşağıda yer alan 3 alan bilgisi aşağıdaki şekilde girilmelidir;

Sözleşme Türü (ContractType) = SW

Varlık Sınıfı (AssetClass) = IR

İşlem Detayı (TransactionDetails) = XCS

Soru: Döviz Forward Sözleşmeleri için yukarıdaki tablodaki hangi ikili seçilmelidir?

Yanıt: Sözleşme Türü (ContractType): FW (Forward)

Varlık Sınıfı (AssetClass): CU Para Birimi

Soru: Interest Rate Swap Sözleşmeleri için ContractType, AssetClass ve TransactionDetails alanları nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Faiz Oranı Swapları söz konusu ise; ilgili 3 alan bilgisi aşağıdaki şekilde girilmelidir;

Sözleşme Türü (ContractType) = SW

Varlık Sınıfı (AssetClass) = IR

İşlem Detayı (TransactionDetails) = OTH

3. Raporlama Alanlarına İlişkin Teknik Bilgiler

Soru: Raporlama Tebliğ ekinde yer alan “Taraflara İlişkin Bilgiler” bölümü ile “Sözleşmeye İlişkin Bilgiler” bölümü Platforma ayrı ayrı mı yoksa tek bir rapor olarak mı raporlanacaktır?

Yanıt: Üyelerimiz iki bölümde yer alan verileri tek bir seferde raporlayacaklardır.

Soru: XML formatında opsiyonel alanlara ilişkin tagler nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Opsiyonel alanlara herhangi bir veri girişi yapılmaması durumunda, XML dosyası içerisinde ilgili tagler yer almamalıdır.

Soru: Ürün ve varlık sınıflandırma ve kod türleri için geçen ISIN, All, CFI kodları için örnek verebilir misiniz?

Yanıt: Mevcut durum itibarıyla ISIN, All ve CFI kod kullanımı opsiyonel olup, özellikle organize piyasa işlemleri için doldurulması tavsiye edilmektedir.

Raporlama Zaman Damgası

Soru: 30.11.2018 tarihli verilerin raporlanması durumunda, “Raporlama Zaman Damgası” verisini 30.11.2018 tarihini mi, yoksa raporlamanın yapıldığı 04.12.2018 tarihinin mi girişini yapılacaktır?

Yanıt: “Raporlama Zaman Damgası” raporlama ile ilgili üyelerimizin doldurması gereken bir alan değildir. İlgili alanı sistem tarafından otomatik olarak dolu getirilmektedir.

Soru: “Raporlama Zaman damgası” ile ilgili “E-Vedo Dosya Formatları” dokümanında herhangi bir açıklama bulunamamıştır. Bu bilgi dokümanda hangi alana karşılık gelmektedir? Raporda nerede kullanılmalıdır?

Yanıt: “Raporlama Zaman Damgası” raporlama yapılırken girilecek bir alan olmayıp, e-VEDO sistemi tarafından otomatik olarak doldurulacaktır.

SenderReference (Mesajı/dosyayı gönderen üyenin mesaja/dosyaya verdiği tekil referans)

SenderMessageRef (Bildirimün Aksiyon Referansı)

ReportTrackingNumber (Rapor Takip Numarası)

Soru: Raporlama alanlarında yer alan “SenderReference”, “SenderMessageRef” ve “ReportTrackingNumber” alanlarının farklarını açıklayabilir misiniz? Bu alanlar bütün bildirimlerin genelinde tekil mi olmalıdır?

Yanıt: “SenderMessageRef” (Gönderen işlem referansı) her sözleşme/pozisyon bildirimine verilen bir referans numarası iken, “SenderReference” (Gönderen dosya referansı) raporlanan dosyaya verilmektedir. “SenderMessageRef” sadece file upload yönteminde kullanılmaktadır.

Örneğin; 100 farklı bildirim içeren sözleşmeye/pozisyona ait bilgilerin yer aldığı dosyada; “SenderReference” bilgisi bir adet, “SenderReferenceRef” bilgisi 100 adet olmalıdır.

“ReportTrackingNumber” ise raporlamaların “Bildirim/Sözleşme İzleme” ekranından daha kolay bir şekilde takip etmenizi sağlayacak bir numara olup, tekil olmasına gerek bulunmamaktadır. Örneğin “ReportTrackingNumber” ile “SenderMessageRef” aynı numarayı içerebilirler.

Soru: “SenderMessageRef” bilgisi, olarak, yatırım kuruluşları tarafından kendi sistemlerinde her bir işlem için özgün bir numara üretilmektedir. Bu numara, sözleşmenin karşı tarafı olan yatırım kuruluşunun sisteminin ürettiği “SenderMessageRef” bilgisi ile aynı mı olmalıdır?

Yanıt: Hayır. İki tarafın da Raporlama yükümlüsü olduğu işlemlerde “SenderMessageRef” bilgisinde tekillik aranmamaktadır. Ancak kurumların kendi içsel kontrollerini daha sağlıklı gerçekleştirebilmesi ve ilgili işlemlere ilişkin aramalarda kullanılabilmesi adına ilgili alanın tekillleştirilerek girilmesi tavsiye edilmektedir.

Soru: “ReportTrackingNumber” üyeler tarafından mı üretilecektir?

Yanıt: Evet. “ReportTrackingNumber” raporlama yapan üyemizin yaptığı raporlamaları takip için kullandığı numara olup, üyenin kendi sistemi tarafından üretilecektir.

BothSideFlag

Soru: Sadece bir yatırım kuruluşu veya tüzel kişinin raporlama yükümlüsü olduğu sözleşme/pozisyon raporlamalarında ilgili alan nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: İlgili alan “F” (False) olarak doldurulmalıdır.

Soru: Sözleşmenin/Pozisyonun iki tarafının da raporlama yükümlüsü olduğu sözleşme/pozisyon raporlamalarında ilgili alan nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Tebliğ hükümlerine göre; iki yatırım kuruluşu arasında akdedilen türev araç sözleşmeleri ile yatırım kuruluşları dışında tüzel kişiler arasında akdedilen türev araç sözleşmelerinde raporlama yükümlülüğünün sözleşmenin karşı tarafına devri mümkündür. Bu durumda ilgili alan T (True) olarak doldurulmalıdır. İki tarafın da ayrı ayrı raporlama yapması durumunda ilgili alan F her iki taraf tarafından da F (False) olarak doldurulmalıdır.

Soru: BothsideFlag alanını T (True) olarak raporlayan raporlama yükümlüsü sözleşmenin taraf ve karşı tarafını raporlamak zorunda mıdır?

Yanıt: Bothsideflag sadece raporlamanın iki taraf adına yapılıp yapılmadığını belirten bir alandır. Her durumda “taraf” ve “karşı taraf” bilgilerinin girilmesi gerekmektedir.

Soru: BothsideFlag alanını T (True) olarak raporlanması durumunda sözleşme/pozisyon eşlemeye girecek midir?

Yanıt: BothsideFlag alanını T (True) olarak raporlanması durumunda, sadece tek taraftan bilgi alınacağından, eşleşme süreci otomatik olarak “eşleşmiş” olarak sonuçlanacaktır.

clientLimit / Müşteri Limiti (Taraf)

otherClientLimit / Müşteri Limiti (Karşı Taraf)

Soru: Müşteri limiti (Taraf) Alanı nasıl doldurulacaktır?

Yanıt: Sözleşmenin tarafının sözleşmenin karşı tarafına tahsis ettiği limit bilgisidir.

Örnek 1: X Bankası ile A Kişisi arasında gerçekleşen bir türev işleminde X Bankası’nın A Kişisine kendi sisteminde tanımlamış olduğu limit “clientLimit Müşteri Limiti (Taraf)” alanına yazılacaktır. “otherClientLimit Müşteri Limiti (Karşı Taraf)” verisi bilinmiyor ise sözleşmenin nominal değeri bilgisi ilgili alana girilebilir.

Örnek 2: X Bankası ile Y Bankası arasında gerçekleşen bir türev işleminde X Bankası’nın Y Bankası’na kendi sisteminde tanımlamış olduğu limit “clientLimit Müşteri Limiti (Taraf)” alanına yazılacaktır.

Soru: Müşteri limitinin tahsis edilmediği durumlarda ilgili alanlar nasıl doldurulacaktır?

Yanıt: İlgili bilgi mevcut değil ise; sözleşmenin nominal değer bilgisi girilebilir.

Soru: Merkez Bankası ile yapılan işlemler bildirilmeli midir? Bildirim söz konusu ise müşteri limiti ve sözleşmenin türü alanlarına hangi değerler girilmelidir?

Yanıt: Evet, bildirilmelidir. Müşteri limiti alanına tarafın TCMB’deki limitinin girilmesi beklenmektedir. Böyle bir limit söz konusu değil ise, ilgili alan sözleşmenin nominal değeri bilgisi girilebilir. Karşı tarafın TCMB olduğu sözleşmelerde natureofReportingOtherCounterparty (Sözleşmenin Karşı Tarafının Türü (Karşı Taraf)) alanı “O (Other)” olarak doldurulmalıdır.

counterpartySide Sözleşme Tarafının Alıcı veya Satıcı Olma Durumu (Taraf)

Soru: Varlık Sınıfı Para Birimi olan Sözleşmelerde alıcı satıcı taraf durumu nasıl belirlenmektedir?

Yanıt: Varlık Sınıfı (AssetClass) Para Birimi (CU) olan Foward, Swap ve Future olanlarda; alfabetik olarak ilk gelen ürünü vade tarihinde almanıza/satmanıza göre alıcı/satıcı olma durumunuz belirlenmektedir.

Örnek1: Vade tarihinde USD alıp TRY satılıyor. **TRY alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız.**

Örnek2: Vade tarihinde EUR alıp USD satılıyor. **EUR alfabetik olarak önce geldiği için alıcısınız.**

Örnek 3: Vade tarihinde GBP alıp EUR satılıyor. **EUR alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız.**

Sözleşme türü, Varlık Sınıfı, İşlem Detayı ve bacaklara göre Alıcı veya Satıcı olma durumu aşağıdaki tabloda detaylı şekilde yer almaktadır;

Asset Class	Base Product	Sub-Product	Transaction Type	Leg 1 / Leg 2 Proposal	Buyer (for Counterparty Side)	Seller (for Counterparty Side)
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Sabit Değişken		Bacak 1 = Sabit Bacak Bacak 2 = Değişken Bacak	Sabit Oranı Ödeyen	Sabit Oranın Alıcısı
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Sabit Değişken	Gecelik Endeksli	Faiz Oranı Swap'ı olarak Sabit/Değişken	Sabit Oranı Ödeyen	Sabit Oranın Alıcısı
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Sabit Değişken	Sıfır Kuponlu	Faiz Oranı Swap'ı olarak Sabit/Değişken	Sabit Oranı Ödeyen	Sabit Oranın Alıcısı
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Sabit Oranlı		Bacak 1 = Yüksek Sabit Oran Bacak 2 = Düşük Sabit Oran Bacakların aynı orana sahip olması durumunda: Bacak 1 = En kısa hesaplama dönemine sahip bacak kullanılır	Bacak 1'i ödeyen	Bacak 1'in alıcısı
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Baz		Bacak 1 = Daha yüksek marjlı bacak İki bacağın da aynı marja sahip olması durumunda : Bacak 1 = En kısa yenileme/sıfırlama dönemindeki bacak kullanılır	Bacak 1'i ödeyen	Bacak 1'in alıcısı
Faiz Oranı	Faiz Oranlı Swap (IR Swap)	Baz	Gecelik Endeksli	Faiz Oran Swap bazı	Bacak 1'i ödeyen	Bacak 1'in alıcısı
Faiz Oranı	Çapraz Kur	Sabit-Değişken		Bacak 1 = ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimi	ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimini alan taraf	ISO 4217 standardına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk görünen para birimini teslim eden taraf
Faiz Oranı	Çapraz Kur	Sabit-Sabit		Bacak 1 = ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimi	ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimini alan taraf	ISO 4217 standardına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk görünen para birimini teslim eden taraf
Faiz Oranı	Çapraz Kur	Baz		Bacak 1 = ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimi	ISO 4217 Standartına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk sırada gelen para birimini alan taraf	ISO 4217 standardına göre alfabetik olarak sıralandığında ilk görünen para birimini teslim eden taraf
Faiz Oranı	Egzotik Opsiyon			Alıcı/Satıcı olma durumunun açıkça belirli olmaması durumunda: Bacak 1 = Alıcı tarafından ödenen bacak	Alıcı = Tiebraker Logic (ISDA tarafından geliştirilen varlık sınıfı) üzerinden LEI'si ilk olarak bulunan taraf	Satıcı = Tiebraker Logic (ISDA tarafından geliştirilen varlık sınıfı) üzerinden LEI'si ikinci olarak bulunan taraf
Faiz Oranı	Enflasyon			(1) Sabit değişken faiz oranı bazında sabit ve değişken (2) Faiz swabı bazında değişkene karşı değişken	1) Sabit Oranı Ödeyen 2) Bkz: Faiz Oranı swabı bazında	1) Sabit Oranı Alan 2) Bkz: Faiz Oranı swabı bazında
Faiz Oranı	Opsiyon	Swaption		Underlying swap bazında uygulanabilir Bacak 1 / Bacak 2 önerisi	Opsiyonu kullanma hakkını elinde bulunduran taraf	Prim Alıcısı
Faiz Oranı	Enflasyon tavan / taban			N/A	Opsiyonu kullanma hakkını elinde bulunduran taraf	Prim Alıcısı
Faiz Oranı	Opsiyon	Borçlanma Aracı Opsiyonu		N/A	Opsiyonu kullanma hakkını elinde bulunduran taraf	Prim Alıcısı
Faiz Oranı	Forward	Borçlanma Aracı		N/A	Finansal aracı alan	Finansal aracı satan
Faiz Oranı	Vadeli (Forward) Oran Anlaşması			N/A	Sabit Oranı Ödeyen	Sabit Oranı Alan
Faiz Oranı	Tavan - Taban			N/A	Opsiyonu kullanma hakkını elinde bulunduran taraf	Prim Alıcısı

ValuationDate / Değerleme Tarihi

Soru: Hala açık olan sözleşmelere ait değerleme yaparken “valuationDate” alanının hangi tarih girilmelidir?

Yanıt: Değerlemeye ilişkin gün bilgisi girilmelidir. Değerleme tarihi, bildirim tarihi ya da bildirim tarihinden bir iş günü öncesi için seçilebilmektedir. Sonlandırma Bildirimi yapılmış olan (Kapalı sözleşmeler) için değerleme bildirimi yapılamamaktadır, dolayısıyla sonlandırma eylem tipi ile bildirim yapılırken ilgili alanlara ait güncel değerlerin girişlerinin Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihinden, Vade Tarihine dek eksik gün kalmadan tamamlanması beklenmektedir. Yapılacak olan son geliştirme ile; bir sözleşmenin değerleme bildirimleri eksik ise; ilgili sözleşmeye sonlandırma bildirimi yapılamayacaktır.

Soru: Valuation date (değerleme tarihi) alanı için saat bilgisi tutulmuyorsa Valuation Time (değerleme zamanı) alanı nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Değerlemeye ilişkin zaman bilgisi girilmelidir. Bu bilginin olmaması durumunda saat bilgisi ilgili gün için 00:00:00 olarak gönderilebilir.

Price/Rate

Soru: PriceRate (Fiyat/oran) alanı nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: İlgili alana; swaplarda forward kur, opsiyonlarda prim oranı, faiz swaplarında sabit faiz oranı, future ve fark sözleşmelerinde alış/satış fiyatı girilmelidir.

PriceRate alanının;

- Forward Sözleşmeleri için: Forward kur
- Future Sözleşmeleri için: Forward kur
- Fark Sözleşmeleri için: Alış/satış fiyatı
- Para Swabı Sözleşmeleri için: Forward kur
- Opsiyon Sözleşmeleri için: Opsiyon primi
- Faiz Swapı(Interest Rate swap) Sözleşmeleri için: Sabit faiz oranı(iki tane sabit varsa yüksek olan)
- Çapraz Para Swabı(XCS) Sözleşmeleri için: Sabit faiz oranı (iki tane sabit varsa yüksek olan) şeklinde doldurulması gerekmektedir.

Clearing Threshold

Soru: Takas eşiği alanı boş bırakılabilir mi?

Yanıt: Takas eşiği zorunlu olarak girilmesi gereken alanlardan biridir. Tebliğ'in rapor açıklamalarında da belirtildiği üzere ilgili mevzuat düzenlenene kadar yurtiçi karşı taraflı sözleşmeler için bu alanın "NA" olarak gönderilmesi beklenmektedir. Yurtdışındaki bazı uygulamalarda, belirli bir hacmin üzerindeki işlemlerin organize piyasalardan gerçekleştirilmesi

gerekmektedir. Bu durumda, yurtdışı karşı taraflı işlemlerde böyle bir uygulama söz konusu ise ilgili alanın doldurulması gerekmektedir.

directlyLinkedToComAct/otherLinkedToComAt

Soru: İlgili alanların format açıklamalarında yer alan “Ticari amaçlı (T)” ve “Hazine işlemi (H)” neyi ifade etmektedir?

Yanıt: Alım-satım amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar için “T”, riskten korunma amaçlı portföye/şirket pozisyonuna dahil edilen türev araçlar için ise “H” değeri girilmelidir.

ccpID / MKT ccpTitle / MKT Unvanı

Soru: Bu alanlar organize piyasalarda yapılan işlemler için mi doldurulmalıdır?

Yanıt: Evet. Takası yurtiçinde yerleşik bir MKT tarafından gerçekleştirilen işlemlerde raporlama yükümlülüğü yurtiçi yerleşik MKT tarafından ifa edildiği için bu alanın doldurulması sadece yurtdışı organize piyasalarda yapılan işlemler için gereklidir.

rediscountAmount / Reeskont Tutarı

Soru: Bu alanın Sözleşmenin Piyasa Değeri alanı ile farkı nedir?

Yanıt: Reeskont tutarı alanında türev işlemlerin gelir ve gider reeskontları belirtilir.

Sözleşmenin piyasa değeri ise sözleşmelerin piyasa fiyatına göre ya da modele göre değerlendirilmiş fiyatını ifade etmektedir. Sözleşmenin piyasa değerlerinin günlük olarak girilmesi gerekmektedir ve teorik olarak aynı değer girilmesi beklenmemektedir.

Teminatlandırmaya ilişkin alanlar

Soru: Gönderilen Değişim Teminatı alanına negatif değer girilebilir mi?

Yanıt: Değişim teminatlarına pozitif değer girilmelidir.

Soru: collateralPortfolioCode alanı nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: Tarafınızdan serbestçe belirlenecek bir koddur. Burada dikkat edilmesi gereken husus, aynı müşterinin farklı sözleşmelerde belirtilen portföy kodu bilgilerinin ve teminat tutarlarının aynı teminat havuzunu kullanan işlemler için aynı olmalıdır. Kod teminat havuzu için belirlenmektedir. Müşterinin tüm teminat bilgisi değil işleme ilişkin teminat bilgisi girilmelidir. İlgili yeknesaklığı sağlamak için portföy kodu alanına, müşteriye tanımlayacak bir karakter veya sıra numarası verilebilir.

settlementDate / Teslim Tarihi

Soru: Swap işlemlerine ait ara ödeme dönemleri için bu alan nasıl doldurulmalıdır?

Yanıt: İlgili alan çoklanabilir bir alan olup, birden fazla teslim tarihi girilebilmektedir. Vadesinde veya vadesinden önce dayanak varlığın teslim edildiği tarih, eğer birden fazla ise bu şekilde çoklanabilir.

otherHedgeInfo / Yatırım Kuruluşları Dışındaki Tarafların İşlemi Yapma Amacı (Karşı taraf)

Soru: otherHedgeInfo alanı nasıl doldurulmalıdır ve bu alana ilişkin kurallar nelerdir?

Yanıt: Yurt içi yatırım kuruluşları haricindeki karşı taraflarda ilgili alanın doldurulması beklenmektedir. Bu alana ilişkin validasyon kuralı, “Sözleşmenin Karşı Tarafının Türü (natureOfReportingOtherCounterparty)” ve “Sözleşmenin Karşı Tarafının Sektörü (otherCorporateSector)” alanları üzerinden sağlanmaktadır. İlgili alanlara sırası ile “F” ve “AK, KB, YB, MB” değerleri girilmiş ise “otherHedgeInfo” alanı gönderilmemelidir.

Yurt dışı yatırım kuruluşları ile gerçekleştirilen işlemler raporlanırken “Sözleşmenin Karşı Tarafının Türü” alanı “O” – Diğer seçilmelidir. Bu kapsamda, “Sözleşmenin Karşı Tarafının

Yerleşik Bulunduğu Ülke (countryOfTheOtherCounterparty)” alanına “TR” dışında bir değer girildiği takdirde “otherHedgeInfo” alanı zorunlu olmayacaktır.

4. Eşleşme Sürecine İlişkin Bilgiler

Soru: Hangi işlemler eşleşmeye tabi tutulacaktır? Hangi işlemler eşleşmeye tabi tutulmadan otomatik olarak eşleşmiş kabul edilecektir?

Yanıt: Aynı sözleşme ve pozisyona ilişkin işlemin her iki tarafının raporlama yükümlülüğü bulunuyorsa bu işlem/pozisyon eşleşme sürecine girecektir. Bu işlemi taraflardan bir tanesi iki taraf adına bildirim yapması durumunda ise eşleştirme sürecine girilmeyecektir ve otomatik olarak “Eşleşti” statüsü alacaktır. Sözleşme ve pozisyon yükümlüğü sadece bir tarafa ait ise bu sözleşmeler/pozisyonlar Platform’a raporlandığında otomatik olarak eşleşmiş kabul edilecektir.

4.1. Eşleşme kapsamı

Her iki sözleşme tarafına da raporlama yükümlülüğü doğuran türev işlemlerine ait bildirimler eşleşmeye tabi olmaktadır. Veri Depolama Kuruluşuna Yapılacak Raporlamalara İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ (IV-87.1) uyarınca sözleşme taraflarının her ikisinin de yurt içi yatırım kuruluşu ya da her ikisinin de yurt içi tüzel kişi olduğu raporlamalar eşleşmeye tabi olacaktır.* Bu minvalde yurt dışı yatırım kuruluşları ile yapılan sözleşmeler eşleşme kapsamı dışındadır. Eşleşme süreci 01.04.2019 tarihinden itibaren bildirilen sözleşmeler için geçerlidir.

*Tüzel kişilere ait eşleşme süreci ve TradeID (İşlem Kodu) mutabakatına ilişkin soruların evedo@mkk.com.tr mail adresine iletilmesi rica olunur.

Eşleşme süreci için TradeID aşağıdaki gibi oluşturulmaktadır:

1) Taraf Kodu 1: (3 karakter): Alfabetik olarak ilk gelen kurumun MKK üye kodu girilir.

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.

4) Dayanak Varlık Detayı (5 karakter): Varlık Sınıfına göre girilir.

5) Sözleşme Türü (2 karakter)

6) Varlık Sınıfı (2 karakter)

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.

e-VEDO Özgün İşlem Kodu Kuralları Hk. isimli duyuruda (<https://www.mkk.com.tr/tr-tr/Duyurular/Sayfalar/e-VEDO-%C3%96zg%C3%BCn-%C4%B0slem-Kodu-Kurallari-Hk.aspx>) genel kurallar ve örnekler açıklanmıştır.

Karşı tarafın yurt içi yerleşik yatırım kuruluşu olma koşulu:

natureOfReportingOtherCounterparty	Sözleşmenin Karşı Tarafının Türü (Karşı Taraf)	F = Finansal taraf
otherCorporateSector	Sözleşmenin Karşı Tarafının Sektörü (Karşı Taraf)	AK, KB,MB,YB

(Karşı tarafın yurt dışı yatırım kuruluşu olduğu sözleşmelerde natureOfReportingOtherCounterparty alanı "O"-Diğer- seçilmelidir)

Ön Eşleşme; "tradeId" (İşlem Kodu) + "counterpartyId" (Sözleşme tarafının kimlik kodu) + "otherCounterpartyId" (Sözleşmenin karşı tarafının kimlik kodu) alanları kullanılarak yapılmaktadır. Tam Eşleşme ise; ön eşleşmede yer alan alanların eşleşmesine ek olarak, aşağıda sayılan 25 adet alanın eşleşmesine tabidir. Tam Eşleşme ise; aşağıda "Eşleşme Alanları Tablosu"nun altında sayılmış olan 25 adet alanın eşleşmesi ile sağlanmaktadır.

4.2. Eşleşme Statüleri ve Eşleşme Alanlarının Tolerans Alanları ve Silme Bildirimine İlişkin Kurallar

Ön eşleşme: CounterpartyID + TradeID + OtherCounterpartyID alanlarının sözleşmenin taraflarının yapmış olduğu raporlamalarda birebir eşleşmesi ile gerçekleşir.

Eşleşme: Tüm eşleşme alanlarının belirtilen tolerans aralıkları üzerindeki kontrol kapsamında.

Eşi Girilmedi: Ön eşleşme sağlanamayan sözleşmeler.

Eşleşmedi: Ön eşleşmeden geçen fakat eşleşme toleranslarını sağlamayan sözleşmeler.

Gecikmeli Eşleşmedi: Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihi (ExecutionDate) baz alınarak 7 iş günü sonrası raporlanan sözleşmeler Ön Eşleşmeyi sağlayıp, eşleşme alanlarında tam eşleşme sağlayamaz ise ilgili statüyü almaktadır.

Eşleşti: Ön eşleşme ve 25 adet eşleşme alanı baz alındığında hepsinde tam eşleşmeyi sağlayan sözleşmeler.

Gecikmeli Eşleşti: Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihi (ExecutionDate) baz alınarak 7 iş günü sonrasında raporlanan sözleşmeler, Ön eşleşme ve 25 adet eşleşme alanı baz alındığında hepsinde tam eşleşmeyi sağlayan sözleşmeler.

Otomatik eşleşti: Eşleşme kapsamı dışında olan sözleşmeler.

Silme Bildirimine İlişkin Kurallar;

- Eşleşen sözleşmeler silinemez.
- Tam eşleşme (YPAR, EYPAR) sağlanan sözleşmeler silinemez.
- Sözleşmeniz ön eşleşmeden geçmiş (NPAR, ENPAR statülü) ise; karşı tarafınız tarafından sonlandırılmış durumda olan (TM) sözleşmeler için silme bildirimi gerçekleştiremezsiniz.
- Sözleşmeniz ön eşleşmeden geçmiş (NPAR veya ENPAR statülü) ise ve her iki tarafın da sözleşmeleri açık statüde (AP) ise; bir tarafın işlemi silmesi durumunda, işlem karşı

tarafına bilgilendirme yapılacak ve işlem karşı tarafının bildiriminin eşleşme statüsü “Eşi Girilmedi (NF)” olarak güncellenecektir.

Açma / kapama yöntemi ile raporlama yapan üyelerimizin sözleşmelerine ilişkin olarak; **“CounterpartyID + TradeID + OtherCounterpartyID”** üçlü kriter bazında *bir gün öncesine* ait kapalı sözleşme olması durumunda eşleşme statüleri (Eşleşmedi, eşleşti, otomatik eşleşti) korunacak olup, tarih kontrolü “eligibilityDate” alanı üzerinden sağlanacaktır. Açma/Kapama Yöntemini tercih eden ve sözleşmeleri “Eşleşmedi” veya “Eşleşti” statüsünde olan üyelerimiz, ilgili sözleşmeyi her iş günü için eksiksiz raporlamaya özen göstermelidir. Eğer bir iş günü bile atlanıp, diğer iş günü için bildirim yapılırsa sözleşmenin statüsü “Eşi Girilmedi” durumuna dönmektedir (Kontrol eligibilityDate üzerinden sağlanmaktadır.)

Eşleşme Alanları Tablosu ve Tolerans Aralıkları

1% Tolerans: Karşılıklı girilen değerlerin eşleşmesinde -/+ %1 farka izin verilmektedir. Örnek: 101 – 100 değerleri eşleşme kriterini sağlarken, 98-100 değerleri eşleşmemektedir.

Virgülden önce validasyon: Girilen değerlerdeki validasyon, virgül sonrası için geçerli değildir.

Örnek: 250,55 – 250,23 değerleri eşleşmektedir.

- Tolerans alanı opsiyonel ise ya her iki tarafça da doldurulmalı ya da her iki tarafça boş bırakılmalıdır.
- Eşleşme süreci T+7 (iş günü) içerisinde mutlaka tamamlanmalıdır. Bu süre sonrasında tamamlanan eşleşme süreci neticesinde sözleşmeler “Gecikmeli” statüsü almaktadır.

TAG NAME	ALAN İSMİ	Z/C/O	TOLERANS
assetClass	Varlık Sınıfı	Z	Tam eşleşme
commodityBase	Baz Emtia	C	Tam eşleşme
commodityDetails	Emtia Detayları	C	Tam eşleşme
contractType	Sözleşme Türü	Z	Tam eşleşme
currencyOfPrice	Fiyatın Para Birimi	C	Tam eşleşme
effectiveDate	Valör Tarihi	Z	Tam eşleşme
exchangeRate1	Döviz Kuru 1	C	1% Tolerans
exchangeRateBasis1	Para Birimi Çifti 1	C	Tam eşleşme
exchangeRateBasis2	Para Birimi Çifti 2	C	Tam eşleşme

executionDate	Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih	Z	Tam eşleşme
fixedRateOfLeg1	1 inci Bacağın Sabit Oranı	C	1% Tolerans
fixedRateOfLeg2	2 inci Bacağın Sabit Oranı	C	1% Tolerans
forwardExchangeRate	Forward Döviz Kuru	C	1% Tolerans
maturityDate	Vade Tarihi	Z	Tam eşleşme
notional	Nominal	Z	Virgülden önce validasyon
notionalCurrency1	Nominal Para Birimi-I	Z	Tam eşleşme
optionType	Opsiyon Tipi	C	Tam eşleşme
optionExerciseStyle	Opsiyon Kullanma Tarzı	C	Tam eşleşme
priceMultiplier	Fiyat Çarpanı	Z	Tam eşleşme
priceNotation	Fiyat Notasyonu	Z	Tam eşleşme
priceRate	Fiyat/Oran	Z	1% Tolerans
quantity	Miktar	Z	Tam eşleşme
strikePrice (cap/floor rate)	Opsiyon Kullanım Fiyatı (Tavan/Taban Oranı)	C	Virgülden önce validasyon
terminationDate	Sözleşmenin Erken Sonlandığı Tarih	O	Tam eşleşme
venueOfExecution	İşlemin Gerçekleştirildiği Kanal	Z	Tam eşleşme

Finansal taraflar arasında gerçekleşen işlemler executiondate T+7 içerisinde 13.00 ve 23.00'da eşleşme jobumuza dahil olmaktadır.

Bildirimin yapıldığı gün executiondate+7 dışında ise eşleşme job'ları saat 23.00'da çalışmaktadır.

5. e-VEDO Platformu Ekranları

5.1. Sözleşme Bildirim Ekranları

5.1.1. T+1 Sözleşme Bildirim Ekranı

T+1 Bildirimlerinin raporlanması için dosya yükleme (XML Dosya yüklemesi) ve uygulama üzerinden manual olarak bildirim şeklinde iki seçenek bulunmaktadır.

Uygulama üzerinden manual şekilde “Bildirim Giriş” ekranından, dosya yükleme olarak ise “Dosya Yükleme” ekranından XML dosya yüklenmesi şeklinde gerçekleştirilmektedir.

Sözleşme Bildirimi | Bildirim İzleme | Sözleşme İzleme | Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme | Açık Sözleşme Raporları | Borçlanma Araçları Bildirimleri | Yönetim | MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.

Bildirim Giriş
Sözleşme Güncelleme
Sözleşme Silme
Sözleşme Sonlandırma
Değerleme
Teminatlandırma
Sıkıştırma
Dosya yükleme
Günlük İşlem Raporu Dosya Yükleme

Kuralları

İme alanından yalnızca **ZIP** formatında dosyalar sisteme aktarılır.
ce **XML** formatında bildirimleri barındıran dosyalar içerebilir. (İlgili format MKK tarafından daha önce duyurulmuştur)
(XML) **en fazla 3000** adet aynı tipine ait bildirim içerebilir. Bir zip dosyasında birden fazla dosya bulunabilir.

- 1 Zip içerisindeki bildirim dosyalarının isimlendirmeleri sisteme aktarım sürecinde önem arz etmektedir: Dosyaların işlenmesi, alfabetik sırada gerçekleşmektedir.
- 1 XML dosya karakter kodlaması (unicode standartlarına göre) **UTF-8 without BOM** olmalıdır.
- 1 Her bildirim dosyası başlığında bulunan senderReference bilgisi gönderen üye bazında tek olmalıdır.
- 1 ZIP dosyalarının formatı **Standart Windows Zip** olmalıdır. (Windows'da context menüde gelen zip özelliği)
- 1 Eğer yukarıdaki maddelerden bir veya bir kaçında sorun oluşursa, ZIP dosyası tümüyle ret edilir.
- 1 Yükleme sırasında görüntülenen durum çubuğu dosyalarda bulunan bildirimlerin sisteme aktarılmasını ifade etmektedir.
- 1 Dosya adında Türkçe karakter kullanılmamalıdır.

Yeni zip dosyası yükle

SİLME BİLDİRİMİNE İLİŞKİN KURALLAR

Yükleme Tarihi: YYYY-MM-DD **Sorgula**

5.1.2. T+0 Sözleşme Bildirim Ekranı

T+0 Günlük İşlem Raporlaması için dosya yükleme işlemleri; XML formatındaki dosyanın ZIP dosyasının içerisine alınarak "Sözleşme Bildirimi" sekmesinin altında yer alan "Günlük İşlem Raporu Dosya Yükleme" ekranından gerçekleştirilmektedir.

Sözleşme Bildirimi | Bildirim İzleme | Sözleşme İzleme | Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme | Açık Sözleşme Raporları | Borçlanma Araçları Bildirimleri | Yönetim | MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.

Bildirim Giriş
Sözleşme Güncelleme
Sözleşme Silme
Sözleşme Sonlandırma
Değerleme
Teminatlandırma
Sıkıştırma
Dosya yükleme
Günlük İşlem Raporu Dosya Yükleme

Bildirim Yükle

Kuralları

İme alanından yalnızca **ZIP** formatında dosyalar sisteme aktarılır.
ce **XML** formatında bildirimleri barındıran dosyalar içerebilir. (İlgili format MKK tarafından daha önce duyurulmuştur)
(XML) **en fazla 5000** adet aynı tipine ait bildirim içerebilir. Bir zip dosyasında birden fazla dosya bulunabilir.

- 1 Zip içerisindeki bildirim dosyalarının isimlendirmeleri sisteme aktarım sürecinde önem arz etmektedir: Dosyaların işlenmesi, alfabetik sırada gerçekleşmektedir.
- 1 XML dosya karakter kodlaması (unicode standartlarına göre) **UTF-8 without BOM** olmalıdır.
- 1 Her bildirim dosyası başlığında bulunan senderReference bilgisi gönderen üye bazında tek olmalıdır.
- 1 ZIP dosyalarının formatı **Standart Windows Zip** olmalıdır. (Windows'da context menüde gelen zip özelliği)
- 1 Eğer yukarıdaki maddelerden bir veya bir kaçında sorun oluşursa, ZIP dosyası tümüyle ret edilir.
- 1 Yükleme sırasında görüntülenen durum çubuğu dosyalarda bulunan bildirimlerin sisteme aktarılmasını ifade etmektedir.
- 1 Dosya adında Türkçe karakter kullanılmamalıdır.
- 1 Yükleme işlemi tamamlanmadan yeni dosya yüklenmemelidir
- 1 Üye bazında yüklenen her bildirim dosyası, daha önce bildirilen tüm raporların silinmesine sebep olacaktır.

Yeni zip dosyası yükle

Sözleşmenizin yanında yer alan yeşil tik başarıyla iletildiğini, kırmızı tik kural hatası aldığını, kırmızı çarpı işareti ise doğru xml formatında girilmediğini göstermektedir. Kırmızı tik alındığında bildirim izleme ekranından hata açıklaması kontrol edilip bildirim yeniden yüklenmelidir. Kırmızı çarpı alındığında xml şeması kontrol edilip bildirim yeniden yüklenmelidir.

Yükleme Durumu	İşlem Bilgisi
Servis hatası	Zip içeriğindeki XML dosyalarının tümünün aktarımı sırasında sorunlar oluştu.
	 [VEDO79] - t1dosyasiSema.xml XML Schema Validation policy failed! Error is: (XML validation error: XML validation error in node 'otherCounterpartyId' (path: /SaveReport/Report/OtherCounterpartyInfo/otherCounterpartyId): string value 'fuekan' does not match pattern for IdentityCodeType in namespace http://ws.mkk.com.tr/schemas/types) (ERR-081)
Dosya yükleme tamamlandı	 [VEDOTEST78] - t1dosyasi.xml
Dosya yükleme tamamlandı	 [VED2077] - t1dosyasi.xml

DİĞER BİLGİLER	
Sistem Mesaj No	1d8cbeb2-fb58-47d3-be59-8b2772f2ac96
Kullanıcı	773F1F3402BA00F6E0530A4AC925B712
Kanal	FU
Giriş Tarihi	12.11.2025 09:50:16
Eylem Tipi	Değerleme Bildirimi
Durum	Hata Aldı
Hata Açıklaması	Seçilen tarih bugün veya 1 iş günü öncesi olabilir.
Raporlama Zaman Damgası	12.11.2025 09:50:16
Eşleşme Durumu	
Eşleşme bildirim tarihi geçmiştir	Evet
İki taraf adına da bildirim	Hayır

En sık alınan kural hataları ve çözümleri aşağıdaki gibidir:

HATA MESAJI	HATA NEDENİ	ÇÖZÜM / DOĞRUSU
-------------	-------------	-----------------

Seçilen tarih bugün veya 1 iş günü öncesi olabilir.	Tarih kilit açma işlemi yapıldıktan sonra raporlama gönderilmeye çalışılmıştır.	Tarih kilit açma talebi iletilmeli, talep onaylandıktan sonra raporlama yapılmalıdır.
Sözleşme Bulunamadı	Sözleşmenin ana kaydı (Yeni Bildirim) sistemde başarıyla oluşturulmadan, doğrudan Değerleme (Valuation) bildirimi gönderilmiştir.	Önce sözleşmenin yeni bildirimi başarıyla gönderilmeli sonrasında değerlendirme bildirimi iletilmelidir.
İlgili sözleşme için eksik değerlendirme bildirimleri tamamlanmadan sonlandırma bildirimi yapılamaz	Sözleşmenin açık kaldığı süre boyunca yapılması gereken periyodik değerlendirme bildirimlerinde eksiklik bulunmaktadır.	Geçmişe dönük eksik tarihli değerleme bildirimlerinin hangi gün olduğu sorgulama ekranında öğrenildikten sonra eksik günler tamamlanmalı, ardından sonlandırma bildirimi gönderilmelidir.
Eşli girilmemiş sözleşmeler sonlandırılmaz	Karşı taraf sözleşmeyi raporlamamış olabilir veya taraflar farklı Trade ID kullandığı için eşleşme sağlanamamıştır. Sözleşme NF statüsünde kalmıştır.	Karşı taraf ile mutabakat sağlanmalıdır. Hatalı Trade ID kullanan taraf kaydı silip doğru ID ile yeniden raporlamalı, sistemde "Eşleşti" statüsü oluştuktan sonra değerlendirme bildirimlerini tamamlayıp sonlandırma yapılmalıdır.
Valör Tarihi Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih'ten önce olamaz.	effectiveDate(Valör),executionDate'den (İşlem Tarihi) daha eski bir tarih olarak girilmiştir.	Valör tarihi, işlem tarihine eşit veya işlem tarihinden daha ileri bir tarih olarak düzeltilmelidir.
Vade Tarihi Valör Tarihi'nden önce olamaz.	maturityDate(Vade),effectiveDate'den (Valör) daha eski bir tarih olarak girilmiştir.	Vade tarihi, valör tarihine eşit veya valör tarihinden sonraki bir tarih olmalıdır.
Vade tarihi, sözleşmenin sonlandırma tarihinden önce olamaz.	terminationDate(Sonlandırma),maturityDate'den (Vade) sonraki bir tarih olarak girilmiştir.	Erken sonlandırma tarihi, sözleşmenin vade tarihinden önce veya vade tarihine eşit olmalıdır.
Erken sonlandırma tarihi, sözleşmenin gerçekleştirildiği tarihten önce olamaz.	terminationDate(Sonlandırma tarihi),executionDate'den (İşlem Tarihi) önce girilmiştir.	Erken sonlandırma tarihi, işlem tarihinden sonraki bir tarih olmalıdır.

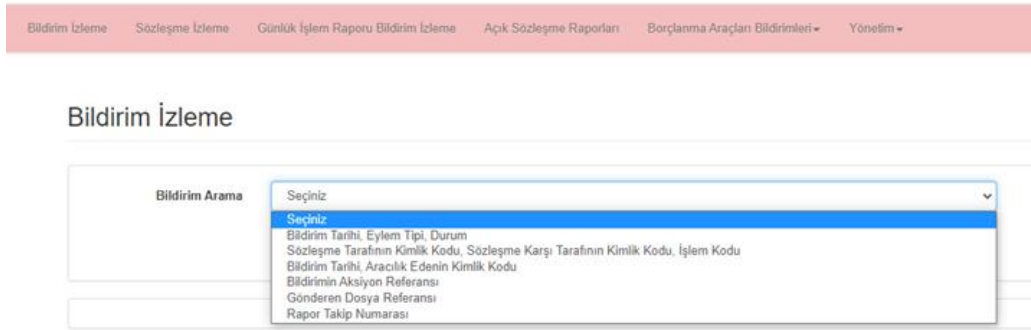
Seçilen tarih bugün veya 2 iş günü öncesi olabilir.	Sonlandırma bildirimi (T+2) geçtikten sonra yapılmıştır.	Sonlandırma bildirimi, işlemin gerçekleştiği günü takip eden en geç 2 iş günü içinde yapılmalıdır.
Raporlamanın gerçekleştirildiği tarih, sözl eşmenin gerçekleştirildiği tarihten önce olamaz	Raporlamanın yapıldığı tarih, sözleşme işlem tarihinden daha eski girilmiştir.	Raporlama tarihi, işlem tarihi ne eşit veya daha ileri bir tarih olmalıdır.
"İşlem Alt Türünün Çapraz Para Swabı" veya "Varlık Sınıfının Para Birimi" olması durumunda bu alana değer girmek zorunludur [forwardExchangeRate]	İşlem türü "Çapraz Para Swabı" veya varlık sınıfı "Para Birimi" olmasına rağmen kur bilgisi girilmemiştir.	forwardExchangeRate alanına ilgili vadeli kur bilgisi girilmelidir.
Varlık Sınıfının Para Birimi olması durumunda "Döviz Kuru 1", "Para Birimi 1" ve "Para Birimi 2" alanlarının doldurulması zorunludur, [exchangeRate1] [exchangeRateBasis1] [exchangeRateBasis2]	Varlık sınıfı "Para Birimi" seçilmiş ancak kur ve para birimi detayları eksik bırakılmıştır.	exchangeRate1, exchangeRateBasis1 ve exchangeRateBasis2 alanları eksiksiz doldurulmalıdır.
Girdiğiniz Bilgilere Sahip Sözleşme Bulunmaktadır.	Sistemde halihazırda kayıtlı olan bir sözleşme (aynı tradeID ile) tekrar yeni kayıt gibi gönderilmiştir.	İşlem kodu kontrol edilip farklı tradeID ile tekrardan raporlanmalıdır.
Bu alan zorunludur [otherCorporateSector]	Taraf türü Finansal (F) veya Finansal Olmayan (N) girilmesine rağmen sektör kodu boş bırakılmıştır.	otherCorporateSector alanına tarafın faaliyet gösterdiği uygun sektör kodu girilmelidir.
Tarafların nihai faydalanıcılarının nominal değer toplamı, sözleşmenin nominal değerine eşit olmalıdır.	Sözleşmenin toplam nominal tutarı ile faydalanıcıların (beneficiary) payları toplamı birbirini tutmamaktadır.	Girilen tüm beneficiaryNotional değerlerinin toplamı, notional değerine eşitlenmelidir.
İlgili alana yalnızca pozitif değer girilebilir. [exchangeRate1]	Kur alanına 0 veya negatif bir sayısal değer girilmiştir.	exchangeRate1 alanına 0'dan büyük, pozitif bir sayı girilmelidir.

5.2. T+1 ve T+0 Bildirim İzleme Ekranları

Dosya yüklemeleri gerçekleştirildikten sonra; Bildirim İzleme ekranlarından, aktarılmış olan bildirimlerin statüleri kontrol edilmelidir. Sisteme aktarılan bildirimlerin durumlarının mutlaka “onaylandı” statüsünde olup olmadığı ve bir hata mesajı alınıp alınmadığının üyelerimiz tarafından T+1 için “Bildirim İzleme” ekranından, T+0 için "Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme" ekranında kontrol edilmesi gerekmektedir.

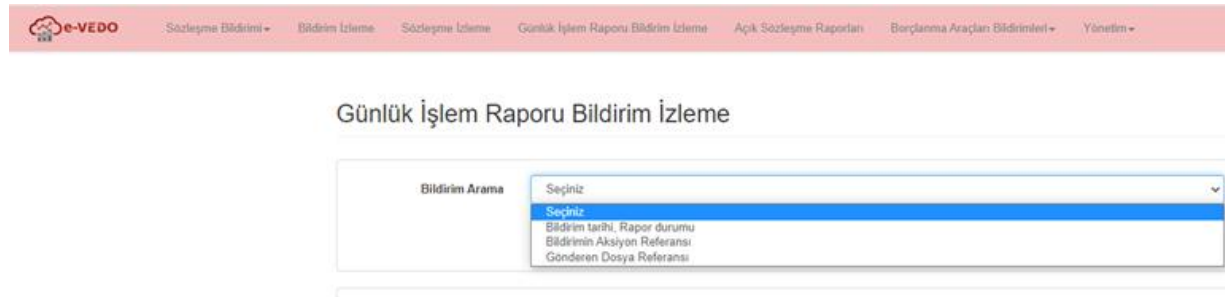
Bildirim İzleme Ekranı, aşağıdaki ekran görüntüsünde yer alan Bildirim Arama kriterleri ile sözleşmelerin sorgulandığı ve sorgu sonucunun Excel formatında alınabildiği ekranlardır. Ayrıca; Sözleşme Sonlandırma, Sözleşme Silme, Sözleşme Güncelleme ekranlarından manual olarak yapılan bildirimlerin Onay işlemleri Bildirim İzleme ekranından yapılmaktadır.

5.2.1. T+1 Bildirim İzleme Ekranı



The screenshot shows the T+1 Bildirim İzleme Ekranı. At the top, there is a navigation bar with the following items: Bildirim İzleme, Sözleşme İzleme, Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme, Açık Sözleşme Raporları, Borçlanma Araçları Bildirimleri, and Yönetim. Below the navigation bar, the title "Bildirim İzleme" is displayed. The main area contains a "Bildirim Arama" section with a dropdown menu labeled "Seçiniz". The dropdown menu is open, showing the following options: Seçiniz, Bildirim Tarihi, Eylem Tipi, Durum, Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu, Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu, İşlem Kodu, Bildirim Tarihi, Aracılık Edenin Kimlik Kodu, Bildirim Aksiyon Referansı, Gonderen Dosya Referansı, and Rapor Takip Numarası.

5.2.2. T+0 Bildirim İzleme Ekranı



The screenshot shows the T+0 Bildirim İzleme Ekranı. At the top, there is a navigation bar with the following items: e-VEDO, Sözleşme Bildirimi, Bildirim İzleme, Sözleşme İzleme, Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme, Açık Sözleşme Raporları, Borçlanma Araçları Bildirimleri, and Yönetim. Below the navigation bar, the title "Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme" is displayed. The main area contains a "Bildirim Arama" section with a dropdown menu labeled "Seçiniz". The dropdown menu is open, showing the following options: Seçiniz, Bildirim tarihi, Rapor durumu, Bildirim Aksiyon Referansı, and Gonderen Dosya Referansı.

5.2.3. Sözleşme İzleme Ekranı (T+1 Bildirimleri)

“Onaylandı” statüsünde olan bildirimler Sözleşme izleme ekranından listelenebilir, güncel Eşleşme Statüsü görüntülenebilir ve "Excel" formatında indirilebilir. Sözleşmelerin Eşleşme Statüleri bu ekrandan kontrol edilmelidir.

Sözleşme İzleme

Bildirim Arama

Seçiniz

Seçiniz

Bildirim Tarihi, Eşleşme Durumu, Durum

Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu, Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu, İşlem Kodu

Bildirim Tarihi, Aracılık Edenin Kimlik Kodu

Bildirim Aksiyon Referansı

Gönderen Dosya Referansı

Rapor Takip Numarası

Bildirim Tarihi, Nihai Faydalanıcının Kimlik Kodu

Bildirim Tarihi, Unvan, Eşleşme Durumu, Durum

Değerleme Bildirimi Eksik Günler Sorgulama

Temizle

5.3. Açık Sözleşme Ekranları

Açık sözleşmelerin raporlandığı ekrandır. Açık sözleşme raporları excel formatındadır.

Raporlama şekli 4 sınıfa ayrılmaktadır:

- Tüm Sözleşmeler
- Detaylı Sorgu
- Açık-Kapalı Sözleşmeler
- Vade Tarihi Gelmiş Olmasına Rağmen Sonlandırılmamış Sözleşmeler

Ekran, açık sözleşmelere ait tüm kayıtların ve detaylı sorgulamaların yapıldığı, excele aktarıldığı ekrandır. Detaylı sorgulamada aşağıdaki tüm alanlar zorunludur:

- Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu
- Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu
- Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarihi

- Vade Tarihi
- Sözleşme Türü
- Varlık Sınıfı

Açık Sözleşme Raporları

Raporlanacak Tarih	YYYY.MM.DD	x
Raporlama Şekli	Seçiniz Tüm Sözleşmeler Detaylı Sorgu Açık Kapalı Sözleşmeler Vade Tarihi Gelmiş Olmasına Rağmen Sonlandırılmamış Sözleşmeler	Temizle

Açık Sözleşme Raporları

Raporlama Şekli	Açık Kapalı Sözleşmeler	Temizle	
Sözleşme Türü	Seçiniz	Varlık Sınıfı	Seçiniz
Sözleşme Durumu	Seçiniz	Eşleşme Statüsü	Seçiniz
Sözleşmenin Karşı Tarafının Kimlik Kodunun Türü	Seçiniz	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu
İşlem Kodu	İşlem Kodu	Nihai Faydalanıcı Türü	Seçiniz
Sözleşmenin Vade Tarihi Durumu	Seçiniz		
Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihi Başlangıç Noktası	YYYY.MM.DD	Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihi Bitiş Noktası	YYYY.MM.DD
Gözet			
*Sözleşmenin gerçekleştirme tarihi, başlangıç noktası ve bitiş noktası (ilgili tarihler dahil olacak şekilde) aralığında olan sözleşmeler sorgu sonucunda gösterilecektir.			

Ekran vasıtasıyla sözleşmenizin durumunu görüntüleyebilir, eşleşmeyen sözleşmelerinizin detaylarını 180 güne kadar görüntüleyebilirsiniz.

Sözleşme İzleme

Bildirim Arama	Değerleme Bildirimi Eksik Günler Sorgulama				
		Temizle			
Sözleşme Taraflarının Kimlik Kodu	Sözleşme Taraflarının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Taraflarının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Taraflarının Kimlik Kodu	İşlem Kodu	İşlem Kodu
					Sorgula

Değerleme Bildirimi Eksik Günler Sorgulama ekranından excel formatında hangi günlere ait değerlemelerin eksik olduklarını görebilir, eksik değerlemeleri tamamladıktan sonra sonlandırma bildirimlerinizi gerçekleştirebilirsiniz.

5.4. Borçlanma Araçları Ekranları

5.4.1. Borçlanma Araçları Dosya Yükleme Ekranı

İlgili ekran Borçlanma Araçları Raporlaması yükümlüsü olan kurumlara tanımlanmaktadır.

Borçlanma Araçları Raporlaması için; MKK internet sitesinde Veri Depolama ve Raporlama Hizmetleri altında "e-VEDO / Borçlanma Araçları Raporlaması" sekmesi altında yer alan "Raporlama Alanları" isimli dosya formatlarına uygun olarak hazırlanan ".CSV" ya da ".txt" dosyası, e-VEDO Platformu üzerinde yer alan "Borçlanma Araçları Raporlaması" sekmesinin altında yer alan "Dosya Yükleme" ekranından yüklenmektedir.

Yükleme sonucunda aynı ekrandan "Mesaj ID" veya "Bildirim Tarihi Başlangıcı ve Bildirim Tarihi Bitişi" kriterlerinden bildirimin statüsü kontrol edilmelidir. Daha detaylı sorgu için "Borçlanma Araçları Bildirimleri" sekmesinin altında yer alan "Bildirim İzleme" ekranı kullanılmalıdır.

Dosya Yükleme

Bildirim İzleme

Borçlanma Araçları Bildirim Yükle

Borçlanma Araçları Bildirim Yükleme Kuralları

- ❶ Toplu bildirim yükleme alanından yalnızca **CSV** formatında dosyalar sisteme aktarılır.
- ❷ CSV dosyaları sadece **CSV** formatında bildirimleri barındıran dosyalar içerebilir. (İlgili format MKK tarafından daha önce duyurulmuştur)
- ❸ Bir bildirim dosyası (CSV) **en fazla 5000** adet aynı tipine ait bildirim içerebilir. Bir csv dosyasında birden fazla dosya bulunabilir.
- ❹ Csv içerisindeki bildirim dosyalarının isimlendirmeleri sisteme aktarım sürecinde önem arz etmektedir: Dosyaların işlenmesi, alfabetik sırada gerçekleşmektedir.
- ❺ CSV dosya karakter kodlaması (unicode standartlarına göre) **UTF-8 without BOM** olmalıdır.
- ❻ Eğer yukarıdaki maddelerden bir veya bir kaçında sorun oluşursa, **CSV** dosyası tümüyle ret edilir.
- ❼ Dosya adında Türkçe karakter kullanılmamalıdır.

- ❶ CSV dosyaları sisteme **ZIP** içerisinde aktarılabilir.
- ❷ ZIP dosyalarının formatı Standart Windows Zip olmalıdır. (Windows'da context menüde gelen zip özelliği)
- ❸ Yüklenen ZIP içerisindeki dosyalar için bir adet mesajID üretilir.

Borçlanma Araçları Türü

Seçiniz

Yeni csv dosyası yükle

Bildirim Tarihi Başlangıcı

YYYY.MM.DD

Bildirim Tarihi Bitişi

YYYY.MM.DD

Mesaj ID

Mesaj ID

Sorgula

Temizle

5.4.2. Borçlanma Araçları Bildirim İzleme Ekranı

Borçlanma Araçları Bildirim İzleme ekranında yer alan alanlardan, sadece statüsü “Başarılı” olan bildirimler özelinde sorgulama yapılabilir. Borçlanma Araçları Bildirim İzleme ekranında yer alan alanlardan yalnızca “Raporlama Tarihi” alanı zorunludur (Not: Mevcut durumda, tarih kilit kontrolleri ve geçmişe dönük raporlama söz konusu olmadığı için Raporlama Tarihi ve İşlem Tarihi bilgisini aynı olmaktadır).

Daha detaylı bildirim sorgulama için; “İşlem Tarihi”, “Menkul Kıymet İhraç Tür Kodu” ve “İşlem Amacı” alanlarından istenilen kırımlarda sorgulama yapılabilir.

53

Borçlanma Araçları Bildirim İzleme

Raporlama Tarihi Başlangıcı	YYYY.MM.DD	Raporlama Tarihi Bitişi	YYYY.MM.DD
İşlem Tarihi Başlangıcı	YYYY.MM.DD	İşlem Tarihi Bitişi	YYYY.MM.DD
Menkul Kıymet İhraç Tür Kodu	Seçiniz	İşlem Amacı	Seçiniz
		Sorgula Temizle	

5.5. Tarih Kilit Kontrolleri Ekranı

e-VEDO Prod uygulamasına giriş yapacak üye bu ekran üzerinde bulunan “Yönetim” sekmesi altındaki “Tarih Kilit Kontrolleri Açma” menüsünden kilit açma bölümüne yönlendirilir.

e-VEDO Sözleşme Bildirimi - Bildirim İzleme - Sözleşme İzleme - Açık Sözleşme Raporları - Borçlanma Araçları Bildirimleri - Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme - Yönetim - MKK PROTESTİ

Tarih Kilit Kontrolü

Tarih Kilit Kontrolü

Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat: ☐

Sonlandırma Tarihi Kontrolünü Kapat: ☐

Değerleme Tarihi Kontrolünü Kapat: ☐

Geçmiş Bildirim Tarih Kontrollerini Kapat: ☐

Günlük Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat: ☐

Tarih Kilit Kontrolünü Kapatma Gerekçesi:

Kullanıcı Tanımlama
Kullanıcı Onay
Kullanıcı Yetkilendirme
Kullanıcı Yetkilendirme Onay
Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme
İletişim Adresi Tanımlama
Sözleşme Taraf Bilgileri Onay
İletişim Adresi Onay
Tarih Kilit Kontrolü Açma
Ücretlendirme Kontrol Ekranı

5.5.1. T+1 Tarih Kilit Kontrolleri

Üye sonrasında aktarımını yapacağı aksiyon tipine göre ilgili tarih kilit kontrol seçeneklerinin kutularını işaretler ve daha sonrasında “Tarih Kilit Kontrolünü Kapatma Gerekçesi” bölümüne anlamlı bir gerekçe yazarak MKK onayına gönderir. MKK tarafından onay mailinin gelmesinin ardından geçmişe yönelik bildirimler gerçekleştirilebilir.

Tarih Kilit Kontrolü

Tarih Kilit Kontrolü

Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☒

Sonlandırma Tarihi Kontrolünü Kapat:

☒

Değerleme Tarihi Kontrolünü Kapat:

☒

Geçmiş Bildirim Tarih Kontrollerini Kapat:

☐

Günlük Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Tarih Kilit Kontrolünü Kapatma Gerekçesi:

Geçmişe Yönelik İşlem Yapma

Kaydet

5.5.2. T+0 Tarih Kilit Kontrolleri

Tarih Kilit Kontrolü

Tarih Kilit Kontrolü

Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Sonlandırma Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Değerleme Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Geçmiş Bildirim Tarih Kontrollerini Kapat:

☐

Günlük Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☒

Tarih Kilit Kontrolünü Kapatma Gerekçesi:

Geçmişe Yönelik İşlem Yapma

Kaydet

5.5.3. Geçmiş Bildirim Tarih Kilit Kontrolleri

30.11.2018 tarihi itibarıyla açık olan işlem/pozisyonlar ile 01.01.2018 tarihinden sonra akdedilmiş ve 30.11.2018 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmeler/pozisyonların bildirilmesinde ilgili seçenek üzerinden kilitler kaldırılır.

Tarih Kilit Kontrolü

Tarih Kilit Kontrolü

Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Sonlandırma Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Değerleme Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Geçmiş Bildirim Tarih Kontrollerini Kapat:

☒

Günlük Raporlama Tarihi Kontrolünü Kapat:

☐

Tarih Kilit Kontrolünü Kapatma Gerekçesi:

Geçmişe Yönelik İşlem Yapma

Kaydet

5.6. Yönetim Ekranı Menüleri:

Yönetim ▾

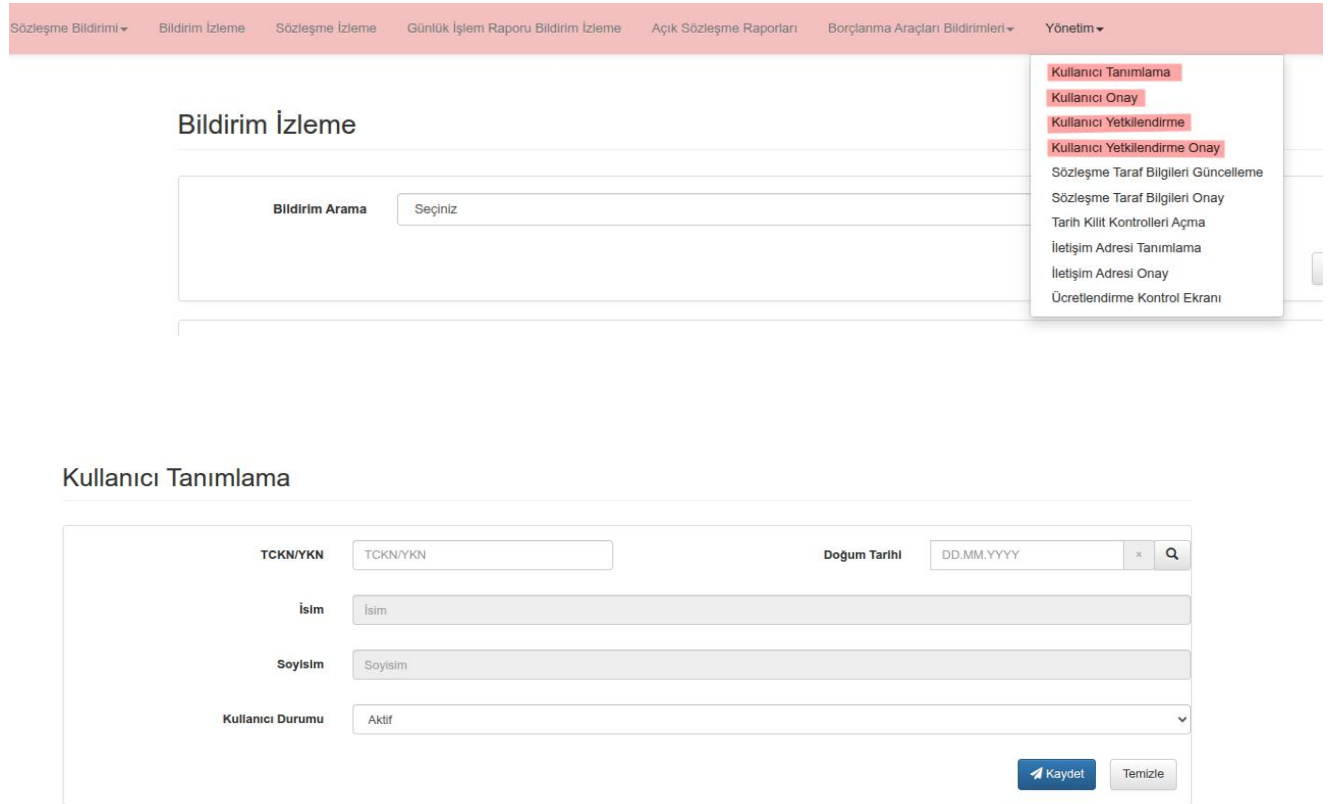
- Kullanıcı Tanımlama
- Kullanıcı Onay
- Kullanıcı Yetkilendirme
- Kullanıcı Yetkilendirme Onay
- Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme
- Sözleşme Taraf Bilgileri Onay
- Tarih Kilit Kontrolleri Açma
- İletişim Adresi Tanımlama
- İletişim Adresi Onay
- Ücretlendirme Kontrol Ekranı

5.6.1. Kullanıcı Tanımlama:

İlgili ekran ile Şirket Ana Temsilcisi ya da Şirket Ana Temsilcisinin “Kullanıcı Yetkilendirme” yetkisi tanımladığı kullanıcılar, aynı şirkette çalışan ve Platform’a giriş yapacak olan diğer

kullanıcıları TCKN/YKN ile tanımlayabilirler. Yönetim sekmesi altında “Kullanıcı Tanımlama Ekranı” ’na gerekli bilgiler girildikten sonra “Kaydet” butonuna basılmalı ve ardından diğer bir ekran olan “Kullanıcı Onay Ekranı” ile bu talebi onaylamalıdır.

Bununla birlikte şirketten ayrılma/ birim değiştirme vb. gibi sebepler ile Platform’a ilgili şirket için giriş yetkisi kaldırılmak istenen kullanıcılar için yine bu ekran üzerinden “Kullanıcı Durumu” Aktif durumdan İptal veya Askı durumuna çekilebilecektir.



5.6.2. Kullanıcı Yetkilendirme:

İlgili menü vasıtası ile şirket içerisinde farklı yetkiler talep edilmesi durumunda kullanıcı bazında bu yetkilendirmeler gerçekleştirilebilecektir. İlgili yetkilendirme işlemini “Şirket Ana Temsilcisi” ve kendisine “Kullanıcı Yetkilendirme” yetkisi tanımlanmış olan kullanıcılar gerçekleştirebilir. Yetkilendirme talep edilecek kişi daha öncesinde tanımlanmış kullanıcı olması gerekmektedir.

Bu kişi seçildikten sonra ekranın aşağısından ilgili roller eklenebilir veya öncesinde verilmiş yetkiler silinebilir.

İşlem yapıldıktan sonra “Kaydet” butonuna basılmalıdır. Daha sonrasında yine “Yönetim” sekmesi altında yer alan “Kullanıcı Yetkilendirme Onay” menüsünden bu talepler onaylanmalıdır.

Kullanıcı Yetkilendirme ekranının devamında kullanıcı TCKN/YKN, İsim Soyisim ve Kullanıcı Durumu bilgileri gözükmemekte ve kullanıcıya aşağıdaki gibi yetkiler eklenebilmekte veya silinebilmektedir;

5.6.3. Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme:

e-VEDO platformuna yapılan bildirimlerde sözleşmelerin tekilliği taraf kimlik kodu (counterpartyId), karşı taraf kimlik kodu (otherCounterpartyId) ve işlem kodu (tradeId) alanları üzerinden sağlanmaktadır. İlgili ekran vasıtası ile sözleşmenin taraf kimlik kodunda bir değişiklik meydana geldiğinde güncelleme imkânı sağlanmaktadır (Örneğin VKN ile bildirilen bir kurumun

LEI kodu edinmesi durumunda). Bunun için “Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu” ve “Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu” bilgileri girilerek “Güncellenecek Kayıtları Dosyada Gör” butonuna tıklanır.

Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme

Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu
Güncellenecek Kayıtları Dosyada Gör			
Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodu	Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodu	Sözleşmenin Karşı Tarafının Yeni Kimlik Kodunun Türü	Seçiniz
Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Ünvanı	Sözleşme Karşı Tarafının Yeni Ünvanı		
☐ İlgili veritabanı güncellemesi talebine ait Excel çıktısını gördüm, onayladım.			
Güncellemek İçin Onaya Gönder			Temizle

İlgili bilgiler girildikten sonra ve “Güncellenecek Kayıtları Dosyada Gör” seçeneği tıklandıktan sonra ekrana sırasıyla bilgilendirme yazısı ve sonrasında “Sözleşmeler” seçeneği gelir. Sözleşmeler ardından excel formatında kullanıcı tarafından indirilebilecektir.

Sözleşme Taraf

Sözleşme Tarafının Kimi
Sözleşme Karşı Tarafı Kimi
Sözleşme Karşı Tarafı

Excel içerisinde detayları yer alan ve onay vereceğiniz veritabanı güncelleme işlemi ilgili taraf ve karşı taraf arasında yapılan tüm sözleşmelerin karşı taraf (otherCounterpartyId) ve karşı taraf nihai faydalanıcısının (otherBeneficiaryId) düzeltme işlemlerini kapsamaktadır. Veritabanı güncellemesi tamamlanıncaya kadar sözleşmeler özelinde bildirim yapılmaması, veritabanı güncelleme işlemleri tamamlandıktan sonra ise gerçekleştirilen tüm bildirimlerin yeni kimlik kodu (veritabanı güncellemesinde iletilen) ile yapılması gerekmektedir. Veritabanı güncelleme talebi ilettiğiniz sözleşmeler özelinde, güncelleme işlemi tamamlanıncaya kadar bildirim yapmanız durumunda ise bu sözleşmeler için de kimlik kodu güncellemesi yapılacaktır olup, bu durum talep edilen ve güncelleme yapılan sözleşme sayılarında farklılığa yol açabilir. Bilgilerinizi rica ederiz.

Bilgilendirme metninden sonra yine ekranda aşağıdaki şekilde “Sözleşmeler” seçeneği belirecektir.

↓ Sözleşmeler

İletilen excel’deki veriler kontrol edildikten sonra yine “Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme” ekranında yer alan bölümden talep edilecek yeni kimlik kodu bilgisi girilerek onaya gönderilir.

Sözleşme Taraf Bilgileri Onay Ekranı:

“Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme” ekranı ile güncelleme talep edilen sözleşmeler ile ilgili taleplerin kontrolleri sağlanmalıdır.

e-VEDO - Elektronik Veri Depolama Sistemi

e-VEDO Sözleşme Bildirimi • Bildirim İzleme Sözleşme İzleme Açık Sözleşme Raporları Borçlanma Araçları Bildirimleri • Günlük İşlem Raporu Bildirim İzleme Yönetim •

Karşı Taraf Kimlik Bilgileri Güncelleme Onay/İzleme Ekranı

Üye Ünvanı	Taraf Kimlik Kodu	Karşı Taraf Kimlik Kodu	K. Taraf Yeni Kimlik Türü	K. Taraf Yeni Kimlik Kodu

Kullanıcı Tanımlama
Kullanıcı Onay
Kullanıcı Yetkilendirme
Kullanıcı Yetkilendirme Onay
Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme
İletişim Adresi Tanımlama
Sözleşme Taraf Bilgileri Onay

5.6.4. İletişim Adresi Tanımlama:

Üye kullanıcı ilgili ekran vasıtası ile e-VEDO raporlamalarında alacağı mailler için grup mail adresi ve iletişim yetkili bilgisi tanımlayabilir. Bilgiler girildikten sonra ekrandaki “Güncelle” butonundan bilgileri onaya gönderir.

İletişim Adresi Onay:

Üye kullanıcı tanımlamasını gerçekleştirdiği bilgileri ilgili ekran vasıtasıyla onaylayabilecektir.

5.6.5. Ücretlendirme Kontrol Ekranı

Üyeler ilgili ekran vasıtası ile e-VEDO Platformu için taraflarına yansıyan fatura bilgilerini, farklı rapor kırılımlarında (T+1, T+0 ve Borçlanma Araçları Raporlaması) görebilmektedirler.

Ücretlendirme Kontrol Ekranı

Dönem

Seçiniz

Fatura Kırılımı

Seçiniz

Sorgula

6. Otomatik Giden Mailler ve Açıklamaları

6.1. Kontrat Tipi Bazında Son 7 Günlük İşlem Sayıları Raporu

Rapor içeriği:

Raporlama yapan kurumun; e-VEDO Platformu'na iletmış olduğu son 7 iş günündeki işlem sayılarını, kontrat tipi dağılımında Excel formatında göstermektedir. Sözleşmelerin daha detaylı haline “Açık Sözleşme Raporları” ekranından ulaşılmalıdır.

6.2. Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu

“Veri Depolama Kuruluşuna Yapılacak Raporlamalara İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ (IV-87.1)”, “İşlem Kodu Kullanımı” adlı Madde 15 uyarınca raporlamaların her sözleşme için taraflarca mutabık kalınan özgün bir işlem kodu ile raporlanması gerekmektedir.

Rapor içeriği:

Rapor; Ön Eşleşme sağlanan (Taraflar Kimlik Kodu, Karşı Taraflar Kimlik Kodu ve İşlem Kodu bilgilerinin iki kurum için de aynı girilmesi) ancak eşleşmeye tabi alanlardaki bilgilerin uyumsuzluğu sebebi ile “Eşleşmedi” statüsünde kalan sözleşmeleri kapsamaktadır. Sözleşmelerin daha detaylı haline “Açık Sözleşme Raporları” ekranından ulaşılmalıdır.

Alınması gereken aksiyon;

Üyelerimizin raporlama yükümlülükleri çerçevesinde; aynı işleme ilişkin kurumların karşılıklı raporlamalarındaki uyumsuzluğun giderilmesi, işlem tekiliğinin sağlanabilmesi ve işlemlere ilişkin "eşleşti" statüsünün oluşabilmesi için ilgili alanlardaki farklılıkların giderilmesi gerekmektedir. Sözleşmelerin eşleşme statülerinin kontrolü, takibi ve gerekiyorsa aksiyonlar alma sorumluluğu üyelerimizde bulunmaktadır.

6.3. Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu

Rapor içeriği;

Kurumun e-VEDO Platformu'na yapmış olduğu bildirimleri çerçevesinde; "Taraf" olarak yer aldığı, Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih (executionDate) alanı üzerinden son 7 iş günü (T-7) içerisinde yer alan ve ön eşleşme sağlanamayan sözleşmeler bulunduğunda, ilgili sözleşmeye ilişkin detayları gösteren Excel raporu üyelerimize otomatik olarak iletilmektedir. Sözleşmelerin daha detaylı haline "Açık Sözleşme Raporları" ekranından ulaşılmalıdır.

Ön Eşleşme sağlanabilmesi için; "Taraf Kimlik Kodu, Karşı Taraf Kimlik Kodu ve İşlem Kodu" bilgilerinin iki kurum tarafından da aynı bilgilerle raporlanması gerekmektedir. Eğer bu üçlü alan için iki tarafın raporladığı sözleşmelerde farklılık var ise veya bir tarafın raporlaması eksik olduğunda; sözleşmeler "Eşi Girilmedi" statüsünde kalacaktır.

Alınması gereken aksiyon;

"Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu" kurumlara iletildiği zaman; kurumların bu sözleşmeler için aksiyon almaları ve sözleşme statüsünü düzeltmeleri gerekmektedir.

6.4. Tüm İşlemleri İçeren Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu

Rapor içeriği;

Kurumun e-VEDO Platformu'na yapmış olduğu bildirimleri çerçevesinde; "Taraf" olarak yer aldığı, Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih (executionDate) alanı üzerinden üye tarafından

Platform’a aktarılan tüm bildirimleri kapsayacak şekilde ve ön eşleşme sağlanamayan sözleşmeler bulunduğunda, ilgili sözleşmelere ilişkin sözleşme türü ve varlık sınıfı kırılımında detayları gösteren Excel raporu üyelerimize otomatik olarak iletilmektedir. Raporda yansıyan tüm sözleşmelerin daha detaylı haline “Açık Sözleşme Raporları” ekranından ulaşılmalıdır.

Ön Eşleşme sağlanabilmesi için; “Taraf Kimlik Kodu, Karşı Taraf Kimlik Kodu ve İşlem Kodu” bilgilerinin iki kurum tarafından da aynı bilgilerle raporlanması gerekmektedir. Eğer bu üçlü alan için iki tarafın raporladığı sözleşmelerde farklılık var ise veya bir tarafın raporlaması eksik olduğunda; sözleşmeler “Eşi Girilmedi” statüsünde kalacaktır.

Alınması gereken aksiyon;

“Tüm İşlemleri İçeren Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu” kurumlara iletildiği zaman; kurumların bu sözleşmeler için aksiyon almaları ve sözleşme statüsünü düzeltmeleri gerekmektedir.

6.5. Karşı Taraf Kimlik Kodu LEI Dışında Bildirilen Sözleşmeler Raporu

“Veri Depolama Kuruluşuna Yapılacak Raporlamalara İlişkin Esaslar Hakkında Tebliğ (IV-87.1)”, “Kimlik Kodu Kullanma Zorunluluğu” adlı Madde 13 uyarınca e-VEDO Platformu’na yapılan raporlamalarda LEI kodu kullanımı zorunludur. Sözleşme bildirimlerinde LEI kodu bilgisi bulunan karşı taraflar için kimlik kodu türünü LEI kullanmanız gerekmektedir.

LEI kodu bulunmayan ve türev sözleşme akdeden kurumların da, yukarıda atfedilen Tebliğ kaynak gösterilerek; LEI kodu edinmeye teşvik edilmelidir.

Rapor içeriği;

Kurumun e-VEDO Platformu’na yaptığı bildirimler çerçevesinde; Karşı Taraf Kimlik Kodu (otherCounterpartyID) alanı “LEI” kodu ile bildirilmeyen sözleşmeler üyelere otomatik mail ile Excel formatında ilgili sözleşmelerin bilgilerini içerecek şekilde iletilmektedir.

Alınması gereken aksiyon;

Kendisine ilgili otomatik rapor iletilen kurumlar; ilgili sözleşmeleri incelemeli ve eğer karşı kurumun LEI kodu bulunuyorsa bu sözleşmede bildirilmiş olan Karşı Taraf Kimlik Kodu bilgisini uygulamada yer alan “Sözleşme Taraf Bilgileri Güncelleme” ekranından güncellemesi gerekmektedir. İlgili ekrandan karşı taraf kimlik kodları güncellendiği zaman; sistemde var olan (Açık – Kapalı) tüm sözleşmelerde ilgili güncelleme yapılmaktadır. Bunun dışında yer alan kimlik kodu güncellemeleri için evedo@mkk.com.tr adresi ile iletişime geçilmelidir.

6.6. T+0 Raporlamayan Üyeler Otomatik Mail Raporu

T+0 Günlük İşlem Raporlaması, raporlama yükümlülüğü bulunan Yatırım Kuruluşları ve Tüzel Kurumlar tarafından gerçekleştirilmektedir. İlgili raporlama kapsamında; işlem günü 18:00’a dek gerçekleştirilen sözleşmeler 18:00 saatine kadar, 18:00 saatinden sonra gerçekleştirilen sözleşmeler ise bir sonraki işlem günü (T+1) saat 10:00 saatine dek raporlanmaktadır.

Rapor içeriği;

Eğer bir kurum bu yükümlülüğü kapsamında bir önceki işlem günü T+0 raporlamasını Platform’a aktarmamış ise; bir sonraki iş günü saat 09:30’da ilgili rapor iletilmektedir. Tarafına ilgili rapor iletilen kurumların saat 10:00’a dek ilgili raporlamayı gerçekleştirmesi gerekmektedir.

Alınması gereken aksiyon;

İlgili rapor vade tarihinden önce raporlaması sonlandırılan bir sözleşme için bile tarafınıza ulaşmaktadır. Eğer ilgili sözleşmeler özelinde erken sonlandırma veya farklı bir durum mevcut ise evedo@mkk.com.tr adresine bilgilendirme yapılmalıdır. (T+0 raporlama yaşam döngüsü ile ilgili olarak; “T+0 Günlük İşlem Raporu Sıkça Sorulan Sorular” dokümanında örnekler bulunmaktadır.)

6.7. T+0 Raporlaması Bir Önceki Güne Ait Hatalı Bildirim Sayıları Raporu

Rapor içeriği;

İlgili otomatik rapor; ilgili kurumun T+0 Günlük İşlem Raporlaması kapsamında bir önceki iş günü bildirilen ancak statüsü “Hata Aldı” olan sözleşmelerin sayısını ve hata açıklamasını göstermektedir. İlgili raporda;

- Sözleşme bazında en son alınan hatayı içermektedir.Tarih kilit kontrolü ile değiştirilen kayıtlar kapsam dışıdır.
- T+0 raporlaması için bir gün öncesine ait olan bildirimler, T-1 iş gününe ait (Eligibility Date) olan son bildirimleri ifade etmektedir.

Alınması gereken aksiyon;

Hatalı olan bildirimlerin düzeltilmesi için ekran üzerinden tarih kilit kontrollerinin kaldırılması ve gerekli bildirimlerin tekrar yapılması gerekmektedir.

Not: İlgili rapor tarafınıza ulaştığında; T+0 raporlamasında bir gün önce almış olduğunuz hatayı düzeltilmiş iseniz; bu raporu dikkate almayınız.

6.8. Taraf - Karşı Taraf Ön Eşleşme Sağlanamayan Sözleşmeler Raporu

Rapor içeriği;

Kurum ile ilgili e-VEDO Platformu’na yapılan bildirimlerde; kurumun Taraf ve Karşı Tarafta yer aldığı sözleşmeler baz alınarak “Ön Eşleşme (Taraf Kimlik Kodu, Karşı Taraf Kimlik Kodu ve İşlem Kodu)” sağlanamayan sözleşmeleri "Kontrat Tipi, Varlık Sınıfı ve Sözleşmenin Gerçekleştirildiği Tarih" kırılımında göstermektedir.

Alınması gereken aksiyon;

İlgili otomatik mail kendilerine ulaşan kurumlar; sözleşmeleri kontrol etmeleri ve karşı taraf ile iletişime geçerek mutabakat sağlamaları gerekmektedir. Sözleşmelere taraf olan kişiler; bu sözleşmenin detaylarına “Açık Sözleşme Raporları” ekranından ulaşabilir.

6.9. “Maximum Fatura Tutarına Ulaşıldı” Bildirimi

04/01/2021 tarihinde yayımlanan “Elektronik Veri Deposu Sistemi (e-VEDO) Ücret Tarifesi Hk.” Konulu 908 numaralı Genel Mektup ile e-VEDO Platformu’na yapılan bildirimler üzerinden ücret alınmaya başlanmıştır. Bu doğrultuda senelik olarak tutarları belirlenen; bir üyenin sene içinde ödeyebileceği minimum ve maksimum tutarlar bulunmaktadır. Bu doğrultuda; sene içerisinde belirlenen maksimum tutara ulaşan üyelere sene sonuna dek fatura yansıtılmamaktadır.

Rapor içeriği;

İlgili rapor; mail şeklinde yukarıda bahsedilmiş olan maksimum tutara ulaşan üyelere iletilmekte olup; “T+1 Raporlaması”, “T+0 Günlük İşlem Raporu” ve “Borçlanma Araçları Raporlaması” çerçevesinde Platform’a iletilen bildirimleri kapsamaktadır.

Alınması gereken aksiyon;

Tarafına ilgili rapor iletilen üyeler, rapora yansımış olan hata almış olan bildirimlerin, son durumda “Onaylandı” statüsünde olduğunu teyit etmelidir. Eğer bildirimin “Onaylandı” statüsünde olmasına dair aksiyon alınmamış ise, rapor geldiği zaman ilgili aksiyon alınmalıdır.

6.10. “e-VEDO Platformu T+1 Raporlaması Bir Önceki Güne Ait Hatalı Bildirimler Hk.” Raporu

Rapor içeriği;

Kurumların e-VEDO Platformu’na yapılan bildirimleri çerçevesinde; bir önceki iş günü (T-1) almış oldukları hataları; tekilliği sağlayan kriterler, hata açıklamaları ve eylem tipi kırımlarında detayları gösteren Excel raporu günlük olarak üyelerimize iletilmektedir.

6.11. Açık Sözleşmeler Hata İzleme Raporu

Rapor içeriği;

Kurumların e-VEDO Platformu’na yapılan bildirimleri çerçevesinde; son 1 hafta içerisinde iş kuralları göz önünde bulundurularak almış oldukları hatalar, “Haftalık Yeni Bildirimler Hata İzleme Raporu” adlı Hata Açıklaması ve Sözleşme Adedi kırımını içeren excel formatındaki dosya ile üyelerimiz otomatik olarak iletilmektedir.

Alınması gereken aksiyon;

Üyelerimizin; ilgili hata açıklaması doğrultusunda hata alan bildirimlerini düzeltmeleri ve bildirimlerini “Onaylandı” statüsüne getirmeleri beklenmektedir.

7. TÜREV SÖZLEŞME RAPORLAMARINA İLİŞKİN ÖRNEK SORULAR VE CEVAPLAR

SORU 1: Emtiaya dayalı işlemleri e-VEDO Platformu’na raporlarken hangi hususlara dikkat etmeliyim?

CEVAP 1:

Emtiaya Dayalı Sözleşmeler için;

- Emtiaya dayalı Opsiyon sözleşmelerinde Opsiyon alıcısı (prim ödeyen) olması durumunda Alıcı (counterpartySide = “B”), Opsiyon satıcısı (prim alan) olması durumunda Satıcı (counterpartySide = “S”) olmalıdır. Ayrıca Emtiaya dayalı SWAP, FORWARD ve FUTURES işlemlerinde ise Alıcı/Satıcı olma durumu vade sonunda ilgili Emtianın alınıp satılmasına göre girilmelidir. Sözleşmeleriniz bu şekilde raporlanmıyorsa düzeltilmesi beklenmektedir.
- Emtiaya dayalı Opsiyon sözleşmelerinde Opsiyon tipi; para birimlerinden farklı olarak alfabetik olma durumuna göre değil; Emtianın opsiyon tipine göre girilmelidir.
- Emtiaya dayalı işlemlerin AssetClass (Varlık Sınıfı) alanı “CO” seçilmelidir. CommodityBase (Baz Emtia) ve CommodityDetails (Emtia Detayları) alanlarının da ilgili Emtiaya göre doldurulması gerekmektedir.
- CurrencyofOriginalNotional ve NotionalCurrency1, currencyofPrice gibi alanlarda; XAU, XAG, XPT gibi kodlar yer almamalıdır. e-VEDO Platformu’nda metaller, para birimi olarak geçmemektedir. Bu nedenle para birimi/kodlarını içeren alanlarda XPT, XAU, XAG, XPD gibi kodların yer almaması gerekmektedir.
- Örneğin; Metal Emtiasını raporlamasında; Varlık Sınıfı alanı (assetClass) “CO” olarak raporlanmalıdır. Baz Emtia(commodityBase) ve Emtia Detayları (commodityDetails)

alanlarının dolu olması gerekmektedir. Baz Emtia (commodityBase) alanı “ME” olarak, Emtia Detayları (commodityDetails) alanının da “PR” girilmesi gerekmektedir.

- Ayrıca Nominal (Notional) ve Sözleşmenin Gerçek Para tutarı (Original Notional) alanları birbirine eşit ve karşı para cinsinden sözleşme büyüklüğü tutarında olmalıdır.
- Emtiaya dayalı Opsiyon işlemlerinde;

$$\text{Quantity} * \text{StrikePrice} * \text{Price_Multiplier} = \text{NOTIONAL} / \text{ORIGINAL NOTIONAL}$$

eşitliği sağlanmalıdır.

- Emtiaya dayalı Swap, Forward ve Futures işlemlerinde

$$\text{Quantity} * \text{PriceRate} * \text{Price_Multiplier} = \text{NOTIONAL} / \text{ORIGINAL NOTIONAL}$$

eşitliği sağlanmalıdır.

SORU 2: Türev Sözleşmenin türünün Forward (FW), Futures (FU) ve Swap (SW) olması ve “Varlık Sınıfı”nın Para Birimi (CU) olması durumunda Platform’a nasıl raporlanacağı konusunda örnekler verebilir misiniz?

CEVAP 2:

NOT: Swap raporlamalarında sadece uzun bacak raporlanmalıdır.

Aşağıdaki örnekler yer almaktadır:

Örnek 1: Vade sonunda USD alıp TRY satıyorsunuz. Bu durumda TRY alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız (counterPartySide = S). Bu durumda;

- Para Birimi Çifti 1(exchangeRateBasis1) = TRY,
- Nominal Para Birimi 1(NotionalCurrency1) = TRY (Alfabetik olarak önce gelen),
- Para Birimi Çifti 2 (exchangeRateBasis2) USD (Alfabetik olarak sonra gelen),
- Sözleşme Tarafının Alıcı veya Satıcı Olma Durumu (counterPartySide) = S (Seller – Satıcı),
- Sözleşmenin Gerçek Para Tutarı (OriginalNotional) = TRY (vadede yükümlü olunan),
- Nominal (Notional) = TRY tutar (alfabetik olarak önce geldiği için)

Örnek 2: Vade sonunda USD satıp, TRY alıyorsunuz. Bu durumda TRY alfabetik olarak önce geldiği için alıcısınız (counterPartySide = B). Bu durumda;

- Para Birimi Çifti 1 (exchangeRateBasis1) = TRY,
- Nominal Para Birimi 1 (NotionalCurrency1) = TRY (alfabetik olarak önce gelen)
- Para Birimi Çifti 2 (exchangeRateBasis2) = USD (alfabetik olarak sonra gelen)
- Sözleşme tarafının Alıcı veya Satıcı olma durumu: (counterpartySide) = B (Buyer – alıcı)
- Sözleşmenin gerçek para tutarı (OriginalNotional) = USD tutar (vadede yükümlü olunan)
- Sözleşmenin gerçek para birimi (currencyofTheOriginalNotional) = USD (vadede yükümlü olunan)
- Nominal (Notional) = TRY tutar (alfabetik olarak önce gelen)

Örnek 3: Vade sonunda TRY satıp EUR alıyorsunuz. EUR alfabetik olarak önce geldiği için alıcısınız. Bu durumda;

- exchangeRateBasis1 = EUR, Nominal Para Birimi 1 (NotionalCurrency1) = EUR (alfabetik önce gelen)
- exchangeRateBasis2 = TRY (alfabetik olarak sonra gelen)
- counterpartySide = B (Buyer – alıcı)
- originalNotional = TRY tutar (vadede yükümlü olunan)
- currencyofTheOriginalNotional = TRY (vadede yükümlü olunan)
- Notional (Nominal) = EUR tutar (alfabetik olarak önce gelen)

Örnek 4: Vade sonunda EUR satıp, TRY alıyorsunuz. EUR alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız. Bu durumda;

- exchangeRateBasis1 = EUR, Nominal Para Birimi 1 (NotionalCurrency1) = EUR (alfabetik olarak önce gelen)
- exchangeRateBasis2 = TRY (alfabetik olarak sonra gelen)
- counterpartySide = S (Seller – satıcı)
- originalNotional = EUR tutar (vadede yükümlü olunan)
- Notional (Nominal) = EUR tutar (alfabetik olarak önce gelen)

SORU 3: Interest Rate Swap Türev Sözleşmelerinde Alıcı/Satıcı olma durumu nasıl belirlenmektedir?

CEVAP 3:

a) İki faizinde sabit olma durumu

- Büyük olan faizi ödüyorsanız “B(alıcısınız)”, küçük olan faizi ödüyorsanız “S(satıcısınız)”
- Her iki faizde aynı ise, kısa periyotlu olan faizi ödüyorsanız “B(alıcısınız)”, uzun periyotlu olanı ödüyorsanız “S(satıcısınız)”

b) İki faizinde değişken olma durumu

- Spreadi yüksek olan faizi ödüyorsanız “B(alıcısınız)”, küçük olan spreadi ödüyorsanız “S(satıcısınız)”

SORU 4: PriceMultiplier, PriceRate ve Quantity alanları arasında bir ilişki mevcut mudur? Mevcut ise farklı türev sözleşme örnekleri ile açıklayabilir misiniz?

CEVAP 4:

a) Para Birimine dayalı OP, SW, FW sözleşmelerinde

Price Multiplier dayanak(baz) döviz cinsinin tutarı kadar olmalıdır.

Quantity sözleşme adedir. OTC’de yapılan sözleşmelerde sözleşme adedi genelde “1” adet olmaktadır.

b) Para Birimine dayalı SW,FW ve FU sözleşmelerinde

$\text{Price/rate} * \text{PriceMultiplier} * \text{Quantity} =$ Sözleşme Büyüklüğü(karşı para cinsinden) ilgili eşitlik sağlanmalıdır.

c) Para Birimine dayalı Opsiyon Sözleşmelerinde

$\text{StrikePrice} * \text{PriceMultiplier} * \text{Quantity} =$ Sözleşme Büyüklüğü(karşı para cinsinden) ilgili eşitlik sağlanmalıdır.

Bu durumda USD/TRY işleminde baz döviz cinsi USD olmaktadır. EUR/GBP işleminde baz döviz cinsi EUR olmaktadır. USD/CHF işleminde baz döviz cinsi USD olmaktadır.

Örnek USD/TRY swap veya forward işlemi:

Price_Multiplier (Dayanak(baz) para birimi miktarı): 1.000.000 USD

Quantity (sözleşme sayısı): 1

Price_rate (fiyat/oran): 19,3376

Quantity*Price_Rate*Price_Multiplier = Sözleşme büyüklüğü (diğer para birimi cinsinden)

$$1*19,3376*1.000.000 = 19.337.600 \text{ TRY}$$

PriceMultiplier alım satım konu olan bir lot içerisinde yer alan finansal araçların sayısıdır, dayanak(baz) döviz cinsinin tutarı kadar olmalıdır. (<https://www.mkk.com.tr/tr-tr/Duyurular/Sayfalar/e-VEDO-Platformu-Para-Birimi-Opsiyonlari-Hk.aspx>)

- 100.000 USD tutarındaki bir işlemde kur 42,00 olarak belirlendiğinde; Price Multiplier değerine 100.000, Price Rate değerine 42,00 yazılır. Alfabetik sıralamada TRY (Türk Lirası), USD'den önce geldiği için notional 4.200.000 TL olarak raporlanmalıdır.
- 50.000 EUR tutarındaki bir işlemde kur 44,00 olarak belirlendiğinde; Price Multiplier değerine 50.000, Price Rate değerine 44,00 yazılır. Alfabetik sıralamada EUR (Euro), TRY'den önce geldiği için notional 50.000 EUR olarak raporlanmalıdır.
- 20.000 GBP tutarındaki bir işlemde kur 49,50 olarak belirlendiğinde; Price Multiplier değerine 20.000, Price Rate değerine 49,50 yazılır. Alfabetik sıralamada GBP (İngiliz Sterlini), TRY'den önce geldiği için notional 20.000 GBP olarak raporlanmalıdır.

d) Emtia veya Paya dayalı OP,SW,FW sözleşmelerinde

Price Multiplier alanı;

1. Emtiaya dayalı sözleşmelerde; emtia miktarı bilgisi olarak,
2. Paya dayalı sözleşmelerde; Pay miktarı olarak girilmelidir.

Örnek olarak; Emtia için işlem 50 varil petrol ise price multiplier alanında 50,

100 ons altın ise price multiplier alanında 100,

Equity(PAY) için işlem 200 X pay üzerine ise priceMultiplier alanında 200 olmalıdır.

SORU 5: Döviz kuru 1 (exchangeRate1) alanına hangi kur bilgisi girilmelidir?

CEVAP 5: İlgili alanın sözleşmedeki döviz kurunun anlaşma anındaki güncel döviz kurunu yansıtmayı beklenmektedir.

Bu konuda spot işlemlerde –güncel piyasa fiyatını baz alan- iki kurum tarafından -eşleşme kriterlerini de göz önünde bulundurarak- sözleşme kurunun girilmesi,

Farklı durumlarda –başlangıç tarihi gelecekte olan işlemler veya opsiyonlar gibi durumlarda- para çifti için güncel kuru yansıtmayı açısından- gün için TCMB fixingi ya da işlem anındaki – sözleşmenin yapılma zamanındaki- Spot piyasa kuru kullanılabilir.

TCMB kuru kullanılacak ise örnek vermek gerekirse;

05.04.2022 Executiondate’li bir işlem için kullanılacak kur TCMB’nin 15:30’da 05.04.2022’de açıkladığı alış kuru olmalıdır (Kapanış Alış Kuru).

SORU 6: Fark Sözleşmelerinde (Contract for Differences) vade tarihi nasıl doldurulmalıdır?

CEVAP 6: Vade tarihi belli olan türev araçlar için vade tarihi girilmelidir. Vade tarihi sözleşme başlangıcında belli olmayan türev araçlar için 31.12.2099 olarak raporlanmalıdır. Sözleşme sonlandırılmak istendiğinde “terminationdate” alanına sonlandırma tarihi girilerek sözleşme sonlandırılabilir.

SORU 7: Eşleşme kapsamına giren Fark Sözleşmelerinde (Contract for Differences), 1515 nolu duyuru (<https://www.mkk.com.tr/en/announcement/Pages/e-VEDO-%C3%96zg%C3%BCn-%C4%B0slem-Kodu-Kurallari-Hk.aspx>) doğrultusunda oluşturulacak olan tradeId (İşlem Kodu) içinde girilmesi gereken 12 haneli nominal alanında hangi değer belirtilmeli?

CEVAP 7: CFD (Contract for Differences) sözleşmelerinde nominal alanının hesaplanmasında “Sözleşme adedi (quantity) x Fiyat Çarpanı (priceMultiplier) x Fiyat/Oran (PriceRate) = Nominal Değer” eşitliğinin sağlanması beklenmektedir. (İşlemin ilk raporlamasında kullanılan TradeID güncellenmemelidir.)

NOT:

- a) CFD işlemlerinde alım satım sonucu işlem tutarının (ilgili hesap toplam pozisyon büyüklüğü) değişmesi durumunda değişen pozisyon **güncelleme bildirimi** ile bildirilmiş olan işlem üzerinde değiştirilmelidir.
- b) CFD işlemlerinde **pozisyon değişikliği haricinde**, tüm var olan bildirimler özelinde **değerleme bildirimi** ile pozisyonlara ait güncel piyasa/model değerlemeleri günlük olarak yapılmalıdır.

SORU 8: CFD pozisyonunun parçalı kapanması halinde, kapanan işlem büyüklüğü kadar notional bildirilmesi gerekmez mi? Örneğin 10000 olarak açıldı 2000'i kapandı. Bu durumda nasıl bildirim yapmamız gerekir?

CEVAP 8: CFD sözleşmelerinin parçalı kapanması halinde de işlem kodu içerisindeki nominal değerinin değişmesi beklenmemektedir. 2000'lik kapanıştan sonraki 8000'lik için yapılan raporlamada, TradeID (İşlem Kodu) bilgisi değiştirilmeden, notional (nominal) ve originalNotional (Sözleşmenin Gerçek Değeri) alanları 8000 olarak M (Güncelleme Bildirimi) ile güncellenmelidir.

SORU 9: N (Yeni Bildirim) ve C (Sonlandırma Bildirimi) bildirimi dışında açık pozisyonları Değerleme Yöntemi ile bildirmeyi düşünüyoruz. Bu durumda kapanan 20'yi nasıl bildirmeliyiz?

CEVAP 9: Örnek olarak; ABC100 işlem kodu ile yeni bildirim yapılan sözleşmenin nominalı 100 olsun. Ertesi gün 20'sinin kapandığı durumda güncelleme bildirimi ile nominalı 80 olacak şekilde güncellenmelidir.

SORU 10: Yabancı piyasalarda yapılan Dolar Endeks Kontratlarındaki bildirimlerde assetClass (Varlık Sınıfı) olarak = 'CU' (para birimi) bildirmekteyiz. Bu durumda exchangeratebasis1 ve exchangeratebasis2 alanlarına aynı değeri yazıyoruz. Ancak bu durum, exchangeratebasis1 ve exchangeratebasis2 alanlarının eşit olmaması gerektiği kuralı ile uymamaktadır.

“exchangeratebasis1 $\neq$ exchangeratebasis2” kuralı sadece FW SW işlemleri için mi geçerli olmalı?

CEVAP 10: Dolar Endeks kontratlarınız için bildirimlerinizi `assetClass = "CO (Emtia)"` olarak, `commodityBase = "IN (Endeks)"` olarak `Commodity Details = "OT "Diğer"` olarak bildirilmesi beklenmektedir. "`exchangeratebasis1 ≠ exchangeratebasis2`" kuralı "`assetClass = "CU (para birimi)"` olan işlemler için geçerlidir.

SORU 11: Çapraz para swaplarının (XCS), ürünün farklı para birimleri içermesinden dolayı taşımış olduğu para birimi swapı özellikleri korunacak şekilde faiz oranı swapları şeması kullanılarak raporlanması beklenmektedir. Böylelikle, XCS'lere ait raporlamalarda `assetClass` (Varlık Sınıfı) alanının "IR" (faiz oranı) ve `transactionDetails` (İşlem Detayı) alanının "XCS" olarak seçilmesi gerekmektedir.

Cross Currency Swap işlemlerimizi bundan böyle IR sınıfında raporlayacaksa, `Exchange Rate1` (Döviz Kuru 1) alanının doldurulması gerekmekte midir?

CEVAP 11: XCS işlemlerde `asset class` IR sınıfında raporlanmalı bu alanın dışında `Exchange Rate1`, `ForwardExchangeRate`, `ExchangeRateBasis1` ve `ExchangeRateBasis2` alanlarının da yukarıdaki örneklerde yer alan Para Birimine dayalı Swap işlemlerinde olduğu gibi doldurulması gerekmektedir.

SORU 12: `currencyOfPrice` (Fiyatın Para Birimi) alanı nasıl doldurulmalı?

CEVAP 12: `PriceRate` alanın konvansiyonel kotasyon cinsinden rakam olarak girilmesi, `currencyofPrice` alanının ise konvansiyonel kotasyonda karşı para birimi olan hangi para birimiye o para biriminin girilmesi beklenmektedir.

Örnek olarak, EUR/TRY işleminde `Price/Rate` alanına 6,00 olarak girilmesi ve burada karşı para birimi TRY olduğu için `currencyofPrice` alanın ise TRY olarak girilmesi beklenmektedir.

SORU 13: `EffectiveDate` (Valör Tarihi) alanı nasıl doldurulmalı?

CEVAP 13:

e-VEDO raporlamasına ilişkin raporda belirtildiği şekilde `effectiveDate` alanın ilgili işleme ait yükümlülüklerin ortaya çıktığı tarih olarak girilmesi beklenmektedir. Forward sözleşmeleri için

bu tarih Forward işleminin yapılma tarihi olup işlem tarihinde vadede gerçekleşecek işlem belirlenmekte ve bu bir yükümlülük halini almaktadır. ESMA standartları kapsamında da EffectiveDate ile ilgili sözleşmede özel bir tarih bulunmaması durumunda; bu tarihe işlem tarihi bilgisinin girilmesi beklenmektedir. Vadede gerçekleşen değişim yükümlülüklerde belirtilen miktarların el değiştirdiği tarih olup, yükümlülüklerin ortaya çıkış tarihi Forward anlaşmasına girildiği işlem tarihi olmaktadır. Diğer tanımlar için Dosya Formatları incelenebilir; <https://www.mkk.com.tr/veri-depolama-hizmetleri/e-vedo/turev-t1-raporlamasi>

SORU 14: AssetClass (Varlık Sınıfı) = CO (Emtia) olan, Altına Dayalı işlemlerde SW (Swap), FW (Forward), FU (Futures), CD (Fark Sözleşmeleri) sözleşmelerinde PriceRate (Fiyat/Oran) alanı nasıl doldurulmalıdır?

CEVAP 14: Altına dayalı sözleşmelerde birimin gram ya da ons olarak bildirilmesi noktasında yeknesaklığın sağlanması adına; eşleşme sürecinde sağlanması gerekli olan karşılıklı mutabakat doğrultusunda aynı şekilde girilmelidir.

SORU 15: Sistemimizde; Opsiyon işlemlerinin kullanılmasından kaynaklı olarak çoğunlukla spot işlem üretilmektedir. Ancak spot işlemler bildirime tabi değildir. Fakat Kullanım tarihi (Exercise Tarihi) ile Takas tarihi arasında T+2 süresinden fazla bir süre olduğunda Forward işlem üretilmektedir. Bu forward işlemin diğer mevcutta yapılan forward işlemleri gibi bildirilmesi gerekir mi?

CEVAP 15: Üretilen Forward işleminin de yeni bir işlem olarak ayrıca bildirilmesi gerekmektedir. Operasyonel, muhasebesel veya kurumların içsel süreçleri sebebiyle olmayan bir işlem üretilmemeli ve işlemin orijinali ile değiştirilmemelidir.

Sisteme bildirilen tüm işlem türlerinde orijinal işlem parametrelerine bağlı kalınmalıdır. İçsel süreçler nedeniyle parametrelerde değişikliğe gidilmemelidir.

SORU 16: XAU Forward işlemleri için varlık sınıfı (Asset Class) ne girilmelidir?

CEVAP 16: XAU Forward işlemleri için Varlık Sınıfı (Asset Class) alanının Emtia (CO) olarak bildirilmesi gerekmektedir.

SORU 17: Cross Currency Swap (XCS) işlemlerde forwardExchangeRate (forward Döviz Kuru) alanında tam olarak hangi bilgiyi raporlamalıyız?

CEVAP 17: ForwardExchangeRate alanına; vadede kullanılacak kur bilgisinin girmesi gerekmektedir.

SORU 18: ExchangeRate1 (Döviz Kuru 1) alanına ExecutionDate (Sözleşmenin Gerçekleşme Tarihi)'deki spot kur mu yoksa valör tarihindeki spot kur mu girilmelidir?

CEVAP 18: İlgili alana dosya formatlarında belirtildiği üzere; ExecutionDate tarihindeki spot kur bilgisi girilmelidir.

SORU 19: Forward işlemlerinde effectiveDate alanına; işlem tarihi girilmesi bekleniyor. Swap, IRS ve XCS işlemlerinde de bu geçerli midir?

CEVAP 19: Sözleşmede özel bir valör tarihi olması durumunda valör tarihi, bu tarih olmaması durumunda işlem tarihi girilebilir. Bu bağlamda swap işlemleri içinde valör tarihi özel olarak belirtilmediği durumda işlem tarihi girilebilir.

EffectiveDate alanına girilen bilginin sözleşmede geçen valör tarihi alanı ile uyumlu olması beklenmektedir.

SORU 20: Altına dayalı türev sözleşmeleri nasıl raporlanmalı?

CEVAP 20: Aşağıda sözleşme türü forward, varlık sınıfı emtia olan örnekler paylaşılmıştır.

Örnek 1:

A kurumu B kurumu ile altın forward sözleşmesi yapmaktadır.

A kurumu 1.000 adet altın üzerine yazılmış 1 adet forward sözleşmesinde uzun pozisyonudur.

Altının ons forward fiyatı 1.800 USD'dir.

Ana para 1.800.000 USD

Bu durumda A kurumu,

Sözleşme Türü (Contract Type): "FW" (Forward işlemi olduğu için)

Varlık Sınıfı (Asset Class): "CO" (Altın bir EMTİA olduğu için)

Sözleşme Tarafının Satıcı veya Alıcı Olma Durumu (CounterpartySide): "B" (A kurumu uzun pozisyonunda olduğu için "Alıcı")

Nominal Para Birimi-I (Notional Currency1): "USD"

Nominal (Notional): "1.800.000"

Fiyat/Oran (Price/Rate): "1.800" ürünün fiyatı

Fiyat Notasyonu (Price Notation): "U" birim

Fiyatın Para Birimi (Currency of Price): "USD" ürünün fiyatı sözleşmede dolar cinsinden verilmiştir.

Fiyat Çarpanı (Price Multiplier): Sözleşmede bir çarpan bulunmadığı için "1000".

Miktar (Quantity): buradaki sözleşme adedi 1'dir.

Baz Emtia (Commodity Base): "ME" metal

Emtia Detayları (Commodity Details): "PR" kıymetli olanlar

Sözleşmenin Gerçek Para Tutarı (Original Notional): "1.800.000"

Sözleşmenin Gerçek Para Birimi (Currency of Original Notional): "USD"

SORU 21: Kıymetli madenlerin dayanak varlık olduğu türev sözleşmelerde; "quantity (Miktar)" alanı bilgisi nasıl girilmelidir?

CEVAP 21: Örneğin altın sözleşmesi ile bir örnek ele alındığında;

Örnek sözleşme: AAA Karşı tarafı ile yapılan 1 adet (gram fiyatlaması üzerinden) 800 gram altın satış işlemi

Quantity: Raporlamaya baz işlem 1 adet sözleşme içerdiği için "1" olarak girilmelidir.

Ancak farklı durum örneği olarak; standardize sözleşmelerde istenen işlem hacmi kapsamında – tek sözleşmenin 100 gram altın içermesi varsayımıyla-

8 adet sözleşme yapılması gerekirse bu miktar 8 olarak girilmelidir.

Price Multiplier: sözleşme 800 adet 1 gram altın içerdiğinde 800×1 olarak price Multiplier alanı 800 olarak girilmelidir.

Farklı durum örneğinde tek sözleşme standart 100 gram altın içereceği için PriceMultiplier 100 olarak girilmelidir.

Price Rate: Sözleşmede baz fiyat 1 gram altın fiyatı olması nedeniyle bu alana 1 gram altının fiyatı girilmelidir.

Notional: Notional alanı $\text{Quantity} \times \text{Price Multiplier} \times \text{Price Rate}$ olacağından;

1 adet 800×1 gram altın içeren sözleşme için: $1 \times 800 \times (1 \text{ gram altın fiyatı})$ olarak yer alacaktır.

SORU 22: Değerleme bildirimlerinin yapılmaya başlandığı tarih (valuationDate), Valör tarihinden (effectiveDate) mi başlamalıdır?

CEVAP 22: Hayır. ExecutionDate (Sözleşmenin Gerçekleştirilme Tarihi) tarihinden bir sonraki iş günü itibarı ile başlamalıdır.

SORU 23: Opsiyonlarda prim tutarı “0” olan işlemlerde “currencyofPrice” (Fiyatın Para Birimi) alanı nasıl doldurulmalıdır? (eşleşmeye tabi sözleşmeler için)

CEVAP 23: Karşı tarafla karşılıklı mutabakat sonucu ilgili işlem parametrelerinde genel olarak hangi para birimi cinsinden prim tutarı ödeniyorsa o para birimi cinsi “currencyofPrice” alanına girilmelidir.

SORU 24: Price/rate (fiyat/oran) ve Faiz alanlarındaki faiz bilgileri yüzdelik mi, baz puan olarak mı nasıl doldurulmalıdır?

CEVAP 24: Örneğin; 2,47% olan bir faiz bilgisi, 2,47 olarak yazılmalıdır.

SORU 25: Digital/binary opsiyon para birimine dayalı sözleşmede “ForwardExchangeRate” alanı “0” girilememektedir. İlgili alana ne girilmelidir?

CEVAP 25: İlgili sözleşme kapsamında “forwardExchangeRate” bilgisinin olmaması durumunda “exchangeRate1” kurunu girebilirsiniz.

SORU 26: Asimetrik Forward Sözleşmeleri nasıl raporlanmalıdır?

CEVAP 26:

Aşağıdaki örnekler ve bilgiler baz alınır ise;

Asimetrik Forward (Zero – Cost) Alım Sözleşmesi

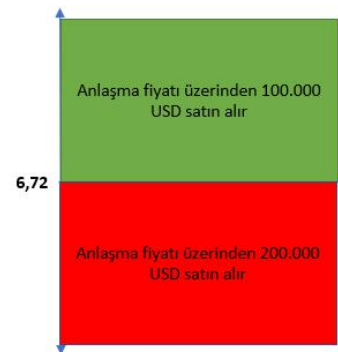
- İhracatçılar, forward kurdan daha avantajlı bir seviyeden, döviz cinsi (ithalat/kredi) ödemelerini kur riskine karşı belirli oranda koruyabilirler.

İşlem Gününde:

- Cari kur 6,7500 iken 3 ay vadeli sözleşme yapılır.

Vade Sonunda:

- Piyasadaki kur, **anlaşma kurunun altındaysa** **kaldıraçlı tutar** kadar (200.000 USD) döviz satın alır,
- Piyasadaki kur, **anlaşma kurunun üzerindeyse anlaşma tutarı** kadar (100.000 USD) satın alır.



Bir forward ve bir digital opsiyon olacak şekilde birbirine “complex component trade id” ile bağlı olacak şekilde girilir. 1.örnek için;

- Para birimine dayalı Forward, ForwardRate 6,72, priceRate 6,72 olacak şekilde.
- Para birimine dayalı digital/binary opsiyon girilir. Opsiyon koşulu gerçekleşirse 100.000 USD’lik fark devreye girdiği için opsiyonda nominal 100.000 olarak girilmelidir. Strike Price alanına 6,72 girilmelidir. Price/rate “0” olacak şekilde raporlanmalıdır.

SORU 27: Ortalama Forward Sözleşmeleri nasıl raporlanmalıdır?

CEVAP 27: Aşağıdaki bilgiler ve örnekler baz alınır ise;

Ortalama Forward (Zero – Cost) Alım Sözleşmesi

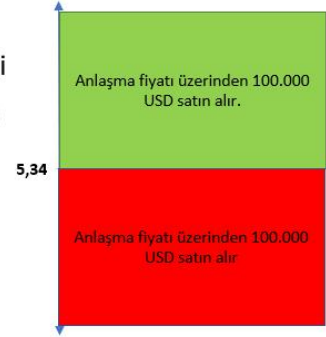
- 1 yıl vadeli kredi ödemesi/eşit taksitli ithalat bedeli için tek bir kurdan alım yaparak, kur riskini yönetmek için kullanılabilir.

İşlem Gününde:

- Cari kur 7,7800 iken 1.200.000 USD tutarındaki 1 yıl vadeli 12 eşit taksitli kredi ödemelerini hedge etmek için 5,3400 ortalama kur üzerinden vadeli döviz alım sözleşmesi yapılır.

Vade Günlerinde:

- Piyasadaki kurdan bağımsız olarak, her bir vade gününde 5,3400'ten 100.000 USD alır.



Ortalama Forward (Zero – Cost) Satım Sözleşmesi

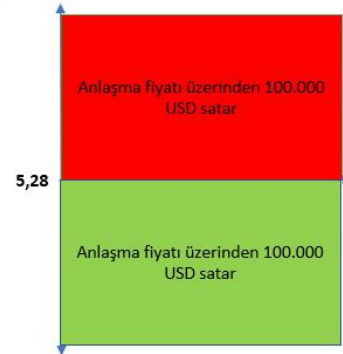
- 1 yıl vadeli kredili ihracat bedelinin ortalama değerini hedge etmek için kullanılabilir.

İşlem Gününde:

- Cari kur 7,7800 iken 1.200.000 USD tutarındaki 1 yıl vadeli 12 eşit taksitli ihracat bedelini hedge etmek için 5,2800 ortalama kur üzerinden vadeli döviz satım sözleşmesi yapılır.

Vade Günlerinde:

- Piyasadaki kurdan bağımsız olarak, her bir vade gününde 5,2800'ten 100.000 USD satar.



ContractType (Sözleşme Türü) = 'FW' ve AssetClass (Varlık Sınıfı) = "CU" (para birimine dayalı) girilecek olup, fxratePaymentFreqLeg1Tp (Sabit Oranlı 1 inci Bacağın Ödeme Sıklığı - Zaman Periyodu) "M" , fxratePaymentFreqLeg1M (Sabit Oranlı 1 inci Bacağın Ödeme Sıklığı – Çarpan)

“1” olarak doldurulur. Notional ve Original Notional alanı ayda bir “Güncelleme Bildirimi (M)” ile güncellenir.

SORU 28: Sabit bacağın negatif faiz olması veya sabit bacak olmaması durumunda alfabetik sıraya göre belirlenen bacağın faiz oranı (örneğin; EUR) negatif olması durumunda “-” negatifliği belirten işaret TRADE ID kapsamında olmalı mıdır?

CEVAP 28: Negatif (-) işaretinin TradeID’nin oluşturulmasında kullanılmamalıdır. Örneğin; -0.105 % faiz oranı için “01050” olacak şekilde TradeID (İşlem Kodu)’de yer almalıdır.

SORU 29: Dayanak Varlığın Jet Fuel olduğu türev sözleşmeler için; commodityDetails alanı nasıl doldurulmalıdır?

CEVAP 29: Dayanak varlık Jet Fuel olan türev sözleşmeler için için CommodityDetails (Emtia detayları) alanı “OI=Petrol” olarak doldurulmalıdır.

SORU 30: Örneğin Soya Fasülyesi, Kakao, Palm Yağı ve Mısır emtialarının dayanak varlık olduğu türev sözleşmeler, e-VEDO Platformu’na nasıl bildirilmelidir?

CEVAP 30: İlgili sorunun cevabı Dosya Formatlarında yer almaktadır. Dosya formatlarına <https://www.mkk.com.tr/veri-depolama-hizmetleri/e-vedo/turev-t1-raporlamasi> adresinden ulaşılabilir.

Yukarıda verilen örnek Platform’a aşağıdaki tablodaki şekilde bildirilmelidir.

Emtia Türü	Emtia Kodu	commodityBase (Baz Emtia)	CommodityDetails (Emtia Detayları)
Soya Fasülyesi	S	AG	GO
Kakao	CC	AG	SO
Palm Yağı	KO	AG	GO
Mısır	C	AG	GO

SORU 31: Gerçekleştirdiğimiz türev sözleşmede Teminatlandırma işlem günü gerçekleştiriliyor ve vade sonuna dek bir daha gerçekleştirilmiyor. Bu durum nasıl raporlanmalıdır?

CEVAP 31: Teminat işlem günü alınıyor ise yeni bildirimde (N) teminat tarihine işlem gününü girebilirsiniz. Sonrasında hiçbir değişiklik gerçekleşmiyorsa teminat değerlendirme (CL) bildirimini göndermeniz beklenmemektedir.

Eğer teminat tutarında değişiklik olursa, teminat tutarının değiştiği günün tarihi teminatlandırma bildiriminde yer alan “Teminat Tarihi (collateralizationDate)” alanına girilmelidir.

SORU 32: Interest Rate Swap sözleşmelerine ilişkin alanlar nasıl doldurulmalıdır?

CEVAP 32: contractType : SW, assetClass : IR ve transactionDetails: OTH şeklinde doldurulmalı,

- Counterpartyside:
 - Fixed/float taraf fixed ödeme yapıyorsa BUYER/ALICI
 - Fixed/float taraf float ödeme yapıyorsa SELLER/SATICI
 - Fixed/fixed taraf büyük olan fixed oranı ödüyorsa BUYER/ALICI
 - Fixed/fixed taraf küçük olan fixed oranı ödüyorsa SELLER/SATICI
 - Float/float taraf büyük olan spread oranını ödüyorsa BUYER/ALICI
 - Float/float taraf küçük olan spread oranını ödüyorsa SELLER/SATICI
 - Fixed/fixed fixed oranları aynı ise taraf periyodu kısa olan fixed oran ödüyorsa BUYER/ALICI
 - Fixed/fixed fixed oranları aynı ise taraf periyodu uzun olan fixed oran ödüyorsa SELLER/SATICI
- PRICE/RATE:
 - Sabit Faiz oranı(İki tane sabit varsa yüksek olan) eşit ise kısa vadeli olan
 - Float/float da spreadler birbirine eşitse kısa vadeli olan spread

- Dosya formatlarında yer alan “Leg” alanlarından sözleşmeye uygun olanlar doldurulmalı.
- LEG1 ve LEG2 ayrımı:
 - Fixed/float LEG1 alanına Fixed oran, LEG2 alanı float oran
 - Fixed/fixed büyük olan LEG1 alanına, küçük olan LEG2 alanına
 - Fixed/fixed birbirine eşitse kısa vadeli fixed oran LEG1 alanına, uzun vadeli LEG2 alanına
 - Float/float büyük spread olan LEG1 alanına, küçük spread olan LEG2 alanına
 - Float/float iki spread de aynı ise, periyodu kısa olan faizin bilgileri LEG1 alanına, periyodu uzun olan LEG2 alanına

Detaylı bilgi için:

evedo@mkk.com.tr



**MERKEZİ KAYIT
İSTANBUL**

Türkiye Sermaye Piyasaları - Merkezi
Saklama ve Veri Depolama Kuruluşu