



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله شمش طلا سررسید آبان ماه ۱۴۰۴

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله شمش طلا سررسید آبان ماه ۱۴۰۴ روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۰۸/۱۸ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده شمش طلا با نماد "CD1GOB0001" امکان‌پذیر می‌باشد.

۲. درخواست‌های اعمال ارائه شده خریداران و ایفای تعهدات فروشندگان در نمادهای در زیان وارد فرآیند تحویل نخواهند شد.

۳. با توجه به اینکه احتمال دارد مشتریان مجموعه‌ای از موقعیت‌های هم‌جهت ("موقعیت خرید در Call و موقعیت فروش در Put" یا "موقعیت فروش در Call و موقعیت خرید در Put") داشته باشند، تخصیص گواهی‌های سپرده و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:

۴. در خصوص گواهی‌های سپرده، تخصیص ابتدا از در سودترین قرارداد Put و سپس از قرارداد Call با کمترین میزان در سود بودن، انجام خواهد شد. بدین مفهوم که ابتدا گواهی‌های سپرده، تحت مالکیت مشتری به منظور اعمال قراردادهای Put مشتری (و به ترتیب از بیشترین قیمت اعمال) و باقیمانده آن به منظور ایفای تعهدات قراردادهای Call وی (و به ترتیب از بیشترین قیمت اعمال) منظور خواهد شد.

۵. در خصوص وجوه واریزی نیز تخصیص ابتدا از در سودترین قرارداد Call و سپس از قرارداد Put با کمترین میزان در سود بودن، انجام خواهد شد. بدین مفهوم که وجوه واریز شده، ابتدا به منظور اعمال قراردادهای Call مشتری (و به ترتیب از کمترین قیمت اعمال) و باقیمانده آن به منظور ایفای تعهدات قراردادهای Put وی (و به ترتیب از کمترین قیمت اعمال) لحاظ خواهد شد.

۶. وجوه مورد نیاز برای ایفای تعهدات مشتریان فروشنده در قرارداد Put، که به منظور ایفای تعهدات خود موظف به واریز ارزش قرارداد هستند، بدون در نظر گرفتن وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت‌های باز ایشان در سررسید آبان (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۷. مرجع قیمت نقدی گواهی سپرده شمش طلا در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نماد "CD1GOB0001" در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

تاریخ: ۱۴۰۴/۰۸/۰۳
شماره: ۱۴۰۴/۳۰۰/۲۴۵۶۸
پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا سررسید آبان ماه ۱۴۰۴ مطابق فرآیند پیوست انجام خواهد پذیرفت. لذا کلیه مشتریان فروشنده دارای موقعیت باز و خریدارانی که درخواست اعمال خود را ارائه کرده باشند موظفند براساس فرآیند اعلام شده اقدام نمایند.

منتشرکننده: مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا که مشتری نزد شرکت بورس کالا معامله نموده و اکنون ملزم به تحویل یا دریافت آن براساس مشخصات ذیل می‌باشد.
- ۲- **بورس کالا:** شرکت بورس کالای ایران که معاملات قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می‌پذیرد.
- ۳- **انبار:** انبار پذیرش شده بورس کالای ایران که مسئولیت دریافت شمش طلا و صدور قبض انبار موقت به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده شمش طلا برای مشتریان که در قراردادهای اختیار معامله شمش طلا بورس کالا معامله نموده‌اند را بر عهده دارد. که در اینجا انبار "خزانه بورس کالای ایران" می‌باشد.
- ۴- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید گواهی سپرده شمش طلا یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده شمش طلا که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل گواهی سپرده شمش طلا می‌باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید گواهی سپرده شمش طلا یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده شمش طلا که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **گواهی سپرده شمش طلا:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۷- **اندازه هر قرارداد گواهی سپرده شمش طلا:** یک گواهی سپرده شمش طلا (معادل ۱۰۰ سوت)
- ۸- **گواهی سپرده کالایی:** اوراق بهاداری است که موید مالکیت دارنده آن بر مقدار معینی کالای سپرده شده در انبار است و پشتوانه آن قبض انباری است که توسط انباردار صادر می‌گردد.

فرآیند تحویل شمش طلا توسط مشتریان فروشنده:

- در حال حاضر امکان تحویل کالا به انبار صرفاً توسط تولیدکننده یا واردکننده مورد تایید بورس کالا وجود دارد؛ در رابطه با سایر متقاضیان بازار گواهی سپرده کالایی بورس کالای ایران در صورت ارائه مدارک و مستندات زیر و پس از طرح و تایید درخواست در کمیته مربوطه بورس، امکان تحویل شمش به خزانه بورس کالای ایران وجود دارد:



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- مستندات مربوط به ثبت اطلاعات شمش در سامانه جامع تجارت؛
- صورتحساب خرید.

شایان ذکر است که حداقل تعداد شمش قابل سپردن به خزانه بورس کالای ایران توسط متقاضیان در هر محموله ۵ قطعه می باشد. لذا سایر مشتریان فروشنده جهت ایفای تعهدات خود در معاملات قراردادهای آتی شمش طلای خام می بایست، حداکثر تا پایان ساعت معاملات آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده شمش طلا در معاملات روزانه گواهی سپرده شمش طلا در نماد "CD1GOB0001" نموده و گواهی آمادگی تحویل را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشند.

هزینه‌های انبارداری و ارزیابی:

- هزینه‌های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه‌های موجود در معاملات گواهی سپرده شمش طلا می باشد.
- تراکنش‌های مالی مربوط به تسویه هزینه انبارداری از طریق اعتبار ریالی در دفاتر دارایی مشتریان (مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده شمش طلا) نزد بورس کالای ایران صورت می گیرد. لذا کلیه مشتریان فروشنده می بایست مبلغ هزینه انبارداری را که پس از انجام فرآیند تحویل مشخص می گردد، تا یک ساعت قبل از پایان روز معاملاتی بعد از سررسید اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا در دفاتر دارایی انبار خود شارژ نمایند. در صورت عدم تامین هزینه انبارداری طی مهلت مذکور، کارگزار مربوطه موظف به تامین وجه مذکور حداکثر تا پایان روز معاملاتی پس از سررسید قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا در دفاتر دارایی مشتریان فروشنده در قرارداد اختیار معامله خواهد بود.
توجه: در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط خریدار، گواهی‌های صادر شده به نام فروشنده باقی مانده و فروشنده می تواند اقدام به فروش گواهی در بازار گواهی سپرده شمش طلا یا در صورت احراز شرایط تحویل، اقدام به ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت شمش طلا نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می بایست حداکثر تا ۱۵ دقیقه پس از پایان معاملات آخرین روز معاملاتی اقدام به تامین وجه ارزش اعمال قرارداد در حساب عملیاتی خود نماید و درخواست اعمال را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد.

انتقال مالکیت گواهی از فروشنده به خریدار:

- جهت انتقال مالکیت گواهی سپرده شمش طلا از فروشنده به خریدار می بایست دفتر دارایی برای کلیه اشخاص ذی نفع معامله ایجاد شود. لذا کلیه مشتریان خریدار موظفند نسبت به به روزرسانی اطلاعات خود در سامانه جدید مشتریان اقدام



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

نمایند. عدم به‌روزرسانی اطلاعات در سامانه جدید مشتریان که منجر به عدم ایجاد دفتر دارایی برای خریداران می‌شود، نکول از طرف خریدار محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
-در نهایت فرایند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، از فروشنده به خریدار انجام می‌شود.

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی شمش طلا: CD1GOB0001

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- تهران، خیابان آیت الله طالقانی، بعد از تقاطع ولی عصر (عج)، شماره ۳۵۱ (خزانه بورس کالای ایران)

نکات مهم:

- ۱- معاملات گواهی سپرده کالایی شمش طلا طی روزهای معاملاتی طریق سامانه معاملات ابزارهای نوین بورس کالای ایران (سما) انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده شمش طلا در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۰۸/۱۸ ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد بازار مالی امکان پذیر می‌باشد.
- ۳- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده شمش طلا در کد بازار مالی خود باشد و در صورت نیاز، درخواست اعمال خود را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد، بورس به تعداد موقعیت‌های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد بازار مالی وی می‌نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد بازار مالی، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۴- هر گواهی سپرده کالایی در کد بازار مالی مشتری شامل یک دهم گرم شمش طلا می‌باشد.
- ۵- تمامی مشتریان دارای موقعیت تعهدی خرید و فروش باید جهت اطلاع از وضعیت کد بازار مالی خود، که تحویل در بورس بر مبنای آن انجام خواهد شد، به کارگزار مربوطه مراجعه نمایند و هر گونه تغییر در وضعیت کد بازار مالی خود را از طریق کارگزار مربوطه به بورس اطلاع دهند.
- ۶- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده در نماد: CD1GOB0001



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- ۷- جهت تحویل گرفتن کالا از انبار لازم است حداقل به میزان ۱۱,۰۰۰ گواهی سپرده کالایی توسط مالک ارائه گردد. در صورت مالکیت کمتر از این مقدار، لازم است گواهی سپرده لازم توسط فرد متقاضی تحویل، در بازار معاملات گواهی سپرده شمش طلا در بورس کالا خریداری گردد.
- ۸- سایر اطلاعات مربوط به انبارداری و تحویل دارایی از انبار مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده شمش طلا می باشد.