

Genel Mektup : 2001

İstanbul, 11/10/2024

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.

15.10.2024 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 15.10.2024 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 15.10.2024 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.

15.10.2024 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.10.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

15.10.2024 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=BSCLTDNMUK> 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	2,210
AKBNK	705
AKSEN	430
ALARK	995
ARCLK	1,640
ASELS	690
ASTOR	900
BIMAS	5,760
BRSAN	5,355
CIMSA	360
CNHTRY	4,685
DOAS	2,385
DOHOL	160
EKGYO	110
ELCBASM	27,730
ELCBASQ	45,265
ELCBASY	97,960
ENJSA	635
ENKAI	520
EREGL	500
EURTRY	3,490
FROTO	10,860
GARAN	1,500
GUBRF	2,395
HALKB	190
HEKTS	45

ISCTR	140
KCHOL	2,160
KONTR	525
KOZAA	625
KOZAL	230
KRDMD	280
MGROS	4,905
ODAS	65
OYAKC	720
PETKM	215
PGSUS	2,815
RUBTRY	5,105
SAHOL	985
SASA	45
SASX10	55
SISE	415
SOKM	490
TAVHL	2,545
TCELL	915
THYAO	2,940
TKFEN	580
TLREF	2,315
TOASO	2,045
TRT	3,300
TSKB	120
TTKOM	500
TUPRS	1,665
USDTRY	3,205
VAKBN	250
VESTL	765
X10XB	10,520
XAUTRY	260
XLBNK	12,500

XSD25	11,440
XU030	9,130
YKBNK	295
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	35
XAGUSD	30
XAUUSD	120
XPDUUSD	155
XPTUSD	70