

Genel Mektup : 1834

İstanbul, 09/12/2022

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

13.12.2022 Salı günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 13.12.2022 tarihinde gün içi ilk risk hesaplama işlemleri sonrasında üye ekranlarından izlenebilecek olup, üyelerimizce teminat yükümlülüklerine ilişkin gerekli kontrollerin yapılması gerekmektedir.

Yeni parametreleri içeren risk parametre dosyası 13.12.2022 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

VİOP'ta işlem gören pay vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin bağlı olduğu dayanak varlıkların fiyat ve/veya miktarında özsermaye hallerine ilişkin yapılan düzeltmeler ilgili paya dayalı vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin risk parametrelerine yansıtılacaktır.

13.12.2022 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 12.12.2022 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 13.12.2022 Salı günü akşamı hesaplanacak teminat tamamlama çağrısı yükümlülükleri ise yeni parametrelere göre olacaktır.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımızla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Avşar R. SUNGURLU
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Risk_Parametreleri (6 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSL5NNRC6B> 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: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin 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 (TL) (Price Scan Range - PSR)
AEFES	1085
AKBNK	305
AKSEN	795
ALARK	1465
ALKIM	755
ARCLK	1395
ASELS	785
BIMAS	1735
COLA	2790
CNHTRY	3740
DOHOL	130
ECILC	485
EKGYO	110
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	525
EREGL	675
EURTRY	2635
FROTO	8170
GARAN	470
GUBRF	3965
HALKB	175
HEKTS*	955

ISCTR	180
ISFIN	165
ISGYO	145
KARSN	220
KCHOL	1065
KOZAA	780
KOZAL	5380
KRDMD	270
MGROS	2735
ODAS	215
OYAKC	300
PETKM	285
PGSUS	7450
RUBTRY	6030
SAHOL	755
SASA	3180
SASX10	85
SISE	615
SKBNK	40
SOKM	425
TAVHL	1420
TCELL	495
THYAO	2385
TKFEN	605
TLREF (Vade Dışı)	3365
TLREF (Vade İçi)	1495
TOASO	2205
TRGYO	285
TRT200923T18	1775
TRT020926T17	5480
TRT131130T14	8495
TSKB	60
TTKOM	285

TUPRS	7915
TURSG	195
ULKER	525
USDTRY	2435
USDTRYK	2435
VAKBN	175
VESTL	1020
X10XB	9660
XAUTRY	170
XLBNK	6050
XU030	6240
YKBNK	195
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	30
GBPUSD	50
XAGUSD	35
XAUUSD	130
XPDUUSD	465
XPTUSD	125
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)
AEFES	1085
AKBNK	305

AKSEN	795
ALARK	1465
ALKIM	755
ARCLK	1395
ASELS	785
BIMAS	1735
CCOLA	2790
CNHTRY	3740
DOHOL	130
ECILC	485
EKGYO	110
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	525
EREGL	675
EURTRY	2635
FROTO	8170
GARAN	470
GUBRF	3965
HALKB	175
HEKTS*	955
ISCTR	180
ISFIN	165
ISGYO	145
KARSN	220
KCHOL	1065
KOZAA	780
KOZAL	5380
KRDMD	270
MGROS	2735
ODAS	215
OYAKC	300

PETKM	285
PGSUS	7450
RUBTRY	6030
SAHOL	755
SASA	3180
SASX10	85
SISE	615
SKBNK	40
SOKM	425
TAVHL	1420
TCELL	495
THYAO	2385
TKFEN	605
TLREF	3365
TOASO	2205
TRGYO	285
TRT	600
TSKB	60
TTKOM	285
TUPRS	7915
TURSG	195
ULKER	525
USDTRY	2435
USDTRYK	2435
VAKBN	175
VESTL	1020
X10XB	9660
XAUTRY	170
XLBNK	6050
XU030	6240
YKBNK	195
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)

EURUSD	30
GBPUSD	50
XAGUSD	35
XAUUSD	130
XPDUSD	465
XPTUSD	125
4)Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (TL) (Physical Delivery Margin)
USDTRY	2435
USDTRYK	2435

*Özsermaye hallerine ilişkin yapılan düzeltmeler fiyat değişim aralığı (PSR) parametresine yansıtılacaktır.