

تاریخ: ۱۴۰۲/۰۸/۰۱

شماره: ۱۴۰۲/۳۰۰/۱۷۸۰۵

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله سکه تحویل آبان ماه ۱۴۰۲

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 سکه طلا سررسید آبان ماه ۱۴۰۲ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۲۱ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده سکه طلا با نمادهای زیر امکان‌پذیر 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 ۰۳۱۰ پ ۰۴)

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۴۱۲ پ ۰۳)

- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۴۱۱ پ ۰۵)

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 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.

تاریخ: ۱۴۰۲/۰۸/۰۱

شماره: ۱۴۰۲/۳۰۰/۱۷۸۰۵

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

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 آبان ماه ۱۴۰۲ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی سکه طلا در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرایم 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 ۰۲ پ ۰۲۱۱)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه رفاه (سکه ۰۱ پ ۰۳۱۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه صادرات (سکه ۰۴ پ ۰۳۱۰)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه سامان (سکه ۰۳ پ ۰۴۱۲)
- سکه تمام بهار تحویلی ۱ روزه آینده (سکه ۰۵ پ ۰۴۱۱)

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله سکه طلا سررسید آبان ماه ۱۴۰۲ 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.

منتشرکننده: مدیریت بازار مشتقه و صندوق‌های کالایی