

Genel Mektup : 1875

İstanbul, 31/03/2023

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.

07.04.2023 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

23.11.2022 tarihinde de duyurulduğu üzere bu hesaplama döneminden itibaren yalnızca PSR değerleri oransal bir değer olarak açıklanacaktır.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 07.04.2023 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 07.04.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

07.04.2023 Cuma günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 06.04.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 07.04.2023 Cuma 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)



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 (%) (Price Scan Range - PSR)
AEFES	17.0
AKBNK	18.0
AKSEN	17.0
ALARK	16.0
ARCLK	16.0
AELS	17.0
BIMAS	14.0
CNHTRY	15.0
DOHOL	17.0
ECILC	17.0
EKGYO	18.0
ELCBASM	11.0
ELCBASQ	6.0
ELCBASY	3.0
ENJSA	17.0
EREGL	16.0
EURTRY	15.0
FROTO	18.0
GARAN	18.0
GUBRF	18.0
HALKB	18.0
HEKTS	19.0
ISCTR	19.0
ISGYO	18.0

KARSN	17.0
KCHOL	18.0
KOZAA	17.0
KOZAL	18.0
KRDMD	18.0
MGROS	18.0
ODAS	17.0
OYAKC	17.0
PETKM	17.0
PGSUS	18.0
RUBTRY	22.0
SAHOL	15.0
SASA	18.0
SASX10	8.0
SISE	17.0
SKBNK	19.0
SOKM	17.0
TAVHL	16.0
TCELL	17.0
THYAO	17.0
TKFEN	17.0
TLREF (Vade Dışı)	22.0
TLREF (Vade İçi)	18.0
TOASO	18.0
TRT200923T18	3.0
TRT020926T17	6.0
TRT131130T14	10.0
TSKB	19.0
TTKOM	17.0
TUPRS	17.0
USDTRY	14.0
USDTRYK	14.0
VAKBN	18.0

VESTL	17.0
X10XB	17.0
XAUTRY	14.0
XLBNK	17.0
XSD25	14.0
XU030	14.0
YKBNK	18.0
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	4.0
GBPUSD	4.0
XAGUSD	17.0
XAUUSD	7.0
XPDUSD	24.0
XPTUSD	12.0
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) 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	850
AKBNK	230
AKSEN	370
ALARK	765
ARCLK	1365
ASELS	705
BIMAS	1425

CNHTRY	3195
DOHOL	110
ECILC	375
EKGYO	90
ELCBASM	24930
ELCBASQ	42840
ELCBASY	92705
ENJSA	365
EREGL	455
EURTRY	2355
FROTO	7800
GARAN	365
GUBRF	2415
HALKB	135
HEKTS	355
ISCTR	175
ISGYO	120
KARSN	100
KCHOL	1035
KOZAA	495
KOZAL	265
KRDMD	240
MGROS	2050
ODAS	75
OYAKC	410
PETKM	185
PGSUS	5640
RUBTRY	4180
SAHOL	480
SASA	1320
SASX10	60
SISE	495
SKBNK	30

SOKM	360
TAVHL	875
TCELL	405
THYAO	1635
TKFEN	405
TLREF	2645
TOASO	2505
TRT	545
TSKB	50
TTKOM	210
TUPRS	7140
USDTRY	2040
USDTRYK	2040
VAKBN	115
VESTL	595
X10XB	8835
XAUTRY	145
XLBNK	5475
XSD25	6405
XU030	5910
YKBNK	125
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	115
XPDUUSD	260
XPTUSD	90

**4)Fiziki Teslimat Teminatı
(Physical Delivery Margin)**

**Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri
(Futures and Options)**

Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (%) (Physical Delivery Margin)
USDTRY	14.0
USDTRYK	14.0