

Genel Mektup : 1726

İstanbul, 13/09/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Platin ve Paladyum 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, 17.09.2021 Cuma günü itibarıyla işleme açılacak XPDUSD ve XPTUSD dayanak varlıklarına bağlı vadeli işlem sözleşmelerinin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri ekte yer almaktadır.

Belirlenen parametreler 17.09.2021 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacaktır.

Yeni sözleşmelere ilişkin parametreleri içeren risk parametre dosyası 17.09.2021 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
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk_Parametreleri_XPDUSD-XPTUSD (1 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSA492K18P> 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 Marjın 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)
XPDUSD	375
XPTUSD	95
2) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
XPDUSD	375
XPTUSD	95
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-XPTUSD	50
XPTUSD-XAGUSD	50
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
XAUUSD-XPTUSD	1.68
XPTUSD-XAGUSD	4.20