

Genel Mektup : 1745

İstanbul, 24/12/2021

**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 ve Borçlanma Araçları Piyasası'nda işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri piyasa koşulları ve dayanak varlık fiyatlarındaki değişimler dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

28.12.2021 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 28.12.2021 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 28.12.2021 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

28.12.2021 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 27.12.2021 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 28.12.2021 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\_24.12.2021 (6 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSPBK62ML4> 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-1: BAP-BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu**

| <b>Fiyat Değişim Aralığı<br/>(Price Scan Range-PSR)</b>    |                                                                |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>                          | <b>Fiyat Değişim Aralığı (TL)<br/>(Price Scan Range - PSR)</b> |
| <b>Altına Dayalı Devlet Tahvili<br/>(Gold Backed Bond)</b> | <b>110</b>                                                     |

EK-2: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

| <b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI)</b><br><b>(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b> |                                                                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------|
| <b>1) Fiyat Değişim Aralığı</b><br><b>(Price Scan Range-PSR)</b>                                                   |                                                                      |
| <b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri</b><br><b>(Futures and Options)</b>                           |                                                                      |
| <b>Kontratlar</b><br><b>(Contracts)</b>                                                                            | <b>Fiyat Değişim Aralığı (TL)</b><br><b>(Price Scan Range - PSR)</b> |
| AEFES                                                                                                              | 465                                                                  |
| AKBNK                                                                                                              | 125                                                                  |
| ALKIM                                                                                                              | 300                                                                  |
| ARCLK                                                                                                              | 735                                                                  |
| ASELS                                                                                                              | 365                                                                  |
| BIMAS                                                                                                              | 870                                                                  |
| COLA                                                                                                               | 1250                                                                 |
| CNHTRY                                                                                                             | 2240                                                                 |
| DOHOL                                                                                                              | 50                                                                   |
| ECILC                                                                                                              | 120                                                                  |
| EKGYO                                                                                                              | 35                                                                   |
| ENJSA                                                                                                              | 210                                                                  |
| EREGL                                                                                                              | 405                                                                  |
| EURTRY                                                                                                             | 1625                                                                 |
| FROTO                                                                                                              | 4575                                                                 |
| GARAN                                                                                                              | 205                                                                  |
| GUBRF                                                                                                              | 1305                                                                 |
| HALKB                                                                                                              | 75                                                                   |
| HEKTS                                                                                                              | 210                                                                  |
| ISCTR                                                                                                              | 125                                                                  |
| ISFIN                                                                                                              | 95                                                                   |
| ISGYO                                                                                                              | 40                                                                   |
| KARSN                                                                                                              | 65                                                                   |
| KCHOL                                                                                                              | 365                                                                  |

|         |      |
|---------|------|
| KOZAA   | 370  |
| KOZAL   | 2010 |
| KRDMD   | 160  |
| MGROS   | 665  |
| MPARK   | 615  |
| ODAS    | 25   |
| OYAKC   | 120  |
| PETKM   | 130  |
| PGSUS   | 1535 |
| RUBTRY  | 1970 |
| SAHOL   | 185  |
| SASA    | 1210 |
| SISE    | 215  |
| SKBNK   | 15   |
| SOKM    | 210  |
| TAVHL   | 530  |
| TCELL   | 245  |
| THYAO   | 330  |
| TKFEN   | 285  |
| TOASO   | 1035 |
| TRGYO   | 70   |
| TSKB    | 25   |
| TTKOM   | 165  |
| TUPRS   | 2550 |
| TURSG   | 100  |
| ULKER   | 270  |
| USDTRY  | 1380 |
| USDTRYK | 1380 |
| VAKBN   | 60   |
| VESTL   | 520  |
| X10XB   | 2750 |
| XAUTRY  | 110  |
| XLBNK   | 2310 |

|                                                                                                                    |                                                                                       |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| XU030                                                                                                              | 2050                                                                                  |
| YKBNK                                                                                                              | 55                                                                                    |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>                                                                                  | <b>Fiyat Değişim Aralığı (USD)<br/>(Price Scan Range - PSR)</b>                       |
| EURUSD                                                                                                             | 25                                                                                    |
| GBPUSD                                                                                                             | 45                                                                                    |
| XAGUSD                                                                                                             | 30                                                                                    |
| XAUUSD                                                                                                             | 110                                                                                   |
| XPDUSD                                                                                                             | 285                                                                                   |
| XPTUSD                                                                                                             | 95                                                                                    |
| <b>2) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı<br/>(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<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b>                                |                                                                                       |
| <b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri<br/>(Futures and Options)</b>                                 |                                                                                       |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>                                                                                  | <b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL)<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b> |
| AEFES                                                                                                              | 465                                                                                   |
| AKBNK                                                                                                              | 125                                                                                   |
| ALKIM                                                                                                              | 300                                                                                   |
| ARCLK                                                                                                              | 735                                                                                   |
| ASELS                                                                                                              | 365                                                                                   |
| BIMAS                                                                                                              | 870                                                                                   |
| COLA                                                                                                               | 1250                                                                                  |
| CNHTRY                                                                                                             | 2240                                                                                  |
| DOHOL                                                                                                              | 50                                                                                    |
| ECILC                                                                                                              | 120                                                                                   |
| EKGYO                                                                                                              | 35                                                                                    |
| ENJSA                                                                                                              | 210                                                                                   |

|               |      |
|---------------|------|
| <b>EREGL</b>  | 405  |
| <b>EURTRY</b> | 1625 |
| <b>FROTO</b>  | 4575 |
| <b>GARAN</b>  | 205  |
| <b>GUBRF</b>  | 1305 |
| <b>HALKB</b>  | 75   |
| <b>HEKTS</b>  | 210  |
| <b>ISCTR</b>  | 125  |
| <b>ISFIN</b>  | 95   |
| <b>ISGYO</b>  | 40   |
| <b>KARSN</b>  | 65   |
| <b>KCHOL</b>  | 365  |
| <b>KOZAA</b>  | 370  |
| <b>KOZAL</b>  | 2010 |
| <b>KRDMD</b>  | 160  |
| <b>MGROS</b>  | 665  |
| <b>MPARK</b>  | 615  |
| <b>ODAS</b>   | 25   |
| <b>OYAKC</b>  | 120  |
| <b>PETKM</b>  | 130  |
| <b>PGSUS</b>  | 1535 |
| <b>RUBTRY</b> | 1970 |
| <b>SAHOL</b>  | 185  |
| <b>SASA</b>   | 1210 |
| <b>SISE</b>   | 215  |
| <b>SKBNK</b>  | 15   |
| <b>SOKM</b>   | 210  |
| <b>TAVHL</b>  | 530  |
| <b>TCELL</b>  | 245  |
| <b>THYAO</b>  | 330  |
| <b>TKFEN</b>  | 285  |
| <b>TOASO</b>  | 1035 |
| <b>TRGYO</b>  | 70   |

|                                                                                    |                                                                                        |
|------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| TSKB                                                                               | 25                                                                                     |
| TTKOM                                                                              | 165                                                                                    |
| TUPRS                                                                              | 2550                                                                                   |
| TURSG                                                                              | 100                                                                                    |
| ULKER                                                                              | 270                                                                                    |
| USDTRY                                                                             | 1380                                                                                   |
| USDTRYK                                                                            | 1380                                                                                   |
| VAKBN                                                                              | 60                                                                                     |
| VESTL                                                                              | 520                                                                                    |
| X10XB                                                                              | 2750                                                                                   |
| XAUTRY                                                                             | 110                                                                                    |
| XLBNK                                                                              | 2310                                                                                   |
| XU030                                                                              | 2050                                                                                   |
| YKBNK                                                                              | 55                                                                                     |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>                                                  | <b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD)<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b> |
| EURUSD                                                                             | 25                                                                                     |
| GBPUSD                                                                             | 45                                                                                     |
| XAGUSD                                                                             | 30                                                                                     |
| XAUUSD                                                                             | 110                                                                                    |
| XPDUSD                                                                             | 285                                                                                    |
| XPTUSD                                                                             | 95                                                                                     |
| <b>4) Fiziki Teslimat Teminatı<br/>(Physical Delivery Margin )</b>                 |                                                                                        |
| <b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri<br/>(Futures and Options)</b> |                                                                                        |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>                                                  | <b>Fiziki Teslimat Teminatı (TL)<br/>(Physical Delivery Margin )</b>                   |
| USDTRY                                                                             | 1380                                                                                   |
| USDTRYK                                                                            | 1380                                                                                   |