

Genel Mektup : 1744

İstanbul, 17/12/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda BIMAS, CNHTRY, EREGL, EURTRY, KCHOL, RUBTRY, SISE, TCELL, TKFEN, USDTRY, X10XB, XU030 dayanak varlıkları için işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

21.12.2021 Salı günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 21.12.2021 tarihinde gün içi ilk risk hesaplama anı sonrasında üye ekranlarından izlenebilecek olup, üyelerimizce teminat yükümlülüklerine ilişkin gerekli kontrollerin yapılması gerekmektedir.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 21.12.2021 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

21.12.2021 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 20.12.2021 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 21.12.2021 Salı günü akşamı hesaplanacak teminat tamamlama çağrısı yükümlülükleri ise yeni parametrelere göre olacaktır.

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 21.12.2021 (2 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSCB5UF6NP> 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-1: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS FOR DERIVATIVES MARKET)	
1)Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
BIMAS	940
CNHTRY	2730
EREGL	365
EURTRY	1980
KCHOL	415
RUBTRY	2405
SISE	195
TCELL	255
TKFEN	305
USDTRY	1750
USDTRYK	1750
X10XB	3355
XU030	2700
2)Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
BIMAS	940
CNHTRY	2730
EREGL	365
EURTRY	1980
KCHOL	415
RUBTRY	2405
SISE	195
TCELL	255

TKFEN	305
USDTRY	1750
USDTRYK	1750
X10XB	3355
XU030	2700
3)Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (TL) (Physical Delivery Margin)
USDTRY	1750
USDTRYK	1750