

دستورالعمل فعالیت بازارگردانی در بورس کالای ایران

در اجرای ماده 34 قانون بازار اوراق بهادار، این دستورالعمل درخصوص بازارگردانی اوراق بهادار مبتنی بر کالا که به نحوی در بورس کالای ایران معامله می‌شوند و به منظور تعیین حدود تعهدات و نحوه فعالیت بازارگردان در بورس کالای ایران در 19 ماده در تاریخ 1395/06/28 به تصویب هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار رسید.

فصل اول- تعاریف

ماده 1- کلیه اصطلاحات و واژه‌هایی که در ماده یک قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران و دستورالعمل معاملات کالا و اوراق بهادار مبتنی بر کالا در بورس کالای ایران مصوب هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار تعریف شده‌اند، به همان مفاهیم در این دستورالعمل نیز کاربرد دارند. واژه‌های دیگر دارای معانی ذیل می‌باشند:

الف- حداقل سفارش انباشته: حداقل تعداد سفارش خرید و حداقل تعداد سفارش فروش که بازارگردان باید طبق تعهدنامه بازارگردانی در سامانه معاملات به صورت فعال نگهدارد.

ب- حداقل معاملات روزانه: حداقل میزان معاملات در نماد معاملاتی مورد بازارگردانی است که بازارگردان موظف به انجام آن در یک روز معاملاتی می‌باشد تا تعهدات وی طبق این دستورالعمل در آن روز معاملاتی ایفاء شده تلقی شود.

ج- دامنه مجاز نوسان قیمت: حداکثر تغییرات مجاز قیمت نماد معاملاتی در هر جلسه معاملاتی نسبت به قیمت تسویه و یا قیمت پایانی جلسه معاملاتی قبل است.

د- دامنه مظنه: حداکثر اختلاف بین قیمت سفارش خرید و سفارش فروش در هر نماد معاملاتی بر حسب درصد است که بازارگردان در سامانه معاملات بورس وارد می‌نماید. این درصد نسبت به قیمت سفارش خرید محاسبه می‌شود.

فصل دوم- شرایط و مراحل اعطای مجوز بازارگردانی

ماده 2- هر شخص حقوقی که صلاحیت انجام فعالیت بازارگردانی در بورس به تشخیص سازمان را داشته باشد، با معرفی سازمان به بورس و پس از دریافت مجوز بازارگردانی، می‌تواند فعالیت خود را در بورس به عنوان بازارگردان آغاز نماید.

ماده 3- جهت دریافت مجوز بازارگردانی در بورس، متقاضی باید درخواست خود را مطابق با فرمت اعلامی بورس ارائه نماید.

ماده 4- درخواست بازارگردانی حداقل شامل موارد ذیل می‌باشد:

الف- مشخصات قراردادهای مورد تعهد برای بازارگردانی

ب- حداقل معاملات روزانه

ج- دامنه مظنه

د- حداقل سفارش انباشته

ماده 5- بورس حداکثر ظرف 15 روز از دریافت درخواست متقاضی، نظر خود را مبنی بر موافقت یا عدم موافقت با درخواست مذکور اعلام می‌نماید. در صورت موافقت بورس، چنانچه بازارگردان طی مهلت اعلامی، تعهدنامه بازارگردانی پیوست این دستورالعمل را امضاء و به تأیید بورس برساند و هم چنین در صورت لزوم تضامین لازم را نزد اتاق پایاپای تودیع نماید، مجوز بازارگردانی برای وی صادر می‌شود. شرایط بازارگردانی و تاریخ آغاز و پایان فعالیت مزبور در مجوز اعطایی ذکر خواهد شد.

ماده 6- بورس قبل از اعطای مجوز شروع فعالیت بازارگردانی، قرارداد بازارگردانی در خصوص هر نماد معاملاتی شامل حداقل سفارش انباشته، حداقل معاملات روزانه، دامنه مظنه و حداقل دوره زمانی مورد قبول برای بازارگردانی را به تأیید سازمان می‌رساند.

ماده 7- مجوز بازارگردانی صادرشده توسط بورس، محدود و منحصر به نمادهای معاملاتی مندرج در مجوز مزبور می‌باشد و انجام فعالیت بازارگردانی در هر نماد دیگر منوط به طی مجدد فرایند دریافت مجوز می‌باشد.

فصل سوم - وظایف و اختیارات بازارگردان

ماده 8- بازارگردان موظف است امکانات مورد نیاز جهت انجام فعالیت بازارگردانی را حسب مقررات بورس فراهم نماید.

ماده 9- بازارگردان موظف است کلیه معاملات بازارگردانی، دریافت‌ها، پرداخت‌ها، هزینه‌ها و درآمدهای مرتبط بازارگردانی را در سرفصل حساب‌های جداگانه ثبت و در مقاطع سه ماهه به سازمان گزارش نماید.

ماده 10- بازارگردان موظف است، سفارش‌های خرید و فروش خود را با رعایت شرایط زیر وارد سامانه معاملات بورس نماید.

الف- قیمت‌های پیشنهادی در این سفارش‌ها باید در دامنه مجاز نوسان باشند.

ب- تفاوت بین کمترین قیمت خرید در سفارش‌های خرید و بیشترین قیمت فروش در سفارش‌های فروش بازارگردان، حداکثر برابر دامنه مظنه باشد.

ج- در هر لحظه از جلسه معاملاتی، سفارش‌های خرید و نیز سفارش‌های فروش هر کدام به تعداد حداقل سفارش انباشته در سامانه معاملاتی موجود باشد.

د- چنانچه حجم سفارش خرید یا فروش کمتر از حداقل سفارش انباشته شود، بازارگردان موظف است بلافاصله و حداکثر ظرف دو دقیقه، حداقل سفارش انباشته را در سامانه ثبت نماید.

ه- سایر شرایط مربوط به بازارگردانی مندرج در تعهدنامه بر روی نماد مربوط را رعایت نماید.

ماده 11- حجم معاملات روزانه بازارگردان باید برابر یا بیشتر از حداقل معاملات روزانه باشد.

ماده 12- بازارگردان موظف است تعهدات خود را، در دوره زمانی مشخص در تعهدنامه و اطلاعیه‌های بورس ایفاء نماید.

ماده 13- در صورتی که مقررات و مشخصات مربوط به نماد تعهد شده تغییر کند، بازارگردان می‌تواند تقاضای انصراف از فعالیت بازارگردانی خود را حداکثر تا موعد مقرر شده توسط بورس در تعهدنامه بازارگردانی به بورس ارائه نماید. در صورت موافقت بورس با تقاضای انصراف بازارگردان، بورس موظف است موضوع را به سازمان گزارش نموده و نسبت به اعلام عمومی آن در پایگاه اطلاع‌رسانی رسمی خود اقدام کند. در سایر موارد، انصراف از فعالیت بازارگردانی با موافقت بورس و تأیید سازمان امکان‌پذیر می‌باشد.

ماده 14- بازارگردان موظف است از ایستگاه معاملاتی اختصاص یافته برای انجام فعالیت بازارگردانی، صرفاً برای انجام امور مربوط به فعالیت بازارگردانی استفاده نماید.

ماده 15- چنانچه شرایط زیر بصورت توأمان دو روز معاملاتی متوالی ادامه پیدا کند، بازارگردان از انجام تعهدات خود در روز معاملاتی بعد معاف می باشد:

الف- وجود صف سفارش خرید یا فروش در نماد معاملاتی به گونه ای که صف سفارش به میزان حداقل مقرر مندرج در تعهدنامه بازارگردانی وجود داشته باشد.

ب- در صورتی که طی یک ساعت پایانی آخرین جلسه معاملاتی، کمتر از میزان مقرر مندرج در تعهدنامه بازارگردانی معامله شود.

فصل چهارم- وظایف و اختیارات بورس در امور مرتبط با بازارگردانی

ماده 16- بورس موظف است موارد ذیل را از طریق پایگاه اطلاع رسانی خود منتشر نماید:

الف- نام و مشخصات بازارگردان های دارای مجوز و هرگونه تغییرات آنها

ب- فهرست نمادهای معاملاتی دارای بازارگردان و تغییرات آن

ماده 17- بورس موظف است بر چگونگی انجام وظایف بازارگردانی و همچنین استمرار شرایط در نظر گرفته شده در این دستورالعمل نظارت نماید.

فصل پنجم- سایر موارد

ماده 18- در تعهدنامه بازارگردانی امتیازات ذیل می تواند برای بازارگردان در نظر گرفته شود:

الف- تخفیف در هزینه های دسترسی به سامانه معاملاتی بورس، به تصویب هیئت مدیره بورس.

ب- تخفیف در کارمزد بورس از معاملات بازارگردان، به تصویب هیئت مدیره بورس.

ج- تخفیف در وجوه تضمین موضوع هر قرارداد. تضمینات موضوع این بند باید به تصویب هیئت مدیره شرکت سپرده گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه برسد.

ماده 19- در صورت نقض مفاد این دستورالعمل یا سایر تعهدات توسط بازارگردان یا بورس، مرجع رسیدگی کننده مطابق " دستورالعمل انضباطی نهادهای مالی غیر کارگزار " و سایر مقررات مربوطه به تخلفات انضباطی آنها رسیدگی خواهد نمود.

این دستورالعمل در 19 ماده در تاریخ 1395/06/28 به تصویب هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار رسید.

پیوست

تعهدنامه فعالیت بازارگردانی در بورس کالای ایران

به موجب این سند، شرکت به شماره ثبت ثبت شرکت‌های به شناسه ملی به نشانی با نمایندگی دارنده/دارندگان امضای مجاز و تعهدآور شرکت مزبور به موجب روزنامه رسمی شماره مورخ، که از این پس بازارگردان نامیده می‌شود، تعهد می‌نماید فعالیت بازارگردانی نمادهای معاملاتی زیر را در شرکت بورس کالای ایران به نحو کامل و صحیح، طبق قانون بازار اوراق بهادار و سایر مقررات مرتبط انجام دهد و کلیه مفاد این تعهدنامه مورد پذیرش و تأیید این شرکت است.

بند اول: مشخصات نمادهای معاملاتی مورد تعهد برای بازارگردانی:

ردیف	نماد معاملاتی	دوره زمانی فعالیت	زمان بندی اجرای تعهدات	تعداد معاملات	تعداد حداقل صف سفارش
				موضوع بند 15 ماده 15	موضوع بند الف ماده 15

بند دوم: تعهدات بازارگردان در دوره زمانی بازارگردانی به شرح زیر مورد تأیید و پذیرش است:

- 1- دامنه مظنه: حداكثر درصد در هر روز معاملاتی
- 2- حداقل سفارش انباشته: حداقل حجم خرید و حداقل حجم فروش در هر روز معاملاتی
- 3- معافیت از تعهد حداقل سفارش انباشته به شرط انجام حداقل معامله
- 4- دوره زمانی بازارگردانی: از تاریخ شروع فعالیت ذکر شده در مجوز بازارگردانی الی.....

بند سوم: زمان بندی اجرای تعهدات در طول جلسه معاملاتی

بازارگردان متعهد است کلیه تعهدات را با توجه به زمانبندی و اطلاعیه‌های بورس به نحو کامل انجام دهد.

بند چهارم: امتیازات اعطا شده به بازارگردان

1. ترکیب وجه تضمین اولیه
2. کارمزد
3. هزینه‌های دسترسی به سامانه معاملاتی

بند پنجم: ترکیب تضامین بازارگردان

بازارگردان اقرار می‌نماید میزان تضامین به شکل را جهت ایفای تعهدات خویش به اتاق پایاپای ارائه نموده و نامه شماره مبنی بر تأیید اتاق پایاپای به پیوست ارائه شده است.

ردیف	نام و نام خانوادگی صاحبان امضای مجاز	امضاء
1		

		2
--	--	---

مهر شرکت