



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین سررسید مهر 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 زعفران نگین سررسید مهر ماه ۱۴۰۳ روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۳/۰۷/۲۲ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده زعفران با نمادهای زیر امکان پذیر می‌باشد:

- زعفران ۰۳۱۰ نگین سحرخیز(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۱
- زعفران ۰۳۱۰ نگین تروند قاینات(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۹
- زعفران ۰۳۱۰ نگین زرین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۵
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بهرامن(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۸
- زعفران ۰۳۱۰ نگین آراسته(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۴
- زعفران ۰۳۱۰ نگین نوین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۹
- زعفران ۰۳۱۰ نگین وحدت جام(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۰
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بدیعی(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۶
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بیرجند(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۶
- زعفران ۰۳۱۰ نگین ملل(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۱
- زعفران ۰۳۱۰ نگین گلیران(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۲
- زعفران ۰۳۱۰ نگین روستا(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۸

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:

۴. 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

تاریخ: ۱۴۰۳/۰۷/۰۱

شماره: ۱۴۰۳/۳۰۰/۲۰۵۹۹

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

از بیشترین قیمت اعمال) و باقیمانده آن به منظور ایفای تعهدات قراردادهای Call وی (و به ترتیب از بیشترین قیمت اعمال) منظور خواهد شد.

۵. 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.

۶. 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 مهر (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۷. مرجع قیمت نقدی زعفران نگین در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، میانگین موزون قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نمادهای زیر در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد:

زعفران ۰۳۱۰ نگین سحرخیز(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین تروند قاینات(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین زرین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۵

زعفران ۰۳۱۰ نگین بهرامن(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۸

زعفران ۰۳۱۰ نگین آراسته(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۴

زعفران ۰۳۱۰ نگین نوین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین وحدت جام(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۰

زعفران ۰۳۱۰ نگین بدیعی(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین بیرجند(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۱۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین ملل(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین گلیران(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۲۲

زعفران ۰۳۱۰ نگین روستا(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ ۰۸

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید مهر 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 صندوق‌های کالایی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله زعفران نگین 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 زعفران نگین و صدور قبض انبار موقت به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده زعفران نگین برای مشتریان که در قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین بورس کالا معامله نموده‌اند را بر عهده دارد. که در اینجا انبارهای زیر می‌باشد:
 - زرین زعفران مشرق زمین
 - اتحادیه تعاونی های روستایی استان خراسان رضوی
 - نوین زعفران
 - سحرخیز
 - بیرجند
 - بهرامن
 - تروند قاینات
 - وحدت جام
 - ملل
 - گلیران
 - آرمان تجارت آراسته
 - بدیعی
- ۴- **مشه تری فروشه ننده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل زعفران نگین می‌باشد.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واريز وجه قرارداد است.

۶- **زعفران:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله

۷- **اندازه هر قرارداد اختیار زعفران نگین:** ۱ گرم زعفران نگین

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.

فرایند تحویل زعفران نگین توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند حداکثر تا سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد اختیار معامله (۱۴۰۳/۰۷/۱۸) برای تبدیل زعفران نگین به گواهی سپرده به به انبارهای "زرین زعفران مشرق زمین"، "اتحادیه تعاونیهای روستایی خراسان رضوی"، "نوبین زعفران"، "سحرخیز"، "بیرجند"، "بهرامن"، "ترونند قاینات"، "وحدت جام"، "ملل"، "گلیران"، "آرمان تجارت آراسته"، "بدیعی" مراجعه نمایند.

علاوه بر این مشتریان فروشنده می‌توانند حداکثر تا ساعت ۱۵:۰۰ آخرین روز معاملاتی (۱۴۰۳/۰۷/۲۲) اقدام به خرید گواهی سپرده زعفران نگین در معاملات روزانه گواهی سپرده زعفران نگین در نمادهای زیر نمایند:

زعفران ۰۳۱۰ نگین سحرخیز(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۱۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین ترونند قاینات(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۱۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین زرین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۰۵

زعفران ۰۳۱۰ نگین بهرامن(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۱۸

زعفران ۰۳۱۰ نگین آراسته(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۲۴

زعفران ۰۳۱۰ نگین نوبین(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۰۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین وحدت جام(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۲۰

زعفران ۰۳۱۰ نگین بدیعی(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۲۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین بیرجند(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۱۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین ملل(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۲۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین گلیران(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۲۲

زعفران ۰۳۱۰ نگین روستا(پ) - زعف ۰۳۱۰ پ۰۸



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

تحویل و کارشناسی زعفران نگین:

صرف تحویل زعفران نگین به انبار مذکور، به منزله ایفا کردن تعهدات فروشنده نمی‌باشد بلکه تعداد گواهی‌های سپرده کالایی زعفران نگین 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 زعفران نگین می‌باشد.

دریافت زعفران نگین و تحویل رسید به مشتری:

انبار پس از کارشناسی و دریافت کامل زعفران نگین 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 زعفران نگین یا ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت زعفران نگین نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ساعت ۱۵:۱۵ 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:

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 فرآیند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، به صورت ترخیص گواهی سپرده زعفران نگین از کد سهامداری فروشنده و انتقال به کد سهامداری 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 زعفران نگین:

- زعفران ۰۳۱۰ نگین سحرخیز(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۱۱
- زعفران ۰۳۱۰ نگین تروند قاینات(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۱۹
- زعفران ۰۳۱۰ نگین زرین(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۰۵
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بهرامن(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۱۸
- زعفران ۰۳۱۰ نگین آراسته(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۲۴
- زعفران ۰۳۱۰ نگین نوین(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۰۹
- زعفران ۰۳۱۰ نگین وحدت جام(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۲۰
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بدیعی(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۲۶
- زعفران ۰۳۱۰ نگین بیرجند(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۱۶
- زعفران ۰۳۱۰ نگین ملل(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۲۱
- زعفران ۰۳۱۰ نگین گلیران(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۲۲
- زعفران ۰۳۱۰ نگین روستا(پ) - زعفر ۰۳۱۰ پ۰۰۸

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده: ۱- انبار زرین زعفران مشرق زمین : خراسان رضوی، تربت حیدریه، خیابان شهید سپهبد، قاسم سلیمانی، کوچه قاسم سلیمانی ۶، ساختمان امید، پلاک ۷ ۲- انبار اتحادیه تعاونیهای روستایی استان خراسان رضوی: خراسان رضوی، مشهد، بلوار شهید صادقی جنب روزنامه خراسان ۳- انبار نوین زعفران: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی توس، فاز دوم، بلوار اندیشه ۶، بلوک ۳۰۶ ۴- انبار سحرخیز: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی توس، فاز ۱، نبش تلاش شمالی ۶ ۵- انبار بیرجند: خراسان جنوبی، بیرجند، خیابان ارتش، مدیریت جهاد کشاورزی بیرجند ۶- انبار بهرامن: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی توس، فاز ۲، اندیشه ۹، پلاک ۳۳۳ ۷- انبار تروند قاینات: خراسان جنوبی، قاین، شهرک صنعتی قاین، بلوار کوشش، قطعه ۴۹/۵۰ ۸- انبار وحدت جام: خراسان رضوی، تربت جام، بلوار والفجر، نبش خیابان گلستان ۹- انبار ملل: خراسان جنوبی، قاین، شهرک صنعتی قاین، تقاطع تلاش شرقی و کوشش ۱۰- انبار گلیران: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی بینالود، بلوار سازندگی، فناوری ۲، قطعه ۱۱۰ ۱۱- انبار آرمان تجارت آراسته: خراسان جنوبی، فردوس، شهرک صنعتی شهید پارسا، خیابان بهار، نبش بهار ۵ ۱۲- انبار بدیعی: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی توس، فاز ۱، صنعت ۵، قطعه ۲۰۸



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

نکات مهم:

۱- معاملات گواهی سپرده کالایی زعفران نگین در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۸:۴۵ 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 ۱۴۰۳/۰۷/۲۲ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند. ۲- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده زعفران نگین 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.

۳- مبنای محاسبه قیمت نقدی زعفران نگین در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین میانگین وزنی قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده زعفران در نمادهای زیر در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله خواهد بود:

زعفران ۰۳۱۰ نگین سحرخیز(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۱۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین تروند قاینات(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۱۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین زرین(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۰۵

زعفران ۰۳۱۰ نگین بهرامن(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۱۸

زعفران ۰۳۱۰ نگین آراسته(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۲۴

زعفران ۰۳۱۰ نگین نوین(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۰۹

زعفران ۰۳۱۰ نگین وحدت جام(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۲۰

زعفران ۰۳۱۰ نگین بدیعی(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۲۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین بیرجند(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۱۶

زعفران ۰۳۱۰ نگین ملل(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۲۱

زعفران ۰۳۱۰ نگین گلیران(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۲۲

زعفران ۰۳۱۰ نگین روستا(پ) - زعف ۰۳۱۰پ ۰۸

۴- هرگواهی سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری شامل یک گرم زعفران نگین می‌باشد.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- ۵- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد سهامداری امکان پذیر می باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی از این کد به عهده مشتری می باشد.
- ۶- جهت تحویل زعفران نگین به انبار توسط مشتری، نیازی به حضور نماینده کارگزار نمی باشد.
- 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 می توانند 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.
- ۹- در صورت تکمیل ظرفیت انبار جهت تحویل قراردادهای اختیار معامله با توجه به موقعیت های باز نمادهای در سود قراردادهای اختیار معامله، سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد، تحویل زعفران نگین به صورت فیزیکی به انبار مذکور و انجام فرایند تحویل خارج از سازوکار گواهی سپرده زعفران نگین امکان پذیر 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 زعفران نگین 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 می نماید پیش از انقضای اعتبار گواهی سپرده کالایی تحویل گرفته شده، نسبت به تحویل گرفتن زعفران نگین 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 سپرده گذاری مرکزی و انبار پذیرش شده بورس هیچ گونه 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 می باشد.
- ۱۱- با توجه به وجود بیش از یک نماد معاملاتی گواهی سپرده زعفران نگین برای تحویل قراردادهای اختیار در صورتی که فروشنده در بیش از یک نماد دارایی داشته باشد، برداشت دارایی برای ایفای تعهدات وی از نقدشونده ترین نماد گواهی سپرده کالایی زعفران نگین صورت خواهد گرفت و تخصیص دارایی از انبارها به خریداران به صورت تصادفی انجام خواهد شد.