

Genel Mektup : 1466

İstanbul, 05/10/2018

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu MKT olunan piyasalarda teminat değerlendirme katsayılarının güncellenmesi hk.
İlgili Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere, Merkezi Karşı Taraf Yönetmeliği'nin "Model güvenliği ve geriye yönelik testler" başlıklı 45 inci maddesi çerçevesinde Takasbank, kullanmakta olduğu risk modelleri ile teminata konu varlık sınıflarına yönelik belirlemiş olduğu değerlendirme katsayılarını periyodik olarak geriye yönelik testler ile sınamaktadır. İlgili test sonuçlarına bağlı olarak ise gerekli gördüğü durumlarda söz konusu modellere ilişkin parametreler ile değerlendirme katsayılarını güncellemektedir.

Bu kapsamda son dönemde yapılan analizlerde, Amerikan Doları, Avrupa Para Birimi ve altın finansal varlıklara ilişkin değerlendirme katsayılarının güncellenmesi gereği ortaya çıkmış olup uygulanacak olan yeni katsayılar ekteki tabloda yer almaktadır.

10.10.2018 tarihinden itibaren geçerli olacak değişiklik doğrultusunda merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz ödünç pay, vadeli işlemler ve opsiyon, pay, borçlanma araçları ile SWAP piyasaları prosedürlerinde gerekli revizyonlar yapılmıştır.

Prosedürlerin son hallerine bankamız internet sitesinden (www.takasbank.com.tr, Mevzuat/Prosedürler) erişilebilmektedir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.
Saygılarımızla

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :Teminat Değerleme Katsayı Tablosu (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEAC3B5SL>

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



TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYI TABLOSU

TEMİNAT DEĞERLEME KATSAYISI	AMERİKAN DOLARI	AVRUPA PARA BİRİMİ	ALTIN
Mevcut Değer	94%	94%	86%
Güncellenmiş Değer	92%	93%	83%