

Genel Mektup : 1996

İstanbul, 12/09/2024

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.

16.09.2024 Pazartesi günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 16.09.2024 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 16.09.2024 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.

16.09.2024 Pazartesi günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 13.09.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

16.09.2024 Pazartesi 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

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSDML3ENK> 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	2,405
AKBNK	665
AKSEN	440
ALARK	1,000
ARCLK	1,460
ASELS	625
ASTOR	1,020
BIMAS	6,635
BRSAN	6,510
CIMSA	385
CNHTRY	4,635
DOAS	2,395
DOHOL	170
EKGYO	135
ELCBASM	27,905
ELCBASQ	45,550
ELCBASY	98,575
ENJSA	675
ENKAI	510
EREGL	485
EURTRY	3,500
FROTO	9,925
GARAN	1,300
GUBRF	2,160
HALKB	185
HEKTS	130

ISCTR	145
KCHOL	1,965
KONTR	590
KOZAA	690
KOZAL	270
KRDMD	240
MGROS	5,480
ODAS	70
OYAKC	750
PETKM	255
PGSUS	2,575
RUBTRY	5,445
SAHOL	1,045
SASA	50
SASX10	55
SISE	430
SOKM	565
TAVHL	3,015
TCELL	1,025
THYAO	3,085
TKFEN	590
TLREF	2,325
TOASO	2,275
TRT	3,240
TSKB	125
TTKOM	550
TUPRS	1,750
USDTRY	3,190
VAKBN	225
VESTL	765
X10XB	10,965
XAUTRY	250
XLBNK	12,545

XSD25	11,955
XU030	9,485
YKBNK	325
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	35
XAGUSD	25
XAUUSD	115
XPDUSD	145
XPTUSD	70