

Genel Mektup : 1835

İstanbul, 23/12/2022

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.

27.12.2022 Salı günü, gün içi ilk risk hesaplama anından itibaren geçerli olacak risk parametrelerine ekte yer verilmektedir.

Değişen parametreler sonucunda teminat yükümlülüklerindeki olası artış veya azalışlar 27.12.2022 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 27.12.2022 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.

27.12.2022 Salı günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 26.12.2022 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 27.12.2022 Salı 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.

Murat GÖRGÜN
Genel Müdür Yardımcısı

Avşar R. SUNGURLU
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek :Risk Parametreleri (13 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSP58FDYUS> 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



BAP-BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu

	TL DİBS ÜRÜN GRUBU (TL GOVERNMENT DEBT SECURITIES)	ENFLASYONA ENDEKSLİ TL DİBS ÜRÜN GRUBU(INFLATION - INDEXED 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	PC1
1-7	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%	50.00%
180	2.88%	0.62%	10.16%	17.60%	32.95%	35.58%
365	2.88%	0.62%	10.26%	16.24%	15.65%	16.85%
730	2.97%	0.83%	10.71%	16.76%	7.85%	8.40%
1825	2.97%	0.74%	6.69%	9.01%	2.95%	3.07%
3650	2.97%	1.00%	5.18%	6.56%	1.46%	2.60%
10950					1.46%	2.60%

- 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 Bonosu,
- 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 Deęişim Aralıęı (Price Scan Range-PSR)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Deęişim Aralıęı (TL) (Price Scan Range - PSR)
Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)	170

Pay Piyasası BISTECH Marjin 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)	BIST30	15%	19%
Borsa Yatırım Fonları	YATIRIM FONU	15%	19%
BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay)	BIST100	20%	26%
Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	24%	31%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	21%	27%
BIST30 Sertifikası	SERTİFİKA	15%	19%
Darphane Altın Sertifikası	SERTİFİKA	10%	13%
DAX Sertifikası	SERTİFİKA	12%	15%
Varant (Alım)	VARANT	100%	100%
Varant (Satım)		150%	150%

BİAŞ SWAP Piyasası 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	4.10%	4.40%
XAUEUR	4.00%	4.20%
XAUTRY	9.40%	5.60%
USDTRY	8.20%	4.20%
EURTRY	8.20%	4.40%

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	1260
AKBNK	385
AKSEN	870
ALARK	1540
ALKIM	745
ARCLK	1710
ASELS	1110
BIMAS	1890
COLA	3335
CNHTRY	4075
DOHOL	180
ECILC	640
EKGYO	150
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	565
EREGL	770
EURTRY	2975
FROTO	9505
GARAN	560
GUBRF	4400
HALKB	255
HEKTS*	700

ISCTR	240
ISFIN	150
ISGYO	195
KARSN	255
KCHOL	1270
KOZAA	1030
KOZAL	9485
KRDMD	345
MGROS	2730
ODAS	215
OYAKC	390
PETKM	360
PGSUS	9095
RUBTRY	6185
SAHOL	830
SASA	2395
SASX10	85
SISE	715
SKBNK	55
SOKM	485
TAVHL	1660
TCELL	605
THYAO	2665
TKFEN	765
TLREF (Vade Dışı)	3340
TLREF (Vade İçi)	1600
TOASO	2580
TRGYO	335
TRT200923T18	1835
TRT020926T17	6590
TRT131130T14	8945
TSKB	90
TTKOM	395

TUPRS	8605
TURSG	250
ULKER	760
USDTRY	2650
USDTRYK	2650
VAKBN	225
VESTL	1335
X10XB	11745
XAUTRY	170
XLBNK	8370
XSD25	7985
XU030	7590
YKBNK	225
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	140
XPDUUSD	420
XPTUSD	125
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	1260

AKBNK	385
AKSEN	870
ALARK	1540
ALKIM	745
ARCLK	1710
ASELS	1110
BIMAS	1890
CCOLA	3335
CNHTRY	4075
DOHOL	180
ECILC	640
EKGYO	150
ELCBASM	33245
ELCBASQ	57120
ELCBASY	123610
ENJSA	565
EREGL	770
EURTRY	2975
FROTO	9505
GARAN	560
GUBRF	4400
HALKB	255
HEKTS*	700
ISCTR	240
ISFIN	150
ISGYO	195
KARSN	255
KCHOL	1270
KOZAA	1030
KOZAL	9485
KRDMD	345
MGROS	2730
ODAS	215

OYAKC	390
PETKM	360
PGSUS	9095
RUBTRY	6185
SAHOL	830
SASA	2395
SASX10	85
SISE	715
SKBNK	55
SOKM	485
TAVHL	1660
TCELL	605
THYAO	2665
TKFEN	765
TLREF	3340
TOASO	2580
TRGYO	335
TRT	610
TSKB	90
TTKOM	395
TUPRS	8605
TURSG	250
ULKER	760
USDTRY	2650
USDTRYK	2650
VAKBN	225
VESTL	1335
X10XB	11745
XAUTRY	170
XLBNK	8370
XSD25	7985
XU030	7590
YKBNK	225

Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	35
GBPUSD	55
XAGUSD	40
XAUUSD	140
XPDUSD	420
XPTUSD	125
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	2650
USDTRYK	2650

*Özsermaye hallerine ilişkin yapılan düzeltmeler fiyat değişim aralığı (PSR) parametresine yansıtılacaktır.

OTC- BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu

Tezgah Üstü Türev Ürünler	
Vade (Gün)	PC1
O/N	8.22%
30	8.22%
60	8.22%
90	8.22%
180	8.22%
270	7.29%
365	7.59%
720	7.27%
1095	5.94%
1460	5.24%
1825	4.60%
2555	4.95%
3650	5.19%

Ödünç Pay Piyasası Risk Parametre Tablosu

ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)	
Gruplar (Groups)	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
BIST30	119%
BIST30 Dışı	123%

Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET)
RMD (VaR)
3.46%