

Genel Mektup : 1913

İstanbul, 18/10/2023

MERKEZİ VARLIK FİYATLAMA ve DEĞERLEME EKİBİ

Konu : KONTR Risk Parametreleri ve Dayanak Varlık Sayısı Limiti Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

Sayın Genel Müdür,

Merkezi karşı taraf hizmeti verdiğimiz Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda KONTR pay vadeli işlem sözleşmelerinin 20.10.2023 tarihinde işleme açılması kapsamında işlem teminatı hesaplamalarında kullanılacak risk parametreleri, piyasa koşulları dikkate alınarak yapılan değerlendirmeler sonucunda belirlenmiştir.

20.10.2023 Cuma günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ve uygulanacak dayanak varlık sayısı limitine ekte yer verilmektedir.

Belirlenen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 20.10.2023 tarihinde gün içi ilk risk hesaplama işlemleri sonrasında üye ekranlarından izlenebilecek olup, üyelerimizce teminat yükümlülüklerine ilişkin gerekli kontrollerin yapılması gerekmektedir.

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 (1 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSAK6EALPU> 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 : Risk Parametre ve Dayanak Varlık Sayısı Limiti Tablosu

| Dayanak Varlık | Fiyat Deęişim Aralığı (Price Scan Range-PSR %) | Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (Intra-Commodity Spread Charge TL) | Dayanak Varlık Sayısı Limiti (Number of Underlying Asset Limit) |
|-----------------------|---|---|--|
| KONTR | 18.60 | 3930 | 2000 |