

SR100U

Türev İşlemler Veri Formu	Açıklama
İşlem Seçimi	İşlemin canlı/sona ermiş olmasına özelliğine göre giriş yapılacaktır. Hesap dönemi itibarıyla bakiyesi olan türev işlemler için 1-Yaşayan(canlı)- değeri seçilecektir. Bir önceki hesap döneminden sonra açılıp kapanan türev işlemler ise 2-Sona Ermiş- değeri seçilecektir.
Sıra No	Sistem tarafından atanacaktır.
İşlemin Yapıldığı Taraf Adı	İşlemin yapıldığı kuruluşun ünvanı tam olarak yazılacaktır.
Ülke	İşlemin gerçekleştirildiği kuruluşun yerleşik olduğu ülkeyi ifade etmekte olup menüden seçilecektir.
İşlemin Yapıldığı Piyasa	İşlem yapılan piyasa türüne bağlı olarak giriş yapılacaktır. "Yurtiçi Organize Piyasalar" için 1, "Yurtiçi Organize Piyasalar" için 2, "Tezgaahüstü Yurtiçi Kuruluşlar" için 3, "Tezgaahüstü Yurtiçi Kuruluşlar (off-shore dahil)" için 4 rakamları menüden seçilecektir.
İşlem Tür Kodu	İşlemin niteliğine göre işlem tür kodları menüden seçilecektir. Örneğin, vadeli döviz alım işlemleri için VDAL kodu olarak giriş yapılacaktır.
Alt Tür Kodu	Türev işlemlerin ve valörlü işlem türlerinin alt tür kodları ilgili menüden seçilecektir.
Opsiyon Şartı	Kullanılan türev ürün düz (plain-vanilla) ise 1, yapılandırılmış bir ürün ise 2 rakamı girilecektir.
Para Kodu	Türk Lirası ve yabancı para üzerinden gerçekleştirilen işlemlerin para türü listeden seçilecektir. İşlem tür kodu alım tipinde olan işlemler için vadede alınacak para türünü, satım tipinde olan işlemler için ise vadede ödenecek para türünü ifade etmektedir. Örneğin, vadede TL karşılığı ABD doları alınacak vadeli döviz alım işleminde para kodu USD seçilecektir.
Karşı Para Kodu	Türk Lirası ve yabancı para üzerinden gerçekleştirilen işlemlerin karşı para türü listeden seçilecektir. İşlem tür kodu alım tipinde olan işlemler için vadede ödenecek para türünü, satım tipinde olan işlemler için ise vadede alınacak para türünü ifade etmektedir. Örneğin, vadede TL karşılığı ABD doları alınacak vadeli döviz alım işleminde karşı para kodu TRY olarak seçilecektir.
Orijinal Para Tutarı	Hesap dönemi itibarıyla bakiyesi olan türev işlemler ve bir önceki hesap döneminden sonra açılıp kapanan türev işlemler, orijinal para türü üzerinden bu sütunda gösterilecektir.
TL Karşılığı	İşlem tutarının işlem tarihindeki Türk Lirası cinsinden karşılığı girilecektir. Para kodu TRY olan işlemlerde orijinal para tutarı ile aynı değer olacaktır.
İşlem Tarihi	İşlemin başlangıç tarihi GG-AA-YYYY formatı ile burada yer alacaktır.
Vade Tarihi	İşlemin bitiş tarihi GG-AA-YYYY formatı ile burada yer alacaktır.
Valör Tarihi	İşlemin valör tarihi GG-AA-YYYY formatı ile burada yer alacaktır.
İşlem Kuru	İşlemin gerçekleştirildiği andaki spot kur değeri girilecektir.
Vade Kuru	Belirli bir vadeye dayalı olarak gerçekleştirilen işlemlerde, vadede uygulanması taahhüt edilen kur değeri girilecektir. Örneğin, vadede ABD doları alımının söz konusu olduğu vadeli döviz alım işlemi örneğinde "Vade Kur", USD'nin vadede satın alınmasında kullanılacak USD/TRY kurudur.
Cari Piyasa Değeri	Her bir türev işlemin cari piyasa değeri yazılacaktır. Delta, opsiyonun fiyatının opsiyona konu varlığın piyasa fiyatındaki meydana gelebilecek değişime olan duyarlılığını ifade etmektedir. Eğer İşlem Tür Kodu olarak PAOA, PAOS, PSOA, PSOS seçildiyse delta zorunlu alan olacaktır. Alt tür kodu 307 ve 308 seçildiyse, düz (vanilya) tipi alım opsiyonları için delta göstergesi alım opsiyonları için -1 ile 0 arasında olacak şekilde doldurulacaktır. Delta göstergesinin dayanak varlığın nasıl modellendiğine bağlı olarak farklılık arz etmesi sebebiyle, opsiyonların fiyatının Black-Scholes modeline göre ima ettiği delta değeri girilmelidir.
Delta	İlgili pozisyonun ne amaçla kullanıldığı yazılacaktır. Hedging (aktif-pasif yönetimi) amaçlı yapılan işlemler için 1, alım-satım amaçlı yapılan işlemler için 2 rakamları menüden seçilecektir.
İşlem Amacı	

EX-7