

22/04/2024 Vadeli Pamuk Varantlarının Vade Sonu Fiyatları

Varantın vadesinde dikkate alınacak dayanak varlık uzlaşı değeri, vade tarihinde ICE Futures US - Commodities borsasında işlem gören ilgili ICE Pamuk No.2 vadeli işlem sözleşmesinin uzlaşı fiyatıdır. İlgili vadedeki Pamuk No.2 Vadeli İşlem Sözleşmesinin fiyatı ICE Futures US – Commodities Borsası tarafından Cent/Libre cinsinden açıklanmaktadır.

Alım varantlarında itfa fiyatı, ICE tarafından açıklanan Pamuk No.2 vadeli işlem sözleşmesi uzlaşı fiyatından kullanım fiyatının çıkarılması, akabinde çarpanla ve TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılıp 100'e bölünmesiyle bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Satım varantlarında itfa fiyatı, kullanım fiyatından ICE tarafından açıklanan Pamuk No.2 vadeli işlem sözleşmesi uzlaşı fiyatının çıkarılması, akabinde çarpanla ve TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılıp 100'e bölünmesiyle bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Varant	Uzun Kod	Dayanak Varlık	Tip	Uzlaş Fiyatı	Kullanım Fiyatı	Çarpan	İtfa Fiyatı Formülü	İtfa Fiyatı
CTIEB	COTTNC2204240080.00IYM0000001NA	PAMUK	C	80.04	80.00	1	$(80.04-80)*1*32.5/100=$	0.01
CTIEC	COTTNC2204240085.00IYM0000001NA	PAMUK	C	80.04	85.00	1	$(80.04-85)*1*32.5/100=$	0.00
CTIED	COTTNC2204240090.00IYM0000001NA	PAMUK	C	80.04	90.00	1	$(80.04-90)*1*32.5/100=$	0.00
CTIEE	COTTNC2204240100.00IYM0000001NA	PAMUK	C	80.04	100.00	1	$(80.04-100)*1*32.5/100=$	0.00
CTIZV	COTTNP2204240090.00IYM0000001NA	PAMUK	P	80.04	90.00	1	$(90-80.04)*1*32.5/100=$	3.24
CTIZY	COTTNP2204240080.00IYM0000001NA	PAMUK	P	80.04	80.00	1	$(80-80.04)*1*32.5/100=$	0.00
CTIZZ	COTTNP2204240075.00IYM0000001NA	PAMUK	P	80.04	75.00	1	$(75-80.04)*1*32.5/100=$	0.00
CTIPA	COTTNP2204240070.00IYM0000001NA	PAMUK	P	80.04	70.00	1	$(70-80.04)*1*32.5/100=$	0.00