



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله سکه تحویل دی ماه ۱۴۰۳

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 سکه طلا سررسید دی ماه ۱۴۰۳ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۳/۱۰/۳۰ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده سکه طلا با نماد "CD1GOC0001" (سکه طلای تمام بهار آزادی طرح جدید) 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:

– 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.

– 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.

۴. 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 دی ماه ۱۴۰۳ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی گواهی سکه طلا در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نماد "CD1GOC0001" در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

تاریخ: ۱۴۰۳/۱۰/۰۳
شماره: ۱۴۰۳/۳۰۰/۳۲۰۹۰
پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله سکه طلا سررسید دی ماه ۱۴۰۳ 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.

منتشر کننده: مدیریت بازار مشتقه و صندوق های کالایی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله سکه طلا))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله سکه 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 توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می‌پذیرد.
- ۳- **انبار:** انبار پذیرش شده بورس کالای ایران که مسئولیت دریافت سکه طلا و صدور قبض انبار موقت به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده سکه طلا برای مشتریان که در قراردادهای اختیار معامله سکه 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 سکه طلا یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش سکه طلا که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل سکه طلا می‌باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید سکه طلا یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش سکه طلا که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **سکه طلا:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۷- **اندازه هر قرارداد اختیار سکه طلا:** یک عدد سکه طلای تمام بهار آزادی طرح امام خمینی (ره) بر اساس استاندارد بانک مرکزی
- 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 سکه طلا توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند صرفاً در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله (یکشنبه ۳۰ دی ماه ۱۴۰۳) تا ساعت ۱۰:۰۰ برای تبدیل سکه طلا به گواهی سپرده به "خزانه بورس کالای ایران" مراجعه نمایند. علاوه بر این مشتریان



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

فروشنده می‌تواند حداکثر تا ساعت ۱۷:۰۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده سکه طلا در معاملات روزانه گواهی سپرده سکه طلا در نماد "CD1GOC0001" نمایند.

تحویل و کارشناسی سکه طلا:

صرف تحویل سکه طلا به انبار مذکور، به منزله ایفا کردن تعهدات فروشنده نمی‌باشد بلکه تعداد گواهی‌های سپرده کالایی سکه طلا در کد بازار مالی مشتری ملاک انجام تعهدات مشتری فروشنده است.

هزینه‌های انبارداری و ارزیابی:

هزینه‌های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق روبه‌های موجود در معاملات گواهی سپرده سکه طلا می‌باشد.

دریافت سکه طلا و تحویل رسید به مشتری:

انبار پس از کارشناسی و دریافت کامل سکه طلا اقدام به صدور رسید به مشتری فروشنده می‌نماید.
توجه: در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط خریدار، گواهی‌های صادر شده به نام فروشنده باقی مانده و فروشنده می‌تواند اقدام به فروش گواهی در بازار گواهی سپرده سکه طلا یا ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت سکه طلا نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ساعت ۱۷:۱۵ 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 سکه طلا از فروشنده به خریدار می‌بایست دفتر دارایی برای کلیه اشخاص ذی‌نفع معامله ایجاد شود. لذا کلیه مشتریان خریدار موظفند نسبت به به‌روزرسانی اطلاعات خود در سامانه جدید مشتریان اقدام 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 فرآیند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، از فروشنده به خریدار انجام می‌شود.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی سکه طلا: CD1GOC0001

۲- نشانی انبار پذیرش شده:

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

نکات مهم:

- ۱- تحویل سکه طلا به انبار جهت تبدیل شدن به گواهی سپرده، حداکثر تا ساعت ۱۰ آخرین روز معاملاتی امکان پذیر می‌باشد.
- ۲- معاملات گواهی سپرده کالایی سکه طلا در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۱۱:۳۰ الی ۱۷:۰۰ و پنجشنبه از ساعت ۱۱:۳۰ الی ۱۵:۰۰ در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری یکشنبه مورخ ۳۰ دی ماه جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۳- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده سکه 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 سکه طلا در کد بازار مالی شامل یک سکه طلا می‌باشد.
- ۵- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد بازار مالی امکان پذیر می‌باشد. همچنین استعلام وضعیت کد بازار مالی مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی از این کد به عهده مشتری می‌باشد.
- ۶- جهت تحویل سکه طلا به انبار توسط مشتری، نیازی به حضور نماینده کارگزار نمی‌باشد.
- ۷- 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.
- ۸- کارگزاران می‌توانند نسبت به مشاهده کد بازار مالی مشتریان، مراتب را در سامانه معاملات ابزار مشتقه (سما) در بخش گزارش‌ها/ مشتریان، ملاحظه نموده و به مشتریان خود اطلاع رسانی لازم را انجام دهند.



شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

۹- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده در نماد CD1GOC0001 امکان پذیر می‌باشد. در صورت تکمیل ظرفیت انبار جهت تحویل قراردادهای اختیار معامله با توجه به موقعیت‌های باز نمادهای در سود قراردادهای اختیار معامله، سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد، تحویل سکه طلا به صورت فیزیکی به انبار مذکور و انجام فرایند تحویل خارج از سازوکار گواهی سپرده سکه طلا امکان‌پذیر خواهد بود. در این صورت تخصیص دارایی به خریداران در قالب گواهی سپرده یا تحویل فیزیکی بر اساسی اولویت زمانی اخذ موقعیت خرید صورت خواهد گرفت. همچنین شرایط در صورت تحویل فیزیکی سکه طلا توسط فروشنده به انبار و مواعد آن تابع مفاد این اطلاعیه خواهد بود.

۱۰- پس از اتمام فرایند تحویل قرارداد اختیار معامله، مطابق مقررات و رویه حاکم بر معاملات گواهی سپرده، دارنده گواهی سپرده کالایی تعهد می‌نماید پیش از انقضای اعتبار گواهی سپرده کالایی تحویل گرفته شده، نسبت به تحویل گرفتن سکه طلا از انبار و یا فروش گواهی سپرده در بازار اقدام نماید. در صورتی که به هر دلیل دارنده گواهی پس از انقضای اعتبار گواهی سپرده و مهلت تعیین شده توسط بورس جهت تحویل کالا مراجعه ننماید، انباردار خروج نهایی کالا را ثبت نموده و بورس، شرکت سپرده‌گذاری مرکزی و انبار پذیرش شده بورس هیچ‌گونه مسئولیتی در خصوص کمیت و کیفیت کالای موجود در انبار ندارند. در صورت عدم مراجعه دارنده گواهی سپرده کالایی، چنانچه انباردار شرایطی جهت نگهداری کالا پس از ثبت خروج کالا از انبار پذیرش شده بورس اعلام نماید، عدم مراجعه در حکم موافقت دارنده گواهی با شرایط اعلامی می‌باشد.