



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله سکه تحویل اسفند ماه ۱۴۰۲

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 اسفند ماه ۱۴۰۲ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۱۲/۲۰ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده سکه طلا با نمادهای زیر امکان‌پذیر می‌باشد:

- تمام سکه طرح جدید ملت (سکه ۰۲ پ ۰۲۱۱)
- تمام سکه طرح جدید رفاه (سکه ۰۱ پ ۰۳۱۲)
- تمام سکه طرح جدید صادرات (سکه ۰۴ پ ۰۳۱۰)
- تمام سکه طرح جدید سامان (سکه ۰۳ پ ۰۴۱۲)
- تمام سکه طرح جدید آینده (سکه ۰۵ پ ۰۴۱۱)

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.

تاریخ: ۱۴۰۲/۱۱/۲۸

شماره: ۱۴۰۲/۳۰۰/۳۲۶۶۸

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

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 اسفند ماه ۱۴۰۲ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی سکه طلا در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرایم نکول، میانگین موزون قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نمادهای زیر در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد:

- تمام سکه طرح جدید ملت (سکه ۰۲ پ ۰۲۱۱)

- تمام سکه طرح جدید رفاه (سکه ۰۱ پ ۰۳۱۲)

- تمام سکه طرح جدید صادرات (سکه ۰۴ پ ۰۳۱۰)

- تمام سکه طرح جدید سامان (سکه ۰۳ پ ۰۴۱۲)

- تمام سکه طرح جدید آینده (سکه ۰۵ پ ۰۴۱۱)

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله سکه طلا سررسید اسفند ماه ۱۴۰۲ 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 صندوق‌های 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 انبارهای زیر می‌باشد:
 - خزانه بانک آینده
 - خزانه بانک رفاه کارگران
 - خزانه بانک سامان
 - خزانه بانک صادرات ایران
 - خزانه بانک ملت
- 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.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

فرایند تحویل سکه طلا توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند صرفاً در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله (یکشنبه ۲۰ اسفند ماه ۱۴۰۲) تا ساعت ۱۳ برای تبدیل سکه طلا به گواهی سپرده به انبار بانک صادرات ایران، بانک رفاه، بانک سامان، بانک ملت و بانک آینده مراجعه نمایند. علاوه بر این مشتریان فروشنده می‌توانند حداکثر تا ساعت ۱۵:۰۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده سکه طلا در معاملات روزانه گواهی سپرده سکه طلا در نمادهای زیر نمایند:

- تمام سکه طرح جدید ملت (سکه ۰۲ پ ۰۲۱۱)
- تمام سکه طرح جدید رفاه (سکه ۰۱ پ ۰۳۱۲)
- تمام سکه طرح جدید صادرات (سکه ۰۴ پ ۰۳۱۰)
- تمام سکه طرح جدید سامان (سکه ۰۳ پ ۰۴۱۲)
- تمام سکه طرح جدید آینده (سکه ۰۵ پ ۰۴۱۱)

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 سهامداری مشتری ملاک انجام تعهدات مشتری فروشنده است.

هزینه‌های انبارداری و ارزیابی:

هزینه‌های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه‌های 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.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ساعت ۱۵:۳۰ 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:

مدیریت فناوری بورس تهران اقدام به ارسال هزینه انبارداری مشتریان به بورس کالا می‌نماید و پس از برداشت هزینه انبارداری از حساب مشتریان فروشنده، بورس اقدام به واریز به حساب عملیاتی انبار می‌نماید. در نهایت فرایند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، به صورت ترخیص گواهی سپرده سکه طلا از کد سهامداری فروشنده و انتقال به کد سهامداری خریدار انجام می‌شود.

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی سکه طلا:

- تمام سکه طرح جدید ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)
- تمام سکه طرح جدید رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- تمام سکه طرح جدید صادرات (سکه ۰۳۱۰ پ ۰۴)
- تمام سکه طرح جدید سامان (سکه ۰۴۱۲ پ ۰۳)
- تمام سکه طرح جدید آینده (سکه ۰۴۱۱ پ ۰۵)

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- خزانه بانک رفاه: تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیرازشمالی، نبش کوچه حاضری شماره ۱۸۶
- خزانه بانک سامان: تهران، خیابان ولیعصر، نرسیده به چهارراه پارک وی، نبش کوچه ترکش دوز، پلاک ۲
- خزانه بانک صادرات ایران: تهران، خیابان سمیه، بین خیابان مفتح و بهار، برج سپهر بانک صادرات ایران، طبقه منفی ۲، صندوق امانات اداره کل خزانه داری
- خزانه بانک ملت: تهران، خیابان طالقانی، نبش خیابان شهید موسوی (فرصت)، شماره ۲۷۶، نیم طبقه شعبه مستقل مرکزی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

– خزانه بانک آینده: تهران، بزرگراه مدرس جنوب به شمال، تقاطع خیابان نلسون ماندلا، ابتدای خیابان بیدار، شماره یک (برج آینده)

نکات مهم:

- ۱- تحویل سکه طلا به انبار جهت تبدیل شدن به گواهی سپرده، حداکثر تا ساعت ۱۳ 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 ۱۵:۰۰ و 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 ۲۰ اسفند ماه جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۳- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده سکه طلا در کد سهامداری 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 سهامداری وی می‌نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۴- هر ۱۰۰ گواهی سپرده کالایی سکه طلا در کد سهامداری شامل یک سکه طلا می‌باشد.
- ۵- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد سهامداری امکان پذیر می‌باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری 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 سهامداری خود، که تحویل در بورس بر مبنای آن انجام خواهد شد، به کارگزار مربوطه مراجعه نمایند و هر گونه تغییر در وضعیت کد سهامداری خود را از طریق کارگزار مربوطه به بورس اطلاع دهند.
- ۸- کارگزاران می‌توانند نسبت به مشاهده کد سهامداری 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.
- ۹- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده در نمادهای زیر:



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- تمام سکه طرح جدید ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)
- تمام سکه طرح جدید رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- تمام سکه طرح جدید صادرات (سکه ۰۳۱۰ پ ۰۴)
- تمام سکه طرح جدید سامان (سکه ۰۴۱۲ پ ۰۳)
- تمام سکه طرح جدید آینده (سکه ۰۴۱۱ پ ۰۵)

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.