

Genel Mektup : 1802

İstanbul, 17/06/2022

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.

22.06.2022 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 22.06.2022 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 22.06.2022 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.

22.06.2022 Çarşamba günü anlık teminat tamamlama çağrısı takiplerinin 21.06.2022 tarihli risk parametrelerine göre yapılması gerekmektedir. 22.06.2022 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

Taşkın ÖKER
Genel Müdür Yardımcısı

Ek :Risk_Parametreleri (13 Sayfa)

Evrakı Doğrulamak İçin : <https://belgedogrulama.takasbank.com.tr/belgedogrulama.aspx?eD=BSCBRRRA2FC> 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	2.75%	0.58%	9.59%	15.91%	31.64%	33.32%
365	2.75%	0.58%	9.79%	15.40%	15.09%	15.84%
730	2.44%	0.50%	9.55%	15.53%	7.54%	8.01%
1825	2.44%	0.50%	5.85%	7.90%	2.82%	2.93%
3650	2.44%	0.50%	4.36%	5.51%	1.39%	2.49%
10950					1.39%	2.49%

- 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 Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	
1802 Kontratlar (Contracts)	17/06/2022 Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)
Altına Dayalı Devlet Tahvili (Gold Backed Bond)	155

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

1802 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	13%	17%
Borsa Yatırım Fonları	YATIRIM FONU	13%	17%
BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay)	BIST100	19%	24%
Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	24%	30%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	20%	25%
Varant (Alım)	VARANT	100%	100%
Varant (Satım)		130%	130%

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

BİAŞ SWAP PİYASASI RİSK PARAMETRE TABLOSU		
1802	(TABLE OF RISK PARAMETERS)	17/06/2022
Sözleşmeler (Contracts)	Alış Marjin Oranı (%) (Buy Side Initial Margin Ratio)(%)	Satış Başlangıç Marjin Oranı (%) (Sell Side Initial Margin Ratio)(%)
XAUUSD	4.30%	4.20%
XAUEUR	3.80%	4.00%
XAUTRY	9.00%	5.30%
USDTRY	7.90%	4.00%
EURTRY	7.90%	4.20%

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)		
1802	1) Fiyat Değişim Aralığı (Price Scan Range-PSR)	17/06/2022
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)		
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (TL) (Price Scan Range - PSR)	
AEFES	530	
AKBNK	145	
ALKIM	430	
ARCLK	1300	
ASELS	475	
BIMAS	1220	
COLA	2010	
CNHTRY	2860	
DOHOL	75	
ECILC	195	
EKGYO	40	
ELCBASM	15210	
ELCBASQ	26135	
ELCBASY	56555	
ENJSA	280	
EREGL	570	
EURTRY	1990	
FROTO	6585	
GARAN	285	
GUBRF	1540	
HALKB	100	
HEKTS	550	
ISCTR*	85	
ISFIN	130	

	ISGYO		285
	KARSN		140
	KCHOL		630
1802	KOZAA	17/06/2022	740
	KOZAL		3705
	KRDMD		285
	MGROS		895
	ODAS		55
	OYAKC		240
	PETKM		185
	PGSUS		2875
	RUBTRY		4310
	SAHOL		390
	SASA*		1110
	SASX10		70
	SISE		375
	SKBNK		20
	SOKM*		265
	TAVHL		825
	TCELL		280
	THYAO		905
	TKFEN		310
	TLREF (Vade Dışı)		2565
	TLREF (Vade İçi)		1430
	TRT200923T18		1525
	TRT020926T17		3695
	TRT131130T14		4365
	TOASO		1340
	TRGYO		155
	TSKB		35
	TTKOM		185
	TUPRS		5035
	TURSG		110

	ULKER		280
	USDTRY		1770
	USDTRYK		1770
1802	VAKBN	17/06/2022	75
	VESTL		625
	X10XB		5590
	XAUTRY		155
	XLBNK		3170
	XU030		3170
	YKBNK		80
	Kontratlar (Contracts)		Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
	EURUSD		30
	GBPUSD		45
	XAGUSD		30
	XAUUSD		135
	XPDUSD		460
	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		530
	AKBNK		145
	ALKIM		430
	ARCLK		1300

	ASELS		475
	BIMAS		1220
	CCOLA		2010
1802	CNHTRY	17/06/2022	2860
	DOHOL		75
	ECILC		195
	EKGYO		40
	ELCBASM		15210
	ELCBASQ		26135
	ELCBASY		56555
	ENJSA		280
	EREGL		570
	EURTRY		1990
	FROTO		6585
	GARAN		285
	GUBRF		1540
	HALKB		100
	HEKTS		550
	ISCTR		85
	ISFIN		130
	ISGYO		285
	KARSN		140
	KCHOL		630
	KOZAA		740
	KOZAL		3705
	KRDMD		285
	MGROS		895
	ODAS		55
	OYAKC		240
	PETKM		185
	PGSUS		2875
	RUBTRY		4310
	SAHOL		390

	SASA		1110
	SASX10		70
	SISE		375
1802	SKBNK	17/06/2022	20
	SOKM		265
	TAVHL		825
	TCELL		280
	THYAO		905
	TKFEN		310
	TLREF		2565
	TOASO		1340
	TRGYO		155
	TRT		540
	TSKB		35
	TTKOM		185
	TUPRS		5035
	TURSG		110
	ULKER		280
	USDTRY		1770
	USDTRYK		1770
	VAKBN		75
	VESTL		625
	X10XB		5590
	XAUTRY		155
	XLBNK		3170
	XU030		3170
	YKBNK		80
	Kontratlar (Contracts)		Vadeler Arası Yayılma Pozisyonu Riski (USD) (Intra-Commodity Spread Charge)
	EURUSD		30
	GBPUSD		45
	XAGUSD		30
	XAUUSD		135

	XPDUSD	460
	XPTUSD	115
1802	4)Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin)	
	Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	17/06/2022
	Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (TL) (Physical Delivery Margin)
	USDTRY	1770
	USDTRYK	1770

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

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

Tezgah Üstü Türev Ürünler			
1802	Vade (Gün)	17/06/2022	PC1
	O/N		7.05%
	30		7.05%
	60		7.05%
	90		7.05%
	180		7.05%
	270		5.80%
	365		6.32%
	720		6.01%
	1095		5.16%
	1460		4.41%
	1825		3.71%
	2555		3.33%
	3650		4.11%

EK-6: Ödünç Pay Piyasası Risk Parametre Tablosu

1802

17/06/2022

ÖDÜNÇ PAY PİYASASI (SECURITIES LENDING MARKET)	
Gruplar (Groups)	Risk Parametreleri (Risk Parameters)
BIST30	117%
BIST30 Dışı	122%

EK-7: Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET)	
1802	RMD (VaR)
	2.98%

17/06/2022