

Genel Mektup : 1943

İstanbul, 12/01/2024

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.

16.01.2024 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 16.01.2024 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 16.01.2024 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.

16.01.2024 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 15.01.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 16.01.2024 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 (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSLKM84J8U> 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



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	1,440
AKBNK	440
AKSEN	350
ALARK	1,110
ARCLK	1,490
ASELS	570
ASTOR	1,230
BIMAS	4,000
CNHTRY	4,450
DOHOL	140
ECILC	550
EKGYO	90
ELCBASM	26,670
ELCBASQ	43,540
ELCBASY	94,220
ENJSA	570
ENKAI	420
EREGL	510
EURTRY	3,350
FROTO	9,490
GARAN	800
GUBRF	2,075
HALKB	170
HEKTS	240
ISCTR	310
ISGYO	195

KARSN	110
KCHOL	1,880
KONTR	3,280
KOZAA	530
KOZAL	230
KRDMD	330
MGROS	4,680
ODAS	100
OYAKC	790
PETKM	230
PGSUS	9,020
RUBTRY	5,440
SAHOL	760
SASA	410
SASX10	60
SISE	570
SKBNK	55
SOKM	650
TAVHL	1,420
TCELL	700
THYAO	2,900
TKFEN	440
TLREF	2,430
TOASO	2,640
TRT	3,720
TSKB	85
TTKOM	350
TUPRS	1,700
USDTRY	3,080
VAKBN	175
VESTL	610
X10XB	13,010
XAUTRY	210

XLBNK	11,140
XSD25	11,560
XU030	9,050
YKBNK	270
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	120
XPDUUSD	170
XPTUSD	80