



## بسمه تعالی

### ((اطلاعیه))

موضوع: راه‌اندازی قرارداد اختیار معامله شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

### متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار خرید و فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ از روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۸ با مشخصات قرارداد پیوست، به شرح زیر راه‌اندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲/۸۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02C280	۱۴۰۲/۰۹/۱۳
	قرارداد اختیار خرید شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲/۹۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02C290	
	قرارداد اختیار خرید شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۰۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02C300	
	قرارداد اختیار خرید شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۱۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02C310	
	قرارداد اختیار خرید شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۲۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02C320	
فروش	قرارداد اختیار فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲/۸۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02P280	
	قرارداد اختیار فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲/۹۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02P290	
	قرارداد اختیار فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۰۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02P300	
	قرارداد اختیار فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۱۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02P310	
	قرارداد اختیار فروش شمش طلا سررسید آذر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳/۲۰۰/۰۰۰ ریال	GBAZ02P320	

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.

لازم به توضیح است امکان استفاده از استراتژی کاورد کال در قراردادهای اختیار معامله شمش طلا، وجود خواهد داشت. شایان ذکر است فرآیند اجرایی درخواست مسدودسازی دارایی برای استفاده از این استراتژی، متعاقبا اطلاع رسانی خواهد شد.

منتشر کننده: مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق‌های کالایی

## مشخصات قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا

۱	دارایی پایه	گواهی سپرده شمش طلا
۲	نماد کالا	GBMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می باشد) GBMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱ گواهی سپرده شمش طلا (معادل ۱۰۰ سوت)
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱۰۰،۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه موقعیت‌های باز فروش برای هر نماد معاملاتی با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن تضمین 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 می‌شود: $\text{مبلغ وجه تضمین اولیه} = \left( \left[ \frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی گواهی سپرده شمش طلا $\times A$ ) و (قیمت اعمال $\times B$ ) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۵۰،۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱ ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود: ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی گواهی سپرده شمش طلا $\times A$ ) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((قیمت اعمال $\times B$ ) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد نکته: در صورتی که قیمت پایانی 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. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد. د) موقعیت باز فروش در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید گواهی سپرده شمش طلا پوشش داده شده باشد، 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 به ازای هر ۱۰۰ سوت (۱ ریال به ازای هر قرارداد)
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 هر ۱۰۰ سوت
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 واریز 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 هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.
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 پایانی گواهی سپرده شمش طلا) 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 می گیرد.																		
۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۷																		
۲۰	کارمزدهای معاملاتی	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> <td>کارگزار</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>بورس کالا</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>جمع</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>۰/۰۰۰۱ 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		۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	جمع	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	بورس کالا	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																			
۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	کارگزار																		
۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	بورس کالا																		
۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	جمع																		
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																			
بورس کالا	۰/۰۰۰۱ 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 ۲۵ قرارداد																		

