

Genel Mektup : 1672

İstanbul, 12/01/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : VİOP'ta Yeni Açılacak Sözleşmenin 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, 15.01.2021 Cuma günü itibarıyla işleme açılacak XAGUSD dayanak varlığına bağlı vadeli işlem sözleşmesinin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri ekte yer almaktadır.

Belirlenen parametreler 15.01.2021 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacaktır.

Yeni sözleşmelere ilişkin parametreleri içeren risk parametre dosyası 15.01.2021 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

Bilgi edinilmesi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Niyazi Burak AKAN
DİREKTÖR

Serkan AŞKAR
GENEL MÜDÜR YRD.

Ek :parametre_tablosu_XAGUSD

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEL547HVH> 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)	
1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
XAGUSD	30
2) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
XAGUSD	30
3) Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)</i>	
XAUUSD-XAGUSD	60
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
XAUUSD-XAGUSD	7,64