

Genel Mektup :1597

İstanbul, 13/11/2019

**MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ**

Konu : VİOP'ta Yeni Açılacak Sözleşmelerin Risk Parametreleri Hk.  
İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf risk ve teminat yönetimi hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda, 15/11/2019 Cuma günü itibarıyla işleme açılacak yeni sözleşmelerin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri belirlenmiştir.

15 Kasım 2019 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametreleri ekte yer almaktadır.

Yeni sözleşmelere ilişkin parametreleri içeren risk parametre dosyası 15/11/2019 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

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 : VİOP'ta Açılacak Yeni Sözleşmelere İlişkin Risk Parametreleri Tablosu (2 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BELC31KND> 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 Yeni Açılacak Sözleşmeler BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

<b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>	
<b>1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)</b>
CCOLA	380
ENKAI	60
FROTO	760
MGROS	255
SASA	155
TRKCM	30
TSKB	10
ULKER	245
<b>2) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
CCOLA	380
ENKAI	60
FROTO	760
MGROS	255
SASA	155
TRKCM	30
TSKB	10
ULKER	245
<b>3) Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	

Kontratlar (Contracts)	Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)</i>	
XU030-MGROS	50
XU030-TSKB	50
XBANK-TSKB	50
<b>Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)</b>	
XU030-MGROS	6.33
XU030-TSKB	140.10
XBANK-TSKB	159.62