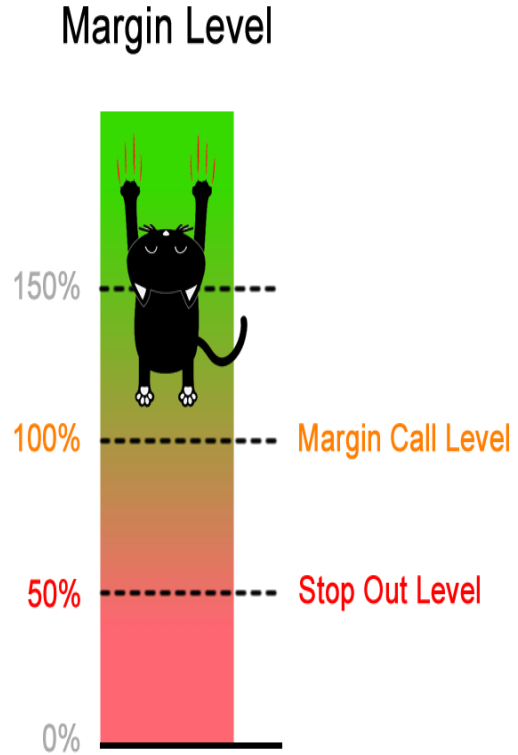


MATRİKS

Portföy Risk Analizi ve Yönetim Sistemleri

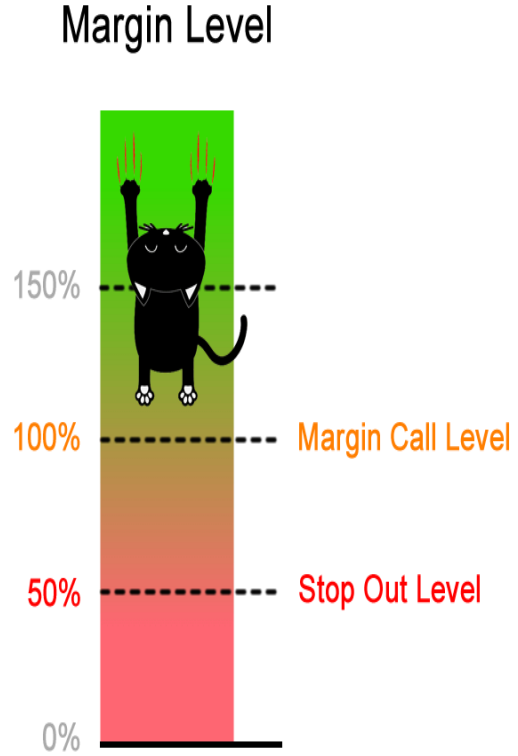
Matriks VIOP OMS - Portföy Risk Simülasyonu ve Anlık Risk Raporları & Auto Margin Call & Auto Stop Out

Portföy Risk Simülasyonu ve Anlık Risk Raporları - I



- Kurum pozisyonlarının **anlık piyasa fiyatlarına** göre Risk Analizi.
- Kurum pozisyonlarının anlık piyasa fiyatları üzerinden dayanak varlık **yüzdesele değişimlerine göre Risk Simülasyonu**.
- Belirlenen zamanlarda anlık risk analizinin yapılması ve hesaplardan sorumlu birimler ve yatırım uzmanlarına eMail yoluyla raporların iletilmesi.
- Özellikle VIOP **Akşam Seansı** uygulamasından sonra kurum risk bildirimlerinin uzaktan takibi.
- Risk raporlarının hesap sahibine **eMail ve SMS** yoluyla iletilmesi.
- Matriks Mobile ve MatriksWebTrader(Html5) ürünleri kullanıcılarına ayrıca **Web/Push Notification** servisleriyle risk bildirimlerinin **anlık** yapılabilmesi.
- **Özkaynak Oranı %0.x**' in Altına Düşen Hesap bildirimlerinin yapılması.
- **Kaldıracı Oranı x**'in üzerine çıkan sözleşmelerin eMail yoluyla raporlarının iletilmesi.
- VIOP Başlangıç Teminatının %50'sinden fazla gün içi teminat tamamlama çağrısı olan hesaplar raporu.
- VIOP Bulunması Gerekenin Altında Teminatı Bulunan Hesaplar (Net Dayanak Varlık Bazında).

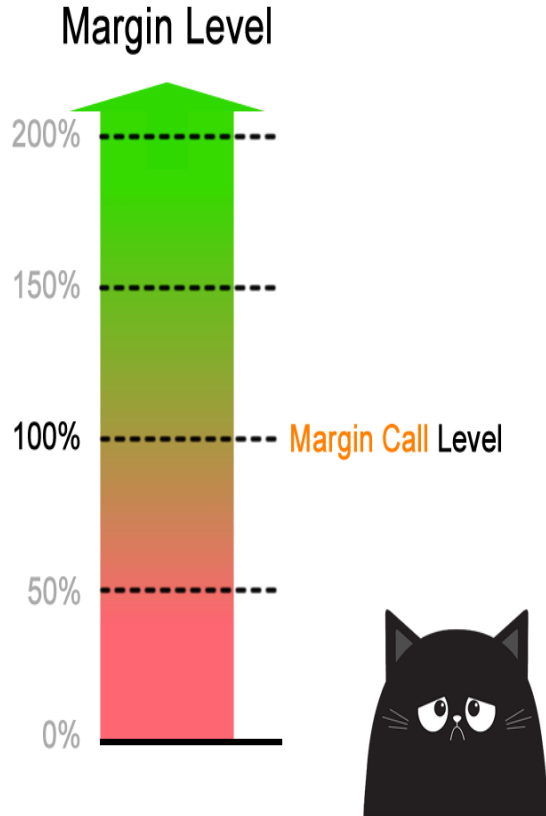
Portföy Risk Simülasyonu ve Anlık Risk Raporları - II



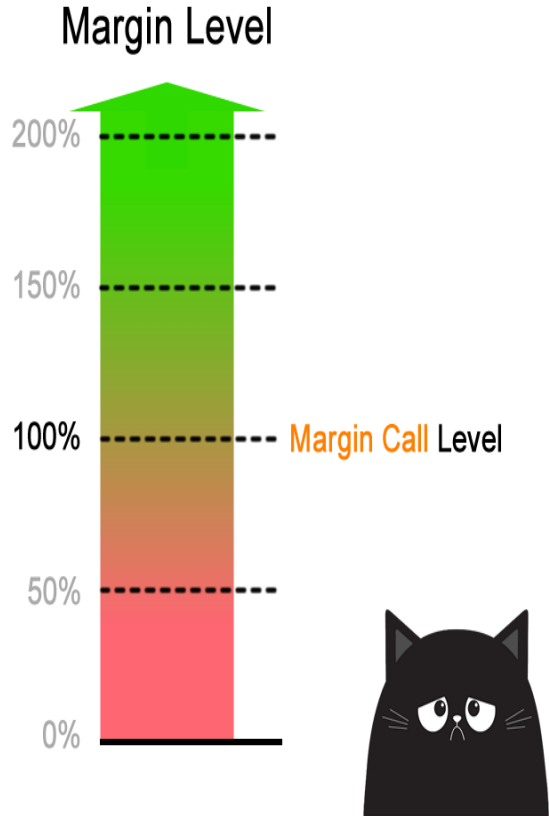
- Kurumun Dayanak Varlık Bazında Brüt Pozisyon Büyüklüğü Raporu.
- VIOP Hesapları Pay Vadeli/Opsiyon Pozisyon Raporu.
- Dayanak Varlık Fiyatında %7 Değişim Olması Halinde Teminatı Eksiye Dönecek Hesaplar Listesi.
- Hesabında Kısa Opsiyon Bulunan Müşteriler İçin, Pozisyonların Spot Fiyatlara Göre Realize Edilmiş Teminat Raporu.
- Kısa Opsiyon Potansiyel Ödeme Raporu.
- VIOP Hesapları Risk Raporu / VIOP Hesapları Risk Raporu (Tarihsel).
- VIOP Pozisyonlar Risk Raporu.
- VIOP Hesapları Risk Raporu Simulasyonu / VIOP Hesapları Risk Raporu Simulasyonu (Tarihsel).
- Kuruma Özel Geliştirilen Raporlar.
- Mart 2019 itibariyle üretim ortamında devreye alındı.
- [Risk Raporlarını detaylı incelemek için tıklayınız.](#)

Risk Server (Auto Margin Call Yönetimi - I)

- ViOP Margin Call işlemlerinin otomasyonunda kullanılan bir sunucu programıdır.
- Parametrelerle belirlenen dinamik kurallara uygun olarak kapatılması gereken pozisyonları hesap bazında belirleyerek önce, kurum ve müşteri bazında uyarı gönderip (e-Mail ve SMS) ardından durum sürüyorsa otomatik olarak pozisyon kapatma işlemlerini gerçekleştirir.
- Matriks Mobile ve MatriksWebTrader(Html5) ürünleri kullanıcılarına ayrıca Web/Push Notification servisleriyle margin call bildirimleri anlık yapılabilir.
- Uygulama dayanak varlıklar ve vadeler arası yayılma kolerasyonlarını da dikkate alarak en uygun enstrüman ve minimum miktarda pozisyon kapatma algoritmasına göre geliştirilmiştir.
- Takasbank ya da kuruma özel katsayılara göre hesaplanmış margin call yönetimi.
- Güvenilir hesaplama için kritik katmanların (Takasbank Servisi, Pozisyonlar, Teminatlar, Span parametre dosyası, Fiyat ve Emir iletim kanalları...vd.) sağlıklı çalıştığı anlık olarak kontrol edilir. Olumsuz bir durumda ilgili birimler eMail , görsel ve sesli olarak ikazlar iletilir.

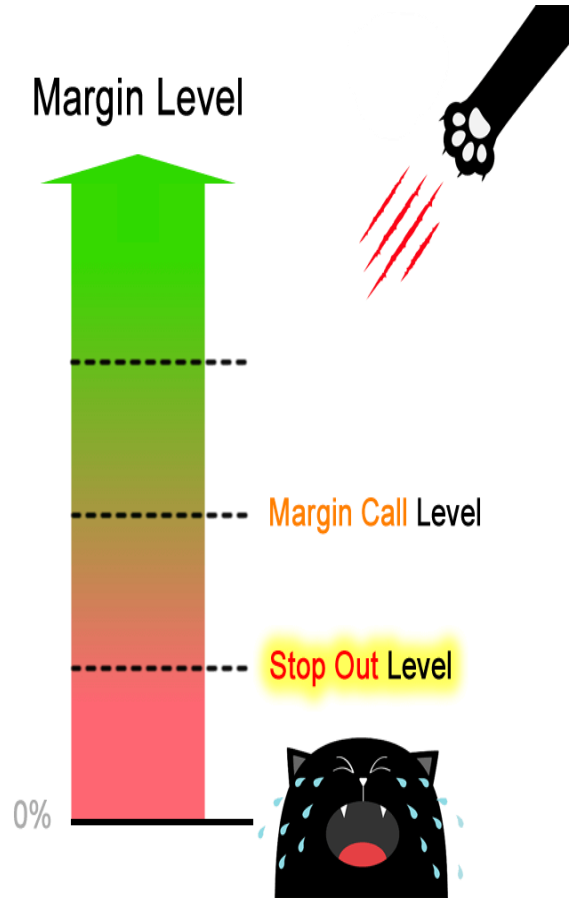


Risk Server (Auto Margin Call Yönetimi - II)



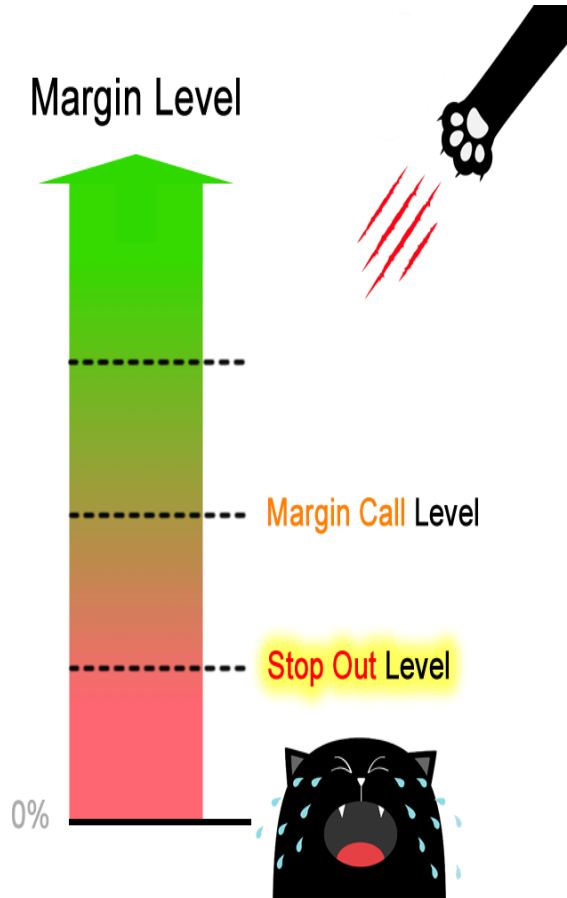
- Hesap, Hesap Gruplarına Dayanak Varlık, Vade Tarihi bazında Miktar limitleri altına uygulanacak şekilde parametreler tanımlanabilir.
- Başlangıç Teminatı, Parasal Büyüklük, Cari Bakiye değerleri altına uygulanacak şekilde limit parametreleri tanımlanabilir.
- Simülasyon modunda çalıştırılarak bildirimler gönderilebilir.
- Kapsamlı loglama ve raporlama yapılmaktadır.
- OMS Terminalleri üzerinden Margin Call logları detaylı olarak anlık takip edilebilir.
- Kuruma özel parametrik kural setleri geliştirilebilir.
- Kasım2019 itibariyle üretim ortamında devreye alındı.
- [Auto Margin Call Yönetimini detaylı incelemek için tıklayınız.](#)

Risk Server (Auto Stop-Out Yönetimi -I)



- ViOP Stop-Out uygulaması otomasyonunda kullanılan bir sunucu programıdır.
- Parametrelerle belirlenen dinamik kurallara uygun olarak kapatılması gereken pozisyonları hesap bazında belirleyerek önce, kurum ve müşteri bazında uyarı gönderip (e-Mail ve SMS) ardından durum sürüyorsa otomatik olarak pozisyon kapatma işlemlerini gerçekleştirir.
- Matriks Mobile ve MatriksWebTrader(Html5) ürünü kullanıcılarına ayrıca Web/Push Notification servisleriyle margin call bildirimleri anlık yapılabilir.
- Uygulama dayanak varlıklar ve vadeler arası yayılma kolerasyonlarını da dikkate alarak minimum pozisyon kapatma algoritmasına göre geliştirilmiştir.
- Akşam Seansına özel, farklı parametre tanımları ile risk uyarısı bildirimlerinin ve pozisyon kapatma işlemleri yapılabilir.
- Güvenilir hesaplama için kritik katmanların (Takasbank Servisi, Pozisyonlar, Teminatlar, Span parametre dosyası, Fiyat ve Emir iletim kanalları...vd.) sağlıklı çalıştığı anlık olarak kontrol edilir. Olumsuz bir durumda ilgili birimler eMail , görsel ve sesli olarak ikazlar iletilir.

Risk Server (Auto Stop-Out Yönetimi -II)



- Hesap, Hesap Gruplarına Dayanak Varlık, Vade Tarihi bazında Miktar limitleri altına uygulanacak şekilde parametreler tanımlanabilir.
- Başlangıç Teminatı, Parasal Büyüklük, Cari Bakiye değerleri altına uygulanacak şekilde limit parametreleri tanımlanabilir.
- Simülasyon modunda çalıştırılarak bildirimler gönderilebilir.
- Kapsamlı loglama ve raporlama yapılmaktadır.
- OMS Terminalleri üzerinden Stop-Out logları detaylı olarak anlık takip edilebilir.
- Kuruma özel parametrik kural setleri geliştirilebilir.
- Haziran 2019 itibariyle üretim ortamında devreye alındı.
- [Auto Stop-Out Yönetimini detaylı incelemek için tıklayınız.](#)

TEŞEKKÜRLER