

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%	9.00%	18.14%	18.99%	18.64%
365	3.41%	8.71%	14.91%	8.98%	8.01%
730	2.62%	8.92%	13.23%	4.25%	3.92%
1825	2.38%	5.16%	6.83%	1.66%	1.58%
3650	2.12%	3.64%	4.56%	0.79%	1.00%
10950				0.66%	0.92%

- 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)	35

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	10%	13%
BIST100-30 (BIST 100 İçinde Yer Alan 100 Adet Paydan BIST30 İçindeki 30 Adet Pay Haricinde Kalan 70 Adet Pay)	BIST100	13%	16%
Gelişen İşletmeler Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	26%	32%
Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	25%	31%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme ve Gelişen İşletmeler Pazarlarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	22%	28%
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 (TABLE OF RISK PARAMETERS FOR SWAP MARKET)		
TL-Başlangıç Marjin Oranı (%) (TRY-Initial Margin Ratio)(%) Valörde TRY Alan (TRY Buyer at Value Date)	USD-Başlangıç Marjin Oranı (%) (USD-Initial Margin Ratio)(%) Valörde USD Alan (USD Buyer at Value Date)	EUR-Başlangıç Marjin Oranı (%) (EUR-Initial Margin Ratio)(%) Valörde EUR Alan (EUR Buyer at Value Date)
3.00%	3.30%	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 FOR DERIVATIVES MARKET)	
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)
AKBNK	110
ARCLK	225
ASELS	440
BIMAS	495
BIST30	1170
COLA	530
CNHTRY	900
COTEGE	895
DOHOL	40
EKGYO	20
ELCBASM	2480
ELCBASQ	4260
ELCBASY	9215
ENJSA	100
ENKAI	70
EREGL	100
EURTRY	750
FROTO	995
GARAN	155
HALKB	115
ISCTR	90
KCHOL	200
KOZAA	390
KOZAL	1850
KRDMD	40
MGROS	315
PETKM	45
PGSUS	1030

RUBTRY	900
SAHOL	105
SASA	240
SASX	55
SISE	55
SODA	70
TAVHL	310
TCELL	165
THYAO	175
TKFEN	205
TLREF	380
TOASO	330
TRKCM	40
TTKOM	110
TSKB	15
TUPRS	1360
ULKER	295
USDTRY	670
USDTRYK	670
VAKBN	95
WHTANR	1150
WHTDRM	1690
X10XB	1250
XAUTRY	35
XBANK	1980
XLBNK	1590
XUSIN	1040
YKBNK	35
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	45
HMSTR	310
XAUUSD	75
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)
AKBNK	110
ARCLK	225
ASELS	440
BIMAS	495
BIST30	1170
COLA	530
CNHTRY	900
COTEGE	895
DOHOL	40
EKGYO	20
ELCBASM	2480
ELCBASQ	4260
ELCBASY	9215
ENJSA	100
ENKAI	70
EREGL	100
EURTRY	750
FROTO	995
GARAN	155
HALKB	115
ISCTR	90
KCHOL	200
KOZAA	390
KOZAL	1850
KRDMD	40
MGROS	315
PETKM	45
PGSUS	1030
RUBTRY	900
SAHOL	105
SASA	240
SASX	55
SISE	55
SODA	70
TAVHL	310
TCELL	165
THYAO	175
TKFEN	205
TLREF	380

TOASO	330
TRKCM	40
TTKOM	110
TSKB	15
TUPRS	1360
ULKER	295
USDTRY	670
USDTRYK	670
VAKBN	95
WHTANR	1150
WHTDRM	1690
X10XB	1250
XAUTRY	35
XBANK	1980
XLBNK	1590
XUSIN	1040
YKBNK	35
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	35
GBPUSD	45
HMSTR	310
XAUUSD	75
Fiziki Teslimat Teminatı (Physical Delivery Margin)	
Vadeli İşlem Sözleşmeleri ve Opsiyon Sözleşmeleri (Futures and Options)	
Kontratlar (Contracts)	Fiziki Teslimat Teminatı (TL) (Physical Delivery Margin)
WHTANR	2055
WHTDRM	3025
COTEGE	1600

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

Vadeler (Tenors)	Tezgah Üstü Türev Ürünler (OTC Derivatives)
Vade (Gün)	PC1
O/N	6.29%
30	6.29%
60	6.29%
90	6.29%
180	5.60%
270	5.01%
365	4.69%
720	4.14%
1095	3.53%
1460	3.03%
1825	2.76%
2555	2.28%
3650	1.98%