

Genel Mektup : 1954

İstanbul, 16/02/2024

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.

20.02.2024 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 20.02.2024 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 20.02.2024 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.

20.02.2024 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 19.02.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

20.02.2024 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=BSFKTHHYKE> 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	1,915
AKBNK	505
AKSEN	450
ALARK	1,435
ARCLK	1,840
ASELS	675
ASTOR	1,745
BIMAS	4,610
CIMSA	455
CNHTRY	4,540
DOAS	3,310
DOHOL	175
ECILC	705
EKGYO	125
ELCBASM	19,060
ELCBASQ	31,115
ELCBASY	67,335
ENJSA	710
ENKAI	515
EREGL	540
EURTRY	3,355
FROTO	11,655
GARAN	795
GUBRF	3,150
HALKB	200
HEKTS	315

ISCTR	345
ISGYO	240
KARSN	130
KCHOL	2,165
KONTR	3,600
KOZAA	615
KOZAL	335
KRDMD	425
MGROS	5,730
ODAS	125
OYAKC	865
PETKM	290
PGSUS	11,135
RUBTRY	5,295
SAHOL	935
SASA	590
SASX10	55
SISE	660
SKBNK	65
SOKM	880
TAVHL	1,995
TCELL	790
THYAO	3,385
TKFEN	595
TLREF	2,560
TOASO	2,940
TRT	4,110
TSKB	130
TTKOM	440
TUPRS	2,030
USDTRY	3,165
VAKBN	185
VESTL	1,075

X10XB	15,385
XAUTRY	205
XLBNK	12,990
XSD25	13,495
XU030	11,125
YKBNK	290
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	25
XAUUSD	115
XPDUUSD	175
XPTUSD	85