

Genel Mektup : 1845

İstanbul, 06/01/2023

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.

10.01.2023 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 10.01.2023 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 10.01.2023 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.

10.01.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 09.01.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 10.01.2023 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.

Niyazi Burak AKAN
Direktör

Avşar R. SUNGURLU
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Risk_Parametreleri (6 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSC5APU8RB> 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



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	1245
AKBNK	380
AKSEN	800
ALARK	1435
ARCLK	1935
ASELS	1195
BIMAS	1950
CNHTRY	4135
DOHOL	205
ECILC	600
EKGYO	170
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	675
EREGL	775
EURTRY	2985
FROTO	10650
GARAN	550
GUBRF	6090
HALKB	230
HEKTS	745
ISCTR	230
ISGYO	200

KARSN	220
KCHOL	1410
KOZAA	990
KOZAL	11180
KRDMD	355
MGROS	2805
ODAS	200
OYAKC	390
PETKM	370
PGSUS	9030
RUBTRY	5810
SAHOL	905
SASA	2415
SASX10	85
SISE	775
SKBNK	50
SOKM	510
TAVHL	1665
TCELL	670
THYAO	2670
TKFEN	855
TLREF (Vade Dışı)	3340
TLREF (Vade İçi)	1600
TOASO	2960
TRGYO	350
TRT200923T18	1840
TRT020926T17	6635
TRT131130T14	9210
TSKB	75
TTKOM	470
TUPRS	9565
USDTRY	2660
USDTRYK	2660

VAKBN	205
VESTL	1380
X10XB	11765
XAUTRY	175
XLBNK	7830
XSD25	8490
XU030	7855
YKBNK	215
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	140
XPDUUSD	425
XPTUSD	135
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	1245
AKBNK	380
AKSEN	800
ALARK	1435
ARCLK	1935
AELS	1195

BIMAS	1950
CNHTRY	4135
DOHOL	205
ECILC	600
EKGYO	170
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	675
EREGL	775
EURTRY	2985
FROTO	10650
GARAN	550
GUBRF	6090
HALKB	230
HEKTS	745
ISCTR	230
ISGYO	200
KARSN	220
KCHOL	1410
KOZAA	990
KOZAL	11180
KRDMD	355
MGROS	2805
ODAS	200
OYAKC	390
PETKM	370
PGSUS	9030
RUBTRY	5810
SAHOL	905
SASA	2415
SASX10	85
SISE	775

SKBNK	50
SOKM	510
TAVHL	1665
TCELL	670
THYAO	2670
TKFEN	855
TLREF	3340
TOASO	2960
TRGYO	350
TRT	630
TSKB	75
TTKOM	470
TUPRS	9565
USDTRY	2660
USDTRYK	2660
VAKBN	205
VESTL	1380
X10XB	11765
XAUTRY	175
XLBNK	7830
XSD25	8490
XU030	7855
YKBNK	215
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	140
XPDUSD	425
XPTUSD	135
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	2660
USDTRYK	2660

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