

Genel Mektup : 1462

İstanbul, 28/09/2018

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BİAŞ SWAP Piyasası Vade Bazlı Başlangıç Marjini Oranları Hk.
İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

01.10.2018 tarihinde faaliyete geçecek olan Borsa İstanbul SWAP Piyasası'nda yürütülecek merkezi karşı taraf hizmeti çerçevesinde başlangıç teminatı hesaplamalarında kullanılacak marjin risk parametreleri piyasa koşulları dikkate alınarak belirlenmiş olup, ilgili değerler ekte yer almaktadır.

Konu ile ilgili sorularınızı mkt@takasbank.com.tr elektronik posta adresine iletebilirsiniz.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

GÖKHAN ELİBOL
GENEL MÜDÜR YRD.

Ek :Swap Piyasası Vade Bazlı Marjin Oranları (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE8R34TAU>

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +09 212 315 25 25 F +90 212 315 25 26 www.takasbank.com.tr Kep Adresi : takasbank.haberlesme@hs03.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



BİAŞ SWAP PİYASASI VADE BAZLI MARJİN ORANLARI

Vade Başlangıcı	Vade Sonu	Başlangıç Marjin Oranı (%)
1	7	3.72
8	14	4.11
15	29	4.72
30	59	5.97
60	89	7.64
90	119	9.31
120	149	10.97
150	>	12.64