

Genel Mektup : 2047

İstanbul, 11/02/2025

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : VİOP Vadeli İşlem Sözleşmesi Fiyatının Risk Hesaplamasında Kullanılması Hk.

İlgili : Aracı Kurumlar, Bankalar

Sayın Genel Müdür,

Bilindiği üzere, Merkezi Karşı Taraf olarak hizmet verilen Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda bazı **vadeli işlem sözleşmeleri** için risk hesaplamasında dayanak varlık fiyatı yerine vadeli işlem sözleşmelerinin kendi fiyatlarının kullanılmasına yönelik uygulama değişikliği 21.02.2025 tarihinde devreye alınacaktır.

21.02.2025 tarihinde gün içi ilk risk hesaplama anında uygulama değişikliği geçerli olacaktır. Bahse konu değişikliğin doğal bir sonucu olarak Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'ndaki teminat gereksinimlerinde değişimler oluşabilecektir.

21.02.2025 Cuma günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 20.02.2025 tarihli dayanak varlık fiyatlarına göre yapılması gerekmektedir. Akşam hesaplanacak teminat tamamlama çağrısı yükümlülükleri ise uygulamaya alınan yeni değişikliğe göre olacaktır.

Vadeli işlem sözleşmelerinin dayanak varlık grubu bazında risk hesaplamasında kullanılacak fiyatlarına ilişkin tabloya ekte yer verilmektedir.

Konuya ilişkin sorularınız için Merkezi Risk Yönetimi Ekibi ile iletişime geçebilirsiniz.

E-posta: mry@takasbank.com.tr

Bilgi edinilmesi ve gereğini rica ederiz.

Saygılarımla,

TAKASBANK
İSTANBUL TAKAS VE SAKLAMA BANKASI A.Ş.

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Dr. Yunus ARINCI
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Dayanak varlık grubu bazında risk hesaplamasında kullanılacak fiyat tablosu (1 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSL606CMSV> 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: Dayanak varlık grubu bazında risk hesaplamasında kullanılacak fiyat tablosu

DAYANAK VARLIK	RİSK HESAPLAMASINDA KULLANILACAK FİYAT	
	VADELİ İŞLEM SÖZLEŞME FİYATI	DAYANAK VARLIK FİYATI
TÜM PAYLAR	X	
XU030	X	
USDTRY	X	
FİZİKİ USDTRY	X	
EURTRY	X	
XAUTRY	X	
XAUUSD	X	
XAGUSD	X	
XLBNK	X	
X10XB	X	
XSD25	X	
RUBTRY	X	
CNHTRY	X	
XCUUSD	X	
XPDUSD	X	
XPTUSD	X	
EURUSD	X	
GBPUSD	X	
TLREF		X
ELCBAS		X
DİBS		X
SASX		X