

Genel Mektup : 1503

İstanbul, 28/12/2018

**MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ**

Konu Swap Piyasası Takas Ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü'nün güncellenmesi hk.  
İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

İstanbul Takas Ve Saklama Bankası A.Ş. Borsa İstanbul Swap Piyasası Takas Ve Merkezi Karşı Taraf Hizmeti Esasları Prosedürü'nün "Değişim teminatı ve fonlama maliyeti hesaplaması" başlıklı 27 nci maddesinin dördüncü fıkrası ile "Garanti fonunun büyüklüğü ve üyelerce yapılacak katkı payı miktarı" başlıklı 39 uncu maddesinin birinci fıkrası güncellenmiştir.

Bu çerçevede garanti fonunu hesaplamaya konu güven düzeyi % 99,90 'dan % 99,75'e indirilmiştir. Ayrıca değişim teminatı finansman maliyetine esas faiz oranı olarak kullanılan Bankalararası Repo - Ters repo Pazarı'nda oluşan gecelik ağırlıklı ortalama faiz oranı yerine Repo-Ters Repo Pazarı'ndaki Normal Emirler Pazarı'nda oluşan gecelik ağırlıklı ortalama faiz oranı kullanılacaktır.

Prosedür'ün son haline web sitemizde 'Mevzuat' başlığı altındaki 'Prosedürler' bölümünden 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

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEAC3L93R>

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@hs01.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015

