

Genel Mektup : 1882

İstanbul, 28/04/2023

**MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME 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.

03.05.2023 Çarşamba günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 03.05.2023 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 03.05.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

03.05.2023 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 02.05.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 03.05.2023 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 (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSU52NZ9C0> 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



EK: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

<b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI)</b> <b>(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>	
<b>1) Fiyat Değişim Aralığı</b> <b>(Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (%)</b> <b>(Price Scan Range - PSR)</b>
ELCBASM	20
ELCBASQ	11
ELCBASY	6
<b>2) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı</b> <b>(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) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski</b> <b>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b> <b>(Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar</b> <b>(Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL)</b> <b>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>
AEFES	755
AKBNK	225
AKSEN	380
ALARK	830
ARCLK	1255
ASELS	620
BIMAS	1625
CNHTRY	3210
DOHOL	115
ECILC	405

EKGYO	80
ELCBASM	10605
ELCBASQ	18225
ELCBASY	39435
ENJSA	350
ENKAI	385
EREGL	390
EURTRY	2405
FROTO	7510
GARAN	380
GUBRF	3135
HALKB	170
HEKTS	415
ISCTR	170
ISGYO	130
KARSN	120
KCHOL	925
KOZAA	535
KOZAL	320
KRDMD	240
MGROS	2605
ODAS	85
OYAKC	405
PETKM	175
PGSUS	6515
RUBTRY	4015
SAHOL	480
SASA	1440
SASX10	55
SISE	560
SKBNK	30
SOKM	435
TAVHL	980

TCELL	425
THYAO	1680
TKFEN	410
TLREF	2420
TOASO	2545
TRT	530
TSKB	60
TTKOM	245
TUPRS	875
USDTRY	2065
USDTRYK	2050
VAKBN	135
VESTL	605
X10XB	8610
XAUTRY	150
XLBNK	5535
XSD25	6480
XU030	5975
YKBNK	130
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	115
XPDUSD	280
XPTUSD	105