

Genel Mektup : 2067

İstanbul, 13/05/2025

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.

15.05.2025 Perşembe günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 15.05.2025 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 15.05.2025 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.

15.05.2025 Perşembe günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.05.2025 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

15.05.2025 Perşembe 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=BSF6JRATCF> Pin Kodu :

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +90 212 25 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	1,795
AKBNK	550
AKSEN	360
ALARK	905
ARCLK	1,170
ASELS	1,510
ASTOR	1,250
BIMAS	4,370
BRSAN	4,170
CIMSA	485
CNHTRY	2,540
DOAS	2,245
DOHOL	155
EKGYO	145
ELCBASM	32,160
ELCBASQ	52,495
ELCBASY	113,600
ENJSA	580
ENKAI	750
EREGL	240
EURTRY	1,945
FROTO	9,530
GARAN	1,130
GUBRF	3,530
HALKB	225
HEKTS	30

ISCTR	105
KCHOL	1,510
KONTR	325
KOZAA	915
KOZAL	290
KRDMD	250
MGROS	5,405
ODAS	50
OYAKC	270
PETKM	170
PGSUS	2,645
RUBTRY	6,315
SAHOL	725
SASA	40
SASX10	55
SISE	330
SOKM	435
TAVHL	2,420
TCELL	965
THYAO	3,050
TKFEN	1,460
TLREF	2,200
TOASO	2,240
TRT	3,350
TSKB	115
TTKOM	650
TUPRS	1,325
ULKER	1,205
USDTRY	1,765
VAKBN	240
VESTL	475
X10XB	7,615
XAUTRY	335

XLBNK	7,370
XSD25	7,820
XU030	6,310
YKBNK	280
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	30
XAGUSD	30
XAUUSD	140
XCUUSD	60
XPDUUSD	130
XPTUSD	65