



MERKEZİ KAYIT KURULUŞU A.Ş.

FORM AÇIKLAMA DOKÜMANI

FORM ADI: YATIRIMCI RİSK TAKİP SİSTEMİ - YRTS

FORMUN AMACI:

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



İÇİNDEKİLER

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



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



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



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



1. İşlem referansı.....	26
2. Üye kodu.....	26
P. FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA RESPONSE).....	26
1. Kredi Alım Yoğunlaşma Verileri	26
(a) Borsa Kodu.....	26
(b) Nominal değer (Rehin/Teminat Miktarı)	26
(c) Oran.....	27

Merkezi Kayıt Kuruluşu A.Ş.



A. RAPORLAMA YÜKÜMLÜLÜĞÜ

Yatırımcı Risk Takip Sistemi (YRTS) sermaye piyasalarında, kredili alım işlemi açığa satış, ödünç menkul kıymet ve/veya **yerine getirilmemiş takas yükümlülükleri** (Güncelleme Tarihi: **17.08.2020**) kaynaklı riskleri, sermaye piyasaları, aracı kurum, menkul kıymet, yatırımcı bazında ölçümleyen risk takip sistemi kurulmasını ve yatırımcıların risk ve teminat bilgilerini tek bir sistem üzerinden takip edilmesini sağlayan bir uygulamadır.

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

B. RAPORLAMA KAPSAMI

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

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

- Yatırımcıya tahsis edilen toplam kredi limiti¹
- Yatırımcının toplam kullanılabilir kredi limiti
- Yatırımcının kullanılan toplam kredi tutarı
- Değerlenmiş teminat tutarı
- Yatırımcı temerrüt durumu (**Kredili işlemler ve ödünç menkul kıymet işlemleri**)
- Yatırımcı temerrüt durumu (**Yerine getirilmemiş takas yükümlülükleri**)
- ~~6 ay nakde zorlanma cezası~~ (**Borsa İstanbul'dan alınacağı için aktarım servisinde çıkarılmıştır.**)
- Öz kaynak tamamlama bildirimleri
- Yatırımcının **hisse senedi bazında** net açığa satış pozisyonu (**net kısa pozisyon**) (**Güncelleme tarihi: 10.09.2020**)
- Yatırımcının tezgah üstü piyasalarda gerçekleştirdiği Ödünç Menkul Kıymet Verileri (**Güncelleme tarihi: 17.08.2020**)

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

- Yatırımcılara tahsis edilen kredi limiti
- Kurumlardaki toplam kullanılabilir kredi limiti

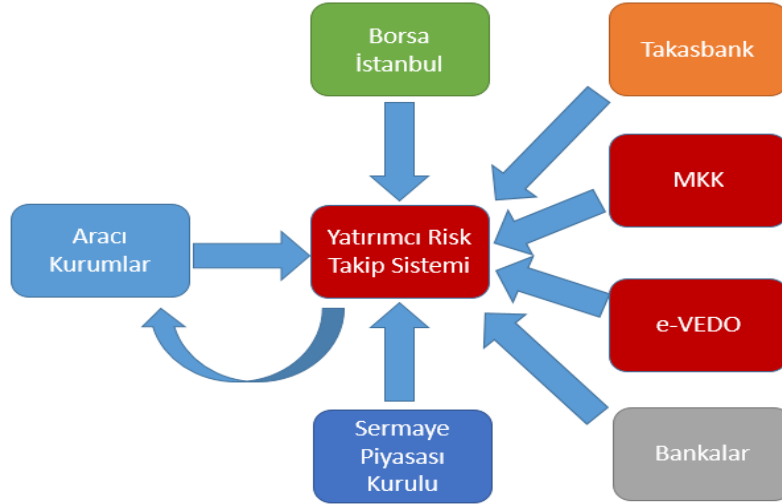
¹ Tüm limit ve tutarlar "Toplam", "Kredili Alım", "Ödünç Menkul Kıymet" ve "Açığa Satış" için ayrı bir şekilde iletilecektir.

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



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

Veri akış şeması aşağıda yer almaktadır:



Veri Akış Şeması

C. KAPSAM TARİHİ



Aracı kurumlar, **30.09.2020** tarihinden itibaren YRTS'ye aktarım yapmaya başlayacaklardır.

(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

D. SİSTEM ÖZELLİKLERİ

Uygulamanın teknik özellikleri aşağıda yer almaktadır;

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

- Sistemde;

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

olmak üzere toplamda 5 adet servis bulunmaktadır.

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

- YRTS, mesaj akışının SSL olarak gerçekleştiği bir uygulamadır.

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

E. FORM ADI

YATIRIMCI RİSK TAKİP SİSTEMİ – YRTS

F. PARA BİRİMİ

TL, ORJİNAL PARA

G. FORMUN AMACI

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

H. FORMUN DOLDURULMA ZAMANLARI

YRTS kapsamında belirtilen işlemlerinin işlem günü MKK'ya aktarılması gerekmektedir. Aktarım ve/veya Sorgu her iş günü itibariyle yapılabilecektir, haftasonları ve tatil günlerinde aktarım olmayacaktır. Üyeler Cuma gününe ait risk aktarımını Pazartesi sabah 06:00'ya kadar yapabilecektir.



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

Bu nedenle sistemde aktarım sürecinde dikkat edilmesi gereken aşağıdaki kontroller bulunmaktadır:

- T+1 günü 09:00'dan sonra yapılan aktarımların Raporlama tarihi T+1 günü olmalıdır.
- T+1 günü 06:00'dan önce yapılan aktarımların Raporlama tarihi T+0 gününe ait olmalıdır.

T+2 gününde müşterinin borcunu ödememesi durumunda ortaya çıkacak temerrüt veya kredi tutarı henüz uygulama kapsamında yer almamaktadır. Aracı Kurumların kurulacak sisteme "kullanılan kredi" olarak iletecekleri bilgilerin içerisinde valörlü işlemlere ilişkin veriler olmamalıdır. Bu durumda, T günü emir alınıp T+2 iş gününe kadar işlem riskinin aracı kurum üzerinde kaldığı işlemler, T+2 günü kredi verisi aktarılmalıdır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

I. FORMA İLİŞKİN GENEL AÇIKLAMALAR

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

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

~~• Aktif hesap kontrolü sorgulama sırasında yapılmaktadır. Aktarım yapılan yatırımcı sicil no aktif değilse bildirim hata alacaktır. (Güncelleme Tarihi:10.09.2020)~~

- Aktarımlar arasında tekillik; işlem referansı ile sağlanmaktadır.
- Yatırımcı bazında aktarımlar MKK Sicil No ile yapılmaktadır.
- Başarılı şekilde sisteme yüklenen (şema validasyonuna takılmayan) dosyalar için yatırımcı bazında Success/Error mesajı dönülecektir.
- Aracı kurum aynı yatırımcı için birden fazla risk aktarımında bulunamayacaktır.



- Gün içinde gönderilen son bildirimler sistemde geçerli olacaktır. Dolayısıyla, raporlama gününe ait düzeltme bildirimi yapılırken tüm bildirimler dikkate alınarak nihai tüm bildirimlerin aktarılması gerekmektedir.

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

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

1. İşlem referansı

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

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.

2. Üye kodu

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

3. Raporlama Tarihi

Raporlamanın gerçekleştirildiği tarih bilgisidir.

4. Yatırımcı Bilgisi

Yatırımcının MKK Sicil Numarası raporlanacaktır.

- Veli, vekil ya da vasi ye sahip olan yatırımcılar için portföy sahibinin MKK Sicil Numarası kullanılacaktır.
- Kredili işlem, açığa satış, ödünç işlemi olan ve bildirim kapsamına giren ortak portföylerde her ortak için ayrı bir bildirim yapılacaktır. Bildirimlere konu olan verilerin dağılımında kurumlardaki ortaklık oranı dikkate alınacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

5. Toplam tahsis edilen kredi limiti

Kredili alım, açığa satış ve ödünç işlemler için ayrı ya da ayrıştırılan bir limitin olmaması ve tahsis edilen toplam limit (çatı limit) bulunması durumunda; tahsis edilen limitin diğer alanlara da yazılması gerekmektedir. Raporlama alanları boş ya da "sıfır" olarak (ilgili kontrol, takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt ile net açığa satış pozisyonu (net kısa pozisyon) bildirimlerinde uygulanmayacaktır.) raporlanmamalıdır. Tüm limitler ayrı değerlendirilmektedir. Çatı limitin bulunmaması durumunda ise, Tebliğ kapsamında bir limit tanımlanması gerektiğinden, risklerin tahsis edilen limite yazılması gerekmektedir. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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

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

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

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



(c) Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit

Açığa satış işlemi için üye tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir. Açığa satış işlemi için üye tarafından tahsis edilen toplam limit, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

Açığa satış limitinin günlük değişen parametrelere bağlı olması durumunda, günlük olarak değişen limit bildirilmelidir. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(d) Toplam tahsis edilen limit

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

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

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

6. Toplam kullandırılabilir kredi limiti

Kullanılabilir limitler, her bir işlem türü içi ayrı ayrı ve toplam tahsis edilen kredi limitlerinden, kullanılan kredi miktarlarının çıkarılması ile bulunur. Her bir işlem türü kendi içinde hesaplamaya dahil edilmekte olup, ilgili detaylar mevcut dokümanda sayfa 13'te belirtilmiştir. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(a) Kredili alım işlemi için kullandırılabilir kredi limiti

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

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için kullandırılabilir limit

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

(c) Açığa satış işlemi için kullandırılabilir limit

Açığa satış işlemi için toplam kullandırılabilir limiti ifade etmektedir. Açığa satış işlemi için kullandırılabilir limit, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.

(d) Toplam kullandırılabilir limit

Üye tarafından toplam kullandırılabilir limiti ifade etmektedir.

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

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

7. Toplam kullanılan kredi

(a) Kredili Alım İşlemi için kullanılan kredi

Kredili Alım İşlemi için toplam kullanılan krediyi ifade etmektedir. Kredili alım işlemi için kullanılan kredi, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır.



(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir. Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri, TL cinsinden, 0 veya 0'dan büyük olmalıdır. Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri 0'dan farklı bir değer ise "Ödünç Menkul Kıymet Verileri alanları"nın doldurulması zorunludur.

Piyasa değeri hesaplamasında, raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(c) Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

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

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(d) Toplam risk tutarı

Kullanılan toplam kredi tutarını ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı

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

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

- Toplam taahsis edilen limit, kredili alım işlemi için taahsis edilen toplam kredi limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam taahsis edilen limit, ödünç alınan menkul kıymetler için taahsis edilen toplam limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam taahsis edilen limit, açığa satış işlemi için taahsis edilen toplam limitinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Kredili alım için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Ödünç için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Açığa satış için toplam kullanılan kredi, kullanılan kredi toplamından büyük olamaz.
- Toplam taahsis edilen limit, toplam kullanılan krediden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Kredili alım işlemi için taahsis edilen toplam kredi limiti, kredili alım için toplam kullanılan krediden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Ödünç alınan menkul kıymetler için taahsis edilen toplam limit, Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değerinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Açığa satış işlemi için taahsis edilen toplam limit, Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değerinden büyük ya da eşit olmalıdır.
- Toplam kullanılan kredi; Kredili alım için toplam kullanılan kredi tutarı, ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri ve açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri toplamına eşit olmalıdır.
- Kullandırılabilir limit, kalan toplam kullandırılabilir limitten büyük olamaz;

kullandırılabilirLimitToplam <= (taahsisEdilenLimitToplam – kullanılanKrediToplam-temerrutTutariKA- temerrutTutariOD)" (Güncelleme Tarihi: 17.08.2020)



- Kredili Alım işlemi için kullanılabilir kredi limiti, kalan toplam Kredili Alım işlemi için kullanılabilir kredi limitinden ve/veya kalan toplam kullanılabilir limitten büyük olamaz.

"kullanılabilirKrediLimitiKA <= min [(tahsisEdilenLimitToplam - kullanılanKrediToplam-temerrutTutariKA- temerrutTutariOD), (tahsisEdilenKrediLimitiKA-kullanılanKrediKA-temerrutTutariKA)]" (Güncelleme Tarihi: 17.08.2020)

- Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit, kalan toplam Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limitten ve/veya kalan toplam kullanılabilir limitten büyük olamaz.

"kullanılabilirKrediLimitiOD <= min [(tahsisEdilenLimitToplam - kullanılanKrediToplam-temerrutTutariKA- temerrutTutariOD), (tahsisEdilenKrediLimitiOD-kullanılanKrediOD-temerrutTutariOD)]" (Güncelleme Tarihi: 17.08.2020)

- Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit, kalan toplam Açığa satış işlemi için kullanılabilir limitten ve/veya kalan toplam kullanılabilir limitten büyük olamaz.

"kullanılabilirKrediLimitiAS<= min [(tahsisEdilenLimitToplam - kullanılanKrediToplam), (tahsisEdilenKrediLimitiAS-kullanılanKrediAS)]"

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

- **Bilindiği takdirde**, Banka aracılığıyla sermaye piyasasında kredili alım için toplam kullanılabilir kredi limiti (TL), Banka aracılığıyla sermaye piyasası için kredili alım için toplam tahsis edilen kredi limiti (TL) ve Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı (TL) bilgileri yazılmalıdır.
- Eğer Banka aracılığıyla kullanılan kredili alım için toplam kullanılabilir kredi limiti ve tahsis edilen kredi limiti **bilinmiyorsa**, tahsis edilen kredi limiti bilgisine, Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı yazılmalıdır.

8. Değerlenmiş Teminat Tutarı

(a) Değerlenmiş Teminat Tutarı

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

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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

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



Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.
(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

9. Temerrüt Durumu

(a) Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı

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

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

(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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

Takas yükümlülüğüne ilişkin nakit temerrüt tutarı değerini ifade etmektedir. Temerrüt faizi ayrıca yazılmayacak olup, toplam tutarın içine dahil edilecektir. Bu alan sadece kredili alım müşterileri değil, temerrüdü bulunan tüm yatırımcılar için geçerlidir. (Güncelleme tarihi: 10.09.2020)

Nakit yükümlülüklerin yerine getirilmemesi durumunda oluşan temerrütlerin bu alanda bildirilmesi gerekmektedir. Kredili alım ile ilişkin temerrütlerin, "Kredili alım işlemine ilişkin güncel nakit temerrüt tutarı - temerrutTutariKA" bölümünde bildirim yapılacağından bu alanda yer almamalıdır. Kredili alım limitine sahip yatırımcının, kredili alım işlemi dışında nakit yükümlülüğünden dolayı bir temerrüde düşmesi durumunda bu alanda bildirilmesi gerekmektedir, karşılığında bir limit bulunmayan ve cari hesapta oluşan eksi bakiye temerrüt olarak raporlanacaktır.

Ayrıca, vergi, nema stopajı, masraf vs. gibi konulardan da müşterinin cari hesabı borçlandırılıyorsa bu alanda gösterilmelidir.

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

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

Takas günü: "temerrutTutariTakas:" alanına 100.000 TL +faiz

Takas günü+1: "temerrutTutariTakas:" alanına 100.000 TL +faiz

Takas günü+2: "temerrutTutariTakas:" alanına 100.000 TL +faiz



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

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

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

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.

Ödünç alınan menkul kıymetlere ilişkin bir temerrüt durumu oluştuğunda, ilgili risk "Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri - kullanılanKrediOD" alanından bu alana transfer edilecektir. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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

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

10. Özkaynak tamamlama bildirimleri

(a) Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı

Aracı Kurumlar tarafından, kredili alım işlemine ilişkin ilgili müşteriye gönderilen özkaynak tamamlama bildirimleri tutarını ifade etmektedir. Bir yatırımcı için, ilgili kurumdaki hesaplardaki özkaynak durumu hesap bazında yerine, konsolide olarak dikkate alınmalıdır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(b) Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı

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

Yukarıda yer alan, özkaynak tamamlama bildirimleri için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir: (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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



11. Net açığa satış pozisyonu- menkul kıymet

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

Net açığa satış pozisyonu için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir: (Güncelleme tarihi: 10.09.2020)

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

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

Borçlanma Araçları Piyasası'nda yapılan valörlü işlemler için, işlem tarihindeki pozisyon dikkate alınmalıdır.

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

(a) Kıymete ait ISIN kodu

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

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

(b) Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon nominal değeri

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

(c) Menkul kıymet bazında net kısa pozisyon cari değeri

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

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

12. Ödünç Menkul Kıymet Verileri

Ödünç Menkul Kıymet Verileri yatırımcı bazlıdır.

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

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



(a) Kıymete ait ISIN kodu

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

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

(b) Menkul kıymet miktarı

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

(c) Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri

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

Piyasa değeri hesaplamasında raporlama gününe ait kapanış fiyatları kullanılacaktır.
(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

(d) Ödünç işlem tarihi

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

(e) Ödünç valör tarihi

Valör tarihi yükümlülüklerin başladığı tarihtir. İşlemin valör tarihi yazılacaktır. Valör Tarihi, İşlem Tarihi'nden büyük ya da eşit olmalıdır.

(f) Ödünç vade tarihi

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

Bu alan doldurulurken aşağıdaki kural dikkate alınmalıdır:

Ödünç Menkul Kıymetler kullanılan kredi tutarı 0'dan farklı bir değer ise Ödünç Menkul Kıymet verilerinin bildirimi zorunludur.

Vade tarihi farklı olan aynı menkul kıymete ait ödünç işlemleri ayrı olarak bildirilmelidir.
(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

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

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

1. İşlem referansı

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



2. Üye kodu

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

3. Sorgu Tipi (T/Y)

Bu alan aşağıdaki kodlar kullanılarak doldurulacaktır:

T=Toplu Sorgu
Y=Yatırımcı bazında sorgu

- Sorgu Tipi= T seçildiğinde aşağıdaki veriler doldurulmayacaktır. (Güncelleme tarihi: 17.08.2020)

4. Yatırımcı Bilgisi

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

(a) Yatırımcı MKK Sicil Numarası

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

(b) Yatırımcı TCKN

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

(c) Yatırımcı VKN

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

Yatırımcı bilgisi doldurulurken aşağıdaki kurallar dikkate alınmalıdır:

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

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

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

1. İşlem referansı

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

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.



2. Yatırımcı Bilgisi

Yatırımcı MKK Sicil Numarası

Sorgu servisinde sorgusu yapılan MKK Sicil Numarası bilgisidir.

3. Kurumlardaki toplam tahsis edilen kredi limiti

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

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

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

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

(c) Açığa satış işlemi için tahsis edilen toplam limit

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

(d) Toplam tahsis edilen limit

Üyeler tarafından tahsis edilen toplam limiti ifade etmektedir.

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

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

4. Toplam kullanılabilir kredi limiti

(a) Kredili Alım İşlemi için kullanılabilir kredi limiti

Kredili alım işlemi için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(b) Ödünç alınan menkul kıymetler için kullanılabilir limit

Ödünç alınan menkul kıymetler için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(c) Açığa satış işlemi için kullanılabilir limit

Açığa satış işlemi için toplam kullanılabilir limiti ifade etmektedir.

(d) Toplam kullanılabilir limit

Kullanılabilir toplam kredi limitini ifade etmektedir.

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

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

5. Toplam kullanılan kredi

(a) Kredili alım işlemi için kullanılan kredi

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



(b) Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Ödünç alınan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir.

(c) Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değeri

Açığa satışı yapılan menkul kıymetlerin cari piyasa değerini ifade etmektedir.

(d) Toplam risk tutarı

Kullanılan toplam kredi tutarını ifade etmektedir.

(e) Banka aracılığıyla kullanılan toplam kredi tutarı

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

6. Kredi Limiti Veren Toplam Kurum Sayısı

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

7. Temerrüt Durumu

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

Aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır. (Güncelleme Tarihi:17.08.2020)

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

Aktarım servisinde, ödünç alınan menkul kıymetlere ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır. (Güncelleme Tarihi:17.08.2020)

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

Aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen temerrüt verisinin yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. (Güncelleme Tarihi:17.08.2020)

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

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

Temerrüt durumu için aşağıdaki bilginin dikkate alınması gerekmektedir:

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



8. 6 ay nakde zorlanma cezası

(a) 6 ay nakde zorlanma cezası başlangıç tarihi

İlgili ceza durumunun başladığı tarih bilgisidir. Aktarım esnasında, **Borsa İstanbul** tarafından aktarımda 6 ay nakde zorlanma cezasının ilk “VAR” olarak raporlandığı tarih cezanın başlangıç tarihi olarak alınacaktır. **(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)**

(b) 6 ay nakde zorlanma cezası bitiş tarihi

İlgili ceza durumunun bittiği tarih bilgisidir. Aktarım esnasında, **Borsa İstanbul** tarafından aktarımda 6 ay nakde zorlanma cezasının “YOK” olarak raporlandığı tarih cezanın bitiş tarihi olarak alınacaktır. **(Güncelleme tarihi: 17.08.2020)**

9. İşlem Yasağı Listesi

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

<https://www.spk.gov.tr/SiteApps/IdariYaptirim/IslemYasaklari>

(a) İşlem yasağı Kurul karar tarihi

Yasağın alındığı Kurul Karar Tarihi bilgisidir.

(b) Pay senedi bilgisi

Yasağın uygulandığı Pay Senedi bilgisidir.

10. Borsa Tedbir Listesi

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

<https://www.borsaistanbul.com/tr/sayfa/1890/elektronik-rapor-dagitimi>

(a) Uygulanan tedbir kodu

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

(b) Uygulanan tedbir adı

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

(c) Tedbir başlangıç tarihi

İlgili tedbirin başlangıç tarihi bilgisidir.

(a) Tedbir bitiş tarihi

İlgili tedbirin bitiş tarihi bilgisidir.

11. Diğer Tedbirler ve İşlem Yasakları Listesi

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



(a) Tedbir başlangıç tarihi

İlgili tedbirin başlangıç tarihi bilgisidir.

(b) Tedbir bitiş tarihi

İlgili tedbirin bitiş tarihi bilgisidir.

(c) Pay senedi bilgisi

İlgili tedbirin uygulandığı Pay Senedi bilgisidir.

(d) Tedbir nedeni

İlgili tedbirin neden açıklamasıdır.

12. Türev Verileri (VIOP)

(a) Sözleşme Türü

Türev sözleşmesinin türünü ifade etmektedir.

Aşağıdaki alan kodları kullanılarak iletilecektir;

FU = Future
OP= Opsiyon

(b) Varlık Sınıfı

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

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

(c) Sözleşmelerin toplam piyasa değeri

Sözleşmelerin toplam piyasa değerini ifade etmektedir.

(d) Sözleşmelerin toplam teminat değeri

Sözleşmelerin toplam piyasa değeri karşılığında alınan toplam teminat değerini göstermektedir.

(e) VIOP raporlama tarihi

VIOP işlemlerinin raporlamasının gerçekleştirildiği tarih bilgisidir.



13. Kaldıraçlı Alım Satım Bilgileri (KASİ)

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

(a) Net kar-zarar

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

(b) Kaldıraçlı alım satım teminat tutarı

Yatırımcıya ait TL cinsinden teminat değerini ifade etmektedir.

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

(c) İşlem tarihi

YRTS sistemine bildirilen işlemlere ilişkin işlem tarihini ifade etmektedir.

14. Yatırımcının hacizde kıymeti olup olmadığı bilgisi

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

VAR= Haciz var
YOK= Haciz yok

15. Tüm kurumlardaki bakiyeli hesap sayısı

Yatırımcının tüm kurumlardaki toplam bakiyeli hesap sayısı raporlanacaktır.

16. Tüm kurumlardaki toplam hesap sayısı

Yatırımcının tüm kurumlardaki toplam hesap sayısı raporlanacaktır.

17. İflas

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

VAR= İflas var
YOK= İflas yok



18. Özkaynak tamamlama bildirimleri

(a) Kredili alım özkaynak tamamlama tutarı

Bu alan aktarım servisinde, kredili alım işlemine ilişkin bildirilen özkaynak tamamlama tutarının yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır. (Güncelleme Tarihi:17.08.2020)

(b) Ödünç menkul kıymet özkaynak tamamlama tutarı

Bu alan aktarım servisinde, ödünç işlemlerine ilişkin bildirilen özkaynak tamamlama tutarının yatırımcı bazında konsolide edilmiş verisidir. Yatırımcı bazında Aracı Kurumlar tarafından gönderilen ilgili verinin toplamı yer alacaktır. (Güncelleme Tarihi:17.08.2020)

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

1. İşlem referansı

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

Aktarımlar arasında tekillik, işlem referansı bazında sağlanmaktadır.

2. Üye kodu

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

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

1. İşlem referansı

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

2. Ödünç Menkul Kıymet Verileri

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

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

(a) Kıymete ait borsa kodu

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

(b) Menkul kıymet miktarı

Menkul kıymetlerin nominal değerleri ilgili alanda raporlanacaktır.

(c) Menkul kıymet bazında cari piyasa değeri

Menkul kıymetin raporlama günündeki ağırlıklı ortalama fiyatı kullanılarak hesaplanacaktır.



(d) Ödünç işlem tarihi

İşlemin gerçekleştiği tarih yer alacaktır.

(e) Ödünç valör tarihi

Valör tarihi yükümlülüklerin başladığı tarih yer alacaktır.

(f) Ödünç vade tarihi

Vade tarihi yükümlülüklerin yerine getirildiği tarihtir.

3. Açığa Satış Verileri

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

(a) Menkul kıymet borsa kodu

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

(b) Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı

Açığa satış işlemlerinin toplam işlem miktarı iletilecektir.

(c) Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem miktarı

Sözleşmelerin toplam açığa satış işlem değeri iletilecektir.

O.FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA SORGU)

1. İşlem referansı

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

2. Üye kodu

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

P. FORM ALAN BAŞLIKLARI (KA YOĞUNLAŞMA RESPONSE)

1. Kredi Alım Yoğunlaşma Verileri

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

(a) Borsa Kodu

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

(b) Nominal değer (Rehin/Teminat Miktarı)

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



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

Nominal oran hesaplanırken aşağıdaki formül dikkate alınmıştır:

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

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

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

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



**MERKEZİ KAYIT
İSTANBUL**

Veri Depolama Direktörlüğü

İletişim:

T +90 212 334 57 00 / e-mail yrtsdestek@mkk.com.tr