

Genel Mektup : 1865

İstanbul, 03/03/2023

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.

07.03.2023 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 07.03.2023 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 07.03.2023 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.

07.03.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 06.03.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 07.03.2023 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

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri (6 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSV5FNZTF0> 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	970
AKBNK	330
AKSEN	635
ALARK	1400
ARCLK	2095
ASELS	1020
BIMAS	1935
CNHTRY	4150
DOHOL	170
ECILC	515
EKGYO	155
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	605
EREGL	825
EURTRY	3005
FROTO	11380
GARAN	430
GUBRF	4240
HALKB	200
HEKTS	660
ISCTR	210
ISGYO	195

KARSN	160
KCHOL	1320
KOZAA	855
KOZAL*	465
KRDMD	415
MGROS	2785
ODAS	140
OYAKC	640
PETKM	310
PGSUS	9170
RUBTRY	5630
SAHOL	860
SASA	2230
SASX10	80
SISE	815
SKBNK	40
SOKM	455
TAVHL	1325
TCELL	555
THYAO	2640
TKFEN	635
TLREF (Vade Dışı)	3590
TLREF (Vade İçi)	1605
TOASO	2970
TRT200923T18	2110
TRT020926T17	6855
TRT131130T14	11570
TSKB	70
TTKOM	330
TUPRS	10810
USDTRY	2680
USDTRYK	2680
VAKBN	165

VESTL	1070
X10XB	12045
XAUTRY	175
XLBNK	6750
XU030	7715
YKBNK	180
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	35
XAUUSD	140
XPDUUSD	345
XPTUSD	120
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	970
AKBNK	330
AKSEN	635
ALARK	1400
ARCLK	2095
ASELS	1020
BIMAS	1935
CNHTRY	4150

DOHOL	170
ECILC	515
EKGYO	155
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	605
EREGL	825
EURTRY	3005
FROTO	11380
GARAN	430
GUBRF	4240
HALKB	200
HEKTS	660
ISCTR	210
ISGYO	195
KARSN	160
KCHOL	1320
KOZAA	855
KOZAL*	465
KRDMD	415
MGROS	2785
ODAS	140
OYAKC	640
PETKM	310
PGSUS	9170
RUBTRY	5630
SAHOL	860
SASA	2230
SASX10	80
SISE	815
SKBNK	40
SOKM	455

TAVHL	1325
TCELL	555
THYAO	2640
TKFEN	635
TLREF	3590
TOASO	2970
TRT	560
TSKB	70
TTKOM	330
TUPRS	10810
USDTRY	2680
USDTRYK	2680
VAKBN	165
VESTL	1070
X10XB	12045
XAUTRY	175
XLBNK	6750
XU030	7715
YKBNK	180
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	35
XAUUSD	140
XPDUUSD	345
XPTUSD	120

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	2680
USDTRYK	2680

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