

Genel Mektup : 1980

İstanbul, 13/06/2024

**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.

20.06.2024 Perşembe günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 20.06.2024 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 20.06.2024 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.

20.06.2024 Perşembe günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.06.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

20.06.2024 Perşembe 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)



**EK: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu**

| <b>1) Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b> |   |
|---|---|
| <b>Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri<br/>(Futures and Options)</b>  |   |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b>   | <b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (TL)<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b> |
| AEFES   | 2,385   |
| AKBNK   | 750   |
| AKSEN   | 500   |
| ALARK   | 1,330   |
| ARCLK   | 1,895   |
| ASELS   | 630   |
| ASTOR   | 1,220   |
| BIMAS   | 6,015   |
| BRSAN   | 5,535   |
| CIMSA   | 325   |
| CNHTRY  | 4,310   |
| DOAS  | 2,965   |
| DOHOL   | 175   |
| EKGYO   | 95  |
| ELCBASM   | 29,840  |
| ELCBASQ   | 48,710  |
| ELCBASY   | 105,410   |
| ENJSA   | 695   |
| ENKAI   | 420   |
| EREGL   | 485   |
| EURTRY  | 3,235   |
| FROTO   | 11,185  |
| GARAN   | 1,215   |
| GUBRF   | 1,750   |
| HALKB   | 215   |
| HEKTS   | 155   |

|        |        |
|--------|--------|
| ISCTR  | 190    |
| KCHOL  | 2,545  |
| KONTR  | 2,330  |
| KOZAA  | 560    |
| KOZAL  | 245    |
| KRDMD  | 305    |
| MGROS  | 5,515  |
| ODAS   | 85     |
| OYAKC  | 735    |
| PETKM  | 230    |
| PGSUS  | 2,485  |
| RUBTRY | 5,275  |
| SAHOL  | 955    |
| SASA   | 520    |
| SASX10 | 55     |
| SISE   | 510    |
| SOKM   | 650    |
| TAVHL  | 2,640  |
| TCELL  | 1,010  |
| THYAO  | 3,285  |
| TKFEN  | 545    |
| TLREF  | 2,220  |
| TOASO  | 3,305  |
| TRT    | 3,210  |
| TSKB   | 120    |
| TTKOM  | 520    |
| TUPRS  | 1,785  |
| USDTRY | 3,030  |
| VAKBN  | 275    |
| VESTL  | 995    |
| X10XB  | 11,635 |
| XAUTRY | 220    |
| XLBNK  | 13,925 |

|                                   |  |
|-----------------------------------|--|
| <b>XSD25</b>                      | 12,300   |
| <b>XU030</b>                      | 9,875  |
| <b>YKBNK</b>                      | 390  |
| <b>Kontratlar<br/>(Contracts)</b> | <b>Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD)<br/>(Intra-Commodity Spread Charge)</b> |
| <b>EURUSD</b>                     | 25   |
| <b>GBPUSD</b>                     | 35   |
| <b>XAGUSD</b>                     | 25   |
| <b>XAUUSD</b>                     | 105  |
| <b>XPDUUSD</b>                    | 130  |
| <b>XPTUSD</b>                     | 70   |