

Genel Mektup : 2015

İstanbul, 12/12/2024

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.

16.12.2024 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 16.12.2024 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 16.12.2024 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.

16.12.2024 Pazartesi günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 13.12.2024 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir.

16.12.2024 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

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk Parametreleri (3 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BS565CJC47> 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	2,520
AKBNK	795
AKSEN	430
ALARK	1,160
ARCLK	1,670
ASELS	820
ASTOR	1,270
BIMAS	6,495
BRSAN	5,925
CIMSA	460
CNHTRY	4,660
DOAS	2,370
DOHOL	175
EKGYO	155
ELCBASM	29,515
ELCBASQ	48,180
ELCBASY	104,265
ENJSA	720
ENKAI	615
EREGL	270
EURTRY	3,415
FROTO	12,160
GARAN	1,565
GUBRF	3,350
HALKB	185
HEKTS	45

ISCTR	165
KCHOL	2,310
KONTR	570
KOZAA	805
KOZAL	275
KRDMD	335
MGROS	5,860
ODAS	70
OYAKC	945
PETKM	220
PGSUS	2,605
RUBTRY	4,800
SAHOL	1,095
SASA	50
SASX10	55
SISE	475
SOKM	460
TAVHL	3,425
TCELL	980
THYAO	3,275
TKFEN	905
TLREF	2,380
TOASO	2,255
TRT	3,500
TSKB	140
TTKOM	505
TUPRS	1,765
ULKER	1,295
USDTRY	3,270
VAKBN	265
VESTL	850
X10XB	11,185
XAUTRY	275

XLBNK	13,725
XSD25	12,975
XU030	9,950
YKBNK	380
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	35
XAGUSD	30
XAUUSD	125
XCUUSD	50
XPDUUSD	145
XPTUSD	70