

Genel Mektup: 1356
Merkezi Karşı Taraf Bölümü

İstanbul, 02/06/2017

Konu: BİAŞ Pay Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi risk parametrelerinin yayınlanması hk.

İlgili: Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Borsa İstanbul Pay Piyasası'nda 19 Haziran 2017 tarihi itibarıyla başlatılacak merkezi karşı taraf hizmeti çerçevesinde işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri piyasa koşulları dikkate alınarak belirlenmiş olup, ilgili değerler ekte yer almaktadır.

Geçiş öncesinde üyelerimizin risk ve teminat durumlarını takas ekranlarından takip edebilmeleri ve gerekli hazırlıkları yapabilmelerini teminen yeni risk parametreleri 7 Haziran 2017 tarihinde BISTECH sistemine tanımlanacaktır.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 7 Haziran 2017 tarihinden itibaren Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

Bilgilerinizi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla.

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.



N. Burak AKAN
Müdür



Mahmut KAYACIK
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek: BİAŞ Pay Piyasası BISTECH risk parametre tablosu

BISTECH RİSK PARAMETRE TABLOSU
(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)

Fiyat Değişim Aralığı
(Price Scan Range-PSR)

LİKİDİTE GRUBU	ÜRÜN GRUBU	1 Günlük PSR Değeri	2 Günlük PSR Değeri
BIST30 (BIST30 Endeksi İçinde Yer Alan 30 adet Pay)	BIST30	7%	10%
BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay)	BIST100	9%	13%
Gelişen İşletmeler Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	15%	21%
Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	17%	24%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	11%	14%
Varant ve Sertifikalar	VARANT/SERTİFİKA	100%	100%

Ürün Grupları Arası Risk Analizi
(Inter-Commodity Spread Credit)

Ürün Grubu	Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)
BIST30/BIST100	20

س

20