

Genel Mektup : 1735

İstanbul, 17/11/2021

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.

22.11.2021 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 22.11.2021 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 22.11.2021 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

22.11.2021 Pazartesi günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 19.11.2021 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 22.11.2021 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

Gökhan ELİBOL
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk_Parametreleri_Kasım_2021 (12 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSPB4M2F1P> 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%	8.56%	15.44%	19.66%	21.88%
365	2.50%	8.62%	14.20%	9.07%	8.61%
730	2.06%	8.67%	13.06%	4.25%	4.34%
1825	2.29%	5.27%	7.00%	1.68%	1.60%
3650	4.30%	6.37%	7.61%	0.94%	2.09%
10950				0.94%	2.09%

- 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)	70

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	18%	22%
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%	23%
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	3.40%	3.60%
XAUTRY	4.80%	4.40%
USDTRY	3.90%	3.40%
EURTRY	4.00%	3.50%

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	310
AKBNK	90
ALKIM	300
ARCLK	455
ASELS	270
BIMAS	705
COLA	1065
CNHTRY	1700
DOHOL	50
ECILC	105
EKGYO	30
ELCBASM	5010
ELCBASQ	8610
ELCBASY	18630
ENJSA	170
EREGL	245
EURTRY	1235
FROTO	3160
GARAN	165
GUBRF	1010
HALKB	75
HEKTS	140
IPEKE	335
ISCTR	80

ISFIN	95
ISGYO	30
KARSN	70
KCHOL	300
KOZAA	430
KOZAL	1810
KRDMD	120
MGROS	600
MPARK	485
ODAS	25
OYAKC	120
PETKM	105
PGSUS	1450
RUBTRY	1500
SAHOL	150
SASA	780
SASX10	75
SISE	115
SKBNK	15
SOKM	185
TAVHL	430
TCELL	190
THYAO	235
TKFEN	185
TLREF (Vade Dışı)	1730
TLREF (Vade İçi)	1435
TOASO	825
TRGYO	60
TSKB	20
TTKOM	110
TUPRS	1930
TURSG	95
ULKER	280

USDTRY	1075
USDTRYK	1075
VAKBN	50
VESTL	540
X10XB	2200
XAUTRY	70
XLBNK	1630
XU030	2000
YKBNK	40
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	25
GBPUSD	45
XAGUSD	30
XAUUSD	110
XPDUSD	300
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	310
AKBNK	90
ALKIM	300
ARCLK	455
AELS	270

BIMAS	705
CCOLA	1065
CNHTRY	1700
DOHOL	50
ECILC	105
EKGYO	30
ELCBASM	5010
ELCBASQ	8610
ELCBASY	18630
ENJSA	170
EREGL	245
EURTRY	1235
FROTO	3160
GARAN	165
GUBRF	1010
HALKB	75
HEKTS	140
IPEKE	335
ISCTR	80
ISFIN	95
ISGYO	30
KARSN	70
KCHOL	300
KOZAA	430
KOZAL	1810
KRDMD	120
MGROS	600
MPARK	485
ODAS	25
OYAKC	120
PETKM	105
PGSUS	1450
RUBTRY	1500

SAHOL	150
SASA	780
SASX10	75
SISE	115
SKBNK	15
SOKM	185
TAVHL	430
TCELL	190
THYAO	235
TKFEN	185
TLREF	1730
TOASO	825
TRGYO	60
TSKB	20
TTKOM	110
TUPRS	1930
TURSG	95
ULKER	280
USDTRY	1075
USDTRYK	1075
VAKBN	50
VESTL	540
X10XB	2200
XAUTRY	70
XLBNK	1630
XU030	2000
YKBNK	40
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	25
GBPUSD	45
XAGUSD	30
XAUUSD	110

XPDUSD	300
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	1075
USDTRYK	1075

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	120%

EK-7: Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

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