

Genel Mektup : 1888

İstanbul, 09/06/2023

MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

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. Güncellemeler sadece fiyat değişiklikleri sebebiyle gerekli görülen dayanak varlıklar için yapılmıştır.

13.06.2023 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 13.06.2023 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 13.06.2023 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

13.06.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 12.06.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir 13.06.2023 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_Haziran2023_aradönem (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSE5T50J7B> 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	800
AKBNK	230
AKSEN	395
ALARK	810
ARCLK	1305
ASELS	635
BIMAS	1575
CNHTRY	3485
DOHOL	115
ECILC	370
EKGYO	105
ELCBASM	17065
ELCBASQ	27860
ELCBASY	60290
ENJSA	405
ENKAI	330
EREGL	430
EURTRY	2620
FROTO	8200
GARAN	375
GUBRF	4085
HALKB	190
HEKTS	395
ISCTR	170
ISGYO	120
KARSN	110

KCHOL	1095
KOZAA	610
KOZAL	345
KRDMD	280
MGROS	2490
ODAS	85
OYAKC	600
PETKM	180
PGSUS	6625
RUBTRY	4605
SAHOL	480
SASA	845
SASX10	55
SISE	580
SKBNK	30
SOKM	380
TAVHL	1060
TCELL	410
THYAO	1950
TKFEN	405
TLREF	2420
TOASO	2650
TRT	700
TSKB	65
TTKOM	240
TUPRS	865
USDTRY	2410
VAKBN	140
VESTL	655
X10XB	9195
XAUTRY	165
XLBNK	6175
XSD25	7000

XU030	6615
YKBNK	145
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	30
XAUUSD	115
XPDUUSD	255
XPTUSD	95