

Genel Mektup : 1970

İstanbul, 19/04/2024

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.

24.04.2024 Çarşamba günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 24.04.2024 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 24.04.2024 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.

24.04.2024 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 22.04.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

24.04.2024 Çarşamba 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=BSPLB6FUNU> 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	2085
AKBNK	730
AKSEN	420
ALARK	1595
ARCLK	1865
ASELS	750
ASTOR	1355
BIMAS	4850
BRSAN	7275
CIMSA	370
CNHTRY	4795
DOAS	4720
DOHOL	160
EKGYO	125
ELCBASM	26165
ELCBASQ	42710
ELCBASY	92430
ENJSA	770
ENKAI	415
EREGL	465
EURTRY	3510
FROTO	14575
GARAN	940
GUBRF	2245
HALKB	185
HEKTS	210

ISCTR	160
KCHOL	2600
KONTR	3285
KOZAA	580
KOZAL	280
KRDMD	305
MGROS	5000
ODAS	110
OYAKC	805
PETKM	240
PGSUS	10615
RUBTRY	5510
SAHOL	985
SASA	470
SASX10	55
SISE	535
SOKM	720
TAVHL	2305
TCELL	870
THYAO	3530
TKFEN	495
TLREF	2380
TOASO	3015
TRT	3680
TSKB	120
TTKOM	450
TUPRS	2255
USDTRY	3345
VAKBN	220
VESTL	1225
X10XB	13850
XAUTRY	260
XLBNK	13860

XSD25	13840
XU030	10800
YKBNK	405
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	30
GBPUSD	40
XAGUSD	35
XAUUSD	140
XPDUUSD	190
XPTUSD	90