

Genel Mektup : 1499

İstanbul, 12/12/2018

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, 14/12/2018 Cuma günü itibariyle işleme açılacak yeni sözleşmelerin işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri belirlenmiştir.

14 Aralık 2018 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametreleri ekte yer almaktadır. Yeni sözleşmelere ilişkin parametreleri içeren risk parametre dosyası 14/12/2018 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.

NİYAZİ BURAK AKAN
MÜDÜR

MAHMUT KAYACIK
GENEL MÜDÜR VE
YÖNETİM KURULU ÜYESİ

Ek :VİOP'ta Açılacak Yeni Sözleşmelere İlişkin Risk Parametreleri Tablosu (4 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?V=BEL53L83Z>

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: ViOP'ta Açılacak Yeni Sözleşmelere İlişkin Risk Parametreleri Tablosu

14 Aralık 2018 (14 December 2018)	
YENİ DAYANAK VARLIKLARA BAĞLI VADELİ İŞLEM SÖZLEŞMELERİ RİSK PARAMETRELERİ (RISK PARAMETERS FOR FUTURES CONTRACTS OF NEW UNDERLYINGS)	
1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
ASELS	355
BIMAS	775
DOHOL	25
ENJSA	50
KOZAA	170
KOZAL	1,095
SODA	75
SOKM	100
TAVHL	330
TKFEN	265
XBANK	1370
XUSIN	855
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
GBPUSD	70

2) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı (Extreme Move Multiplier and Extreme Move Covered Fraction)	
1. Aşırı Hareket Senaryo Çarpanı (Extreme Move Multiplier)	3
2.Kapsama Oranı (%) (Extreme Move Covered Fraction)	32
3) 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 (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)
ASELS	355
BIMAS	775
DOHOL	25
ENJSA	50
KOZAA	170
KOZAL	1,095
SODA	75
SOKM	100
TAVHL	330
TKFEN	265
XBANK	1,370
XUSIN	855
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
GBPUSD	70
4)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)
XBANK-GARAN	70
XBANK-AKBNK	70
XBANK-ISCTR	70
XBANK-VAKBN	70
XBANK-HALKB	70
XBANK-YKBNK	70
BIST30-XBANK	70
XUSIN-BIST30	60
XBANK-SAHOL	50
XUSIN-XBANK	50
XUSIN-VAKBN	50
KOZAL-KOZAA	50
XUSIN-HALKB	50
XUSIN-EREGL	50
XUSIN-ISCTR	50
XUSIN-GARAN	50
XBANK-KCHOL	50
XUSIN-AKBNK	50
XBANK-EKGYO	50
XUSIN-YKBNK	50
XUSIN-KCHOL	50
XUSIN-KRDMD	50
XUSIN-SAHOL	50
XBANK-THYAO	50
TUPRS-XUSIN	50
XUSIN-SISE	50
XUSIN-EKGYO	50
XUSIN-THYAO	50
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
XBANK-GARAN	15.31
XBANK-AKBNK	16.54
XBANK-ISCTR	27.17
XBANK-VAKBN	31.17
XBANK-HALKB	16.65
XBANK-YKBNK	65.96
BIST30-XBANK	1.06
XUSIN-BIST30	1.01
XBANK-SAHOL	

	14.98
XUSIN-XBANK	1.07
XUSIN-VAKBN	33.23
KOZAL-KOZAA	8.06
XUSIN-HALKB	17.76
XUSIN-EREGL	12.01
XUSIN-ISCTR	28.97
XUSIN-GARAN	16.32
XBANK-KCHOL	7.09
XUSIN-AKBNK	17.63
XBANK-EKGYO	64.05
XUSIN-YKBNK	70.33
XUSIN-KCHOL	7.56
XUSIN-KRDMD	34.12
XUSIN-SAHOL	15.98
XBANK-THYAO	6.64
TUPRS-XUSIN	1.09
XUSIN-SISE	22.17
XUSIN-EKGYO	68.30
XUSIN-THYAO	7.09