

Genel Mektup : 1686

İstanbul, 22/03/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

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

Sayın Genel Müdür,

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

22.03.2021 Pazartesi günü, saat 09:00 risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 22.03.2021 tarihinde saat 09:00 risk hesaplama anı sonrasında üye ekranlarından izlenebilecek olup, üyelerimizce teminat yükümlülüklerine ilişkin gerekli kontrollerin yapılması gerekmektedir.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 22.03.2021 saat 09:00 risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

22 Mart 2021 Pazartesi günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 19.03.2021 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 22.03.2021 Pazartesi 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

Serkan AŞKAR
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :BISTECH Risk Parametreleri Döviz 22.03.21 (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEKA41SSS> 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 (TL) (Price Scan Range - PSR)
CNHTRY	1355
EURTRY	1065
RUBTRY	1270
USDTRY	850
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)
CNHTRY	1355
EURTRY	1065
RUBTRY	1270
USDTRY	850