

Genel Mektup : 1426

İstanbul,18/04/2018

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu Kıymetli Madenler Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi risk parametreleri hk.
İlgili Bankalar
Kıymetli Madenler Piyasası Üyesi Kuruluşlar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul Kıymetli Madenler Piyasası'nda (KMP) 07.05.2018 tarihli BISTECH geçişi ile başlanılacak risk yönetimi hizmeti çerçevesinde işlem teminatı hesaplamasında kullanılacak risk parametreleri, işlem öncesi risk yönetimi sisteminde kullanılacak ölçeklendirme parametresi ve gün sonu teminat tamamlama çağrılarına esas sürdürme seviyesine ilişkin katsayılar piyasa koşulları dikkate alınarak belirlenmiş olup, ilgili değerler EK 1'de yer almaktadır.

Geçiş öncesinde Üyelerimizin yapacakları işlemler dolayısıyla karşı karşıya kalacakları risk seviyelerini takas ekranlarından takip edebilmeleri ve gerekli hazırlıkları yapabilmelerini teminen risk parametreleri 19.04.2018 tarihinde BISTECH test ortamına tanımlanacaktır.

Konu ile ilgili sorularınızı mkt@takasbank.com.tr elektronik posta adresine iletebilirsiniz.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.
Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :Kıymetli Madenler Piyasası Risk Parametreleri (1 sayfa)



KIYMETLİ MADENLER PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU
(PMD TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)

Kıymetli Madenler (Precious Metals)	Vade Gününe Göre FDA ve Birim Teminat Değerleri (Price Scan Range-PSR & Unit Margin)			Alış/Satış Fark Teminatı (B/A Spread)	PTRM Birim Teminat Ölçeklendirme Katsayısı (Unit Margin Coefficient)	Günsonu Sürdürme Seviyesi Katsayısı (Maintenance Margin Coefficient)
	0-2	03-10	11 ve üzeri (11 and more)			
Altın (Gold)	2,50%	3,50%	8,00%	2,50%	200%	60%
Gümüş (Silver)	4,25%	6,00%	14,25%	3,50%		
Paladyum (Palladium)	5,75%	7,75%	19,25%	4,50%		
Platin (Platinum)	3,50%	5,50%	14,25%	3,50%		