

مشخصات قرارداد اختیار معامله مبتنی بر واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلای)

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلای)
۲	نماد کالا	TLMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می‌باشد) TLMYYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می‌باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱ واحد سرمایه‌گذاری
۴	فاصله قیمت اعمال	مضری از ۱۰,۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه:
		<p>وجه تضمین اولیه موقعیت‌های 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 تعديل می‌شود:</p> $\text{C} = \left(\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} + 1 \right) \times \text{C}$ <p>IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای لوتوس (طلای × A) و (قیمت اعمال × B) هر کدام که بزرگتر بود. A: %۲۰: C ۱۰۰: ریال B: اندازه قرارداد: ۱</p> <p>ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود:</p> <p>۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای لوتوس × A) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>۲- ((قیمت اعمال × B) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>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 قرارداد اختیار معامله در فرمول فوق خواهد شد.</p> <p>ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می‌باشد.</p> <p>د) موقعیت باز فروش در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری طلای لوتوس پوشش داده شده باشد، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.</p>
۶	سبک اعمال	اعمال می‌توانند صرفا 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	مهلت تحويل و شرایط آن	<p>مهلت تحويل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای اختیار معامله بوده و محل تحويل، انتقال پایاپایی بورس یا محلی است که توسط بورس تعیین می‌گردد و سایر مهلت‌های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است:</p> <p>(الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واریز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی.</p> <p>(ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست‌های اعمال توسط بورس و اطلاع به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی.</p> <p>(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.</p> <p>(د) مهلت ایفای تمهدات برای خریداران موضوع ۸-۲ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.</p>
۱۴	سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم جهت	سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم جهت
۱۵	خسارت‌ها	<p>در صورتی که موقعیت‌های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تمهدات فروشند، منجر به تسویه نقدی شود، فروشندۀ به میزان ۱ درصد ارزش فعلی معامله (حجم ضربدر اندازه قرارداد ضربدر قیمت پایانی واحدهای سرمایه‌گذاری) به نفع خریدار خسارت می‌پردازد. همچنین کارمزدهای اعمال مربوط به بورس هر دو طرف معامله از مشتری فروشندۀ دریافت خواهد شد. در صورت عدم ایفای شرایط اعمال توسط خریدار، قرارداد اختیار منقضی شده و خریدار و فروشندۀ موظف به پرداخت کارمزد بورس و کارگزار مربوط به خود می‌باشد.</p>
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	<p>(الف) مطابق ماده ۸ دستورالعمل اجرایی قرارداد اختیار معامله درخصوص درج اولین نماد معاملاتی بی‌تفاوت، قیمت اعمال این نماد مضری از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضری از فاصله قیمت اعمال خواهد بود.</p> <p>(ب) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های اعمالی که قادر موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.</p>
۱۸	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می‌گیرد.
۱۹	ساعت‌ها و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵

کارمزد فروشنده	کارمزد خریدار	
۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	کارگزار
۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	بورس کالا
-	-	حق نظارت سازمان
۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	جمع

کارمزد تسویه و تحويل:

۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سرسید	کارگزار
۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سرسید	بورس کالا
۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سرسید	جمع

نوع تسويه پس از اعمال

تحويل دارایی پایه

۲۱

حداکثر تا ۲۵ قرارداد

حداکثر حجم هر سفارش

۲۲

