

Genel Mektup : 1660

İstanbul, 13/11/2020

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : VIOP ve SWAP Piyasalarında Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.
İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda yürütmekte olduğumuz merkezi karşı taraf hizmeti çerçevesinde CCOLA, CNHTRY, EREGL, EURTRY, ISCTR, KCHOL, RUBTRY, SAHOL, USDTRY, X10XB, XU030 ve YKBNK dayanak varlıkları için işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

18.11.2020 tarihinde, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine Ek 1'de yer verilmektedir. Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 18.11.2020 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 18.11.2020 tarihi gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır. 18.11.2020 tarihinde anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 17.11.2020 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 18.11.2020 günü akşamı hesaplanacak teminat tamamlama çağrısı yükümlülükleri ise yeni parametrelere göre olacaktır.

Bununla birlikte, bir diğer merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz BİAŞ Swap Piyasası'nda, 16.11.2020 Pazartesi günü itibarıyla işleme açılacak olan XAUEUR, XAUTRY ve XAUUSD swap sözleşmeleri ile güncellenen EURTRY ve USDTRY sözleşmelerinin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri Ek 2'de yer almaktadır. Belirlenen parametreler 16.11.2020 Pazartesi günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacaktır.

Bilgi edinilmesi ve gereğini rica ederiz.
Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN
DİREKTÖR

Serkan AŞKAR
GENEL MÜDÜR YRD.

Ek :

- 1- EK-1 Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu (2 sayfa)
- 2- EK-2 BİAŞ SWAP Piyasası Risk Parametre Tablosu (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BENN4K7BP> 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)	
Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
COLA	560
CNTRY	1,275
ERGL	120
EURTRY	1,000
ISCTR	70
KCHOL	185
RUBTRY	1,190
SAHOL	105
USDTRY	800
X10XB	1,565
XU030	1,430
YKBNK	30
Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
COLA	560
CNTRY	1,275
ERGL	120
EURTRY	1,000
ISCTR	70
KCHOL	185

RUBTRY	1,190
SAHOL	105
USDTRY	800
X10XB	1,565
XU030	1,430
YKBNK	30

EK-2: BİAŞ SWAP Piyasası Risk Parametre Tablosu

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

Sözleşmeler (Contracts)	Alış Başlangıç Marjin Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%)	Satış Başlangıç Marjin Oranı (%) (Sell Side Initial Margin Ratio)(%)
XAUUSD	3.50%	3.80%
XAUEUR	3.80%	3.60%
XAUTRY	4.80%	4.50%
USDTRY	3.30%	2.90%
EURTRY	3.50%	3.10%

Sözleşmeler Arası Risk Analizi (Spread Credit)	
SWAP Sözleşmeleri	
Sözleşmeler (Contracts)	Kredi Oranları (%) (Spread Credit)
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre dir (Priority is applied as follows)</i>	
XAUUSD - XAUEUR	50
XAUUSD - XAUTRY	50
XAUEUR - XAUTRY	50
USDTRY - EURTRY	50