

Genel Mektup : 1623

İstanbul, 07/04/2020

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : ASELS 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, 10/04/2020 Cuma günü itibarıyla işleme açılacak ASELS dayanak varlığına bağlı opsiyon sözleşmelerinin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri belirlenmiştir.

10 Nisan 2020 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametreleri ekte yer almaktadır.

Yeni sözleşmelere ilişkin parametreleri içeren risk parametre dosyası 10/04/2020 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 : BISTECH Risk Parametreleri Tablosu ASELS (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEL53VZ8K> 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 BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS FOR DERIVATIVES MARKET)	
Parametreler (Parameters)	ASELS Opsiyon Kontratları (ASELS Option Contract)
Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range-PSR)	440
Volatilite Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range-VSR)	43
Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)	440
Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (TL) (Short Option Minimum Risk)	35