

Genel Mektup : 2031

İstanbul, 13/01/2025

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.

15.01.2025 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 15.01.2025 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 15.01.2025 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.

15.01.2025 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.01.2025 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

15.01.2025 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=BSN6NYCZFK> 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	1,980
AKBNK	800
AKSEN	460
ALARK	1,110
ARCLK	1,655
ASELS	925
ASTOR	1,430
BIMAS	6,315
BRSAN	5,285
CIMSA	515
CNHTRY	4,670
DOAS	2,225
DOHOL	170
EKGYO	165
ELCBASM	27,380
ELCBASQ	44,695
ELCBASY	96,720
ENJSA	665
ENKAI	550
EREGL	250
EURTRY	3,370
FROTO	10,930
GARAN	1,590
GUBRF	3,620
HALKB	200
HEKTS	40

ISCTR	175
KCHOL	2,160
KONTR	455
KOZAA	785
KOZAL	270
KRDMD	315
MGROS	5,955
ODAS	65
OYAKC	270
PETKM	210
PGSUS	2,395
RUBTRY	5,055
SAHOL	1,135
SASA	40
SASX10	55
SISE	450
SOKM	440
TAVHL	3,435
TCELL	1,010
THYAO	3,190
TKFEN	770
TLREF	2,315
TOASO	2,415
TRT	3,510
TSKB	150
TTKOM	520
TUPRS	1,645
ULKER	1,270
USDTRY	3,320
VAKBN	265
VESTL	825
X10XB	10,795
XAUTRY	280

XLBNK	13,920
XSD25	12,230
XU030	9,820
YKBNK	380
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	30
XAGUSD	30
XAUUSD	125
XCUUSD	50
XPDUUSD	140
XPTUSD	70