

Genel Mektup : 1908

İstanbul, 15/09/2023

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.

19.09.2023 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 19.09.2023 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 19.09.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

19.09.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 18.09.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 19.09.2023 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
DirektörMurat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk_Parametreleri_Eylül 2023_aradönem (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSPKB9CT15> 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	1325
AKBNK	375
AKSEN	445
ALARK	1470
ARCLK	1980
ASELS	500
ASTOR	1870
BIMAS	3300
CNHTRY	3905
DOHOL	165
ECILC	700
EKGYO	115
ELCBASM	23055
ELCBASQ	37635
ELCBASY	81440
ENJSA	630
ENKAI	440
EREGL	545
EURTRY	3370
FROTO	10850
GARAN	725
GUBRF	4680
HALKB	210
HEKTS	365
ISCTR	300
ISGYO	290

KARSN	150
KCHOL	1715
KOZAA	845
KOZAL	420
KRDMD	360
MGROS	5080
ODAS	150
OYAKC	990
PETKM	240
PGSUS	11120
RUBTRY	4390
SAHOL	700
SASA	725
SASX10	55
SISE	670
SKBNK	70
SOKM	805
TAVHL	1495
TCELL	690
THYAO	2845
TKFEN	595
TLREF	2525
TOASO	3225
TRT	2920
TSKB	105
TTKOM	355
TUPRS	1755
USDTRY	3010
VAKBN	195
VESTL	795
X10XB	14180
XAUTRY	185
XLBNK	9905

XSD25	12075
XU030	10055
YKBNK	210
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	25
XAUUSD	110
XPDUSD	220
XPTUSD	85