

Genel Mektup : 1904

İstanbul, 18/08/2023

**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. Güncellemeler sadece fiyat değişiklikleri sebebiyle gerekli görülen dayanak varlıklar için yapılmıştır.

22.08.2023 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 22.08.2023 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 22.08.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

22.08.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 21.08.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 22.08.2023 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

Avşar R. SUNGURLU  
Genel Müdür  
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Risk\_Parametreleri\_Ağustos 2023\_aradönem (3 Sayfa)



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

<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	1325
AKBNK	395
AKSEN	465
ALARK	1370
ARCLK	1830
ASELS	905
ASTOR	1645
BIMAS	3275
CNHTRY	3965
DOHOL	155
ECILC	535
EKGYO	120
ELCBASM	24255
ELCBASQ	39590
ELCBASY	85670
ENJSA	575
ENKAI	425
EREGL	480
EURTRY	3465
FROTO	11735
GARAN	765
GUBRF	4315
HALKB	195
HEKTS	400
ISCTR	225
ISGYO	250

KARSN	150
KCHOL	1655
KOZAA	685
KOZAL	360
KRDMD	335
MGROS	4155
ODAS	155
OYAKC	855
PETKM	225
PGSUS	12175
RUBTRY	4515
SAHOL	700
SASA	795
SASX10	55
SISE	630
SKBNK	55
SOKM	640
TAVHL	1510
TCELL	630
THYAO	3175
TKFEN	505
TLREF	2525
TOASO	3280
TRT	700
TSKB	95
TTKOM	275
TUPRS	1345
USDTRY	3095
VAKBN	175
VESTL	770
X10XB	13125
XAUTRY	185
XLBNK	9490

<b>XSD25</b>	11440
<b>XU030</b>	9720
<b>YKBNK</b>	210
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	30
<b>GBPUSD</b>	40
<b>XAGUSD</b>	25
<b>XAUUSD</b>	110
<b>XPDUSD</b>	220
<b>XPTUSD</b>	85