

شماره: ۴۰۲/۳۰۰/۶۳۳۳

تاریخ: ۱۴۰۲/۰۴/۲۰

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راه اندازی قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا سررسید مهر ماه ۱۴۰۲

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا سررسید مهر ۱۴۰۲ از روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۵/۰۱ به شرح زیر راه اندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰ ریال	KBME02C18	۱۴۰۲/۰۷/۳۰
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۱/۰۰۰ ریال	KBME02C21	
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۳/۰۰۰ ریال	KBME02C23	
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۵/۰۰۰ ریال	KBME02C25	
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۷/۰۰۰ ریال	KBME02C27	
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۹/۰۰۰ ریال	KBME02C29	
	قرارداد اختیار خرید سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳۲/۰۰۰ ریال	KBME02C32	
فروش	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰ ریال	KBME02P18	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۱/۰۰۰ ریال	KBME02 P21	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۳/۰۰۰ ریال	KBME02 P23	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۵/۰۰۰ ریال	KBME02P25	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۷/۰۰۰ ریال	KBME02P27	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۲۹/۰۰۰ ریال	KBME02P29	
	قرارداد اختیار فروش سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ با قیمت اعمال ۳۲/۰۰۰ ریال	KBME02P32	

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.

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 واحدهای سرمایه گذاری صندوق س. پشտوانه طلای کهربا

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشտوانه طلای کهربا(کهربا)
۲	نماد کالا	KBMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می باشد) KBMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱۰۰۰ واحد سرمایه گذاری
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱،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: $\text{IM} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی صندوق س. پشտوانه طلای کهربا × A) و (قیمت اعمال × B) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰،۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱۰۰۰ ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می شود: ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی صندوق س. پشտوانه طلای کهربا × A) + قیمت پایانی) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((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 باشد، میزان در سود بودن قرارداد جایگزین قیمت پایانی در فرمول فوق خواهد شد. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد. د) موقعیت باز فروش بازارگردان در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید واحدهای سرمایه گذاری صندوق س. پشտوانه طلای کهربا پوشش داده شده باشد، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.
۶	سبک اعمال	اعمال می تواند صرفا در آخرین روز معاملاتی صورت پذیرد (اختیار معامله اروپایی).
۷	روش تخصیص	اولویت زمانی
۸	حداقل تغییر قیمت	۱ ریال
۹	ماه های قرارداد	تمامی ماه های 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 واحد سرمایه گذاری (۱،۰۰۰ ریال به ازای هر قرارداد)
۱۲	مهلت ارائه درخواست اعمال	۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی
۱۳	مهلت تحویل و شرایط آن	مهلت تحویل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای اختیار معامله بوده و محل تحویل، اتاق پایاپای بورس یا محلی است که توسط بورس تعیین می گردد و سایر مهلت های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است: الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واریز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی. ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست های اعمال توسط بورس و اطلاع به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی. ج) مهلت اطلاع نتیجه بررسی بند ب توسط کارگزار به مشتریان، تا قبل از شروع جلسه معاملاتی دارایی پایه در روز کاری بعد از آخرین جلسه معاملاتی. د) مهلت ایفای تعهدات برای خریداران موضوع ۲-۸ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.
۱۴	سقف مجاز موقعیت های باز و هم جهت	سقف موقعیت های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.
۱۵	خسارت ها	در صورتی که موقعیت های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تعهدات فروشنده، منجر به تسویه نقدی شود، فروشنده به میزان ۱ درصد ارزش فعلی معامله (حجم ضربدر قیمت پایانی واحدهای سرمایه گذاری) به نفع خریدار خسارت می پردازد. همچنین کارمزدهای اعمال مربوط به بورس هر دو طرف معامله از مشتری فروشنده دریافت خواهد شد. در صورت عدم ایفای شرایط اعمال توسط خریدار، قرارداد اختیار منقضی شده و خریدار و فروشنده موظف به پرداخت کارمزد بورس و کارگزار مربوط به خود می باشند.
۱۶	سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری توسط کارگزار	به اندازه ارزش اعمال مجموع قراردادهای اختیار معامله منتشر شده توسط هر مشتری دارنده موقعیت باز فروش
۱۷	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 مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس می تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.
۱۸	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می گیرد.

۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵																										
۲۰	کارمدهای معاملاتی	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>کارگزار</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>بورس کالا</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>جمع</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <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>کارگزار</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>بورس کالا</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>جمع</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td>۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده	کارگزار	کارگزار	بورس کالا	بورس کالا	جمع	جمع	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	کارگزار	کارگزار	بورس کالا	بورس کالا	جمع	جمع	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																											
کارگزار	کارگزار																											
بورس کالا	بورس کالا																											
جمع	جمع																											
۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد																											
۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																											
۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد																											
کارگزار	کارگزار																											
بورس کالا	بورس کالا																											
جمع	جمع																											
۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																											
۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																											
۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																											
۲۱	نوع تسویه پس از اعمال	تحویل دارایی پایه																										
۲۲	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۲۵ قرارداد																										

