

تاریخ: ۱۴۰۳/۰۲/۰۵

شماره: ۱۴۰۳/۳۰/۳۷۴۸

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) سررسید اردیبهشت 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 واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۳/۰۲/۲۳ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) با نماد " صندوق س. طلای سرخ نوویرا (نهال)" امکان پذیر 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:

- در خصوص واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال)، 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال)، 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

تاریخ: ۱۴۰۳/۰۲/۰۵

شماره: ۱۴۰۳/۳۰/۳۷۴۸

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

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 اردیبهشت (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) نماد " صندوق س. طلای سرخ نوویرا (نهال)" در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) سررسید اردیبهشت ماه 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 صندوق‌های کالایی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال)))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) 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- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل دارایی پایه قرارداد اختیار می‌باشد.
 - ۴- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
 - ۵- **واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال):** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
 - ۶- **اندازه هر قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال):** ۱۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری
- فرآیند تحویل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده (که مطابق با تعاریف فوق ملزم به تحویل دارایی پایه هستند) موظفند حداکثر تا پایان آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در کد سهامداری خود



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

نماینده بدیهی است با توجه به اندازه قرارداد، مشتریان فروشنده، به ازای هر موقعیت تعهدی باز خود در قرارداد اختیار معامله می بایست ۱۰۰۰ واحد سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) را تأمین نمایند.

توجه

- ۱- اگر مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید دارای واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در کد سهامداری خود باشد و مشتری دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش علاوه بر ارائه درخواست اعمال، دارای واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در کد سهامداری خود باشد بورس متناسب با موقعیت های باز این مشتریان در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری ایشان می نماید. لازم به ذکر است، عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید (متعهد به تحویل دارایی پایه می باشد)، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۲- در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط مشتری خریدار، واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) صادر شده به نام مشتری فروشنده باقی خواهد ماند و وی می تواند اقدام به فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در بازار صندوق های سرمایه گذاری کالایی پس از اتمام فرآیند تحویل نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می بایست حداکثر تا ۳۰ دقیقه پس از پایان آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین 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 واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) از مشتری

فروشنده به مشتری خریدار:

فرآیند انتقال دارایی پایه از مشتری فروشنده به مشتری خریدار به صورت انتقال مالکیت واحدهای سرمایه گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال)، از کد سهامداری مشتری فروشنده به کد سهامداری مشتری خریدار متناسب با موقعیت های قابل تحویل انجام می شود.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

سایر اطلاعات:

نماد معاملاتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال): " صندوق س. طلای سرخ نوویرا (نهال)"

نکات مهم:

- ۱- معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۱۱:۳۰ الی ۱۵:۰۰ و در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری بورس تهران انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز معاملاتی نسبت به خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) در این بازار و نگهداری آن تا پایان فرآیند تحویل روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۳/۰۲/۲۳ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- انجام معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال) 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 مشتری و کارگزاری می‌باشد.
- ۳- 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.
- ۴- کارگزاران می‌توانند نسبت به مشاهده کد سهامداری مشتریان، مراتب را در سامانه معاملات ابزار مشتقه (سما) در بخش گزارش ها/ مشتریان، ملاحظه نموده و به مشتریان خود اطلاع رسانی لازم را انجام دهند.
- ۵- مبنای محاسبه قیمت نقدی در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق چند کالایی طلای سرخ نوویرا (نهال)، قیمت پایانی نماد " صندوق س. طلای سرخ نوویرا (نهال)" در آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خواهد بود.
- ۶- هرگونه مانع جهت انتقال دارایی در کد سهامداری مشتریان، به منزله عدم ایفای تعهدات می‌باشد.
- ۷- باتوجه به وجود مهلت مجدد در فرآیند تحویل (مطابق مشخصات قرارداد) و لزوم مسدودسازی دارایی در کد سهامداری مشتریان فروشنده می‌بایست کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه در بورس کالا یکسان باشند (امکان تغییر کارگزار ناظر وجود ندارد و مغایرت کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه به منزله عدم ایفای تعهدات مشتری می‌باشد). همچنین باتوجه به فرآیند دو روزه تحویل، حفظ دارایی تا اتمام فرآیند تحویل جهت ایفای تعهدات الزامی است.