

Genel Mektup : 1988

İstanbul, 12/07/2024

## 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.

16.07.2024 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 16.07.2024 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 16.07.2024 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.

16.07.2024 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 12.07.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

16.07.2024 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=BSRLCS2CV7> 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	3,035
AKBNK	735
AKSEN	510
ALARK	1,160
ARCLK	1,885
ASELS	715
ASTOR	1,205
BIMAS	6,685
BRSAN	5,130
CIMSA	375
CNHTRY	4,365
DOAS	2,855
DOHOL	190
EKGYO	120
ELCBASM	30,960
ELCBASQ	50,535
ELCBASY	109,365
ENJSA	760
ENKAI	425
EREGL	575
EURTRY	3,310
FROTO	11,830
GARAN	1,450
GUBRF	1,745
HALKB	220
HEKTS	140

ISCTR	190
KCHOL	2,515
KONTR	2,180
KOZAA	695
KOZAL	280
KRDMD	360
MGROS	6,160
ODAS	90
OYAKC	915
PETKM	255
PGSUS	2,830
RUBTRY	5,445
SAHOL	1,145
SASA	515
SASX10	55
SISE	525
SOKM	685
TAVHL	3,045
TCELL	1,155
THYAO	3,375
TKFEN	645
TLREF	2,450
TOASO	3,590
TRT	3,170
TSKB	135
TTKOM	570
TUPRS	1,845
USDTRY	3,080
VAKBN	260
VESTL	985
X10XB	12,495
XAUTRY	225
XLBNK	14,465

<b>XSD25</b>	13,200
<b>XU030</b>	10,570
<b>YKBNK</b>	360
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	25
<b>GBPUSD</b>	35
<b>XAGUSD</b>	30
<b>XAUUSD</b>	110
<b>XPDUUSD</b>	145
<b>XPTUSD</b>	75