

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 MARJİN YÖNTEMİ RİSK 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
ELCBASM	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
XPDUUSD	265
XPTUSD	100