

ViOP Vadeli İşlem Sözleşmesi Fiyatının Risk Hesaplamasında Kullanılması

ViOP'ta 21.02.2025 tarihinden itibaren başlangıç teminatlarının hesaplamasında dayanak varlık fiyatı (spot fiyat) yerine vadeli işlem sözleşmelerinin kendi fiyatlarının kullanılması uygulamasına geçilecektir.

Örneğin;

F_AKBNK sözleşmesinde 20.02.2025 tarihinde,

AKBNK Spot fiyat; 65,85

PSR;16,6

Bütün vadeler için $65,85 * 0.166 * 100 = 1,093.11$ TL başlangıç teminatı hesaplarken,

21.02.2025 tarihinden itibaren aşağıdaki şekilde hesaplanacak;

F_AKBNK0225 Fiyat; 66,35 Başlangıç Teminatı; 1,101.41 TL

F_AKBNK0325 Fiyat; 66,86 Başlangıç Teminatı; 1,109.88 TL

F_AKBNK0425 Fiyat; 68,94 Başlangıç Teminatı; 1,144.40 TL

Aşağıdaki linkten ilgili duyuruya ulaşabilirsiniz.

https://www.takasbank.com.tr/documents/file/Takasbank_Announcement/2047-19053fae-0230-4964-b5bf-eca9234d5be7.pdf