

**DÖVİZ DEPO PİYASASINA İLİŞKİN  
TÜRKİYE CUMHURİYET MERKEZ BANKASI  
BASIN DUYURUSU**

4 Ağustos 2011 tarihinde yapılan Para Politikası Kurulu ara toplantısında belirlenen strateji çerçevesinde, bankalar arası döviz piyasasında döviz likiditesinin akışkanlığının artırılmasına katkıda bulunmak amacıyla son günlerde uluslararası piyasalarda artan belirsizliklerin ortadan kalkmasına kadar geçecek sürede Merkez Bankasının Döviz ve Efektif Piyasaları döviz depo piyasasındaki aracılık faaliyetlerine 10 Kasım 2011 tarihinden itibaren yeniden başlanmasına karar verilmiştir.

Bu çerçevede, Döviz ve Efektif Piyasaları Uygulama Talimatı ile belirlenen kurallar doğrultusunda döviz depo piyasasında bankalar Merkez Bankası aracılığı ile birbirlerinden borç alıp verebileceklerdir. Döviz depo piyasasının işleyişine ilişkin esaslar ekte yer almaktadır.

Kamuoyunun bilgisine sunulur.

## **EK: Döviz Depo Piyasası İşleyiş Esasları:**

- 1- Döviz depo piyasasında Döviz ve Efektif Piyasaları üyesi tüm bankalar işlem yapabileceklerdir.
- 2- Bankaların işlem limitleri Döviz ve Efektif Piyasalarında kendilerine tanınan işlem yapma limiti olacaktır.
- 3- Bankalar döviz depo işlemlerini teminat karşılığında gerçekleştireceklerdir.

Teminata kabul edilen kıymetler şunlardır:

- i. Merkez Bankası Ankara, İstanbul ve İzmir Şubeleri nezdinde bankaların kendi adlarına açtırdıkları efektif depoları,
  - ii. Vade yapıları ve özellikleri Merkez Bankası İdare Merkezince değerlendirilerek kabul edilen yabancı devlet ve hazinelerince ihraç edilmiş bono ve tahviller,
  - iii. Hazine Müsteşarlığınca ihraç edilmiş Eurobond'lar,
  - iv. Hazine Müsteşarlığınca ihraç edilmiş Devlet İç Borçlanma Senetleri (DİBS'ler),
  - v. Merkez Bankası likidite senetleri.
- 4- Döviz ve Efektif Piyasalarında bankalar kendileri için belirlenen grup ve tranş tutarları çerçevesinde aşağıda yer alan fazla bulundurma oranlarını dikkate alarak teminat tesis edeceklerdir.

<b><u>Teminat Türleri</u></b>	<b><u>1. Trans</u></b>	<b><u>2. Trans</u></b>	<b><u>3. Trans</u></b>
<b>Efektif Depoları</b>	<b>10</b>	<b>11</b>	<b>12</b>
<b>Yabancı Devlet Bono ve Tahvilleri</b>	<b>17</b>	<b>20</b>	<b>23</b>
<b>Eurobondlar</b>	<b>20</b>	<b>25</b>	<b>30</b>
<b>Vadesine 1Yıldan Az Kalan DİBS (TL/ Döviz ve Dövizde Endekli)</b>	<b>20</b>	<b>25</b>	<b>30</b>
<b>Vadesine 1Yıldan Çok Kalan DİBS (TL/ Döviz ve Dövizde Endekli)</b>	<b>30</b>	<b>35</b>	<b>40</b>
<b>Likidite Senetleri</b>	<b>20</b>	<b>25</b>	<b>30</b>

- 5- Bankaların işlemlerine karşılık bulundurdıkları teminatların değerlerinde fiyat ve kur hareketleri gibi nedenlerden dolayı değişiklikler olması durumunda, teminatları işlemlerini tam olarak karşılamayan bankalardan, ilave teminat getirmesi istenecektir. Bu yükümlülüğü kendisine bildirilen süre içerisinde yerine getiremeyen bankalar temerrüde düşmüş kabul edilecek ve söz konusu bankalara temerrüde düşme halinde uygulanan kurallar dahilinde işlem yapılacaktır.
- 6- İşlemler Amerikan doları ve euro döviz cinsleri üzerinden sabah saat 10.00-12.00 ile öğleden sonra 13.00-15.30 arasında gerçekleştirilecektir.
- 7- Aynı gün valörlü işlemler euro için saat 12.00, Amerikan doları için saat 15.00'e kadar gerçekleştirilecektir.
- 8- Bankalar talep ve tekliflerini Döviz ve Efektif Piyasaları Müdürlüğü telefonları (0 5075200-23) aracılığıyla vereceklerdir.
- 9- İşlem alt limiti 1 milyon Amerikan doları ve eurodur. İşlemler 1 milyon ve katları olarak gerçekleştirilecektir.
- 10- İşlemler aynı gün, bir gün, spot valörle başlamak üzere bir haftadan bir ay vadeye kadar gerçekleştirilebilecektir.
- 11- Talep ve teklif edilecek faizlerin yıllık olarak ve küsüratların tam, 1/2, 1/4 ya da 1/8 olarak tanımlanması ve bunlar dışında küsürat kullanılmaması, faize esas vadede ise senenin 360 gün olarak kabul edilmesi gerekmektedir.
- 12- Bankalar bildirdikleri toplam teklif veya talep tutarlarının bölünebilir olup olmadığını bildirecekler, bölünebilir teklif ya da talepler kısmen karşılanmış olabilecektir.
- 13- En iyi üç talep ve teklif Reuters sisteminin "CBTJ" sayfasında ilan edilecek ve tüm bankaların aynı anda bilgi sahibi olması sağlanacaktır. İşlemler

gerçekleştğinde aynı sayfada duyurulacaktır. Gerçekleşen işlemlerde muhatap Merkez Bankası olacak ve alım satım işlemini gerçekleştiren kuruluşlar birbirlerini bilmeyeceklerdir.

14-Bankalarca verilen teklif ve talepler gerçekleşmedikleri takdirde gün sonunda iptal edilecektir.

15-Bankaların gerçekleştirdikleri depo işlemlerini aynı gün saat 16.30'a kadar telefonla teyit etmeleri gerekmektedir. Aksi takdirde anlaşmazlık durumunda Merkez Bankası kayıtları geçerli olacaktır.

16-Gerçekleşen depo işlemleri için hem alıcı hem satıcı taraftan işleme esas dövizin Bankamızca bir önceki iş günü belirlenen gösterge niteliğindeki döviz alış kuru karşılığı Türk Lirası eşdeğerinin onbinde 1'inden (0,0001) az olmamak koşuluyla, tahakkuk eden faizler üzerinden Bankamızca bir önceki iş günü belirlenen gösterge niteliğindeki döviz alış kuru karşılığı Türk Lirası eşdeğerinin yüzde 10'u (0,10) oranında komisyon tahsil edilecektir. Ancak, her iki taraftan tahsil edilecek komisyon tutarı, işlem sonucu oluşan faiz tutarının Bankamızca bir önceki iş günü belirlenen gösterge niteliğindeki döviz alış kuru karşılığı Türk Lirası eşdeğerinin yarısını geçmeyecektir.

17-Bankalarca döviz depo piyasasında borç verilen tutarlar yabancı para zorunlu karşılıklarına sayılmayacaktır.

18-Yükümlülüğünü yerine getiremeyen bankalara Döviz ve Efektif Piyasaları Uygulama Talimatı çerçevesinde müeyyide uygulanacaktır.