

İçindekiler

Tanımlar	2
Platform	2
1. Raporlamaya İlişkin Genel Bilgiler	2
1.1. Raporlama Kapsamı	2
1.2. Üyelik İşlemleri.....	5
1.3. Raporlama Yöntemleri	7
1.4. Raporlama Yükümlülükleri.....	15
1.5. LEI (Legal Entity Identifier).....	16
2. Raporlama Alanlarına İlişkin Bilgiler.....	19
2.1. Sözleşmenin Tarafları.....	19
2.2. Sözleşme Türü ve Varlık Sınıfı	22
3. Raporlama Alanlarına İlişkin Teknik Bilgiler	23
4. Eşleşme Sürecine İlişkin Bilgiler	31
4.1. Eşleşme kapsamı	32
4.2. Eşleşme statüleri ve tolerans alanlarına ilişkin kurallar	32

SIKÇA SORULAN SORULAR

Tanımlar

LEI: 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.

VİOP: 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 göstergesi, belirlenen ileri bir tarihte, bugünden üzerinde anlaşılan fiyattan alma veya satma yükümlülüğü veren sözleşmelerdir.

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

Elektronik imza: 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.

XML Format: XML, interneti kullanarak veri alışverişi yapan sistemler ve platformlar arasındaki veri iletişimini standart hale getirmek için tasarlanan bir işaretleme dilidir.

Platform

1. Raporlamaya İlişkin Genel Bilgiler

1.1. Raporlama Kapsamı

Soru: Raporlamanın yasal dayanağı nedir? (20.11.2018)

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 İşlemler MKK'ya raporlanacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Yurtiçi ve yurtdışı organize ve tezgahüstü piyasalarda gerçekleştirilen türev işlemleri MKK'ya raporlanacaktır.

Soru: Türev Araçlarını tanımlayabilir misiniz? (20.11.2018)

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: Veri Deposu Platformu'na yapılacak raporlama kapsamı nedir? (20.11.2018)

Yanıt: Yurtiçi ve Yurtdışı organize ve tezgahüstü piyasalarda gerçekleşen tüm türev işlemleri e-VEDO Veri Deposu Platformu'na bildirilmelidir.

Soru: Kaldıraçlı İşlemler Platform'a raporlanacak mıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Kaldıraçlı İşlemler Platform'a raporlanmayacak olup, mevcut durumda olduğu gibi Takasbank'a raporlanacaktır. Ancak sermaye piyasası düzenlemelerine göre kaldıraçlı işlem olarak Takasbank'a bildirilen Fark sözleşmeleri Platforma da bildirilecektir.

Soru: İleri Vadeli Taahhütler Platform'a raporlanacak mıdır? (20.11.2018)

Yanıt: İleri vadeli taahhütler türev işlemi olmadığı için Platforma raporlanmayacaktır.

Soru: Platforma yapılacak raporlamanın içeriği müşteri ve banka işlemlerine ait tüm hazine işlemleri kapsamakta mıdır? (Spot, forward, swap, depo, bankalar arası kredi, IRS/CCS, opsiyon) (20.11.2018)

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

Soru: Raporlama başlangıç tarihi nedir? (Yatırım Kuruluşları dışındaki Tüzel Kişiler) (20.11.2018)

Yanıt: Türev işlemlerini, Türkiye'de yerleşik bir yatırım kuruluşu aracılığıyla gerçekleştirmeyen tüzel kişiler, 01.01.2019 tarihinde gerçekleştirdikleri işlemleri en geç 02.01.2019 tarihine kadar e-VEDO Platformuna iletmeleri gerekmektedir.

Soru: İşlem tarihinden sonra kaç gün içerisinde raporlama yapılması gerekmektedir? (Yatırım Kuruluşları dışındaki Tüzel Kişiler) (20.11.2018)

Yanıt: İşlem tarihinden itibaren en geç 1 iş günü sonrasına kadar raporlama yapılması gerekmektedir.

Soru: Raporlama Başlangıç Tarihi olan 30.11.2018 itibariyle açık olan sözleşmeler raporlanacak mıdır? Eğer raporlanacak ise hangi tarihe kadar e-VEDO Platformuna raporlanacaktır? (Yatırım Kuruluşları dışındaki Tüzel Kişiler) (20.11.2018)

Yanıt: Evet. 01.01.2019 tarihi itibariyle açık olan sözleşmeler en geç 31.01.2019 tarihine kadar raporlanmalıdır.

Soru: Yukarıda yer alan yükümlülükler dışında bildirilmesi gereken başka rapor bulunmakta mıdır? (Yatırım Kuruluşları dışındaki Tüzel Kişiler) (20.11.2018)

Yanıt: Evet. 01.01.2018 tarihinden sonra yapılmış ve 01.01.2019 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmeler en geç 31.01.2019 tarihine kadar raporlanmalıdır.

Soru: Nback bildirimlerinde kapanmış sözleşmelere ilişkin değerlendirme nasıl yapılmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: 03.12.2018 tarihli ve 842 Sayılı Genel Mektubumuzda belirtildiği üzere 01.01.2018 tarihinden sonra akdedilmiş ve 30.11.2018 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmelerin raporlanmasında, her bir sözleşme için değerlemenin "vade-1" gününe göre tek bir bildirimde yapılabilmesine Sermaye Piyasası Kurulu tarafından karar verilmiştir.

1.2. Üyelik İşlemleri

Soru: Sadece VİOP'ta işlem yapan yatırım kuruluşlarının Platform'a üye olması gerekli midir? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili işlemler Takasbank tarafından raporlanacağından, sadece VİOP'ta işlem yapan yatırım kuruluşlarının Platform'a üye olmasına gerek bulunmamaktadır. Ancak bu kurumların tezgahüstü ve yurtdışı piyasalarda işlem yapmaları durumunda üye olmaları zorunludur.

Soru: Yatırım Kuruluşları dışında hangi tüzel kişiler Platforma üye olmalıdır?(20.11.2018)

Yanıt: Yatırım Kuruluşları dışında aşağıdaki tüzel kişiler herhangi bir yatırım kuruluşunu kullanmadan 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 Bankasınca belirlenen firmalar.

Soru: e-VEDO Platformuna üyelik türleri nelerdir? (20.11.2018)

Yanıt: e-VEDO Platformda iki farklı üyelik tipi bulunmaktadır.

a. Genel Üyelik, kendilerinin taraf oldukları veya aracılık ettikleri işlemlerin yanı sıra bu işlemlerden bağımsız olarak üçüncü taraflar adına da raporlama hizmeti sağlamaya yetkili kuruluşlardır.

b. Doğrudan Üyelik, taraf oldukları işlemlere veya aracılık ettikleri işlemlere ilişkin raporlama yükümlülüklerini kendileri adına ve/veya aracılık edilen işlemin tarafı müşterileri adına yerine getiren kuruluşlardır.

Soru: Raporlama yükümlüsü kurumların e-VEDO Platformuna üyelik başvurusunda yerine getirmesi gereken şartlar nelerdir? (20.11.2018)

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**	√	√

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

m. a) *Tüzel kişinin Türkiye’de yerleşik olması (Noter tasdikli Ticaret Sicil Belgesi)*

n. b) *Raporlama işlemlerinin yapılmasını ve izlenmesini yürütecek personelden en az bir tanesinin Türev Araçları Lisansına sahip olması (Noter tasdikli olmalıdır.)*

o. 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*

p. ***Yönetim Kurulumuzun 24.05.2019 tarihli toplantısında alınan karar çerçevesinde, Piyasanın gelişimine katkıda bulunulması ve işlem taraflarının maliyetlerinin artırılmaması amacıyla 31.12.2019 tarihine kadar ücret alınmayacaktır.*

Soru: Platformda işlem yapacak temsilci türleri nelerdir? (20.11.2018)

Yanıt: Platformda işlem yapacak 2 tip temsilci bulunmaktadır:

Şirket Yetkilisi: Üyenin e-VEDO uygulamasında yetkilendirme onay yetkisine sahip temsilcisidir. En az bir kişi atanmalıdır. İlk şirket yetkilisi Kuruluşumuz tarafından tanımlanacaktır. Diğer şirket yetkilileri ise, Kuruluşumuz tarafından yetkilendirilen "Şirket Yetkilisi" tarafından tanımlanacaktır.

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 Yetkilisi" raporlama yetkililerini tanımlayacaktır. (Kuruluşumuz tarafından raporlama yetkililerine ilişkin herhangi bir tanımlama yapılmayacaktır.)

Soru: Platformda işlemler elektronik imzalı olarak mı yapılacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Evet. Platformda işlemler elektronik imzalı olarak yapılacaktır.

Soru: Üyelik Sözleşmenin imzalayacak yetkililer kimler olmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Platforma yapılacak raporlamalar üyelerin sorumluluğu olup, imza sirkülerinde sermaye piyasası işlemlerine ilişkin belgeleri imzalayacak en üst düzey yetkililer tarafından sözleşmenin imzalanması gerekmektedir.

Soru: Yatırım Fonları ve Emeklilik Yatırım Fonları Platform Üyesi olmalı mıdır? Bu kurumlar raporlama yükümlülüklerini devredebilirler mi? (20.11.2018)

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 Platforma üye olmak zorundadırlar. Fonlar bu yükümlülüklerini, Portföy Yönetim Şirketlerine devredebilirler. Bu durumda, Portföy Yönetim Şirketinin Platforma genel üye olarak başvurması gerekmektedir.

1.3. Raporlama Yöntemleri

Soru: İşlemler hangi Platform üzerinden MKK'ya raporlanacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Raporlama yükümlüsü kurumlar <https://evedo.mkk.com.tr/> adresinde yer alan e-VEDO Platformunu kullanarak raporlamalarını yapacaklardır.

Soru: Raporlama yöntemleri nelerdir? (20.11.2018)

Yanıt: Raporlama yükümlüleri üç farklı şekilde verileri raporlayabileceklerdir.

- a. Ekran üzerinden
- b. XML dosyası yükleme

c. Online Entegrasyon (.Devreye alınış tarihi ayrıca duyurulacaktır.)

Soru: Raporlamalar Platform'a ekran üzerinden mi aktarılacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Evet. Rapor yüklemeleri için özel bir ekran tasarlanmıştır. Üye temsilcileri elektronik imzalı olarak Platform'a giriş yaptıktan yüklemek istedikleri dosyayı (Dosyanın ZIP li olması gerekmektedir.) ilgili ekrandan Platform'a yükleyeceklerdir.

Soru: Platform'a yüklenecek dosyaların formatı csv mi olacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. Dosya formatı XML olacaktır.

Soru: Ekran yoluyla yapılan veri girişlerinde time out süresi kaç dakikadır? (20.11.2018)

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

Soru e-VEDO Platformuna raporlama yapılırken kullanılacak Eylem Tipleri Nedir?(20.11.2018)

Yanıt: Raporlama yapılırken kullanılacak Eylem Tipleri aşağıda yer almaktadır:

N (Yeni): Platforma yeni bir işlem veya pozisyonun raporlanmasında kullanılacak eylem tipidir.

M (Değişiklik): Platforma raporlanan bir işlem veya pozisyonun herhangi bir alanında değişiklik yapılmak istenmesi durumunda kullanılacaktır. Örneğin sözleşmenin veya pozisyonun vadesi değiştiğinde bu raporlama "M" olarak yapılacaktır. "M" olarak yapılacak raporlamalarda sözleşme veya pozisyonun tüm alanları tekrar girilmelidir.

E (Hata): Hatalı olarak raporlaması yapılan sözleşme veya pozisyonların iptal edilmesi için bu eylem tipi kullanılmalıdır.

C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma): Sözleşme veya pozisyonun vadesinde veya vadesinden önce sonlandırılması durumunda bu eylem tipi kullanılır.(Her gün açık işlem veya pozisyonlarını raporlayan yükümlülerin bir gün önce raporladıkları işle veya pozisyonları bu eylem tipi ile kapatmaları gerekmektedir.)

Z (Sıkıştırma): Daha önceden raporlanan sözleşmelerin toplulaştırılarak tek bir sözleşme haline getirilmesi ve yeni sözleşmenin Platforma raporlanması durumunda bu eylem tipi kullanılır. 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.

P (Pozisyon bileşeni): Bir türev araç sözleşmesi yeni bir işlem olarak raporlanması ve ayrıca aynı gün içinde raporlanan farklı bir pozisyona dâhil olması durumunda "pozisyon bileşeni" olarak tanımlanır. Bu değer sıkıştırmayı gösteren raporun güncellenmesini takiben raporlanan yeni işlemin değerine eşit olur.

D (Sözleşmenin Piyasa Değerini Değerleme): Platformda açık olan sözleşmelere veya pozisyonlara günlük olarak yapılacak değerlemeler sonucunda sözleşmenin piyasa değerindeki (mark to market) değişimler bu eylem tipi ile yapılacaktır.

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.

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.

Soru: N (Yeni) ve NBACK (Geçmişe Yönelik Raporlama) sözleşmelerine ilişkin örnek verebilir misiniz? (20.11.2018)

Yanıt:

Örnek1:

Sözleşme tarihi: 30.11.2018

Vade tarihi: 01.03.2019

N eylem tipi ile 30.11.2018den itibaren en geç 04.12.2018(T+2 olduğu için (01.01.2019 itibari ile bu süre T+1'e inecek) tarihine kadar raporlanması gerekmektedir.

Örnek 2:

Sözleşme tarihi: 01.01.2018

Vade tarihi: 01.03.2018

NBACK eylem tipi ile 01.01.2019 tarihine kadar raporlanması gerekmektedir.

Örnek 3:

Sözleşme tarihi: 01.01.2018

Vade tarihi: 31.12.2018

NBACK eylem tipi ile 01.01.2019 tarihine kadar raporlanması gerekmektedir.

Örnek 4:

Sözleşme tarihi: 01.01.2017

Vade tarihi: 31.12.2018

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? (20.11.2018)

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? (20.11.2018)

Yanıt:

- Manuel olarak yapılan sözleşme veya pozisyon raporlamalarında giriş ve onay aşamaları bulunmaktadır.
- XML olarak yapılan sözleşme veya pozisyon raporlamaları tek aşamalıdır.
- Manuel olarak yapılan sözleşme piyasa değerinin değerlendirilmesi veya teminat değerlendirme raporlamaları tek aşamalıdır.
- XML olarak yapılan sözleşme piyasa değerinin değerlendirilmesi veya teminat değerlendirme raporlamaları tek aşamalıdır.

Soru: İşlem bazında ve pozisyon bazında raporlamaları açıklayabilir misiniz? (20.11.2018)

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.

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 market-to-market ve teminat değerlemeleri günlük olarak nasıl bildirilecektir? (20.11.2018)

Yanıt: Bu konuda iki alternatif bulunmaktadır.

- a. **D (Sözleşmenin Piyasa Değerini Değerleme) ve CL (Teminat Değerleme)** Eylem Tipleri seçilerek günlük değerlemeler raporlanabilir.
- b. Her gün açık işlem bildirim yapılmaması durumunda ise, ilk önce **C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)** eylem tipi seçilerek açık olan işlem kapatılır. Daha sonra gün sonu itibarıyla açık işlemler **N (Yeni)** olarak raporlanır.

Soru: Pozisyon Bazında raporlamalarda işlemin günlük market-to-market ve teminat değerlemeleri günlük olarak nasıl bildirilecektir? (20.11.2018)

Yanıt: Bu konuda iki alternatif bulunmaktadır.

- a. **D (Sözleşmenin Piyasa Değerini Değerleme) ve CL (Teminat Değerleme)** Eylem Tipleri seçilerek günlük değerlemeler raporlanabilir.
- b. Her gün açık pozisyon bildirim yapılması durumunda ise, ilk önce **C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)** eylem tipi seçilerek açık olan pozisyon kapatılır. Daha sonra gün sonu itibarıyla açık pozisyonlar **N (Yeni)** olarak raporlanır.

Soru: Sözleşme ve Pozisyonlarda Piyasa Değeri (Market To Market) ve Teminat Değerlemelerini sözleşme veya pozisyonun vade tarihine kadar yapılmalı mıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Evet yapılmalıdır.

Soru: Vade tarihi gelen sözleşme ve pozisyonlar otomatik olarak sistem tarafından kapatılmakta mıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Güncel durumda kapatılmamaktadır. Raporlama yapanların vade tarihinde ilgili sözleşme ve pozisyonu C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) eylem tipi ile Platformda işlem yapması gerekmektedir.

Soru: Tebliğde yer alan "Sonlandırılmış" ve "Sonuçlandırılmış" kelimeleri neyi ifade etmektedir? Bu işlemler için hangi Eylem Tipi kullanılmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: "Sonlandırılmış" kelimesi sözleşmenin vadesinden önce erken sonlandırılmasını, "Sonuçlandırılmış" kelimesi ise sözleşmenin vade tarihinde takasının gerçekleştiğini 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 veri kullanılacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Sözleşme/Pozisyon Raporlamalarında taraf/nihai faydalanıcı olan gerçek kişilerin 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: Birden fazla müşterinin ortak olduğu bir hesap ile yapılan türev sözleşmelerine ilişkin raporlamalar nasıl yapılmalıdır? Ortak olarak açılan hesap üzerinde mi bildirim yapmalıdır? Yoksa hesabın ortaklarının ortaklık paylarına göre dağılımını mı raporlamalıyız? (20.11.2018)

Yanıt: Birden fazla müşterinin ortak olduğu bir hesaba ilişkin raporlamalarda, karşı taraf/karşı taraf nihai faydalanıcı olarak hesap ortaklarından sadece birisinin bilgileri yazılmalıdır.

Örneğin: X bankası, Ahmet Say ve Ayşe Say'ın müşterek olarak açtıkları bir hesap ile 500.000 Dolarlık bir swap sözleşmesi yapmışsa, X bankası raporlama yetkilisi Platforma bu işleme ilişkin raporlamayı Ahmet Say veya Ayşe Say ismine göre tek bir kayıta iletmelidir.

Soru: İki yatırım kuruluşu tarafından raporlaması gereken türev sözleşmelerinde, bir yatırım kuruluşu işlem bazında, diğer yatırım kuruluşu ise pozisyon bazında raporlama yapabilir mi? (20.11.2018)

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.

Soru: Her bir türev işlemi, BDDK raporlamasında alım ve satım bacaklarıyla iki satırda raporlanmaktadır. Platforma yapılacak raporlamalarda işlemler alım/satım yönleriyle iki satırda mı raporlanmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. Her bir işlem veya pozisyon tek bir satır olarak Platforma raporlanmalıdır.

Soru: Herhangi bir türev işlemi olmayan yatırım kuruluşlarından boş raporlama yapması istenmekte midir? (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. Türev işlemi olmayan kurumlardan Platforma herhangi bir raporlama yapması beklenmemektedir.

Soru: 30.11.2018'de açılan 1 ay vadeli bir fx forward işlemi (vade tarihi: 27.12.2018) 04.12.2018 tarihinde Eylem Tipi=N olarak raporlanacaktır. Bu işlemin vadesi boyunca yeniden raporlanmasını beklenmekte midir? (20.11.2018)

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

1. Yaşam Döngüsü:

- Tarih: 04.12.2018 Eylem Tipi= N (Yeni)
- Tarih: 05.12.2018 Eylem Tipi = D (Sözleşmenin Piyasa Değerini Değerleme) ve CL (Teminat Değerleme)
- Tarih Aralığı: 06.12.2018-27.12.2018 Eylem Tipi = D (Sözleşmenin Piyasa Değerini Değerleme) ve CL (Teminat Değerleme)
- Tarih: 28.12.2018 Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)

2. Yaşam Döngüsü:

- Tarih: 04.12.2018; Eylem Tipi= N (Yeni)
- Tarih: 05.12.2018; Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) ve N (Yeni)
- Tarih Aralığı: 06.12.2018-27.12.2018; Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma) ve N (Yeni)
- Tarih: 28.12.2018; Eylem Tipi = C (Sonlandırma/Erken Sonlandırma)

Soru: Nback bildirimlerinde kapanmış sözleşmelere ilişkin değerlendirme nasıl yapılmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: 03.12.2018 tarihli ve 842 Sayılı Genel Mektubumuzda belirtildiği üzere 01.01.2018 tarihinden sonra akdedilmiş ve 30.11.2018 tarihi itibarıyla sonuçlandırılmış ya da sonlandırılmış olan sözleşmelerin raporlanmasında, her bir sözleşme için değerlemenin "vade-1" gününe göre tek bir bildirimde yapılabilmesine Sermaye Piyasası Kurulu tarafından karar verilmiştir.

Soru: Platforma Dosya Yükleme konusunda dikkat edilecek hususlar nelerdir?(20.11.2018)

Yanıt: Platforma 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 bildirimleri barındıran dosyalar içerebilir.
- Bir bildirim dosyası (XML) en fazla 3000 adet aynı tipine ait bildirim içerebilir. Bir ZIP dosyasında birden fazla dosya bulunabilir. (Buradaki kısıt ZIP dosyasının en fazla 5MB olacağı şeklindedir. Bu da yaklaşık olarak 3.000 kayıttan 3 veya 4 dosyaya tekabül etmektedir.)
- Dosya isimlendirmelerinde standart bir prosedür söz konusu değildir.
- ZIP içerisindeki bildirim dosyalarının isimlendirmeleri sisteme aktarım sürecinde önem arz etmektedir: Dosyaların işlenmesi, alfabetik sırada gerçekleşmektedir.
- XML dosya karakter kodlaması (Unicode standartlarına göre) UTF-8 without BOM olmalıdır.
- Her bildirim dosyası başlığında bulunan **senderReference** bilgisi gönderen üye bazında tek olmalıdır.
- ZIP dosyalarının formatı Standart Windows ZIP olmalıdır. (Windows'da context menüde gelen ZIP özelliği)
- Eğer yukarıdaki maddelerden bir veya bir kaçında sorun oluşursa, ZIP dosyası tümüyle ret edilir.
- Yükleme sırasında görüntülenen durum çubuğu dosyalarda bulunan bildirimlerin sisteme aktarılmasını ifade etmektedir.
- Yükleme sırasında oluşan hatalar (!) işaret aracılığı ile hangi aşamada, nasıl bir hata aldığını göstermektedir.

Soru: Dosya yükleme ekranlarından yüklenen ZIP dosyasının başarılı bir şekilde yüklenmesi raporlama yükümlülüğünün yerine getirilmesi adına yeterli midir? (X.12.2018)

Yanıt: Hayır. ZIP dosyasının yüklenmesi sadece ilgili dosyanın Platform'a aktarılabilmesini göstermektedir, ilgili dosyanın başarılı bir şekilde yüklenmesi XML şemalarının validasyonu ile ilgilidir. ZIP dosyasının başarılı bir şekilde yüklenmesi, ilgili bildirimlerin başarılı bir şekilde sözleşmeye dönüştüğünü göstermemektedir.

Hatalı / hatasız bildirimlerin öğrenilebilmesi için "Bildirim İzleme" ekranlarından ilgili kriterlerden biri seçilerek sorgulama yapılmalıdır. Sorgulama sonucunda ekranda toplamda 100 kayıt görünürken, bildirilen tüm kayıtlar (5000 kayıt sınırı bulunmaktadır) "excele aktar"

seçeneđi ile detaylarıyla incelenebilmektedir. Durumu "onaylandı" olarak görünen kayıtlar başarılıdır ve sadece "hata aldı" olarak görünen kayıtlar tekrar gönderilmelidir.

Soru: Geçmişe yönelik raporlama yaparken işlemlerin dönemsel olarak bölünerek farklı dosyalarda gönderilmesi gerekir mi? (X.12.2018)

Yanıt: XML dosyasında yer alabilecek azami işlem sayısı göz önünde bulundurularak hepsi Nback eylem tipinde olduđu sürece aynı dosyada gönderilebilir.

Soru: Manuel ekranlarda Nback eylem tipi bulunmamaktadır. Dosya yükleme seçeneđi dışında geçmişe yönelik bildirimleri nasıl gerçekleştirilmektedir? (X.12.2018)

Yanıt: Dosya yükleme metoduyla yapılan geçmişe yönelik bildirimler, eylem tipi alanı (actiontype) "NBack" seçilerek yapılabilmektedir. Manuel ekranlarda ise Nback için ayrı bir ekran yer almamakta olup, geçmişe yönelik bildirimler "Bildirim Giriş (N)" ekranları üzerinden gönderilmelidir. Sistemimiz, ilgili bildirim N-Nback ayrımını sözleşmenin gerçekleştirildiđi tarih değeri üzerinden otomatik algılamaktadır.

1.4. Raporlama Yükümlülükleri

Soru: Hangi kurumlar yükümlülük kapsamındadır? (20.11.2018)

Yanıt: Türev işlem tarafı tüzel kişiler, işlemlere aracılık eden yatırım kuruluşları ve merkezi karşı taraf hizmeti veren kuruluşlar raporlama yükümlüğüne tabiidir.

Soru: Yurtiçi organize piyasalarda yapılan türev işlemlerinin raporlama yükümlüsü hangi kurumdur? (20.11.2018)

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

Soru: e-VEDO Platformuna raporlama yükümlülüđünü taraflar ve piyasa bazında açıklayabilir misiniz? (20.11.2018)

Yanıt: Raporlama yükümlülükleri taraflar ve piyasa bazında bu dokümanın ekinde yer almaktadır. (Ek-1)

Soru: Raporlama yükümlüsü taraflar, bu yükümlülüklerini devredebilirler mi? (20.11.2018)

Yanıt: Evet devredebilirler. Raporlama Tebliđi 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.

Örnek1: X bankası ile Y bankasının arasında gerçekleşen bir opsiyon işlemi;

- a. X Bankası tarafından
- b. Y Bankası tarafından
- c. Platforma genel üye olan Z kuruluşu tarafından raporlanabilir.

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

- a. X Bankası tarafından
- b. Platforma genel üye olan Z kuruluşu tarafından raporlanabilir.

Not: Raporlama yükümlülüğünün devri, yükümlülüğün devredildiği taraflar arasında imzalanacak bir sözleşme ile gerçekleştirilir. Bu devir, yükümlülüğe tabi tarafın sorumluluğunu ortadan kaldırmayacaktır.

1.5. LEI (Legal Entity Identifier)

Soru: Raporlamalarda Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) kullanımı zorunlu mudur? (Yatırım Kuruluşları) (20.11.2018)

Yanıt: Yatırım Kuruluşlarının e-VEDO Platformuna üyelik başvurusu sırasında veya taraf oldukları işlemler/pozisyonların raporlanmasında kullanılmak üzere LEI kodunu Kuruluşumuza ve/veya Platforma iletmeleri zorunludur.

Soru: Raporlamalarda Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) kullanımı zorunlu mudur? (Yatırım Kuruluşları dışındaki tüzel kişiler) (20.11.2018)

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.

Soru: Yatırım kuruluşları dışındaki tüzel kişilerin LEI kodu alması zorunlu mudur? (20.11.2018)

Yanıt: Evet zorunludur.

Soru: Raporlama sırasında LEI kodu olmayan tüzel kişilerin LEI kodu alması için belirlenmiş bir süre var mıdır? (20.11.2018)

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.

Soru: Karşı Taraf Kimlik Kodu alanında yurtdışı ve yurtiçi kurumlarla yapılan türev işlemlerde LEI kodları Takasbank A.Ş. den mi, yoksa doğrudan işlem yapılan karşı taraftan mı alınacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Karşı taraf kimlik kodu alanına girişi yapılacak LEI kodu türev sözleşmesinin karşı tarafından öğrenilmelidir.

Soru: LEI kodu alması zorunlu olan Tüzel Kişiler kimlerdir? (20.11.2018)

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 tüzel kişiler (Kanun kapsamındaki halka açık anonim ortaklıklar, kolektif yatırım kuruluşları, portföy yönetim şirketleri, ipotek finansmanı kuruluşları, konut finansmanı ve varlık finansmanı fonları, varlık kiralama şirketleri, 19.10.2005 tarihli ve 5411 sayılı Bankacılık Kanunu uyarınca yetkilendirilen finansal kuruluşlar, 03.06.2007 tarihli ve 5684 sayılı Sigortacılık Kanunu uyarınca ruhsat verilen sigorta ve reasürans şirketleri, 28.03.2001 tarihli ve 4632 sayılı Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu uyarınca ruhsat verilen emeklilik şirketleri, 21.11.2012 tarihli ve 6361 sayılı Finansal Kiralama, Faktoring ve Finansman Şirketleri Kanunu uyarınca yetkilendirilen finansal kiralama şirketleri, faktoring şirketleri ve finansman şirketleri ile 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 Bankasınca belirlenen firmalar) mi LEI kodu almak zorundadır? (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. 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? (20.11.2018)

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

Soru: Taraf ve karşı taraf kodlarının sıralaması nasıl olmalıdır? (20.11.2018)

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? (20.11.2018)

Yanıt: Tebliğ ile Tüzel kişilerin LEI kodu kullanması zorunlu hale getirilmiştir. Tebliğde belirtilen sürelerde LEI kodu almayan tüzel kişilere ilişkin Kurul'a bildirim yapılacaktır.

Soru: Tüzel Kişi Kimlik Kodu (LEI-Legal Entity Identifier) olmayan tüzel kişilere ilişkin sözleşme/pozisyon raporlamalarında hangi veri kullanılacaktır? (21.11.2018)

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; 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? (20.11.2018)

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 yetkilileri aşağıda yer almaktadır:

Selin Uçar 0 212 315 20 71

Damla Gümüştekin 0 212 315 20 70

İrfan Kaya 0 212 315 20 31

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

2. Raporlama Alanlarına İlişkin Bilgiler

2.1. Sözleşmenin Tarafları

Soru: "ReportingCounterpartyId (Raporlayan Kurumun Kimlik Kodu)" LEI kodundan farklı bir değer alabilir mi? (Vergi Numarası, MKK Sicil Numarası vb.) (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. Raporlama yapan üyelerimiz e-Vedo Platformuna üyelik başvurusunda LEI koduna sahip olması gerekmektedir.

ReportingCounterpartyId (Raporlayan Kurumun Kimlik Kodu)

Soru: "ReportingCounterpartyId (Raporlayan Kurumun Kimlik Kodu)" LEI kodundan farklı bir değer alabilir mi? (Vergi Numarası, MKK Sicil Numarası vb.) (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. Raporlama yapan üyelerimiz e-Vedo Platformuna üyelik başvurusunda LEI koduna sahip olması gerekmektedir.

counterpartyIdType: Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu Türü (Taraf)

counterpartyId: Sözleşme Tarafının Kimlik Kodu (Taraf)

nameOfTheCounterparty: Sözleşme Tarafının Ticaret Unvanı ya da Adı (Taraf)

Soru: Yatırım kuruluşlarının sözleşmenin tarafı/karşı tarafı olması durumunda "counterpartyIdType" alanında hangi kimlik kodu türü olmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Yatırım kuruluşlarının sözleşmenin tarafı olması durumunda "counterpartyIdType"/"othercounterpartyIdType" alanında mutlaka LEI kodu olması gerekmektedir.

Soru: Yatırım kuruluşları dışındaki tüzel kişilerin sözleşmenin tarafı/karşı tarafı olması durumunda "counterpartyIdType"/"othercounterpartyIdType" alanında hangi kimlik kodu türü olmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alanda LEI kodu kullanılır. Raporlama tarihi itibariyle LEI kodu olmayan tüzel kişiler, LEI kodu temin edilinceye kadar, bu kişilere ait MKK sicil numarası, MKK sicil numarasının bulunmadığı durumlarda vergi kimlik numarası; bunların bulunmadığı durumlarda, bu kişilere ait ISO 9362 ile uyumlu BIC Kodu, BIC Kodunun bulunmadığı durumlarda ise müşteri numarası kullanılır.

countryTheCounterparty Sözleşme Tarafının Yerleşik Bulunduğu Ülke (Taraf)

countryOfTheOtherCounterparty Sözleşmenin Karşı Tarafının Yerleşik Bulunduğu Ülke (Karşı Taraf)

Soru: Bu alanların doldurulmasında kullanılan standart nedir? (20.11.2018)

Yanıt: Bu alanlarda ISO 3166 ile belirlenen 2 haneli kod kullanılmalıdır.

othercounterpartyIdType: Sözleşmenin Karşı Tarafının Kimlik Kodu Türü (Karşı Taraf)

othercounterpartyId: Sözleşme Karşı Tarafının Kimlik Kodu (Karşı Taraf)

nameOfTheOtherCounterparty: Sözleşme Karşı Tarafının Ticaret Unvanı ya da Adı (Karşı Taraf)

Soru: Bu alanlarda yer alabilecek değerler nelerdir? (20.11.2018)

Yanıt: Sözleşmeye finansal kuruluşun (Sermaye Piyasası Kanunu veya Bankacılık Kanunu veya Sigortacılık Kanunu ve Bireysel Emeklilik Tasarruf ve Yatırım Sistemi Kanunu veya Finansal Kiralama, Faktoring ve Finansman Şirketleri Kanunu uyarınca faaliyet gösteren kurumlar) taraf olması durumunda (F), Finansal olmayan Tüzel kişilerin (Tebliğde yer alan NACE kodları kullanılarak belirlenen 21 Grup) olması durumunda (N) Merkezi Karşı Taraf olması durumunda C ve bunun dışındaki taraflar ise O olarak tanımlanır.

Soru: Sözleşmenin taraflarından bir tanesinin yurtdışında yerleşik bir finansal kuruluş olması durumunda ilgili alanda hangi kod olacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alana "O" verisi giriş yapılacaktır.

Soru: Sözleşme taraflarından bir tanesinin gerçek kişi olması durumunda ilgili alan nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alana "O" verisi giriş yapılacaktır.

Soru: Sözleşme taraflarından bir tanesinin yurtdışında faaliyet gösteren merkezi karşı taraf olması durumunda ilgili alan nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alana "C" verisi giriş yapılacaktır.

corporateSector Sözleşmenin Tarafının Sektörü (Taraf)

otherCorporateSector Sözleşmenin Karşı Tarafının Sektörü

Soru: Mevduat bankaları için hangi kod seçilecektir? (20.11.2018)

Yanıt: Mevduat bankaları için "MB" kodu kullanılacaktır.

Soru: Aracı kurumlar için hangi kod seçilecektir. (20.11.2018)

Yanıt: Aracı kurumlar için "AK" kodu seçilecektir.

Soru: Akdeniz Tarım Ürünleri A.Ş. için hangi kod seçilecektir? (20.11.2018)

Yanıt: Akdeniz Tarım Ürünleri A.Ş. için "1" seçilecektir.

beneficiaryIdType: Nihai Faydalanıcının Kimlik Kodu Türü (Taraf)

beneficiaryId Nihai Faydalanıcının Kimlik Kodu (Taraf)

beneficiaryName Nihai Faydalanıcının Unvanı (Taraf)

otherBeneficiaryIdType Nihai Faydalanıcının Kimlik Kodu Türü (Karşı Taraf)

otherBeneficiaryId Nihai Faydalanıcının Kimlik Kodu (Karşı Taraf)

otherBeneficiaryName Nihai Faydalanıcının Unvanı (Karşı Taraf)

Soru: Yatırım Kuruluşu'nun portföyüne yaptığı işlemlerde ilgili alanlar nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Nihai faydalanıcı olarak Yatırım Kuruluşu'nun bilgileri tekrar girilecektir.

Soru: Nihai faydalanıcının bilinmediği durumlarda ilgili alanlar nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Nihai faydalanıcının bilinmediği durumlarda ilgili alanlara sözleşmenin karşı tarafının bilgileri tekrar girilecektir.

Soru: Sözleşme tarafının gerçek kişi olduğu durumlarda bu alan nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Gerçek kişinin bilgileri bu alanlara tekrar girilecektir.

tradingCapacity / Sözleşmenin Yapılış Türü (Taraf)

otherTradingCapacity / Sözleşmenin Yapılış Türü (Karşı Taraf)

Soru: İlgili alanları nihai faydalanıcı alanında yer alan değerlere göre doldurunuz. (20.11.2018)

Yanıt:

- Nihai faydalanıcının aynı zamanda işlem tarafı olması durumunda "P"
- Nihai faydalanıcının işlem tarafı olmaması durumunda "A" (Aracı alanı sözleşme tarafı olacak şekilde doldurulacaktır.)
- Nihai faydalanıcının müşteri olması durumunda (T) (Aracı alanı boş geçilecektir.)

brokerIdType / Aracılık Edenin Kimlik Kodu Türü

brokerId / Aracılık Edenin Kimlik Kodu

brokerName / Aracılık Edenin Unvanı

Soru: İlgili Alan hangi koşullarda doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: Nihai faydalanıcının sözleşme tarafından farklı olması durumunda, bu alan sözleşme tarafının bilgisi girilecektir. Aracılık işleminin olmadığı durumlarda ilgili alan boş bırakılacaktır.

Sözleşmeyi Gerçekleştiren Birim (Karşı Taraf)

Sözleşmenin Yapılış Türü (Karşı Taraf)

Müşteri Limiti (Karşı Taraf)

İşlemin Ticari Amaçlı Yapılması Veya Hazine İşlemi Olması Durumu (Karşı Taraf)

Sözleşmenin Risk Grubu Kodu (Karşı Taraf)

Yatırım Kuruluşunun İşlemi Yapma Amacı (Karşı Taraf)

Yatırım Kuruluşu Dışındaki Tarafların İşlemi Yapma Amacı (Karşı Taraf)

Soru: Karşı tarafa ilişkin yukarıdaki alanlar nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: 842 Sayılı Genel Mektupta belirtildiği üzere Raporlama Tebliği'nin ekinde "zorunlu alan" olarak belirlenen yukarıdaki alanların 01.02.2019 tarihine kadar "opsiyonel alan" olarak kabul edilmesine Sermaye Piyasası Kurulu tarafından karar verilmiştir.

2.2. Sözleşme Türü ve Varlık Sınıfı

Soru: Raporlanacak sözleşmelerde "Sözleşme Türü" ve "Varlık Sınıfı"na ilişkin örnekler verebilir misiniz? (X.11.2018)

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

Sözleşme Türü	Varlık Sınıfı
---------------	---------------

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

3. 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 yukarıdaki tablodaki hangi ikili seçilmelidir? (20.11.2018)

Yanıt: Sözleşme Türü: SW (Swap)-Varlık Sınıfı: CU Para Birimi (Not: İlgili sözleşme türünün içerisinde faiz pozisyonlarının da bulunması halinde faiz alanlarının da doldurulması beklenmektedir.)

Soru: Döviz Forward Sözleşmeleri için yukarıdaki tablodaki hangi ikili seçilmelidir? (20.11.2018)

Yanıt: Sözleşme Türü: FW (Forward)-Varlık Sınıfı: CU Para Birimi

Soru: Interest Rate Swap Sözleşmeleri için yukarıdaki tablodaki hangi ikili seçilmelidir? (20.11.2018)

Yanıt: Sözleşme Türü: SW (Swap)-Varlık Sınıfı: IR (Faiz Oranı)

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? (20.11.2018)

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

Soru: XML formatında opsiyonel alanlara ilişkin tagler nasıl doldurulmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: Opsiyonel alanlara herhangi bir veri girişi yapılmaması durumunda, herhangi bir tag kullanılmadan diğer alanlara geçiş yapılmalıdır.

Soru: Ürün ve varlık sınıflandırma ve kod türleri için geçen ISIN, AII, CFI kodları için örnek verebilir misiniz? (20.11.2018)

Yanıt: Mevcut durum itibarıyla ISIN, AII ve CFI kod kullanımı opsiyonel olup, önümüzde dönemde bu alanlara ilişkin veri girişleri sağlanacaktır.

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? (20.11.2018)

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

Soru: "Raporlama Zaman damgası" ile ilgili "EK-2 E-Vedo Dosya Formatları" dosyasında herhangi bir açıklama bulunamamıştır. Bu bilgi dokümanda hangi alana karşılık gelmektedir? Raporla nerede kullanılmalıdır? (20.11.2018)

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

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

SenderMessageRef (Bildirim 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? (21.11.2018)

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 3 farklı sözleşmeye/pozisyona ait bilgilerin yer aldığı dosyanın tek bir "SenderReference" numarası, 3 tane "SenderMessageRef" numarası 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? (20.11.2018)

Yanıt: Hayır. İki tarafın da Raporlama yükümlüsü olduğu işlemlerde "SenderMessageRef" bilgisinde tekillik aranmamaktadır.

Soru: "ReportTrackingNumber" üyeler tarafından mı üretilmektedir? (20.11.2018)

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

Channel (Mesajın/dosyanın gönderildiği kanal)

Soru: Bu alanın alabileceği değerler nelerdir? (20.11.2018)

Yanıt: Bu alan iki değer alabilmektedir.

- WS: Web Service(Online Entegrasyon) (Önümüzdeki yıl devreye alınacaktır.)
- FU: File Upload (Dosya Yükleme)

BothSideFlag (Bildirim iki taraf adına da mı yapılıyor?)

Soru: Sadece bir yatırım kuruluşu veya tüzel kişinin raporlama yükümlüsü olduğu sözleşme/pozisyon raporlamalarında ilgili alan nasıl doldurulmalıdır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alan "F" (False) olarak doldurulmalıdır.

Soru: Sözleşmenin/Pozisyonun iki tarafının da raporlama yükümlüsü olduğu sözleşme/pozisyon raporlamalarında ilgili alan nasıl doldurulmalıdır? (20.11.2018)

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 (False) olarak doldurulmalıdır.

Soru: BothsideFlag alanını T (True) olarak raporlayan raporlama yükümlüsü sözleşmenin taraf ve karşı tarafını raporlamak zorunda mıdır? (20.11.2018)

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? (20.11.2018)

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? (20.11.2018)

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

Örnek1: X Bankası ile Ali Atasoy arasında gerçekleşen bir türev işleminde X Bankası'nın Ali Atasoy'a kendi sisteminde tanımlamış olduğu limit "clientLimit Müşteri Limiti (Taraf)" alanına yazılacaktır." otherClientLimit Müşteri Limiti (Karşı Taraf)" verisi ise "0" olarak girişi yapılacaktır.

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. Y Bankası'nın X Bankası'na tanımladığı limit ise " otherClientLimit Müşteri Limiti (Karşı Taraf)" verisi ise "0" olarak girişi yapılacaktır.

Soru: Müşteri limitinin tahsis edilmediği durumlarda ilgili alanlar nasıl doldurulacaktır? (20.11.2018)

Yanıt: İlgili alanlara "0" yazılacaktır.

Soru: Merkez Bankası ile yapılan işlemler bildirilmeli midir? Bildirim söz konusu ise müşteri limiti ve sözleşmenin türü alanlarına hangi değerler girilmelidir? (X.12.2018)

Yanıt: Evet, bildirilmelidir. Müşteri limiti alanına tarafın TCMB'deki limitinin girilmesi beklenmektedir. Böyle bir limit söz konusu değil ise, ilgili alan "0" girilebilir. Tarafın TCMB olduğu sözleşmelerde ilgili tarafın sözleşme türü Diğer - "0" seçilmelidir.

counterpartySide Sözleşme Tarafının Alıcı veya Satıcı Olma Durumu (Taraf)

Soru: Sözleşmelerde alıcı satıcı taraf durumu nasıl belirlenmektedir? (21.11.2018)

Yanıt: Bütün sözleşmelerde alfabetik olarak ilk gelen ürüne göre alıcı/satıcı pozisyonunuz belirlenmektedir. (Alım satımını yaptığınız döviz paritesi alfabetik olarak sıralandığında önce gelen kur için pozisyon ne ise alıcı/satıcı durumu ona göre yazılmalıdır.)

Örnek1: USD alıp TRY satıyoruz. **TRY alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız.**

Örnek2:EUR alıp USD satıyoruz. **EUR alfabetik olarak önce geldiği için alıcısınız.**

Örnek 3: GBP alıp EUR satıyoruz. **EUR alfabetik olarak önce geldiği için satıcısınız.**

Örnek 4: Sabit faiz (fixed rated) alıp değişken faiz (floating rate) satıyorsunuz. Burada alıcısınız.

ValuationDate / Değerleme Tarihi

Soru: Hala açık olan sözleşmelere ait değerlendirme yaparken "valuationDate" alanına hangi tarih girilmelidir? (X.12.2018)

Yanıt: Değerleme tarihi, bildirim tarihi ya da bildirim tarihinden bir iş günü öncesi için seçilebilmektedir. Kapalı sözleşmeler için değerlendirme ekranları kullanılamamaktadır, dolayısıyla sonlandırma eylem tipi ile bildirim yapılırken ilgili alanlara ait güncel değerlerin girilmesi beklenmektedir.

Soru: Valuation date (değerleme tarihi) alanı için saat bilgisi tutulmuyorsa valuation time (değerleme zamanı) alanı nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: Bu durumda saat bilgisi ilgili gün için 00:00:00 olarak gönderilebilir.

Price/Rate

Soru: Fiyat/oran alanı nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

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

Clearing Treshold

Soru: Takas eşiği alanı boş bırakılabilir mi? (X.12.2018)

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

directlyLinkedToComAct

otherLinkedToComAct

Soru: İlgili alanların format açıklamalarında yer alan "Ticari amaçlı (T)" ve "Hazine işlemi (H)" neyi ifade etmektedir? (X.12.2018)

Yanıt: Alım-satım amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar için "T", riskten korunma amaçlı portföye dahil edilen türev araçlar için ise "H" değeri girilmelidir.

ccpID / MKT

ccpTitle / MKT Unvanı

Soru: Bu alanlar borsada yapılan işlemler için mi doldurulmalıdır? (X.12.2018)

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? (X.12.2018)

Yanıt: Reeskont tutarı alanında türev işlemlerin gelir ve gider reeskontları belirtilir. Reeskont alanı için, bankalarca BDDK'ya bildirilen BD111GS raporunda bildirilen şekilde raporlama yapılmalıdır.

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.

Teminatlandırma ilişkin alanlar

Soru: Gönderilen Değişim Teminatı alanına negatif değer girilebilir mi? (X.12.2018)

Yanıt: Değişim teminatlarına pozitif değer girilmelidir.

Soru: collateralPortfolioCode alanı nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: Tarafınızdan serbestçe belirlenecek bir koddur. Burada dikkat edilmesi gereken husus, aynı müşterinin farklı sözleşmelerde belirtilen portföy kodu bilgilerinin ve teminat tutarlarının aynı olmasıdır. İlgili yeknesaklığı sağlamak için portföy kodu alanına, müşteriyi tanımlayacak bir karakter veya sıra numarası verilebilir.

Soru: Teminatlandırmanın portföy bazında yapıldığı durumlarda başlangıç teminatı ve sürdürme teminatı için ayrı bir data tutulmamaktadır. Bu nedenle ilgili iki alan nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

Yanıt: Portföy bazında teminatlandırma bilgisi girilebilir. Aynı müşteri, aynı portföy ve aynı toplam portföy değerinin girilmesi gerekmektedir. Bu durumda, ilgili değer sadece başlangıç teminat alanına girilebilir.

settlementDate / Teslim Tarihi

Soru: Swap işlemlerine ait ara ödeme dönemleri için bu alan nasıl doldurulmalıdır? (X.12.2018)

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.

Soru: Sıkıştırma eylem tipi hangi amaçla kullanılmaktadır? (X.12.2018)

Yanıt: Sıkıştırma eylem tipi belli bir işlem hacminin üzerinde olan raporlamalar için geçerlidir. Aynı taraf, aynı vade ve aynı ürünler için tek ve net bir bildirim yapılması şeklinde kullanılmaktadır.

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

Soru: otherHedgeInfo alanı nasıl doldurulmalıdır ve bu alana ilişkin kurallar nelerdir? (xx.xx.2019)

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.

exchangeRateBasis1 / Para Birimi Çifti 1

exchangeRateBasis2 / Para Birimi Çifti 2

notional / Nominal

notionalCurrencyI / Nominal Para Birimi I

notionalCurrencyII / Nominal Para Birimi II

**Soru: Nominal ve nominal para birimlerine ilişkin bilgiler nasıl doldurulmalıdır?
(X.04.2019)**

Yanıt: e-VEDO Platformuna yapılan raporlamaların incelenmesi ve üyeler ile yapılan görüşmeler neticesinde "Nominal Alan" Bilgisinin raporlanmasında yeknesaklık sağlanamadığı tespit edilmiştir. Uluslararası uygulamalar ile düzenleyici ve denetleyici kuruluşlar ile yapılan görüşmeler neticesinde, sözleşmelerde ilgili alan ve buna bağlı olarak doldurulması gereken alanların 01.04.2019 tarihinden aşağıdaki şekilde raporlanmasına karar verilmiştir.

- a. Nominal Para Birimi-I: İngilizce alfabetik sıraya göre (ISO kodu) İlk gelen para birimi. (Zorunlu Alan)
- b. Nominal Para Birimi-II: İngilizce alfabetik sıraya göre (ISO kodu) ikinci gelen para birimi (Opsiyonel Alan)

Yukarıdaki alanlar ve 1 numaralı maddede yer alan verilerin doldurulmasına ilişkin örnekler aşağıda yer almaktadır.

- i. Para birimine dayalı sözleşmeler için

Örnek: 13.02.2019 tarihinde yapılan EUR/USD Forward işleminde raporlayan taraf 1.130.000 USD satmakta ve 1.000.000 EUR almaktadır. Buna göre ilgili alanlar aşağıdaki gibi doldurulmalıdır.

Nominal Para Birimi-I: EUR (EUR İngilizce alfabetik olarak USD'den önce gelmektedir.)

Nominal Para Birimi-II: USD (USD İngilizce alfabetik olarak EUR'dan sonra gelmektedir.)

Nominal: 1.000.000 (EUR İngilizce alfabetik olarak USD'den önce gelmektedir.)

- ii. Diğer sözleşmeler için

Nominal Para Birimi-I: Sözleşmeden doğan ödemelerin belirlendiği para birimi

Nominal: Sözleşmeden doğan ödemelerin belirlendiği referans tutar

güncellenmemektedir. Üyelerimiz tarafından talep edildiği takdirde bu alanlara ilişkin geçmişe yönelik olarak değer girilebilmektedir.

4. Eşleşme Sürecine İlişkin Bilgiler

Soru: Hangi işlemler eşleşmeye tabi tutulacaktır? Hangi işlemler eşleşmeye tabi tutulmadan otomatik olarak eşleşmiş kabul edilecektir? (20.11.2018)

Yanıt: Aynı sözleşme ve pozisyona ilişkin iki yatırım kuruluşunun raporlama yükümlülüğü bulunuyorsa bu işlem/pozisyon eşleşme sürecine girecektir. Bu işlemi taraflardan bir tanesi iki taraf adına bildirim yapması durumunda ise eşleştirme sürecine girilmeyecektir. Sözleşme ve pozisyon yükümlüğü sadece bir tarafa ait ise bu sözleşmeler/pozisyonlar Platforma raporlandığında otomatik olarak eşleşmiş kabul edilecektir.

Soru: Hangi alanlar eşleşme kapsamına girmektedir? (X.X.2019)

Yanıt: Aşağıdaki alanlar eşleşme kapsamına girmektedir.

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-1	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
------------------	----------------------------------	---	-------------

- Eşleşmeyen sözleşmeler sonlandırılmaz.
- Eşleşen sözleşmeler silinemez.

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 mutabakatına ilişkin soruların evedo@mkk.com.tr mail adresine iletilmesi rica olunur.

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)

Eşleşme, "**tradeId**" (İşlem Kodu) + "**counterpartyId**" (**Sözleşme tarafının kimlik kodu**) + "**otherCounterpartyId**" (**Sözleşmenin karşı tarafının kimlik kodu**) alanları kullanılarak yapılmaktadır.

4.2. Eşleşme statüleri ve tolerans alanlarına ilişkin kurallar

Ön eşleşme: CounterpartyID + TradeID + OtherCounterpartyID alanları üzerindeki kontrol.

Eşleşme: Eşleşme tolerans alanları üzerindeki kontrol.

Eşi Girilmedi: Ön eşleşmeden geçmeyen ya da eşi girilmeyen sözleşmeler.

Eşleşmedi: Ön eşleşmeden geçen fakat eşleşme toleranslarını sağlamayan sözleşmeler.

Eşleşti: Ön eşleşme ve eşleşmeyi sağlayan sözleşmeler.

Otomatik eşleşti: Eşleşme kapsamı dışında olan sözleşmeler.

- "Eşi girilmedi" statülü sözleşmeler sonlandırılmaz.
- "Eşleşti" statülü sözleşmeler silinemez.

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.

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

Tam eşleşme: En kapsamlı eşleşme kriteri olup, karşılıklı girilen değerlerin tam olarak aynı olması beklenmektedir.

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, virgün 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 tamamlanmalıdır. Tarih kontrolü, EligibilityDate (Raporlamanın gerçekleştirildiği tarih) alanı üzerinden yapılacak olup, 7 iş günü içerisinde eşleşmeyen sözleşmelerin durumu "Eşi girilmedi" olarak görünmektedir. Periyodun dolduğunu belirten uyarı mesajı, sözleşme izleme ekranlarında sorgulanabilen bu kaydın üzerine tıklandığında açılan pop-up üzerinde yer almaktadır.