

تاریخ: ۱۴۰۴/۱۲/۰۲  
شماره: ۱۴۰۴/۳۰۰/۴۰۸۰۷  
پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)  
Iran Mercantile Exchange

بسمه تعالی

((اطلاعیه))

**موضوع:** فرآیند تحویل قراردادهای آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا سررسید اسفند ماه ۱۴۰۴

**مخاطب:** کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

**متن اطلاعیه:**

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران بازار قراردادهای مشتقه می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا تحویل اسفند ماه ۱۴۰۴ در روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۴/۱۲/۱۲ مطابق ضوابط پیوست انجام خواهد پذیرفت. لذا کلیه مشتریان فروشنده و خریدار دارای موقعیت تعهدی باز موظفند براساس ضوابط اعلام شده جهت انجام فرآیند تحویل اقدام نمایند.

**منتشر کننده:** مدیریت پایاپای بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)  
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

## ((فرآیند تحویل قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا))

### تعاریف:

- قرارداد:** قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا که مشتری نزد شرکت بورس کالا معامله نموده و اکنون ملزم به تحویل یا دریافت آن براساس مندرجات ذیل می‌باشد.
  - بورس کالا:** شرکت بورس کالای ایران که معاملات قراردادهای آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا توسط خریداران و فروشندگان در آن صورت می‌پذیرد.
  - مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی باز فروش در قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تأمین واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا می‌باشد.
  - مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی باز خرید در قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه ارزش قرارداد آتی است.
  - واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا:** دارایی پایه قرارداد آتی
  - اندازه هر قرارداد آتی صندوق طلای کهربا:** ۱۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا
- فرآیند تحویل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا توسط مشتریان فروشنده:**
- کلیه مشتریان فروشنده موظفند حداکثر تا پایان ساعت معاملات آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا در کد سهامداری خود نمایند. بدیهی است به‌ازای هر موقعیت تعهدی باز فروش در قرارداد آتی می‌بایست ۱۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا تأمین گردد.

### فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ۱۵ دقیقه پس از اتمام بازار در آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین وجه ارزش قرارداد متناسب با تعداد موقعیت‌های تعهدی باز خود، در دفتر بازار آتی خود نماید و گواهی آمادگی تحویل را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد.

### انتقال مالکیت واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا از فروشنده به خریدار:

فرآیند تحویل دارایی پایه (واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا) به صورت انتقال مالکیت واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا، از کد سهامداری فروشنده به کد سهامداری خریدار به میزان تعداد موقعیت‌های قابل تحویل انجام می‌شود.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)  
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

## سایر اطلاعات:

### نماد معاملاتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا: کهربا (صندوق س. کالای کهربا) نکات مهم:

- ۱- معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا طی روزهای معاملاتی هر هفته در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری بورس تهران انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز نسبت به خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا در این بازار و نگهداری آن تا پایان فرآیند تحویل جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- اگر دارنده موقعیت تعهدی باز فروش در آخرین روز معاملاتی، دارای واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا در کد سهامداری خود باشد و گواهی آمادگی تحویل را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد، بورس به تعداد موقعیت‌های تعهدی باز مشتری در قراردادهای آتی اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری وی می‌نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری، به منزله نکول قرارداد به میزان تعداد موقعیت‌های ایفا نشده، محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۳- مبنای محاسبه قیمت نقدی در محاسبات جرایم نکول قراردادهای آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا (صندوق س. کالای کهربا)، قیمت پایانی نماد "کهربا" در آخرین روز معاملاتی قراردادهای آتی خواهد بود.
- ۴- انجام معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا فقط با کد سهامداری امکان پذیر می‌باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی به عهده مشتریان خریدار و فروشنده می‌باشد.
- ۵- تمامی مشتریان دارای موقعیت تعهدی باز خرید و فروش باید جهت اطلاع از آخرین وضعیت کد سهامداری خود، که تحویل در بورس بر مبنای آن انجام خواهد شد، به کارگزار مربوطه مراجعه نمایند و هر گونه تغییر در کد و یا وضعیت کد سهامداری خود را از طریق کارگزار مربوطه به بورس اطلاع دهند.
- ۶- کارگزاران می‌توانند جهت 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.
- ۷- هرگونه مانع جهت انتقال دارایی در کد سهامداری مشتریان، به منزله عدم ایفای تعهدات می‌باشد.