

Genel Mektup 1563

İstanbul, 14/06/2019

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BİAŞ SWAP Piyasası Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.
İlgili Bankalar

Sayın Genel Müdür,

12.06.2019 tarih ve 1559 numaralı genel mektupla duyurulan Borsa İstanbul Swap Piyasası işlem teminatı hesaplamalarında yapılan geliştirme doğrultusunda, başlangıç teminatı değerlerinde değişiklik yapılma ihtiyacı ortaya çıkmıştır.

Bu kapsamda güncellenmiş olan risk parametreleri ektedir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

BEYHAN ARASAN
DİREKTÖR

NİYAZİ BURAK AKAN
DİREKTÖR

Ek : Risk Parametre Tablosu (1 sayfa)



BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU
(TABLE OF RISK PARAMETERS)

TL-Başlangıç Marjin Oranı (%) (TRY-Initial Margin Ratio)(%) Valörde TRY Alan (TRY Buyer at Value Date)	USD-Başlangıç Marjin Oranı (%) (USD-Initial Margin Ratio)(%) Valörde USD Alan (USD Buyer at Value Date)	EUR-Başlangıç Marjin Oranı (%) (EUR-Initial Margin Ratio)(%) Valörde EUR Alan (EUR Buyer at Value Date)
3.30	4.30	4.35