BISTECH PTRM/İşlem Öncesi Risk Yönetimi Uygulaması

Kullanıcı Kılavuzu

BORSA İSTANBUL A.Ş.

VERSİYON: 1.0

İçerik

1. GİRİŞ 1

1.1. AMAÇ 1

1.2. OKUYUCU KİTLESİ 1

1.3. TANIMLAR 1

2. GENEL BAKIŞ 1

3. KULLANICI TÜRLERİ 2

3.1. ÜYE KULLANICILARI 2

3.2. BORSA KULLANICILARI 2

4. UYGULAMANIN KURULUMU VE SİSTEM GEREKSİNİMLERİ 2

4.1. SİSTEM GEREKSİNİMLERİ 2

4.2. UYGULAMANIN BAŞLATILMASI VE KURULUMU 2

5. PENCERE DÜZENİ 4

5.1. PANELLERİN GENİŞLETİLMESİ VE DARALTILMASI 6

5.2. GÜNCELLEMELERİ BAŞLATMA VE DURDURMA 6

5.3. RİSK GRUPLARINA GENEL BAKIŞ 7

5.3.1. Risk Grubunun Bileşenleri 8

5.4. GÜN İÇİ DEĞİŞİKLİKLER VE ERTESİ GÜN DEĞİŞİKLİKLERİ 8

5.4.1. Gün İçi Değişiklikler 8

5.4.2. Ertesi Gün Değişiklikleri 9

5.5. İHLALLER VE ENGELLEME 10

5.5.1. İhlaller 10

5.5.2. Manuel Engelleme ve İzlenen Kullanıcının Bağlantısının Kopması 11

6. TEMSİLCİ PANELİ 11

6.1. TEMSİLCİ PANELİNDE BİLDİRİM, UYARI VE İHLAL GÖSTERGELERİ 12

6.1.1. Uyarı ve Bildirim Yüzdelerini Ayarlama 12

6.2. BİR RİSK GRUBU İÇİN İŞLEM YAPILABİLECEK ENSTRÜMANLARI KISITLAMA 14

6.3. EMİR/SN. LİMİTİNİ AYARLAMA 15

7. MEVCUT KULLANIM SEKMESİ 17

8. RİSK GRUPLARIYLA ÇALIŞMA 18

8.1. RİSK GRUBU EKLEME 18

8.2. RİSK GRUBUNU ENGELLEME 21

8.3. Risk Grubunu Silme 22

8.4. Risk Grubunda Emirleri Toplu Halde İptal Etme 23

8.5. Risk Grubunun Engellemesini Kaldırma 24

8.6. Bir Emir/sn. Limiti İhlalinin Engellemesini Kaldırma 24

8.7. Risk Grubu Enstrüman Limitinin İhlalinin Kaldırılması 24

8.8. Grup Kilidi 25

9. ENSTRÜMAN LİMİTLERİNİ DÜZENLEME 25

9.1. Yeni Bir İşlem Limiti Ekleme 26

9.2. İşlem Limitlerini Düzenleme 29

9.3. Bir İşlem Limitini Silme 31

10. KULLANICI YÖNETİMİ GENEL BAKIŞ 33

10.1. Kullanıcıları İnceleme 33

10.2. Risk Grubuna Kullanıcı Ekleme 34

10.3. Kullanıcıyı Gruptan Çıkarma 37

10.4. Varsayılan Grup 40

10.5. İzlenen Kullanıcıyı Değiştirme veya Çıkarma 41

11. E-POSTA ALARMLARINI YÖNETMEYE GENEL BAKIŞ 44

11.1. E-Posta Alarmlarını Ayarlama 44

11.2. Yeni E-posta Alarmı Alıcısı Ekleme 46

11.3. E-Posta Uyarısı Alıcılarını Düzenleme 48

11.4. E-Posta Uyarısı Alıcılarını Çıkarma 49

1. GİRİŞ

1.1. Amaç

Bu kullanım kılavuzu, üyelerin kullanıcılarının gruplandırılması yoluyla maruz kalınan riski izlemek ve sınırlamak amacıyla Risk Gruplarını yönetmek ve yapılandırmak üzere tasarlanan BISTECH PTRM/İşlem Öncesi Risk Yönetimi uygulamasının nasıl kullanılacağını açıklamaktadır.

1.2. Okuyucu Kitlesi

Bu belge Borsada üyeler tarafında oluşan risk tutarını yapılandırmaya ve izlemeye ihtiyaç duyan BISTECH PTRM uygulaması kullanıcılarını hedeflemektedir.

1.3. Tanımlar

Bu dokümanda ve BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünde kullanılan kısaltmalar ve tanımlara aşağıdaki tabloda yer verilmiştir;

Tablo 1 Tanımlar ve Açıklamalar

Tanımlar	Açıklama
Risk Grubu	Risk Grubu bir kullanıcı grubunun riskini takip etmek ve kontrol etmek üzere sponsor olan üye PTRM kullanıcısı yada Borsa PTRM kullanıcısı tarafından oluşturulur.
Sponsor Olan Üye	Diğer müşterilerin erişimine sponsorluk yapan bir piyasa üyesidir. Sponsor olan üyeler sponsor olduğu müşterilerin aktivitelerini takip edebilir ve onlar için limitler belirleyebilir.
Sponsor Olunan Müşteri	Piyasaya erişimi bir sponsor olan üye tarafından sağlanan ve izlenen bir piyasa katılımcısıdır.
İzlenen Kullanıcı	Sponsor olan üyenin gerçek zamanlı bağlantı durumunu(FIX/OMnet) izlemek üzere bir risk grubunun yapılandırılmasıdır.
Enstrüman	Borsada işlem gören sermaye piyasası araçlarıdır.
Varsayılan Grup	Bir risk grubunun varsayılan grup olarak atanması halinde, Borsa tarafından üye namına girilen işlemlerin PTRM tarafından hesaplanan toplam riske yansıtılmasını sağlayan gruptur.

2. GENEL BAKIŞ

BISTECH PTRM/İşlem Öncesi Risk Yönetimi sistemi, Borsamıza riskin takip ve kontrol edilebildiği bir alım satım sistemi sağlamaktadır. İşlem Öncesi Risk Yönetimi, riski bir bakışta anlık olarak Borsa, sponsor olan üye /sponsor olunan müşteriler ve kullanıcıları şeklindeki bir hiyerarşiyle göstermektedir.

İşlem Öncesi Risk Yönetiminin Borsaya sağladığı fonksiyonlar başlıca şunlardır;

- Bir Üyenin kullanıcılarının risk gruplarına bağlanması ve bu risk gruplarına limit tanımlanması ile riskin izlenebilmesi ve sınırlandırılabilmesi,
- Risk Gruplarının maruz kaldığı riskin gerçek zamanlı takibi,
- Saniyede/saniyenin onda birinde gönderilen emir sayısına limit konulabilmesi,
- Maksimum emir büyüklüğü üzerine limitler konulabilmesi,
- Risk gruplarına enstrüman bazında limitler konulabilmesi,
- Belirlenen risk gruplarının sadece limit belirlenmiş enstrümanlarda işlem yapmakla sınırlandırılabilmesi,

- Bir enstrümanda belirlenen uyarı yâda bildirim eşiğini geçilmesi halinde e-posta uyarıları oluşturulması,
- Risk grubu kullanıcılarının limitleri geçmesi halinde yeni emir girişinin engellenebilmesi,
- Kullanıcılarının yeni emirler girememesi için bir risk grubunun manuel olarak engellenebilmesi veya engelleme durumunun kaldırılması,
- Bir risk grubuna bağlanmış kullanıcılar için bekleyen tüm emirlerin toplu halde iptal edilebilmesi.

3. KULLANICI TÜRLERİ

PTRM kullanıcılarının üye veya Borsa seviyesinde olmak üzere iki seviyede rolü olabilmektedir.

3.1. Üye Kullanıcıları

Üye kullanıcıları, kendi kullanıcıları ve sponsor olduğu müşterinin kullanıcıları için limit belirleme yetkisi bulunmaktadır.

3.2. Borsa Kullanıcıları

Borsa kullanıcılarının tüm üye ve sponsor olunan müşteri kullanıcıları için limit belirleme yetkisi bulunmaktadır.

4. UYGULAMANIN KURULUMU VE SİSTEM GEREKSİNİMLERİ

4.1. Sistem Gereksinimleri

BISTECH PTRM uygulamasını yürütmek için, bilgisayarınızda Java 7® yüklü olmalıdır. Ayrıca internet bağlantısına ve bir Web tarayıcısına ihtiyacınız olacaktır.

Tablo 2 Desteklenen Versiyonlar

Program	Desteklenen Versiyonlar
JAVA	7
Microsoft® Internet Explorer™	7.x – 9.x
Mozilla Firefox	10 veya daha yüksek
Google® Chrome™	13.x veya daha yüksek

4.2. Uygulamanın Başlatılması ve Kurulumu

Uygulamayı yüklemek ve çalıştırmak için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. Web tarayıcısını açın ve başlatma sayfasına gidiniz.
2. Java yüklü değilse, Java ikonuna tıklayınız ve programı yükleyiniz.
3. Launch BISTECH PRM Client linkine tıklayınız.
4. Uygulama yüklenecek ve giriş penceresi görüntülenecektir. Uygulamada kullanılacak dil seçeneklerinden İngilizce veya Türkçeyi seçiniz.
5. Kullanıcı adınızı ve şifrenizi giriniz.
6. Oturum aç düğmesine tıklayınız.

7. BISTECH PTRM uygulamasının arayüzü görüntülenecektir.
8. Bu işlemleri tamamladığınızda masaüstüne kısayol yerleştirilmiş olacaktır. Bundan sonra bu kısayol ile uygulamaya giriş yapabilirsiniz.

5. PENCERE DÜZENİ

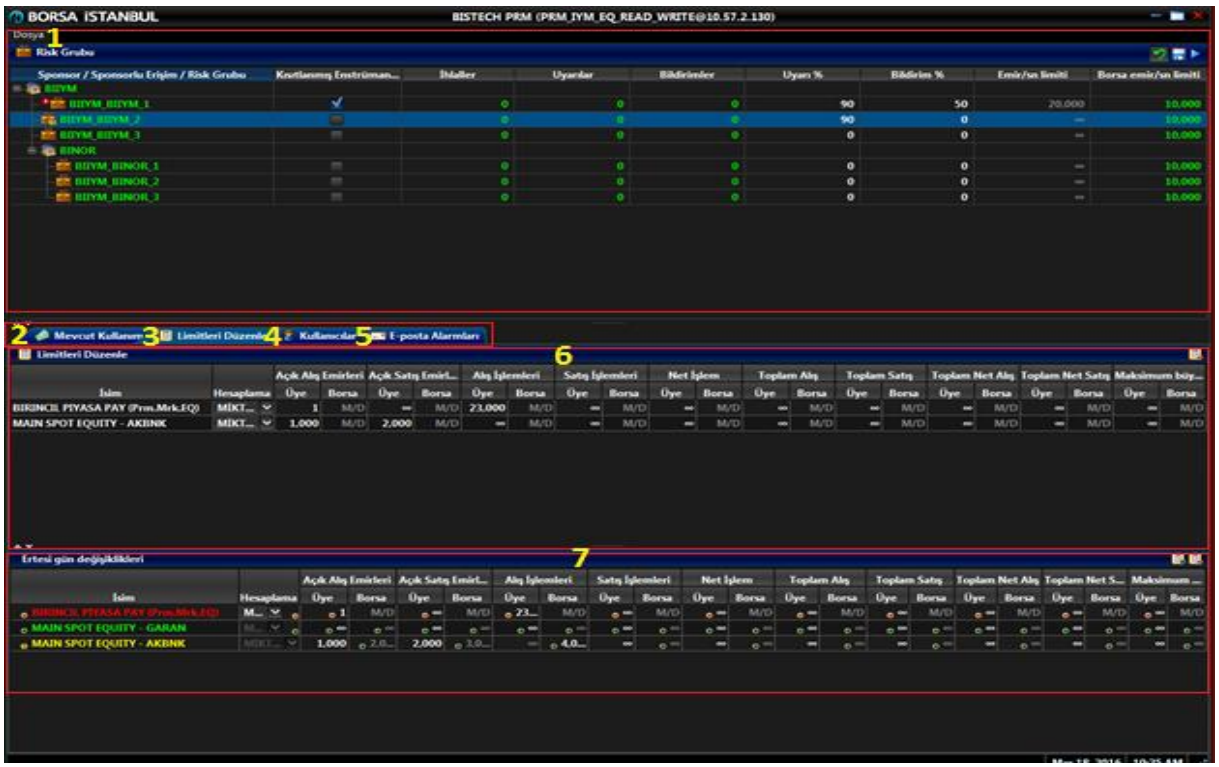
BISTECH PTRM kullanıcı arayüzü sponsor olan üyenin, sponsor olunan müşterinin risk gruplarının risk limiti parametrelerini gerçek zamanlı olarak izlemesine ve değiştirmesine imkan sağlar.

BISTECH PTRM kullanıcı arayüzü aşağıdaki ekran görüntüsünde numaralandırılan tabloda detaylı açıklanan bölümlerden oluşur:

Tablo 3 PTRM Penceresi Panel ve Sekmeleri

Alan	İşlevi
1	**Temsilci Paneli:** Temsilci paneli sponsor olan üyelere atanmış olan risk gruplarını ve sponsor olunan müşterileri risk gruplarını hiyerarşik olarak görüntüler.
2	**Mevcut Kullanım Sekmesi:** Risk grubu için düzenlenen tüm limitlerinin anlık tüketim durumunu gösterir.
3	**Limitleri Düzenle Sekmesi:** Limitleri düzenle sekmesi bir risk grubuna limit atamanıza yada mevcut limitleri düzenlemenize imkan tanır.
4	**Kullanıcılar Sekmesi:** Kullanıcılar sekmesi hangi kullanıcıların bir risk grubuna atandığını görüntülemeye, risk grubuna yeni kullanıcı eklenmesine ve risk grubundan kullanıcı çıkarılmasına imkân tanır.
5	**E-posta Alarmları Sekmesi:** E-posta alarmları sekmesi risk grubu için ihlal, uyarı, bildirim alarmlarının gönderildiği e-posta adresinin tanımlandığı alandır. Bu sekme aynı zamanda ilgili gruba hangi türde alarmların gönderileceğini belirlemenize imkân tanır.
6	**Gün içi Değişiklikler Paneli:** Gün içi değişiklikler paneli, kaydedildiğinde sistemde hemen geçerli olan değişiklikleri gösterir.
7	**Ertesi Gün Değişiklikleri Paneli:** Ertesi gün değişiklikleri paneli, kaydedildiğinde borsa veri tabanına gönderilen ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelen değişiklikleri gösterir.

Şekil 1 PTRM Kullanıcı Arayüzü Panel ve Sekmeleri Ekran Görüntüsü



Tablo 4 PTRM Kullanıcı Arayüz İkonları

İkon	Komut
	Simge Durumuna Küçült: Uygulamayı görev çubuğunuzda simge durumuna küçültür. **Ekranı Kapla**: Uygulamayı tüm ekranınızı doldurmak üzere ekran boyutuna getirir. **Kapat**: Uygulamayı kapatır.
	Değişiklikleri Geri al: Kaydedilmemiş her türlü değişikliği geri alır.
	Değişiklikleri Kaydet: Güncel değişikliklerinizi kaydeder.
	Güncellemeyi Durdur: Kullanıcı arayüzüne gelen güncellemeleri durdurur. **Güncellemeye Başla**: Kullanıcı arayüzüne gelen güncellemeleri devam ettirir.
	Ekle: Bir limit, kullanıcı veya e-posta hesabı ekler.
	Kaldır: Bir limiti, kullanıcıyı veya e-posta alıcısını çıkarır.

Temsilci, gün içi değişiklikler ve ertesi gün değişiklikleri panellerinde yapılan değişikliklerin durumunu belirten birçok ikon mevcuttur.

Tablo 5 PTRM Kullanıcı Arayüz İkonları

İkon	Komut
	Silinecek: Bu öğenin kaydedilmiş olduğunu ve ertesi gün geçerli olacak şekilde kaldırılmak üzere işaretlendiğini belirtir.
	Eklenecek: Bu öğenin kaydedilmiş olduğunu ve ertesi gün geçerli olacak şekilde eklenmek üzere işaretlendiğini belirtir.
	Kaydedilmemiş: Bu öğenin henüz kaydedilmemiş olduğunu belirtir. Eğer bu öğenin kaydedilmesini istiyorsanız kaydet düğmesine basmalısınız.

5.1. Panellerin Genişletilmesi ve Daraltılması

BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünde belirli bir paneli incelemek istemiyorsanız, daraltma düğmelerini kullanarak o paneli gizleyebilirsiniz. Alternatif olarak ise, genişletme düğmelerini kullanarak o paneli görüntüleyebilirsiniz.

Tablo 6 Genişletme ve Daraltma Düğmeleri

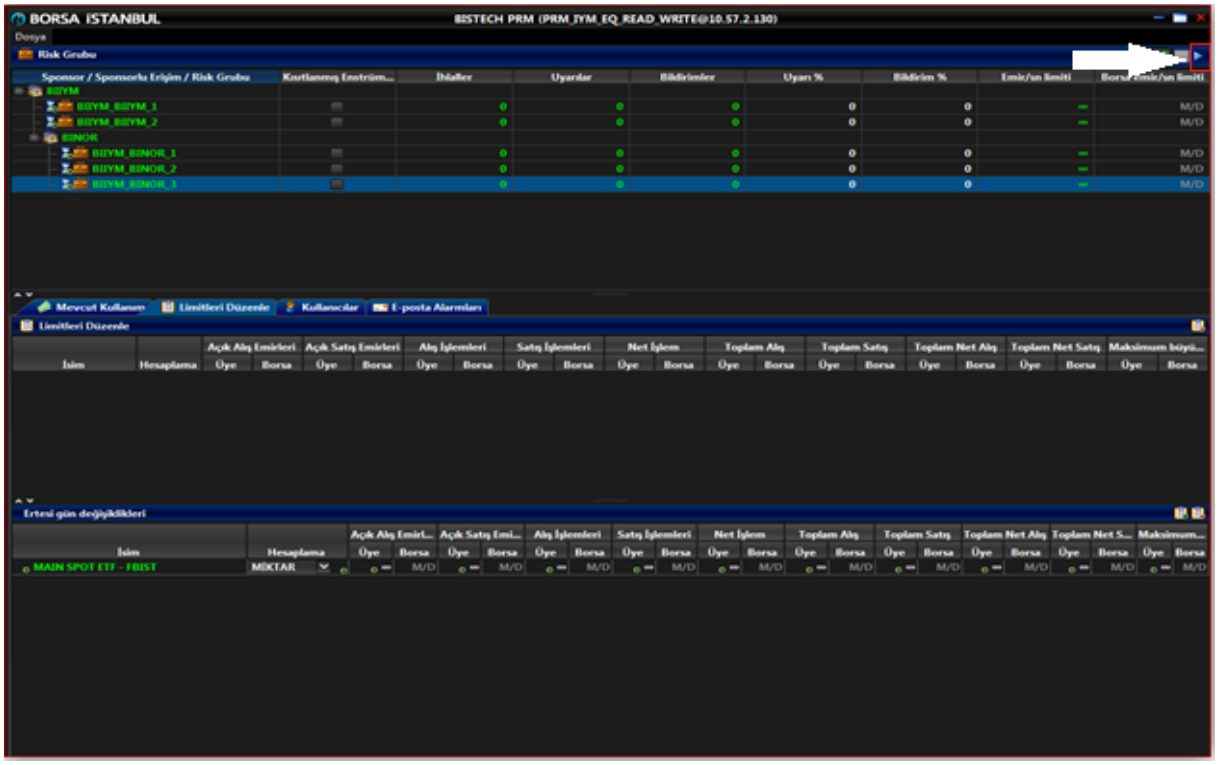
İKON	KOMUT
	Bu düğmelere tıklayarak kullanıcı arayüzündeki panelleri gizleyebilir veya görüntüleyebilirsiniz.

5.2. Güncellemeleri Başlatma ve Durdurma

Veri güncellemelerini durdurmak ve uygulamada görüntülenen detayları incelemek için güncellemeyi durdur butonuna tıklayınız. Güncellemeleri durdurmak sunucunun işleyişini etkilemez, sadece PTRM kullanıcı arayüzüne gelen güncellemeler duraklatılmış olacaktır. Sunucu, risk gruplarını izlemeye devam edecektir. Güncellemelere devam etmek için güncellemeye başla butonuna tıklayınız.

Tablo 7 Güncellemeleri Başlatma ve Durdurma

İKON	KOMUT
	• Güncellemeleri duraklatmak için, panelin sağ üst köşesindeki güncellemeyi durdur düğmesine tıklayınız. • En son sunucu verileriyle birlikte kullanıcı arayüzüne olan güncellemelere devam etmek için, panelin sağ üst köşesindeki güncellemeye başla düğmesine tıklayınız.



Veri güncellemelerini durdurmak ve mevcut kullanım sekmesindeki anlık limit tüketim detayları incelemek için güncellemeyi durdur butonuna tıklayınız. Güncellemeleri durdurmak sunucu işleyişini etkilemez, sadece mevcut kullanım sekmesinde yer alan gerçek zamanlı güncellemeler duraklatılmış olacaktır. Sunucu, işlemleri ve risk kontrollerini gerçekleştirmeye devam edecektir. Mevcut Kullanım sekmesi için güncellemeleri duraklatmak için, sağ üst köşedeki Güncellemeyi Durdur butonuna tıklayınız.

En son sunucu verileriyle birlikte BISTECH PTRM kullanıcı arayüzüne olan veri güncellemelerini yeniden başlatmak için güncellemeye başla butonuna tıklayınız.

5.3. Risk Gruplarına Genel Bakış

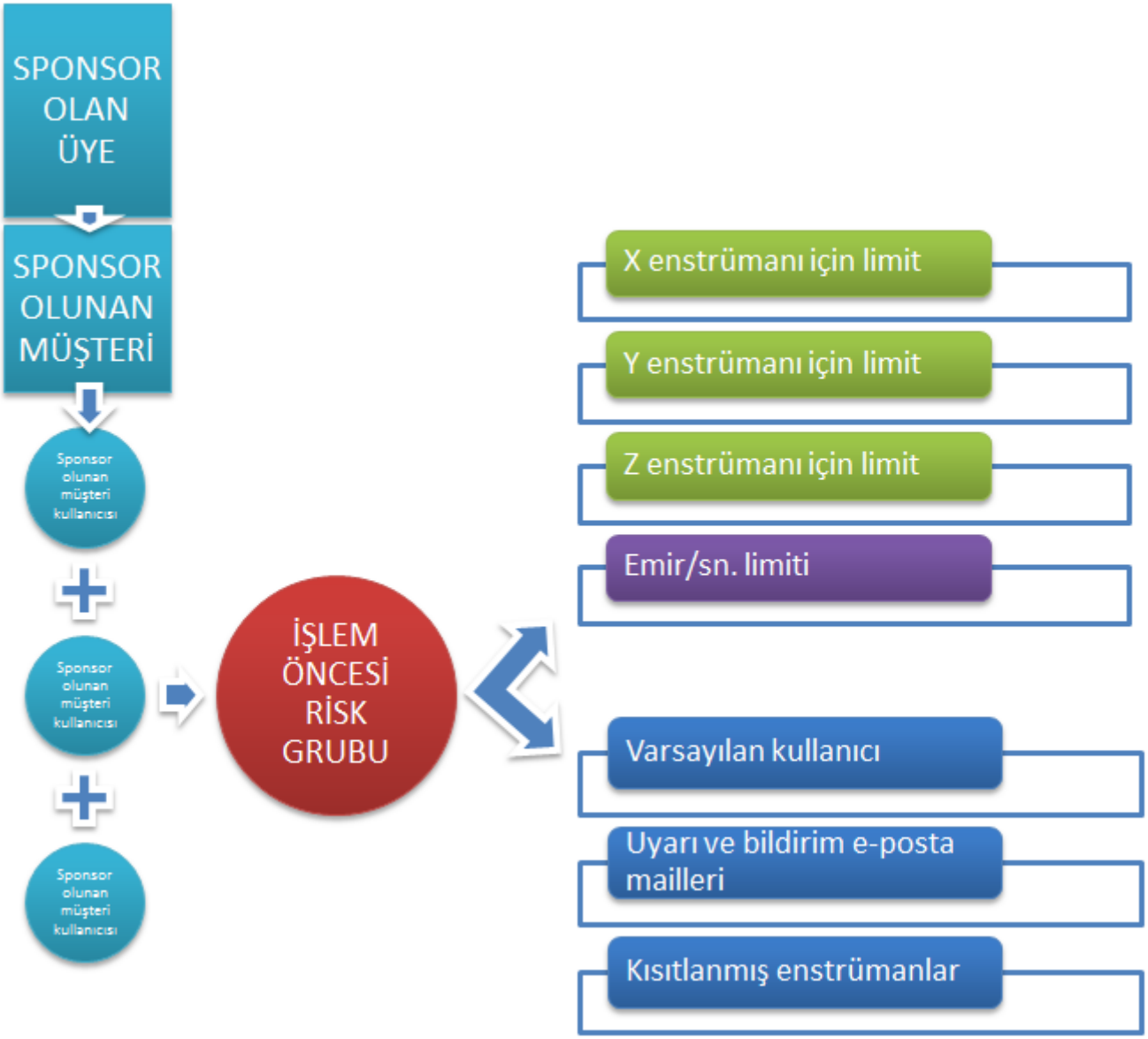
Risk grubu BISTECH PTRM uygulamasında riskin gözlemlendiği temel kavramsal birimdir.

Bir risk grubu aşağıdaki parçalardan meydana gelir:

- Bir sponsor üye

- Bir sponsor olunan müşteri
- Risk grubu limitlerinin atandığı izlenecek sponsor olunan müşteri altında yer alan kullanıcılar
- Enstrüman bazında pozisyon limitleri
- Grup için emir/sn. limiti
- Grubun maruz kaldığı riski gösteren uyarıları alacak olan e-posta adresleri
- Grup için konfigüre edilebilir belirli davranışlarını seçmeye yarayan kontrol işaretleri

5.3.1. Risk Grubunun Bileşenleri



5.4. Gün içi Değişiklikler ve Ertesi Gün Değişiklikleri

5.4.1. Gün İçi Değişiklikler

Aşağıdaki değişiklikler BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünde her zaman yapılabilir ve yapıldığı anda geçerli olmaktadır:

- Limit değerlerini güncelleme

- Uyarı ve bildirim seviyesi yüzdelerini ayarlama
- Emir/sn. limitini ayarlama
- E-posta alarmlarını ayarlama
- Yeni e-posta alarmı alıcısı ekleme
- Risk grubu emirlerini toplu halde iptal etme
- Risk grubu engelleme
- Risk grubu engellemesini kaldırma
- Risk grubu emir/sn. limiti ihlali engellemesini kaldırma
- Risk grubu için kısıtlanmış enstrüman seçeneğinin seçilmesi

Kaydedilmemiş olan gün içi değişiklikler gün içi değişiklikler panelinde görüntülenmektedir.

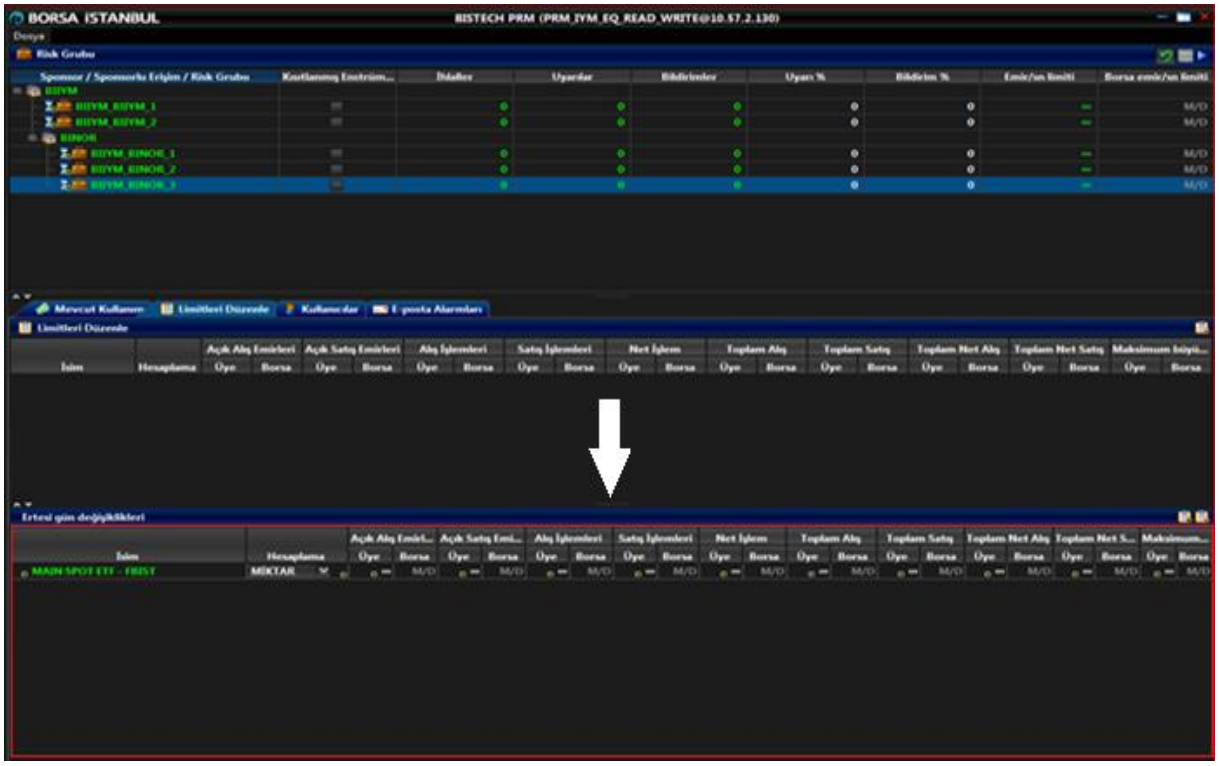
5.4.2. Ertesi Gün Değişiklikleri

Aşağıdaki değişiklikler ertesi gün değişikliğidir. Arayüzde kaydedildiklerinde bu değişiklikler borsa veri tabanına gönderilecek ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelecektir:

- Yeni bir işlem limiti ekleme
- Mevcut bir işlem limitini silme
- E-posta alarmlarını tetikleyen eşikleri değiştirme
- E-posta uyarısı alıcılarını çıkarma
- Risk grubuna kullanıcı ekleme
- Risk grubu ekleme
- Risk grubu silme
- Risk grubundan kullanıcı çıkartma
- İzlenen kullanıcıyı değiştirme
- Risk grubuna varsayılan kullanıcı atama

Ertesi gün değişiklikleri, sistem için askıya alınmış değişiklikler oldukları ve mevcut işlem gününde uygulanmayacaklarını belirtmek amacıyla farklı bir panelde görüntülenir.

Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir değişiklik eklemelisiniz.



5.5. İhlaller ve Engelleme

5.5.1. İhlaller

Enstrüman veya grup seviyesinde ihlal meydana gelebilir.

Enstrüman Seviyesinde İhlal

İhlaller önce enstrüman seviyesinde kontrol edilir. Enstrüman seviyesindeki ihlaller bir enstrümana gönderilen emirlerin söz konusu enstrüman üzerinde tanımlı limitlerden birini aşması durumunda meydana gelir. Enstrüman seviyesinde bir ihlal meydana geldiği zaman, bu enstrümanda hiçbir emre izin verilmez. Yeni emirler, enstrümanda limit aşımı olduğu için reddedilir. Daha fazla bilgi için risk grubunun engellemesini kaldır bölümüne bakınız.

Grup Seviyesinde İhlal

İhlaller grup seviyesinde de kontrol edilmektedir. Hâlihazırda tek grup seviyesi kontrolü emir/sn. limiti kontrolüdür. Grup seviyesinde bir ihlal meydana geldiğinde, ihlale sebep olan kullanıcının bulunduğu risk grubu kullanıcıları için yeni emir girişine izin verilmez.

5.5.2. Manuel Engelleme ve İzlenen Kullanıcının Bağlantısının Kopması

Manuel engelleme grup seviyesinde yapılabilmektedir. Engelleme aktifken bu gruptaki kullanıcılar tarafından sisteme yeni emir gönderilmesine izin verilmeyecektir. Daha fazla bilgi için risk grubu engelleme ve risk grubunun engellemesini kaldırma bölümlerine bakınız.

Bir başka engelleme türü de izlenen kullanıcının bağlantısı kopması sonucu oluşan engellemedir. Bu engelleme otomatiktir. Eğer izlenen risk grubu kullanıcısının bağlantısı koparsa, ilgili risk grubu altındaki temsilcilerin yeni emir girişleri otomatik olarak engellenecektir. Daha fazla bilgi için izlenen kullanıcıyı değiştirme veya çıkarma bölümüne bakınız.

6. TEMSİLCİ PANELİ

Temsilci paneli tüm sponsor olan üyeleri, sponsor olunan müşterileri ve risk gruplarını hiyerarşik şekilde gösterir.

Bu hiyerarşi aşağıdaki seviyeleri içerir:

- **En Üst Seviye/Sponsor olan Üye:** Bir veya daha fazla üyenin piyasaya doğrudan bağlanmasına sponsor olan, işlem yapan bir üyedir.
- **İkinci Seviye/ Sponsor Olunan Müşteri:** Bir sponsor olan üye tarafından kontrol edilen bir müşteridir. Bir sponsor olunan müşteri sadece bir sponsor olan üye ile ilişkilendirilir.
- **Üçüncü Seviye/Risk Grupları:** Sponsor olan üyeye bağlı temsilcilerin mantıksal bir gruplanmasıdır.

Risk kontrolleri her bir risk grubu için işlem modülünden emir ve işlem mesajlarının gönderilmesiyle birlikte gerçek zamanlı hesaplanmaktadır.

Temsilci Paneli Sütunları

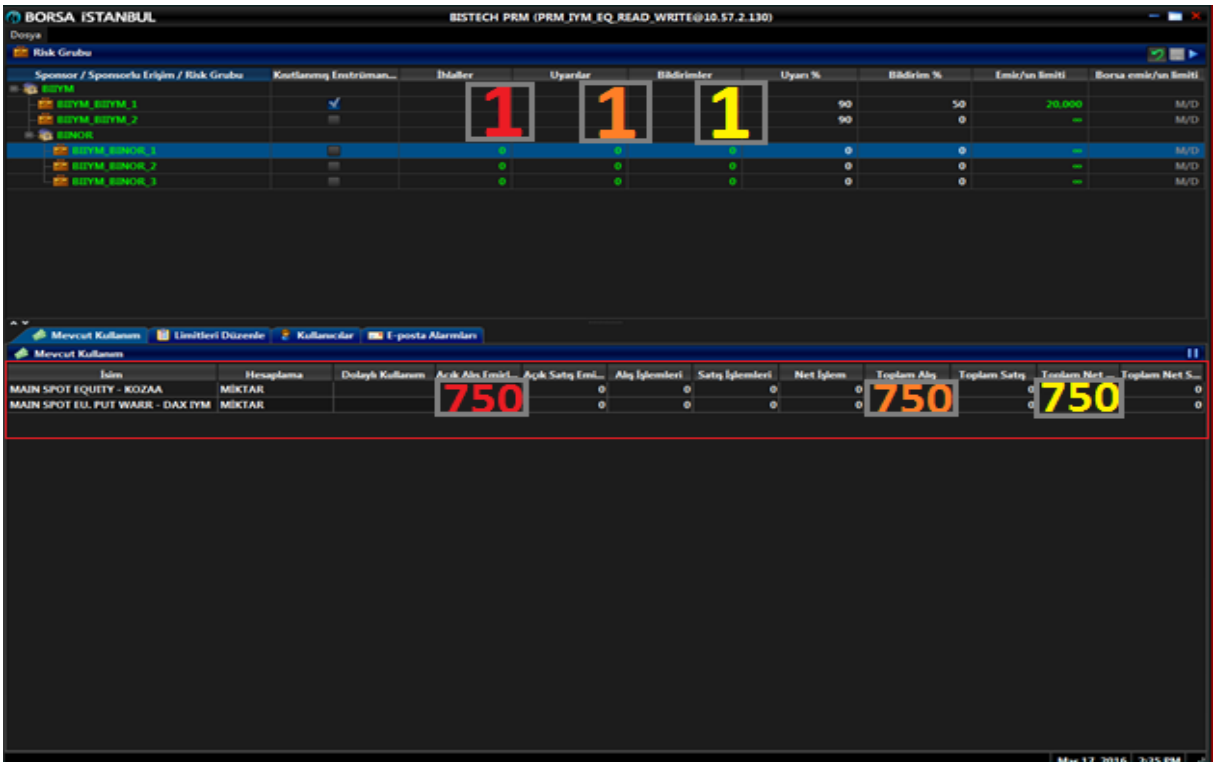
Temsilci Panelinde aşağıdaki sütunlar görüntülenmektedir;

- **Kısıtlanmış Enstrümanlar**: Bu işaret kutucuğu, ilgili grubun işlem yapma limitlerinin sadece işlem limiti tanımlanmış olan enstrümanlarla sınırlandırılıp sınırlandırılmadığını göstermektedir. Eğer işaretlenmemişse, grup herhangi bir enstrümanda işlem yapabilir ve sadece limitleri tanımlanmış olan enstrümanlarda risk kontrolü yapılır.
- **İhlaller**: İlgili risk grubuna ait risk kontrolü ihlallerinin sayısını görüntüler.
- **Uyarılar**: İlgili risk grubuna ait risk kontrolü uyarılarının sayısını görüntüler.
- **Bildirimler**: İlgili risk grubuna ait risk kontrolü bildirimlerinin sayısını görüntüler.
- **Uyarı%**: Temsilci veya grup bu limit yüzdesine ulaştığında, ikaz amaçlı e-posta uyarıları oluşturulacaktır.
- **Bildirim%:** Temsilci veya grup bu limit yüzdesine ulaştığında, ikaz amaçlı e-posta uyarıları oluşturulacaktır.
- **Emir/sn. Limiti**: Üye tarafından bir risk grubu için konulmuş emir/sn. limiti görüntüler. Risk grubu için Üye ve Borsa tarafından tanımlanmış emir/sn. limitlerinin en düşüğü geçerli olacaktır. Emir/sn. limitinin aşılması sadece ihlal e-postalarını oluşturacak, uyarı veya bildirim e-postalarını oluşturmayacaktır.
- **Borsa Emir/sn. Limiti**: Borsa tarafından bir risk grubu için konulmuş emir/sn. limitini görüntüler. Üye ve Borsa emir/sn. limitlerinin en düşüğü geçerli olacaktır. Emir/sn. limitini aşmak sadece ihlal e-postalarını oluşturacaktır, emir/sn. limitini aşmak uyarı veya bildirim e- postalarını oluşturmayacaktır.

6.1. Temsilci Panelinde Bildirim, Uyarı ve İhlal Göstergeleri

Temsilci panelindeki risk grupları alarm durumuna göre değişen renklerde görüntülenecektir. Renkler söz konusu grup için meydana gelmiş her türlü bildirim, uyarı ve ihlal olaylarına karşılık gelmektedir.

- **Yeşil:** Risk grubunun riski mevcut durumda bildirim eşiğinin altındadır.
- **Sarı:** Risk grubunun riski bir limitte bildirim seviyesini geçmiştir.
- **Turuncu:** Risk grubunun riski bir limitte uyarı seviyesini geçmiştir.
- **Kırmızı:** Risk grubu bir limiti ihlal etmiştir.



Grup ihlal durumunda iken;

- Risk grubu altında tanımlı kullanıcılar limiti ihlal edilmiş enstrümana yeni emir gönderemez, fakat bekleyen emirleri iptal edebilirler.

Bir risk grubu ihlalini kaldırmak için lütfen risk grubunun engellemesini kaldırma bölümüne bakınız.

6.1.1. Uyarı ve Bildirim Yüzdelerini Ayarlama

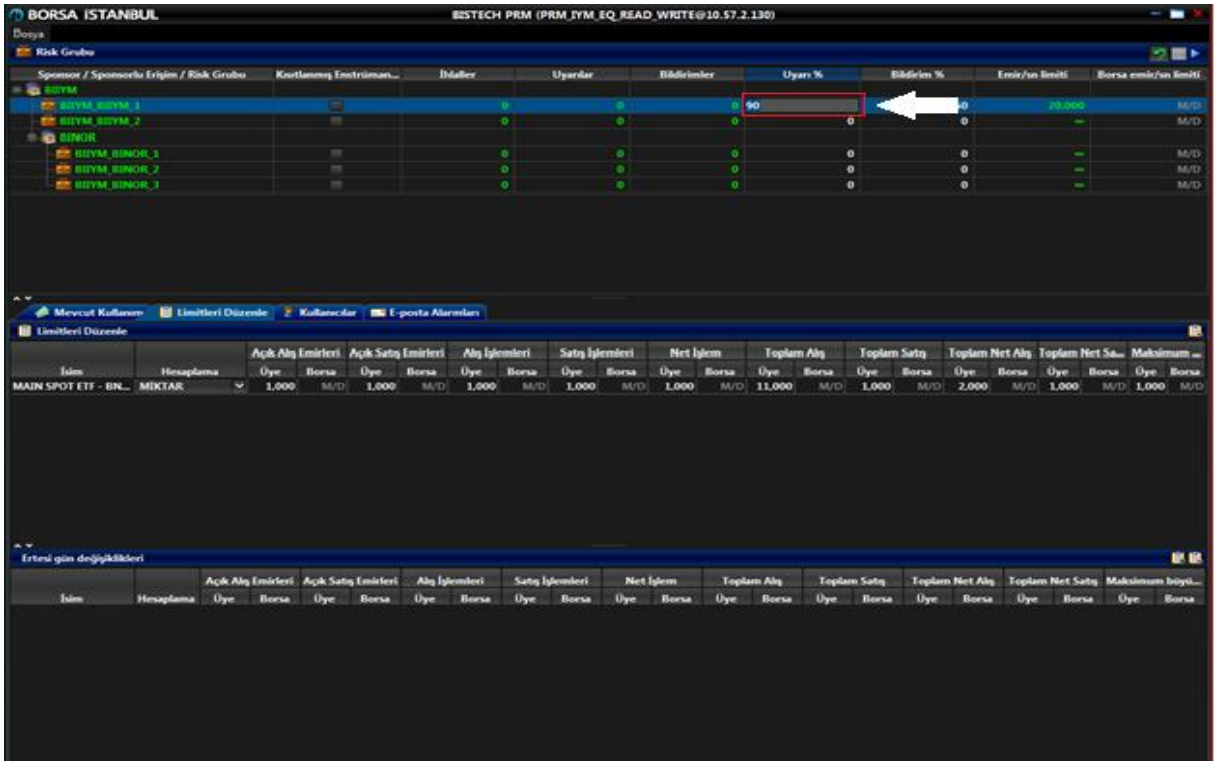
Bir risk grubunun risk eşiklerini takip etmek için, uyarı ve bildirim yüzdelerini yapılandırabilirsiniz.

İhlallerle ilişkilendirilmiş değerler görsel bir gösterge sunmak amacıyla renkler kullanılarak görselleştirilmiştir.

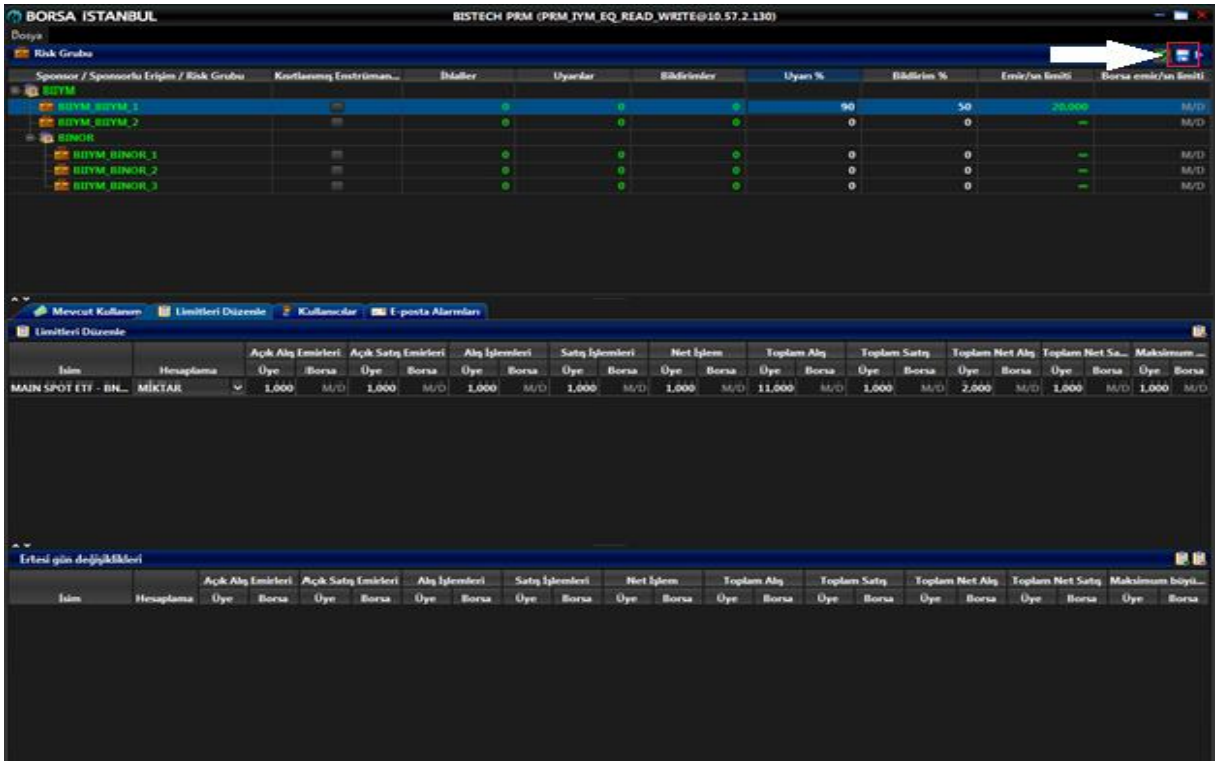
- Bildirim bir alarmın en düşük seviyesidir.
- Uyarı bildirimin bir sonraki seviyesidir.

Bir risk grubunun uyarı ve bildirim yüzdelerini ayarlamak için:

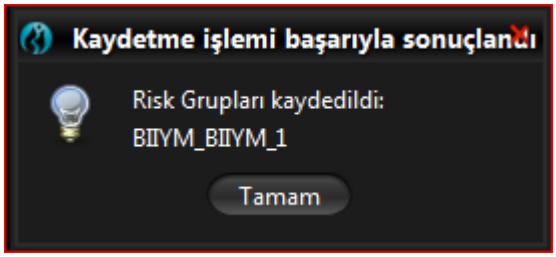
1. Bir risk grubu satırında Uyarı% veya Bildirim% sütununa çift tıklayınız.
2. Uyarı% veya Bildirim % için yeni bir değer giriniz.



3. Değişiklikleri kaydetmek için temsilci panelindeki kaydet düğmesine tıklayınız.



4. Risk grubu/grupları için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.



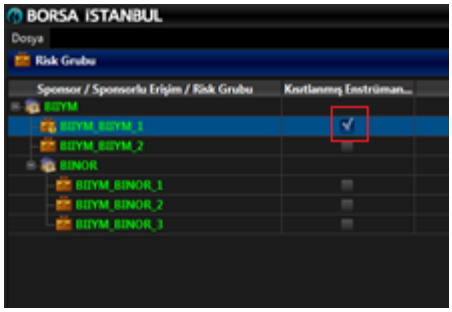
Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır. Gün içi değişiklikler hakkında daha fazla bilgi için gün içi değişiklikler bölümüne bakınız.

6.2. Bir Risk Grubu İçin İşlem Yapılabilecek Enstrümanları Kısıtlama

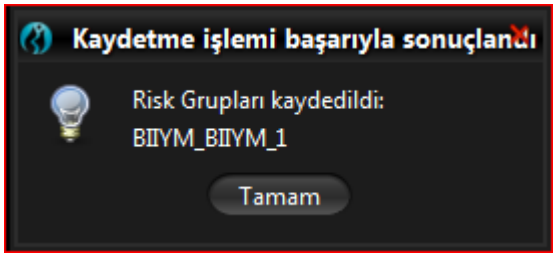
Temsilci panelinde kısıtlanmış enstrümanlar sütununu bulabilirsiniz. Bu sütun grubun sadece risk limitlerini tanımlamış olan enstrümanlar için işlem yapıp yapamayacağını kontrol etmektedir. Kutucuk işaretlenmemişse, risk grubu tüm enstrümanlarda işlem yapabilir ve bu durumda sadece risk limiti tanımlanmış enstrümanlarda risk takibi yapılacak ve ihlaller oluşacaktır.

Sadece risk limitleri tanımlanmış olan enstrümanlarda işlem yapmak üzere risk grubunu sınırlamak için aşağıdaki adımları izleyiniz;

1. Temsilci panelinde bir risk grubu seçiniz.
2. Kısıtlanmış enstrümanlar kutucuğunu işaretleyiniz. Kaydet düğmesine tıklayınız.



3. Risk grubu/grupları için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Tamam düğmesine tıklayınız.



Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

6.3. Emir/sn. Limitini Ayarlama

Emir/sn. limiti temsilci panelinden risk grubu bazında düzenlenir. Bu limit, eşleşme modülüne risk grubundaki tüm temsilcilerden gönderilen emirlerin sayısını toplayarak risk ölçümünü yapar.

Emir/sn. limiti kontrolünde emir defterine alınan yeni emirler hesaplamaya dâhil edilmektedir. Eğer bir emir, emir girişinde işleme dönüşmüş ise emir/sn. limiti hesaplamasına dahil edilecektir.

Aşağıdaki emir türleri Emir/sn. limiti hesaplamasına dâhil edilmemektedir.

- Emir iptal talepleri
- Reddedilen emirler
- Emir düzeltmeleri
- Gerçekleşmezse iptal et gibi defterde kalmayan emir türleri.

Not: Bu emirler eğer işlem görürlerse hesaplamaya dâhil edilecektir. Müzayede zamanları boyunca bu türler emir defterinde kalmaktadır.

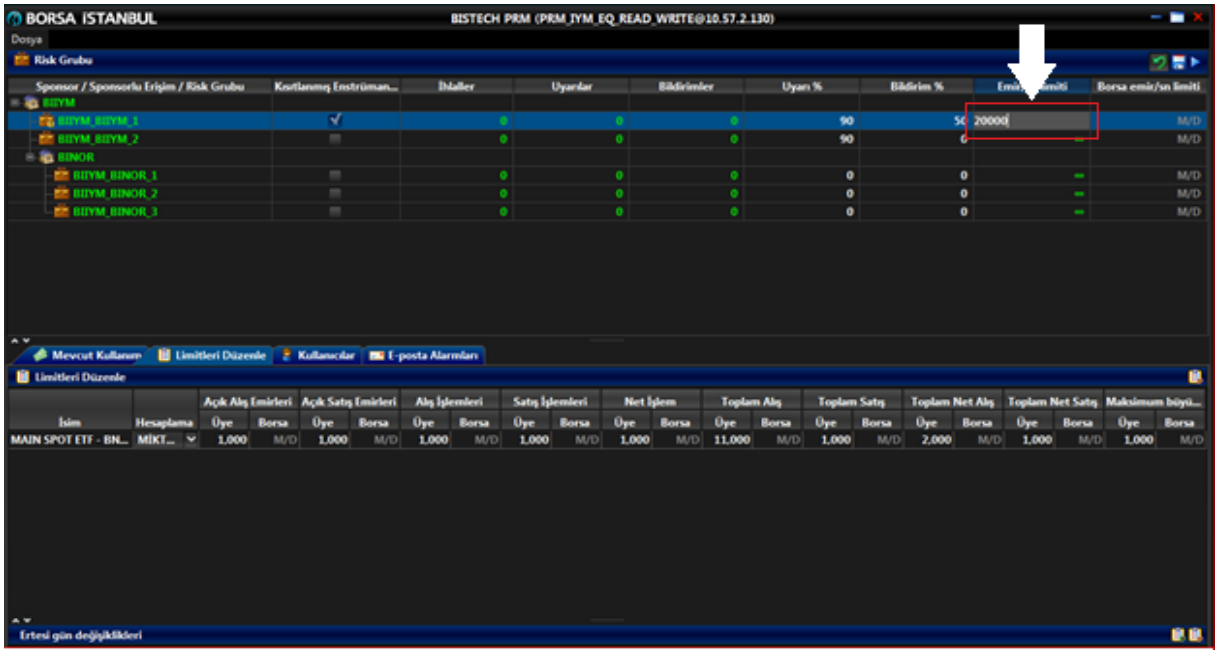
Saniyenin her 10'da 1'inde emir/sn. limiti kontrolü yapılmaktadır. Bir risk grubundaki kullanıcılar tarafından saniyenin onda biri zaman diliminde gönderilen emir sayısı ilgili risk grubu için tanımlanan emir/sn. limitinin onda birine eşit veya daha büyükse emir/sn. limiti ihlal edilmiş olur.

Üyenin PTRM kullanıcısı ve Borsa PTRM kullanıcısı bir risk grubu için emir/sn. limiti belirleyebilmektedir. Her iki limit de temsilci panelinde görüntülenebilmektedir. Borsa ve Üye kullanıcısının aynı anda limit tanımlaması durumunda iki limitin en sınırlayıcı olanı geçerli olacaktır. İki limitten geçerli olan yeşil renkte görüntülenecek ve geçerli olmayan ise gri renkte görüntülenecektir.

Emir/sn. limitinin ihlali halinde oluşan engelleme durumunun nasıl kaldırıldığını öğrenmek için emir/sn. limiti ihlalinin engellemesini kaldırma bölümüne bakınız.

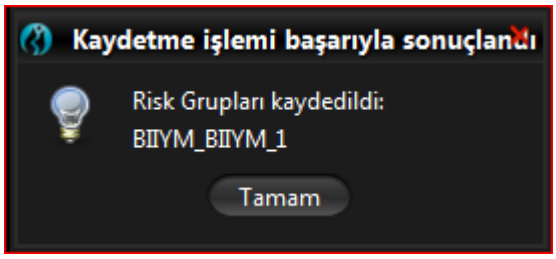
Bir risk grubuna bir emir/sn. limiti atamak için aşağıdaki adımları izleyiniz.

1. Bir risk grubu satırında emir/sn. limiti sütununa çift tıklayınız.
2. Emir/sn. limiti için yeni bir rakam giriniz.



3. Değişikliklerinizi kaydetmek için temsilci panelindeki kaydet düğmesine tıklayınız.

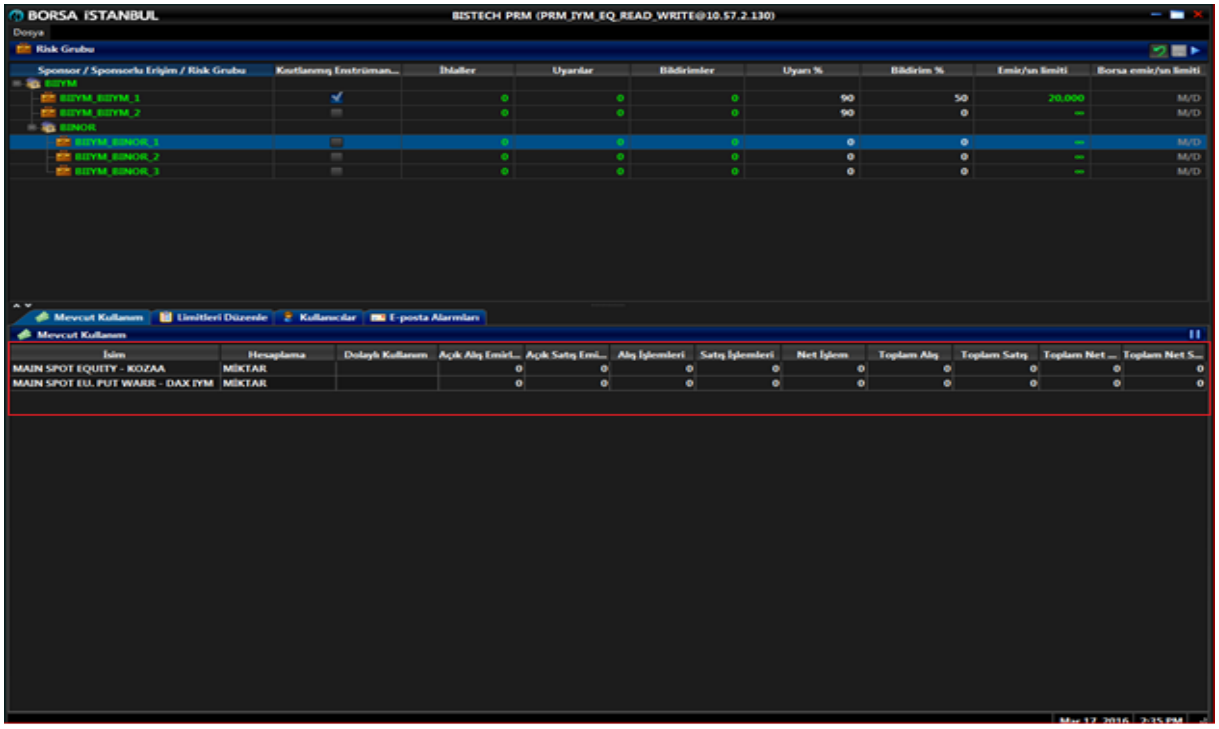
4. Değiştirmiş olduğunuz grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme onay penceresi görüntülenecektir. Tamam düğmesine tıklayınız.



Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

7. MEVCUT KULLANIM SEKMESİ

Mevcut kullanım sekmesi seçilen risk grubu için enstrüman bazında geçerli limit hesaplama yöntemleri ile risk grubuna tanımlanmış limitlerin anlık tüketimini görüntüler. Bunların yanı sıra kısıtlanmış enstrümanın seçilmesi durumunda, dolaylı kullanım sebebiyle risk hesaplaması yapılan enstrümanların anlık tüketimleri de bu ekranda gösterilmektedir.



Mevcut kullanım sekmesinde aşağıdaki sütunlar gösterilmektedir:

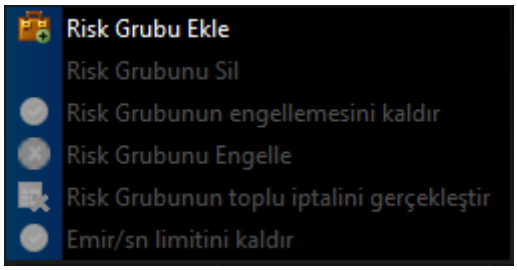
- **İsim**: Enstrümanın adıdır.
- **Hesaplama**: Limitler hesaplamaları için geçerli hesaplama metodudur. Miktar, hacim yada değer seçilebilmektedir.
- **Dolaylı Kullanım**: Borsa tarafından üyenin risk grubuna atanmış ve risk limiti belirlenmiş olan bir enstrüman için üye kendisi risk limiti belirlememiş ise ve kısıtlanmış enstrüman kutucuğunun işaretlenmiş olması durumunda limit kullanımının Borsanın belirlediği limitlerden gerçekleşeceğini ifade eder.
- **Açık alış emirleri**: Enstrüman için açık alış emirlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Açık satış emirleri**: Enstrüman için açık satış emirlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Alış İşlemleri**: Enstrüman için alım işlemlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Satış İşlemleri**: Enstrüman için satım işlemlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Net İşlem**: Enstrüman için Alış İşlemleri - Satış İşlemleri mutlak değerini gösterir.
- **Toplam Alış**: Enstrüman için Açık Alış Emirleri + Alım İşlemleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Satış**: Enstrüman için Açık Satış Emirleri + Satım İşlemleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Net Alış**: Enstrüman için Alım işlemleri - Satış işlemleri + Açık Alış Emirleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Net Satış**: Enstrüman için Satış İşlemleri - Alım İşlemleri + Açık Satış Emirleri toplamını göstermektedir.

8. RİSK GRUPLARIYLA ÇALIŞMA

8.1. Risk Grubu Ekleme

Bir risk grubu eklemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

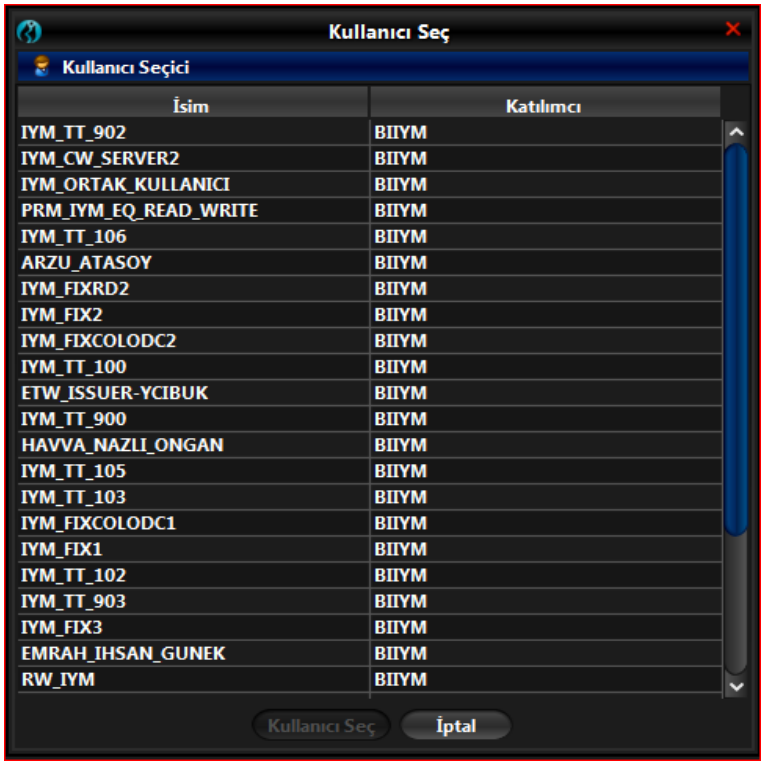
1. BISTECH PTRM penceresi temsilci panelinden bir sponsor olan üye veya bir sponsor olunan müşteri seçiniz.
2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından açılan menüden risk grubu ekle başlığını seçiniz.



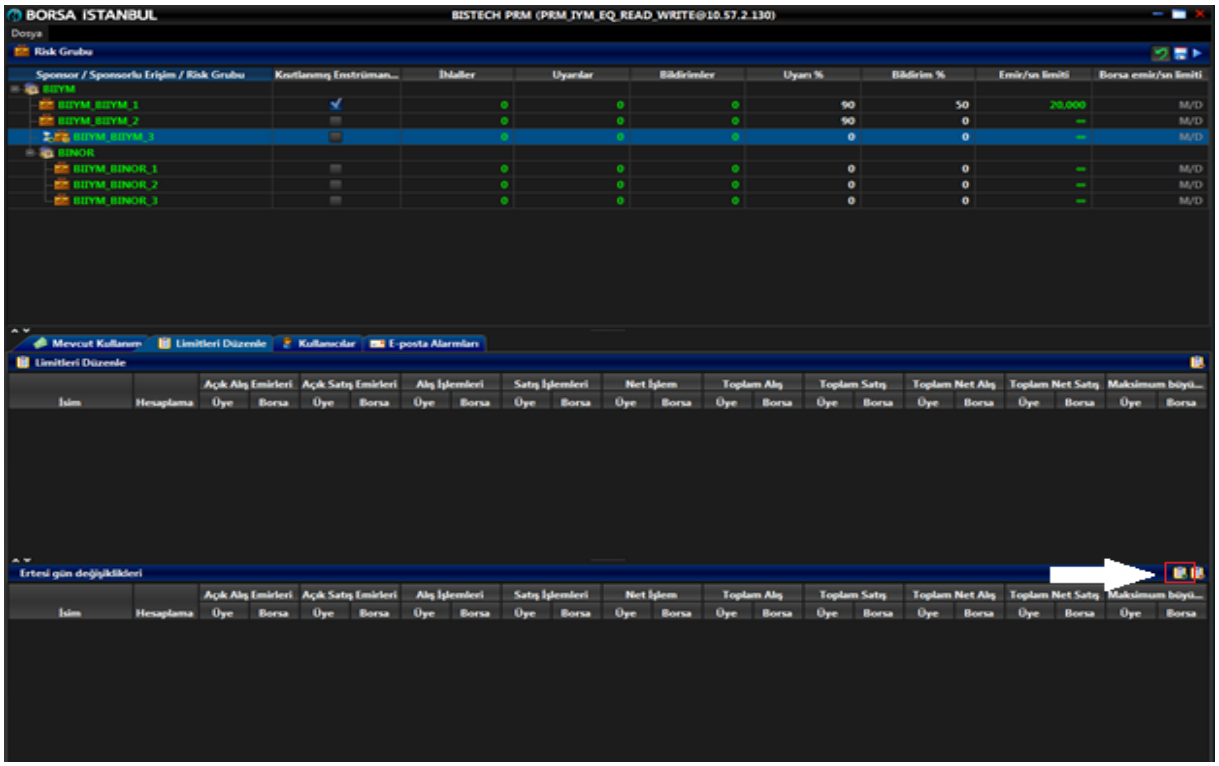
3. Giriş penceresi görünecektir. Yeni risk grubunun adını giriniz. Tamam düğmesine tıklayınız, eylemi iptal etmek için iptal düğmesine tıklayabilirsiniz.

Not: Bir risk grubuna özgün bir isim verilmesi zorunludur. İsim oluşturulurken aşağıdaki adlandırma kuralını kullanılmalıdır:[Sponsor olan Üye Kodu]_[Sponsor Olunan Müşteri Kodu]_[Grup İsmi]

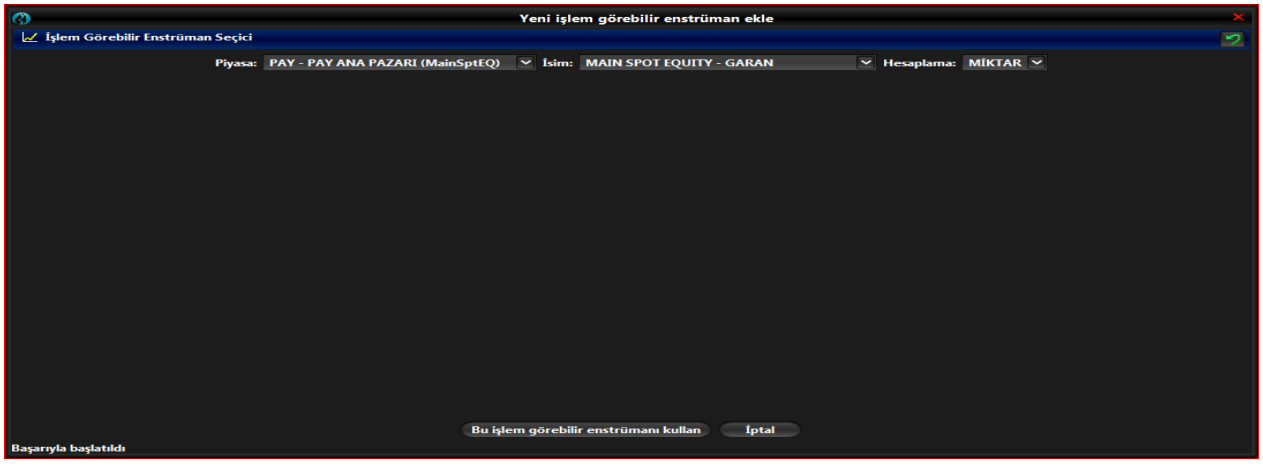
4. Kullanıcı seç penceresinden yeni risk grubunun altında yer alacak kullanıcıları seçiniz ve kullanıcı seç tuşuna tıklayınız.



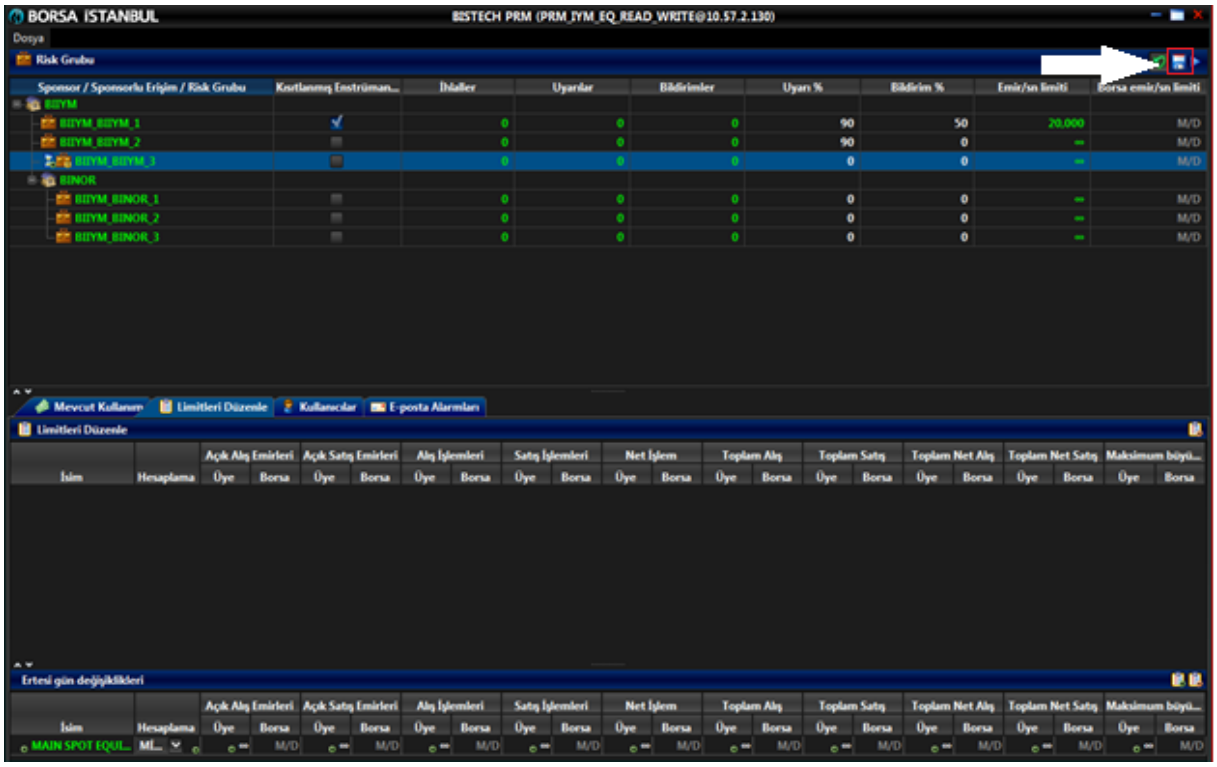
5. Yeni işlem görebilir enstrüman ekle düğmesine tıklayarak yeni grubunuza bir ya da birden fazla enstrüman atayınız.



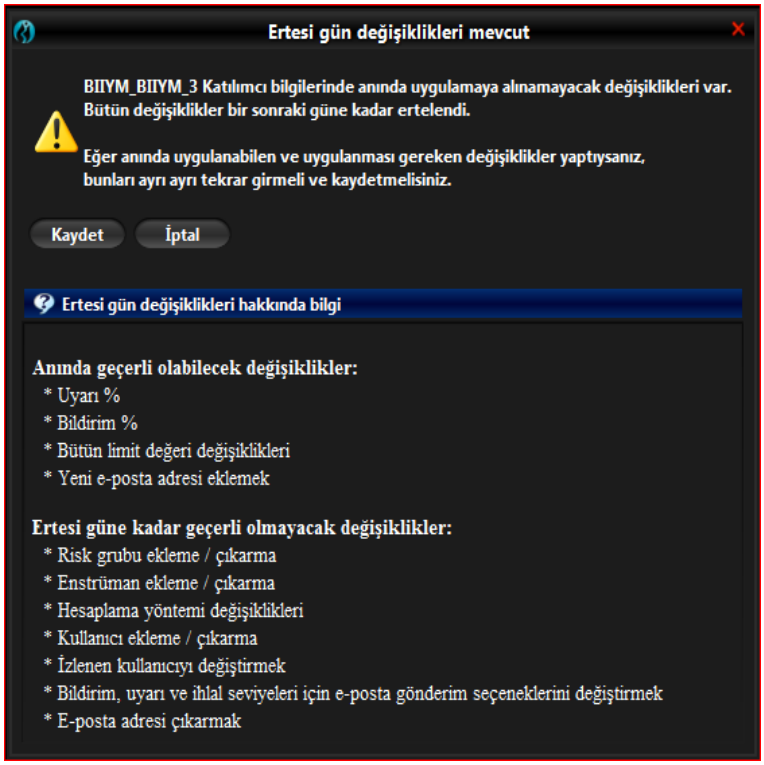
6. Çıkan yeni işlem görebilir enstrüman ekle penceresinden piyasa, isim ve hesaplama seçerek yeni enstrümanlarınızı ekleyebilirsiniz. Eğer bunu yapmak için yardıma ihtiyacınız olursa, yeni bir işlem limiti ekleme bölümüne bakınız.



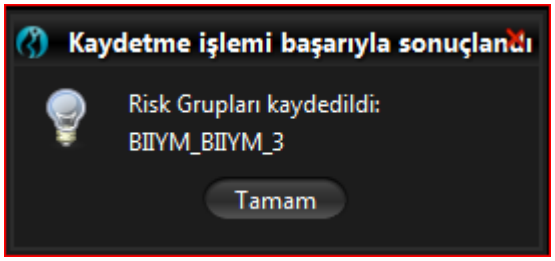
7. Değişikliklerinizi kaydetmek için temsilci panelindeki kaydet düğmesine tıklayınız.



8. Değiştirmiş olduğunuz grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri onaylamanızı sağlayan ertesi gün değişiklikleri mevcut penceresi görüntülenecektir, bu pencerede kaydet tuşuna basınız.



9. Başarılı kaydetme onay penceresinde yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız. Risk grubunu ekledikten ve kaydet düğmesine tıkladıktan sonra yeni grup, ertesi gün değişiklikleri panelinde görünecek ve ertesi işlem gününde aktif hale gelecektir.



Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişikliği kaydetmek o değişikliğin borsa veri tabanına gönderilmesine ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelmesine sebep olur. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

8.2. Risk Grubunu Engelleme

Bir risk grubu bir üyenin PTRM kullanıcısı veya Borsa PTRM kullanıcısı tarafından manuel olarak engellenebilmektedir. Engellenmiş grupların kullanıcıları yeni emir girememekte ve mevcut emirler üzerinde değişiklik yapamamaktadırlar.

Engellenmiş bir risk grubunun kullanıcıları:

- Mevcut emirleri ve kotasyonları iptal edebilirler,
- Oturum açma iznine sahiptirler,
- Broadcast alma ve sorgulama iznine sahip olduklarından, piyasayı takip edebilmektedirler.

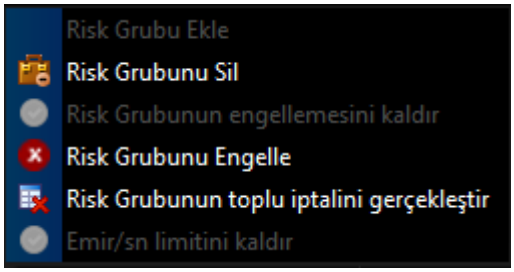
Üye ve Borsa PTRM kullanıcıları, bloke edilmiş bir risk grubu namına hala hareket edebilirler (Risk Grubu bloke edilmeden evvelki ile aynı şekilde).

Risk gruplarının manuel engellemesi gün içinde otomatik olarak ortadan kalkmamaktadır. Bloke edilmiş bir risk grubunun engellemesi ancak gün içinde bir üye veya Borsa PTRM kullanıcısı tarafından kaldırılabilir.

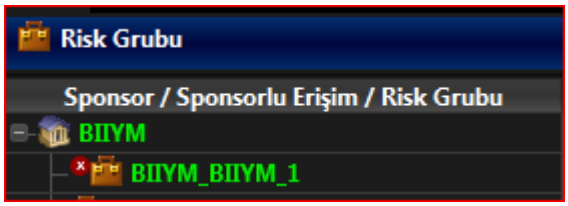
Eğer risk grubunun engellemesi o işlem günü boyunca manuel olarak kaldırılmamışsa, bloke edilmiş grubun engellemesi ertesi işlem günün başında otomatik olarak kaldırılacaktır.

Bir risk grubunu manuel engellemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzündeki temsilci panelinde bir risk grubunu seçiniz.
2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından da açılan menüden risk grubunu engelle başlığını seçiniz.



3. Grup için kullanılan ikon bu durumu belirtmek amacıyla değişir.

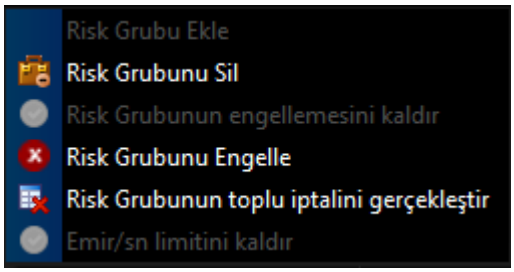


Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

8.3. Risk Grubunu Silme

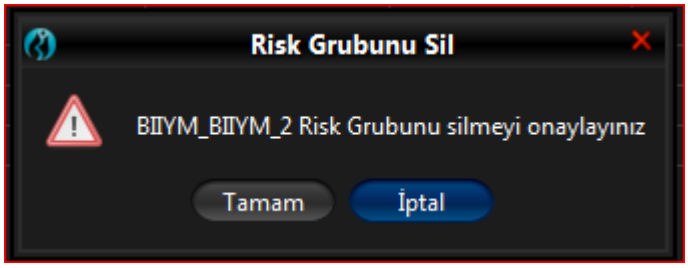
Bir risk grubunu silmek için aşağıdaki adımları tamamlayın:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzündeki temsilci panelinden bir risk grubu seçiniz.
2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından açılan menüden risk grubunu sil başlığını seçiniz.



3. Kaydet düğmesine tıklayınız.

4. Grubu silmek için tamam düğmesine tıklayınız, eylemi iptal etmek için iptal düğmesine de tıklayabilirsiniz.



Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişikliği kaydetmek o değişikliğin borsa veri tabanına gönderilmesine ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelmesine sebep olur. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

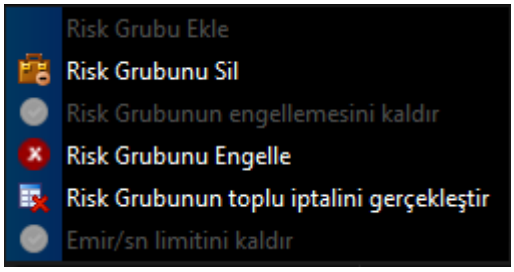
Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

8.4. Risk Grubunda Emirleri Toplu Halde İptal Etme

Toplu iptal, PTRM kullanıcısına belirli bir risk grubundaki kullanıcılar için mevcut açık emirlerin hepsini iptal etme olanağı sağlar.

Bir risk grubu için emirleri iptal etmek üzere aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzündeki temsilci panelinden bir risk grubu seçiniz.
2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından da açılan menüden risk grubu toplu iptalini gerçekleştir seçeneğini seçiniz.



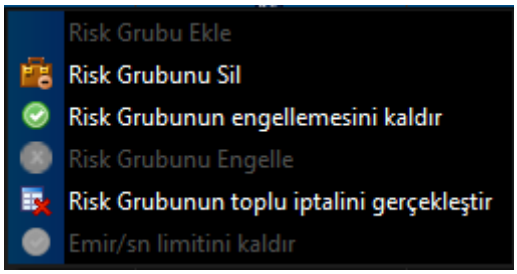
3. Grup için sistemde bekleyen emirlerin hepsi iptal edilmiş olacaktır. Mevcut kullanım sekmesi ve TW ekranlarından bekleyen emirlerin iptalini kontrol edebilirsiniz.

Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

8.5. Risk Grubunun Engellemesini Kaldırma

Bir risk grubunun engellemesini kaldırmak için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzündeki temsilci panelinde bir risk grubu seçiniz.
2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından da açılan menüden risk grubunun engellemesini kaldır seçeneğini seçiniz. Grubun engellemesi kaldırılmış olacaktır. Grup için kullanılan ikon bu durumu belirtmek amacıyla değişir. Risk grubunun engellemesini kaldırdıktan sonra, gruptaki kullanıcılara normal şekilde emir girme ve işlem yapma izni verilir.



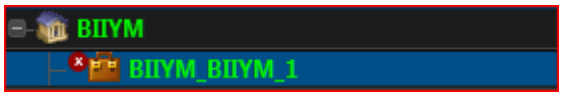
Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

8.6. Bir Emir/sn. Limiti İhlalinin Engellemesini Kaldırma

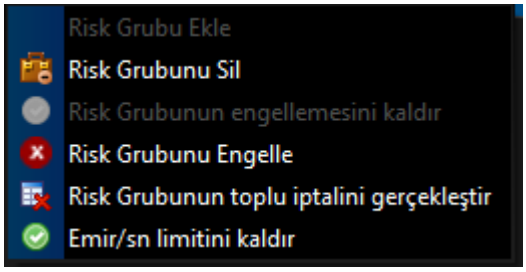
Eğer bir risk grubu kendisine tanımlanan emir/sn. limitlerini ihlal ederse, yeni bir emir giremeyecektir. İhlal sınırlamasını kaldırmak için engellemenin yetkili PTRM kullanıcısı tarafından manuel olarak kaldırılması gereklidir.

Bir emir/sn. limiti ihlalinin engellemesini kaldırmak için aşağıdaki adımları izleyiniz;

1. BISTECH PTRM penceresinden temsilci panelinde engellenmiş bir risk grubunu seçiniz.



2. Farenizi kullanarak sağ tıklayınız ve ardından da açılan menüden emir/sn. limitini kaldır başlığını seçiniz.



Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır.

8.7. Risk Grubu Enstrüman Limitinin İhlalinin Kaldırılması

Bir risk grubu enstrümanı ihlal durumundayken;

O risk grubu altındaki kullanıcılar aşağıdakileri yapabilir:

- Açık emirleri iptal edebilir.
- İhlal durumunda olmayan enstrümanlarda emir girip işlem yapabilir.

O risk grubu altındaki kullanıcılar aşağıdakileri yapamaz:

- İhlal edilmiş enstrümanlarda yeni emir giremez.
- İhlal edilmiş enstrümanlarda mevcut emirlerinde düzeltme yapamaz.

Eğer bir temsilci mevcut emirlerini kendi limitleri dâhilinde kalacak şekilde iptal ederse ihlal durumu otomatik olarak kalkar ve risk grubu altındaki kullanıcılar normal şekilde emir girip işlem yapabilir.

Bir sponsor olan üye PTRM kullanıcısı bir risk grubunun ihlalini kaldırmak için ayrıca ihlal durumunda olan risk grubuna atanmış mevcut limiti arttırabilir.

Sponsor olan üye veya Borsa PTRM kullanıcısı ihlal edilmiş bir grupta aşağıda sıralanan aksiyonları alabilir:

1. Grubun ihlal durumunda bırakılması durumunda sisteme gönderilen emirler reddedilecektir.
2. İhlal durumunda olan risk grubuna atanmış mevcut limitin arttırılması durumunda sisteme gönderilen emirler kabul edilecektir.

8.8. Grup Kilidi

Borsa seviyesinde yetkiye sahip bir PTRM kullanıcısı, üye risk gruplarını değişiklik yapmamaları için kilitleyebilir.

Kilitlenmiş bir risk grubu aşağıdaki aksiyonları almaya yetkili değildir;

- Üye PTRM kullanıcısı gruba kullanıcı ekleyemeyecek veya gruptan kullanıcı çıkaramayacaktır.
- Üye e-posta alarmlarının ikaz seviyelerini değiştiremeyecektir.

Kilitlenmiş bir risk grubu aşağıdaki aksiyonları almaya yetkilidir;

- E-posta alarmları alıcıları ekleme ve çıkarma.

Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

9. ENSTRÜMAN LİMİTLERİNİ DÜZENLEME

Bir dizi enstrüman üzerinde tüm risk grubu kullanıcılarının maruz kaldığı riskler hep birlikte hesaplanır.

BISTECH PTRM uygulamasında, limitleri aşağıdaki parametreleri ayarlayarak yapılandırırsınız:

1. Bir piyasa ve/veya enstrüman seçimi yapılır.
2. Risk limiti için bir hesaplama metodu seçimi yapılır.

Hesaplama metodu aşağıdakilerden biri olabilir:

- **Miktar**: Risk, risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedinin kümülatif toplanmasıyla hesaplanır.

- **Hacim:** Risk, risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedinin fiyat ile çarpılarak kümülatif toplanmasıyla hesaplanır.
- **Değer**: Risk, risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedinin fiyat çarpanı ile çarpılarak kümülatif toplanmasıyla hesaplanır.

Her bir enstrüman grup bazında farklı limitlerin hesaplandığı çeşitli risk limiti parametrelerine sahip olabilmektedir.

- **Açık alış emirleri**: Enstrüman için açık alış emirlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Açık satış emirleri**: Enstrüman için açık satış emirlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Alış İşlemleri**: Enstrüman için alım işlemlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Satış İşlemleri**: Enstrüman için satım işlemlerinin toplamını gerçek zamanlı gösterir.
- **Net İşlem**: Enstrüman için Alış İşlemleri - Satış İşlemleri mutlak değerini gösterir.
- **Toplam Alış**: Enstrüman için Açık Alış Emirleri + Alım İşlemleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Satış**: Enstrüman için Açık Satış Emirleri + Satım İşlemleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Net Alış**: Enstrüman için Alım işlemleri - Satış işlemleri + Açık Alış Emirleri toplamını göstermektedir.
- **Toplam Net Satış**: Enstrüman için Satış İşlemleri - Alım İşlemleri + Açık Satış Emirleri toplamını göstermektedir.
- **Maksimum Emir Büyüklüğü**: Her bir emrin girilebileceği maksimum emir büyüklüğü limitidir.

Borsa Limitleri ve Üye Limitleri

Bir risk grubu için iki risk limiti tanımlanabilmektedir. Bunlardan biri borsa tarafından tanımlanırken, diğeri Üyenin PTRM yöneticisi tarafından belirlenir. Borsa limiti borsanın operasyon birimi tarafından tüm risk grupları üzerinde uygulanmasına karar kılınmış temel risk seviyesini hedef alarak tanımlanmaktadır. Üyenin PTRM kullanıcısı daha sonra üye limitlerini ayarlayarak bu seviyeleri sınırlayabilir. Bir üyenin belirlediği limit, borsa limitinden daha sınırlayıcı(daha küçük bir değer) olabilir, ama daha az sınırlayıcı(daha büyük bir değer) olamaz. Risk Engine bu iki limitin en sınırlayıcı olanını uygulamaya geçirecektir. Dolayısıyla, üyeler risk limitlerini sıkılaştırabilir, ama borsa tarafından belirlenmiş seviyeleri gevşetemezler.

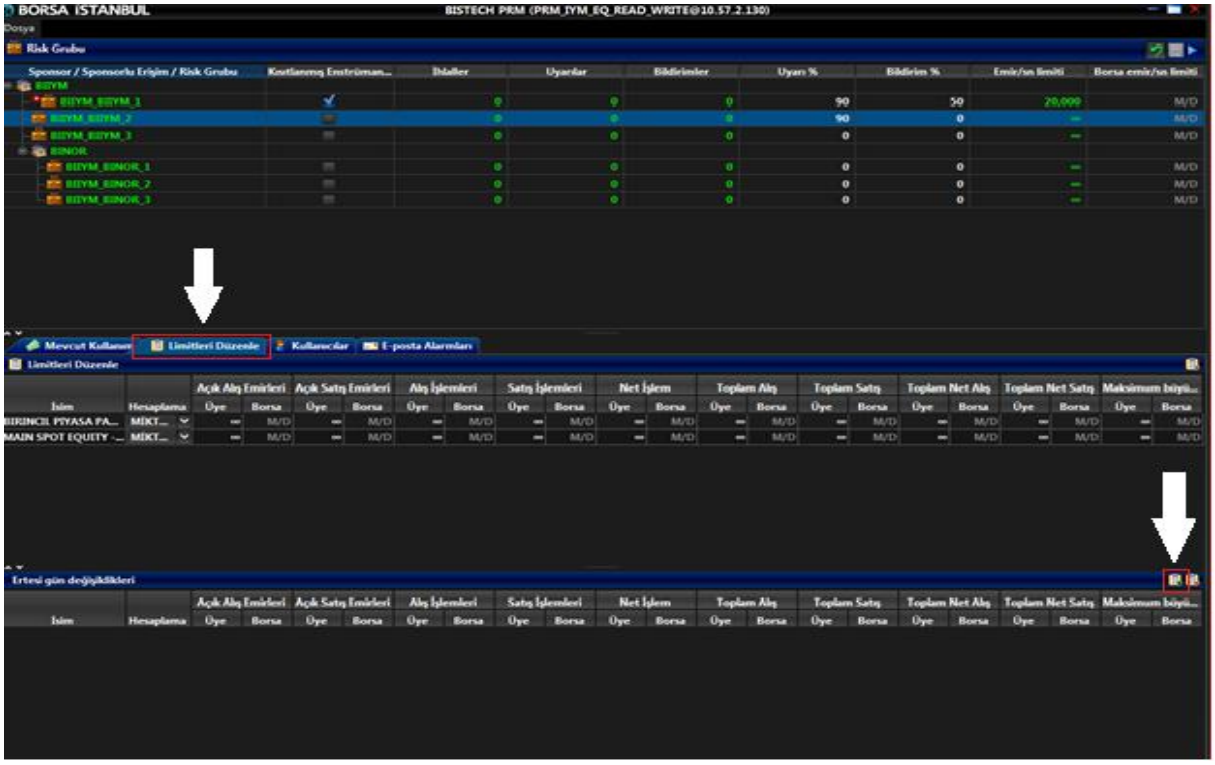
İhlal Edilmiş Limitler

Risk limitlerinden herhangi biri aşılırsa, ilgili enstrümana risk grubunun tüm kullanıcıları tarafından girilen yeni emirleri sistem reddeder. Limit ihlal edildiğinde kullanıcı ilgili enstrüman için bekleyen emirleri iptal edebilir.

9.1. Yeni Bir İşlem Limiti Ekleme

Bir risk grubuna yeni bir işlem limiti eklemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

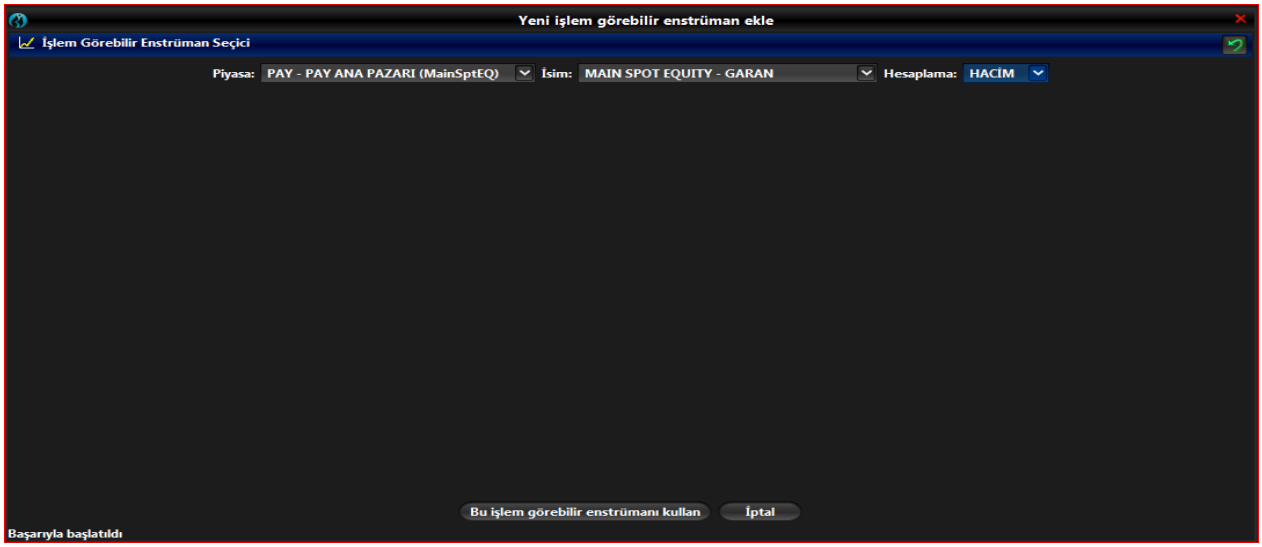
1. Limitleri üzerinde değişiklik yapmak istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından limitleri düzenle sekmesine tıklayınız. Yeni işlem görebilir enstrüman ekle düğmesine tıklayınız.



2. Bir enstrüman seçiniz:
   1. **Piyasa:** Enstrümanın bulunduğu piyasayı seçiniz. Bu alanı boş bırakmak tüm piyasalardaki enstrümanları gösterecektir.
   2. **İsim**: Görüntülenecek olan enstrümanın adıdır. Borsamızda işlem gören sermaye piyasası araçları burada listelenmektedir.
3. Limit için hesaplama metodunu seçiniz:

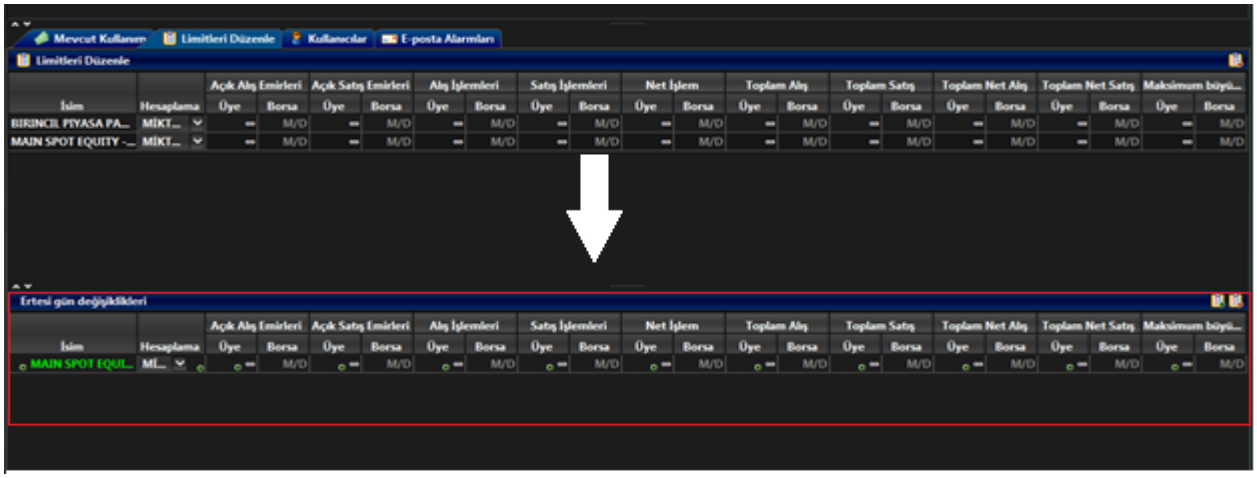
- ***Miktar***: Seçilmesi durumunda risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedi baz alınarak risk limiti hesaplaması yapılır.
- ***Hacim:*** Seçilmesi durumunda risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedinin fiyat ile çarpılması baz alınarak risk limiti hesaplaması yapılır.
- ***Değer***: Seçilmesi durumunda risk grubu altındaki her bir kullanıcı tarafından sisteme iletilen her bir emrin adedinin fiyat çarpanı ile çarpılması baz alınarak risk limiti hesaplaması yapılır.

4. Seçimlerinizi yaptıktan sonra bu işlem görebilir enstrümanı kullan düğmesine tıklayınız.

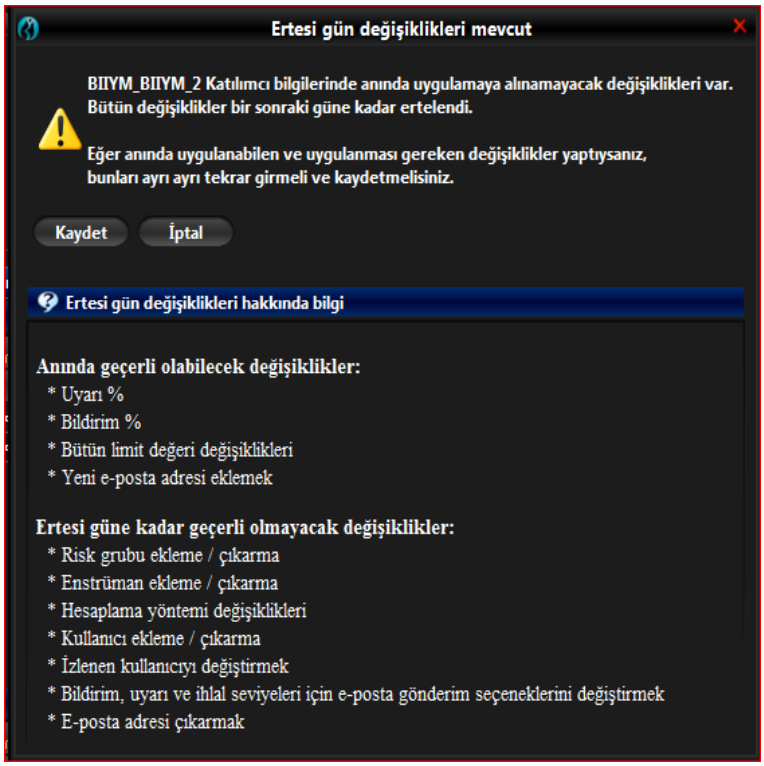


Not: Listelenen enstrümanlar sadece oturum açan kullanıcı için geçerli enstrüman tiplerinde tanımlanmış enstrümanları gösterecektir.

5. Limitleri düzenle panelinde, ertesi gün değişiklikleri sekmesinde işlem yapılabilir yeni enstrüman yeni bir satırda görünecektir. Seçilen enstrümanlarda uygulanacak her türlü limiti bu satırda ayarlayabilirsiniz.

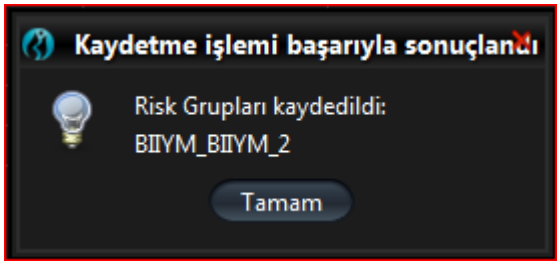


6. Kaydet düğmesine tıklayınız. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir. Kaydet düğmesine tıklayınız.

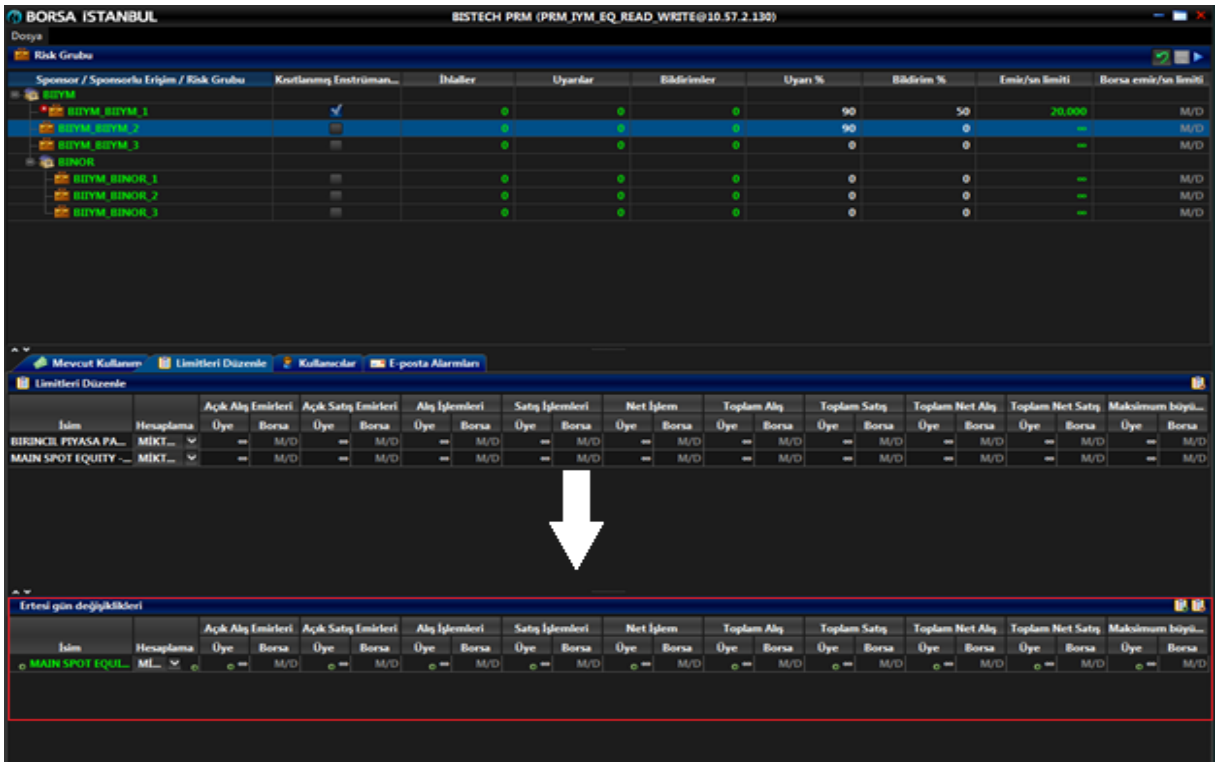


7. Değiştirmiş olduğunuz grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.

Not: Sıfır olan bir limit hacmi hiçbir limit olmadığı ve o risk sayacı için hiçbir ihlalin mümkün olmadığı anlamına gelir.



8. Yeni limit, ertesi gün değişiklikleri panelinde görünecek ve ertesi işlem gününde etkin hale gelmiş olacaktır.



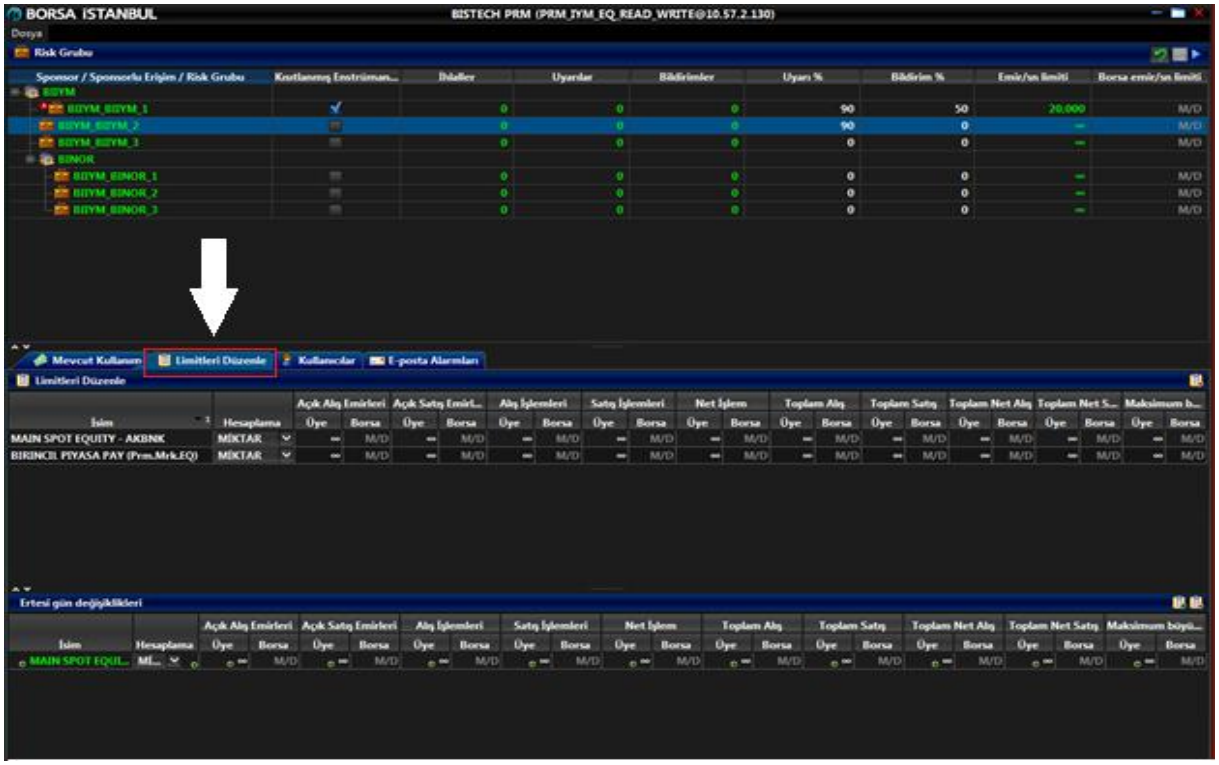
Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişikliği kaydetmek o değişikliğin borsa veri tabanına gönderilmesine ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelmesine sebep olur. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

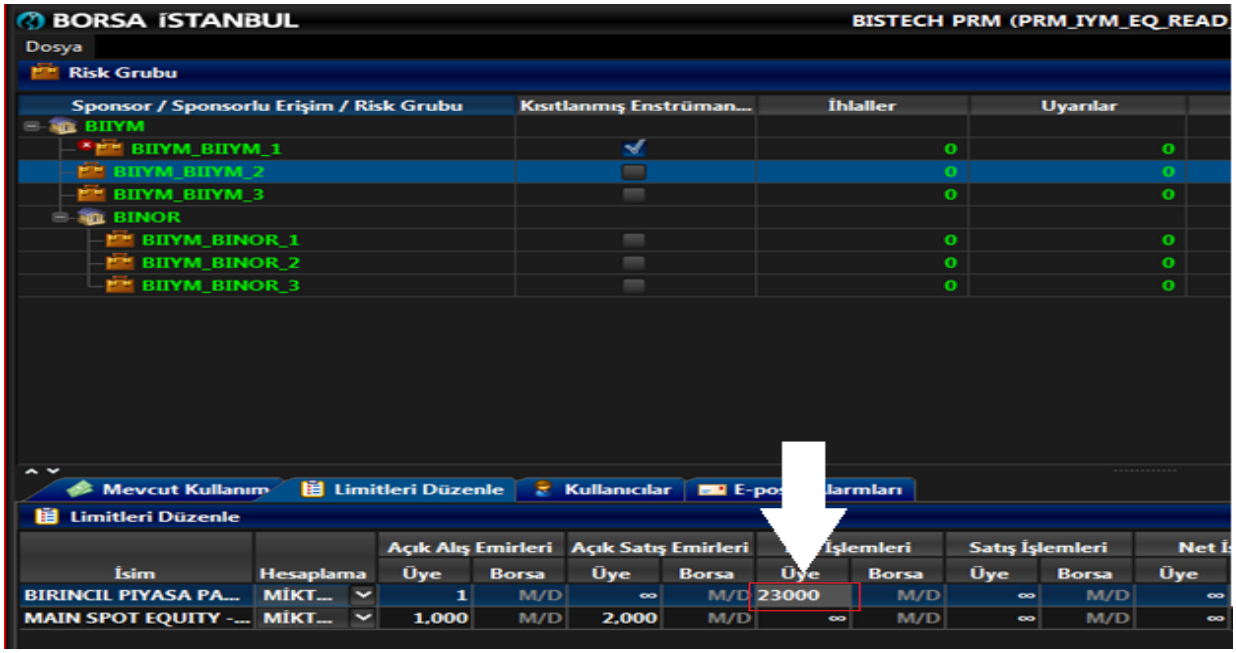
9.2. İşlem Limitlerini Düzenleme

Bir risk grubu üzerinde bir limiti düzenlemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünde limitlerini düzenlemek istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından limitleri düzenle sekmesine tıklayınız.

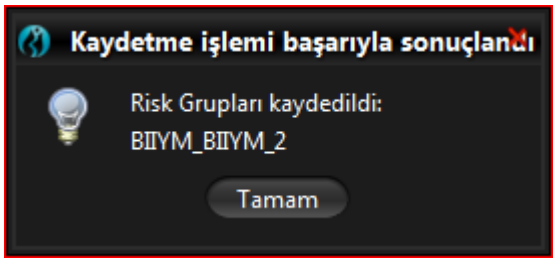


2. Gün içi değişiklikler panelinde gereken alanları gözden geçiriniz veya değiştiriniz.



3. Kaydet düğmesine tıklayınız.

4. İlgili risk grubu/grupları için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.



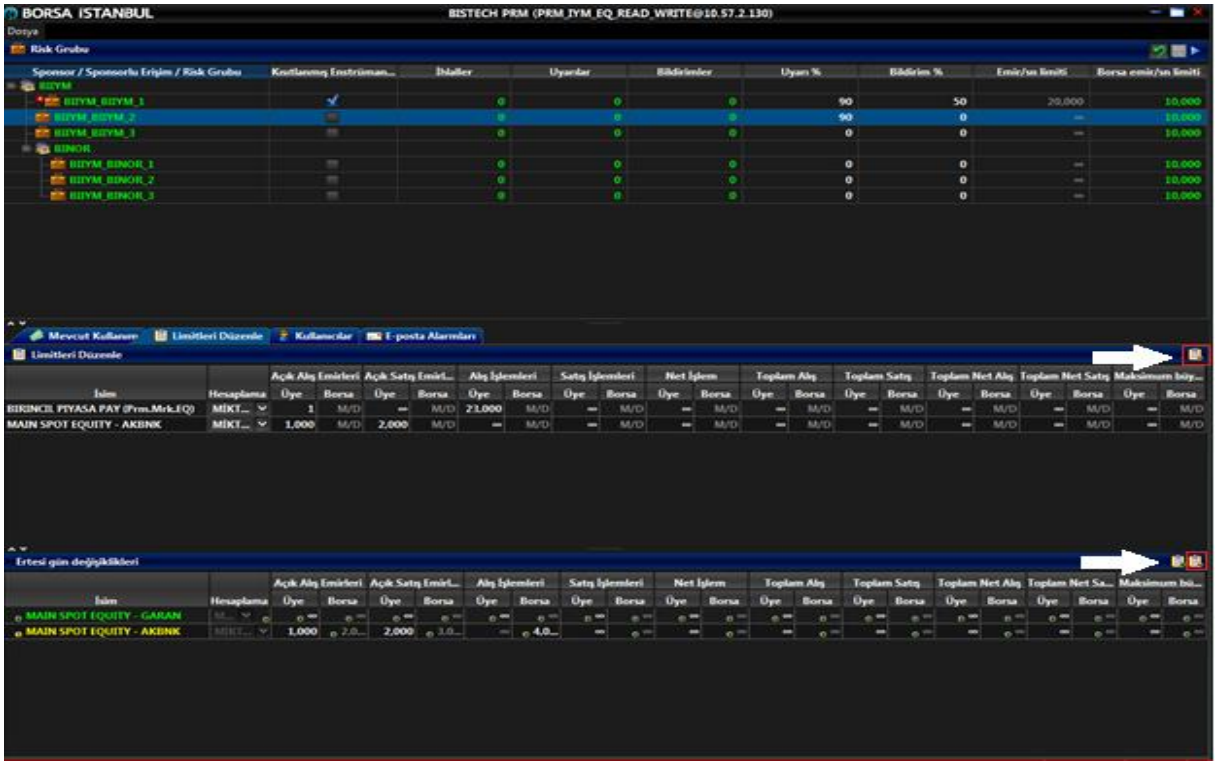
Not: Bir işlem limitini değiştirmek bir gün içi veya bir ertesi gün değişikliği olabilir. Eğer değişiklik sadece risk sayacı limitlerini etkilerse bu bir gün içi değişiklik olacaktır. Eğer değişiklik limit hesaplamasını etkilerse limit ertesi gün değişiklikleri panelinde görünecek ve ertesi gün uygulamaya sokulacaktır.

- **Limiti sıfır olarak tanımlamak risk kontrolünü etkisiz kılar.**
- **Bir limiti gün içinde sıfırdan sıfır-olmayan rakama değiştirmek öngörülemez sonuçlara sebep olabilir. Limit sıfır iken risk grubu, anlık tüketimi göz ardı eder.**

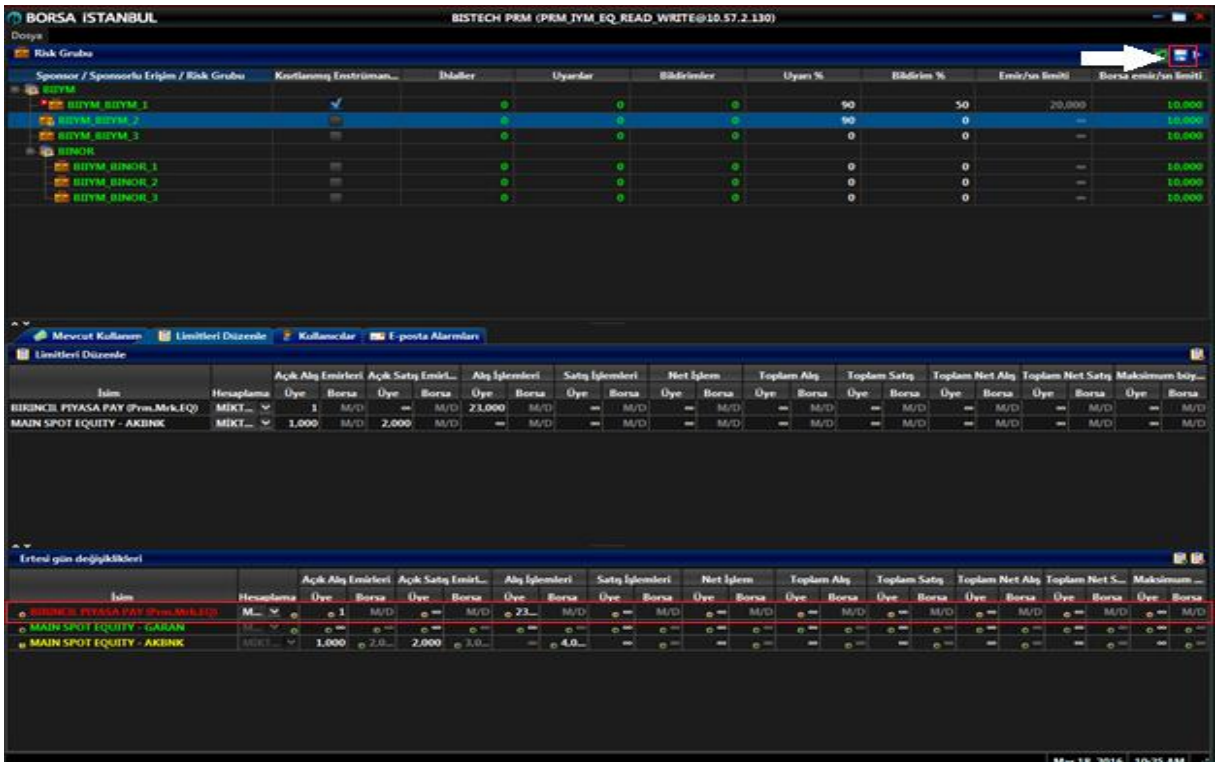
9.3. Bir İşlem Limitini Silme

Bir risk grubunda tanımlı bir işlem limitini silmek için aşağıdaki adımları izleyiniz;

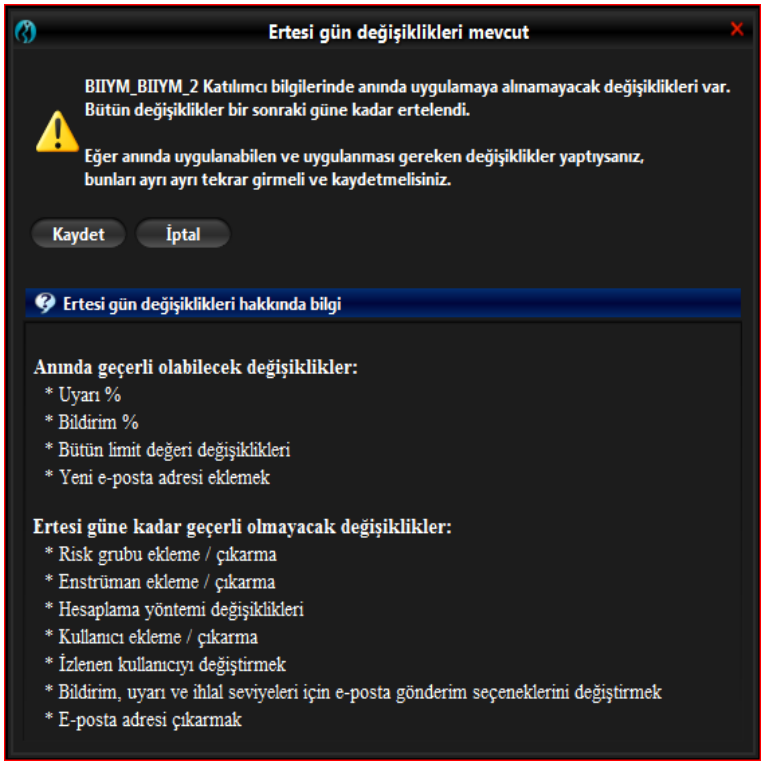
1. Limitlerini düzenlemek istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından limitleri düzenle sekmesine tıklayınız.
2. Ya gün içi değişiklikler yada ertesi gün değişiklikleri panelinde silinecek limiti seçiniz.
3. Uygun panelde çıkarma işleminin üye kısmını geri al düğmesine tıklayınız.



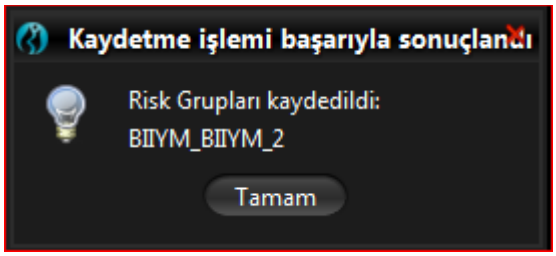
4. Kaydet düğmesine tıklayınız. Silinecek limit ertesi gün değişiklikleri panelinde kırmızı renkte ekran görüntüsündeki gibi görünecektir.



5. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir. Kaydet düğmesine tıklayınız.



6. İlgili risk grubu/grupları için yaptığınız değişiklikleri onaylandığını gösteren başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.



Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişikliği kaydetmek, o değişikliğin borsa veri tabanına gönderilmesine ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelmesine sebep olur. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

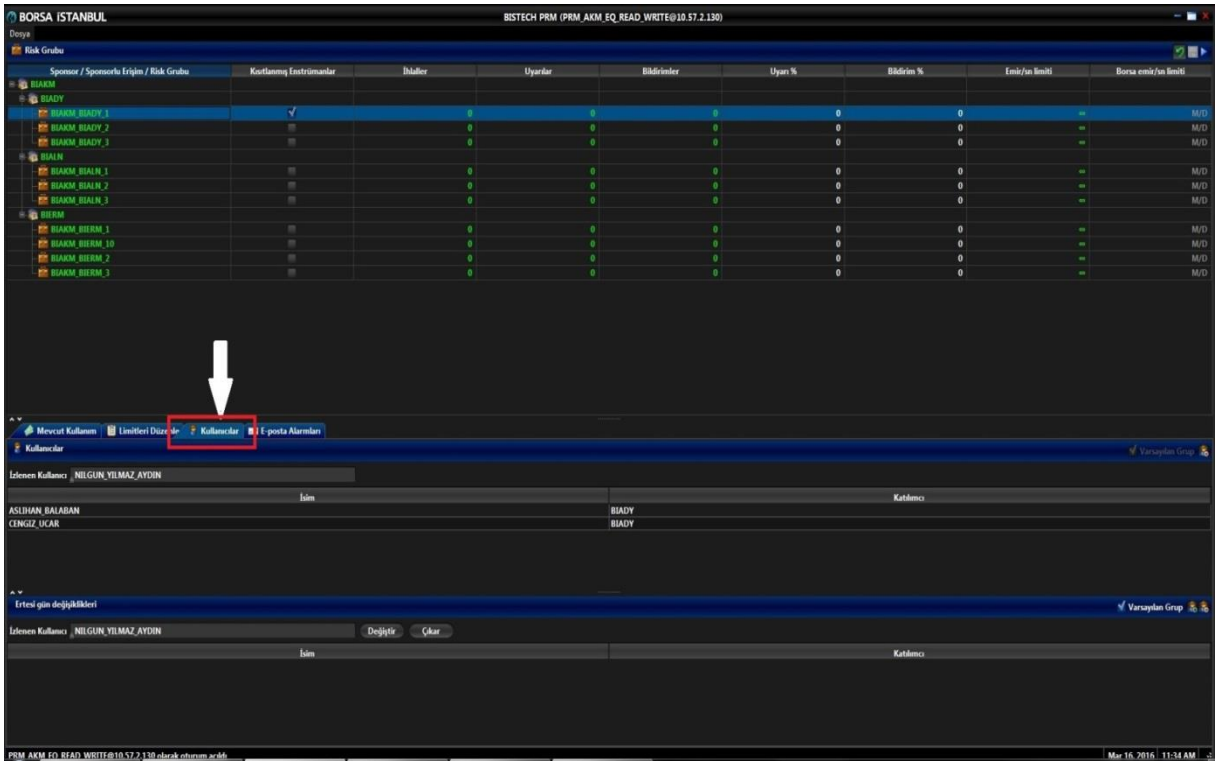
10. KULLANICI YÖNETİMİ GENEL BAKIŞ

Kullanıcılar sekmesi bir risk grubuna hangi kullanıcıların atandığını gösterir.

10.1. Kullanıcıları İnceleme

Bir risk grubuna atanmış kullanıcıları incelemek için, aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. Ana pencereden kullanıcılarını incelemek istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından kullanıcılar sekmesine tıklayınız.



2. Gruba atanmış kullanıcıları gözden geçiriniz:

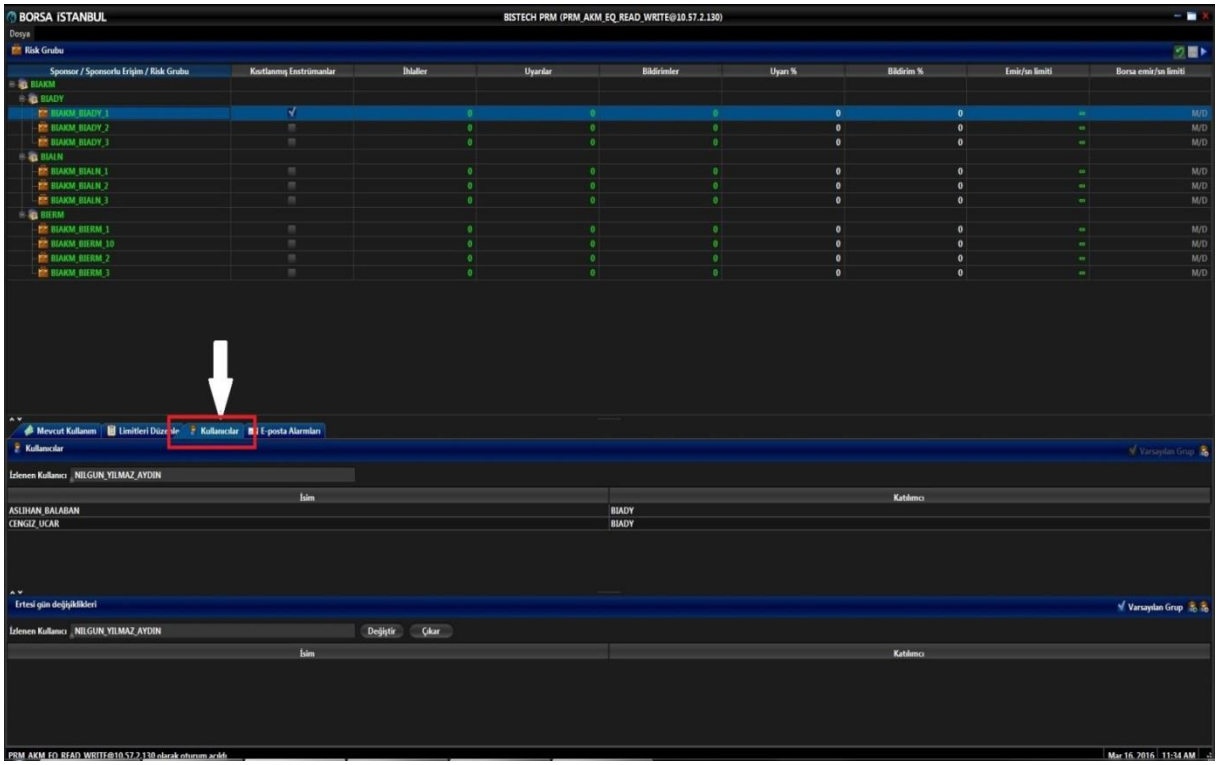
- ***İsim:*** Kullanıcı kodunu görüntüler.
- ***Katılımcı:*** Kullanıcının ait olduğu katılımcıyı gösterir**.**

10.2. Risk Grubuna Kullanıcı Ekleme

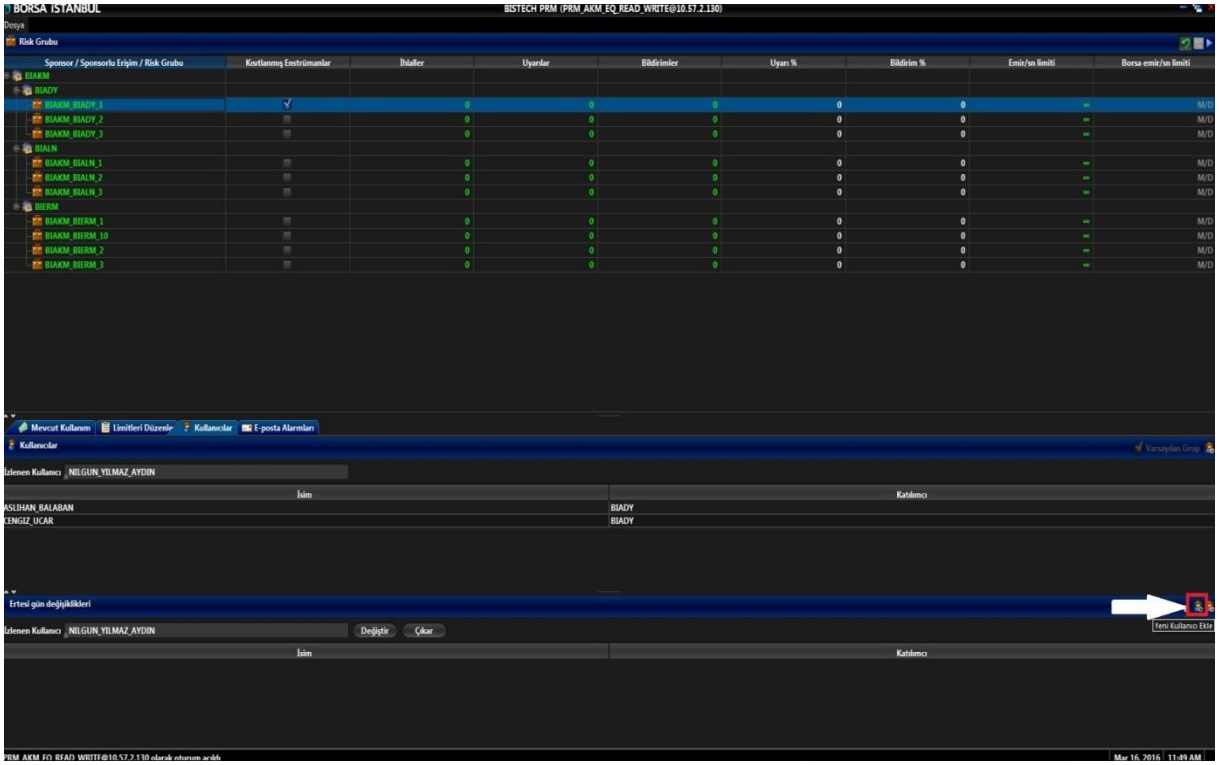
BISTECH PTRM uygulamasında kullanıcılar bir risk grubuna atanmak suretiyle gruplandırılmaktadır. Bir kullanıcı sadece bir tane risk grubuna atanabilir.

Bir kullanıcıyı bir risk grubuna atamak için aşağıdaki adımları tamamlayınız:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünden yeni bir kullanıcı eklemek istediğiniz risk grubuna ardından kullanıcılar sekmesine tıklayınız.



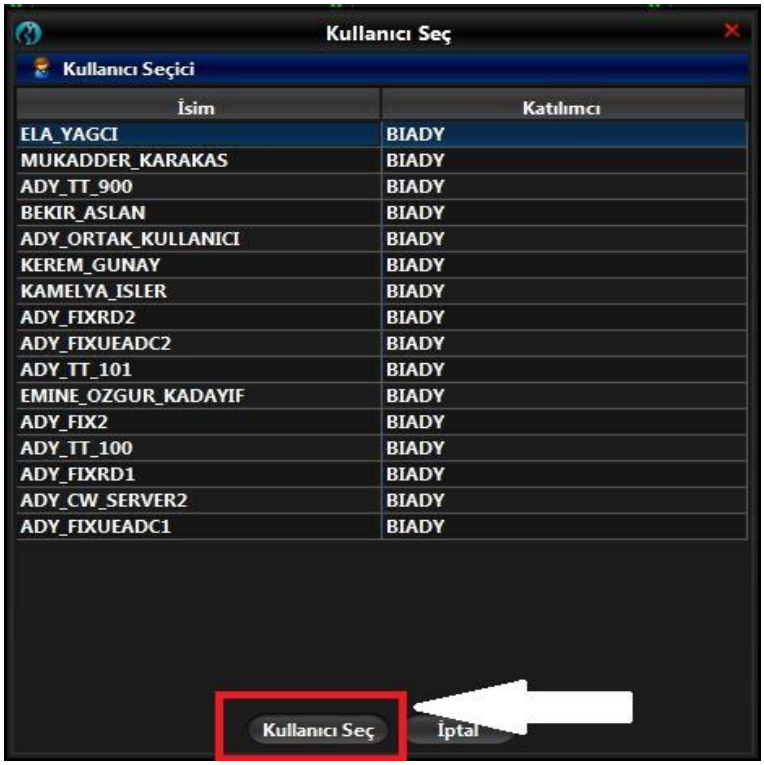
2. Yeni kullanıcı ekle düğmesine tıklayınız.



3. Kullanıcı seç penceresi görüntülenecektir.
4. Tablo, risk gruplarına atanmamış olan kullanıcıları gösterir. Hangi kullanıcıyı eklemek istediğinize karar vermek için aşağıdaki alanları inceleyiniz:

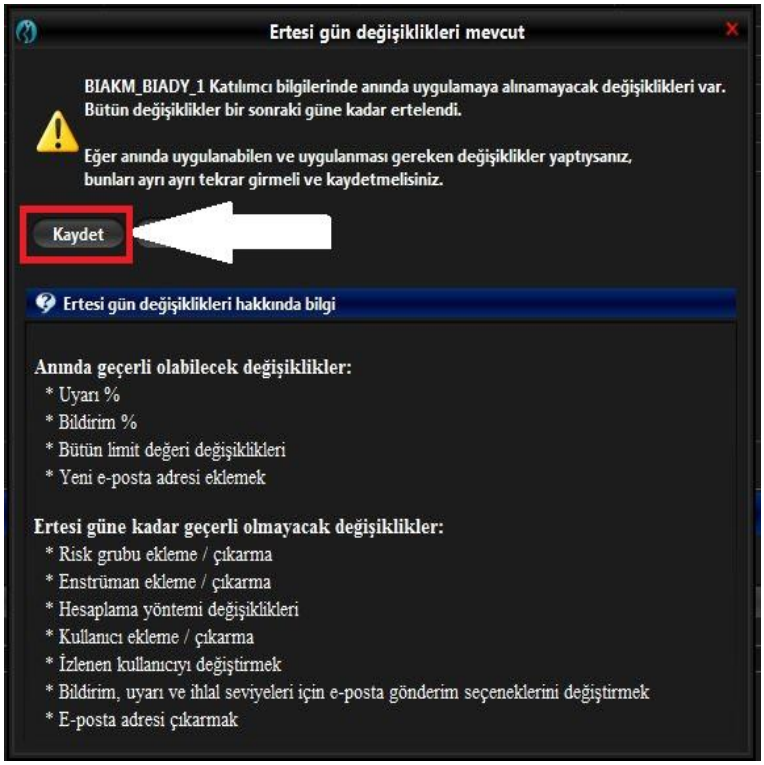
- ***İsim:*** Kullanıcı kodunu görüntüler.
- ***Katılımcı:*** Kullanıcının ait olduğu üyeyi gösterir.

5. Tablodan bir kullanıcı seçiniz.
6. Kullanıcı seç düğmesine tıklayınız.



7. Yeni kullanıcı kullanıcılar sekmesine eklenmiş olacaktır. Kaydet düğmesine tıklayınız.

8. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir. Kaydet düğmesine tıklayınız.



9. Değişiklik yaptığınız grup/gruplar için yaptığınız değişiklikleri teyit eden başarılı kaydetme penceresi görünecektir.

10. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.

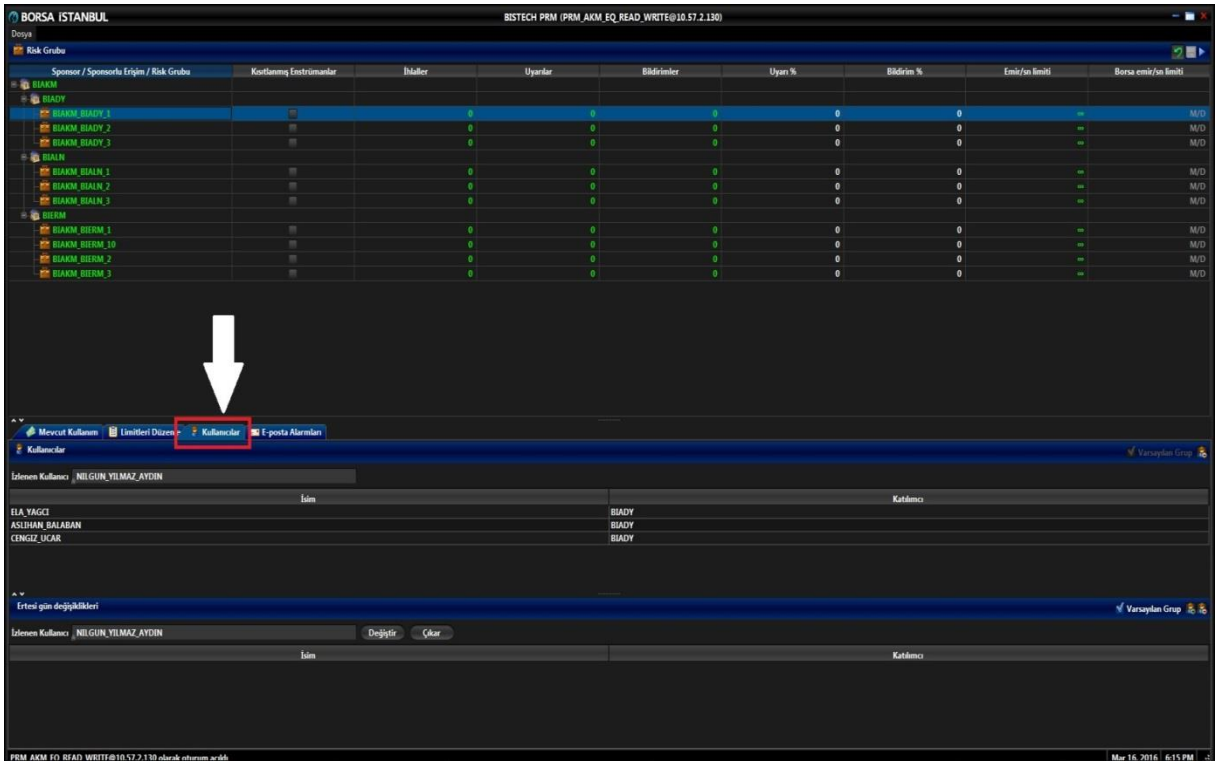
Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

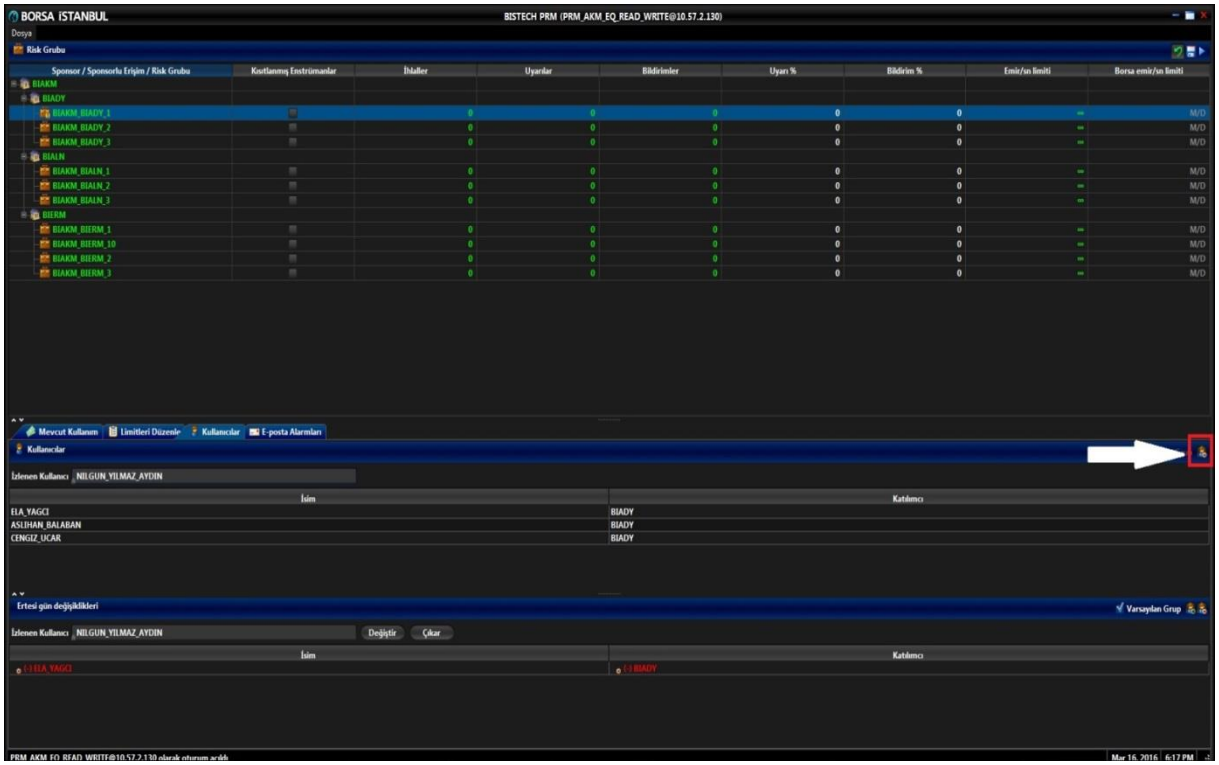
10.3. Kullanıcıyı Gruptan Çıkarma

Bir kullanıcıyı bir risk grubundan çıkarmak için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. Üzerinde değişiklik yapmak istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından kullanıcılar sekmesine tıklayınız.

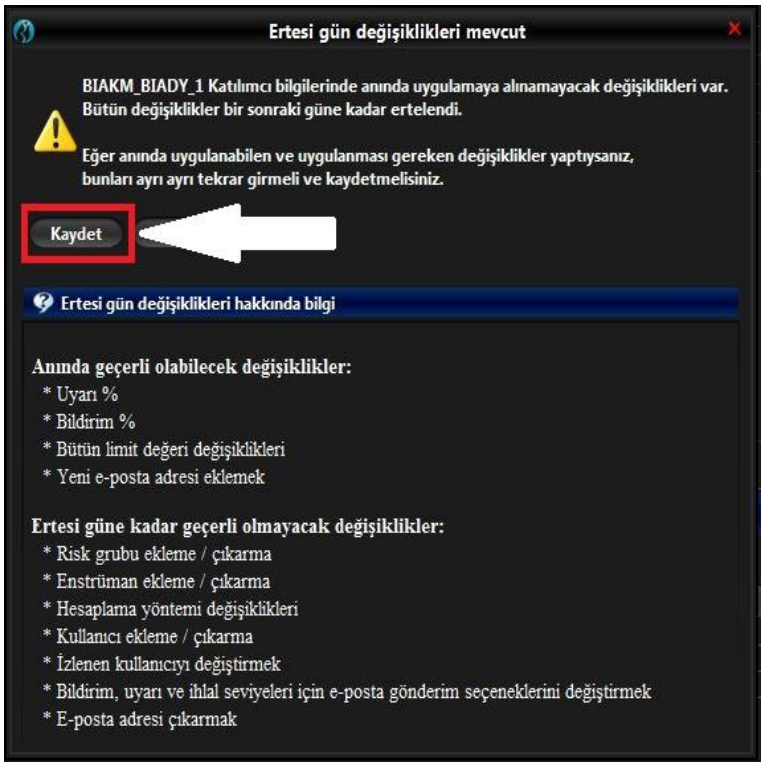


2. Çıkarılacak kullanıcıyı seçiniz. Kullanıcı çıkar düğmesine tıklayınız.

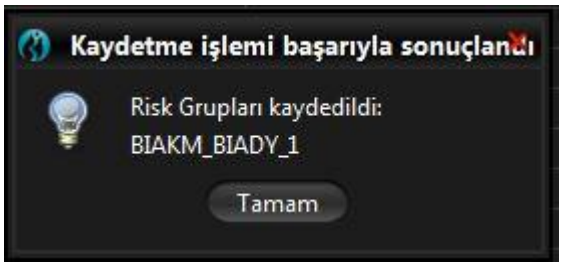


3. Kaydet düğmesine tıklayınız.

4. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir. Kaydet düğmesine tıklayınız.



5. Değiştirmiş olduğunuz grup/gruplar için yaptığınız değişiklikleri onaylayan başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.



Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

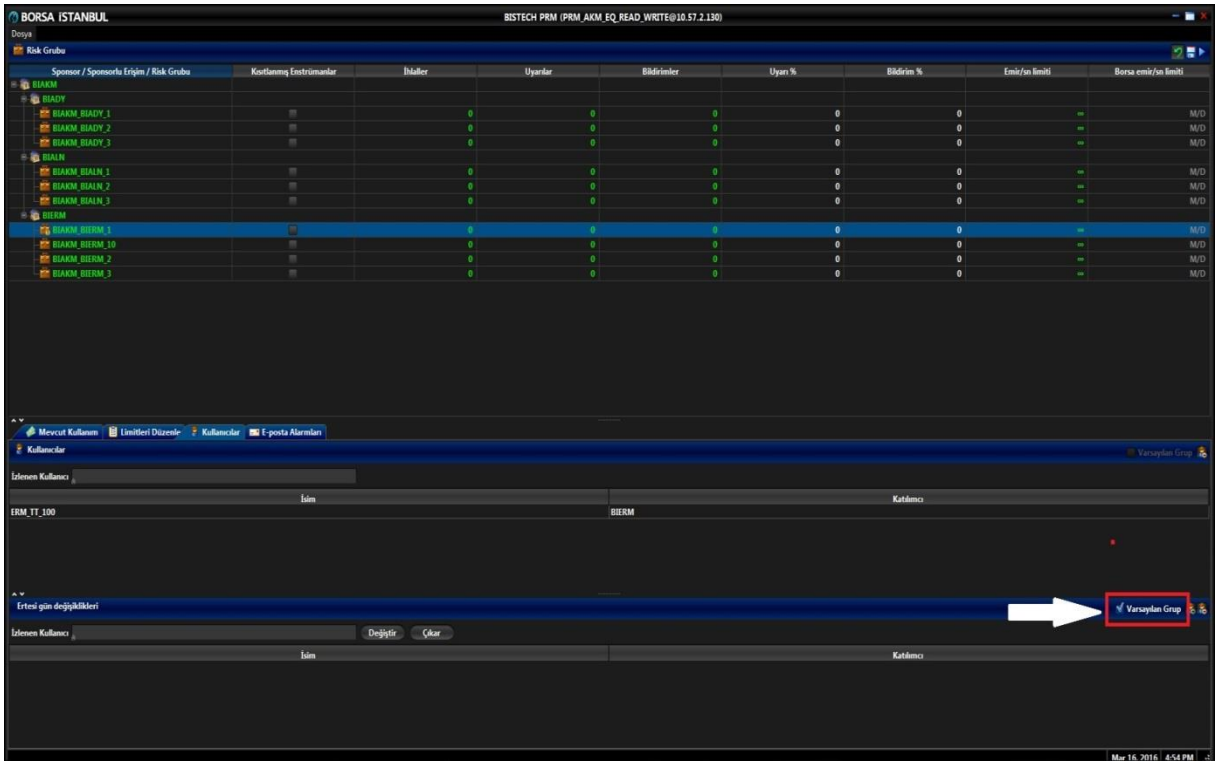
Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

10.4. Varsayılan Grup

Bir grubu varsayılan grup olarak tayin etmek varsayılan kullanıcı işlemlerini grup ile ilişkilendirir. Varsayılan kullanıcının yaptığı işlemler kullanıcı alanının geçerli bir kullanıcı kodu içermediği işlemlerdir. Bu durum, çift taraflı bir işlem girildiğinde veya bir borsa bir üye namına bir emir girdiğinde ya da bir emri değiştirdiğinde gerçekleşir. Bir risk grubu varsayılan grup olarak atanmadığı sürece bu işlemler PTRM tarafından hesaplanan toplam riske yansıtılmayacaktır.

Varsayılan kullanıcıyı bir risk grubuna atamak için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. Varsayılan kullanıcı riskini ekleyeceğiniz bir risk grubu seçiniz.
2. Kullanıcılar sekmesine tıklayınız.



3. Ertesi gün değişiklikleri panelinde varsayılan grup onay kutusuna tıklayınız.
4. Kaydet düğmesine tıklayınız. Bir başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Tamama tıklayınız.

Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hali hazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

10.5. İzlenen Kullanıcıyı Değiştirme veya Çıkarma

Bir risk grubu, bir sponsor üyenin gerçek zamanlı bağlantı durumunu (FIX ve/ya OMnet) izlemek üzere yapılandırılabilir. Örneğin belirli bir takas üyesi kullanıcısının drop-copy yayın bağlantı durumunu izlemek için kullanılabilir. Eğer takas üyesinin bağlantısı koparsa risk grubundaki temsilcilerin işlem girmeleri otomatik olarak engellenecektir.

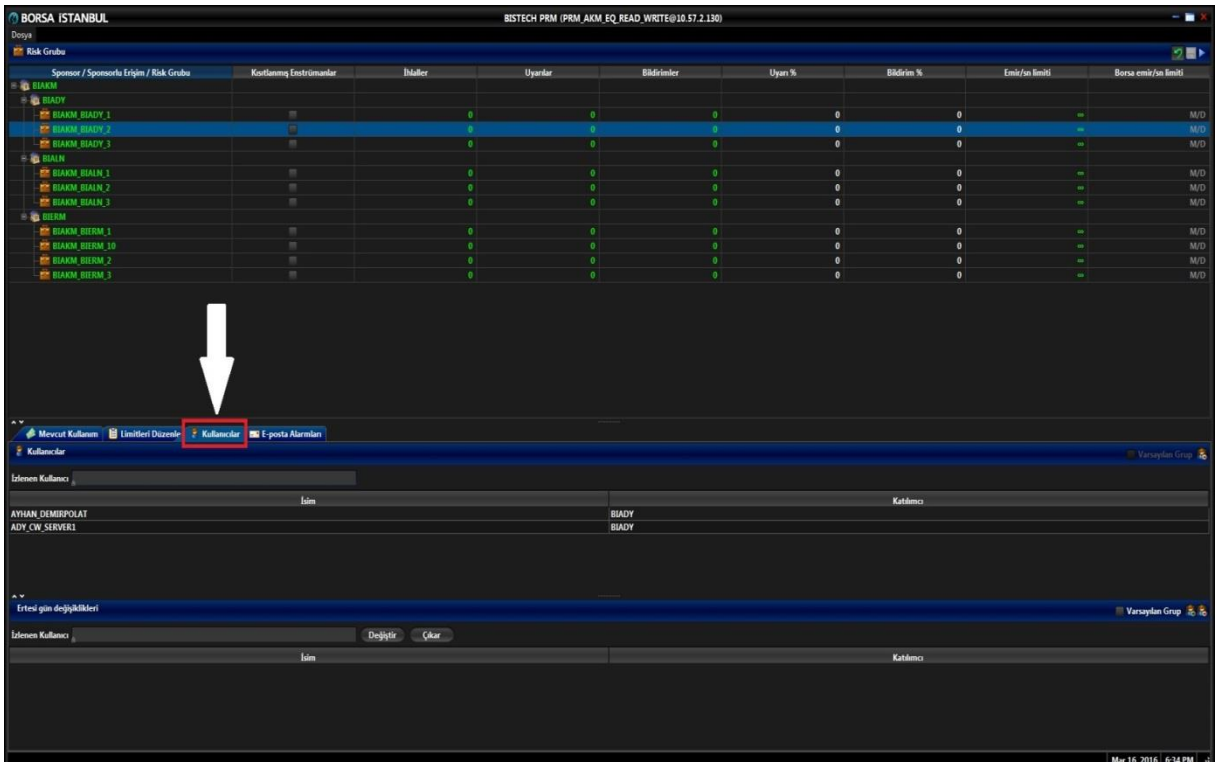
Eğer izlenen kullanıcının borsa ile bağlantısı koparsa o kullanıcıları gözlemleyen her risk grubundaki diğer kullanıcıların bekleyen emirlerinin hepsi iptal edilecektir. İzlenen kullanıcı yeniden bağlanana kadar bu kullanıcılar engellenecektir. (normal emir ve kotasyon emri giremeyecekler.)

İzlenen bir kullanıcıyı ayarlamak opsiyoneldir. İzlenen kullanıcı risk grubunun sponsor üyesine ait olmalıdır.

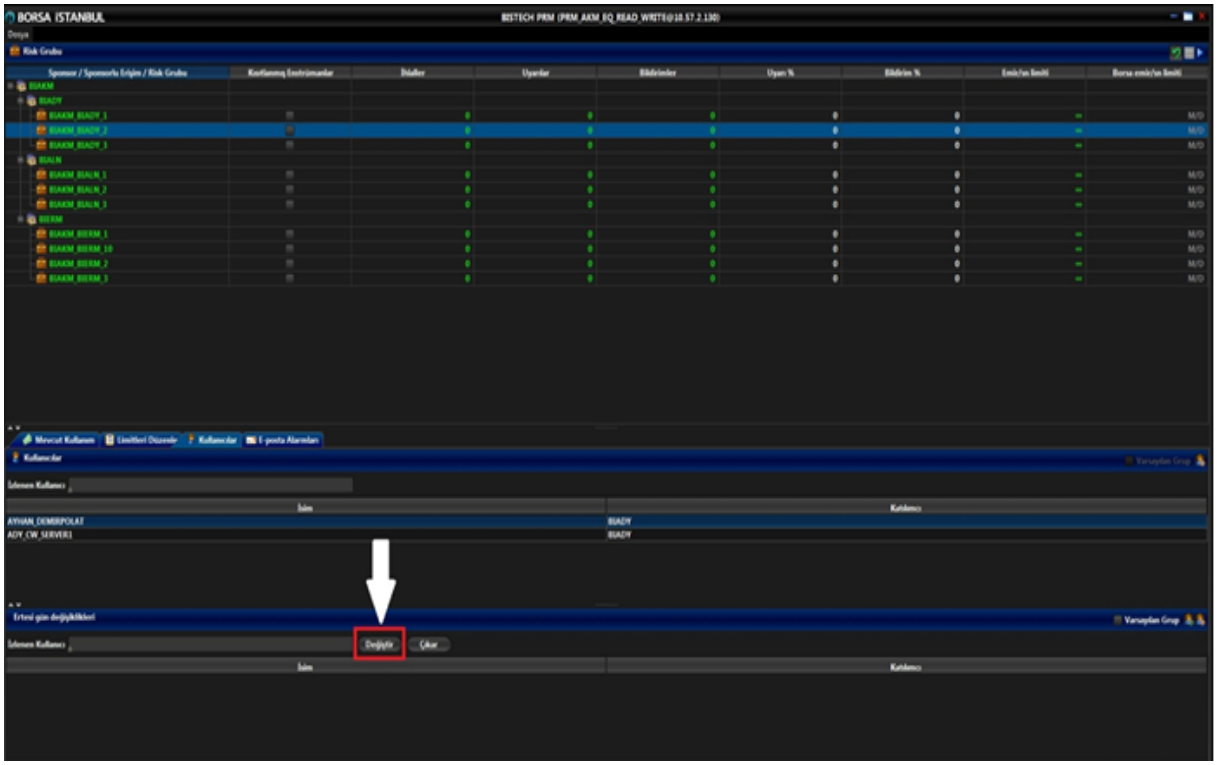
Not: İzlenen kullanıcı kodu asla BISTECH PTRM uygulamasında oturum açmak için kullanılmamalıdır. Kullanılması izlenen grupların bloke edilmesini tetikleyecektir.

İzlenen bir kullanıcıyı değiştirmek için aşağıdaki adımları tamamlayınız:

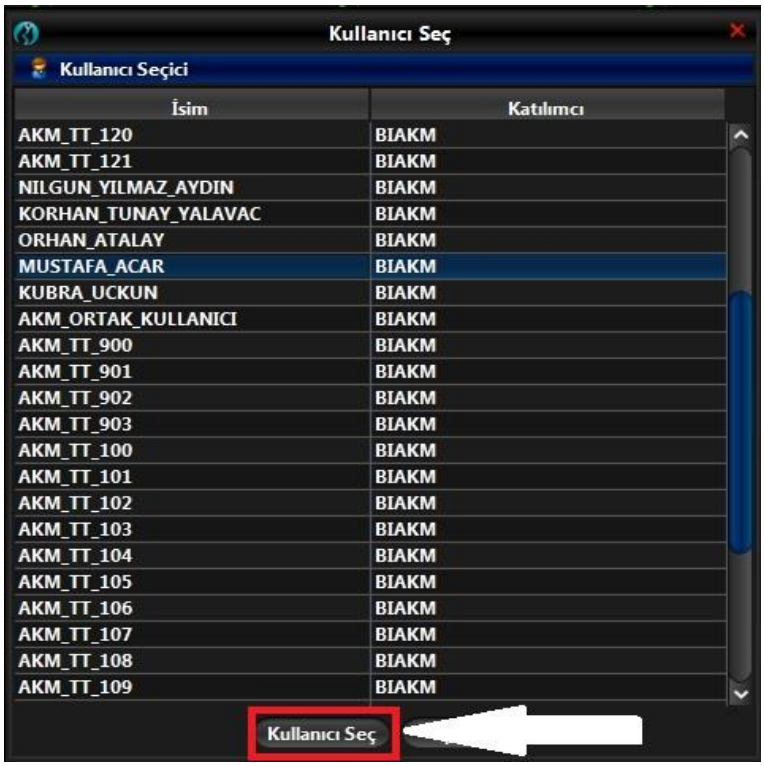
1. BISTECH PTRM arayüzünden izlenen bir kullanıcıyı değiştirmek istediğiniz risk grubuna tıklayınız ve ardından Kullanıcılar sekmesine tıklayınız.



2. Değiştir düğmesine tıklayınız. Alternatif olarak ise, seçilen kullanıcıyı çıkarmak için çıkar düğmesine tıklayınız.

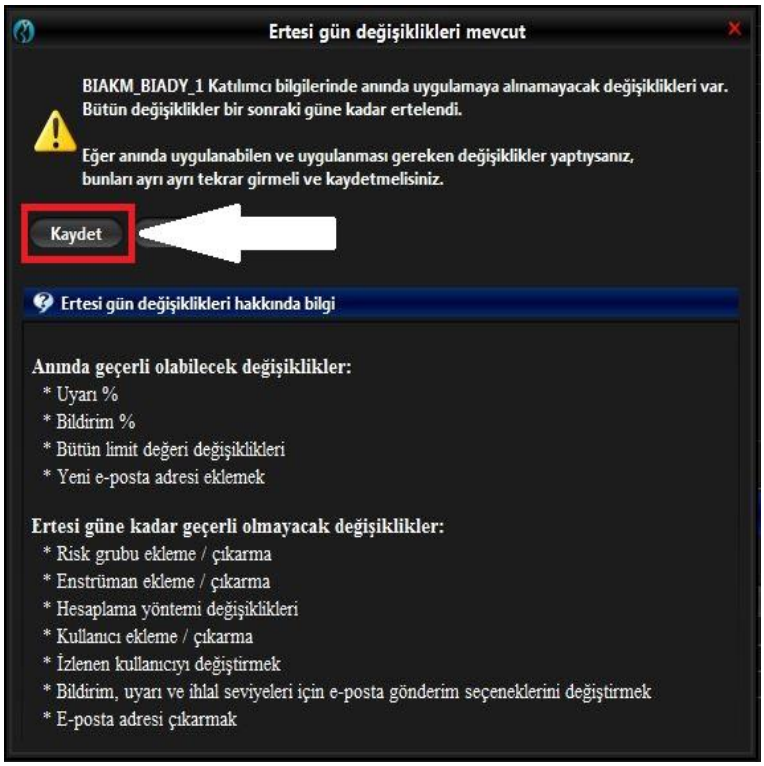


3. Kullanıcı seçimi penceresi görüntülenecektir. İzlenen kullanıcı olarak atamak istediğiniz kullanıcıya tıklayınız ve ardından kullanıcı seç düğmesine tıklayınız.



4. Değişiklikleri kaydetmek için temsilci panelinde kaydet düğmesine tıklayınız.

5. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir.



6. Kaydet düğmesine tıklayınız. Değişiklik yapmış olduğunuz grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri teyit eden başarılı kaydetme penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.

Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hali hazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

11. E-POSTA ALARMLARINI YÖNETMEYE GENEL BAKIŞ

BISTECH PTRM sunucusu bütün risk gruplarının aktivitelerini anlık olarak izlemektedir. Eğer bir grubun hesaplanmış güncel riski herhangi bir bildirim seviyesini aşarsa, o grup için olan bildirim listesindeki tüm üyelere e-postalar gönderilir. Bildirim seviyeleri limitin bir yüzdesi olarak belirlenir ve her bir risk grubu için farklılaştırılarak belirlenebilir.

BISTECH PTRM uygulaması üç tip e-posta alarmı göndermek üzere yapılandırılabilir:

1. ***Bildirim***: Alarmın en düşük seviyesi
2. ***Uyarı***: Alarmın en yüksek seviyesi
3. ***İhlaller***: Risk limit eşiklerinin aşılma seviyesi

İhlallerle ilişkilendirilmiş değerler seviyelerle tanımlanmış ve riske dair görsel bir gösterge sunmak amacıyla renklerle kodlanmıştır.

- *Bildirim* (sarı), alarmın en düşük seviyesidir.
- *Uyarı* (turuncu), alarmın en yüksek seviyesidir.
- *İhlal* (kırmızı), belirlenmiş limit değerlerinin aşıldığını belirtir.

Bir risk grubu için tanımlanmış her limit, her işlem günü başına sadece bir bildirim, bir uyarı ve ihlal e-posta alarmı gönderecektir.

Eğer işlem günü boyunca bir limit değiştirilmişse, bu sınırlama sıfırlanacak ve daha önceden gönderilmiş olanların hiçbiri dikkate alınmaksızın limit yeniden her bir alarm seviyesi için birer tane e-posta alarmı oluşturacaktır.

Her gün her risk grubu için sadece bir tane Bildirim, Uyarı ve İhlal e-postası olacaktır. E-postaları alan kullanıcılar detaylar için BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünü kontrol etmelidir.

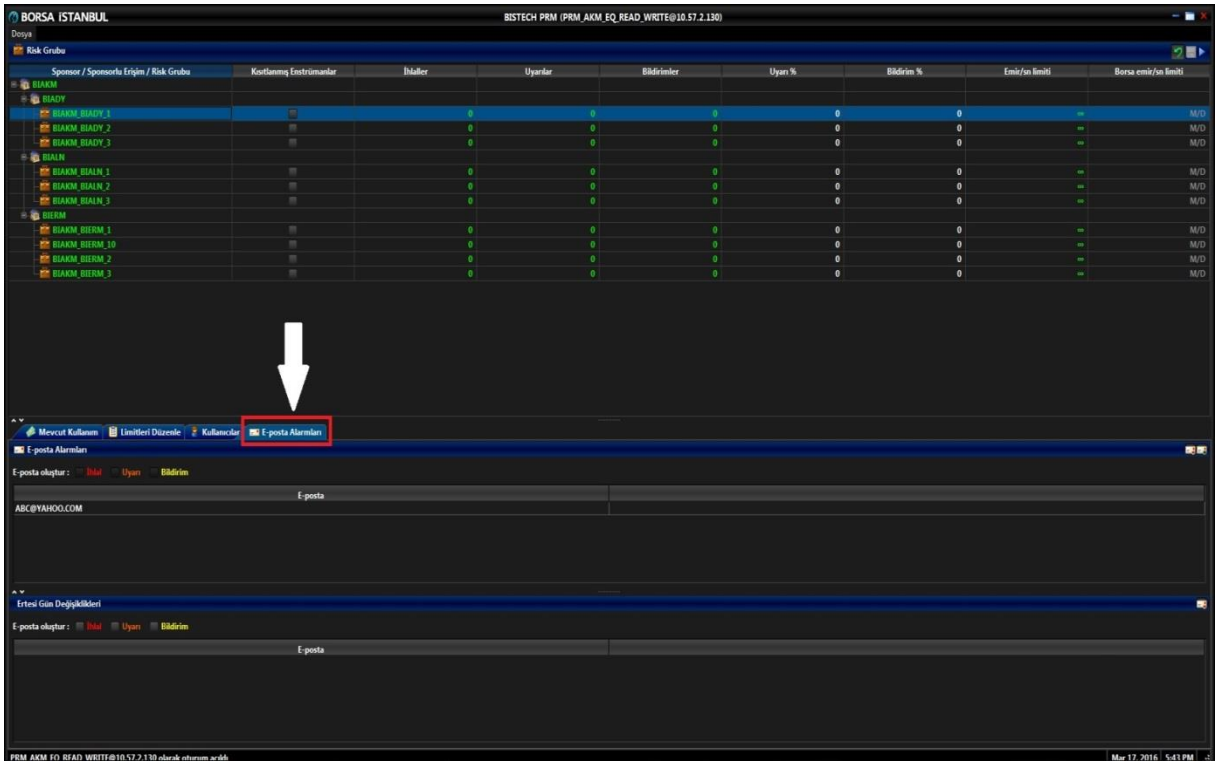
Eğer gün içinde herhangi bir limit değiştirilmişse, e-posta sayıcılar sıfırlanacak ve yeni e-posta alarmları oluşturulacaktır.

Not: Emir/sn Limiti sadece ihlal e-postaları oluşturur. Bildirim veya Uyarı e-postaları üretmez. Emir/sn limitinin her ihlal edilişinde bir e-posta uyarısı gönderilecektir.

11.1. E-Posta Alarmlarını Ayarlama

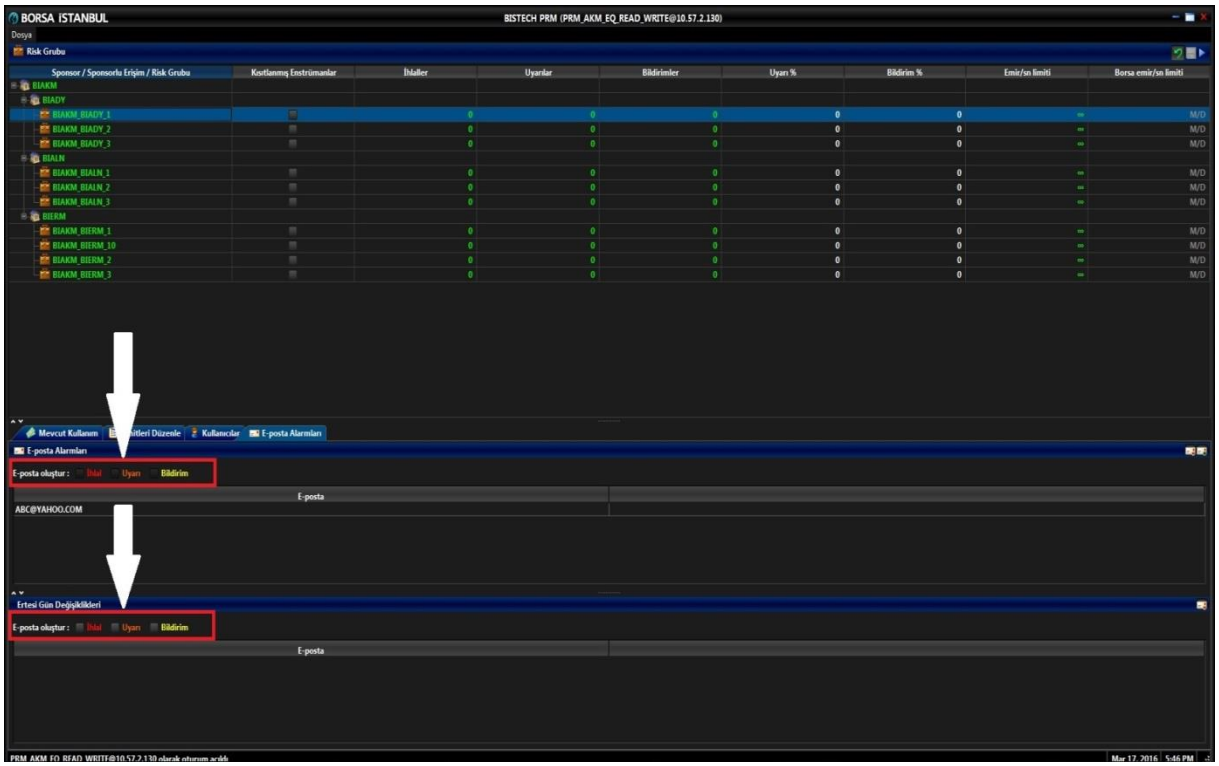
E-posta alarmlarını ayarlamak için aşağıdaki adımları tamamlayınız:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünden, temsilci panelinde yeni e-posta alarmı tanımlamak istediğiniz risk grubunu seçiniz ve ardından e-posta alarmları sekmesine tıklayınız.



2. Aşağıdaki seçim kutularını etkinleştirmek veya etkisiz hale getirmek üzere, seçim kutularını işaretleyiniz veya işaretlerini kaldırınız.

- ***İhlal***: Risk grubu ayarlanmış bir limiti ihlal ettiğinde e-posta gönder.
- ***Uyarı***: Risk grubu bir limitin ikaz seviyesine ulaştığında e-posta gönder.
- ***Bildirim***: Risk grubu bir limitin bildirim seviyesine ulaştığında e-posta gönder.



3. Değişiklikleri kaydetmek için temsilci panelinden kaydet düğmesine tıklayınız.

E-posta alarmlarını ayarlayıp kaydettikten sonra, e-posta alarm grubundaki tüm üyeler seçilen olaylar meydana geldiğinde bildirimler alacaktır.

Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

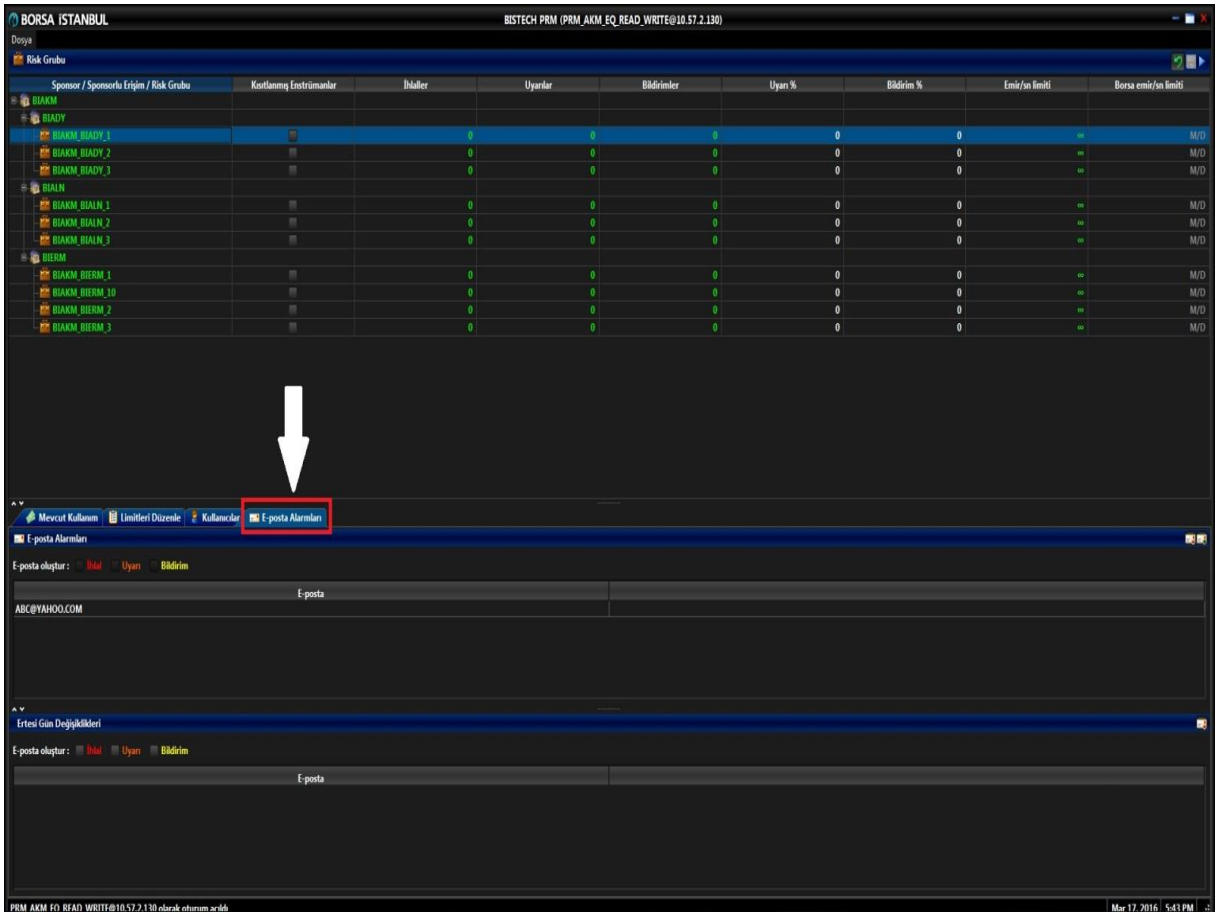
Hali hazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

11.2. Yeni E-posta Alarmı Alıcısı Ekleme

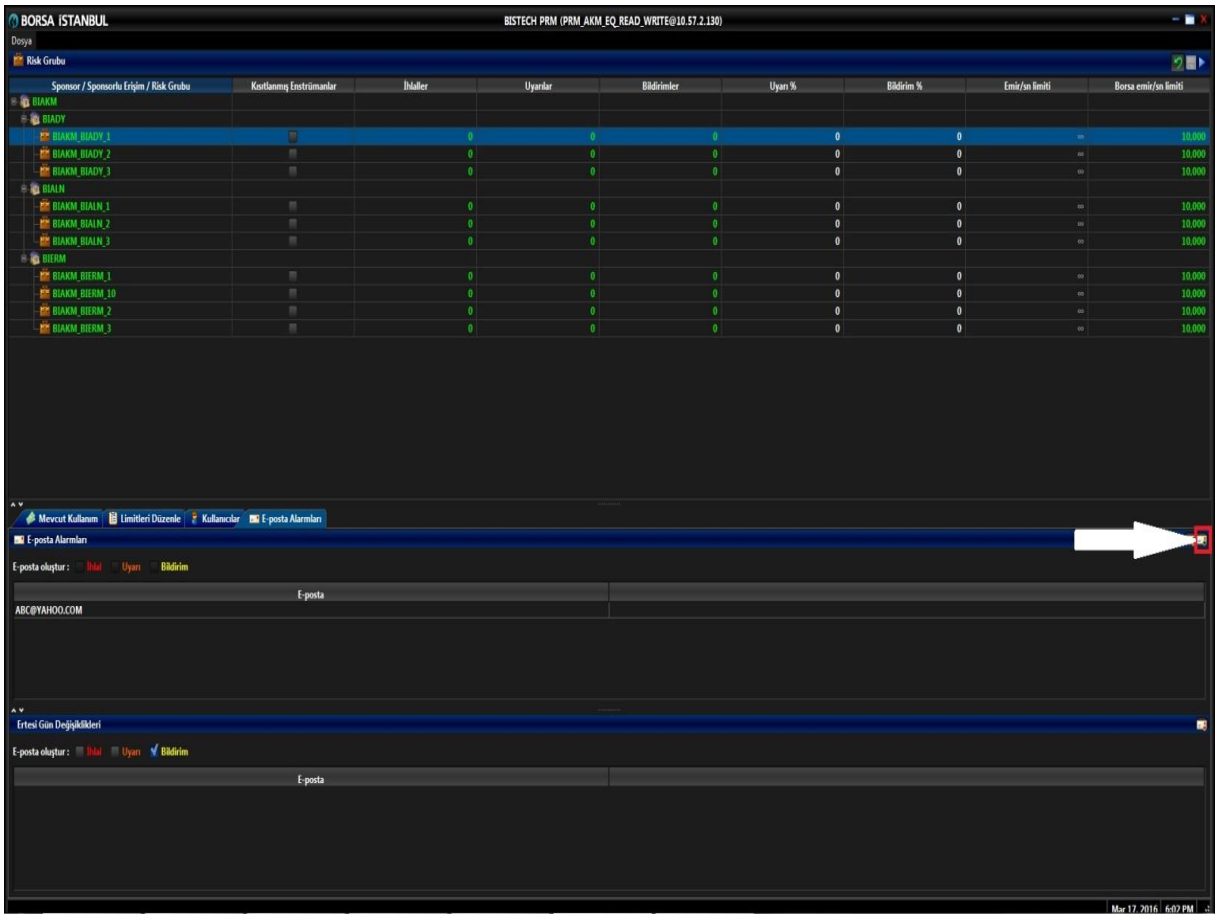
Bir risk grubu bildirim, uyarı ve ihlal olayları meydana getirdiğinde bildirim gönderilecek yeni e-posta adresleri ekleyebilirsiniz. Yeni e-posta uyarısı alıcısını ekledikten ve kaydet düğmesine tıkladıktan sonra e-posta adresi derhal risk grubu için olan bildirim listesine eklenir.

Yeni e-posta adresi eklemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

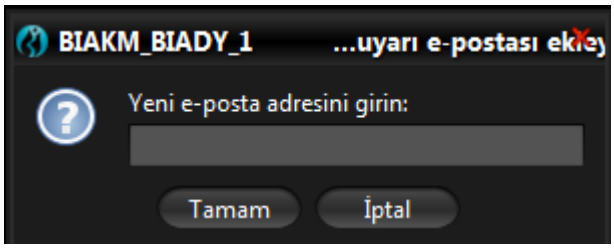
1. BISTECH PTRM arayüzünden, temsilci panelinde yeni e-posta alarmlarını tanımlamak istediğiniz risk grubunu seçiniz ve ardından e-posta alarmları sekmesine tıklayınız.



2. Yeni e-posta ekle düğmesine tıklayınız.



3. Bildirim e-postası ekle penceresi görüntülenecektir. Yeni e-posta adresini giriniz. Tamam düğmesine tıklayınız.



4. Değişiklikleri kaydetmek için temsilci panelinden kaydet düğmesine tıklayınız.

5. Değişiklik yaptığınız grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri teyit eden başarılı kaydetme onay penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.

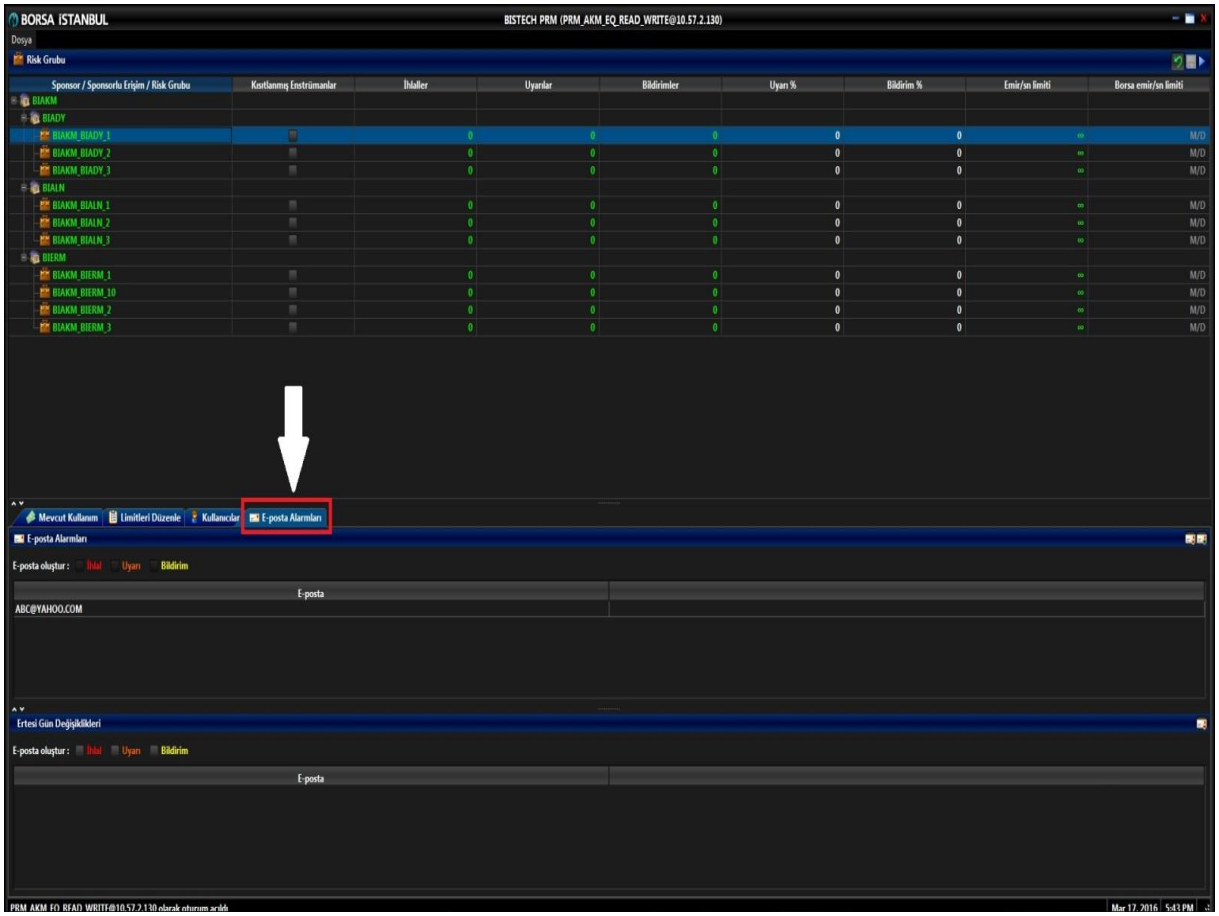
Not: Bu bir gün içi değişikliktir. Bu değişiklik derhal etkin olacaktır. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakın.

11.3. E-Posta Uyarısı Alıcılarını Düzenleme

Herhangi bir bildirim alıcısının e-posta adresini herhangi bir zamanda düzenleyebilirsiniz. E-posta uyarısı alıcılarını düzenledikten ve kaydet düğmesine tıkladıktan sonra, e-posta uyarılarını derhal almaya başlayacaklardır.

E-posta uyarılarını düzenlemek için aşağıdaki adımları izleyiniz:

1. BISTECH PTRM kullanıcı arayüzünden temsilci panelinde, yeni e-posta uyarılarını tanımlamak istediğiniz risk grubunu seçiniz ve ardından e-posta alarmları sekmesine tıklayınız. E-Posta alarmları paneli görüntülenecektir.



2. Aşağıdaki onay kutularını etkinleştirmek veya etkisiz hale getirmek üzere, onay kutularını işaretleyin veya işaretlerini kaldırınız.

- **İhlal**: Risk grubuna tanımlanan bir limit ihlal ettiğinde e-posta gönder.
- **Uyarı:** Risk grubuna tanımlanan bir limit uyarı seviyesine ulaştığında e-posta gönder.
- **Bildirim**: Risk grubuna tanımlanan bir limit bildirim seviyesine ulaştığında e-posta gönder.

3. Kaydet düğmesine tıklayınız.

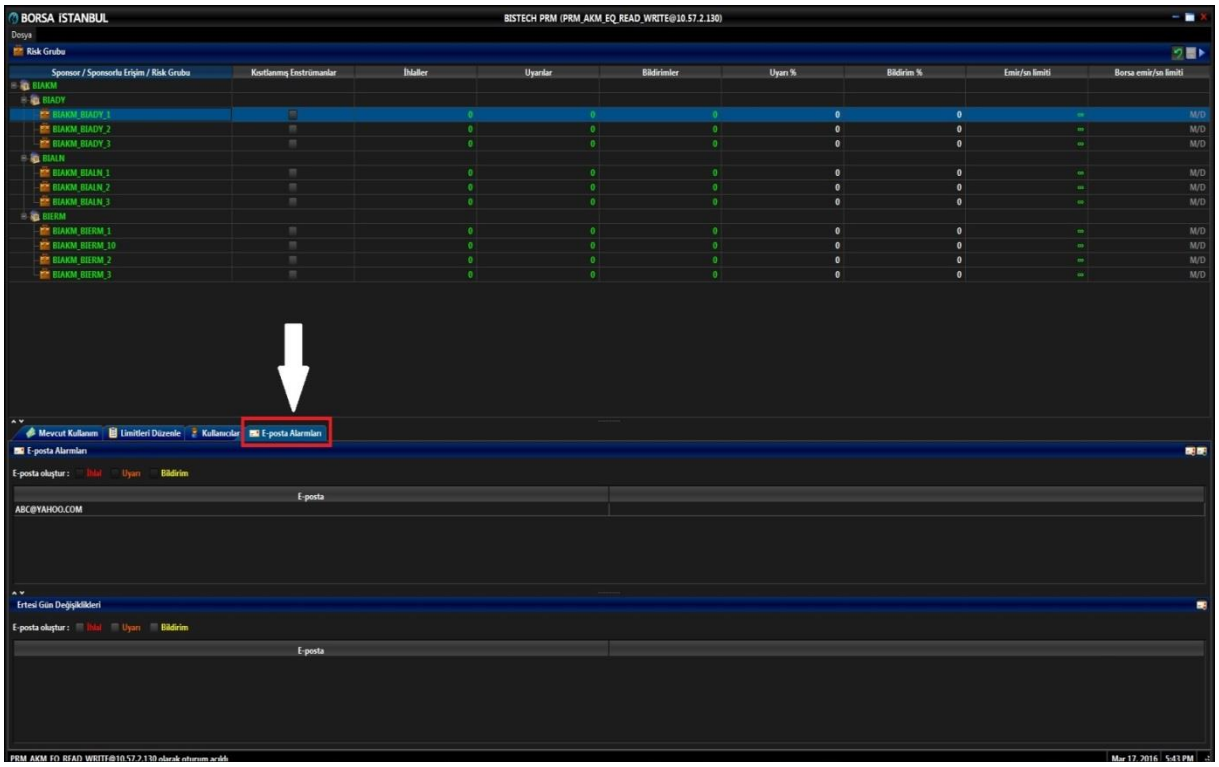
Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

11.4. E-Posta Uyarısı Alıcılarını Çıkarma

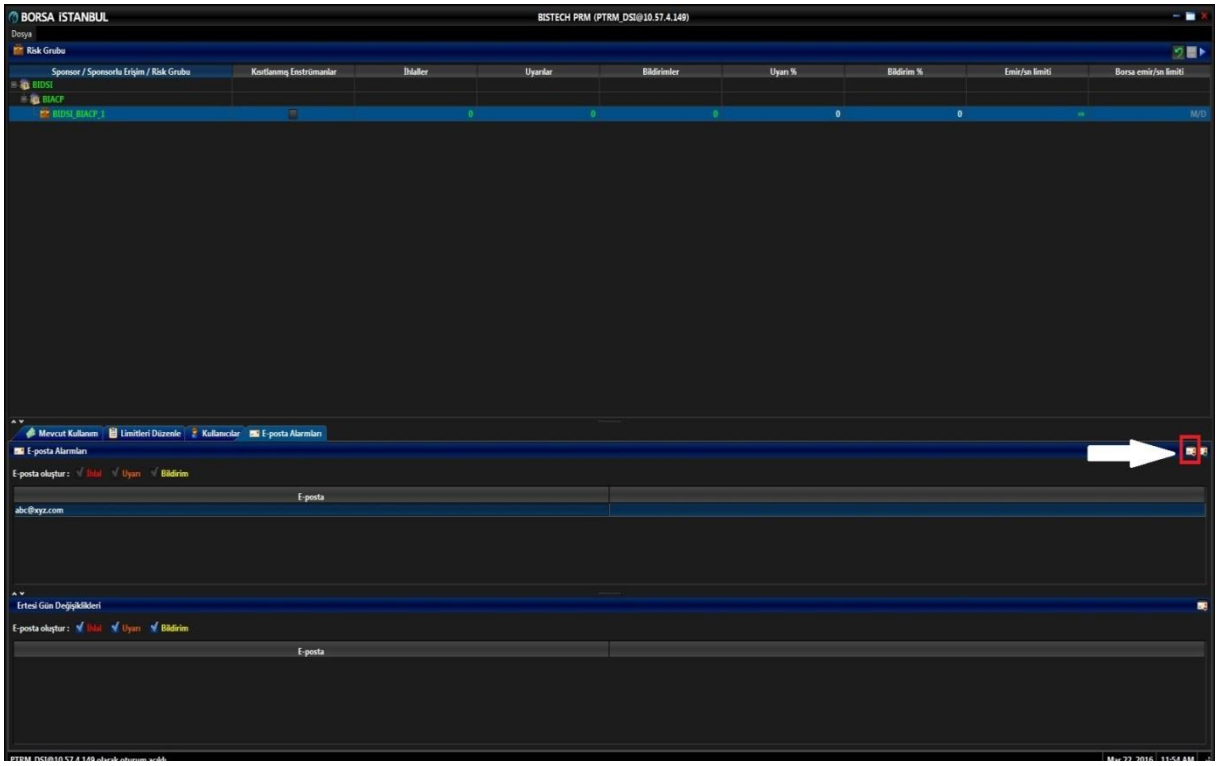
E-posta alıcısını çıkardıktan ve kaydet düğmesine tıkladıktan sonra, çıkarılan e-posta adresi ertesi gün değişiklikleri panelinde görünecektir. Bu değişiklik sonraki işlem gününde uygulamaya geçecektir.

E-posta alıcısını alarm listesinden çıkarmak için aşağıdaki adımları izleyiniz.

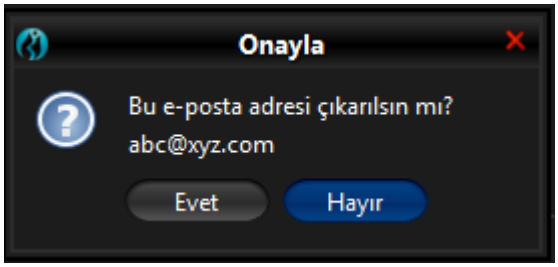
1. BISTECH PTRM arayüzündeki temsilci panelinde, risk grubunu seçin ve ardından e-posta alarmları sekmesine tıklayınız.



2. Çıkarılmak istenen e-posta alıcısına tıklayınız.
3. E-postayı çıkar düğmesine tıklayınız.

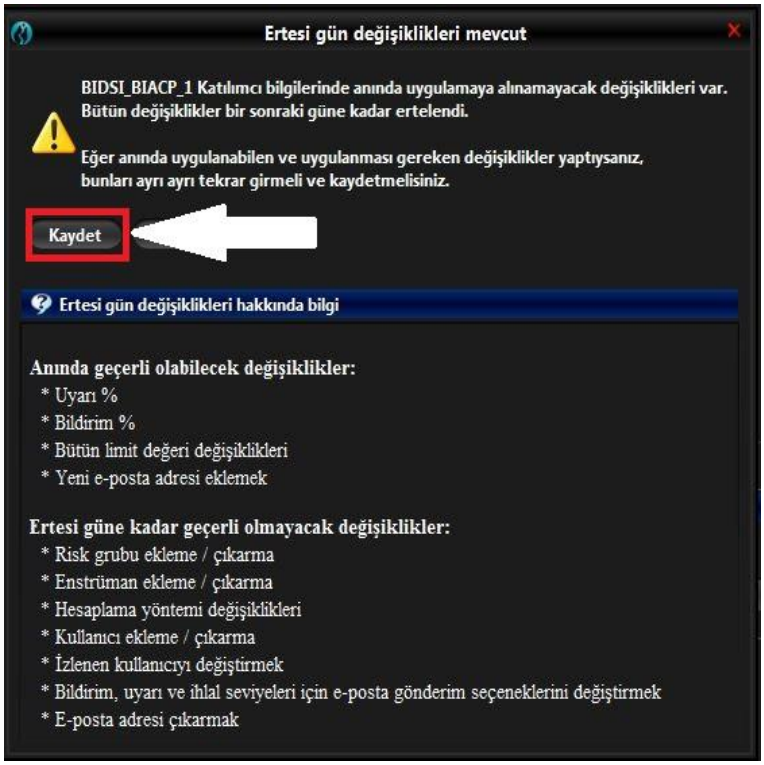


4. Bir onay kutusu görünecektir. Evet düğmesine tıklayınız.

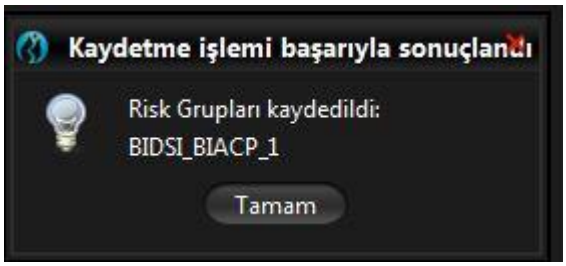


5. Kaydet düğmesine tıklayınız.

6. Ertesi gün değişiklikleri mevcut onay penceresi görünecektir. Kaydet düğmesine tıklayınız.



7. Değiştirmiş olduğunuz grup veya gruplar için yaptığınız değişiklikleri teyit eden başarılı kaydetme penceresi görünecektir. Yaptığınız değişikliği onaylamak için tamam düğmesine tıklayınız.



Not: Bu bir ertesi gün değişikliğidir. Değişiklik kaydedilerek o değişiklik borsa veri tabanına gönderilir ve ertesi gün sistem açıldığında etkin hale gelir. Ertesi gün değişiklikleri hakkında daha fazla bilgi için ertesi gün değişiklikleri bölümüne bakınız.

Hâlihazırda Eklenmiş Olan bir Ertesi Gün Değişikliğini Değiştirmek: Eğer bir ertesi gün değişikliği eklerseniz ve ertesi günden evvel o ertesi gün değişikliğinin üzerinde değişiklik yapmaya ihtiyacınız varsa, o değişikliği silmeli ve ardından yeni bir tane eklemelisiniz.

Versiyon Değişiklik Listesi

Revizyon	Tarih	Açıklama
1.0	29 Mart 2016	Borsa İstanbul ilk sürüm tarihi