

Genel Mektup : 1860

İstanbul, 03/02/2023

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf veya teminat yönetimi hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon piyasasında işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

07.02.2023 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 07.02.2023 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 07.02.2023 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.

07.02.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 06.02.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 07.02.2023 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.

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Avşar R. SUNGURLU
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Risk Parametre Tablosu (6 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSE5E405Y0> 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	935
AKBNK	315
AKSEN	630
ALARK	1255
ARCLK	1845
ASELS	1060
BIMAS	1795
CNHTRY	4250
DOHOL	160
ECILC	465
EKGYO	140
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	595
EREGL	705
EURTRY	3075
FROTO	10510
GARAN	435
GUBRF	5800
HALKB	180
HEKTS	675
ISCTR	195

ISGYO	210
KARSN	165
KCHOL	1290
KOZAA	975
KOZAL	10330
KRDMD	310
MGROS	2655
ODAS	135
OYAKC	395
PETKM	295
PGSUS	9415
RUBTRY	6030
SAHOL	785
SASA	2465
SASX10	85
SISE	705
SKBNK	45
SOKM	465
TAVHL	1445
TCELL	635
THYAO	2605
TKFEN	670
TLREF (Vade Dışı)	3310
TLREF (Vade İçi)	1600
TRT200923T18	2085
TRT020926T17	6355
TRT131130T14	9955
TOASO	2770
TRGYO	290
TSKB	70
TTKOM	380
TUPRS	10875
USDTRY	2670

USDTRYK	2670
VAKBN	160
VESTL	1165
X10XB	11235
XAUTRY	185
XLBNK	6360
XSD25	7600
XU030	7230
YKBNK	160
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	150
XPDUSD	400
XPTUSD	130
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	935
AKBNK	315
AKSEN	630
ALARK	1255
ARCLK	1845

ASELS	1060
BIMAS	1795
CNHTRY	4250
DOHOL	160
ECILC	465
EKGYO	140
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	595
EREGL	705
EURTRY	3075
FROTO	10510
GARAN	435
GUBRF	5800
HALKB	180
HEKTS	675
ISCTR	195
ISGYO	210
KARSN	165
KCHOL	1290
KOZAA	975
KOZAL	10330
KRDMD	310
MGROS	2655
ODAS	135
OYAKC	395
PETKM	295
PGSUS	9415
RUBTRY	6030
SAHOL	785
SASA	2465
SASX10	85

SISE	705
SKBNK	45
SOKM	465
TAVHL	1445
TCELL	635
THYAO	2605
TKFEN	670
TLREF	3310
TRT200923T18	570
TRT020926T17	570
TRT131130T14	570
TOASO	2770
TRGYO	290
TSKB	70
TTKOM	380
TUPRS	10875
USDTRY	2670
USDTRYK	2670
VAKBN	160
VESTL	1165
X10XB	11235
XAUTRY	185
XLBNK	6360
XSD25	7600
XU030	7230
YKBNK	160
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	150
XPDUSD	400

XPTUSD	130
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	2670
USDTRYK	2670

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