

TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI

ANONİM ŞİRKETİ
SERMAYESİ : YTL 25.000
İDARE MERKEZİ : ANKARA

İDARE MERKEZİ

Cevaplarda şu işaretlerin tekrarını dileriz :

ANKARA, 22 Mayıs 2008

B.02.2.TCM.0.10.00.01/

Konu: Yeni Repo Uygulaması

İlgi: Nisan 2004 tarihli Açık Piyasa İşlemleri Uygulama Talimatı

Sayın Genel Müdürün Dikkatine

Bilindiği üzere, açık piyasa işlemleri çerçevesinde gerçekleştirilmekte olan repo ihalelerinde, ihalelere teklif göndermekte kullanılan HABR-TKLF mesajlarında kıymet kodu bölümünün doldurulması, diğer bir ifadeyle repo işlemine konu olan kıymet tanımının belirlenmesi zorunlu bulunmaktadır. Repo ihalelerinde katılımcı kuruluşlara operasyonel olarak esneklik sağlanması amacıyla 01.07.2008 tarihinden itibaren, repo 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 oranı alanlarını zorunlu olarak dolduracaklardır. Elektronik Fon Transferi (EFT) 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.

Repo ihaleleri sonuçlandırıldıktan sonra, repo ihalesini kazanan kuruluşlara kazanmış oldukları tekliflerine ait bilgiler HABR-GENL mesajı ile bildirilecektir. Mesajın formatı aşağıdaki şekilde olacaktır:

```
REPO*KIYMET*BİLDİR
RF:XXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*FZ:XXXXX.XX
RF:XXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*FZ:XXXXX.XX
RF:XXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*FZ:XXXXX.XX
RF:XXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*FZ:XXXXX.XX
RF:XXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX*FZ:XXXXX.XX
```

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Bankamız tarafından gönderilen bir HABR-GENL mesajında, bir kuruluşa ait kazandığı en fazla beş repo teklifine ilişkin bildirim yapılabilecektir. Kuruluşun beş adetten fazla kazanan repo teklifi olması durumunda, her beş teklifinden sonra yeni bir HABR-GENL mesajı oluşturulacaktır. HABR-GENL 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 HABR-GENL mesajındaki referans numarası 0222200017 olacaktır. HABR-GENL mesajında yer alan "TUTAR" ibaresi, kuruluşların ihalede kazanmış oldukları YTL tutarını ifade etmektedir.

HABR-GENL mesajını alan kuruluşlar, her bir "RF" nolu kazanmış repo teklifi için bir HABR-GENL mesajını Bankamıza iletceklerdir. Her bir HABR-GENL 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 HABR-GENL mesajının formatı aşağıdaki şekilde olacaktır:

```
REPO*RF:XXXXXXXXXX
ISIN:XXXXXXXXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX
ISIN:XXXXXXXXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX
ISIN:XXXXXXXXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX
ISIN:XXXXXXXXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX
ISIN:XXXXXXXXXXXXXXXXXX*TUTAR:XXXXXXXXXXXXXXXXXXXXX.XX
```

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Kuruluş, kıymet bildirmek için göndereceği HABR-GENL mesajında yer alan referans numarasını on hane olacak şekilde eksiksiz girecektir. Kuruluşun Bankamıza gönderdiği HABR-GENL mesajında yer alan "TUTAR" ibaresi YTL

tutarını ifade edecek olup, beş kıymete ait tutarlar toplamı ilgili repo teklifi tutarına eşit olacaktır. Gönderilecek HABR-GENL mesajının yukarıda belirtilen şekil şartlarını taşıması zorunludur. Yanlış referans numarasıyla, yanlış kıymet tanımı (ISIN) içeren, repo tutarından eksik ya da fazla tutar içeren HABR-GENL mesajları dikkate alınmayacak kuruluşa hata mesajı gönderilecektir. Hatayı bildirecek HABR-GENL mesajı ise aşağıdaki şekilde olacaktır:

```
REPO*HATALI
EFT*İŞLEM*NUMARASI:*XXXXXXXXXXXXXXXXXX
<HATA AÇIKLAMA>
```

(*) karakteri boşluk anlamına gelmektedir.

Kuruluşların repo karşılığı kıymet belirleme işlemini, Bankamızdan kendilerine HABR-GENL mesajı gönderildikten sonra saat 12:00'ye kadar gerçekleştirmeleri gerekmektedir. Ancak, ihale katılımcılarının kendi sistemlerinde ya da EFT Merkezinde bir sorun olması ve bunun EFT Merkezince teyit edilmesi durumunda repo karşılığı kıymetler telefon ya da faks yoluyla alınabilecektir. EFT üyesi olmayan kuruluşlar ihalede tekliflerini ve ihale sonrasında repo karşılığı kıymetlerini telefon ile bildirebileceklerdir.

Kuruluşlar repo 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 HABR-ACIK 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 0 312 309 19 30-9 numaralı telefonlardan aranabilecektir.

Bilgilerinizi rica ederiz.

TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI
İdare Merkezi

Ali ÇUFADAR
Genel Müdür Yardımcısı

Aysun EVRENSEL
Müdür