

Genel Mektup : 2008

İstanbul, 13/11/2024

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.

15.11.2024 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 15.11.2024 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 15.11.2024 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 öz sermaye hallerine ilişkin yapılan düzeltmeler ilgili paya dayalı vadeli işlem ve opsiyon sözleşmelerinin risk parametrelerine yansıtılacaktır.

15.11.2024 Cuma günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.11.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

15.11.2024 Cuma 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=BSULYVP9PT> 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**

<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	2,350
AKBNK	580
AKSEN	375
ALARK	1,095
ARCLK	1,535
ASELS	770
ASTOR	1,155
BIMAS	5,095
BRSAN	6,200
CIMSA	405
CNHTRY	4,595
DOAS	2,300
DOHOL	150
EKGYO	120
ELCBASM	28,795
ELCBASQ	47,005
ELCBASY	101,720
ENJSA	640
ENKAI	580
EREGL	530
EURTRY	3,395
FROTO	12,215
GARAN	1,355
GUBRF	2,670
HALKB	175
HEKTS	40

ISCTR	130
KCHOL	1,995
KONTR	615
KOZAA	700
KOZAL	225
KRDMD	285
MGROS	4,975
ODAS	65
OYAKC	720
PETKM	200
PGSUS	2,955
RUBTRY	5,095
SAHOL	885
SASA	45
SASX10	55
SISE	420
SOKM	435
TAVHL	2,740
TCELL	1,005
THYAO	3,120
TKFEN	900
TLREF	2,260
TOASO	2,010
TRT	3,430
TSKB	135
TTKOM	505
TUPRS	1,580
ULKER	1,245
USDTRY	3,220
VAKBN	250
VESTL	725
X10XB	10,770
XAUTRY	260

<b>XLBNK</b>	11,890
<b>XSD25</b>	11,405
<b>XU030</b>	9,155
<b>YKBNK</b>	290
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	25
<b>GBPUSD</b>	35
<b>XAGUSD</b>	30
<b>XAUUSD</b>	120
<b>XPDUUSD</b>	140
<b>XPTUSD</b>	70