

Sayı : E-18454353-2-100.04.02-28700

29.08.2024

Konu : CNH/TL Vadeli İşlem Sözleşmelerinin
Vade Sonu Uzlaşma Fiyatı Hesaplama
Yöntemi Değişikliği Hk. Duyuru

Sn. Yetkili

Borsamız Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası'nda (VİOP) işlem gören CNH/TL vadeli işlem sözleşmelerinin vade sonu uzlaşma fiyatı hesaplama yönteminin, vade sonu tarihi 31/12/2024'ten sonra olan yeni işleme açılacak sözleşmeler için geçerli olmak üzere;

"Vade sonu uzlaşma fiyatı, son işlem gününde Türkiye Saati ile 17:00:00 – 17:00:59 arasında LSEG Data & Analytics Workspace tarafından CNH=kodu ile açıklanan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı kuru alış ve satış fiyatlarının ortalaması ile TCMB tarafından son işlem günü açıklanan gösterge niteliğindeki ABD Doları alış ve satış kurları ortalaması kullanılarak hesaplanan Offshore Çin Yuanı/Türk Lirası kurudur.

Belirlenen yöntem ile hesaplanan vade sonu uzlaşma fiyatı en yakın fiyat adımına yuvarlanır.

Son işlem gününde resmi tatil veya başka bir nedenle fiyat açıklanmaması, yeterli veri bulunamaması veya fiyatların piyasayı yansıtmadığına kanaat getirilmesi halinde vade sonu uzlaşma fiyatı Uzlaşma Fiyatı Komitesi tarafından belirlenir."

şeklinde değiştirilmesine karar verilmiştir.

VİOP Prosedürü'nde geçerli olacak değişiklikler Ek'te yer almaktadır. Prosedürün güncel haline Borsamız internet sitesindeki "Kurumsal" başlığı "Mevzuat" alt başlığındaki "Prosedürler" sayfasından (<https://www.borsaistanbul.com/tr/sayfa/146/prosedurler>) ulaşılabilir.

Bilgi edinilmesini ve gereğini rica ederim.

Korkmaz ERGUN
Genel Müdür
Yönetim Kurulu Üyesi

Ek:

1 - VİOP Prosedürü Güncellemesine İlişkin Değişiklikler (2 Sayfa)

2 - İngilizce Duyuru Metni (3 Sayfa)

Dağıtım:

Vadeli İşlem ve Opsiyon Piyasası Üyelerine

Bu belge, güvenli elektronik imza ile imzalanmıştır.
Doğrulama Kodu: AA9DF98B-27D2-4843-B012-91EE6F367D56 Doğrulama Adresi: <https://www.turkiye.gov.tr/bist-ebys>

Adres: Reşitpaşa Mahallesi, Borsa İstanbul Caddesi, No:4 34467 Sarıyer/ STANBUL

Telefon: (212) 298 21 00

Faks: (212) 298 25 00

KEP Adresi : borsaistanbul@hs03.kep.tr

Bilgi için:Hüseyin Evren ARIK
Türev Piyasalar Direktörü V.



VİOP Prosedürü Güncellemesine İlişkin Değişiklikler

MEVCUT METİN		REVİZE METİN	
EK-1: BORSA İSTANBUL VADELİ İŞLEM VE OPSİYON PİYASASINDA İŞLEM GÖREN SÖZLEŞME ÖZELLİKLERİ		EK-1: BORSA İSTANBUL VADELİ İŞLEM VE OPSİYON PİYASASINDA İŞLEM GÖREN SÖZLEŞME ÖZELLİKLERİ	
O. CNH/TL Vadeli İşlem Sözleşmeleri		O. CNH/TL Vadeli İşlem Sözleşmeleri	
...		...	
.....
Vade Sonu Uzlaşma Fiyatı	Hong Kong Treasury Markets Association tarafından son işlem gününde açıklanan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı çapraz kuru (USD/CNY (HK)) ile TCMB tarafından son işlem günü açıklanan gösterge niteliğindeki ABD Doları alış ve satış kurları ortalaması kullanılarak hesaplanan Offshore Çin Yuanı/Türk Lirası kuru. Son işlem gününde resmi tatil veya başka bir nedenle ABD Doları/Offshore Çin Yuanı çapraz kuru açıklanamaması halinde, uluslararası spot piyasalarda Türkiye saatiyle 17:00'de oluşan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı alış ve satış fiyatlarının ortalaması kullanılır. Belirlenen yöntem ile hesaplanan vade sonu uzlaşma fiyatı en yakın fiyat adımına yuvarlanır. Uzlaşma Fiyatı Komitesi'nin vade sonu uzlaşma fiyatını değiştirme hakkı saklıdır.	Vade Sonu Uzlaşma Fiyatı*	Hong Kong Treasury Markets Association tarafından son işlem gününde açıklanan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı çapraz kuru (USD/CNY (HK)) ile TCMB tarafından son işlem günü açıklanan gösterge niteliğindeki ABD Doları alış ve satış kurları ortalaması kullanılarak hesaplanan Offshore Çin Yuanı/Türk Lirası kuru. Son işlem gününde resmi tatil veya başka bir nedenle ABD Doları/Offshore Çin Yuanı çapraz kuru açıklanamaması halinde, uluslararası spot piyasalarda Türkiye saatiyle 17:00'de oluşan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı alış ve satış fiyatlarının ortalaması kullanılır. Belirlenen yöntem ile hesaplanan vade sonu uzlaşma fiyatı en yakın fiyat adımına yuvarlanır. Uzlaşma Fiyatı Komitesi'nin vade sonu uzlaşma fiyatını değiştirme hakkı saklıdır.
		*Vade sonu tarihi 31/12/2024'ten sonra olan sözleşmeler için vade sonu uzlaşma fiyatı, son işlem gününde Türkiye Saati ile 17:00:00 – 17:00:59 arasında LSEG Data & Analytics Workspace tarafından CNH= kodu ile	

	<p><u>açıklanan ABD Doları/Offshore Çin Yuanı kuru alış ve satış fiyatlarının ortalaması ile TCMB tarafından son işlem günü açıklanan gösterge niteliğindeki ABD Doları alış ve satış kurları ortalaması kullanılarak hesaplanan Offshore Çin Yuanı/Türk Lirası kurudur.</u></p> <p><u>Belirlenen yöntem ile hesaplanan vade sonu uzlaşma fiyatı en yakın fiyat adımına yuvarlanır.</u></p> <p><u>Son işlem gününde resmi tatil veya başka bir nedenle fiyat açıklanmaması, yeterli veri bulunamaması veya fiyatların piyasayı yansıtmadığına kanaat getirilmesi halinde vade sonu uzlaşma fiyatı Uzlaşma Fiyatı Komitesi tarafından belirlenir.</u></p>
--	---