

شماره: ۴۰۱/۳۰۰/۸۲۰۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۷/۲۴

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راه اندازی قرارداد اختیار معامله مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ماه ۱۴۰۱

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۴۰۱/۰۷/۲۴

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند قرارداد اختیار معامله مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ماه ۱۴۰۱ از روز **دوشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۸/۱۶** به شرح زیر و مشخصات قرارداد پیوست، راه اندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سرسید
خرید	قرارداد اختیار خرید مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۳۸۰/۰۰۰ ریال	FSDY01C38000	۱۴۰۱/۰۷/۲۰
	قرارداد اختیار خرید مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۴۱۰/۰۰۰ ریال	FSDY01C41000	
	قرارداد اختیار خرید مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۴۴۰/۰۰۰ ریال	FSDY01C44000	
فروش	قرارداد اختیار فروش مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۳۸۰/۰۰۰ ریال	FSDY01P38000	
	قرارداد اختیار فروش مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۴۱۰/۰۰۰ ریال	FSDY01P41000	
	قرارداد اختیار فروش مبتنی بر قرارداد آتی زعفران نگین سرسید دی ۱۴۰۱ با قیمت اعمال ۴۴۰/۰۰۰ ریال	FSDY01P44000	

قراردادهای اختیار معامله بدون حد نوسان قیمتی، با دوره گشایش به مدت ۳۰ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و با دوره عادی معاملاتی ادامه می‌یابد.

شایان ذکر است زمان برگزاری کلاس‌های آموزشی قرارداد اختیار معامله مبتنی بر قرارداد آتی، در اسرع وقت به شرکت‌های کارگزاری اطلاع رسانی خواهد شد.

منتشر کننده: مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق‌های کالایی

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

آدرس: تهران، خیابان آیت الله طالقانی،
بعد از تقاطع ولی عصر (عج)، شماره ۳۵۱
تلفن گویا: ۸۵۶۴۰ | نمابر: ۸۸۳۸۳۰۰۰

www.ime.co.ir info@ime.co.ir

مشخصات قرارداد اختیار معامله مبتنی بر قرارداد آتی زعفران رشته‌ای بریده ممتاز (نگین)

۱	دارایی پایه	قرارداد آتی زعفران رشته‌ای بریده ممتاز (نگین)
۲	نماد کالا	FSMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می‌باشد) FSMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می‌باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱ قرارداد آتی زعفران رشته‌ای بریده ممتاز (نگین)
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱۰/۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: 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: $\text{مبلغ وجه تضمین اولیه} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{F} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت تسویه قرارداد آتی زعفران نگین × A) و (قیمت اعمال × B) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰/۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱ F: اندازه قرارداد آتی: ۱۰۰ ب) وجه تضمین لازم: به ازای هر قرارداد در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود؛ ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت تسویه قرارداد آتی زعفران نگین × A) × F + قیمت پایانی) ضربدر اندازه قرارداد ۲- (F × قیمت اعمال × B) + قیمت پایانی) ضربدر اندازه قرارداد نکته: در صورتی که قیمت پایانی در بندهای ۱ و ۲، کمتر از "میزان در سود بودن قرارداد × F" باشد، "میزان در سود بودن قرارداد × F" جایگزین قیمت پایانی در فرمول فوق خواهد شد. ج) حداقل وجه تضمین: معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد.
۶	سبک اعمال	اعمال می‌تواند صرفاً در آخرین روز معاملاتی صورت پذیرد (اختیار معامله اروپایی).
۷	روش تخصیص	اولویت زمانی
۸	حداقل تغییر قیمت	۱ ریال
۹	ماه‌های قرارداد	تمامی ماه‌های سال به تشخیص بورس
۱۰	دوره معاملاتی	دوره معاملاتی هر کدام از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.
۱۱	واحد پولی قیمت	ریال به ازای هر قرارداد
۱۲	مهلت ارائه درخواست اعمال	۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی
۱۳	شرایط تحویل	الف) درخواست اعمال برای "نمادهای اختیار معامله در سود" پذیرفته خواهد شد. ب) موقعیت‌های خریدی که درخواست اعمال آن‌ها به بورس ارائه شده باشند وارد فرآیند تحویل خواهند شد و دارنده موقعیت فروش در طرف مقابل، ملزم به ایفای تعهدات و پرداخت مابه‌التفاوت قیمت تسویه قرارداد آتی و قیمت اعمال می‌باشد. ج) برای دارندگان موقعیت خرید و فروش قرارداد اختیار معامله، بر اساس خالص موقعیت‌های مشتری در هر زیرگروه هم ماه، در بازار قرارداد آتی موقعیت تعهدی باز ایجاد خواهد شد. د) خریدار اختیار و فروشنده اختیار، متناسب با تعداد موقعیت‌های تعهدی باز تخصیص یافته در قراردادهای آتی، ملزم به تامین وجه تضمین اولیه قرارداد آتی (واریز وجه تضمین اولیه یا داشتن موقعیت باز معکوس یا امکان استفاده از تخفیف بین سررسید) می‌باشند. در غیر این صورت مشتری مطابق قوانین و مقررات بازار قراردادهای آتی، خطریه افزایش وجه تضمین دریافت کرده و تا یک ساعت پس از شروع جلسه معاملاتی، ملزم به واریز وجه تضمین جبرانی یا بستن موقعیت‌های خود می‌باشد.
۱۴	سقف مجاز موقعیتهای باز و هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتری در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: ○ مشتریان حقیقی و حقوقی: ۱۰۰۰ قرارداد ○ بازارگردان: بدون سقف
۱۵	سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری توسط کارگزار	برای دارنده موقعیت باز فروش: حداکثر به اندازه ارزش اعمال مجموع قراردادهای اختیار معامله منتشر شده برای دارنده موقعیت باز خرید: حداکثر به اندازه وجه تضمین اولیه قرارداد آتی به تعداد موقعیت‌های باز ایجاد شده
۱۶	نحوه درج نماد قرارداد اختیار معامله	الف) مطابق ماده ۸ دستورالعمل اجرایی قرارداد اختیار معامله در خصوص درج اولین نماد معاملاتی بی تفاوت، قیمت اعمال این نماد ضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز ضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس قیمت‌های اعمال جدید را در صورتی راه‌اندازی خواهد کرد که برای حداقل یک روز معاملاتی، نماد اختیار معامله در سود (یا در زیان) وجود نداشته باشد. ج) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.

۱۷	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می گیرد.																								
۱۸	ساعت و روزهای معاملاتی	روزهای شنبه تا پنجشنبه ۱۰ الی ۱۵.																								
۱۹	کارمزدهای معاملاتی	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>حق نظارت سازمان</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۱ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده		کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	حق نظارت سازمان	-	-	جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید		بورس کالا	۰/۰۰۰۱ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید		جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																									
کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد																								
بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																								
حق نظارت سازمان	-	-																								
جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد																								
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
بورس کالا	۰/۰۰۰۱ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
۲۰	نوع تسویه پس از اعمال	ایجاد موقعیت تعهدی باز قرارداد آتی																								
۲۱	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۲۵ قرارداد																								

