

Tablolar

Tablo 1

Vadeden Sonraki İş Günü Sayısı	Oran (%)
5 ile 15 gün arası	8
16 ile 30 gün arası	50
31 ile 45 gün arası	75
46 ve daha fazla gün	100

Tablo 2

İşlem Tipi	Sözleşmenin gerektirdiği ilk ödeme veya teslimine kadar	Sözleşmenin gerektirdiği ilk ödeme veya teslimden, ikinci ödeme veya teslimin dört iş günü sonrasına kadar	Sözleşmenin gerektirdiği ikinci ödeme veya teslimin beşinci iş gününden itibaren işlemin sona ermesine kadar
Ödemesiz teslim	Sermaye yükümlülüğü hesaplanmasına gerek yoktur.	Riske maruz kalındığı kabul edilir ve bir alacak gibi değerlendirilir.	Özkaynaktan indirilir.

Tablo 3

Vadeye Kalan Süre	Risk Ağırlığı (%)
I. ZAMAN ARALIĞI	
1 aydan daha az	0,00
1 ile 3 ay arası (3 ay dâhil)	0,20
3 ile 6 ay arası (6 ay dâhil)	0,40
6 ay ile 12 ay arası (12 ay dâhil)	0,70
II. ZAMAN ARALIĞI	
1 ile 2 yıl arası (2 yıl dâhil)	1,25
2 ile 3 yıl arası (3 yıl dâhil)	1,75
3 ile 4 yıl arası (4 yıl dâhil)	2,25
III. ZAMAN ARALIĞI	
4 ile 5 yıl arası (5 yıl dâhil)	2,75
5 ile 7 yıl arası (7 yıl dâhil)	3,25
7 ile 10 yıl arası (10 yıl dâhil)	3,75
10 ile 15 yıl arası (15 yıl dâhil)	4,50
15 ile 20 yıl arası (20 yıl dâhil)	5,25
20 yıl ve daha fazla	6,00

Tablo 4

Menkul Kıymet Türü	Oran (%)
Kamu Menkul Kıymetleri	% 0.00
Nitelikli Menkul Kıymetler:	
Vadeye Kalan Süresi 6 ay ve daha az olanlar	% 0.25
Vadeye Kalan Süresi 6 –24 ay olanlar	% 1.00
Vadeye Kalan Süresi 24 aydan uzun olanlar	% 1.60
Diğer Menkul Kıymetler	% 8.00

Tablo 5

ENDEKS	ÜLKE
BİST	Türkiye
S & P 500	A.B.D
NIKKEI 25	Japonya
DAX	Almanya
FTSE 100 ve FTSE -Mid 250	İngiltere
CAC 40	Fransa
TSE 35	Kanada
SMI	İsviçre
OMX	İsveç
IBEX 35	İspanya
EOE 25	Hollanda
BEL 20	Belçika
ATX	Avusturya

Tablo 6

Basitleştirilmiş Yöntem

Pozisyon	Uygulama
Sözleşmeye konu varlığa ilişkin uzun pozisyon ve uzun satım opsiyonu veya Sözleşmeye konu varlığa ilişkin kısa pozisyon ve uzun alım opsiyonu	Sermaye yükümlülüğü, sözleşmeye konu varlığın piyasa fiyatı ile spesifik ve genel piyasa riski oranları toplamının çarpımından, kârda opsiyonun gerçek değerinin çıkarılması suretiyle bulunur.
Uzun alım opsiyonu veya Uzun satım opsiyonu	Sermaye yükümlülüğü, aşağıdakilerden küçük olanıdır: <ul style="list-style-type: none"> Sözleşmeye konu varlığın piyasa fiyatı ile spesifik ve genel piyasa riski oranları toplamının çarpımı Opsiyonun piyasa fiyatı

Tablo 7

Vade dilimi	Spread oranı (%)
≤ 1 ay	1,50
> 1 ay ve ≤ 3 ay	1,50
> 3 ay ve ≤ 6 ay	1,50
> 6 ay ve ≤ 12 ay	1,50
> 1 yıl ve ≤ 2 yıl	1,50
> 2 yıl ve ≤ 3 yıl	1,50
> 3 yıl	1,50

Tablo 8

Seviye 1	Seviye 2	Aktivite Grupları	% Oran
Kurumsal Finansman	Kurumsal Finansman	Birleşme ve devralmalara, özelleştirmelere, sekürityasyon finansmanına (varlıkların menkul kıymetleştirilmesi), araştırma, devlete, kamu kurumlarına, belediyelere doğrudan ya da borçlanma senetleri mukabili verilen krediler, sendikasyon kredileri, ortaklık payı edinimi, danışmanlık hizmetleri.	18
	Ticari Bankacılık		
	Belediye/Kamu Finansmanı		
	Danışmanlık Hizmetleri		
Alım - Satım	Satışlar	Para ve sermaye piyasası araçlarının alım ve satımı, repo, ters repo işlemleri, efektif döviz ve kıymetli maden işlemleri gibi hazine işlemleri ile emtiaya dayalı sözleşmelerin alım satımı.	18
	Piyasa İşlemleri		
	Emtiyaya dayalı Pozisyonlar		
	Hazine İşlemleri		
Perakende Bankacılık	Perakende Bankacılık	Tüketici kredi ve mevduatları, bankacılık hizmetleri, bireysel krediler ve mevduatlar, bankacılık hizmetleri, yatırım danışmanlıkları, Ticari/Bireysel/Kurumsal kartlar, perakende servisler.	12
	Bireysel Bankacılık		
	Kart Servisleri		
Ticari Bankacılık	Ticari Bankacılık	Proje finansmanı, gayrimenkul, ihracat finansmanı, ticari kredi, faktoring, finansal kiralama, kredi, garantiler, dış ticaret işlemleri, kambiyo işlemleri.	15
Takas ve Ödemeler	Banka Dışı Müşteriler	Ödeme ve tahsilatlar, para havaleleri, takas hizmetleri.	18
Acente Hizmetleri	Emanet ve Saklama Şirket Acenteliği	Sigorta acenteliği, kiralık kasa ve saklama faaliyetleri, menkul kıymet kredisi.	15
Varlık Yönetimi	İsteğe Bağlı ve İsteğe Bağlı Olmayan Varlık Yönetimi	Çeşitlendirilmiş, bireysel, kurumsal, açık, kapalı, özel fonlar	12
Perakende Aracılık	Perakende Aracılık	Tam yetkili bireysel aracılık hizmeti	12