

Genel Mektup : 1740

İstanbul, 13/12/2021

MERKEZİ RİSK YÖNETİMİ EKİBİ

Konu : Risk Parametrelerinin Güncellenmesi Hk.

İlgili : Bankalar, Aracı Kurumlar

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.

15.12.2021 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 15.12.2021 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 15.12.2021 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

15.12.2021 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 14.12.2021 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 15.12.2021 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_Aralık_2021 (12 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSPB5CH85C> Pin Kodu :

İstanbul Takas ve Saklama Bankası A.Ş.

Reşitpaşa Mahallesi Borsa İstanbul Caddesi No:4 Sarıyer 34467 İstanbul

T +09 212 315 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-1: BAP-BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu

| | TL DİBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES) | BANKA İHRACI ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (FINANCIAL CORPORATE BONDS) | BANKA DIŞI İHRAÇ ÖZEL SEKTÖR ÜRÜN GRUBU (NON-FINANCIAL CORPORATE BONDS) | YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (DOLAR) (USD EUROBOND) | YABANCI PARA ÖDEMELİ ÜRÜN GRUBU (EURO) (EURO EUROBOND) |
|-------------------|---|--|--|---|---|
| Vade (Gün) | PC1 | PC1 | PC1 | PC1 | PC1 |
| 1-7 | 50.00% | 50.00% | 50.00% | 50.00% | 50.00% |
| 180 | 2.50% | 8.55% | 15.42% | 22.13% | 24.04% |
| 365 | 2.50% | 8.62% | 14.12% | 9.69% | 10.29% |
| 730 | 2.06% | 8.64% | 13.19% | 4.34% | 4.91% |
| 1825 | 2.29% | 5.33% | 7.07% | 1.82% | 1.96% |
| 3650 | 4.30% | 6.44% | 7.65% | 1.02% | 2.12% |
| 10950 | | | | 1.02% | 2.12% |

- 1-) TL DİBS Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; Devlet Tahvilleri, Hazine Bonoları ve Kamu Kira Sertifikaları'dır.
- 2-) Banka İhracı Özel Sektör Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; bankaların ihraç ettiği Özel Sektör Tahvilleri, Finansman Bonoları ve Yapılandırılmış Borçlanma Araçları'dır.
- 3-) Banka Dışı İhraç Özel Sektör Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; banka dışı kuruluşların ihraç ettiği Özel Sektör Tahvili, Finansman Bonusu,
- 4-) Yabancı Para Ödemeli Ürün Grubuna dahil olan kıymetler; Eurotahviller, YP Kamu Kira Sertifikaları, YP Özel Kira Sertifikaları'dır.
- 5-) Vadeler arasındaki PC değerleri, tablodaki PC değerleri arasında lineer interpolasyonla elde edilen değere eşittir.

| Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR) | |
|--|--|
| Kontratlar (Contracts) | Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR) |
| Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond) | 115 |

EK-2: Pay Piyasası BISTECH Marjın Yöntemi Risk Parametre Tablosu

| PAY PİYASASI BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS) | | | |
|--|-------------------|----------------------------|----------------------------|
| Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR) | | | |
| LİKİDİTE GRUBU | ÜRÜN GRUBU | 1 Günlük PSR Değeri | 2 Günlük PSR Değeri |
| BIST30 (BIST30 Endeksi İçinde Yer Alan 30 adet Pay ve Borsa Endeks Fonları) | BIST30 | 11% | 14% |
| BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay) | BIST100 | 17% | 21% |
| Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar | BISTDİĞER | 22% | 28% |
| Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları) | BISTDİĞER | 19% | 24% |
| Varant (Alım) | VARANT | 100% | 100% |
| Varant (Satım) | | 130% | 130% |

EK-3: BİAŞ SWAP PİYASASI Vade Bazlı Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

| BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU | | |
|--|---|---|
| (TABLE OF RISK PARAMETERS) | | |
| Sözleşmeler (Contracts) | Alış Marjin Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%) | Satış Başlangıç Marjin Oranı (%) (Sell Side Initial Margin Ratio)(%) |
| XAUUSD | 3.50% | 3.90% |
| XAUEUR | 3.30% | 3.60% |
| XAUTRY | 7.70% | 4.50% |
| USDTRY | 6.50% | 3.40% |
| EURTRY | 6.60% | 3.60% |

EK-4: Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası BISTECH Marjin Yöntemi Risk Parametre Tablosu

| BISTECH MARJİN YÖNTEMİ RİSK PARAMETRE TABLOSU (TÜREV PİYASASI) (TABLE OF BISTECH RISK PARAMETERS) | |
|--|--|
| 1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR) | |
| Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options) | |
| Kontratlar (Contracts) | Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR) |
| AEFES | 365 |
| AKBNK | 110 |
| ALKIM | 325 |
| ARCLK | 600 |
| ASELS | 345 |
| BIMAS | 790 |
| COLA | 1215 |
| CNHTRY | 2260 |
| DOHOL | 55 |
| ECILC | 125 |
| EKGYO | 35 |
| ELCBASM | 6190 |
| ELCBASQ | 10630 |
| ELCBASY | 23000 |
| ENJSA | 200 |
| EREGL | 300 |
| EURTRY | 1640 |
| FROTO | 4385 |
| GARAN | 200 |
| GUBRF | 1415 |
| HALKB | 80 |
| HEKTS | 185 |
| ISCTR | 105 |
| ISFIN | 105 |

| | |
|-------------------|------|
| ISGYO | 40 |
| KARSN | 80 |
| KCHOL | 380 |
| KOZAA | 430 |
| KOZAL | 2130 |
| KRDMD | 145 |
| MGROS | 775 |
| MPARK | 580 |
| ODAS | 30 |
| OYAKC | 135 |
| PETKM | 130 |
| PGSUS | 1775 |
| RUBTRY | 1990 |
| SAHOL | 185 |
| SASA | 1085 |
| SASX10 | 75 |
| SISE | 165 |
| SKBNK | 15 |
| SOKM | 235 |
| TAVHL | 500 |
| TCELL | 230 |
| THYAO | 305 |
| TKFEN | 250 |
| TLREF (Vade Dışı) | 1705 |
| TLREF (Vade İçi) | 1445 |
| TOASO | 1150 |
| TRGYO | 65 |
| TSKB | 25 |
| TTKOM | 140 |
| TUPRS | 2355 |
| TURSG | 100 |
| ULKER | 290 |
| USDTRY | 1450 |

| | |
|--|---|
| USDTRYK | 1450 |
| VAKBN | 60 |
| VESTL | 635 |
| X10XB | 2700 |
| XAUTRY | 115 |
| XLBNK | 2205 |
| XU030 | 2350 |
| YKBNK | 50 |
| Kontratlar (Contracts) | Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR) |
| EURUSD | 25 |
| GBPUSD | 45 |
| XAGUSD | 30 |
| XAUUSD | 110 |
| XPDUUSD | 285 |
| XPTUSD | 95 |
| 2) Aşırı Hareket Senaryosu ve Kapsama Oranı (Extreme Move Multiplier and Extreme Move Covered Fraction) | |
| 1. Aşırı Hareket Senaryo Çarpanı (Extreme Move Multiplier) | 3 |
| 2.Kapsama Oranı (%) (Extreme Move Covered Fraction) | 32 |
| 3) 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 | 365 |
| AKBNK | 110 |
| ALKIM | 325 |
| ARCLK | 600 |
| ASELS | 345 |
| BIMAS | 790 |

| | |
|---------|-------|
| CCOLA | 1215 |
| CNHTRY | 2260 |
| DOHOL | 55 |
| ECILC | 125 |
| EKGYO | 35 |
| ELCBASM | 6190 |
| ELCBASQ | 10630 |
| ELCBASY | 23000 |
| ENJSA | 200 |
| EREGL | 300 |
| EURTRY | 1640 |
| FROTO | 4385 |
| GARAN | 200 |
| GUBRF | 1415 |
| HALKB | 80 |
| HEKTS | 185 |
| ISCTR | 105 |
| ISFIN | 105 |
| ISGYO | 40 |
| KARSN | 80 |
| KCHOL | 380 |
| KOZAA | 430 |
| KOZAL | 2130 |
| KRDMD | 145 |
| MGROS | 775 |
| MPARK | 580 |
| ODAS | 30 |
| OYAKC | 135 |
| PETKM | 130 |
| PGSUS | 1775 |
| RUBTRY | 1990 |
| SAHOL | 185 |
| SASA | 1085 |

| | |
|-----------------------------------|--|
| SASX10 | 75 |
| SISE | 165 |
| SKBNK | 15 |
| SOKM | 235 |
| TAVHL | 500 |
| TCELL | 230 |
| THYAO | 305 |
| TKFEN | 250 |
| TLREF | 1705 |
| TOASO | 1150 |
| TRGYO | 65 |
| TSKB | 25 |
| TTKOM | 140 |
| TUPRS | 2355 |
| TURSG | 100 |
| ULKER | 290 |
| USDTRY | 1450 |
| USDTRYK | 1450 |
| VAKBN | 60 |
| VESTL | 635 |
| X10XB | 2700 |
| XAUTRY | 115 |
| XLBNK | 2205 |
| XU030 | 2350 |
| YKBNK | 50 |
| Kontratlar (Contracts) | Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge) |
| EURUSD | 25 |
| GBPUSD | 45 |
| XAGUSD | 30 |
| XAUUSD | 110 |
| XPDUUSD | 285 |
| XPTUSD | 95 |

| 4)Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin) | |
|--|--|
| Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options) | |
| Kontratlar (Contracts) | Fiziki Teslimat Teminatı (TL) (Physical Delivery Margin) |
| USDTRY | 1450 |
| USDTRYK | 1450 |

EK-5: OTC- BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu

| Tezgah Üstü Türev Ürünler | |
|----------------------------------|------------|
| Vade (Gün) | PC1 |
| O/N | 8.34% |
| 30 | 8.34% |
| 60 | 8.34% |
| 90 | 8.34% |
| 180 | 8.34% |
| 270 | 7.26% |
| 365 | 6.17% |
| 720 | 4.94% |
| 1095 | 4.20% |
| 1460 | 3.73% |
| 1825 | 3.41% |
| 2555 | 3.07% |
| 3650 | 2.85% |

EK-6: Ödünç Pay Piyasası Risk Parametre Tablosu

| ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET) | |
|---|--------------------------------------|
| Gruplar (Groups) | Risk Parametreleri (Risk Parameters) |
| BIST30 | 114% |
| BIST30 Dışı | 119% |

EK-7: Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

| TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET) |
|---|
| RMD (VaR) |
| 2.58% |