

Genel Mektup : 1773

İstanbul, 11/03/2022

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 CNHTRY, EURTRY, ISGYO ve USDTRY dayanak varlıkları için işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan güncellenmiş risk parametre hesaplama çalışmaları ile 15.03.2022 Salı günü itibarıyla işleme açılacak TRT200923T18, TRT020926T17 ve TRT131130T14 dayanak varlıklarına bağlı vadeli işlem sözleşmelerinin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak olan risk parametre hesaplama çalışmaları tamamlanmıştır.

15.03.2022 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 15.03.2022 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 15.03.2022 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

15.03.2022 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.03.2022 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 15.03.2022 Salı günü akşamı hesaplanacak teminat tamamlama çağrısı yükümlülükleri ise yeni parametrelere göre olacaktır.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk_Parametreleri (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BS5BAVPJ0C> 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



Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)	
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)
CNHTRY	2425
EURTRY	1705
ISGYO	100
USDTRY	1550
TRT200923T18	1495
TRT020926T17	3615
TRT131130T14	4055
2) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri (Futures)	
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)
CNHTRY	2425
EURTRY	1705
ISGYO	100
USDTRY	1550
TRT200923T18	1495
TRT020926T17	3615
TRT131130T14	4055
3) Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri (Futures)	
Kontratlar (Contracts)	Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)
TRT020926T17-TRT200923T18	100
TRT131130T14-TRT200923T18	100
TRT131130T14-TRT020926T17	100
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
TRT020926T17-TRT200923T18	2.42
TRT131130T14-TRT200923T18	2.71
TRT131130T14-TRT020926T17	1.12