

Genel Mektup : 1911

İstanbul, 13/10/2023

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.

17.10.2023 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 17.10.2023 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 17.10.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

17.10.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 16.10.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 17.10.2023 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_EKİM 2023_aradönem (3 Sayfa)



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

1) 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	1330
AKBNK	410
AKSEN	440
ALARK	1370
ARCLK	1960
ASELS	505
ASTOR	1505
BIMAS	3685
CNHTRY	4035
DOHOL	165
ECILC	710
EKGYO	100
ELCBASM	22685
ELCBASQ	37030
ELCBASY	80140
ENJSA	620
ENKAI	415
EREGL	540
EURTRY	3405
FROTO	10500
GARAN	645
GUBRF	4850
HALKB	225
HEKTS	355
ISCTR	330
ISGYO	325

KARSN	150
KCHOL	1845
KOZAA	840
KOZAL	380
KRDMD	395
MGROS	5160
ODAS	180
OYAKC	1025
PETKM	275
PGSUS	9490
RUBTRY	4395
SAHOL	665
SASA	660
SASX10	55
SISE	635
SKBNK	100
SOKM	785
TAVHL	1560
TCELL	635
THYAO	2685
TKFEN	590
TLREF	2500
TOASO	3315
TRT	3620
TSKB	115
TTKOM	295
TUPRS	1790
USDTRY	3005
VAKBN	210
VESTL	815
X10XB	13735
XAUTRY	190
XLBNK	11030

XSD25	12220
XU030	10105
YKBNK	240
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	25
XAUUSD	105
XPDUUSD	205
XPTUSD	80