

Genel Mektup : 2147

İstanbul, 13/05/2026

**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. 15.05.2026 Cuma 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 15.05.2026 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 15.05.2026 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. 15.05.2026 Cuma günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.05.2026 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 15.05.2026 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

**Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSNAK11S1N> 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



## DEĞİŞEN RİSK PARAMETRELERİ

<b>1)Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
AEFES	230
AKBNK	785
AKSEN	905
ALARK	1,015
ARCLK	1,055
ASELS	4,965
ASTOR	3,770
BIMAS	6,850
BRSAN	6,715
CIMSA	555
CNHTRY	2,865
DOAS	1,950
DOHOL	255
EKGYO	215
ELCBASM	12,015
ELCBASQ	19,615
ELCBASY	42,455
ENJSA	1,300
ENKAI	1,045
EREGL	410
EURTRY	2,405
FROTO	945
GARAN	1,380
GUBRF	7,230
HALKB	485

Halka Açık (Tasnif Dışı)

HEKTS	45
ISCTR	145
KCHOL	1,935
KONTR	110
TRMET	1,455
TRALT	555
KRDMD	450
MGROS	6,815
ODAS	80
OYAKC	255
PETKM	285
PGSUS	1,900
RUBTRY	8,165
SAHOL	1,005
SASA	35
SASX10	65
SISE	505
SOKM	515
TAVHL	3,085
TCELL	1,120
THYAO	3,070
TKFEN	1,635
TLREF	2,095
TOASO	3,260
TRT	3,620
TSKB	125
TTKOM	680
TUPRS	2,635
ULKER	1,315
USDTRY	2,070
VAKBN	335
VESTL	310
X10XB	12,255

Halka Açık (Tasnif Dışı)

<b>XAUTRY</b>	720
<b>XLBNK</b>	10,520
<b>XSD25</b>	10,935
<b>XU030</b>	10,000
<b>YKBNK</b>	420
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	25
<b>GBPUSD</b>	30
<b>XAGUSD</b>	130
<b>XAUUSD</b>	350
<b>XCUUSD</b>	80
<b>XPDUUSD</b>	200
<b>XPTUSD</b>	235

Halka Açık (Tasnif Dışı)

## MEVCUTTA GEÇERLİ OLAN RİSK PARAMETRELERİ

### BAP-BISTECH NAKİT AKIM TEMİNATLANDIRMA YÖNTEMİ TEMEL BİLEŞEN PARAMETRE TABLOSU

	TL DİBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)	ENFLASYONA ENDEKSLİ TL DİBS 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)
<b>Vade (Gün)</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>	<b>PC1</b>
1-7	30.00%	30.00%	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%
180	12.22%	0.98%	42.43%	50.00%	30.19%	30.11%
365	7.72%	0.64%	46.80%	50.00%	13.57%	14.30%
730	4.87%	0.73%	32.62%	37.14%	6.78%	7.19%
1825	4.87%	1.77%	10.74%	14.19%	2.65%	2.63%
3650	4.87%	1.09%	9.10%	11.34%	1.37%	2.35%
10950					1.37%	2.35%

1-) TL DİBS 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 Bonusu,

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.

**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	22%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları )	BISTDİĞER	20%
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**

<b>BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>	
<b>2) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)</b>
AEFES	15.1
AKBNK	14.4
AKSEN	14.3
ALARK	13.4
ARCLK	12.3
ASELS	15.8
ASTOR	15.1
BIMAS	11.7
BRSAN	16.6
CIMSA	13.4
CNHTRY	10.7
DOAS	14.1
DOHOL	14.1
EKGYO	14.1
ELCBASM	20
ELCBASQ	11
ELCBASY	6
ENJSA	14.8
ENKAI	13.8
EREGL	13.8
EURTRY	11.3
FROTO	13.4
GARAN	13.8

Halka Açık (Tasnif Dışı)

GUBRF	16.1
HALKB	16
HEKTS	13.6
ISCTR	13.8
KCHOL	12.7
KONTR	15.1
KRDMD	13.4
MGROS	13.4
ODAS	14.1
OYAKC	14.5
PETKM	14.2
PGSUS	14.1
RUBTRY	17.7
SAHOL	14.1
SASA	14.5
SASX10	5.7
SISE	13.2
SOKM	13.4
TAVHL	15.3
TCELL	13
THYAO	13.4
TKFEN	14.1
TLREF (Vade Dışı)	8.2
TLREF (Vade İçi)	9
TOASO	14
TRALT	16.1
TRMET	15.1
TRT020926T17	12.9
TRT131130T14	25.2
TSKB	14.1
TTKOM	14.1
TUPRS	13.8
ULKER	13.7

Halka Açık (Tasnif Dışı)



USDTRY	11.4
VAKBN	14.1
VESTL	14.1
X10XB	12.6
XAUTRY	14
XLBNK	13.9
XSD25	11.5
XU030	11.9
YKBNK	14.8
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (%) (Price Scan Range - PSR)</b>
EURUSD	3.2
GBPUSD	3.2
XAGUSD	20
XAUUSD	10
XCUUSD	8.1
XPDUUSD	18
XPTUSD	15
<b>3) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı (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>4) Volatilite Değişim Aralığı (Volatility Scan Range-VSR)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Volatilite Değişim Aralığı (%) (Volatility Scan Range - VSR)</b>
AKBNK	30
ALARK	28
ARCLK	31
ASELS	34
BIMAS	31
EKGYO	29

Halka Açık (Tasnif Dışı)

ENKAI	33
EREGL	29
FROTO	27
GARAN	30
HALKB	35
ISCTR	28
KCHOL	27
KRDMD	25
PETKM	28
PGSUS	30
SAHOL	26
SISE	29
TAVHL	28
TCELL	28
THYAO	27
TOASO	24
TTKOM	29
TUPRS	30
USDTRY	32
VAKBN	32
XU030	32
YKBNK	27
<b>5)Ürün Grupları Arası Risk Analizi (Inter-Commodity Spread Credit)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Ürün Grupları Arası Kredi Oranı (%) (Inter-Commodity Spread Credit)</b>
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre (Priority is applied as follows)</i>	
USDTRY-USDTRYK	100
ELCBASQ-ELCBASM	100
ELCBASY-ELCBASQ	100

Halka Açık (Tasnif Dışı)

ELCBASY-ELCBASM	100
TRT131130T14-TRT020926T17	100
X10XB-XU030	70
XLBNK-AKBNK	70
XLBNK-GARAN	70
XLBNK-ISCTR	70
XLBNK-YKBNK	70
CNHTRY-USDTRY	70
GARAN-AKBNK	60
XU030-AKBNK	60
XU030-ISCTR	60
XU030-SAHOL	60
XU030-YKBNK	60
XU030-KCHOL	60
XLBNK-XU030	60
AKBNK-ISCTR	60
AKBNK-YKBNK	60
X10XB-EREGL	60
GARAN-ISCTR	60
GARAN-YKBNK	60
YKBNK-ISCTR	60
X10XB-THYAO	60
HALKB-VAKBN	60
XLBNK-VAKBN	60
XAUUSD-XAGUSD	60
X10XB-SISE	60
TRMET-TRALT	60
AKBNK-VAKBN	60
VAKBN-ISCTR	60
EURTRY-USDTRY	60
XU030-GARAN	60
XU030-VAKBN	60
GARAN-VAKBN	60

Halka Açık (Tasnif Dışı)

THYAO-PGSUS	60
CNHTRY-EURTRY	60
YKBNK-VAKBN	50
X10XB-TUPRS	50
KRDMD-EREGL	50
XAUUSD-XAUTRY	50
XLBNK-HALKB	50
XU030-SISE	50
KCHOL-SAHOL	50
XU030-PGSUS	50
XU030-TCELL	50
XU030-THYAO	50
XU030-EREGL	50
X10XB-AKBNK	50
XU030-TUPRS	50
XU030-EKGYO	50
XU030-HALKB	50
XU030-KRDMD	50
XU030-PETKM	50
KCHOL-ISCTR	50
XU030-TTKOM	50
XU030-ASELS	50
XU030-TSKB	50
X10XB-ISCTR	50
SAHOL-AKBNK	50
AKBNK-HALKB	50
AKBNK-TSKB	50
SAHOL-VAKBN	50
GARAN-TSKB	50
GARAN-SAHOL	50
GARAN-HALKB	50
SAHOL-ISCTR	50
ISCTR-TSKB	50

Halka Açık (Tasnif Dışı)

HALKB-ISCTR	50
X10XB-TCELL	50
SAHOL-YKBNK	50
XLBNK-SAHOL	50
X10XB-SAHOL	50
VAKBN-TSKB	50
HALKB-YKBNK	50
GBPUSD-EURUSD	50
X10XB-EKGYO	50
XLBNK-KCHOL	50
X10XB-KCHOL	50
X10XB-KRDMD	50
X10XB-PGSUS	50
X10XB-PETKM	50
X10XB-TTKOM	50
X10XB-ASELS	50
XLBNK-TSKB	50
X10XB-XLBNK	50
XAGUSD-XPTUSD	50
<b>Delta Spread Oranı (Delta Per Spread Ratio)</b>	
USDTRY-USDTRYK	1
ELCBASQ-ELCBASM	3
ELCBASY-ELCBASQ	4
ELCBASY-ELCBASM	12
TRT131130T14-TRT020926T17	1.17
X10XB-XU030	1.13
XLBNK-AKBNK	20.32
XLBNK-GARAN	10.94
XLBNK-ISCTR	105.64
XLBNK-YKBNK	42.36
CNHTRY-USDTRY	1.45
GARAN-AKBNK	1.86

Halka Açık (Tasnif Dışı)

XU030-AKBNK	18.05
XU030-ISCTR	93.8
XU030-SAHOL	14.76
XU030-YKBNK	37.61
XU030-KCHOL	7.35
XLBNK-XU030	1.13
AKBNK-ISCTR	5.2
AKBNK-YKBNK	2.08
X10XB-EREGL	58.6
GARAN-ISCTR	9.65
GARAN-YKBNK	3.87
YKBNK-ISCTR	2.49
X10XB-THYAO	5.44
HALKB-VAKBN	1.24
XLBNK-VAKBN	45.89
XAUUSD-XAGUSD	5.72
X10XB-SISE	38.01
TRMET-TRALT	2.7
AKBNK-VAKBN	2.26
VAKBN-ISCTR	2.3
EURTRY-USDTRY	1.17
XU030-GARAN	9.72
XU030-VAKBN	40.75
GARAN-VAKBN	4.19
THYAO-PGSUS	1.52
CNHTRY-EURTRY	1.23
YKBNK-VAKBN	1.08
X10XB-TUPRS	7.27
KRDMD-EREGL	1.06
XAUUSD-XAUTRY	28.63
XLBNK-HALKB	37.06
XU030-SISE	33.69
KCHOL-SAHOL	2.01

Halka Açık (Tasnif Dışı)

XU030-PGSUS	7.32
XU030-TCELL	13.05
XU030-THYAO	4.82
XU030-EREGL	51.95
X10XB-AKBNK	20.36
XU030-TUPRS	6.44
XU030-EKGYO	63.58
XU030-HALKB	32.91
XU030-KRDMD	49.08
XU030-PETKM	80.34
KCHOL-ISCTR	12.77
XU030-TTKOM	22.7
XU030-ASELS	4.8
XU030-TSKB	110.97
X10XB-ISCTR	105.81
SAHOL-AKBNK	1.22
AKBNK-HALKB	1.82
AKBNK-TSKB	6.15
SAHOL-VAKBN	2.76
GARAN-TSKB	11.42
GARAN-SAHOL	1.52
GARAN-HALKB	3.39
SAHOL-ISCTR	6.36
ISCTR-TSKB	1.18
HALKB-ISCTR	2.85
X10XB-TCELL	14.73
SAHOL-YKBNK	2.55
XLBNK-SAHOL	16.62
X10XB-SAHOL	16.65
VAKBN-TSKB	2.72
HALKB-YKBNK	1.14
GBPUSD-EURUSD	1.15
X10XB-EKGYO	71.72

Halka Açık (Tasnif Dışı)

XLBNK-KCHOL	8.27
X10XB-KCHOL	8.29
X10XB-KRDMD	55.37
X10XB-PGSUS	8.26
X10XB-PETKM	90.63
X10XB-TTKOM	25.61
X10XB-ASELS	5.42
XLBNK-TSKB	124.98
X10XB-XLBNK	1
XAGUSD-XPTUSD	16.8
<b>6) Kısa Opsiyon Pozisyonu Minimum Riski (Short Option Minimum Risk)</b>	
<b>Opsiyon Sözleşmeleri (Options)</b>	
AKBNK	365
ALARK	455
ARCLK	580
ASELS	1765
BIMAS	3460
EKGYO	100
ENKAI	485
EREGL	140
FROTO	540
GARAN	670
HALKB	195
ISCTR	65
KCHOL	975
KRDMD	150
PETKM	95
PGSUS	905
SAHOL	465
SISE	240
TAVHL	1495

Halka Açık (Tasnif Dışı)



TCELL	540
THYAO	1475
TOASO	1420
TTKOM	300
TUPRS	1275
USDTRY	2215
VAKBN	165
XU030	7525
YKBNK	170
<b>7) Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin )</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiziki Teslimat Teminatı (%) (Physical Delivery Margin )</b>
USDTRY	11.4

<b>Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)</b>
<b>Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)</b>	1060

Halka Açık (Tasnif Dışı)

**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	6.70%
1095	5.80%
1460	4.91%
1825	4.52%
2555	4.01%
3650	4.79%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

**KIYMETLİ MADENLER VE KIYMETLİ TAŞLAR PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>KIYMETLİ MADENLER PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (PMD TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)</b>						
<b>Kıymetli Madenler (Precious Metals)</b>	<b>Vade Gününe Göre FDA ve Birim Teminat Değerleri (Price Scan Range-PSR &amp; Unit Margin)</b>			<b>Alış/Satış Fark Teminatı (B/A Spread)</b>	<b>PTRM Birim Teminat Ölçeklendirme Katsayısı (Unit Margin Coefficient)</b>	<b>Günsonu Sürdürme Seviyesi Katsayısı (Maintenance Margin Coefficient)</b>
	<b>0-2</b>	<b>03-10</b>	<b>11 ve üzeri (11 and more)</b>			
<b>Altın (Gold)</b>	6.00%	7.20%	14.00%	6.00%	200%	100%
<b>Gümüş(Silver)</b>	11.00%	13.30%	20.00%	11.00%		
<b>Paladyum(Palladium)</b>	8.10%	10.00%	19.30%	8.10%		
<b>Platin(Platinum)</b>	7.90%	9.70%	16.00%	7.90%		

**ÖDÜNÇ PAY PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU**

<b>ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)</b>	
<b>Gruplar (Groups)</b>	<b>Risk Parametreleri (Risk Parameters)</b>
<b>BIST30</b>	114%
<b>BIST30 Dışı</b>	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	5%
Teminat Dönüşüm Parametresi	105%
Alacak Dağıtım Parametresi	10%

## 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%

Halka Açık (Tasnif Dışı)

Sözleşmeler Arası Risk Analizi	
(Spread Credit)	
SWAP Sözleşmeleri	
Sözleşmeler	Kredi Oranları (%)
(Contracts)	(Spread Credit)
<i>* Öncelik aşağıdaki ikili sırasına göre dir</i>	
<i>(Priority is applied as follows)</i>	
XAUUSD - XAUEUR	50
XAUUSD - XAUTRY	50

#### TAKASBANK ÇEK TAKASI PARAMETRE TABLOSU

TAKASBANK ÇEK TAKASI GARANTİ MEKANİZMASI KATKI PAYI	
Katkı Payı	5%
Ek Katkı Payı	2.5%