

23/06/2020 Vadeli Pamuk Varantlarının Vade Sonu Fiyatları

Varantın vadesinde dikkate alınacak Dayanak Gösterge Uzlaşı Değeri, vade tarihinde ICE Futures U.S – Commodities borsasında işlem gören ilgili ICE Pamuk No.2 Vadeli İşlem Sözleşmesi'nin uzlaşı fiyatı kullanılarak hesaplanan 1 kg Pamuk'un Türk Lirası cinsinden fiyatıdır. İlgili vadedeki Pamuk No.2 Vadeli İşlem Sözleşmesinin fiyatı ICE Futures US – Commodities Borsası tarafından Cent/Libre cinsinden açıklanmakta olup, TL/KG cinsi için TCMB USD/TRY alış kuru ve Libre – Kg dönüşüm oranı kullanılmıştır. 1 Cent 1/100 USD'dir ve 1 Libre 0,45359237 Kg'dır.

Alım varantlarında itfa fiyatı, ICE tarafından açıklanan Pamuk vadeli işlem sözleşmesi uzlaşı fiyatının TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılıp 45.359237 ile bölünmesi sonucu elde edilen değerden kullanım fiyatının çıkarılması, akabinde çarpanla çarpılmasıyla bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Satım varantlarında itfa fiyatı, kullanım fiyatından ICE tarafından açıklanan Pamuk vadeli işlem sözleşmesi uzlaşı fiyatının TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılıp 45.359237 ile bölünmesi sonucu elde edilen değerden çıkarılması, akabinde çarpanla çarpılmasıyla bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Varant	Uzun Kod	Dayanak Varlık	Tip	Uzlaşı Fiyatı	Kullanım Fiyatı	Çarpan	İtfa Fiyatı Formülü	İtfa Fiyatı
CTIAD	COTTNC2306200010.00IYM0000001NA	PAMUK	C	9.5118	10.00	1.00	$(63.04*6.8440/(100*0.45359237)-10)*1=$	0.00
CTIAE	COTTNC2306200009.50IYM0000001NA	PAMUK	C	9.5118	9.50	1.00	$(63.04*6.8440/(100*0.45359237)-9.5)*1=$	0.01
CTIAF	COTTNC2306200009.00IYM0000001NA	PAMUK	C	9.5118	9.00	1.00	$(63.04*6.8440/(100*0.45359237)-9)*1=$	0.51
CTIPT	COTTNP2306200009.50IYM0000001NA	PAMUK	P	9.5118	9.50	1.00	$(9.5-63.04*6.8440/(100*0.45359237))*1=$	0.00
CTIPU	COTTNP2306200009.00IYM0000001NA	PAMUK	P	9.5118	9.00	1.00	$(9-63.04*6.8440/(100*0.45359237))*1=$	0.00
CTIPV	COTTNP2306200008.50IYM0000001NA	PAMUK	P	9.5118	8.50	1.00	$(8.5-63.04*6.8440/(100*0.45359237))*1=$	0.00