

Genel Mektup: 1261
Türev Araçlar Takas Ekibi

İstanbul, 09/02/2016

Konu: İşleme açılacak yeni pay vadeli işlem ve opsiyon sözleşmeleri hk.

İlgili: Bankalar
Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

BİAŞ Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda 11 Şubat 2016 tarihinde işleme açılacak olan 10 adet yeni paya dayalı vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin SPAN risk parametreleri aşağıda verilmektedir.

Dayanak	Fiyat Değişim Aralığı (PSR)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski
Arçelik A.Ş. (ARCLK)	200	200
Emlak Konut GYO A.Ş. (EKGYO)	35	35
T. Halk Bankası A.Ş. (HALKB)	155	155
Koç Holding A.Ş. (KCHOL)	125	125
Kardemir Karabük Demir Çelik San. ve Tic. A.Ş. (KRDMD)	15	15
Petkim Petrokimya Holding A.Ş. (PETKM)	50	50
Pegasus Hava Taşımacılığı A.Ş. (PGSUS)	215	215
T. Şişe ve Cam Fabrikaları A.Ş. (SISE)	35	35
Tofaş Türk Otomobil Fab. A.Ş. (TOASO)	260	260
Türk Telekomünikasyon A.Ş. (TTKOM)	70	70

10 adet yeni paya dayalı sözleşmeleri de içeren 10 Şubat 2016 tarihli SPAN parametre dosyası aynı tarihli normal seans sonunda gerçekleştirilen günsonu işlemleri sürecinde Takasbank internet sitesine yüklenecektir.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Sezai BEKGÖZ
Genel Müdür Yardımcısı

Murat ULUS
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

2

SPAN PARAMETRE TABLOSU
(TABLE OF SPAN PARAMETERS)

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)
AKBNK	80
ARCLK	200
BIST30	900
BIST30X	9
COTEGE	435
EKGYO	35
ELCBAS	720
EREGL	40
EURUSD	155
FBIST	55
GARAN	90
HALKB	155
HMSTR	560
ISCTR	60
KCHOL	125
KRDMD	15
ONRPM	250
ONRPQ	445
PETKM	50
PGSUS	215
SAHOL	95
SASX	40
SISE	35
TCCELL	110
THYAO	95
TOASO	260
TRYEUR	155
TRYUSD	145
TRYUSDK	145
TTKOM	70
TUPRS	830
VAKBN	50
WHTANR	580
XAUTRY	8
XAUUSD	235
YKBNK	45

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) Volatilité Değişim Aralığı
(Volatility Scan Range-VSR)

Opsiyon Sözleşmeleri
(Options)

Kontratlar (Contracts)	Volatilité Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range - VSR)
AKBNK	23
ARCLK	23
BIST30	26
BIST30X	26

EKGYO	30
EREGL	28
GARAN	23
HALKB	27
ISCTR	22
KCHOL	24
KRDMD	29
PETKM	33
PGSUS	23
SAHOL	27
SISE	25
TCELL	31
THYAO	30
TOASO	23
TRYUSDK	26
TTKOM	31
TUPRS	23
VAKBN	26
YKBNK	27

**4) 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)
AKBNK	80
ARCLK	200
BIST30	900
BIST30X	9
COTEGE	435
EKGYO	35
ELCBAS	720
EREGL	40
EURUSD	155
FBIST	55
GARAN	90
HALKB	155
HMSTR	560
ISCTR	60
KCHOL	125
KRDMD	15
ONRPM	250
ONRPQ	445
PETKM	50
PGSUS	215
SAHOL	95
SASX	40
SISE	35
TCELL	110
THYAO	95
TOASO	260
TRYEUR	155
TRYUSD	145
TRYUSDK	145
TTKOM	70
TUPRS	830
VAKBN	50
WHTANR	580
XAUTRY	8

XAUUSD	235
YKBNK	45
5)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</i>	
TRYUSD/TRYUSDK	100
BIST30/BIST30X	100
BIST30/AKBNK	60
BIST30X/AKBNK	60
BIST30/GARAN	60
BIST30X/GARAN	60
BIST30/ISCTR	60
BIST30X/ISCTR	60
BIST30/YKBNK	60
BIST30X/YKBNK	60
BIST30/VAKBN	60
BIST30X/VAKBN	60
GARAN/AKBNK	60
BIST30/HALKB	60
BIST30X/HALKB	60
ISCTR/YKBNK	60
XAUUSD/XAUTRY	60
GARAN/ISCTR	50
AKBNK/YKBNK	50
GARAN/YKBNK	50
ISCTR/VAKBN	50
VAKBN/YKBNK	50
AKBNK/ISCTR	50
GARAN/VAKBN	50
HALKB/VAKBN	50
HALKB/YKBNK	50
HALKB/GARAN	50
HALKB/ISCTR	50
AKBNK/VAKBN	50
HALKB/AKBNK	50
BIST30/SAHOL	50
BIST30X/SAHOL	50
BIST30/KCHOL	50
BIST30X/KCHOL	50
SAHOL/AKBNK	50
ONRPQ / ONRPM	50
BIST30/THYAO	50
BIST30X/THYAO	50
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
TRYUSD/TRYUSDK	1.00
BIST30/BIST30X	100.00
BIST30/AKBNK	13.09
BIST30X/AKBNK	0.13
BIST30/GARAN	12.55
BIST30X/GARAN	0.13
BIST30/ISCTR	19.39
BIST30X/ISCTR	0.19
BIST30/YKBNK	26.86
BIST30X/YKBNK	0.27

BIST30/VAKBN	22.89
BIST30X/VAKBN	0.23
GARAN/AKBNK	1.04
BIST30/HALKB	8.45
BIST30X/HALKB	0.08
ISCTR/YKBNK	1.39
XAUUSD/XAUTRY	28.24
GARAN/ISCTR	1.55
AKBNK/YKBNK	2.05
GARAN/YKBNK	2.14
ISCTR/VAKBN	1.18
VAKBN/YKBNK	1.17
AKBNK/ISCTR	1.48
GARAN/VAKBN	1.82
HALKB/VAKBN	2.71
HALKB/YKBNK	3.18
HALKB/GARAN	1.48
HALKB/ISCTR	2.29
AKBNK/VAKBN	1.75
HALKB/AKBNK	1.55
BIST30/SAHOL	10.85
BIST30X/SAHOL	0.11
BIST30/KCHOL	7.69
BIST30X/KCHOL	0.08
SAHOL/AKBNK	1.21
ONRPQ / ONRPM	1.00
BIST30/THYAO	11.64
BIST30X/THYAO	0.12

**6) Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski
(Short Option Minimum Risk)**

**Opsiyon Sözleşmeleri
(Options)**

AKBNK	15
ARCLK	30
BIST30	130
BIST30X	1.3
EKGYO	10
EREGL	10
GARAN	15
HALKB	25
ISCTR	10
KCHOL	20
KRDMD	5
PETKM	10
PGSUS	35
SAHOL	20
SISE	10
TCELL	20
THYAO	20
TOASO	40
TRYUSDK	20
TTKOM	10
TUPRS	125
VAKBN	10
YKBNK	10

Güncellenme Tarihi (Update Date): 10/02/2016