BSPZD6LE8N

Genel Mektup : 2171 İstanbul, 29/09/2026

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. 01.10.2026 Perşembe 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 01.10.2026 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 01.10.2026 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. 01.10.2026 Perşembe günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 30.09.2026 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 01.10.2026 Perşembe 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.

Semanur CERRAHOĞLU
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri

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

	TL DIBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)	ENFLASYONA ENDEKSLİ TL DIBS 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%	1.24%	42.43%	50.00%	29.27%	27.39%
365	7.72%	0.80%	46.80%	50.00%	13.66%	12.97%
730	4.75%	0.66%	32.64%	37.06%	6.80%	6.64%
1825	4.75%	1.97%	10.73%	14.13%	2.66%	2.63%
3650	4.75%	1.22%	9.10%	11.29%	1.37%	1.84%
10950					1.37%	1.84%

1-) TL DIBS 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.

Halka Açık (Tasnif Dışı)

PAY REPO PARAMETRE TABLOSU

	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
Pay Repoya Konu Kıymetler (Equity Repo)	
AEFES	20%
AKBNK	15%
AKSEN	20%
ALARK	20%
ASELS	15%
ASTOR	20%
BIMAS	15%
BRSAN	26%
BTCIM	26%
CANTE	26%
CCOLA	15%
CIMSA	15%
EKGYO	15%
ENKAI	15%
EREGL	15%
FROTO	15%
GARAN	15%
GLRMK	20%
GUBRF	20%
HALKB	15%
HEKTS	26%
ISCTR	15%
KCHOL	15%
KRDMD	15%
MGROS	15%
OYAKC	15%
PETKM	20%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

PGSUS	15%
SAHOL	15%
SASA	26%
SISE	15%
TAVHL	15%
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)	
1) 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	17.0
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	13.3
SOKM	13.4
TAVHL	15.3
TCELL	13.4
THYAO	13.4
TKFEN	15.1
TLREF (Vade Dışı)	8.9
TLREF (Vade İçi)	9.9
TOASO	15.3
TRALT	16.1
TRMET	14.1
TRT131130T14	25.2
TSKB	14.1
TTKOM	14.4
TUPRS	14.3
ULKER	13.7
USDTRY	11.0
VAKBN	14.1

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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
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) Volatilite Değişim Aralığı (Volatility Scan Range-VSR)	
Kontratlar (Contracts)	**Volatilite Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range - VSR)**
AKBNK	32
ALARK	28
ARCLK	30
ASELS	33
BIMAS	31
EKGYO	29
ENKAI	33
EREGL	28

Halka Açık (Tasnif Dışı)

FROTO	25
GARAN	30
HALKB	34
ISCTR	30
KCHOL	27
KRDMD	25
PETKM	28
PGSUS	27
SAHOL	27
SISE	29
TAVHL	27
TCELL	29
THYAO	28
TOASO	24
TTKOM	29
TUPRS	27
USDTRY	32
VAKBN	32
XU030	32
YKBNK	28
4)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 göredir (Priority is applied as follows)***	
USDTRY-USDTRYK	100
ELCBASQ-ELCBASM	100
ELCBASY-ELCBASQ	100
ELCBASY-ELCBASM	100
XLBNK-AKBNK	70

X10XB-XU030	70
XLBNK-ISCTR	70
XLBNK-YKBNK	70
XLBNK-GARAN	70
CNHTRY-USDTRY	70
GARAN-AKBNK	70
XU030-XLBNK	60
AKBNK-YKBNK	60
AKBNK-ISCTR	60
YKBNK-ISCTR	60
XU030-AKBNK	60
GARAN-ISCTR	60
XU030-GARAN	60
XU030-ISCTR	60
GARAN-YKBNK	60
XLBNK-VAKBN	60
XAUUSD-XAGUSD	60
XU030-SAHOL	60
XU030-YKBNK	60
XU030-KCHOL	60
HALKB-VAKBN	60
CNHTRY-EURTRY	60
TRMET-TRALT	60
X10XB-THYAO	60
AKBNK-VAKBN	60
VAKBN-ISCTR	60
THYAO-PGSUS	60
X10XB-SISE	60
EURTRY-USDTRY	60
XU030-VAKBN	60
GARAN-VAKBN	60
XLBNK-SAHOL	60
X10XB-EREGL	50

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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

Halka Açık (Tasnif Dışı)

X10XB-ISCTR	50
AKBNK-TSKB	50
X10XB-TCELL	50
EURTRY-XAUTRY	50
VAKBN-TSKB	50
HALKB-YKBNK	50
X10XB-EKGYO	50
XAGUSD-XPTUSD	50
X10XB-PGSUS	50
XU030-TCELL	50
X10XB-AKBNK	50
XU030-TUPRS	50
XU030-ASELS	50
SAHOL-VAKBN	50
GARAN-HALKB	50
X10XB-ARCLK	50
YKBNK-TSKB	50
X10XB-TTKOM	50
Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)	
USDTRY-USDTRYK	1
ELCBASQ-ELCBASM	3
ELCBASY-ELCBASQ	4
ELCBASY-ELCBASM	12
XLBNK-AKBNK	20.59
X10XB-XU030	1.21
XLBNK-ISCTR	109.48
XLBNK-YKBNK	40.63
XLBNK-GARAN	11.07
CNHTRY-USDTRY	1.48
GARAN-AKBNK	1.86
XU030-XLBNK	1.13
AKBNK-YKBNK	1.97

Halka Açık (Tasnif Dışı)

AKBNK-ISCTR	5.32
YKBNK-ISCTR	2.69
XU030-AKBNK	23.19
GARAN-ISCTR	9.89
XU030-GARAN	12.47
XU030-ISCTR	123.3
GARAN-YKBNK	3.67
XLBNK-VAKBN	45.41
XAUUSD-XAGUSD	6.77
XU030-SAHOL	17.86
XU030-YKBNK	45.76
XU030-KCHOL	7.95
HALKB-VAKBN	1.27
CNHTRY-EURTRY	1.29
TRMET-TRALT	2.58
X10XB-THYAO	6.29
AKBNK-VAKBN	2.21
VAKBN-ISCTR	2.41
THYAO-PGSUS	1.97
X10XB-SISE	46.74
EURTRY-USDTRY	1.15
XU030-VAKBN	51.15
GARAN-VAKBN	4.1
XLBNK-SAHOL	15.86
X10XB-EREGL	49.29
YKBNK-VAKBN	1.12
X10XB-TUPRS	5.95
XLBNK-TSKB	127.78
XAUUSD-XAUTRY	28.73
XU030-THYAO	5.2
XLBNK-HALKB	35.63
KCHOL-SAHOL	2.25
SAHOL-AKBNK	1.3

Halka Açık (Tasnif Dışı)

X10XB-SAHOL	21.59
GBPUSD-EURUSD	1.17
X10XB-KCHOL	9.61
X10XB-KRDMD	46.35
XU030-SISE	38.66
X10XB-ASELS	5.25
XU030-HALKB	40.13
XU030-KRDMD	38.34
SAHOL-ISCTR	6.9
XU030-EKGYO	82.56
XU030-TSKB	143.92
GARAN-SAHOL	1.43
X10XB-PETKM	96.52
KRDMD-EREGL	1.06
GARAN-TSKB	11.55
SAHOL-YKBNK	2.56
XLBNK-KCHOL	7.06
X10XB-XLBNK	1.36
XU030-EREGL	40.78
XU030-PETKM	79.85
XU030-TTKOM	29.33
AKBNK-HALKB	1.73
ISCTR-TSKB	1.17
HALKB-ISCTR	3.07
XU030-PGSUS	10.27
X10XB-ISCTR	149.04
AKBNK-TSKB	6.21
X10XB-TCELL	18.87
EURTRY-XAUTRY	7.67
VAKBN-TSKB	2.81
HALKB-YKBNK	1.14
X10XB-EKGYO	99.8
XAGUSD-XPTUSD	17.73

Halka Açık (Tasnif Dışı)

X10XB-PGSUS	12.42
XU030-TCELL	15.61
X10XB-AKBNK	28.03
XU030-TUPRS	4.93
XU030-ASELS	4.34
SAHOL-VAKBN	2.86
GARAN-HALKB	3.22
X10XB-ARCLK	20.5
YKBNK-TSKB	3.14
X10XB-TTKOM	35.45
5) Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (Short Option Minimum Risk)	
Opsiyon Sözleşmeleri (Options)	
AKBNK	355
ALARK	545
ARCLK	445
ASELS	1895
BIMAS	2090
EKGYO	95
ENKAI	425
EREGL	180
FROTO	385
GARAN	660
HALKB	235
ISCTR	65
KCHOL	1090
KRDMD	220
PETKM	105
PGSUS	750
SAHOL	450
SISE	200
TAVHL	1355

TCELL	495
THYAO	1445
TOASO	1435
TTKOM	260
TUPRS	2060
USDTRY	2435
VAKBN	165
XU030	8180
YKBNK	175
6)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
7)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	190
AKBNK	815
AKSEN	755
ALARK	1,025
ARCLK	825
ASELS	4,235
ASTOR	2,840
BIMAS	4,000
BRSAN	7,420
CIMSA	435
CNHTRY	3,120

DOAS	1,695
DOHOL	205
EKGYO	225
ELCBASM	25,270
ELCBASQ	41,250
ELCBASY	89,270
ENJSA	1,130
ENKAI	885
EREGL	385
EURTRY	2,315
FROTO	800
GARAN	1,375
GUBRF	4,920
HALKB	550
HEKTS	20
ISCTR	125
KCHOL	2,025
TRMET	1,405
TRALT	555
KRDMD	460
MGROS	5,560
ODAS	70
OYAKC	220
PETKM	215
PGSUS	1,715
RUBTRY	7,700
SAHOL	850
SASA	20
SASX10	60
SISE	375
SOKM	560
TAVHL	3,060
TCELL	985

Halka Açık (Tasnif Dışı)

THYAO	2,880
TKFEN	3,065
TLREF	2,100
TOASO	3,195
TRT	3,750
TSKB	100
TTKOM	575
TUPRS	4,260
ULKER	870
USDTRY	2,155
VAKBN	345
VESTL	205
X10XB	11,360
XAUTRY	685
XLBNK	9,775
XSD25	9,980
XU030	8,825
YKBNK	415
Kontratlar (Contracts)	**Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)**
EURUSD	40
GBPUSD	45
XAGUSD	90
XAUUSD	310
XCUUSD	85
XPDUSD	165
XPTUSD	195

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)	1035

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%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

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)	
Gruplar (Groups)	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
AEFES	120%
AKBNK	115%
AKSEN	120%
ALARK	120%
ASELS	115%
ASTOR	120%
BIMAS	115%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

BRSAN	126%
BTCIM	126%
CANTE	126%
CCOLA	115%
CIMSA	115%
CVKMD	120%
CWENE	126%
DOAS	115%
ECILC	126%
EKGYO	115%
ENERY	126%
ENKAI	115%
EREGL	115%
FROTO	115%
GARAN	115%
GLRMK	120%
GUBRF	120%
HALKB	115%
HEKTS	126%
ISCTR	115%
KCHOL	115%
KRDMD	115%
MAVI	120%
MGROS	115%
OYAKC	115%
PETKM	120%
PGSUS	115%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

SAHOL	115%
SASA	126%
SISE	115%
TAVHL	115%
TCELL	115%
THYAO	115%
TOASO	115%
TRALT	120%
TRMET	120%
TSKB	115%
TTKOM	115%
TUPRS	115%
TURSG	115%
ULKER	115%
VAKBN	115%
YKBNK	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	7%
Teminat Dönüşüm Parametresi	107%
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 Marjin Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%)	Satış Başlangıç Marjin 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 göredir* *(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%

Halka Açık (Tasnif Dışı)