

Genel Mektup : 1464

İstanbul, 01/10/2018

TEMİNAT İZLEME ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu Borsa İstanbul Swap Piyasası'nda risk ve teminat yönetimi süreçlerinde uygulanacak teminat değerlendirme katsayıları hk.

İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul Swap Piyasası Takas ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü'nün "Teminat ve garanti fonu katkı payı olarak kabul edilebilecek varlıklar" başlıklı 29 uncu maddesinde, üyeler tarafından teminat ve garanti fonu katkı payı yükümlülüklerinin yerine getirilmesi amacıyla kullanılabilecekleri varlıklar listelenmiştir.

Prosedür'ün "Değerleme katsayıları" başlıklı 31 inci maddesinde ise değerlendirme katsayılarının genel mektup vasıtasıyla duyurulacağı ve söz konusu katsayıların piyasa şartları paralelinde üç ayda bir revize edileceği düzenlenmiştir.

Piyasa'da teminat ve garanti fonu katkı payı yükümlülüklerinin yerine getirilmesine yönelik değerlendirme katsayılarını aşağıda yer alan tabloda belirlenmiştir:

Teminat Çeşidi	Değerleme Katsayısı
Türk Lirası	%100
Konvertibl Döviz(USD/EUR)	%94
DİBS	%91
T.C. Hazine Varlık Kiralama A.Ş. Tarafından İhraç Edilen Kira Sertifikaları	%88

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

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE6P34JJ4>

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

