



بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راه اندازی قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۲/۱۱/۱۶ به شرح زیر و مشخصات قرارداد پیوست، با اندازه قرارداد یک گواهی سپرده زعفران نگین (یک گرم) و امکان استفاده از استراتژی کاورد کال، راه اندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۷۶۰/۰۰۰ ریال	SFOR03C76	۱۴۰۳/۰۲/۱۶
	قرارداد اختیار خرید زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۷۸۰/۰۰۰ ریال	SFOR03C78	
	قرارداد اختیار خرید زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۸۰۰/۰۰۰ ریال	SFOR03C80	
	قرارداد اختیار خرید زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۸۲۰/۰۰۰ ریال	SFOR03C82	
فروش	قرارداد اختیار فروش زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۷۶۰/۰۰۰ ریال	SFOR03P76	
	قرارداد اختیار فروش زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۷۸۰/۰۰۰ ریال	SFOR03P78	
	قرارداد اختیار فروش زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۸۰۰/۰۰۰ ریال	SFOR03P80	
	قرارداد اختیار فروش زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۸۲۰/۰۰۰ ریال	SFOR03P82	

قراردادهای اختیار معامله بدون حد نوسان قیمتی، با دوره گشایش به مدت ۳۰ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و با دوره عادی معاملاتی ادامه می‌یابد.

منتشر کننده: مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق‌های کالایی

مشخصات قرارداد اختیار معامله زعفران رشته‌ای بریده ممتاز (نگین)

۱	دارایی پایه	گواهی سپرده زعفران رشته‌ای بریده ممتاز (نگین)
۲	نماد کالا	SFMMYYK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می‌باشد) SFMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می‌باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱ گرم
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱۰,۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه موقعیت های باز فروش برای هر نماد معاملاتی با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن تضامین طی زمان ثابت نبوده و به صورت پویا در حال تغییر خواهد بود. وجه تضمین اولیه در پایان هر روز معاملاتی بر اساس فرمول زیر تعدیل می شود: $\text{مبلغ وجه تضمین اولیه} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت نقدی زعفران × A) و (قیمت اعمال × B) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰,۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد، معادل ۱ ب) وجه تضمین لازم: وجه تضمین لازم به ازای هر قرارداد در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود؛ ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت نقدی زعفران × A) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((قیمت اعمال × B) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد نکته ۱: در صورتی که قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله در بندهای ۱ و ۲، کمتر از میزان در سود بودن قرارداد باشد، میزان در سود بودن قرارداد جایگزین قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله در فرمول فوق خواهد شد. نکته ۲: مبنای محاسبه قیمت نقدی زعفران، توسط شرکت بورس کالای ایران تعیین خواهد شد. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد. د) موقعیت باز فروش قرارداد اختیار معامله خرید پوشش داده شده با خرید گواهی سپرده زعفران نگین، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.
۶	سبک اعمال	اعمال می‌تواند صرفاً در آخرین روز معاملاتی صورت پذیرد (اختیار معامله اروپایی).
۷	روش تخصیص	اولویت زمانی
۸	حداقل تغییر قیمت	۱ ریال
۹	ماه‌های قرارداد	تمامی ماه‌های سال به تشخیص بورس
۱۰	دوره معاملاتی	دوره معاملاتی هر کدام از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.
۱۱	واحد پولی قیمت	ریال به ازای گرم
۱۲	مهلت ارائه درخواست اعمال	۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی
۱۳	مهلت تحویل و شرایط آن	مهلت تحویل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای اختیار معامله بوده و محل تحویل، اتاق پایاپای بورس یا محلی است که توسط بورس تعیین می‌گردد و سایر مهلت‌های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است: الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واريز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی. ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست‌های اعمال توسط بورس و اطلاع به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی. ج) مهلت اطلاع نتیجه بررسی بند ب توسط کارگزار به مشتریان، تا قبل از شروع جلسه معاملاتی دارایی پایه در روز کاری بعد از آخرین جلسه معاملاتی. د) مهلت ایفای تعهدات برای خریداران موضوع ۲-۸ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.
۱۴	سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم‌جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتری در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: ○ مشتریان حقیقی و حقوقی: ۱۰۰,۰۰۰ قرارداد ○ بازارگردان: ۲۰۰,۰۰۰ قرارداد و قابل افزایش تا ۲۰ درصد موقعیت های باز هر نماد معاملاتی
۱۵	خسارت‌ها	در صورتی که موقعیت‌های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تعهدات فروشنده، منجر به تسویه نقدی شود، فروشنده به میزان ۱ درصد ارزش فعلی معامله (حجم ضربدر قیمت نقدی) به نفع خریدار خسارت می‌پردازد. همچنین کارمزدهای اعمال مربوط به بورس هر دو طرف معامله از مشتری فروشنده دریافت خواهد شد. در صورت عدم ایفای شرایط اعمال توسط خریدار، قرارداد اختیار منقضی شده و خریدار و فروشنده موظف به پرداخت کارمزد بورس و کارگزار مربوط به خود می‌باشند.
۱۶	سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری توسط کارگزار	به اندازه ارزش اعمال مجموع قراردادهای اختیار معامله منتشر شده توسط هر مشتری دارنده موقعیت باز فروش
۱۷	نحوه درج نماد قرارداد اختیار معامله	الف) مطابق ماده ۸ دستورالعمل اجرایی قرارداد اختیار معامله در خصوص درج اولین نماد معاملاتی بی‌تفاوت، قیمت اعمال این نماد مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.

۱۸	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می‌گیرد.														
۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵														
۲۰	کارمزدهای معاملاتی	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده	کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده															
کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد															
بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد															
جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد															
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید															
بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید															
جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید															
۲۱	نوع تسویه پس از اعمال	تحویل دارایی پایه														
۲۲	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۱،۰۰۰ قرارداد														

