

Gecelik Referans Faiz Oranı VİS Vade Sonu Uzlaşma Fiyatı

$$VSUF = \left[\prod_{i=1}^{N_0} \left(1 + \frac{r_i \times n_i}{365} \right) - 1 \right] \times \frac{365}{N} \times 100$$

N : vade dönemindeki takvim günü sayısı

N_0 : hesaplama periyodundaki iş günü sayısı

n_i : r_i faiz oranının geçerli olduğu takvim günü sayısı

r_i : i günü için açıklanan TLREF

Vade Sonu Uzlaşma Fiyatı

=Round([(Günlük Getirilerin Çarpımı)-1]*(365/N)*100);0,010)

=Round([(1.001054795 xx 1.001989863)-1]*(365/N)*100);0,010)

=Round([1,018229476-1]*(365/30)*100);0,010)

=22,18

Tatil	Tarih	Gün Sayısı	TLREF	Getiri
	31/08/2018	2	0.19250	1.001054795
Tatil Günü	01/09/2018			
Tatil Günü	02/09/2018			
	03/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	04/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	05/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	06/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	07/09/2018	3	0.19250	1.001582192
Tatil Günü	08/09/2018			
Tatil Günü	09/09/2018			
	10/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	11/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	12/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	13/09/2018	1	0.19250	1.000527397
	14/09/2018	3	0.24000	1.001972603
Tatil Günü	15/09/2018			
Tatil Günü	16/09/2018			
	17/09/2018	1	0.24000	1.000657534
	18/09/2018	1	0.24000	1.000657534
	19/09/2018	1	0.24000	1.000657534
	20/09/2018	1	0.23360	1.00064
	21/09/2018	3	0.24480	1.002012055
Tatil Günü	22/09/2018			
Tatil Günü	23/09/2018			
	24/09/2018	1	0.24250	1.000664384
	25/09/2018	1	0.23480	1.000643288
	26/09/2018	1	0.23750	1.000650685
	27/09/2018	1	0.24610	1.000674247
	28/09/2018	3	0.24210	1.001989863
Tatil Günü	29/09/2018			
Tatil Günü	30/09/2018			

