

Genel Mektup : 1975

İstanbul, 15/05/2024

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.

17.05.2024 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 17.05.2024 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 17.05.2024 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.

17.05.2024 Cuma günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 16.05.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

17.05.2024 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 (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSFLLBHDJ7> 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	2,355
AKBNK	755
AKSEN	450
ALARK	1,390
ARCLK	2,065
ASELS	740
ASTOR	1,410
BIMAS	5,870
BRSAN	6,615
CIMSA	380
CNHTRY	4,750
DOAS	3,480
DOHOL	170
EKGYO	125
ELCBASM	22,985
ELCBASQ	37,520
ELCBASY	81,190
ENJSA	775
ENKAI	435
EREGL	530
EURTRY	3,525
FROTO	14,675
GARAN	1,075
GUBRF	1,965
HALKB	210
HEKTS	200

ISCTR	170
KCHOL	2,925
KONTR	2,980
KOZAA	570
KOZAL	255
KRDMD	340
MGROS	5,720
ODAS	110
OYAKC	770
PETKM	235
PGSUS	12,150
RUBTRY	5,605
SAHOL	1,110
SASA	600
SASX10	50
SISE	600
SOKM	760
TAVHL	2,705
TCELL	950
THYAO	3,740
TKFEN	625
TLREF	2,310
TOASO	3,160
TRT	3,380
TSKB	120
TTKOM	495
TUPRS	2,240
USDTRY	3,310
VAKBN	285
VESTL	1,315
X10XB	14,730
XAUTRY	220
XLBNK	14,820

XSD25	14,305
XU030	11,695
YKBNK	395
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	25
XAUUSD	110
XPDUUSD	145
XPTUSD	75