



## (( اطلاعیه ))

**موضوع:** تغییر در مشخصات قرارداد اختیار معامله زعفران نگین

**مخاطب:** کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

**تاریخ انتشار:** ۱۴۰۰/۱۱/۱۹

### متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، بندهای ۵، ۶ و ۱۵ مشخصات قرارداد اختیار معامله زعفران نگین به شرح زیر تغییر یافته است.

شرح	بند
۳۰/۰۰۰ ریال	۵ فاصله قیمت اعمال
<p>الف) وجه تضمین اولیه:</p> <p>وجه تضمین اولیه موقعیت های باز فروش برای هر نماد معاملاتی با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن تضامین 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 می شود:</p> $\text{وجه تضمین اولیه} = \left( \left[ \frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ <p>IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت نقدی زعفران <math>\times A</math>) و (قیمت اعمال <math>\times B</math>) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰/۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد، معادل ۱۰۰</p> <p>ب) وجه تضمین لازم:</p> <p>وجه تضمین لازم به ازای هر قرارداد در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود:</p> <p>۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت نقدی زعفران <math>\times A</math>) + قیمت پایانی) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>۲- ((قیمت اعمال <math>\times B</math>) + قیمت پایانی) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>نکته ۱: 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 در فرمول فوق خواهد شد.</p> <p>نکته ۲: مبنای محاسبه قیمت نقدی زعفران، توسط شرکت بورس کالای ایران تعیین خواهد شد.</p> <p>ج) حداقل وجه تضمین:</p> <p>حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد.</p> <p>د) موقعیت باز فروش قرارداد اختیار معامله خرید پوشش داده شده با خرید گواهی سپرده زعفران نگین، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.</p>	۶ وجه تضمین

شماره: ۴۰۰/۳۰۰/۱۲۰۰۴

تاریخ: ۱۴۰۰/۱۱/۱۹

پیوست: ندارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)  
Iran Mercantile Exchange

سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتری در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: ○ مشتری حقیقی و حقوقی: بدون سقف	۱۵
----------------------------------	--	----

**منتشر کننده:** مدیریت توسعه بازار مشتقه