

Genel Mektup:1242
Türev Araçlar Takas Ekibi

İstanbul, 14/10/2015

Konu: Gecelik Repo Oranı Vadeli İşlem Sözleşmeleri hk.

İlgili: Bankalar
Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

BİAŞ Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda 21 Ekim 2015 tarihinde işleme açılacak olan ve Borsa İstanbul Bankalararası Repo-Ters Repo Pazarı'nda gerçekleşen aynı gün valörlü gecelik miktar ağırlıklı ortalama basit faiz oranının bileşik ortalamasına dayanan aylık ve üç aylık (çeyreklik) Gecelik Repo Vadeli İşlem Sözleşmelerinin sözleşme büyüklüğü 1.000.000,-TL olup, SPAN risk parametreleri aşağıda verilmektedir.

Sözleşme Adı	Fiyat Değişim Aralığı (PSR)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski
ONRPM (aylık sözleşme)	250 TL	250 TL
ONRPO (3 aylık sözleşme)	445 TL	445 TL

Repo vadeli işlem sözleşmelerini de içeren 20 Ekim 2015 tarihli SPAN parametre dosyası aynı tarihli normal seans sonunda gerçekleştirilen günsonu işlemleri sürecinde Takasbank internet sitesine yüklenecektir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Sezai BEKGÖZ
Genel Müdür Yardımcısı

Murat ULUS
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi