

TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI

ANONİM ŞİRKETİ
SERMAYESİ : TL 25.000
İDARE MERKEZİ : ANKARA

İDARE MERKEZİ

Cevaplarda şu işaretlerin tekrarını dileriz :
B.02.2.TCM.0.10.00.01/

ANKARA, 22 Mayıs 2008

Konu: Yeni Geri Satım Vaadiyle Alım Uygulaması

İlgi: Nisan 2004 tarihli Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatı

Sayın Genel Müdürün Dikkatine

Bilindiği üzere, açık piyasa işlemleri çerçevesinde gerçekleştirilmekte olan geri satım vaadiyle alım ihalelerinde, ihalelere teklif göndermekte kullanılan İhale Teklifi mesajlarında kıymet kodu bölümünün doldurulması, diğer bir ifadeyle geri satım vaadiyle alım işlemine konu olan kıymet tanımının belirlenmesi zorunlu bulunmaktadır. Geri satım vaadiyle alım ihalelerinde katılımcı kuruluşlara operasyonel olarak esneklik sağlanması amacıyla 01.07.2008 tarihinden itibaren, geri satım vaadiyle alım ihalelerine teklif gönderilirken işleme konu kıymet tanımının (ISIN) belirtilmesi zorunluluğu kaldırılacaktır. Yeni uygulamayla açık piyasa işlemlerine katılan yetkili kuruluşlar, ihale tekliflerini gönderirken ihale kodu, ihale numarası, teklif türü, teklif tutarı ve faiz/getiri oranı alanlarını zorunlu olarak dolduracaklardır. TCMB Ödeme Sistemleri İhale Sistemi (İHS) sistemi aracılığı ile alınacak tekliflerde;

- İhale kodu ve/veya numarasının yanlış olması,
- Teklif türünün yanlış olması,
- Teklif tutarının, en az tutar ve katlarında olmaması,

halinde teklifler değerlendirmeye alınmayacaktır. Bununla birlikte kuruluşların, ihale teklif mesajlarında kıymet tanımı alanına giriş yapmaları durumunda, belirttikleri kıymet tanımı dikkate alınmayacaktır.

Geri satım vaadiyle alım ihaleleri sonuçlandırıldıktan sonra, geri satım vaadiyle alım ihalesini kazanan kuruluşlara kazanmış oldukları tekliflerine ait bilgiler TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı ile bildirilecektir. Mesajın formatı aşağıdaki şekilde olacaktır:

REPO*KIYMET*BİLDİR

RF:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*OR:XXXXX.XX

RF:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*OR:XXXXX.XX

RF:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*OR:XXXXX.XX

RF:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*OR:XXXXX.XX

RF:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*OR:XXXXX.XX

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Bankamız tarafından gönderilen bir TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajında, bir kuruluşa ait kazandığı en fazla beş geri satım vaadiyle alım teklifine ilişkin bildirim yapılabilecektir. Kuruluşun beş adetten fazla kazanan geri satım vaadiyle alım teklifi olması durumunda, her beş teklifinden sonra yeni bir TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı oluşturulacaktır. TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajında yer alan referans numarasının (RF) ilk beş hanesi ihale numarasını, son beş hanesi ise teklif numarasını ifade etmektedir. Örneğin, 2222 numaralı ihalenin 17 numaralı teklifini kazanan kuruluşa gönderilecek TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajındaki referans numarası 0222200017 olacaktır. TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajında yer alan “TUTAR” ibaresi, kuruluşların ihalede kazanmış oldukları TL tutarını ifade etmektedir.

TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajını alan kuruluşlar, her bir “RF” nolu kazanmış geri satım vaadiyle alım teklifi için bir Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajını Bankamıza ileteceklerdir. Her bir Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı ile ilgili teklife ait en fazla beş kıymet bildirilebilecektir. Kuruluşun aynı referans numarasıyla gönderilmiş birden fazla mesajı varsa, son gelen mesajı doğru kabul edilecektir.

Kuruluşlarca gönderilecek Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajının formatı aşağıdaki şekilde olacaktır:

REPO*RF:XXXXXXXXXXXX

ISIN:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX

ISIN:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX

ISIN:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX

ISIN:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX

ISIN:XXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Kuruluş, kıymet bildirmek için göndereceği Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajında yer alan referans numarasını on hane olacak şekilde eksiksiz girecektir.

Kuruluşun Bankamıza gönderdiği Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajında yer alan “TUTAR” ibaresi TL tutarını ifade edecek olup, beş kıymete ait tutarlar toplamı ilgili geri satım vaadiyle alım teklifi tutarına eşit olacaktır. Gönderilecek Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajının yukarıda belirtilen şekil şartlarını taşıması zorunludur. Yanlış referans numarasıyla, yanlış kıymet tanımı (ISIN) içeren, geri satım vaadiyle alım tutarından eksik ya da fazla tutar içeren Katılımcı Piyasa İşlemleri Bildirim mesajları dikkate alınmayacak kuruluşa hata mesajı gönderilecektir. Hatayı bildirecek TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı ise aşağıdaki şekilde olacaktır:

REPO*HATALI
MESAJ*SORGU*NO:*XXXXXXX
<HATA AÇIKLAMA>

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Kuruluşların geri satım vaadiyle alım karşılığı kıymet belirleme işlemini, Bankamızdan kendilerine TCMB Piyasa İşlemleri Bildirim mesajı gönderildikten sonra saat 12:00’ye kadar gerçekleştirmeleri gerekmektedir. Ancak, ihale katılımcılarının kendi Katılımcı Arayüzü Sistemi İstemcilerinde veya iletişim ağı alt yapılarında ya da TCMB Ödeme Sistemleri hizmetlerinde bir sorun olması ve bu durumun TCMB Ödeme Sistemleri operasyon veya teknik birimlerince teyit edilmesi durumunda geri satım vaadiyle alım karşılığı kıymetler telefon ya da faks yoluyla alınabilecektir. TCMB Ödeme Sistemleri üyesi olmayan kuruluşlar ihalede tekliflerini ve ihale sonrasında geri satım vaadiyle alım karşılığı kıymetlerini telefon ile bildirebileceklerdir.

Kuruluşlar geri satım vaadiyle alım karşılığı kıymetlerini bildirdikten sonra, ek teminatlarını mevcut Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatındaki formüller çerçevesinde hesaplayıp ilgili teminat depolarına aktaracaktır. Ek teminatların tamamlanmasından sonra kuruluşlara kazanan işlemlerine ilişkin TCMB Piyasa İşlemleri Api Ödeme İsteği mesajları iletilecektir. Kıymet ve nakit transferine ilişkin işlemler ve mesajlar mevcut uygulamadaki şekilde devam edecektir.

Tereddüt edilen konularla ilgili olarak bilgi için Açık Piyasa İşlemleri Müdürlüğü 0 312 507 50 80-9 numaralı telefonlardan aranabilecektir.

Bilgilerinizi rica ederiz.

TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI
İdare Merkezi

Ali ÇUFADAR

Aysun EVRENSEL

Genel Müdür Yardımcısı

Müdür