

# TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI

ANONİM ŞİRKETİ  
SERMAYESİ : TL. 25.000.000.000  
İDARE MERKEZİ : ANKARA

İ D A R E M E R K E Z İ

ANKARA, 25 Şubat 2003

Cevaplarda şu işaretlerin tekrarını dileriz :  
B.02.2.TCM.0.093.00.03-13  
İstatistik Genel Müdürlüğü  
Bankacılık Verileri Müdürlüğü

## SAYIN GENEL MÜDÜRÜN DİKKATİNE

İlgi: 16.04.2002 ve 26.04.2002 tarihli yazılarımız.

İlgide kayıtlı yazılarımız doğrultusunda İMKB Tahvil Bono Piyasası işlem hacimleri göz önüne alınarak tespit edilen 40 aracı kurumdan kendileri ve müşterileri adına yapmış oldukları işlemler nedeniyle İMKB Takasbank A.Ş.'nde ve yurtdışında saklamada tuttıkları Devlet Borçlanma Senetlerinin (DBS) miktar, tür, para cinsi ve mülkiyet sahipliği ile ilgili haftalık raporlar alınmaktadır.

Sözkonusu raporlamanın 7 Mart 2003 tarihinden itibaren **tüm aracı kurumlarca yapılması uygun görülmüş olup**, içeriği yeniden düzenlenen raporlama tablosunun yeni şekli ve açıklaması yazımız ekinde gönderilmektedir. Sözkonusu tablo ve açıklama, raporlama yapan biriminiz ilgisinin e-posta adresine de gönderilecektir. Daha önce raporlama kapsamında olmayan aracı kurumların, yazımızı almalarını müteakip aşağıda belirtilen adrese e-posta adreslerini bildirmeleri üzerine kendilerine de raporlama dosyası kısa sürede iletilecektir.

Raporlamanın, 7 Mart 2003 gününden başlamak üzere, her haftanın son iş günü kapanış itibariyle **Excel ortamında** hazırlanmak suretiyle, en geç takip eden haftanın **Çarşamba günü saat 12:00'a kadar** dosyanın form açıklamasında belirtildiği şekilde adlandırılmış olarak **dbst@tcmb.gov.tr** e-posta adresine gönderilmesini, halihazırda tarafımıza haftalık rapor göndermekte olan aracı kurumların mevcut formatlı raporlamayı 21 Mart 2003 tarihine kadar bir süre daha yeni rapor ile birlikte devam ettirmelerini ve bu tarihten sonra ise sadece yeni raporu göndermelerini rica ederiz.

TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI

İdare Merkezi

Ek. Tablo ve açıklaması..

**1. FORM KODU: MD102H****2. FORM ADI: MENKUL DEĞERLER HAFTALIK BİLGİ FORMU****3. PARA BİRİMİ: BİN TL (Yatırım Fonu Katılım Belgelerine ilişkin Nominal Değer-ADET ve Hisse Senetlerine İlişkin Nominal Değer-TL üzerinden doldurulacaktır)**

**4. FORMUN AMACI:** Bu form, raporlayan aracı kurumun mülkiyetinde bulunan menkul kıymetler ile yurtiçi ve yurtdışında yerleşik çeşitli kesimleri temsil eden yatırımcı müşterilerine; gerek kendisinin doğrudan satış yapması neticesinde yaptığı saklama hizmetine, gerekse müşteri talimatı ile bir başka aracı kuruluştan aktarılan menkul kıymetler için verdiği saklama hizmetine dönük bilgilerin yatırım aracı ve yatırımcı kuruluş kategorisi bazında; hisse senetleri ve yatırım fonu katılma belgelerini cari değeri ve aracı kurum kayıtlarındaki değeriyle, diğer menkul kıymetlerin nominal değer ve aracı kurum kayıtlarındaki değeriyle izlenebilmesi amacıyla istenmektedir.

**5. FORMUN DOLDURULMA ZAMANLARI:** Bu form, **haftanın son işgünü kapanış itibariyle** hazırlanacak, hazırlanan dosya tarafınıza gönderilmiş dosya içindeki dosya adlandırma düzenine göre isimlendirilip (İMKB’de kullanılan kuruluş kodunuz ve SPK kayıtlarındaki kuruluş unvanınızın birleştirilmiş halinin 13 karakteri ve ggaayy formatındaki raporlama dönemini içeren düzende, örneğin ABN – ABN AMR07 03 03.xls) **izleyen haftanın ilk işgünü saat 12:00’a kadar** gönderilecektir. TCMB’ye e-posta ile göndereceğiniz dosyaların TCMB’nin istediği şekilde oluşmasını sağlayacak “Dosya kontrol ve kayıt Makrosu”, TCMB tarafından gönderilen raporlama dosyasında mevcut olup, bu makronun çalıştırılmasıyla oluşturulan dosyanın gönderildiği e-postanın konu / subject satırının sadece raporlama dönemi verilerini içeren dosya adından oluşması (örneğin ABN – ABN AMR07 3 03.xls) gerekmektedir.

**6. GENEL AÇIKLAMA:** Formun sıralarında mülkiyeti aracı kuruma / müşterilere ait, yurtiçi / yurtdışı yetkili saklama kuruluşlarında bulunan menkul kıymetin ISIN kodu girilerek, menkul kıymeti mülkiyetinde tutan müşterilerin yurtiçi / yurtdışı yerleşiklik bazında faaliyette bulunduğu sektöre göre sınıflandırılması (taraf kodu) yapılarak, nominal / cari değer sütununa hisse senetleri ve yatırım fonu katılma belgelerinin cari, diğer menkul kıymetlerin ise nominal değeri (**eğer döviz cinsinden ise, raporlama döneminde geçerli olan TCMB Döviz Alış Kurundan** TL karşılığı hesaplanarak) girilecektir. **İMKB Tahvil-Bono Piyasası’nda**

gerçekleştirilen Ters repo ile alınan menkul kıymetlerin (işlemi yapan aracı kurum veya banka da raporlamasında repo işlemine konu kıymetleri RBd taraf koduyla bildirecek olması nedeniyle) raporlanmaması gerekmektedir. Ancak İMKB dışında gerçekleştirilen Ters Repo işlemi ile yurtiçi veya yurtdışı bir mali kuruluştan saklama hesaplarınıza alınan kıymetlerin ilgili taraf kodu kullanılarak (menkul kıymet bankadan alındıysa BNK, aracı kurumdan alındı ise ARK, diğer mali kuruluşlardan alındı ise DMK kodu, yurtiçi yurtdışı yerleşiklik ayrımı yapılarak) emanet kıymetler içinde gösterilmesi gerekmektedir. İhracı raporlamacı kuruluş tarafından gerçekleştirilmiş yatırım fonları portföyündeki yurtdışı saklama hesaplarında izlenen (TAKASBANK A.Ş. nezdindeki depo hesaplara aktarılmamış) yabancı para cinsinden menkul kıymetlerin, söz konusu fonu ihraç eden kuruluş tarafından mutlaka raporlanması gerekmektedir. Müşterilere ilişkin yurtiçi / yurtdışı yerleşiklik ayrımında temel kıstas; müşterinin 1 yıl veya daha uzun süreden beri kesintisiz şekilde ülke sınırları içinde ikamet ediyor ve / veya faaliyette bulunuyor olmasıdır. **Menkul kıymetin tanınmasında temel bilgi olduğundan ISIN kodunun kesinlikle doğru girilmesi gerekmektedir.** Formun doldurulması sırasında ihtiyaç duyulabilecek bazı açıklamalar aşağıda verilmektedir.

#### 7. SÜTUN BAŞLIKLARI:

**ISIN / Kod:** 15 alfanumerik haneden oluşan bu sütunda, TP hisse senetleri için “HISSESENEEDITP”, YP hisse senetleri için “HISSESENEEDIYP”, TP yatırım fonu katılma belgeleri için “YATIRIMFONUTP”, YP yatırım fonu katılma belgeleri için ise “YATIRIMFONUYP” kısaltması ile hisse senetleri ve yatırım fonları **cari değerleri ilk sıralarda** özetlenecektir. Diğer menkul kıymetler için ISIN kodu (Hisse Senetleri ve Yatırım Fonları dışında kalan tüm menkul kıymetlerin cari değerleri TCMB tarafından hesaplanacağından,12 karakterden oluşan International Securities Identification Number raporlamanızda yanlış / eksik girilmemelidir) bazında bu sütunda bilgi verilecektir.

**Tür Kodu:** 2 alfanumerik haneden oluşan bu alana ilgili menkul kıymetin türünü simgeleyen aşağıdaki kodlar yazılacaktır.

<b>Menkul Kıymet Türleri</b>	<b>Kodu</b>
Devlet Tahvilleri	01
Hazine Bonoları	02
Gelir Ortaklığı / Gelire Endeksli Senetler	03
Dövizle Endeksli Kamu Borçlanma Senetleri	04
Diğer Kamu Borçlanma Senetleri / Menkul Kıymetleri	05
Varlığa Dayalı Menkul Kıymetler	06
Özel Sektör Tahvilleri	07
Finansman Bonoları	08
Banka Bonoları ve Banka Garantili Bonolar	09
Hisse Senetleri	10
Yatırım Fonu Katılım Belgeleri	11
Yabancı Devletlerce İhraç Edilen Menkul Kıymetler	12
Yurtdışı Bankalarca İhraç Edilen Menkul Kıymetler	13
Yabancı Özel Sektör Borçlanma Senetleri / Menkul Kıymetleri	14
Hazinece Yurt Dışında İhraç Edilen Eurobond ve Benzeri Tahviller	15
Hazinece Yurt Dışında İhraç Edilen Diğer Menkul Kıymetler	16
Yurtiçinde İhraç Edilen Kâr ve Zarar Ortaklığı Belgeleri	17
Yurtdışında İhraç Edilen Kâr ve Zarar Ortaklığı Belgeleri	18
Yurtiçi Bankalarca İhraç Edilen Tahviller	19
Merkez Bankasınca İhraç Edilen Likidite Senetleri	20
Krediye Bağlı Tahvil	21
Varlık Teminatlı Menkul Kıymetler	22
Hazinece Yurtiçinde İhraç Edilen Kira Sertifikaları	23
Hazinece Yurtdışında İhraç Edilen Kira Sertifikaları	24
Kira Sertifikaları / Sukuk	25
Gayrimenkul Sertifikası	26
Altın Tahvili	27
Altına Dayalı Kira Sertifikası	28
Diğer Menkul Kıymetler	99

**Taraf Kodu:**

**RBa:** mülkiyeti raporlayan aracı kuruma ait *teminata verilmeyen, repoda kullanılmayan* menkul kıymetleri kapsamaktadır.

**Rbd:** mülkiyeti raporlayan aracı kuruma ait *repo ve teminata konu* menkul kıymetleri kapsamaktadır.

**BNK:** Adına menkul kıymet saklanan müşterinin bir banka olması durumunda müşteri bankayı simgelemektedir.

**ARK:** Adına menkul kıymet saklanan müşterinin bir başka aracı kurum olması durumunda müşteri aracı kurumu simgelemektedir.

**GRK:** Adına menkul kıymet saklanan gerçek kişileri ifade etmektedir.

**SGT:** Adına menkul kıymet saklanan sigorta şirketlerini ifade etmektedir.

**DMK:** Adına menkul kıymet saklanan banka ve sigorta kuruluşları dışında kalan diğer mali kesim müşterileri simgelemektedir. Tarafınızca ihraç edilmiş Yatırım fonları portföyündeki menkul kıymetlerin yurtiçi yetkili saklama kuruluşlarında (Takasbank A.Ş.) saklananları, TCMB tarafından Takasbank'tan bu bilgiler alındığından, raporlamanızda bildirilmeyecek, bu fonların portföyündeki yurtdışı saklama hesaplarında izlenen (TAKASBANK A.Ş. nezdindeki depo hesaplarında izlenemeyen) yabancı para cinsinden menkul kıymetlerin ise mutlaka raporlanması gerekmektedir.

**RMK:** Adına menkul kıymet saklanan resmi nitelikli (sosyal güvenlik kuruluşları dahil) tüm kamu kurum ve kuruluşlarını ifade etmektedir.

**DTK:** Saklama hizmeti verilen ve yukarıda belirtilen kesimler dışında kalan üretim, ticaret ve hizmet faaliyeti sürdüren tüm yurtiçi ve yurtdışı yerleşik müşterileri ifade etmektedir.

RBa	Mülkiyeti Kurumunuza Ait Olan	Teminata Verilmeyen ve Repoda kullanılmayan	Nominal ve Aracı Kurum Kayıtlarındaki Değer
RBd	Mülkiyeti Kurumunuza Ait Olan	Repoya ve / veya teminata konu olan	Nominal ve Aracı Kurum Kayıtlarındaki Değer
BNK	Bankalar	Müşterilere Ait, Saklama Hizmeti Verilen M.K.	Nominal Değer
ARK	Aracı Kurum		
GRK	Gerçek Kişiler		
SGT	Sigorta Şirketleri		
DMK	Diğer Mali Kesim		
RMK	Resmi Kuruluşlar		
DTK	Mali Olmayan Diğer Kuruluşlar		

**Para Kodu:** 3 alfanumerik haneden oluşan bu sütuna Türk Lirası cinsinden menkul kıymetler için “TRY”, yabancı para cinsinden olanlar için “DVZ”, yabancı para cinsinden olanlar için “DVZ” ve endeksli için “END” kodu girilecektir.

**Nominal / Cari Değer:** Bu sütuna ISIN kodu dökümü yapılmaksızın HİSSESENEDİTP, HİSSESENEDIYP, YATIRIMFONUTP, YATIRIMFONUYP kısaltmalarıyla taraf koduna göre ayrıştırılarak cari değeri hesaplanacak hisse senetleri ve yatırım fonu katılma belgelerinin cari değeri ile hisse senedi ve yatırım fonu katılma belgeleri dışında kalan diğer menkul kıymetlerin nominal değeri Bin TL bazında yazılacaktır. Bu sütun, hem raporlayan aracı kurumun mülkiyetinde bulunan, hem de müşteriler adına saklanan menkul değerler için müşterilerin yurtiçi / yurtdışı yerleşikliği gözetilerek doldurulacaktır.

**Aracı Kurumun Kayıtlarındaki Değer:** Bu sütun sadece aracı kurumun mülkiyetindeki menkul değerler için doldurulacaktır. Menkul kıymetin, rapor tarihi itibariyle aracı kurumun bilançosundaki değeri (alım bedeli) Bin TL bazında yazılacaktır.

**Karşı Taraf Ülke Kodu:** Bu sütun, takip eden linkten faydalanılarak bulunacak ülke kodlarından yararlanılmak suretiyle doldurulacaktır.

[http://www.iso.org/iso/home/standards/country\\_codes/country\\_names\\_and\\_code\\_elements.htm](http://www.iso.org/iso/home/standards/country_codes/country_names_and_code_elements.htm)

Bu kapsamda, mülkiyeti aracı kuruma ait olan;

- teminata verilmeyen ve repoda kullanılmayan menkul deęerler için lke kodu bilgisi yazılmayacaktır,
- repo işlemlerine konu olan menkul deęerler için repo yapılan tarafın yerleşik olduęu lke kodu,
- teminata verilen menkul deęerler için menkul deęerin teminata konu olmasını saęlayan işlemin karşı tarafının yerleşik olduęu lke kodu,

Emanet menkul deęerler için ise saklama hizmeti verilen müşterinin yerleşik olduęu lke kodu yazılacaktır.

**HISSENEEDITP, HISSENEEDIYP, YATIRIMFONUTP, YATIRIMFONUYP** için lke kodu girilmeyecektir.

## ARACI KURUMLAR MENKUL DEĞERLER HAFTALIK BİLGİ FORMU

MK TÜRÜ BAZINDA RAPORLAMA ÖZETİ  
(Trilyon TL)

ARACI KURUM UNVANI
gg.aa.yyyy

FORM KODU:MD102H

PARA BİRİMİ: MİLYAR TL

Raporlama Yetkiliniz

Telefon Numaranız

E-posta Adresiniz

E-posta Adresiniz

E-posta Adresiniz

TÜR

YURTDIŞI  
YERLEŞİK  
NOMİNALYURTDIŞI  
YERLEŞİK  
NOMİNALARACI KURUM  
KAYITLARINDAKİ  
DEĞER

01

0,376

0,135

0,265

02

0,376

0,135

0,246

03

0

0

0

04

0,376

0,135

0,265

05

0

0

0

06

0

0

0

07

0

0

0

08

0

0

0

09

0

0

0

10

0,37

0,162

0,13

11

0,52

0,162

0,28

12

0

0

0

13

0

0

0

14

0

0

0

15

0,376

0,135

0,265

16

0

0

0

99

0

0

0

TOPLAM

2,394

0,864

1,451

SIRA NO	ISIN/KOD	TÜR KODU	TARAF KODU	PARA KODU	NOMİNAL DEĞER		ARACI KURUM KAYITLARINDAKİ İ DEĞER
					Yurtiçi	Yurtdışı	
1	HISSESENEDİTP	10	RBa	TRL	30		30
2	HISSESENEDİTP	10	RBd	TRL	25		25
3	HISSESENEDİYP	10	RBa	DVZ	30		30
4	HISSESENEDİYP	10	RBd	DVZ	45		45
5	YATIRIMFONUTP	11	RBa	TRL	92		92
6	YATIRIMFONUTP	11	RBd	TRL	33		33
7	YATIRIMFONUYP	11	RBa	DVZ	105		105
8	YATIRIMFONUYP	11	RBd	DVZ	50		50
9	HISSESENEDİTP	10	BNK	TRL	25	10	
10	HISSESENEDİTP	10	GRK	TRL	5	75	
11	HISSESENEDİTP	10	SGT	TRL	155	13	
12	HISSESENEDİTP	10	DMK	TRL	13	43	
13	HISSESENEDİTP	10	RRR	TRL	3	1	
14	HISSESENEDİTP	10	DTK	TRL	5	7	
15	HISSESENEDİYP	10	BNK	DVZ	7	3	
16	HISSESENEDİYP	10	GRK	DVZ	18	5	
17	HISSESENEDİYP	10	SGT	DVZ	3	2	
18	HISSESENEDİYP	10	DMK	DVZ	2	1	
19	HISSESENEDİYP	10	RRR	DVZ	1	1	
20	HISSESENEDİYP	10	DTK	DVZ	3	1	
21	YATIRIMFONUTP	11	BNK	TRL	25	10	
22	YATIRIMFONUTP	11	GRK	TRL	5	75	
23	YATIRIMFONUTP	11	SGT	TRL	155	13	
24	YATIRIMFONUTP	11	DMK	TRL	13	43	
25	YATIRIMFONUTP	11	RRR	TRL	3	1	
26	YATIRIMFONUTP	11	DTK	TRL	5	7	
27	YATIRIMFONUYP	11	BNK	DVZ	7	3	
28	YATIRIMFONUYP	11	GRK	DVZ	18	5	
29	YATIRIMFONUYP	11	SGT	DVZ	3	2	
30	YATIRIMFONUYP	11	DMK	DVZ	2	1	
31	YATIRIMFONUYP	11	RRR	DVZ	1	1	
32	YATIRIMFONUYP	11	DTK	DVZ	3	1	
33	TRB180603T19	02	RBa	TRL	195		171
34	TRB180603T19	02	RBd	TRL	85		75



35	TRB180603T19	02	BNK	TRL	5	25	
36	TRB180603T19	02	GRK	TRL	45	15	
37	TRB180603T19	02	SGT	TRL	25	75	
38	TRB180603T19	02	DMK	TRL	3	13	
39	TRB180603T19	02	RKR	TRL	15	3	
40	TRB180603T19	02	DTK	TRL	3	4	
41	TRT250204F19	01	RBa	DVZ	195		185
42	TRT250204F19	01	RBd	DVZ	85		80
43	TRT250204F19	01	BNK	DVZ	5	25	
44	TRT250204F19	01	GRK	DVZ	45	15	
45	TRT250204F19	01	SGT	DVZ	25	75	
46	TRT250204F19	01	DMK	DVZ	3	13	
47	TRT250204F19	01	RKR	DVZ	15	3	
48	TRT250204F19	01	DTK	DVZ	3	4	
49	TRT160604F16	04	RBa	END	195		185
50	TRT160604F16	04	RBd	END	85		80
51	TRT160604F16	04	BNK	END	5	25	
52	TRT160604F16	04	GRK	END	45	15	
53	TRT160604F16	04	SGT	END	25	75	
54	TRT160604F16	04	DMK	END	3	13	
55	TRT160604F16	04	RKR	END	15	3	
56	TRT160604F16	04	DTK	END	3	4	
57	US900123AK66	15	RBa	DVZ	195		185
58	US900123AK66	15	RBd	DVZ	85		80
59	US900123AK66	15	BNK	DVZ	5	25	
60	US900123AK66	15	GRK	DVZ	45	15	
61	US900123AK66	15	SGT	DVZ	25	75	
62	US900123AK66	15	DMK	DVZ	3	13	
63	US900123AK66	15	RKR	DVZ	15	3	
64	US900123AK66	15	DTK	DVZ	3	4	