

Genel Mektup : 1962

İstanbul, 14/03/2024

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.

19.03.2024 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 19.03.2024 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 19.03.2024 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.

19.03.2024 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 18.03.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

19.03.2024 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

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSEKYEF2ZU> 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	1,800
AKBNK	505
AKSEN	435
ALARK	1,520
ARCLK	1,760
ASELS	675
ASTOR	1,515
BIMAS	4,750
CIMSA	400
CNHTRY	4,755
DOAS	3,440
DOHOL	155
ECILC	645
EKGYO	145
ELCBASM	28,525
ELCBASQ	46,565
ELCBASY	100,775
ENJSA	680
ENKAI	450
EREGL	510
EURTRY	3,565
FROTO	13,820
GARAN	790
GUBRF	2,610
HALKB	175
HEKTS	250

ISCTR	140
ISGYO	190
KARSN	155
KCHOL	2,150
KONTR	3,465
KOZAA	595
KOZAL	290
KRDMD	325
MGROS	6,525
ODAS	120
OYAKC	930
PETKM	290
PGSUS	10,385
RUBTRY	5,590
SAHOL	900
SASA	515
SASX10	50
SISE	545
SKBNK	55
SOKM	810
TAVHL	1,945
TCELL	715
THYAO	3,240
TKFEN	530
TLREF	2,380
TOASO	3,125
TRT	3,980
TSKB	100
TTKOM	385
TUPRS	1,980
USDTRY	3,300
VAKBN	180
VESTL	1,070

X10XB	14,320
XAUTRY	235
XLBNK	12,200
XSD25	13,795
XU030	10,695
YKBNK	270
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	125
XPDUUSD	200
XPTUSD	90