

25/08/2020 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
PBIEN	BRENTC2508200040.00IYM0000.05NA	BRENT	C	45.86	40.00	0.05	$(45.86-40)*0.05*7.3674=$	2.16
PBIEO	BRENTC2508200045.00IYM0000.05NA	BRENT	C	45.86	45.00	0.05	$(45.86-45)*0.05*7.3674=$	0.32
PBIFA	BRENTC2508200050.00IYM0000.05NA	BRENT	C	45.86	50.00	0.05	$(45.86-50)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIFB	BRENTC2508200055.00IYM0000.05NA	BRENT	C	45.86	55.00	0.05	$(45.86-55)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIFC	BRENTC2508200060.00IYM0000.05NA	BRENT	C	45.86	60.00	0.05	$(45.86-60)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIPJ	BRENTP2508200040.00IYM0000.05NA	BRENT	P	45.86	40.00	0.05	$(40-45.86)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIPK	BRENTP2508200035.00IYM0000.05NA	BRENT	P	45.86	35.00	0.05	$(35-45.86)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIPL	BRENTP2508200030.00IYM0000.05NA	BRENT	P	45.86	30.00	0.05	$(30-45.86)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIPM	BRENTP2508200025.00IYM0000.05NA	BRENT	P	45.86	25.00	0.05	$(25-45.86)*0.05*7.3674=$	0.00
PBIPN	BRENTP2508200020.00IYM0000.05NA	BRENT	P	45.86	20.00	0.05	$(20-45.86)*0.05*7.3674=$	0.00