

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%	8.63%	15.76%	19.92%	21.99%
365	2.50%	8.65%	15.26%	9.09%	8.70%
730	2.06%	8.71%	13.19%	4.29%	4.38%
1825	2.29%	5.25%	7.04%	1.69%	1.60%
3650	4.30%	6.38%	7.66%	0.93%	1.58%
10950	4.30%	6.38%	7.66%	0.93%	1.58%

- 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)	55

EK-2: 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 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	16%	20%
Yakın İzleme Pazarında İşlem Gören Paylar	BISTDİĞER	23%	29%
Diğer (BIST100 Payları, Yakın İzleme Pazarındaki Paylar, Varantlar ve Sertifikalar Haricindeki Tüm Pay Piyasası Araçları)	BISTDİĞER	23%	29%
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	3.75%	4.05%
XAUEUR	3.75%	3.75%
XAUTRY	5.05%	4.75%
USDTRY	3.85%	3.35%
EURTRY	3.85%	3.45%

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	340
AKBNK	70
ALKIM	300
ARCLK	440
ASELS	255
BIMAS	775
CCOLA	1065
CNHTRY	1355
COTEGE	1465
DOHOL	60
ECILC	120
EKGYO	30
ELCBASM	2575
ELCBASQ	4420
ELCBASY	9565
ENJSA	190
ENKAI	110
EREGL	225
EURTRY	1065
FROTO	3095
GARAN	110
GUBRF	1240
HALKB	70

HEKTS	315
IPEKE	385
ISCTR	65
ISFIN	100
ISGYO	30
KARSN	75
KCHOL	230
KOZAA	435
KOZAL	2430
KRDMD	120
MGROS	620
MPARK	410
ODAS	60
OYAKC	130
PETKM	105
PGSUS	1285
RUBTRY	1270
SAHOL	95
SASA	1020
SASX10	50
SISE	100
SKBNK	15
SOKM	210
TAVHL	335
TCELL	185
THYAO	200
TKFEN	205
TLREF	380
TOASO	465
TRGYO	60
TSKB	20
TTKOM	95
TUPRS	1375

TURSG	120
ULKER	310
USDTRY	850
USDTRYK	850
VAKBN	55
VESTL	730
WHTANR	1630
WHTDRM	1800
X10XB	1730
XAUTRY	55
XLBNK	1810
XU030	1450
YKBNK	30
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	30
GBPUSD	55
HMSTR	470
XAGUSD	30
XAUUSD	110
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	340
AKBNK	70

ALKIM	300
ARCLK	440
ASELS	255
BIMAS	775
CCOLA	1065
CNHTRY	1355
COTEGE	1465
DOHOL	60
ECILC	120
EKGYO	30
ELCBASM	2575
ELCBASQ	4420
ELCBASY	9565
ENJSA	190
ENKAI	110
EREGL	225
EURTRY	1065
FROTO	3095
GARAN	110
GUBRF	1240
HALKB	70
HEKTS	315
IPEKE	385
ISCTR	65
ISFIN	100
ISGYO	30
KARSN	75
KCHOL	230
KOZAA	435
KOZAL	2430
KRDMD	120
MGROS	620
MPARK	410

ODAS	60
OYAKC	130
PETKM	105
PGSUS	1285
RUBTRY	1270
SAHOL	95
SASA	1020
SASX10	50
SISE	100
SKBNK	15
SOKM	210
TAVHL	335
TCELL	185
THYAO	200
TKFEN	205
TLREF	380
TOASO	465
TRGYO	60
TSKB	20
TTKOM	95
TUPRS	1375
TURSG	120
ULKER	310
USDTRY	850
USDTRYK	850
VAKBN	55
VESTL	730
WHTANR	1630
WHTDRM	1800
X10XB	1730
XAUTRY	55
XLBNK	1810
XU030	1450

YKBNK	30
Kontratlar (Contracts)	Fiyat Değişim Aralığı (USD) (Price Scan Range - PSR)
EURUSD	30
GBPUSD	55
HMSTR	470
XAGUSD	30
XAUUSD	110
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)
WHTANR	2915
WHTDRM	3220
COTEGE	2620

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	118%

EK-7: Takasbank Para Piyasası Risk Parametre Tablosu

TAKASBANK PARA PİYASASI (TAKASBANK MONEY MARKET)
RMD (VaR)
2.71%