

Genel Mektup : 1604

İstanbul, 19/12/2019

**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, 20/12/2019 Cuma günü itibarıyla işleme açılacak yeni sözleşmelerin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri belirlenmiştir.

20 Aralık 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 20/12/2019 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=BEL9325TK> 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)</b> <b>(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>	
<b>Fiyat Değişim Aralığı</b> <b>(Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (TL)</b> <b>(Price Scan Range - PSR)</b>
XLBNK	1,750
X10XB	1,110
<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski</b> <b>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL)</b> <b>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>
XLBNK	1,750
X10XB	1,110
<b>Ürün Grupları Arası Risk Analizi</b> <b>(Inter-Commodity Spread Credit)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%)</b> <b>(Inter-Commodity Spread Credit)</b>
<b>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre</b> <b>(Priority is applied as follows)</b>	
XBANK-XLBNK	70
XLBNK-GARAN	70
XLBNK-AKBNK	70
XLBNK-VAKBN	70
XLBNK-ISCTR	70
XLBNK-YKBNK	70
XLBNK-HALKB	60
XLBNK-TSKB	50
XLBNK-XU030	60
X10XB-TUPRS	60
X10XB-XUSIN	50
XLBNK-SAHOL	50
X10XB-XU030	50
XLBNK-XUSIN	50

XLBNK-KCHOL	50
XLBNK-EKGYO	50
XLBNK-THYAO	50
<b>Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)</b>	
XBANK-XLBNK	1.08
XLBNK-GARAN	13.84
XLBNK-AKBNK	17.85
XLBNK-VAKBN	27.69
XLBNK-ISCTR	21.95
XLBNK-HALKB	22.55
XLBNK-YKBNK	55.59
XLBNK-TSKB	144.09
XLBNK-XU030	1.05
X10XB-TUPRS	1.00
X10XB-XUSIN	1.10
XLBNK-SAHOL	14.90
X10XB-XU030	1.03
XLBNK-XUSIN	1.13
XLBNK-KCHOL	7.00
XLBNK-EKGYO	101.94
XLBNK-THYAO	10.86