

Genel Mektup : 1923

İstanbul, 10/11/2023

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.

14.11.2023 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 14.11.2023 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 14.11.2023 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.

14.11.2023 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 13.11.2023 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 14.11.2023 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\_Kasım 2023\_aradönem (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSPKAL6EHE> 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	1375
AKBNK	355
AKSEN	400
ALARK	1265
ARCLK	1605
ASELS	515
ASTOR	1465
BIMAS	3565
CNHTRY	4155
DOHOL	165
ECILC	590
EKGYO	80
ELCBASM	24945
ELCBASQ	40715
ELCBASY	88110
ENJSA	630
ENKAI	395
EREGL	435
EURTRY	3085
FROTO	10100
GARAN	585
GUBRF	4630
HALKB	180
HEKTS	310
ISCTR	240
ISGYO	285

KARSN	125
KCHOL	1725
KONTR	3805
KOZAA	655
KOZAL	270
KRDMD	320
MGROS	4800
ODAS	145
OYAKC	935
PETKM	240
PGSUS	9575
RUBTRY	4900
SAHOL	655
SASA	590
SASX10	55
SISE	600
SKBNK	95
SOKM	820
TAVHL	1475
TCELL	600
THYAO	2690
TKFEN	500
TLREF	2470
TOASO	3020
TRT	3840
TSKB	90
TTKOM	270
TUPRS	1825
USDTRY	2920
VAKBN	235
VESTL	800
X10XB	13255
XAUTRY	190

<b>XLBNK</b>	9465
<b>XSD25</b>	11225
<b>XU030</b>	9280
<b>YKBNK</b>	205
<b>Kontratlar (Contracts)</b>	<b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)</b>
<b>EURUSD</b>	30
<b>GBPUSD</b>	40
<b>XAGUSD</b>	25
<b>XAUUSD</b>	115
<b>XPDUUSD</b>	175
<b>XPTUSD</b>	80