

Genel Mektup : 1652

İstanbul, 27/10/2020

**MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ**

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.  
İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz piyasalarda yürütmekte olduğumuz hizmet çerçevesinde USDTRY, CNHTRY, EURTRY ve RUBTRY dayanak varlıkları için işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

30.10.2020 tarihinde, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir. Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 30.10.2020 tarihinde gün içi ilk risk hesaplama işlemleri sonrasında üye ekranlarından izlenebilecek olup, üyelerimizce teminat yükümlülüklerine ilişkin gerekli kontrollerin yapılması gerekmektedir.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 30.10.2020 tarihi gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

30.10.2020 tarihinde anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 28.10.2020 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 30.10.2020 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.**

**Serkan AŞKAR**  
**GENEL MÜDÜR YRD.**

**Gökhan ELİBOL**  
**GENEL MÜDÜR VEKİLİ**  
**YÖNETİM KURULU ÜYESİ**

Ek :BISTECH Risk Parametreleri (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BE6P45E9H> 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

<b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI)</b> <b>(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS FOR DERIVATIVES MARKET)</b>	
<b>Fiyat Değişim Aralığı</b> <b>(Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (USD)</b> <b>(Price Scan Range - PSR)</b>
USDTRY	825
CNHTRY	1315
EURTRY	1030
RUBTRY	1230
<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski</b> <b>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (USD)</b> <b>(Price Scan Range - PSR)</b>
USDTRY	825
CNHTRY	1315
EURTRY	1030
RUBTRY	1230