



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله سکه طلا تحویل شهریور ماه ۱۴۰۱

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۴۰۱/۰۶/۰۶

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله سکه طلا سررسید شهریور ماه ۱۴۰۱ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۶/۲۷ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

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

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۱۱۰ پ ۰۴)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۱۱۱ پ ۰۵)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۱۱۲ پ ۰۳)

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

«پرینت نامه بدون درج مهر برجسته فاقد اعتبار است.»



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.

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 شهریور ماه ۱۴۰۱ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی سکه طلا 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:

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۱۱۰ پ ۰۴)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۱۱۱ پ ۰۵)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۱۱۲ پ ۰۳)

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی قرارداد اختیار معامله سکه طلا سررسید شهریور ماه ۱۴۰۱ 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



((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 پردیس بانک رفاه کارگران
 - خزانه بانک سامان
 - خزانه زرین سپهر بانک صادرات ایران
 - خزانه بانک ملت
- ۴- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله 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 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.



شماره:

تاریخ:

پیوست:

فرایند تحویل سکه طلا توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند صرفاً در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله (یکشنبه ۲۷ شهریور ماه ۱۴۰۱) 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:

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه ملت (سکه ۰۲ پ ۰۲۱۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۱ پ ۰۳۱۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۴ پ ۰۱۱۰)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۵ پ ۰۱۱۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۳ پ ۰۱۱۲)

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.



شماره:

تاریخ:

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:

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۱۱۰ پ ۰۴)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۱۱۱ پ ۰۵)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۱۱۲ پ ۰۳)

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- خزانه پردیس بانک رفاه: تهران، ونک، خیابان ملاصدرا، خیابان شیرازشمالی، شماره ۱۸۶
- خزانه بانک سامان: تهران، خیابان ولیعصر، نرسیده به چهارراه پارک ویف نبش کوچه ترکش دوز، پلاک ۲
- خزانه زرین سپهر بانک صادرات ایران: تهران، خیابان سمیه، بین خیابان مفتوح و بهار، برج سپهر بانک صادرات ایران، طبقه منفی ۲، صندوق امانات اداره کل خزانه داری
- خزانه بانک ملت: تهران، خیابان دماوند، بعد از تقاطع آیت، پلاک ۴۸۴
- خزانه بانک آینده: تهران، خیابان احمدقصر، خیابان پانزدهم (احمدیان)، شعبه مستقل بانک آینده



شماره:

تاریخ:

پیوست:

نکات مهم:

- ۱- تحویل سکه طلا به انبار جهت تبدیل شدن به گواهی سپرده، حداکثر تا ساعت ۱۳ آخرین روز معاملاتی امکان پذیر می باشد.
- ۲- معاملات گواهی سپرده کالایی سکه طلا در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۱۰:۰۰ الی ۱۵:۰۰ و در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری انجام می گیرد، لذا مشتریان می توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری یکشنبه مورخ ۲۷ شهریور ماه ۱۴۰۱ 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 موقعیت های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری وی می نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۴- هر ۱۰۰ گواهی سپرده کالایی سکه طلا در کد سهامداری شامل یک سکه طلا می باشد.
- 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 سکه طلا 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- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده در نمادهای زیر:

— سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه ملت (سکه ۰۲۱۱ پ ۰۲)



شماره:

تاریخ:

پیوست:

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۳۱۲ پ ۰۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۱۱۰ پ ۰۴)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۱۱۱ پ ۰۵)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۱۱۲ پ ۰۳)

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 أخذ 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.