

Genel Mektup : 1991

İstanbul, 13/08/2024

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.

15.08.2024 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 15.08.2024 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 15.08.2024 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.

15.08.2024 Perşembe günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.08.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

15.08.2024 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.

Semanur CERRAHOĞLU
Direktör

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BS4LFF9TTT> 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	2,835
AKBNK	660
AKSEN	455
ALARK	1,125
ARCLK	1,665
ASELS	675
ASTOR	980
BIMAS	6,790
BRSAN	4,450
CIMSA	350
CNHTRY	4,520
DOAS	2,495
DOHOL	185
EKGYO	125
ELCBASM	29,905
ELCBASQ	48,815
ELCBASY	105,640
ENJSA	770
ENKAI	465
EREGL	515
EURTRY	3,410
FROTO	9,575
GARAN	1,435
GUBRF	2,035
HALKB	180
HEKTS	135

ISCTR	150
KCHOL	2,065
KONTR	615
KOZAA	705
KOZAL	270
KRDMD	300
MGROS	5,825
ODAS	80
OYAKC	825
PETKM	230
PGSUS	2,680
RUBTRY	5,360
SAHOL	1,010
SASA	525
SASX10	55
SISE	450
SOKM	640
TAVHL	2,665
TCELL	1,125
THYAO	3,265
TKFEN	560
TLREF	2,335
TOASO	2,435
TRT	3,250
TSKB	120
TTKOM	565
TUPRS	1,770
USDTRY	3,140
VAKBN	210
VESTL	865
X10XB	11,505
XAUTRY	240
XLBNK	12,265

XSD25	12,975
XU030	9,635
YKBNK	300
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	35
XAGUSD	25
XAUUSD	115
XPDUSD	135
XPTUSD	70