

Genel Mektup : 1925

İstanbul, 15/12/2023

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.

19.12.2023 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 19.12.2023 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 19.12.2023 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.

19.12.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 18.12.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

19.12.2023 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_Ara Dönem 2023 (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSFK7TD2MU> 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	1470
AKBNK	410
AKSEN	360
ALARK	1080
ARCLK	1450
ASELS	570
ASTOR	1190
BIMAS	3800
CNHTRY	4350
DOHOL	140
ECILC	570
EKGYO	90
ELCBASM	22260
ELCBASQ	36340
ELCBASY	78640
ENJSA	560
ENKAI	420
EREGL	450
EURTRY	3250
FROTO	9400
GARAN	670
GUBRF	4910
HALKB	170
HEKTS	270
ISCTR	290
ISGYO	270

KARSN	110
KCHOL	1770
KONTR	3010
KOZAA	580
KOZAL	250
KRDMD	290
MGROS	4590
ODAS	120
OYAKC	730
PETKM	230
PGSUS	8940
RUBTRY	5160
SAHOL	740
SASA	570
SASX10	50
SISE	590
SKBNK	100
SOKM	710
TAVHL	1440
TCELL	650
THYAO	3020
TKFEN	520
TLREF	2370
TOASO	2620
TRT	3740
TSKB	90
TTKOM	290
TUPRS	1840
USDTRY	2980
VAKBN	190
VESTL	650
X10XB	12610
XAUTRY	200

XLBNK	10820
XSD25	11700
XU030	9670
YKBNK	230
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	110
XPDUUSD	200
XPTUSD	90