

Cevaplarda şu işaretlerin tekrarını dileriz :

B.02.2.TCM.0.10.01.00-010.07.01/

Konu: Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatı
Değişiklikleri hk.

- İlgi:** 1. Nisan 2004 tarihli Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatı
2. 22 Mayıs 2008 tarihli API Repo İhalelerinde Menkul Kıymet Bildirim Zorunluluğunun Kaldırılmasına İlişkin Talimat

Sayın Genel Müdür'ün Dikkatine

Bilindiği üzere, açık piyasa işlemleri çerçevesinde kotasyon yöntemiyle gerçekleştirilmekte olan işlemlerde, kuruluşlar tekliflerini telefon aracılığıyla iletmektedirler. Söz konusu işlemlerde tekliflerin telefonla alınmasından kaynaklanabilecek operasyonel risklerin azaltılması ve katılımcı kuruluşlara operasyonel olarak esneklik sağlanması amacıyla 21.02.2014 tarihinden itibaren, kotasyon teklifleri Türkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) Ödeme Sistemleri İhale Sistemi (İhS) üzerinden API Kotasyon Teklifi mesajı ile gerçekleştirilecektir. Bu amaçla, bu mesaja ilişkin temel iş akışı testleri 10-11 Şubat 2014 tarihlerinde tamamlanmıştır. Yeni uygulamayla açık piyasa işlemleri çerçevesindeki kotasyon işlemlerine katılan yetkili kuruluşların, kotasyon tekliflerini "TCMB Ödeme Sistemleri Mesaj Yapısı ve İşlem Türleri (Kullanım Kuralları)" dokümanına uygun olarak göndermeleri gerekmektedir. Diğer taraftan, Açık Piyasa İşlemleri Teminat Sistemi bölümünde, bankaların teminat olarak getirebilecekleri döviz deposundan masraf alınmasına karar verilmiştir. Bu çerçevede, Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatında aşağıdaki değişiklikler gerçekleştirilecektir.

"V. Açık Piyasa İşlemlerinde Uygulanan Yöntemler, A- Kotasyon" bölümüne;

"i) Kotasyon İlanı:

yazılan 18.02.2014 tarih, sayılı yazının 2. sayfası

Merkez Bankası, kotasyon bilgilerini piyasaya;

- a) Reuters servisi,
- b) Trkiye Cumhuriyet Merkez Bankası (TCMB) deme Sistemleri İhale Sistemi (İhS)

aracılıęı ile duyurur. Duyuru, yukarıdaki araçlardan biri ya da ikisi bir arada kullanılmak suretiyle yapılabilir.

Kotasyon duyurusu hangi yntemle yapılırsa yapılsın ařaęıdaki bilgileri ierir:

- Kotasyon numarası,
- Kotasyonu yapılan iřlem tr (kesin alım, kesin satım, geri satım vaadi ile alım, geri alım vaadi ile satım, likidite senetleri ihracı ya da erken itfası),
- Kotasyon tarih ve saati (en son teklif verme zamanı),
- İřlem valr,
- Menkul kıymet tanımı (kesin alım/satım ve likidite senedi ihra/erken itfa iřlemlerinde) / iřlem vadesi (geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım iřlemlerinde),
- Teklif verme řekli (TCMB deme Sistemleri İhS ya da telefon),

ii) Kotasyon Tekliflerinin Alınması:

Yetkili kuruluřların, en son teklif verme saatine kadar tekliflerini Aık Piyasa İřlemleri Mdrlęne iletmeleri gerekmektedir. Ayrıca tekliflerin iletilme biiminin kotasyon duyurusunda yer aldıęı řekilde olması ve tekliflerin, ister TCMB deme Sistemleri İhS aracılıęı ile ister telefonla verilsin, ařaęıdaki bilgileri mutlaka iermesi gerekmektedir:

- Kotasyon numarası,
- Teklifi veren yetkili kuruluř,
- Teklif edilen tutar (kesin alım/satım ve likidite senedi ihra/erken itfa iřlemlerinde nominal deęer, geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım iřlemlerinde Trk lirası tutarı olarak 1 milyon Trk lirası ve katları),
- Fiyat (kesin alım/satım ve likidite senedi ihra/erken itfa iřlemlerinde, TL 100 nominal deęer iin)/ Faiz / Getiri oranı (geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım iřlemlerinde (xx,xx))

Merkez Bankasınca kotasyon tekliflerinin telefonla alınması halinde, tekliflerin Merkez Bankasına açık piyasa işlemleri yapma yetkisi bulunan kişilerce verilmesi zorunludur. Teklif bilgilerine ilişkin çıkacak her türlü uyuşmazlıkta, telefon görüşme kayıtları esas alınır, sorunun çözülememesi durumunda Merkez Bankası kayıtları geçerli olur.

Kotasyon saatinden sonra verilen ve/veya yukarıdaki bilgileri doğru şekliyle içermeyen teklifler değerlendirmeye alınmaz. Bu nedenle, saatlerin TCMB Ödeme Sistemleri İhS saatine uygunluğunun sağlanması gerekmektedir. Saatlerde farklılık olması durumunda TCMB Ödeme Sistemleri İhS saati esas alınır.

TCMB Ödeme Sistemleri İhS ile gönderilecek açık piyasa işlemlerine ilişkin kotasyon teklif mesajları (API Kotasyon Teklifi), TCMB Ödeme Sistemleri Mesaj Yapısı ve İşlem Türleri (Kullanım Kuralları) dokümanına uygun olarak hazırlanır. TCMB Ödeme Sistemleri İhS mesajındaki bilgilerin yanlış olmasından, yanlış alana girilmesinden, hiç girilmemesinden veya başka yanlışlıklardan doğacak sonuçlar teklifi gönderene aittir.

TCMB Ödeme Sistemleri İhS aracılığı ile alınacak tekliflerde;

- Kotasyon kodu ve/veya numarasının yanlış olması,
- Teklif tutarının, en az tutar ve katlarında olmaması,
- Kesin alım/satım ve likidite senedi ihraç/erken itfa işlemlerinde fiyat yerine faiz / getiri oranı belirtilmesi,
- Kotasyon işlem saatleri dışında teklif gönderilmesi ve benzeri

hallerde teklifler değerlendirmeye alınmaz. Yapılan hata, TCMB tarafından kuruluşlara TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim (H04) mesajı ile iletilir.

Kuruluşlardan gelen başarılı kotasyon repo teklifleri sonrasında, kuruluşlara tekliflerine ait bilgiler TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı ile iletilir. TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajını alan kuruluşlar, her bir referans (RF) nolu geri satım vaadiyle alım teklifi için bir Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim (H03) mesajını Bankamıza iletirler. Her bir Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı ile ilgili teklife ait en fazla beş kıymet bildirilir. Kuruluşun aynı referans numarasıyla göndermiş olduğu birden fazla Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı varsa, doğru gelen ilk Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı kabul edilir. Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajını doğru bir şekilde gönderen katılımcılar mevcut repo ihalelerinde izledikleri süreci takip ederek işlemlerini tamamlar.

Mkerrer teklif gnderilmesi durumunda, ayırım yapılmaksızın tekliflerin hepsi deęerlendirmeye alınır. TCMB deme Sistemleri İhS ile gnderilen tekliflere iliřkin olarak, daha sonra yapılacak dzeltme talepleri kabul edilmez.

Kotasyon teklifleri TCMB deme Sistemleri İhS ile istenildięinde, dięer iletiřim araları ile verilen teklifler kabul edilmez. Ancak, kotasyon katılımcılarının kendi Katılımcı Arayz Sistemi İstemcilerinde veya iletiřim aęı alt yapılarında ya da TCMB deme Sistemleri hizmetlerinde bir sorun olması ve bu durumun TCMB deme Sistemleri operasyon veya teknik birimlerince teyit edilmesi durumunda teklifler telefon ile alınabilir. TCMB deme Sistemleri yesi olmayan kuruluřlar, kotasyonlarda tekliflerini telefon ile verebilir.

TCMB deme Sistemleri İhS ile teklif verecek aracı kurumların, mesaj gnderiminden nce Piyasalar Genel Mdrlę ile telefonla temas kurarak, ilgili depo hesaplarında bulunan teminatlar esas alınarak belirlenen iřlem yapma limitleri iin mutabakat saęlamaları gerekir. İřlem yapma limitini ařan teklifler deęerlendirmeye alınmaz.

iii) Kotasyon Sonularının İlanı:

Kesin alım/satım ile likidite senetleri ihra/erken itfasına iliřkin kotasyonların sonuları Reuters servisinin CBTM, geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım kotasyonlarının sonuları da CBTG sayfasında ařaęıdaki bilgileri ierecek řekilde ilan edilir.

- Toplam teklif tutarı,
- Kabul edilen teklif tutarı,
- Ortalama fiyat (kesin alım/satım ve likidite senetleri iřlemlerinde),
- Ortalama faiz/getiri oranı (geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım iřlemlerinde),
- En yksek ve en dřk fiyatlar (kesin alım/satım ve likidite senetleri iřlemlerinde),
- En yksek ve en dřk faiz/getiri oranları (geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım iřlemlerinde).

Kotasyon tekliflerini hatasız olarak gnderen kuruluřlara iřlemlere iliřkin teyit bilgileri TCMB deme Sistemleri İhS ya da faks aracılıęıyla gnderilir.

iv) Kotasyonlara İlişkin Diğer Hususlar:

a) Aynı gün içinde birden fazla tanım ve vade için kotasyon açılabilir.

b) Yukarıda açıklanan hususların yanı sıra Merkez Bankası, ilan ettiği kesin alım, kesin satım, likidite senetleri ihraç/erken itfa, geri satım vaadi ile alım ve geri alım vaadi ile satım kotasyonlarını iptal etme hakkına da sahiptir." düzenlemeleri eklenmiştir.

"VI. Açık Piyasa İşlemleri Çalışma Esasları" bölümünde;

"H- Kotasyon yolu ile yapılan açık piyasa işlemleri, işleme taraf olan kuruluş yetkilisinin telefonda işlemi talep etmesi ve Merkez Bankası Açık Piyasa İşlemleri Müdürlüğü yetkilisinin onay vermesi ile gerçekleşmiş sayılır. Çıkacak uyuşmazlıkların çözümünde Merkez Bankası işlem ve telefon kayıtları esas alınır. " şeklindeki düzenleme "H- Kotasyon yolu ile yapılan açık piyasa işlemlerinin telefonla gerçekleştirilmesi halinde, işleme taraf olan kuruluş yetkilisinin telefonda işlemi talep etmesi ve Merkez Bankası Açık Piyasa İşlemleri Müdürlüğü yetkilisinin onay vermesi ile gerçekleşmiş sayılır. Çıkacak uyuşmazlıkların çözümünde Merkez Bankası işlem ve telefon kayıtları esas alınır." olarak;

M ve N maddelerindeki ihale ifadeleri ihale/kotasyon olarak;

"VII. Açık Piyasa İşlemleri Teminat Sistemi, B-Teminatlara İlişkin Esaslar; ii) Döviz ve Efektif Depoları" bölümünde;

"... Söz konusu döviz depoları, Merkez Bankası'na uluslararası para piyasalarında değerlendirilecek ve sağlanacak faiz gelirleri ilgili bankalara aktarılacaktır." şeklindeki düzenleme "...Söz konusu döviz depoları, Merkez Bankası'na uluslararası para piyasalarında değerlendirilecek ve sağlanacak faiz gelirleri masraflar düşüldükten sonra ilgili bankalara aktarılacaktır." olarak;

değiştirilmiştir.

yazılan 18.02.2014 tarih, sayılı yazının 6. sayfası

Tereddt edilen konularda Aık Piyasa İřlemleri Mdrlğnn 0 312 507 50 80-9 numaralı telefonlarından bilgi alınabilir.

Gereğini rica ederiz.

TRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI
İdare Merkezi

TRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI A.ř
TİCARET SİCİL NUMARASI: 269
SERMAYESİ: 25.000 TL
İDARE MERKEZİ, ANKARA

İstiklal Cad. 10 06100 Ulus - ANKARA
Tel: (90 - 312) 507 50 00 Faks: (90 - 312) 507 56 40
E-Posta: iletisimbilgi@tcmb.gov.tr Swift: tcmtr2a
Genel Ađ: http://www.tcmb.gov.tr

Bu belge TS 13298 elektronik belge ynetimi standardına uygun řekilde hazırlanmıřtır.