

Genel Mektup : 1785

İstanbul, 18/03/2022

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.

23.03.2022 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 23.03.2022 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 23.03.2022 gün içi ilk risk hesaplama anı itibarıyla Takasbank internet sitesinde duyurulacaktır.

23.03.2022 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 22.03.2022 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 23.03.2022 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_Mart_2022 (13 sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSFBZAH7UC> 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)	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	2.50%	0.61%	8.76%	14.38%	28.28%	30.30%
365	2.50%	0.62%	8.91%	14.03%	13.44%	14.36%
730	2.22%	0.67%	8.82%	13.90%	6.73%	7.21%
1825	2.22%	0.67%	5.39%	7.20%	2.53%	2.63%
3650	2.22%	0.67%	3.85%	4.75%	1.25%	2.24%
10950					1.25%	2.24%

- 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.
- 6-) Enflasyona endeksli DİBS ürünlerinin parametreleri TL DİBS ürünleri üzerinden hesaplanmıştır.

Fiyat Deęişim Aralıęı (Price Scan Range-PSR)	
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Deęişim Aralıęı (TL) (Price Scan Range - PSR)
Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)	135

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	12%	15%
Borsa Yatırım Fonları	YATIRIM FONU	12%	15%
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 Pazarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	18%	23%
Varant (Alım)	VARANT	100%	100%
Varant (Satım)		130%	130%

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	3.50%	3.80%
XAUEUR	3.40%	3.50%
XAUTRY	8.10%	4.80%
USDTRY	7.10%	3.60%
EURTRY	6.90%	3.80%

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	445
AKBNK	120
ALKIM	330
ARCLK	845
ASELS	415
BIMAS	1000
COLA	1575
CNHTRY	2425
DOHOL	50
ECILC	145
EKGYO	35
ELCBASM	10445
ELCBASQ	17945
ELCBASY	38830
ENJSA	245
EREGL	485
EURTRY	1705
FROTO	5210
GARAN	200
GUBRF	1470
HALKB	75
HEKTS	230
ISCTR	140
ISFIN	90

ISGYO	100
KARSN	75
KCHOL	440
KOZAA	480
KOZAL	2350
KRDMD	225
MGROS	730
ODAS	25
OYAKC	140
PETKM	140
PGSUS	1825
RUBTRY	1640
SAHOL	240
SASA	1335
SASX10	65
SISE	210
SKBNK	15
SOKM	230
TAVHL	595
TCELL	270
THYAO	490
TKFEN	315
TLREF (Vade Dışı)	2715
TLREF (Vade İçi)	1455
TRT200923T18	1495
TRT020926T17	3615
TRT131130T14	4055
TOASO	1310
TRGYO	105
TSKB	25
TTKOM	160
TUPRS	3340
TURSG	90

ULKER	245
USDTRY	1550
USDTRYK	1550
VAKBN	60
VESTL	510
X10XB	3860
XAUTRY	135
XLBNK	2340
XU030	2400
YKBNK	65
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	50
XAGUSD	35
XAUUSD	130
XPDUSD	425
XPTUSD	115
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	445
AKBNK	120
ALKIM	330
ARCLK	845

ASELS	415
BIMAS	1000
CCOLA	1575
CNHTRY	2425
DOHOL	50
ECILC	145
EKGYO	35
ELCBASM	10445
ELCBASQ	17945
ELCBASY	38830
ENJSA	245
EREGL	485
EURTRY	1705
FROTO	5210
GARAN	200
GUBRF	1470
HALKB	75
HEKTS	230
ISCTR	140
ISFIN	90
ISGYO	100
KARSN	75
KCHOL	440
KOZAA	480
KOZAL	2350
KRDMD	225
MGROS	730
ODAS	25
OYAKC	140
PETKM	140
PGSUS	1825
RUBTRY	1640
SAHOL	240

SASA	1335
SASX10	65
SISE	210
SKBNK	15
SOKM	230
TAVHL	595
TCELL	270
THYAO	490
TKFEN	315
TLREF	2715
TRT200923T18	1495
TRT020926T17	3615
TRT131130T14	4055
TOASO	1310
TRGYO	105
TSKB	25
TTKOM	160
TUPRS	3340
TURSG	90
ULKER	245
USDTRY	1550
USDTRYK	1550
VAKBN	60
VESTL	510
X10XB	3860
XAUTRY	135
XLBNK	2340
XU030	2400
YKBNK	65
Kontratlar (Contracts)	Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
EURUSD	35
GBPUSD	50

XAGUSD	35
XAUUSD	130
XPDUSD	425
XPTUSD	115

OTC- BISTECH Nakit Akım Teminatlandırma Yöntemi Temel Bileşen Parametre Tablosu

Tezgah Üstü Türev Ürünler	
Vade (Gün)	PC1
O/N	9.49%
30	9.49%
60	9.49%
90	9.49%
180	9.49%
270	8.95%
365	6.93%
720	5.21%
1095	4.40%
1460	4.10%
1825	3.67%
2555	3.14%
3650	3.03%

Ödünç Pay Piyasası Risk Parametre Tablosu

ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)	
Gruplar (Groups)	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
BIST30	115%
BIST30 Dışı	120%

Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET)
RMD (VaR)
2.67%