

Genel Mektup 1572

İstanbul, 30/07/2019

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu TLREF Risk Parametreleri Hk.
İlgili Bankalar ve Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

BİAŞ Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda 2 Ağustos 2019 tarihinde işleme açılacak olan TL referans faiz oranına dayalı vadeli işlem sözleşmelerine ait BISTECH marjın yöntemi risk parametreleri aşağıda verilmektedir.

TLREF Kontratları	Fiyat Değişim Aralığı (PSR)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski
Vade Ayı Kontratı	275 TL	260 TL
Diğer Vadelere İlişkin Kontratlar	260 TL	260 TL

Vade ayına giren kontratlar için açıklanan PSR değeri vade dönemi sonuna kadar her gün %2 oranında azalmakta olup bu azalışlar sonucunda PSR parametresinin inebileceği minimum tutar açıklanan parametrenin %50'sidir.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 2 Ağustos 2019 tarihinden itibaren Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.
Saygılarımızla

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
DİREKTÖR

GÖKHAN ELİBOL
GENEL MÜDÜR VEKİLİ
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEKA3EUTN>

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

