

Genel Mektup : 1884

İstanbul, 12/05/2023

MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi

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.

16.05.2023 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 16.05.2023 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 16.05.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

16.05.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 15.05.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 16.05.2023 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 (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BS45PZD0M0> 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

BISTECH MARIJİN YÖNTEMİ RISK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI)
(TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS)

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 | 755 |
| AKBNK | 200 |
| AKSEN | 320 |
| ALARK | 675 |
| ARCLK | 1065 |
| ASELS | 480 |
| BIMAS | 1630 |
| CNHTRY | 3220 |
| DOHOL | 105 |
| ECILC | 320 |
| EKGYO | 70 |
| ELCBASIM | 12140 |
| ELCBASQ | 20820 |
| ELCBASY | 44580 |
| ENJSA | 320 |
| ENKAI | 305 |
| EREGL | 340 |
| EURTRY | 2420 |
| FROTO | 6860 |
| GARAN | 365 |
| GUBRF | 3055 |
| HALKB | 145 |
| HEKTS | 340 |
| ISCTR | 165 |

| | |
|--------|------|
| ISGYO | 105 |
| KARSN | 100 |
| KCHOL | 910 |
| KOZAA | 400 |
| KOZAL | 240 |
| KRDMD | 195 |
| MGROS | 2485 |
| ODAS | 65 |
| OYAKC | 360 |
| PETKM | 150 |
| PGSUS | 5765 |
| RUBTRY | 4190 |
| SAHOL | 450 |
| SASA | 1255 |
| SASX10 | 55 |
| SISE | 505 |
| SKBNK | 30 |
| SOKM | 395 |
| TAVHL | 835 |
| TCELL | 370 |
| THYAO | 1600 |
| TKFEN | 315 |
| TLREF | 2420 |
| TOASO | 2065 |
| TRT | 700 |
| TSKB | 55 |
| TTKOM | 190 |
| TUPRS | 785 |
| USDTRY | 2075 |
| VAKBN | 115 |
| VESTL | 500 |
| X10XB | 7595 |
| XAUTRY | 150 |

| | |
|---------------------------|--|
| XLBNK | 5535 |
| XSD25 | 6085 |
| XU030 | 5455 |
| YKBNK | 120 |
| Kontratlar (Contracts) | Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge) |
| EURUSD | 30 |
| GBPUSD | 40 |
| XAGUSD | 30 |
| XAUUSD | 120 |
| XPDUSD | 265 |
| XPTUSD | 100 |