

25/11/2021 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
PBIJB	BRENTC2511210070.00IYM0000.05NA	BRENT	C	82.22	70.00	0.05	$(82.22-70)*0.05*12.0001=$	7.33
PBIJC	BRENTC2511210075.00IYM0000.05NA	BRENT	C	82.22	75.00	0.05	$(82.22-75)*0.05*12.0001=$	4.33
PBIJD	BRENTC2511210080.00IYM0000.05NA	BRENT	C	82.22	80.00	0.05	$(82.22-80)*0.05*12.0001=$	1.33
PBIJE	BRENTC2511210085.00IYM0000.05NA	BRENT	C	82.22	85.00	0.05	$(82.22-85)*0.05*12.0001=$	0.00
PBIUM	BRENTP2511210070.00IYM0000.05NA	BRENT	P	82.22	70.00	0.05	$(70-82.22)*0.05*12.0001=$	0.00
PBIUN	BRENTP2511210065.00IYM0000.05NA	BRENT	P	82.22	65.00	0.05	$(65-82.22)*0.05*12.0001=$	0.00
PBIUO	BRENTP2511210060.00IYM0000.05NA	BRENT	P	82.22	60.00	0.05	$(60-82.22)*0.05*12.0001=$	0.00
PBIVA	BRENTP2511210055.00IYM0000.05NA	BRENT	P	82.22	55.00	0.05	$(55-82.22)*0.05*12.0001=$	0.00