

ORGANİZE TOPTAN DOĞAL GAZ SATIŞ PİYASASI (OTSP) SÜREKLİ TİCARET PLATFORMU (STP)

*Spot Doğal Gaz
Operasyon Müdürlüğü
Mart 2018*

STP'nin Getirdikleri

Günlük Referans Fiyat



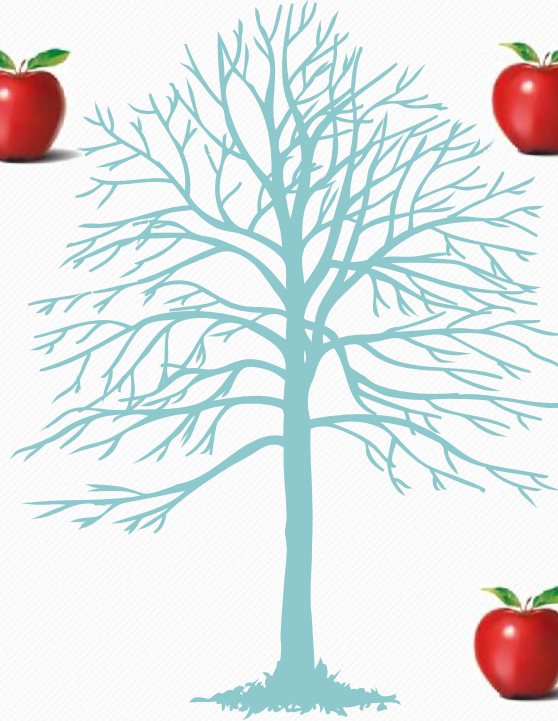
**Spot doğal gaz ticareti ve
kendilerini dengeleme fırsatı**

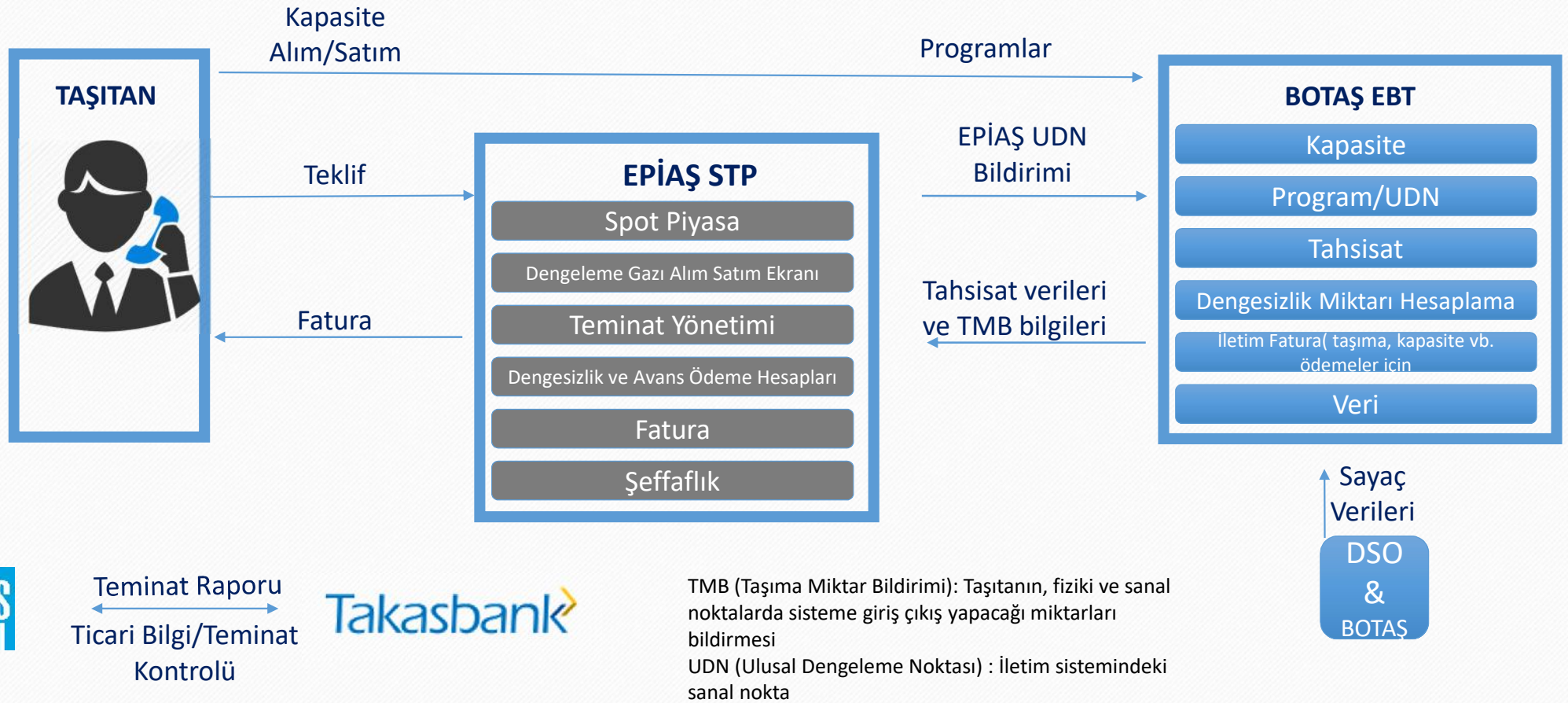


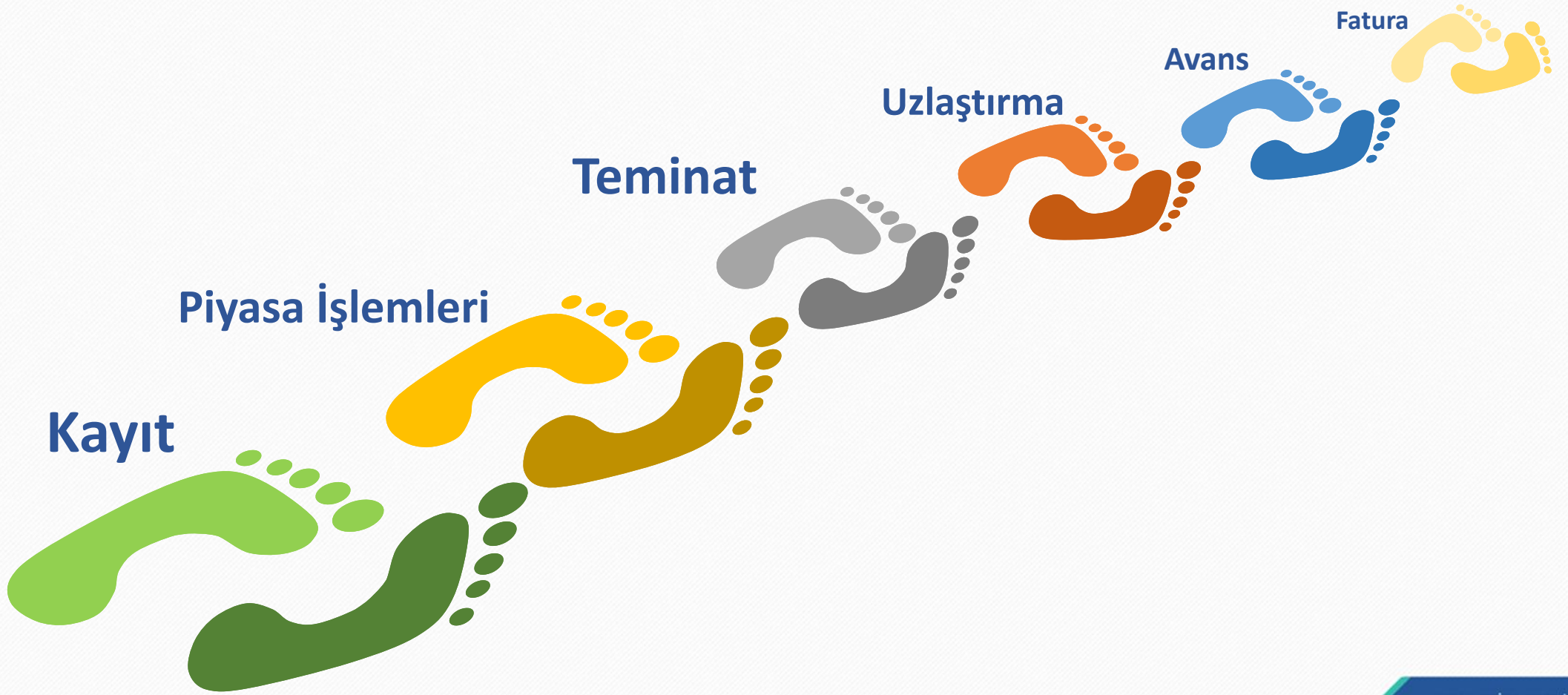
**İletim Şirketine sistemi
piyasa bazlı dengeleme
fırsatı**



**Piyasa işlemlerinin ve
taşıtanların dengesizlik
işlemlerinin uzlaştırılmasının
EPIAŞ tarafından yapılması**







Kayıt

- ✓ STP'de piyasa işlemi yapmak için EPIAŞ ile STP Katılım Anlaşması imzalayarak kayıt yaptırmak gerekmektedir.
- ✓ Kayıt başvuruları ilgili gaz yılı/yılları için her zaman yapılabilir. Gaz yılı öncesinde ise kayıt güncellemeleri 1 Kasım-31 Aralık tarihleri arasında yapılabilir.
- ✓ Kayıt için ilk olarak EPIAŞ'ın web sitesi üzerinden online kayıt yapılır.
- ✓ Online kayıt sonrasında PUE'de istenilen belgeler eksiksiz olarak EPIAŞ'a 10 iş günü içinde sunulur.
- ✓ EPIAŞ, sunulan bilgi ve belgelerin uyumluluğu ve doğruluğu ile alakalı incelemelerini başvuru tarihini izleyen 5 iş günü içerisinde tamamlar.
- ✓ Uygun bulunan katılımcılar ile Piyasa Katılım Anlaşması imzalanır ve anlaşmanın imzalanmasını müteakip kayıt başvurusu tamamlanmış olur.

Piyasa Modeli - Roller



- İletim şirketi ile Standart Taşıma Sözleşmesi imzalar.
- EPIAŞ, İletim Şirketi ve Taşıtan Dengesizlikleri Uzlaştırma Protokolü (DUP) imzalar.

- Online kayıt formu doldurulur.
- Takasbank ile anlaşma imzalanır.
- PUE'de belirtilen diğer belgeler 10 iş günü içerisinde EPIAŞ'a sunulur.

Piyasa Katılım Anlaşması imzalanır.



İlk kayıt başvuruları yıl içerisinde herhangi bir zaman yapılabilir.



Kayıt güncelleme tarihi 1 Kasım-31 Aralık tarihleri arasındadır.

Piyasa Modeli - Roller

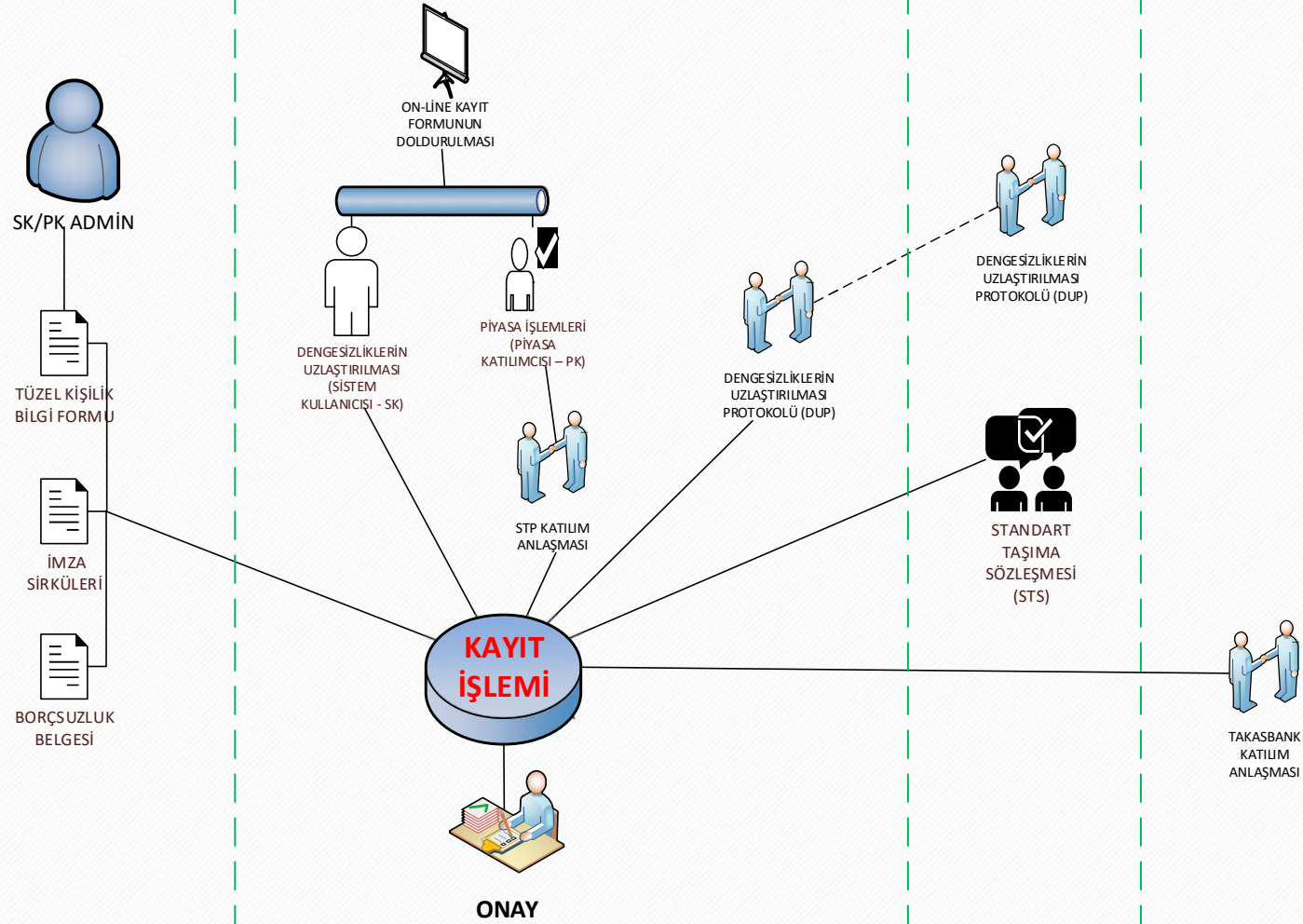
8

TAŞITANLAR

EPIAŞ

BOTAŞ

TAKASBANK



Online Kayıt Formu

10

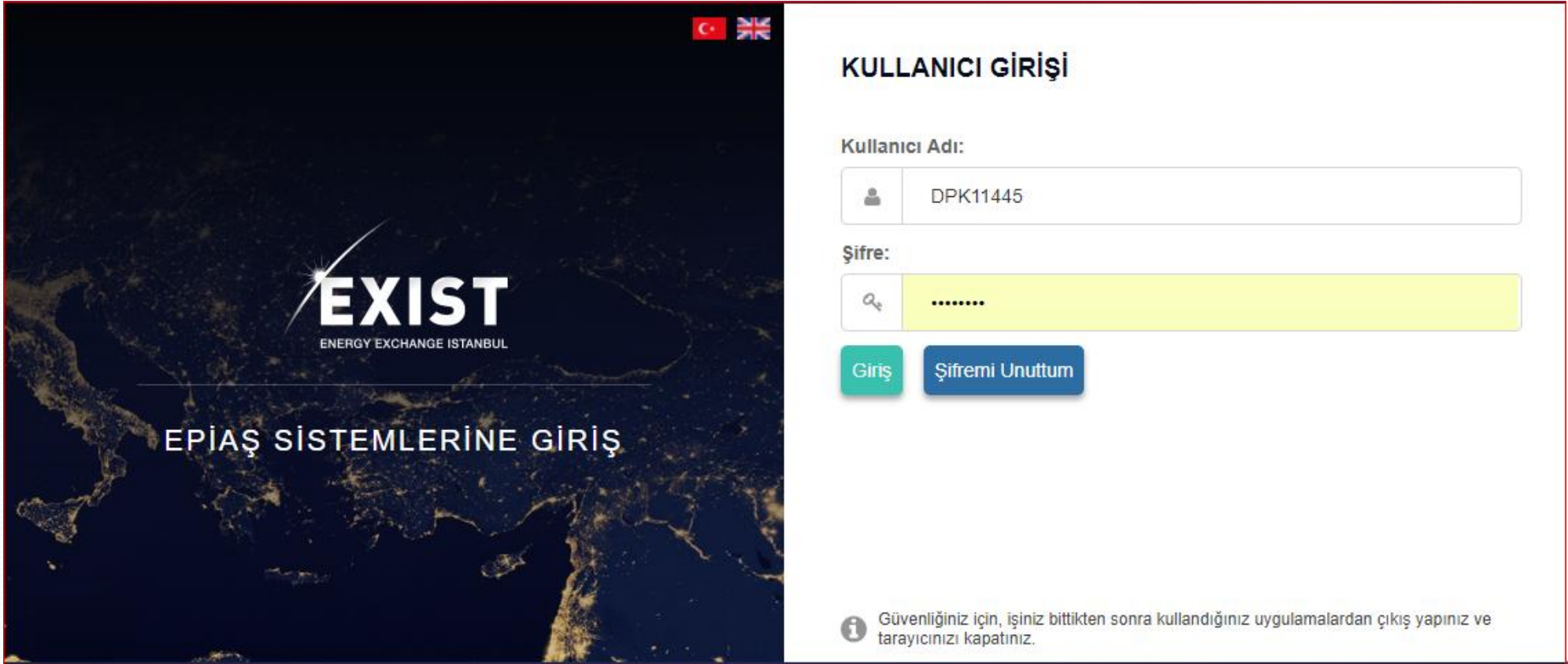
Katılım Tipi Katılım Tipi Seçiniz	Lisans Bilgileri * + Lisans Ekle
Kayıt Dönemi Kayıt Dönemi Seçiniz	
Piyasa Katılımcı Bilgileri	Vergi Bilgileri
EPİAŞ Tekil ID * 	Vergi Dairesi *
Organizasyon Adı * 	Vergi No * Lütfen 10 Haneli Vergi Numaranızı Girin.
Adres * 	Finans Sorumlusu Bilgileri
Posta Kodu * 	Sorumlu Ad *
Şehir * Şehir Seçiniz	Sorumlu Soyad *
İlçe * İlçe Seçiniz	Sorumlu Telefon * +90(5_)
Telefon * +90()	Sorumlu E-Posta * sorumlu@sirketiniz.com.tr
Telefon 2 +90()	Sorumlu TC Kimlik Numarası *
Fax * +90()	
KEP Adresi * 	Güvenlik Doğrulaması *
Web Adresi 	☐ Ben robot değilim 
	* ile işaretlenmiş alanlar zorunlu alanlardır.
	Kaydet

- ✓ Kayıt için ilk olarak EPİAŞ web sitesinden «**Online Kayıt**» formunu doldurmak zorundadır.
- ✓ Online Kayıt işlemini tamamlayan taşıtanlar 10 iş günü içinde PUE'de belirtilen belgeleri Piyasa İşletmecisine eksiksiz olarak teslim etmek zorundadır.

EKYS - EPIAŞ Kimlik Yönetim Sistemi

11

- ✓ Taşıtanlar EPIAŞ EKYS üzerinden kullanıcı işlemlerini yönetebileceklerdir.



EXIST
ENERGY EXCHANGE ISTANBUL

EPIAŞ SİSTEMLERİNE GİRİŞ

KULLANICI GİRİŞİ

Kullanıcı Adı:

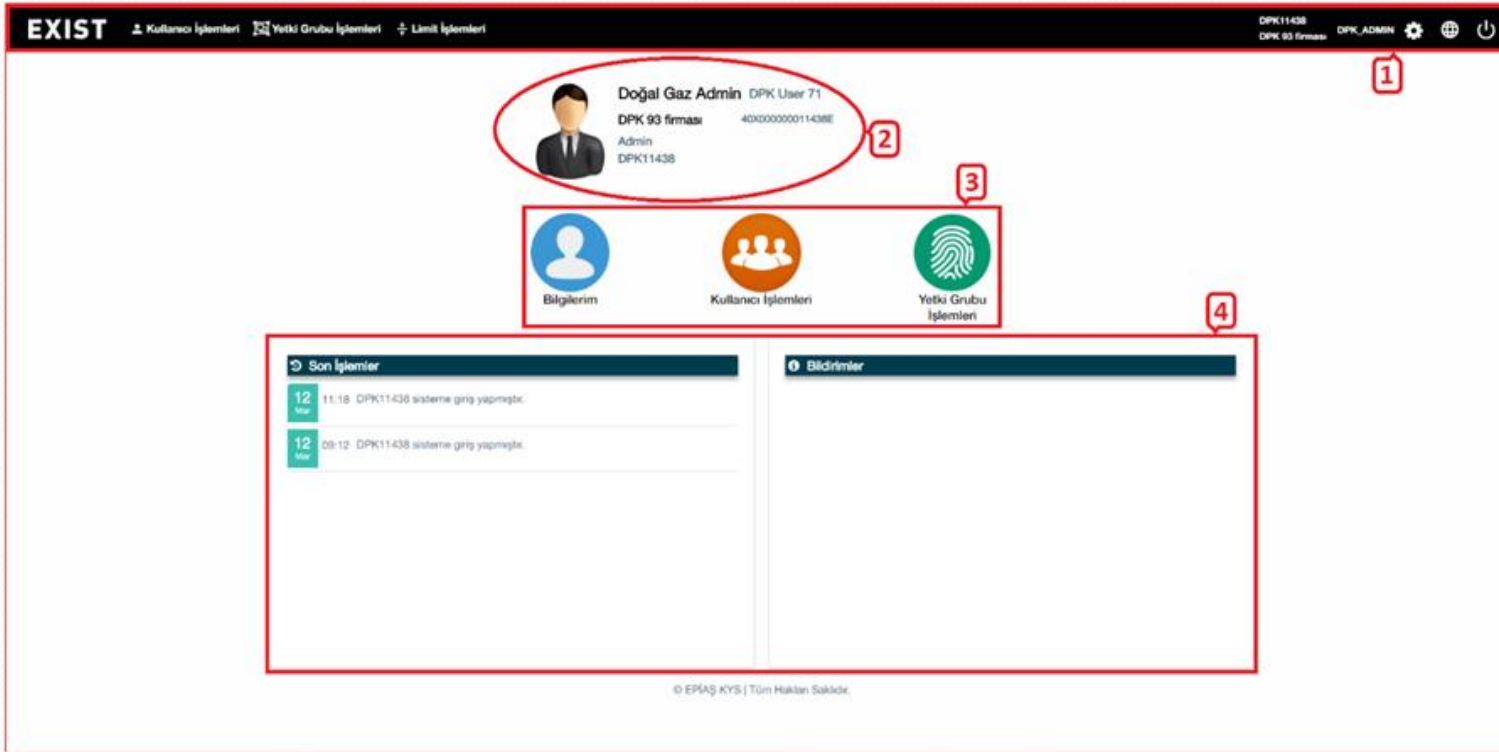
DPK11445

Şifre:

.....

Giriş Şifremi Unuttum

i Güvenliğiniz için, işiniz bittikten sonra kullandığınız uygulamalardan çıkış yapınız ve tarayıcınızı kapatınız.



- ✓ EKYS ile kullanıcı bilgileri ve bu bilgilerin yönetimi, kullanıcı limit işlemleri, kullanıcı yetki ve yetki grubu işlemleri, kullanıcı tercihleri gibi direkt kullanıcı odaklı olan yönetim alanlarının tümü tek bir çatı altında toplanmıştır.

Yeni Alt Kullanıcı Ekle

Organizasyon:

DPK 44 firması

Kullanıcı Tipi: *

Seçiniz

Cinsiyet: *

☐ Bay: ☐ Bayan:

Görev: *

Görev

Kullanıcı Adı *

Kullanıcı Adı

Adı: *

Ad

Soyadı: *

Soyad

TCKN: *

TCKN

Telefon: *

90 Seçiniz 1234567

E-Posta: *

Kullanıcı Adı @ Alan Uzanti

Kullanıcı Oluştur

* ile işaretli alanların doldurulması zorunludur.

- ✓ EPIAŞ EKYS sistemi üzerinden organizasyonun Admin yetkisine sahip kullanıcısı tarafından, organizasyonun ihtiyaçları göz önünde bulundurularak «Alt Kullanıcılar» oluşturulabilir.

EKYS – Yetki Grubu İşlemleri

- ✓ Organizasyon Admini ve “Yetki Grubu İşlemleri” yetkisine sahip kullanıcılar, kendi organizasyonunun işlem yapmaya yetkili olduğu uygulamalardaki tüm yetkileri ve kendi organizasyonuna ait yetki gruplarını yönetebilirler.

The screenshot displays the EXIST web application interface for 'Yetki Grubu İşlemleri' (Authority Group Operations). The top navigation bar includes the EXIST logo, user management links, and the current page title. The main content area is divided into two panels: 'Admin Yetki Listesi' (Admin Authority List) and 'Yetki Grupları' (Authority Groups).

1 The 'Yetki Grubu Listele' (List Authority Groups) button is highlighted in the top navigation bar.

2 The 'Admin Yetki Listesi' panel shows a list of permissions, including 'Aktif Bölgesel Kontratları Listeleme Yetkisi', 'Aktif Kontratları Listeleme Yetkisi', 'Anasayfa ile Teklif ve Eşleşmeler Sayfası; Teklif Geçmişini Görüntüleme Yetkisi', 'Avans Bildirim Ekranı / Servis Görüntüleme Yetkisi', 'Aylık Uzlaştırma Hesabının Görüntülenmesi Kullanıcı', 'Doğalgaz Piyasası Giriş Yetkisi', 'Duyuru Ekranları Duyuruları Listeleme Yetkisi', 'Eşleşme Detay Listeleme Yetkisi', and 'Eşleşme Listeleme Yetkisi'.

3 The 'Yetki Grupları' panel shows a list of authority groups, including 'DPK11445_STP_ADMIN' and 'Malatyalı stp'.

4 A red circle with a plus sign is located at the bottom right of the interface.

© EPIAŞ KYS | Tüm Hakları Saklıdır.

www.epias.com.tr

- ✓ Organizasyon Admini ve “Limit İşlemleri” yetkisine sahip kullanıcılar, kendi organizasyonunun işlem yapmaya yetkili olduğu uygulamalardaki tüm limit işlemlerini yönetebilirler.

EXIST | Kullanıcı İşlemleri | Yetki Grubu İşlemleri | Limit İşlemleri

DPK11445
DPK 44 firması | DPK_ADMIN | Settings | Logout

Limit İşlemleri > Kullanıcı Limit İşlemleri

Kullanıcı Limit İşlemleri

1 **Kullanıcı Listesi**

☐ Tümünü Seç | Kişilerde Ara

Seç	Kullanıcı	Yetki
☐	DPK User 59 Admin	DPK11445
☐	ASD QWERT MÜHENDİS	EXCHANGE
☐	ABC DEF ALT KULLANICI	MALATYALI

(1 of 1) << < 1 > >>

2 **Uygulama Limitleri**

STP

STP Tavan Fiyat: 0 | Admin Limiti: 2500
Değerler 'Lot' türündendir. 0 | 2.500

STP Bölgesel Minimum Miktar İletim: 1 | Admin Limiti: 30000
Değerler 'Lot' türündendir. 1 | 30.000

STP Taban Fiyat: 0 | Admin Limiti: 2500
Değerler 'Lot' türündendir. 0 | 2.500

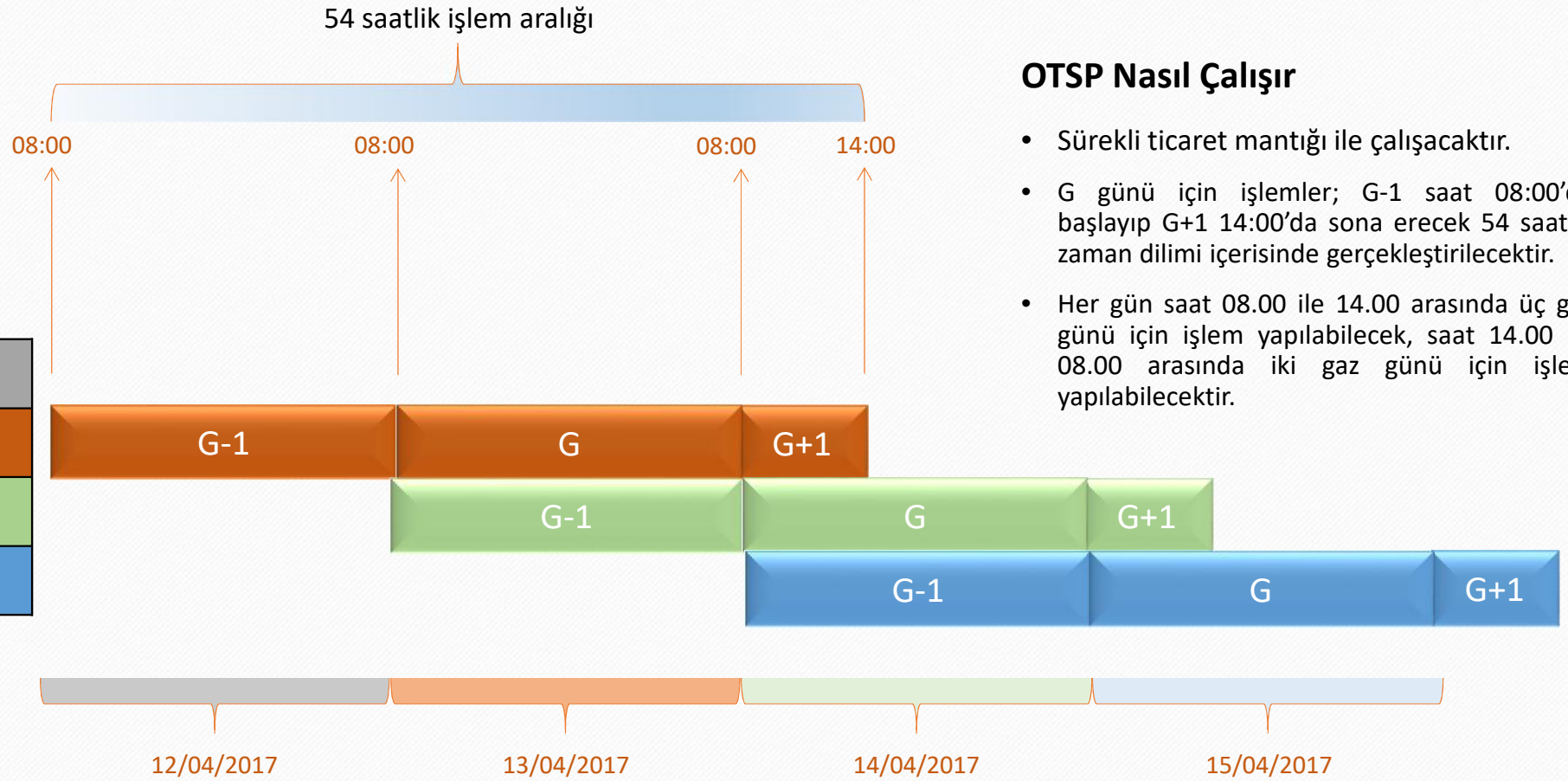
STP Minimum Miktar İletim: 1 | Admin Limiti: 30000
Değerler 'Lot' türündendir. 1 | 30.000

STP Maksimum Miktar İletim: 1 | Admin Limiti: 30000
Değerler 'Lot' türündendir. 1 | 30.000

© EPIAŞ KYS | Tüm Hakları Saklıdır.

www.epias.com.tr

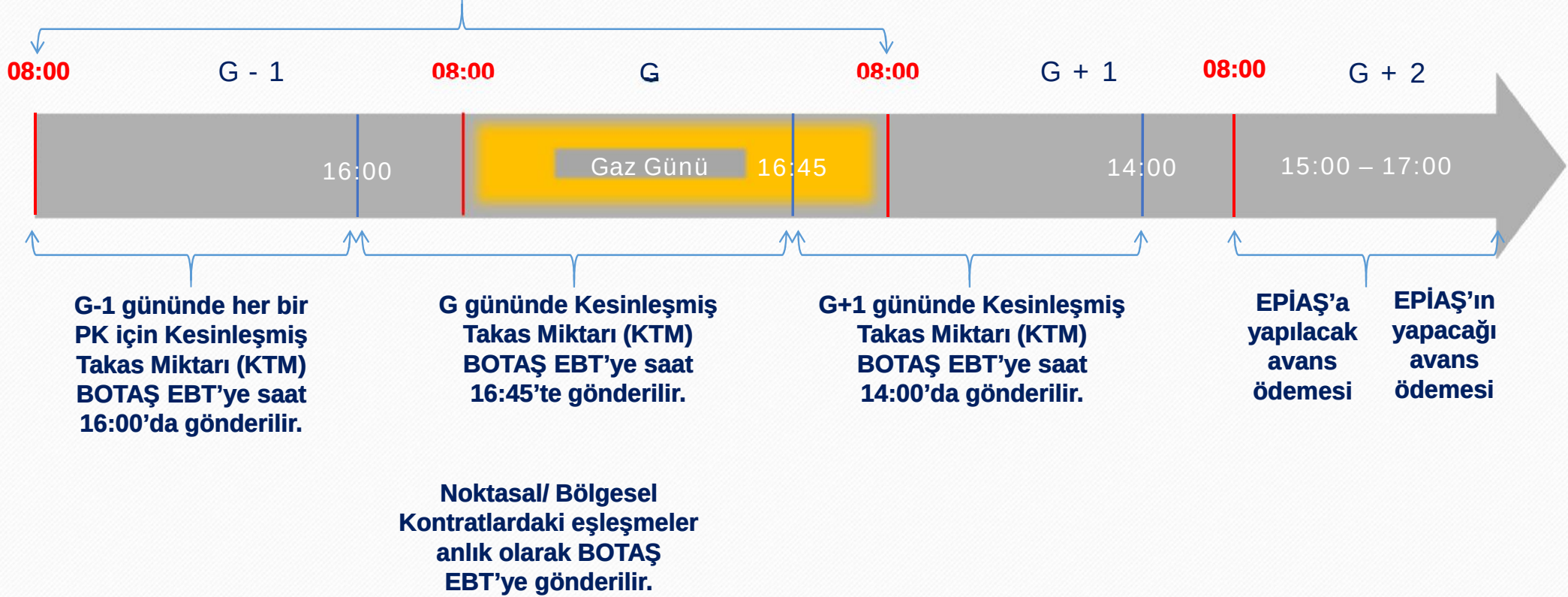
Piyasa İşlemleri



OTSP Nasıl Çalışır

- Sürekli ticaret mantığı ile çalışacaktır.
- G günü için işlemler; G-1 saat 08:00'de başlayıp G+1 14:00'da sona erecek 54 saatlik zaman dilimi içerisinde gerçekleştirilecektir.
- Her gün saat 08.00 ile 14.00 arasında üç gaz günü için işlem yapılabilecek, saat 14.00 ile 08.00 arasında iki gaz günü için işlem yapılabilecektir.

Günlük Referans Fiyatı; G-1saat 08:00 ile G+1 günü saat 08:00 arasında gerçekleşen işlemlerin ağırlıklı ortalamasıdır.



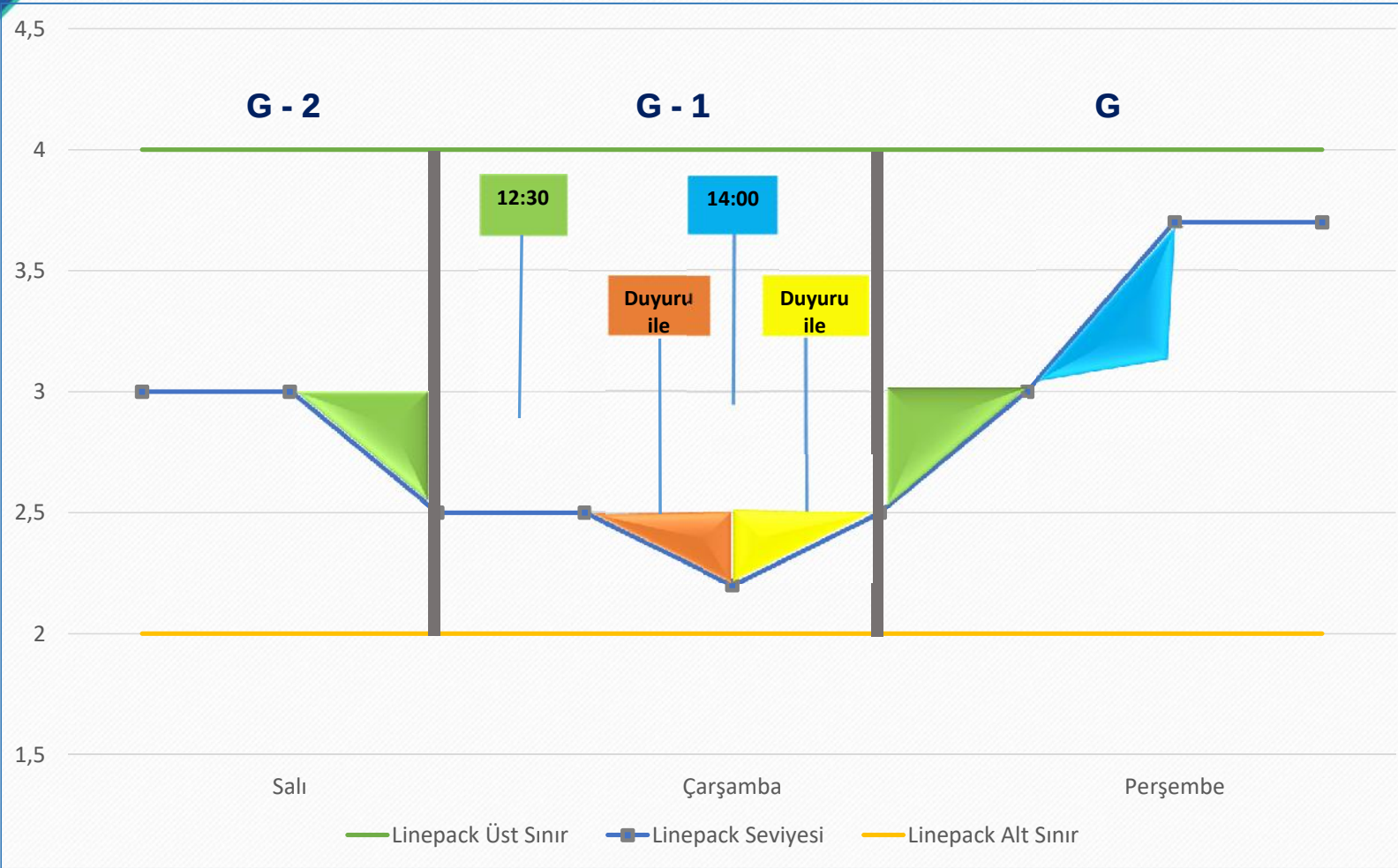
İlave Dengeleyici İşlemleri

İletim şirketi 3 Kodlu (UDN'de mevcut teklif defterinde veya 4 Kodlu olarak ayrı bir teklif defterinde Noktasal/bölgesel ürün açılmasını talep eder.



*BOTAŞ İletim, dengeleme gazı işlemlerini **G-1 ve G** de spot piyasada gerçekleştirir.*

İlave Dengeleyici İşlemleri



1 Kodlu ilave dengeleme;
Çarşamba 12:30'de Salı gününün eksikliği giderilir. Perşembe kontratında işlem yapılır. Gaz Perşembe gelir.

2 Kodlu ilave dengeleme;
Çarşamba 14:00'de şebeke stoğunun seviyesi değiştirilmek istendiğinde gerçekleşir. Perşembe kontratında işlem yapılır.

3 Kodlu ilave dengeleme;
Çarşamba herhangi bir zaman mevcut defterde Çarşamba veya Perşembe gününün eksikliği giderilir.

4 Kodlu ilave dengeleme;
Çarşamba herhangi bir zaman noktasal/bölgesel teklif olarak ayrı bir teklif defterinde Çarşamba veya Perşembe gününün eksikliği giderilir.

Teklif ve Eşleşme Prosedürleri



Teklif Birimleri

- Teklifin yönü
- Miktarlar 1000 Sm³ ve katları cinsinden ifade edilir.
- Fiyatların birimi TL/1000 Sm³'tür.
- Teklifler için verilen fiyatlar 0,25 TL ve katları olarak verilir.



Teklif Limitleri

- STP'de verilen tekliflerdeki fiyatlar;
 - Asgari 0 TL/1000 Sm³
 - Azami ise 2500 TL/1000 Sm³'tür.
- İletim Şirketi ile işlem yapmak isteyen taşıtanlar son 2 gündeki en yüksek eşleşme fiyatının %4'ünün altındaki fiyatla İletim Şirketi ile eşleşebilirler



Teklif Seçenekleri

- ✓ Standart Teklif
- ✓ ~~Tamamını Eşle veya Yok Et (TEYE)~~
- ✓ Olanı Eşle ve Yok Et (OEYE)
- ✓ Zaman Sınırlı Teklif



Kontrat	Alış Miktarı (1000Sm3)	Alış Fiyatı (TL/1000Sm3)
GD150616	100	950

Teklif

- ✓ Enerji miktarları 1000Sm3 olarak girilir.
- ✓ Teklifler gün için girilir, fiziki teslimatı için saat ayrımı yoktur.
- ✓ Önce girilen teklif önceliklidir.
- ✓ En iyi satış teklifi; fiyatı en düşük olan tekliftir.
- ✓ En iyi alış teklifi; fiyatı en yüksek olan tekliftir.

Teklif Derinliğinde Öncelik Sıralaması (Alış Teklifleri)

25

Alış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
950	50
949,75	300
930	20
925	90
910	500
910	40
300	80



Saat	Fiyat (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
8:30:45:550	910	50
8:30:50:300	910	40

Alış Yönünde Tekliflerin Sıralanması

- Fiyatı en yüksek olan alış teklifi en üst sırada yer alır.
- Tekliflerin fiyatları eşit ise sisteme kaydoluş sırasına bakılır. Önce kaydolan teklif önceliklidir.
- Tekliflerde yapılan güncellemeler teklifin sisteme kaydolma zamanını değiştirecektir.

Satış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Satış Miktarı (1000Sm3)
900	5
910	100
960	50
960	40
960	90
1000	80



Saat	Fiyat (TL/1000Sm3)	Satış Miktarı (1000Sm3)
10:20:45:550	960	50
10:20:45:750	960	40
10:25:00:001	960	90

Satış Yönünde Tekliflerin Sıralanması

- Fiyatı en düşük olan satış teklifi en üst sırada yer alır.
- Tekliflerin fiyatları eşit ise sisteme kaydoluş sırasına bakılır. Önce kaydolan teklif önceliklidir.
- Tekliflerde yapılan güncellemeler teklifin sisteme kaydolma zamanını değiştirecektir.

Tekliflerin Eşleştirilmesi (Yeni Bir Alış Teklifi Geldiğinde) 27

Satış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Satış Miktarı (1000Sm3)
940	50
945	75
945,50	10
945,75	30
960	20
970	500
1000	200



Alış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
940	50
938	30
935	20
930	45
925	15
920	200
900	400
899	250

Alış yönünde yeni bir teklif girildiğinde (Tam eşleşme)

- 940 TL 'den sunulan alış teklifi en yüksek fiyatlı alış teklifi olduğu için ilk sıraya yerleştirilir.
- 940 TL fiyatlı satış teklifi ile 940 TL fiyatlı alış teklifi eşleşir.

Satış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Satış Miktarı (1000Sm3)
940	50
945	5
945	10
950	30
955	20
960	500

Alış Teklifleri	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
950	100
910	30
905	20
905	45
905	15
900	200
900	400

Alış Teklif Derinliği Son Hali	
Fiyat (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
950	5
910	30
905	20
905	45
905	15
900	200
900	400

Alış yönünde yeni bir teklif girildiğinde (Kısmi eşleşme)

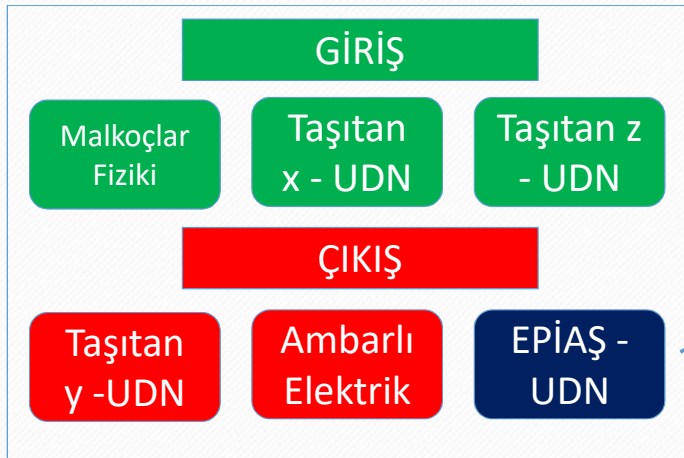
- 150 TL 'den sunulan alış teklifi en yüksek fiyatlı alış teklifi olduğu için ilk sıraya yerleştirilir.
- 150 TL'ye kadar olan satış teklifleri ile miktarları doğrultusunda eşleştirilir.
- Kalan miktar teklifin fiyatına göre teklif derinliğinde sıralamaya yerleştirilir.

Firma	Saat	Fiyat (TL/1000Sm3)	Satış Miktarı (1000Sm3)
A	10:10:25	940	50
B	09:45:00	945	5
C	10:05:30	945	10
C	10:15:15	950	30

Firma	Saat	Alış Fiyatı (TL/1000Sm3)	Alış Miktarı (1000Sm3)
D	10:20:45	950	100

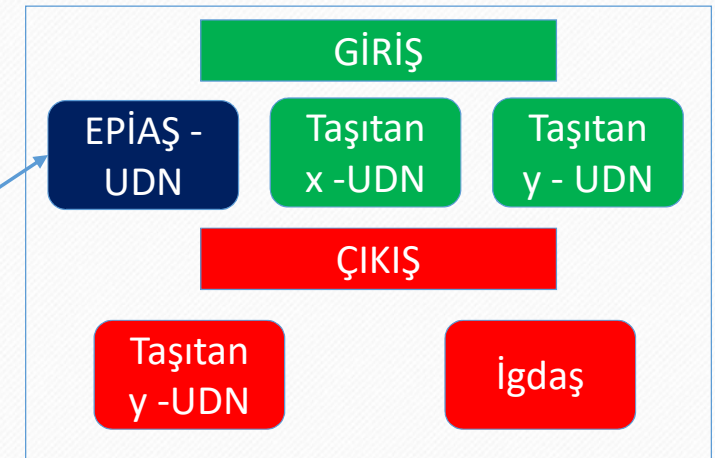
Firma	Miktar x Fiyat	Tutar	Durum
A	(940 x 50)	47.000 TL	Alacak
B	(945 x 5)	4.725 TL	Alacak
C	(945 x 10 + 950 x 30)	28.500 TL	Alacak
D	(940 x 50 + 945 x 5 + 945 x 10 + 950 x 30)	80.225TL	Borç

Taşıtan A



Taşıtan STP'de satış teklifi vermiş ve eşleşmiş

Taşıtan B



Taşıtan STP'de alış teklifi vermiş ve eşleşmiş

- ✓ STP'de yapılan ticaret fiziki teslimat zorunluluğu doğurur.

Uzlařtırma

Dengeleme Gazı Alış Fiyatı (DGAF): Taşıtanların, G günündeki dengeleme gazı alış fiyatını;

Dengeleme Gazı Satış Fiyatı (DGSF): Taşıtanların, G günündeki dengeleme gazı satış fiyatını;

Günlük Referans Fiyat (GRF): Bir gaz günü için kesinleşmiş eşleşmelerin fiyatlarından hareketle hesaplanan günlük doğal gaz fiyatını;

İlave Dengeleyici Alış Fiyatı (İDAF): İletim Şirketi'nin sistem ihtiyaçlarını karşılamak için OTSP'de gerçekleştirdiği alış yönlü işlemler üzerinden hesaplanan ağırlıklı ortalama fiyatı;

İlave Dengeleyici Satış Fiyatı (İDSF): İletim Şirketi'nin sistem ihtiyaçlarını karşılamak için OTSP'de gerçekleştirdiği satış yönlü işlemler üzerinden hesaplanan ağırlıklı ortalama fiyatı ifade eder.



$$\begin{array}{c} \text{EPIAŞ UDN GİRİŞ} \\ + \\ \text{UDN GİRİŞ} \\ + \\ \text{FİZİKİ GİRİŞ} \end{array} - \begin{array}{c} \text{EPIAŞ UDN ÇIKIŞ} \\ + \\ \text{UDN ÇIKIŞ} \\ + \\ \text{FİZİKİ ÇIKIŞ} \end{array} \neq 0$$



Katılımcıların dengesizlik hesaplamaları yapılırken yukarıdaki hesaplamanın sonucu dikkate alınır.



Bir piyasa katılımcının tüm girişleri toplamı, tüm çıkışları toplamından küçük ise katılımcı negatif, büyük ise pozitif dengesizlik durumundadır ve buna göre dengesizlik teminatı hesaplamaları yapılır.



Botaş iletim tarafından hesaplanacak dengesizlik miktarları ay sonunda günlük bazda EPIAŞ'a gönderilir. Epias'ta yapılacak dengesizlik uzlaştırmasında bu miktarlar dikkate alınır.

- ✓ Katılımcıların STP’de gerçekleştirdikleri işlemler
 - ✓ İletim sisteminde oluşan dengesizlikler
- EPİAŞ tarafından uzlaştırılır.

DENGELEME GAZI FİYATI

- *Dengeleme Gazı Alış Fiyatı (DGAF) : $((1,03), İ)$
- *Dengeleme Gazı Satış Fiyatı (DGSF) : $((0,97), İ)$

- İletim şirketinin ilave dengeleyici olarak piyasada işlem yaptığı durumlarda dengesizlik hesapları bu şekilde yapılır.

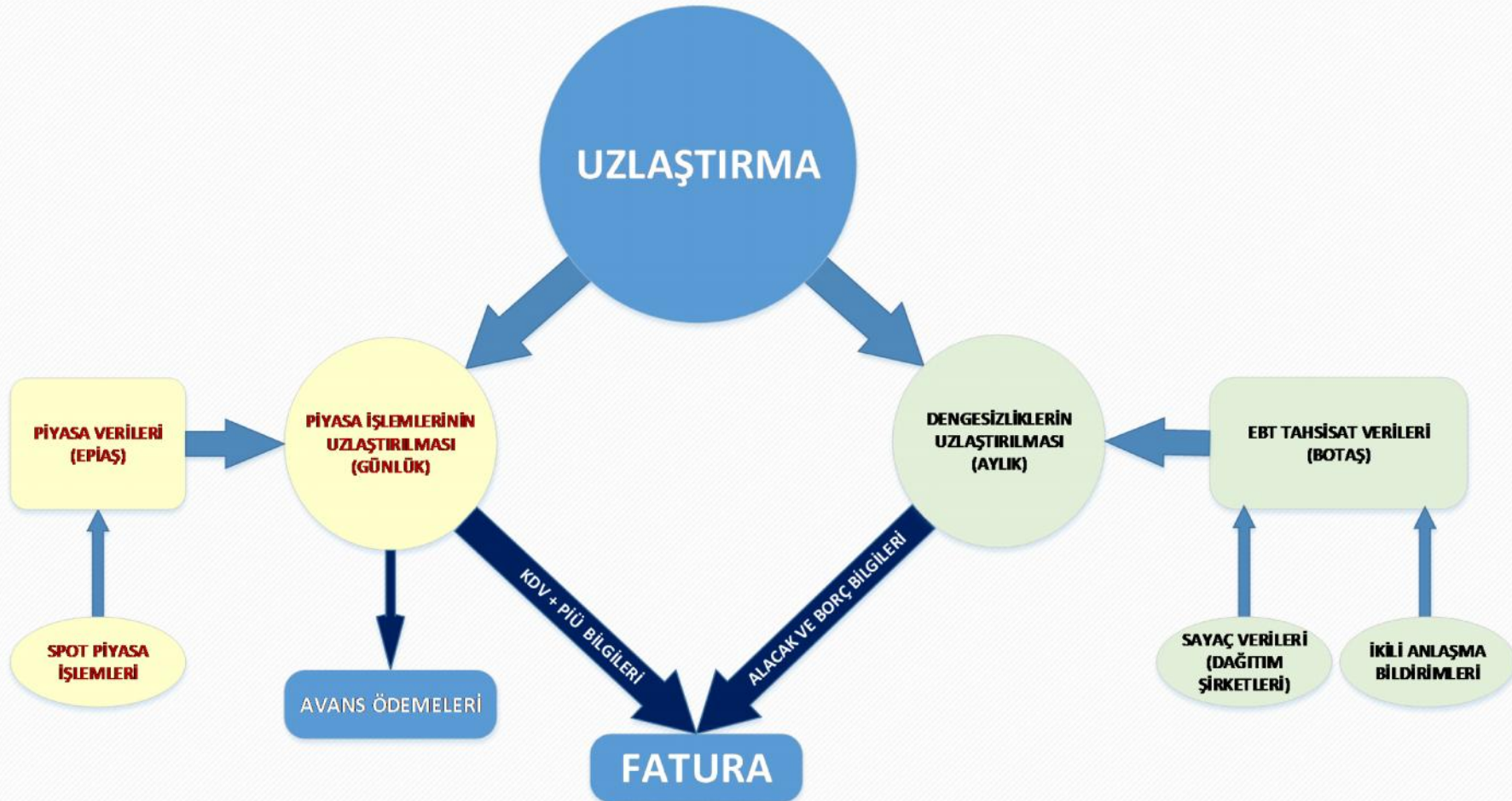
OTSP İŞLEMLERİNİN UZLAŞTIRILMASI

ALİŞ MİKTARI*ALİŞ FİYATI= SİSTEM BORÇ TUTARI
SATIŞ MİKTARI*SATIŞ FİYAT=SİSTEM ALACAK TUTARI

DENGESİZLİKLERİN UZLAŞTIRILMASI

NEGATİF DENGESİZLİK MİKTARI*DGAF
POZİTİF DENGESİZLİK MİKTARI*DGSF

NOT: Talimat alan taşıtanlar için yeni ŞİD’e göre muaf miktarlar DGAF yerine İDSF, DGSF yerine İDAF ile çarpılarak dengesizlik miktarları hesaplanır.



Dengesizliklerin Uzlaştırılması Sonucu Oluşan Bakiyenin Sıfırlanması (BAST) Hesaplaması

BAST aşağıdaki formüller uyarınca hesaplanır:

) Sistem dengesi pozitifse, BAST aşağıdaki formüle göre hesaplanır:

$$= (\ddot{O} - \ddot{O}) - (-) \times$$

) Sistem dengesi negatifse, BAST aşağıdaki formüle göre hesaplanır:

$$= (\ddot{O} - \ddot{O}) - (-) \times i$$

Negatif Dengesizlik Ödemesi	Pozitif Dengesizlik Ödemesi	Negatif Dengesizlik Miktarı (Sm3)	Pozitif Dengesizlik Miktarı (Sm3)	GRF (TL/Sm3)	DGAF (TL/Sm3)	DGSF (TL/Sm3)
-561.000 ₺	382.500 ₺	-600.000	500.000	0,85 ₺	0,94 ₺	0,77 ₺
Dengesizlik Ödemeleri sonucu İletim Şirketinin elinde kalan net tutar			İletim Şirketinin Gazının Bedeli			
178.500 ₺			-85.000 ₺			
BAST			93.500 ₺			

- ✓ 93.500 TL olarak dengesizliklerden oluşan bakiye PUE'de belirtilen oranlarda ilgililere dağıtılır.

- ✓ Sistemde negatif kalan taşıtanlara DGAF üzerinden bedel yansıtılır.
- ✓ Sistemde pozitif kalan taşıtanlara ise DGSF üzerinden bedel yansıtılır.
- ✓ Negatif dengesizlik ile pozitif dengesizlik miktarları arasındaki fark sistemden giderilmiş olur ve STP'den bu gaz temin edilir. Temin edilen gazın bedeli ilgili gün için sistem pozitif ise GRF ile çarpılır, negatif ise İDAF ile çarpılarak hesaplanır.
- ✓ Bu işlemlerden doğan BAST olarak taşıtanlara yansıtılır.

Dengesizliklerin Uzlaştırılması Sonucu Oluşan Bakiyenin Sıfırlanması (BAST)

BAST

Aylık oluşan BAST'ın %50'si giriş/çıkışları oranında PUE'de belirtilen formül uyarınca Sistem Kullanıcılarına dağıtılır.

Aylık oluşan BAST'ın %40'ı giriş/çıkışları oranında PUE'de belirtilen formül uyarınca Piyasa Kullanıcılarına dağıtılır.

Aylık oluşan BAST'ın %10'u İletim Şirketine dağıtılır.

*BAST'ın negatif olması durumunda tüm Taşıtanlar için;

$$= \frac{\sum \text{S}}{\sum \text{S}} \times (\quad , 0,2) + \frac{\sum \text{Ş}}{\sum \text{Ş}} \times (\quad , 0,8)$$

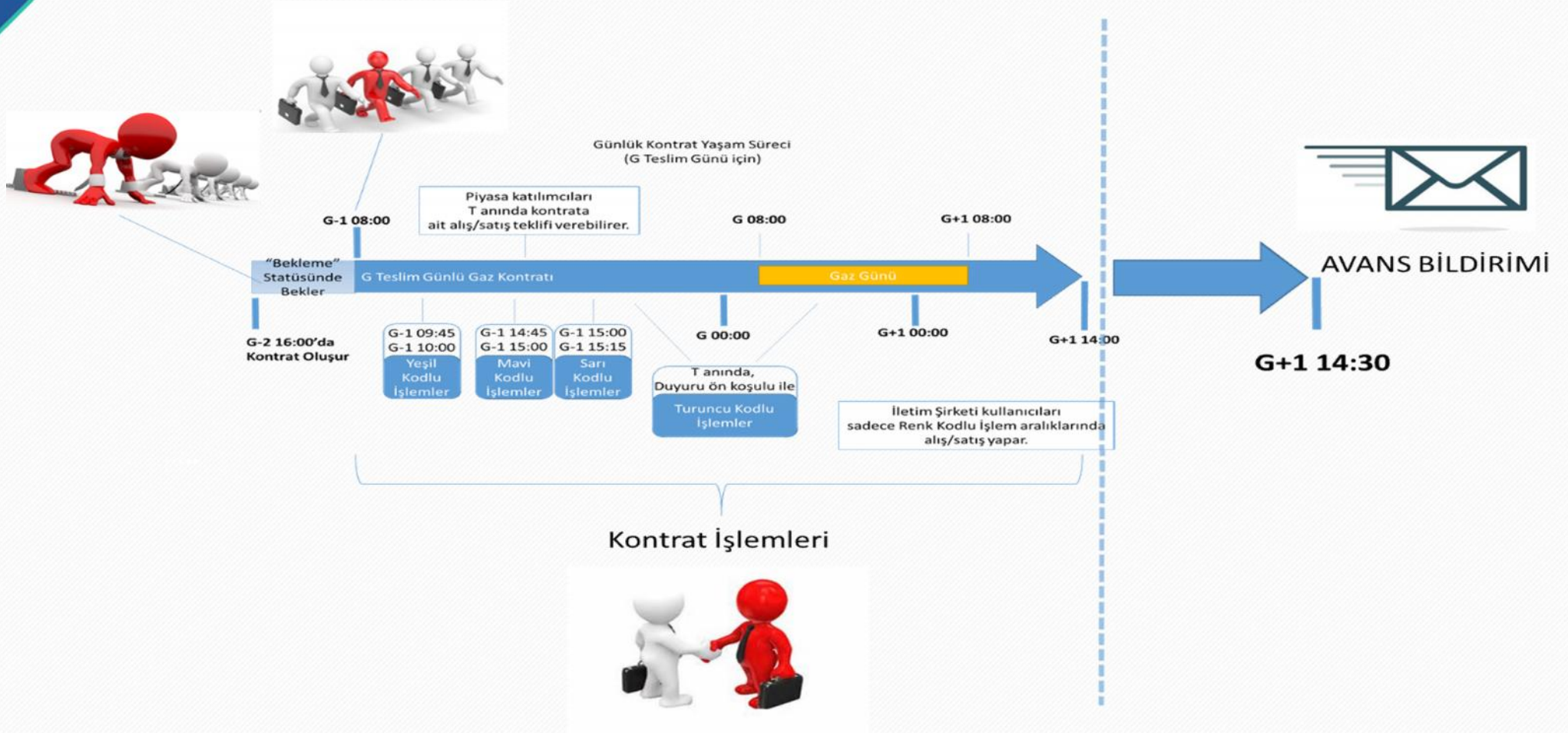
**Sistem Kullanıcısı için;

$$= \frac{\sum \text{S}}{\sum \text{S}} \times (\quad , 0,1) + \frac{\sum \text{Ş}}{\sum \text{Ş}} \times (\quad , 0,4)$$

***Piyasa Katılımcısı için;

$$= \left(\frac{ \left(\frac{\sum \text{S}}{\sum \text{S}} \right) \cdot \left(\frac{\sum \text{Ş}}{\sum \text{Ş}} \right) }{ \left(\frac{\sum \text{S}}{\sum \text{S}} \right) \cdot \left(\frac{\sum \text{Ş}}{\sum \text{Ş}} \right) } \right) \times (\quad , 0,4)$$

Avans



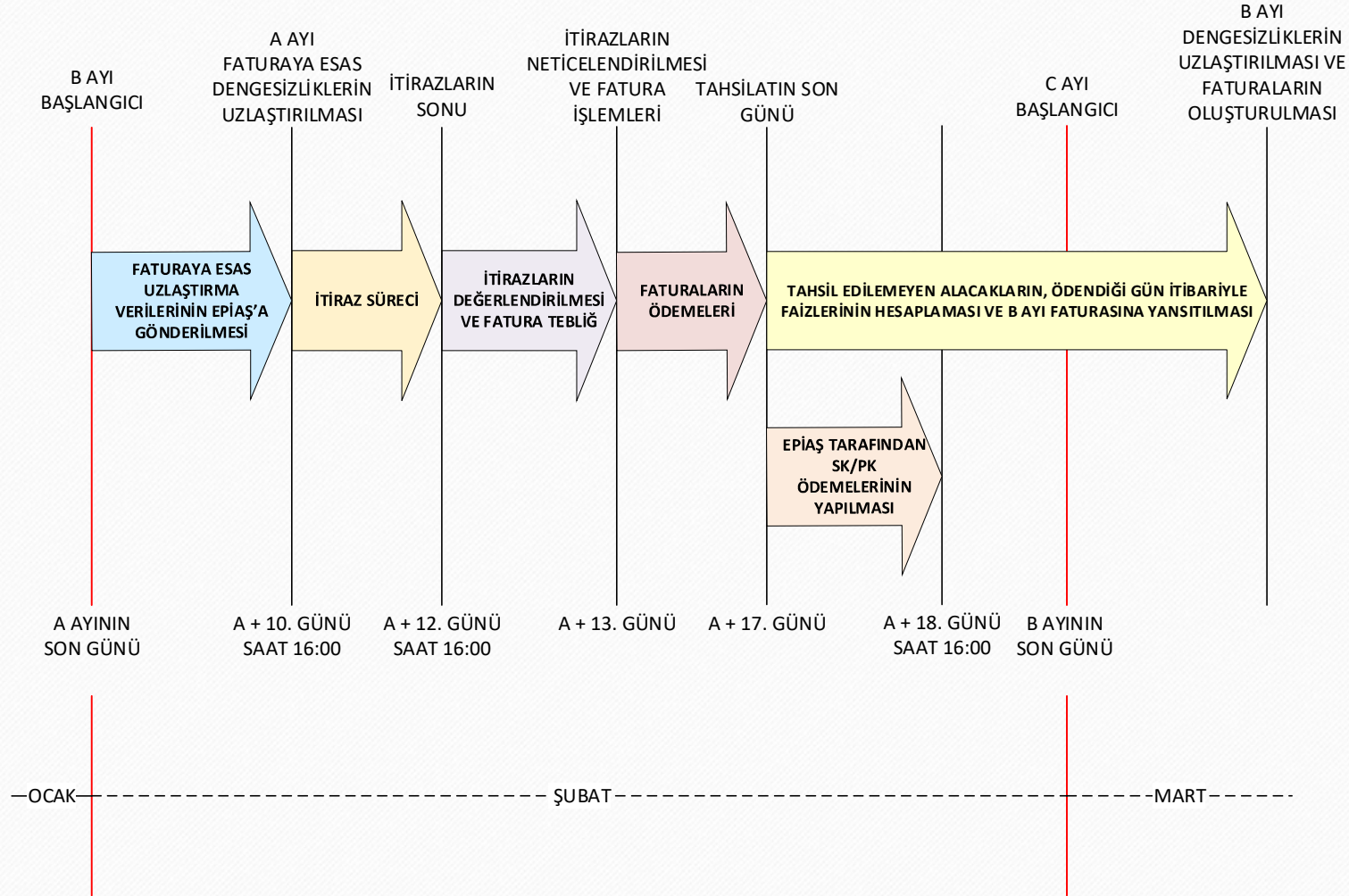
Avans

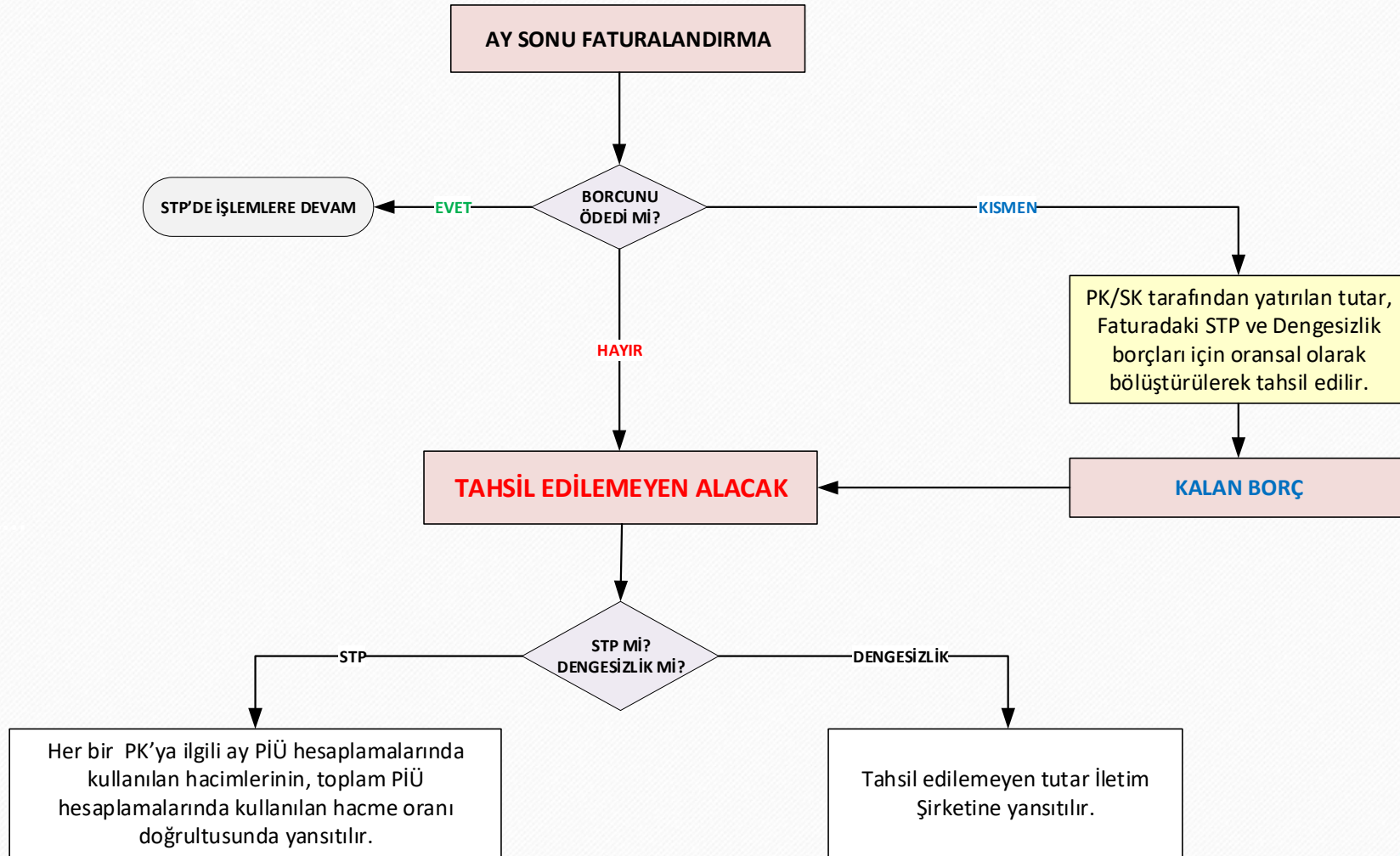
- ✓ STP'de her bir kontrat için yapılan işlemlere ilişkin uzlaştırma hesaplamaları sonucunda EPIAŞ'a yapılacak ya da EPIAŞ tarafından yapılacak ödemeler belirlenir.
- ✓ Bu tutarlar günlük «Avans Tutarları»dır, bu ödemelere ilişkin yapılan bildirimlere ise «Günlük Avans Ödeme Bildirimi» adı verilir.
- ✓ Günlük avans ödeme bildirimleri; G+1 gününde en geç saat 15:00'de STP üzerinden yayınlanır.
- ✓ Avans ödeme bildirimlerine ilişkin ödemeler, borçlu olan Piyasa Katılımcıları tarafından G+2 en geç saat 15:00'de,
- ✓ Piyasa İşletmecisi tarafından, alacaklı Piyasa Katılımcılarına ise saat 17:00 de yapılır.



Fatura, Ödeme ve Tahsilat Süreçleri

42





Teminatlar



TEMİNAT OLARAK KABUL EDİLECEK KIYMETLER*

-  Türk lirası,
-  Döviz (ABD doları veya AVRO),
-  Bankacılık mevzuatlarına tabi yerli veya yabancı bankaların düzenleyecekleri, TL veya döviz cinsinden (ABD doları veya AVRO) kesin ve süresiz teminat mektupları,
-  Hazine Müsteşarlığınca ihraç edilen Devlet İç Borçlanma Senetleri,

* Nakit teminatların yönetimi TAKASBANK'ta, teminat mektuplarının yönetimi ise EPIAŞ'ta olacaktır.

**Teminatlara ilişkin detaylı bilgi PUE'de mevcuttur.

Günlük İşlem Teminatı

- ✓ STP'de alış işlemi yapılabilmesi için yatırılması zorunludur.
- ✓ STP'de yapmak istediği işlem miktarı kadar yatırılır.
- ✓ Piyasada yapılacak alış yönlü ticari işlemler için kullanılır.
- ✓ Tamamı nakit olarak alınır.

İşlem Limiti

- ✓ Her bir kontrat için ayrı ayrı hesaplanır.
- ✓ Kontratlardaki satış işlemi gerçekleştiğinde artırılır.
- ✓ Kontratlarda alış teklifi verilmesi ile beraber günlük işlem teminatına bloke konması ile beraber işlem limiti azaltılır.

Fatura İşlem Teminatı (FİT)

- ✓ Her bir piyasa katılımcısının her bir fatura dönemi içerisinde her bir avans borç bildirimi sonrası oluşacak KDV riskine dair avans borcunun %18'i kadar fatura işlem teminatı alır.
- ✓ Piyasa katılımcısının ilgili fatura dönemi içerisinde avans alacaklısı olması durumunda, fatura işlem teminatı yükümlülüğü avans alacağının %18 (yüzde onsekiz)'i kadar azaltılır.

Günlük İşlem Limiti Senaryosu

15.Haz			16.Haz			17.Haz		
GEP 14/06	GİP 15/06	GÖP 16/06	GEP 15/06	GİP 16/06 -20	GÖP 17/06	GEP 16/06	GİP 17/06	GÖP 18/06
Toplam Teminat	Bloke Edilen Teminat	Çekilebilir Teminat	Net Mali Durum			İşlem Limiti		
100	-20	80	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı
			0	-20	0	80	80	80



15.Haz			16.Haz			17.Haz		
GEP 14/06	GİP 15/06	GÖP 16/06	GEP 15/06	GİP 16/06 -20	GÖP 17/06 30	GEP 16/06	GİP 17/06	GÖP 18/06
Toplam Teminat	Bloke Edilen Teminat	Çekilebilir Teminat	Net Mali Durum			İşlem Limiti		
100	-20	80	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı
			0	-20	30	80	80	110



15.Haz			16.Haz			17.Haz		
GEP 14/06	GİP 15/06	GÖP 16/06	GEP 15/06 -40	GİP 16/06 -20	GÖP 17/06 30	GEP 16/06	GİP 17/06	GÖP 18/06
Toplam Teminat	Bloke Edilen Teminat	Çekilebilir Teminat	Net Mali Durum			İşlem Limiti		
100	-60	40	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı	15/06 Kontratı	16/06 Kontratı	17/06 Kontratı
			-40	-20	30	40	40	70

1. İlk işlem 16 tarihinde 16 haziran kontratında 20 TL'lik alış işlemi. Bu kontrat için güncel net mali durum -20 TL. işlem limiti ise tüm kontratlar için 20 TL düşürülmüştür.
2. İkinci işlem 16 haziran günü 17 haziran kontratında 30 TL'lik satış işlemi. 17'nin net mali durumu +30 TL. bu pozitif net mali durum yalnızca 17 Haziran kontratının işlem limitini artırıyor.
3. Üçüncü işlem 16 Haziranda 15 Haziran kontratında 40 TL'lik alış işlemi. Net mali durum -40 TL. Negatif net mali durum tüm işlem limitlerini 40 TL düşürüyor.

Dengesizlik Teminatı Hesaplaması

- ✓ Tahsisatların günlük olarak EPIAŞ'a iletilmesi ile beraber her bir taşıtanın teminatı ve dengesizliklerinden dolayı oluşturduğu risk günlük olarak takip edilebilecek ve teminat hesabı günlük olarak güncellenecektir.
- ✓ EPIAŞ'a ulaşan ilk tahsisat miktarı ile ay sonunda sayaç okumalarına müteakip ulaşan son tahsisat verisi arasında fark oluşması durumunda; oluşan fark %5'in üzerindeyse bu oran, oranın hesaplandığı ilgili ay içindeki dengesizlik teminatı hesaplamalarında risk katsayısı çarpanı olarak kullanılacaktır.

DT

Dengesizlik Teminatı: Piyasa katılımcılarının dengesizliklerinin uzlaştırılması sonucu oluşabilecek mali risklerine binaen oluşabilecek risklerine karşılık alınan teminattır.

$$DT = \left(\left(\frac{ODM}{1000000} \right) \times DGA_{maks} \right) + \left(\left(\frac{DGA_{maks}}{1000000} \right) \times m \times r \right) + NDB$$

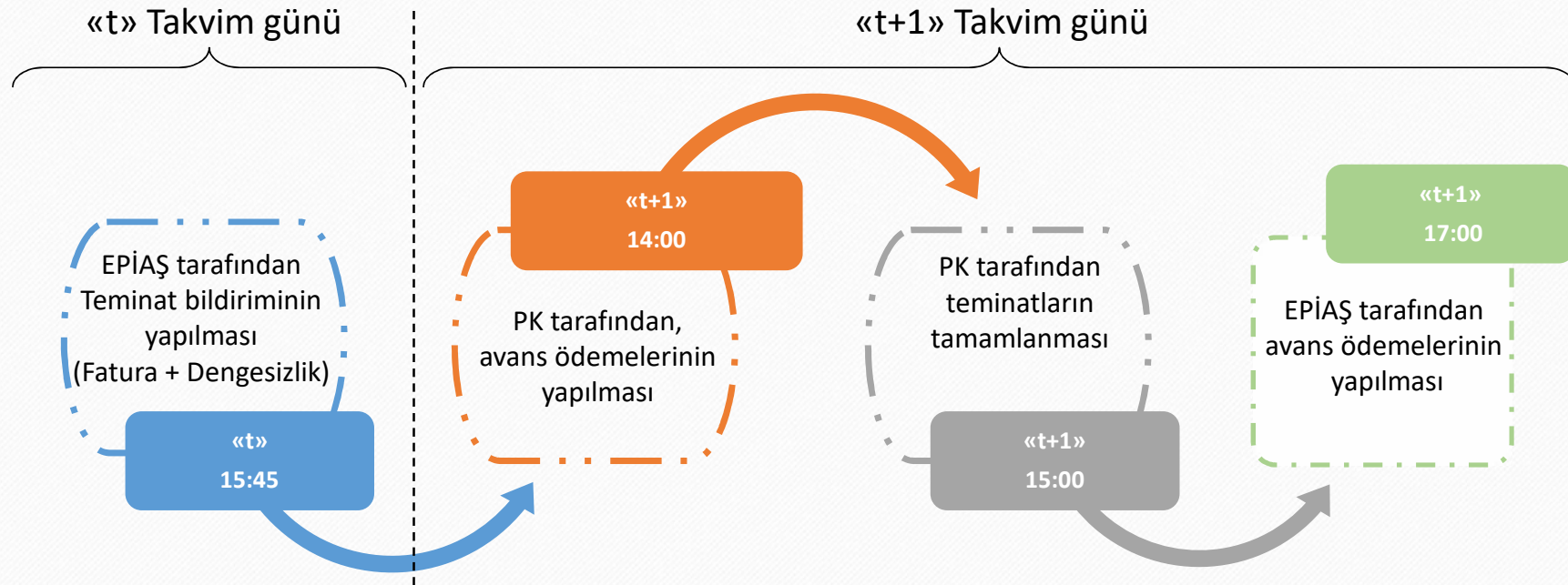
*ODM: Geçmiş 10(on) gün içerisindeki en yüksek Negatif Dengesizlik Miktarını,

*DGA_{max}: Geçmiş 10(on) gün içerisindeki en yüksek DGA'ı,

*m: En az 3(üç) olmak kaydıyla resmi tatil gün sayısının 1(bir) fazlasını,

*r: Sayaç okumaları sonrasında; ilk tahsisat ile sayaç okumaları arasındaki fark %5'ten fazla ise formülde geçen «r» katsayısı oluşur ve aradaki fark kadar olmak üzere dengesizlik teminatı ile çarpılır.

*NDB: Net Dengesizlik Bakiyesini ifade eder.



Saat 15:00'da teminat bildirimine uymadığı anlaşılan piyasa katılımcısının:

- STP işlemi yapmasına ve UDN Satış işlemi yapılmasına izin verilmez.
- Alacaklı olması halinde EPIAŞ tarafından avans ödemesi yapılmaz.

1

EPIAŞ'tan Alacakları varsa teminatı alacaklarından karşılanır

2

STP'de işlem yapamaz, mevcut teklifleri silinir, yeni teklif girmesine izin verilmez

3

İletim şirketi bilgilendirilir, UDN çıkışları silinir, ikili anlaşma yaptığı diğer taşıtana bilgi verilir, fiziki çıkış yaptığı müşterileri başka taşıtanlara devredilir.





- 1.Çalışmaların tamamlanması
- 2.Katılımcılara duyurulması – 30 gün
- 3.Kayıt sürecinin işletilmesi

Teşekkürler...

dogalgaz@epias.com.tr