

Genel Mektup : 1737

İstanbul, 24/11/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz SWAP Piyasası'nda işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

26.11.2021 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK  
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN  
Direktör

Murat GÖRGÜN  
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :BISTECH Risk Parametreleri 26112021 (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSFBB5YBSC> Pin Kodu :

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



EK: BİAŞ SWAP Piyasası Vade Bazlı Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

<b>BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU</b>		
<b>(TABLE OF RISK PARAMETERS)</b>		
<b>Sözleşmeler (Contracts)</b>	<b>Alış Marjin Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%)</b>	<b>Satış Başlangıç Marjin Oranı (%) (Sell Side Initial Margin Ratio)(%)</b>
<b>XAUTRY</b>	<b>7.20%</b>	<b>4.40%</b>
<b>USDTRY</b>	<b>5.90%</b>	<b>3.40%</b>
<b>EURTRY</b>	<b>6.00%</b>	<b>3.50%</b>