

Genel Mektup : 1480

İstanbul, 26/10/2018

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu Borçlanma Araçları Piyasası'nda işlem anı risk yönetimi uygulama esasları ve prosedür değişikliği hk.
İlgili Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere 08/10/2018 tarihli ve 1468 sayılı genel mektup ile Borçlanma Araçları Piyasası'nda işlem anı risk yönetimi sisteminin devreye alınması hususu üyelerimize duyurulmuş ve iş kurallarına ilişkin detayların üyelerimizle daha sonra paylaşılacağı ifade edilmiştir.

İşlem anı risk yönetimi, emrin işleme dönüştüğü anda yapılan teminat kontrolü sürecidir. Bu kapsamda, BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası'nda işlem anı risk yönetimi sistemine geçilmesiyle birlikte teminat eksikliği olan hesaplar üzerinden pozisyon artırıcı emir iletimine izin verilmeyecek, yalnızca pozisyon azaltıcı emir iletimi sistem tarafından kabul edilecektir. İşlem anı risk yönetimi uygulaması (PTRM) ve emir kabulüne ilişkin uygulama esasları, Borçlanma Araçları Piyasası İşleyiş Uygulama Usul ve Esasları dokümanının Ek-5'inde yer alan "İşlem Öncesi Risk Yönetimi Uygulaması" bölümünde yer almaktadır.

İşlem anı risk yönetimi uygulamasının devreye alınması ile birlikte, üyelerimizin yeni sisteme alışma süreci de göz önünde bulundurularak belirli bir gün içi sürdürme seviyesi uygulanacaktır. Sürdürme seviyesi, hesaplara ilişkin toplam marjin gereksiniminin "1" den küçük bir katsayı ile ölçeklendirilerek risk teminat dengesinde bu ölçeklendirilmiş tutarın işlem anı risk yönetiminde dikkate alınmasını ifade etmektedir. Uygulamaya geçişle birlikte bir sonraki duyuruya kadar geçerli olacak sürdürme seviyesi %90 olarak belirlenmiştir. Sürdürme seviyesi katsayısı ile ölçeklendirilmiş risk teminat dengesi PTRM ekranı üzerinden takip edilecektir.

Sürdürme seviyesi sadece gün içinde geçerli olup **gün sonlarında geçerli olmayacaktır**. Gün sonlarında sürdürme seviyesiz risk tutarı değerlendirilmiş teminat tutarından fazla olan hesaplar için teminat tamamlama çağrısı yapılmaya devam edilecektir.

Bu çerçevede, BAP Takas Ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü revize edilmiş olup, Prosedür'ün son haline Bankamız internet sitesinden (www.takasbank.com.tr/Mevzuat/Prosedürler/) BİAŞ Borçlanma Araçları Piyasası Takas ve MKT Hizmeti Esasları Prosedürü) erişilebilecektir.

Konuya ilişkin detaylı açıklamalar daha sonra tarihi duyurulacak olan üye bilgilendirme toplantısında paylaşılacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.
Saygılarımızla

TAKASBANK

İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜRMAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE6L3560U>

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

