

Genel Mektup : 1895

İstanbul, 21/07/2023

**MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME EKİBİ**

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda işlem teminatı hesaplamalarında kullanılan risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucu güncellenmiştir.

Güncellemeler sadece fiyat değişiklikleri sebebiyle gerekli görülen dayanak varlıklar için yapılmıştır.

25.07.2023 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 25.07.2023 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 25.07.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

25.07.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 24.07.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 25.07.2023 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\_Temmuz2023\_aradönem (3 Sayfa)



**EK: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu**

<b>1) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge)</b>	
<b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)</b>	
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
AEFES	1055
AKBNK	330
AKSEN	420
ALARK	950
ARCLK	1855
ASELS	845
ASTOR	945
BIMAS	2260
CNHTRY	4170
DOHOL	145
ECILC	515
EKGYO	120
ELCBASM	20965
ELCBASQ	34225
ELCBASY	74065
ENJSA	500
ENKAI	380
EREGL	450
EURTRY	3420
FROTO	10740
GARAN	530
GUBRF	4090
HALKB	185
HEKTS	395
ISCTR	210
ISGYO	165

KARSN	125
KCHOL	1405
KOZAA	740
KOZAL	395
KRDMD	325
MGROS	3465
ODAS	100
OYAKC	715
PETKM	205
PGSUS	9605
RUBTRY	4975
SAHOL	605
SASA	900
SASX10	55
SISE	605
SKBNK	35
SOKM	520
TAVHL	1280
TCELL	515
THYAO	2680
TKFEN	500
TLREF	2880
TOASO	3035
TRT	730
TSKB	75
TTKOM	295
TUPRS	1100
USDTRY	2995
VAKBN	160
VESTL	730
X10XB	11265
XAUTRY	185
XLBNK	7360

<b>XSD25</b>	8150
<b>XU030</b>	8170
<b>YKBNK</b>	190
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	30
<b>GBPUSD</b>	45
<b>XAGUSD</b>	30
<b>XAUUSD</b>	115
<b>XPDUSD</b>	230
<b>XPTUSD</b>	90