

Genel Mektup : 2063

İstanbul, 14/04/2025

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.

16.04.2025 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 16.04.2025 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 16.04.2025 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.

16.04.2025 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 15.04.2025 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

16.04.2025 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=BSF6PHK82L> 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	1,785
AKBNK	585
AKSEN	355
ALARK	1,010
ARCLK	1,365
ASELS	1,380
ASTOR	1,185
BIMAS	4,035
BRSAN	4,410
CIMSA	480
CNHTRY	2,450
DOAS	2,455
DOHOL	175
EKGYO	135
ELCBASM	33,205
ELCBASQ	54,200
ELCBASY	117,300
ENJSA	665
ENKAI	670
EREGL	205
EURTRY	1,935
FROTO	10,625
GARAN	1,135
GUBRF	3,025
HALKB	205
HEKTS	30

ISCTR	120
KCHOL	1,635
KONTR	340
KOZAA	840
KOZAL	315
KRDMD	260
MGROS	4,800
ODAS	50
OYAKC	325
PETKM	160
PGSUS	2,950
RUBTRY	6,040
SAHOL	755
SASA	40
SASX10	55
SISE	340
SOKM	395
TAVHL	2,610
TCELL	900
THYAO	3,075
TKFEN	1,425
TLREF	2,290
TOASO	1,710
TRT	3,420
TSKB	110
TTKOM	515
TUPRS	1,385
ULKER	1,140
USDTRY	1,735
VAKBN	230
VESTL	535
X10XB	7,270
XAUTRY	325

XLBNK	7,285
XSD25	7,685
XU030	6,095
YKBNK	265
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	30
XAGUSD	25
XAUUSD	135
XCUUSD	45
XPDUUSD	125
XPTUSD	65