

Genel Mektup : 2169

İstanbul, 11/09/2026

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. 15.09.2026 Salı 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 15.09.2026 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 15.09.2026 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. 15.09.2026 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.09.2026 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 15.09.2026 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

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri



DEĞİŞEN RİSK PARAMETRELERİ

1)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	205
	AKBNK	855
	AKSEN	915
	ALARK	1,165
	ARCLK	930
	ASELS	4,700
	ASTOR	3,465
	BIMAS	4,110
	BRSAN	8,210
	CIMSA	465
	CNHTRY	3,100
	DOAS	1,855
	DOHOL	225
	EKGYO	255
	ELCBASM	33,985
	ELCBASQ	55,475
	ELCBASY	120,055
	ENJSA	1,255
	ENKAI	925
	EREGL	405
	EURTRY	2,345
	FROTO	880
	GARAN	1,440
	GUBRF	5,710
	HALKB	620

Halka Açık (Tasnif Dışı)

HEKTS	30
ISCTR	135
KCHOL	2,155
TRMET	1,465
TRALT	635
KRDMD	460
MGROS	5,695
ODAS	80
OYAKC	235
PETKM	265
PGSUS	1,845
RUBTRY	7,665
SAHOL	935
SASA	30
SASX10	65
SISE	430
SOKM	605
TAVHL	3,120
TCELL	1,020
THYAO	3,005
TKFEN	2,410
TLREF	1,955
TOASO	3,315
TRT	3,760
TSKB	115
TTKOM	600
TUPRS	4,450
ULKER	960
USDTRY	2,135
VAKBN	365
VESTL	280
X10XB	12,435
XAUTRY	710

Halka Açık (Tasnif Dışı)

XLBNK	10,355
XSD25	10,805
XU030	9,740
YKBNK	430
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	40
GBPUSD	50
XAGUSD	95
XAUUSD	325
XCUUSD	85
XPDUSD	175
XPTUSD	200

MEVCUTTA GEÇERLİ OLAN RİSK PARAMETRELERİ

BAP-BISTECH NAKİT AKIM TEMİNATLANDIRMA YÖNTEMİ TEMEL BİLEŞEN PARAMETRE TABLOSU

	TL DİBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)	ENFLASYONA ENDEKSLİ TL DİBS ÜRÜN GRUBU(INFLATION - INDEXED TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)	BANKA İHRACI ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (FINANCIAL CORPORATE BONDS)	BANKA DIŞI İHRAÇ ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (NON-FINANCIAL CORPORATE BONDS)	YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (DOLAR) (USD EUROBOND)	YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (EURO) (EURO EUROBOND)
Vade (Gün)	PC1	PC1	PC1	PC1	PC1	PC1
1-7	30.00%	30.00%	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%
180	12.22%	1.26%	42.43%	50.00%	29.21%	27.35%
365	7.72%	0.82%	46.80%	50.00%	13.63%	12.93%
730	4.75%	0.67%	32.42%	36.83%	6.79%	6.63%
1825	4.75%	2.01%	10.63%	14.04%	2.66%	2.63%
3650	4.75%	1.24%	8.97%	11.15%	1.37%	1.93%
10950					1.37%	1.93%

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 Bonosu,

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 REPO PARAMETRE TABLOSU

	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
Pay Repoya Konu Kıymetler (Equity Repo)	
AEFES	20%
AKBNK	15%
AKSEN	20%
ALARK	15%
AELS	15%
ASTOR	20%
BIMAS	15%
BRSAN	20%
BTCIM	20%
CANTE	23%
COLA	15%
CIMSA	15%
DSTKF	23%
ECILC	20%
EFOR	23%
EKGYO	15%
ENKAI	15%
EREGL	15%
FROTO	15%
GARAN	15%
GLRMK	20%
GUBRF	23%
HALKB	15%
HEKTS	20%
ISCTR	15%
KCHOL	15%
KRDMD	15%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

KTLEV	23%
KUYAS	23%
MGROS	15%
MIATK	20%
OYAKC	15%
PASEU	23%
PETKM	20%
PGSUS	15%
SAHOL	15%
SASA	20%
SISE	15%
TAVHL	20%
TCELL	15%
THYAO	15%
TOASO	15%
TRALT	20%
TRMET	20%
TTKOM	15%
TUPRS	15%
TURSG	15%
ULKER	15%
VAKBN	15%
YKBNK	15%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

PAY PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU

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

Halka Açık (Tasnif Dışı)

VADELİ İŞLEM VE OPSİYON PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU

BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)	
2) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)
AEFES	14.1
AKBNK	15.7
AKSEN	15.3
ALARK	13.4
ARCLK	13.1
ASELS	15.8
ASTOR	16.1
BIMAS	12.7
BRSAN	15.5
CIMSA	13.8
CNHTRY	10.7
DOAS	15.1
DOHOL	14.1
EKGYO	16.1
ELCBASM	20.0
ELCBASQ	11.0
ELCBASY	6.0
ENJSA	14.3
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	15.5
ISCTR	13.5
KCHOL	12.8
KRDMD	13.4
MGROS	14.1
ODAS	15.1
OYAKC	14.4
PETKM	14.3
PGSUS	16.1
RUBTRY	17.7
SAHOL	13.2
SASA	14.8
SASX	5.7
SISE	13.2
SOKM	13.4
TAVHL	15.3
TCELL	13.4
THYAO	13.4
TKFEN	15.1
TLREF (Vade Dışı)	8.3
TLREF (Vade İçi)	9.1
TOASO	15.3
TRALT	16.1
TRMET	14.1
TRT020926T17	12.2
TRT131130T14	25.2
TSKB	14.1
TTKOM	14.4
TUPRS	14.3
ULKER	13.7
USDTRY	11.0

Halka Açık (Tasnif Dışı)

VAKBN	14.1
VESTL	14.5
X10XB	11.8
XAUTRY	14.0
XLBNK	13.7
XSD25	11.4
XU030	11.4
YKBNK	15.8
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	5.0
GBPUSD	5.0
XAGUSD	20.0
XAUUSD	10.0
XCUUSD	8.1
XPDUSD	18.0
XPTUSD	15.0
3) 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
4) Volatilite Değişim Aralığı (Volatility Scan Range-VSR)	
Kontratlar (Contracts)	Volatilite Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range - VSR)
AKBNK	31
ALARK	28
ARCLK	30
ASELS	33
BIMAS	32
EKGYO	28
ENKAI	33

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
5)Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)
* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)	
USDTRY-USDTRYK	100
ELCBASQ-ELCBASM	100
ELCBASY-ELCBASQ	100
ELCBASY-ELCBASM	100

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
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-TCCELL	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
HALKB-ISCTR	50

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
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
GARAN-AKBNK	1.84

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
KCHOL-SAHOL	2.08

Halka Açık (Tasnif Dışı)

XU030-PGSUS	8.89
XU030-TCCELL	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-TCCELL	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
GBPUSD-EURUSD	1.15

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
6) Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (Short Option Minimum Risk)	
Opsiyon Sözleşmeleri (Options)	
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
SISE	235

Halka Açık (Tasnif Dışı)

TAVHL	1520
TCELL	580
THYAO	1640
TOASO	1660
TTKOM	320
TUPRS	1120
USDTRY	2320
VAKBN	175
XU030	8560
YKBNK	210
7)Fiziki Teslimat Teminatı (Physicial Delivery Margin)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (%) (Physicial Delivery Margin)
USDTRY	11.0
Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)	1060

OTC- BISTECH NAKİT AKIM TEMİNATLANDIRMA YÖNTEMİ TEMEL BİLEŞEN PARAMETRE TABLOSU

Tezgah 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	6.63%
1095	5.71%
1460	4.86%
1825	4.51%
2555	3.95%
3650	4.39%

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

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

ÖDÜNÇ PAY PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU

ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)	
Ödünç Pay Piyasasına Konu Kıymetler	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
AEFES	120%
AKBNK	115%
AKSEN	120%
ALARK	115%
ASELS	115%
ASTOR	120%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

BIMAS	115%
BRSAN	120%
BTCIM	120%
CANTE	123%
CCOLA	115%
CIMSA	115%
DSTKF	123%
ECILC	120%
EFOR	123%
EKGYO	115%
ENKAI	115%
EREGL	115%
FROTO	115%
GARAN	115%
GLRMK	120%
GUBRF	123%
HALKB	115%
HEKTS	120%
ISCTR	115%
KCHOL	115%
KRDMD	115%
KTLEV	123%
KUYAS	123%
MGROS	115%
MIATK	120%
OYAKC	115%
PASEU	123%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

PETKM	120%
PGSUS	115%
SAHOL	115%
SASA	120%
SISE	115%
TAVHL	120%
TCELL	115%
THYAO	115%
TOASO	115%
TRALT	120%
TRMET	120%
TTKOM	115%
TUPRS	115%
TURSG	115%
ULKER	115%
VAKBN	115%
YKBNK	115%

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%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

BİAŞ SWAP PİYASASI VADE BAZLI MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU

BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU		
(TABLE OF RISK PARAMETERS)		
Sözleşmeler (Contracts)	Alış Marjın Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%)	Satış Başlangıç Marjın Oranı (%) (Sell Side Initial Margin Ratio)(%)
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%

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

TAKASBANK ÇEK TAKASI PARAMETRE TABLOSU

TAKASBANK ÇEK TAKASI GARANTİ MEKANİZMASI KATKI PAYI	
Katkı Payı	5%
Ek Katkı Payı	2.5%