

Genel Mektup : 1490

İstanbul, 30/11/2018

TEMİNAT ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BİAŞ SWAP Piyasası risk katsayısı farklılaştırılması hk.
İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul A.Ş. SWAP Piyasası'nda risk yönetimi süreçlerinin etkinliğinin artırılmasına yönelik çalışmalar kapsamında, teminatlandırma sürecinde değişikliğe gidilmiştir.

Bu değişiklik kapsamında, işlem teminatları vade kırılımına ek olarak işlem tarafı bazında da farklılaştırılacaktır. Buna göre, yeni sistemde piyasaya TL arz eden taraf (YP alan) için yalnızca kur riski primi dikkate alınarak işlem teminatı hesaplaması yapılacaktır. Buna karşın piyasadaki TL temin eden taraftan işlem teminatlarında kur riski primi yanında faiz riski primi tahsil edilmeye devam edilecektir.

Bahse konu değişiklikler doğrultusunda BİAŞ Swap Piyasası Takas ve MKT Hizmeti Esasları Prosedürü ile ilgili risk parametreleri revize edilmiştir. 03/12/2018 Pazartesi sabahı itibarıyla geçerli olacak risk parametrelerine ilişkin tablo aşağıda yer almakta olup, Prosedür'ün son haline ise Bankamız internet sitesinden (<https://www.takasbank.com.tr/tr/mevzuat/prosedurler>) ulaşılabilecektir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :SWAP Piyasası risk katsayısı tablosu (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEA93KPVN>

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



Ek 1: Bařlangıç Teminatı Risk Katsayıları

Başlangıç Teminatı Risk Katsayıları			
Gün		TL Alan	YP Alan
1	7	3.61%	3.50%
8	14	3.81%	3.50%
15	29	4.11%	3.50%
30	59	4.74%	3.50%
60	89	5.57%	3.50%
90	119	6.40%	3.50%
120	149	7.24%	3.50%
150	181	8.07%	3.50%