

Genel Mektup : 1452

İstanbul, 14/08/2018

TEMİNAT İZLEME ve TEMERRÜT YÖNETİMİ EKİBİ

Konu BISTECH Marjin Yöntemi risk parametreleri güncellemesi hk.
İlgili Bankalar
Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda yürütmekte olduğumuz merkezi karşı taraf hizmeti çerçevesinde işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan BISTECH Marjin Yöntemi risk parametreleri önümüzdeki dönemde piyasaların kapalı olduğu günler dikkate alınarak güncellenmiştir.

Bu döneme hazırlık anlamında üyelerimizden de aktif risk yönetimi uygulamaları beklenmekte olup, 16 Ağustos 2018 Perşembe günü, gün sonunda yapılacak risk hesaplamalarında geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 16 Ağustos 2018 tarihinde gün sonu risk hesaplama işlemleri sırasında üye ekranlarından izlenebilecektir.

Yeni değerleri içeren risk parametre dosyası 16.08.2018 gün sonu işlemleri süreci sonrası Takasbank internet sitesinden duyurulacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

GÖKHAN ELİBOL
GENEL MÜDÜR YRD.

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :Risk Parametre Güncellemeleri (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/envision-external/belgedogrulama.aspx?V=BE8433AK9>

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.haberlesme@hs03.kep.tr

Ticaret Sicil No:276870 Mersis No:0481002693100015



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	910
EURTRY	740
RUBTRY	1740
USDTRY	670
USDTRYK	670
Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)
CNHTRY	910
EURTRY	740
RUBTRY	1740
USDTRY	670
USDTRYK	670
Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (Short Option Minimum Risk)	
Opsiyon Sözleşmeleri (Options)	
USDTRYK	110