

Genel Mektup : 2151

İstanbul, 29/06/2026

**MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME EKİBİ**

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Aracı Kurumlar, Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf veya teminat yönetimi hizmeti verdiğimiz piyasalarda işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir. 01.07.2026 Çarşamba günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak değişen risk parametreleri ile merkezi karşı taraf ve teminat yönetimi hizmeti verilen piyasalarda risk hesaplamasında kullanılan tüm değerler ekte yer almaktadır.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 01.07.2026 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 01.07.2026 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. 01.07.2026 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 30.06.2026 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 01.07.2026 Çarşamba 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

Murat GÖRGÜN  
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri

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

**İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.**

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +90 212 315 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



**BAP-BISTECH NAKİT AKIM TEMİNATLANDIRMA YÖNTEMİ TEMEL BİLEŞEN PARAMETRE TABLOSU**

	<b>TL DİBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)</b>	<b>ENFLASYONA ENDEKSLİ TL DİBS ÜRÜN GRUBU(INFLATION - INDEXED TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)</b>	<b>BANKA İHRACI ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (FINANCIAL CORPORATE BONDS)</b>	<b>BANKA DIŞI İHRAÇ ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (NON-FINANCIAL CORPORATE BONDS)</b>	<b>YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (DOLAR) (USD EUROBOND)</b>	<b>YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (EURO) (EURO EUROBOND)</b>
<b>Vade (Gün)</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>
1-7	30.00%	30.00%	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%
180	12.22%	0.92%	42.43%	50.00%	29.12%	27.36%
365	7.72%	0.60%	46.80%	50.00%	13.58%	12.91%
730	4.75%	0.67%	32.57%	36.92%	6.79%	6.63%
1825	4.75%	1.48%	10.66%	14.00%	2.65%	2.63%
3650	4.75%	1.30%	8.93%	11.06%	1.36%	2.06%
10950					1.36%	2.06%

1-) TL DİBS Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; Devlet Tahvilleri, Hazine Bonoları ve Kamu Kira Sertifikaları'dır.

2-) Banka İhracı Özel Sektör Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; bankaların ihraç ettiği Özel Sektör Tahvilleri, Finansman Bonoları ve Yapılandırılmış Borçlanma Araçları'dır.

3-) Banka Dışı İhraç Özel Sektör Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; banka dışı kuruluşların ihraç ettiği Özel Sektör Tahvili, Finansman Bonusu,

4-) Yabancı Para Ödemeli Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; Eurotahviller, YP Kamu Kira Sertifikaları, YP Özel Kira Sertifikaları'dır.

5-) Vadeler arasındaki PC değerleri, tablodaki PC değerleri arasında lineer interpolasyonla elde edilen değere eşittir.

**PAY PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>PAY PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU</b> <b>(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>		
<b>Fiyat Değişim Aralığı</b> <b>(Price Scan Range-PSR)</b>		
<b>LİKİDİTE GRUBU</b>	<b>ÜRÜN GRUBU</b>	<b>PSR Değeri</b>
<b>BIST30 (BIST30 Endeksi İçinde Yer Alan 30 adet Pay)</b>	<b>BIST30</b>	14%
<b>Borsa Yatırım Fonları - Emtia</b>	<b>YATIRIM FONU</b>	10%
<b>Borsa Yatırım Fonları -Döviz</b>	<b>YATIRIM FONU</b>	8%
<b>Borsa Yatırım Fonları - Endeks</b>	<b>YATIRIM FONU</b>	14%
<b>Borsa Yatırım Fonları – TLREF Endeksli</b>	<b>YATIRIM FONU</b>	2.5%
<b>BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay)</b>	<b>BIST100</b>	15%
<b>Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar</b>	<b>BISTDİĞER</b>	25%
<b>Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları )</b>	<b>BISTDİĞER</b>	25%
<b>BIST30 Sertifikası</b>	<b>SERTİFİKA</b>	14%
<b>Darphane Altın Sertifikası</b>	<b>SERTİFİKA</b>	10%
<b>Gümüş Sertifikası</b>	<b>SERTİFİKA</b>	14%
<b>Brent Petrol Sertifikası</b>	<b>SERTİFİKA</b>	17%
<b>DAX Sertifikası</b>	<b>SERTİFİKA</b>	9%
<b>Varant (Alım)</b>	<b>VARANT</b>	100%
<b>Varant (Satım)</b>		200%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

**VADELİ İŞLEM VE OPSİYON PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>	
<b>1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)</b>
AEFES	14.1
AKBNK	15.7
AKSEN	14.3
ALARK	13.4
ARCLK	13.1
ASELS	15.8
ASTOR	16.1
BIMAS	12.7
BRSAN	15.5
CIMSA	13.4
CNHTRY	10.7
DOAS	15.1
DOHOL	14.1
EKGYO	16.1
ELCBASM	20.0
ELCBASQ	11.0
ELCBASY	6.0
ENJSA	13.4
ENKAI	13.8
EREGL	14.0
EURTRY	10.4
FROTO	14.4
GARAN	14.4

Halka Açık (Tasnif Dışı)

GUBRF	15.1
HALKB	16.6
HEKTS	15.0
ISCTR	13.5
KCHOL	12.8
KONTR	17.0
KRDMD	13.4
MGROS	13.4
ODAS	15.1
OYAKC	13.5
PETKM	14.3
PGSUS	14.1
RUBTRY	17.7
SAHOL	13.2
SASA	14.5
SASX10	5.7
SISE	13.2
SOKM	13.4
TAVHL	15.3
TCELL	13.4
THYAO	13.4
TKFEN	14.1
TLREF (Vade Dışı)	8.2
TLREF (Vade İçi)	9.0
TOASO	15.3
TRALT	16.1
TRMET	14.1
TRT020926T17	12.2
TRT131130T14	25.2
TSKB	14.1
TTKOM	14.4
TUPRS	13.4
ULKER	13.7

Halka Açık (Tasnif Dışı)

USDTRY	11.0
VAKBN	14.1
VESTL	14.1
X10XB	11.8
XAUTRY	14.0
XLBNK	13.7
XSD25	11.4
XU030	11.4
YKBNK	15.5
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)</b>
EURUSD	5.0
GBPUSD	5.0
XAGUSD	20.0
XAUUSD	10.0
XCUUSD	8.1
XPDUUSD	18.0
XPTUSD	15.0
<b>2) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı (Extreme Move Multiplier and Extreme Move Covered Fraction)</b>	
<b>1. Aşırı Hareket Senaryo Çarpanı (Extreme Move Multiplier)</b>	3
<b>2.Kapsama Oranı (%) (Extreme Move Covered Fraction)</b>	32
<b>3) Volatilite Değişim Aralığı (Volatility Scan Range-VSR)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Volatilite Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range - VSR)</b>
AKBNK	31
ALARK	28
ARCLK	30
ASELS	33
BIMAS	32
EKGYO	28

Halka Açık (Tasnif Dışı)

ENKAI	33
EREGL	26
FROTO	26
GARAN	30
HALKB	35
ISCTR	29
KCHOL	27
KRDMD	25
PETKM	28
PGSUS	30
SAHOL	26
SISE	28
TAVHL	27
TCELL	28
THYAO	28
TOASO	24
TTKOM	29
TUPRS	28
USDTRY	32
VAKBN	32
XU030	32
YKBNK	27
<b>4)Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)</b>
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)</i>	
USDTRY-USDTRYK	100
ELCBASQ-ELCBASM	100
ELCBASY-ELCBASQ	100

Halka Açık (Tasnif Dışı)

ELCBASY-ELCBASM	100
TRT131130T14-TRT020926T17	100
X10XB-XU030	70
XLBNK-AKBNK	70
XLBNK-GARAN	70
XLBNK-ISCTR	70
XLBNK-YKBNK	70
CNHTRY-USDTRY	70
GARAN-AKBNK	70
XU030-AKBNK	60
XU030-ISCTR	60
XU030-SAHOL	60
XU030-YKBNK	60
XU030-KCHOL	60
XU030-XLBNK	60
AKBNK-ISCTR	60
AKBNK-YKBNK	60
GARAN-ISCTR	60
GARAN-YKBNK	60
YKBNK-ISCTR	60
X10XB-THYAO	60
HALKB-VAKBN	60
XLBNK-VAKBN	60
XAUUSD-XAGUSD	60
X10XB-SISE	60
TRMET-TRALT	60
AKBNK-VAKBN	60
VAKBN-ISCTR	60
EURTRY-USDTRY	60
XU030-GARAN	60
XU030-VAKBN	60
GARAN-VAKBN	60
THYAO-PGSUS	60

Halka Açık (Tasnif Dışı)

CNHTRY-EURTRY	60
X10XB-EREGL	50
YKBNK-VAKBN	50
X10XB-TUPRS	50
KRDMD-EREGL	50
XAUUSD-XAUTRY	50
XLBNK-HALKB	50
XU030-SISE	50
KCHOL-SAHOL	50
XU030-PGSUS	50
XU030-TCELL	50
XU030-THYAO	50
XU030-EREGL	50
X10XB-AKBNK	50
XU030-TUPRS	50
XU030-EKGYO	50
XU030-HALKB	50
XU030-KRDMD	50
XU030-PETKM	50
KCHOL-ISCTR	50
XU030-TTKOM	50
XU030-ASELS	50
XU030-TSKB	50
X10XB-ISCTR	50
SAHOL-AKBNK	50
AKBNK-HALKB	50
AKBNK-TSKB	50
SAHOL-VAKBN	50
GARAN-TSKB	50
GARAN-SAHOL	50
GARAN-HALKB	50
SAHOL-ISCTR	50
ISCTR-TSKB	50

Halka Açık (Tasnif Dışı)

HALKB-ISCTR	50
X10XB-TCELL	50
SAHOL-YKBNK	50
XLBNK-SAHOL	50
X10XB-SAHOL	50
VAKBN-TSKB	50
HALKB-YKBNK	50
YKBNK-TSKB	50
GBPUSD-EURUSD	50
X10XB-EKGYO	50
XLBNK-KCHOL	50
X10XB-KCHOL	50
X10XB-KRDMD	50
X10XB-PGSUS	50
X10XB-PETKM	50
X10XB-TTKOM	50
X10XB-ASELS	50
XLBNK-TSKB	50
X10XB-XLBNK	50
XAGUSD-XPTUSD	50
<b>Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)</b>	
USDTRY-USDTRYK	1
ELCBASQ-ELCBASM	3
ELCBASY-ELCBASQ	4
ELCBASY-ELCBASM	12
TRT131130T14-TRT020926T17	1.14
X10XB-XU030	1.16
XLBNK-AKBNK	20.68
XLBNK-GARAN	11.27
XLBNK-ISCTR	107
XLBNK-YKBNK	40.95
CNHTRY-USDTRY	1.47

Halka Açık (Tasnif Dışı)

GARAN-AKBNK	1.84
XU030-AKBNK	22.14
XU030-ISCTR	114.57
XU030-SAHOL	16.82
XU030-YKBNK	43.84
XU030-KCHOL	8.08
XU030-XLBNK	1.07
AKBNK-ISCTR	5.17
AKBNK-YKBNK	1.98
GARAN-ISCTR	9.5
GARAN-YKBNK	3.63
YKBNK-ISCTR	2.61
X10XB-THYAO	6.03
HALKB-VAKBN	1.26
XLBNK-VAKBN	45.99
XAUUSD-XAGUSD	6.09
X10XB-SISE	39.97
TRMET-TRALT	2.75
AKBNK-VAKBN	2.22
VAKBN-ISCTR	2.33
EURTRY-USDTRY	1.17
XU030-GARAN	12.06
XU030-VAKBN	49.24
GARAN-VAKBN	4.08
THYAO-PGSUS	1.71
CNHTRY-EURTRY	1.26
X10XB-EREGL	53.45
YKBNK-VAKBN	1.12
X10XB-TUPRS	7.32
KRDMD-EREGL	1.08
XAUUSD-XAUTRY	28.84
XLBNK-HALKB	36.63
XU030-SISE	34.54

Halka Açık (Tasnif Dışı)

KCHOL-SAHOL	2.08
XU030-PGSUS	8.89
XU030-TCELL	14.34
XU030-THYAO	5.21
XU030-EREGL	46.19
X10XB-AKBNK	25.62
XU030-TUPRS	6.32
XU030-EKGYO	78.26
XU030-HALKB	39.22
XU030-KRDMD	42.93
XU030-PETKM	71.87
KCHOL-ISCTR	14.18
XU030-TTKOM	25.66
XU030-ASELS	4.13
XU030-TSKB	134.63
X10XB-ISCTR	132.59
SAHOL-AKBNK	1.32
AKBNK-HALKB	1.77
AKBNK-TSKB	6.08
SAHOL-VAKBN	2.93
GARAN-TSKB	11.16
GARAN-SAHOL	1.39
GARAN-HALKB	3.25
SAHOL-ISCTR	6.81
ISCTR-TSKB	1.18
HALKB-ISCTR	2.92
X10XB-TCELL	16.6
SAHOL-YKBNK	2.61
XLBNK-SAHOL	15.71
X10XB-SAHOL	19.46
VAKBN-TSKB	2.73
HALKB-YKBNK	1.12
YKBNK-TSKB	3.07

Halka Açık (Tasnif Dışı)

GBPUSD-EURUSD	1.15
X10XB-EKGYO	90.57
XLBNK-KCHOL	7.55
X10XB-KCHOL	9.35
X10XB-KRDMD	49.68
X10XB-PGSUS	10.29
X10XB-PETKM	83.17
X10XB-TTKOM	29.69
X10XB-ASELS	4.78
XLBNK-TSKB	125.73
X10XB-XLBNK	1.24
XAGUSD-XPTUSD	17.69
<b>5) Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (Short Option Minimum Risk)</b>	
<b>Opsiyon Sözleşmeleri (Options)</b>	
AKBNK	405
ALARK	510
ARCLK	515
ASELS	2050
BIMAS	1955
EKGYO	110
ENKAI	470
EREGL	200
FROTO	455
GARAN	720
HALKB	245
ISCTR	75
KCHOL	995
KRDMD	200
PETKM	100
PGSUS	920
SAHOL	510

Halka Açık (Tasnif Dışı)

SISE	235
TAVHL	1520
TCELL	580
THYAO	1640
TOASO	1660
TTKOM	320
TUPRS	1120
USDTRY	2320
VAKBN	175
XU030	8560
YKBNK	210
<b>6)Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin )</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiziki Teslimat Teminatı (%) (Physical Delivery Margin )</b>
USDTRY	11.0
<b>7)Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
AEFES	225
AKBNK	900
AKSEN	870
ALARK	1,050
ARCLK	1,015
ASELS	4,230
ASTOR	3,500
BIMAS	3,525
BRSAN	6,285

Halka Açık (Tasnif Dışı)

CIMSA	490
CNHTRY	2,935
DOAS	2,075
DOHOL	220
EKGYO	250
ELCBASM	19,560
ELCBASQ	31,925
ELCBASY	69,090
ENJSA	1,030
ENKAI	935
EREGL	430
EURTRY	2,215
FROTO	925
GARAN	1,485
GUBRF	5,415
HALKB	545
HEKTS	35
ISCTR	145
KCHOL	1,885
KONTR	40
TRMET	1,160
TRALT	570
KRDMD	395
MGROS	6,870
ODAS	90
OYAKC	205
PETKM	205
PGSUS	1,880
RUBTRY	7,925
SAHOL	960
SASA	25
SASX10	65
SISE	440

Halka Açık (Tasnif Dışı)

SOKM	470
TAVHL	3,250
TCELL	1,110
THYAO	3,310
TKFEN	1,485
TLREF	2,095
TOASO	3,740
TRT	3,650
TSKB	125
TTKOM	665
TUPRS	2,195
ULKER	1,055
USDTRY	2,050
VAKBN	340
VESTL	275
X10XB	10,665
XAUTRY	640
XLBNK	10,865
XSD25	10,230
XU030	9,375
YKBNK	470
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
EURUSD	40
GBPUSD	45
XAGUSD	85
XAUUSD	305
XCUUSD	80
XPDUUSD	165
XPTUSD	180

Halka Açık (Tasnif Dışı)

Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)	975

#### OTC- BISTECH NAKİT AKIM TEMİNATLANDIRMA YÖNTEMİ TEMEL BİLEŞEN PARAMETRE TABLOSU

Tezgaah Üstü Türev Ürünler	
Vade (Gün)	PC1
O/N	9.00%
30	9.00%
60	9.00%
90	9.00%
180	9.00%
270	7.06%
365	7.26%
720	6.70%
1095	5.80%
1460	4.91%
1825	4.52%
2555	4.01%
3650	4.79%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

**KIYMETLİ MADENLER VE KIYMETLİ TAŞLAR PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>KIYMETLİ MADENLER PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (PMD TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>						
<b>Kıymetli Madenler (Precious Metals)</b>	<b>Vade Gününe Göre FDA ve Birim Teminat Değerleri (Price Scan Range-PSR &amp; Unit Margin)</b>			<b>Alış/Satış Fark Teminatı (B/A Spread)</b>	<b>PTRM Birim Teminat Ölçeklendirme Katsayısı (Unit Margin Coefficient)</b>	<b>Günsonu Sürdürme Seviyesi Katsayısı (Maintenance Margin Coefficient)</b>
	<b>0-2</b>	<b>03-10</b>	<b>11 ve üzeri (11 and more)</b>			
<b>Altın (Gold)</b>	6.00%	7.20%	14.00%	6.00%	200%	100%
<b>Gümüş(Silver)</b>	11.00%	13.30%	20.00%	11.00%		
<b>Paladyum(Palladium)</b>	8.10%	10.00%	19.30%	8.10%		
<b>Platin(Platinum)</b>	7.90%	9.70%	16.00%	7.90%		

**ÖDÜNÇ PAY PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)</b>	
<b>Gruplar (Groups)</b>	<b>Risk Parametreleri (Risk Parameters)</b>
<b>BIST30</b>	114%
<b>BIST30 Dışı</b>	115%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

#### TAKASBANK PARA PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU

TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET)	
RMD (VaR)	
4.14%	

#### PARA PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU

PARA PİYASASI İŞLEMLERİNDE KULLANILACAK RİSK VE TEMİNAT PARAMETRELERİ	
Başlangıç Teminatı Risk Parametresi	5%
Teminat Dönüşüm Parametresi	105%
Alacak Dağıtım Parametresi	10%

**BİAŞ SWAP PİYASASI VADE BAZLI MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU</b>		
<b>(TABLE OF RISK PARAMETERS)</b>		
<b>Sözleşmeler</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Alış Marjin Oranı</b> <b>(%)</b> <b>(Buy Side Initial</b> <b>Margin Ratio)(%)</b>	<b>Satış Başlangıç Marjin Oranı</b> <b>(%)</b> <b>(Sell Side Initial Margin</b> <b>Ratio)(%)</b>
XAUUSD	10.50%	10.50%
XAUEUR	9.80%	9.80%
XAUTRY	13.70%	13.70%
USDTRY	10.70%	10.70%
EURTRY	10.50%	10.50%

<b>Sözleşmeler Arası Risk Analizi</b>	
<b>(Spread Credit)</b>	
<b>SWAP Sözleşmeleri</b>	
<b>Sözleşmeler</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Kredi Oranları (%)</b> <b>(Spread Credit)</b>
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)</i>	
XAUUSD - XAUTRY	60
XAUUSD - XAUEUR	50
XAUEUR-XAUTRY	50

Halka Açık (Tasnif Dışı)

**TAKASBANK ÇEK TAKASI PARAMETRE TABLOSU**

<b>TAKASBANK ÇEK TAKASI GARANTİ MEKANİZMASI KATKI PAYI</b>	
<b>Katkı Payı</b>	5%
<b>Ek Katkı Payı</b>	2.5%