

17/02/2017 Vadeli Petrol Varantlarının Vade Sonu Fiyatları

Varantın vadesinde dikkate alınacak dayanak varlık uzlaşma değeri, vade tarihinde ICE Futures Europe - Commodities borsasında işlem gören ilgili ICE Brent Petrol vadeli işlem sözleşmesinin uzlaşma fiyatıdır.

Alım varantlarında itfa fiyatı, ICE tarafından açıklanan Brent Petrol vadeli işlem sözleşmesi uzlaşma fiyatından kullanım fiyatının çıkarılması, akabinde çarpanla ve TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılmasıyla bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Satım varantlarında itfa fiyatı, kullanım fiyatından ICE tarafından açıklanan Brent Petrol vadeli işlem sözleşmesi kapanış fiyatının çıkarılması, akabinde çarpanla ve TCMB gösterge niteliğindeki Dolar/TL alış kuruyla çarpılmasıyla bulunur. İtfa fiyatının alabileceği minimum değer sıfırdır.

Varant	Uzun Kod	Dayanak Varlık	Tip	Uzlaşma Fiyatı	Kullanım Fiyatı	Çarpan	İtfa Fiyatı Formülü	İtfa Fiyatı
PXIDF	BRENTC1702170080.00IYM00000.1NA	BRENT	C	55.81	80	0.1	$(55.81-80)*0.1*3.6662=$	0.00
PXIYS	BRENTP1702170030.00IYM00000.1NA	BRENT	P	55.81	30	0.1	$(30-55.81)*0.1*3.6662=$	0.00
PXIEB	BRENTC1702170050.00IYM00000.1NA	BRENT	C	55.81	50	0.1	$(55.81-50)*0.1*3.6662=$	2.13
PXIEC	BRENTC1702170060.00IYM00000.1NA	BRENT	C	55.81	60	0.1	$(55.81-60)*0.1*3.6662=$	0.00
PXIED	BRENTC1702170065.00IYM00000.1NA	BRENT	C	55.81	65	0.1	$(55.81-65)*0.1*3.6662=$	0.00
PXIZV	BRENTP1702170060.00IYM00000.1NA	BRENT	P	55.81	60	0.1	$(60-55.81)*0.1*3.6662=$	1.54
PXIZY	BRENTP1702170050.00IYM00000.1NA	BRENT	P	55.81	50	0.1	$(50-55.81)*0.1*3.6662=$	0.00
PXIZZ	BRENTP1702170045.00IYM00000.1NA	BRENT	P	55.81	45	0.1	$(45-55.81)*0.1*3.6662=$	0.00