



بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راهاندازی قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۲/۱۰/۲۵ به شرح زیر با امکان استفاده از استراتژی کاور دکال و اندازه قرارداد یک واحد سرمایه‌گذاری به شرح مشخصات قرارداد پیوست، راهاندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۶۰/۰۰۰ ریال	TLOR03C16	۱۴۰۳/۰۳/۲۰
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۸۰/۰۰۰ ریال	TLOR03C18	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۰۰/۰۰۰ ریال	TLOR03C20	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۳۰/۰۰۰ ریال	TLOR03C23	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۶۰/۰۰۰ ریال	TLOR03C26	
فروش	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۶۰/۰۰۰ ریال	TLOR03P16	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۸۰/۰۰۰ ریال	TLOR03P18	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۰۰/۰۰۰ ریال	TLOR03P20	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۳۰/۰۰۰ ریال	TLOR03P23	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای لوتوس سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۶۰/۰۰۰ ریال	TLOR03P26	

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

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

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلا)
۲	نماد کالا	TLMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می‌باشد) TLMMYYPK (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	مضربی از ۱۰,۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: 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 تعدیل می‌شود: $\text{وجه تضمین اولیه} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای لوتوس (طلا) \times A) و (قیمت اعمال \times B) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱ ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود: ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای لوتوس \times A) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((قیمت اعمال \times B) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) 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 قرارداد اختیار معامله در فرمول فوق خواهد شد. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می‌باشد. 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.
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	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 می‌گردد و سایر مهلت‌های 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 درخواست‌های 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 موقعیت‌های باز و هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.
۱۵	خسارت‌ها	در صورتی که موقعیت‌های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تعهدات فروشنده، منجر به تسویه نقدی شود، فروشنده 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 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 می‌باشند.
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 بی‌تفاوت، قیمت اعمال این نماد مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های 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 می‌گیرد.
۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵

<table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۸</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۴</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۱۲</td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده	کارگزار	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۸	بورس کالا	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۴	جمع	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۱۲	کارمزد معاملاتی	۲۰
	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده								
	کارگزار	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۸								
	بورس کالا	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۰۴								
	جمع	ارزش هر قرارداد ۰/۰۰۱۲								
کارمزد تسویه و تحویل:										
کارگزار	ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید ۰/۰۰۰۴									
بورس کالا	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید ۰/۰۰۱									
جمع	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید ۰/۰۰۱۴									
تحویل دارایی پایه	نوع تسویه پس از اعمال	۲۱								
حداکثر تا ۲۵ قرارداد	حداکثر حجم هر سفارش	۲۲								

