



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین تحویل دی ماه ۱۳۹۹

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۳۹۹/۱۰/۰۸

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید دی ماه ۹۹ در روز سه‌شنبه مورخ ۱۳۹۹/۱۰/۲۳ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده زعفران با نمادهای زیر امکان پذیر می‌باشد:

- زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ)(زعف ۰۰۸ پ ۰۸)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)

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.

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 دی ماه ۹۹ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی زعفران نگین در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، میانگین موزون قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نمادهای زیر در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد:

- زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ) (زعف ۰۰۸ پ ۰۸)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید دی ماه ۱۳۹۹ 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 توسعه بازار مشتقه



((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله زعفران نگین که مشتری نزد شرکت بورس کالا معامله نموده و اکنون ملزم به تحویل یا دریافت آن براساس مشخصات ذیل می‌باشد.
- ۲- **بورس کالا:** شرکت بورس کالای ایران که معاملات قراردادهای اختیار معامله توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می‌پذیرد.
- ۳- **انبار:** انبار پذیرش شده بورس کالای ایران که مسئولیت دریافت زعفران نگین و صدور قبض انبار موقت به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده زعفران نگین برای مشتریان که در قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین بورس کالا معامله نموده‌اند را بر عهده دارد. که در اینجا انبارهای زیر می‌باشد:
 - شرکت زرین زعفران مشرق زمین
 - اتحادیه تعاونی های روستایی استان خراسان رضوی
 - شرکت نوین زعفران
 - شرکت طلای سرخ گلشید ایرانیان
 - شرکت کشاورزی تولیدی زعفران سحرخیز
 - شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی
 - شرکت زعفران بهرامن
- ۴- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفاء تعهد خود ملزم به تحویل زعفران نگین می‌باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات جهت ایفاء تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **زعفران:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۷- **اندازه هر قرارداد اختیار زعفران نگین:** ۱۰۰ گرم زعفران نگین
- ۸- **گواهی سپرده کالایی:** اوراق بهاداری است که موید مالکیت دارنده آن بر مقدار معینی کالای سپرده شده در انبار است و پشتوانه آن قبض انباری است که توسط انباردار صادر می‌گردد.

شماره:
تاریخ:
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

فرایند تحویل زعفران نگین توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند حداکثر تا سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد اختیار معامله برای تبدیل زعفران نگین به گواهی سپرده به انبارهای زیرمراجعه نمایند.

- شرکت زرین زعفران مشرق زمین
 - اتحادیه تعاونی های روستایی استان خراسان رضوی
 - شرکت نوین زعفران
 - شرکت طلای سرخ گلشید ایرانیان
 - شرکت کشاورزی تولیدی زعفران سحرخیز
 - شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی
 - شرکت زعفران بهرامن
- علاوه بر این مشتریان فروشنده می توانند حداکثر تا ساعت ۱۵:۰۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده زعفران نگین در معاملات روزانه گواهی سپرده زعفران نگین در نمادهای زیر نمایند:

- زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ) (زعف ۰۰۸ پ ۰۸)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ) (زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)

شماره:
تاریخ:
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

تحويل و کارشناسی زعفران نگین:

صرف تحويل زعفران نگین به انبار مذکور، به منزله ایفا کردن تعهدات فروشنده نمی باشد بلکه تعداد گواهی های سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری مشتری ملاک انجام تعهدات مشتری فروشنده است.

هزینه های انبارداری و ارزیابی:

هزینه های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه های موجود در معاملات گواهی سپرده زعفران نگین می باشد. دریافت زعفران نگین و تحويل رسید به مشتری:

انبار پس از کارشناسی و دریافت کامل زعفران نگین اقدام به صدور رسید به مشتری فروشنده می نماید. توجه: در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط خریدار، گواهی های صادر شده به نام فروشنده باقی مانده و فروشنده می تواند اقدام به فروش گواهی در بازار گواهی سپرده زعفران نگین یا ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت زعفران نگین نماید.

فرآیند تحويل خریداران:

مشتری خریدار می بایست حداکثر تا ساعت ۱۵:۳۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به تامین وجه ارزش اعمال قرارداد در حساب عملیاتی خود نماید و درخواست اعمال را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد.

انتقال مالکیت گواهی از فروشنده به خریدار:

مدیریت فناوری بورس تهران اقدام به ارسال هزینه انبارداری مشتریان به بورس کالا می نماید و پس از برداشت هزینه انبارداری از حساب مشتریان فروشنده، بورس اقدام به واریز به حساب عملیاتی انبار می نماید. در نهایت فرایند تحويل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، به صورت ترخیص گواهی سپرده زعفران نگین از کد سهامداری فروشنده و انتقال به کد سهامداری خریدار انجام می شود.

شماره:
تاریخ:
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی زعفران نگین:

- زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ)(زعف ۰۰۸ پ ۰۸)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)
- زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- انبار شرکت زرین زعفران مشرق زمین: خراسان رضوی، تربت حیدریه، خیابان فردوسی شمالی، فردوسی ۳۱، ساختمان امید، پلاک ۷
- انبار اتحادیه تعاونیه‌های روستایی استان خراسان رضوی: خراسان رضوی، مشهد، بلوار شهید صادقی، جنب روزنامه خراسان
- انبار شرکت طلای سرخ گلشید ایرانیان: خراسان رضوی، شهرک صنعتی توس، بعد از میدان تلاش، مجتمع خوشه زعفران واحد ۸۰۴
- انبار شرکت نوین زعفران: خراسان رضوی، شهرک صنعتی توس، فاز دوم، بلوار اندیشه ۶، بلوک ۳۰۶
- انبار شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی: خراسان رضوی، بیرجند، خیابان ارتش، مدیریت جهاد کشاورزی بیرجند
- انبار شرکت کشاورزی تولیدی زعفران سحرخیز: خراسان رضوی، مشهد، شهرک صنعتی توس فاز ۱ نبش تلاش شمالی ۶
- انبار شرکت زعفران بهرامن: مشهد-شهرک صنعتی توس فاز ۲ اندیشه ۹ پلاک ۳۳۳

شماره:

تاریخ:

پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

نکات مهم:

- ۱- تحویل زعفران نگین به انبار جهت تبدیل شدن به گواهی سپرده، حداکثر تا سه روز کاری قبل از سررسید امکان پذیر می باشد.
- ۲- معاملات گواهی سپرده کالایی زعفران نگین در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۸:۳۰ الی ۱۵:۰۰ و در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری انجام می گیرد، لذا مشتریان می توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری ۹۹/۱۰/۲۳ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۳- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده زعفران نگین در کد سهامداری خود باشد و، در صورت نیاز، درخواست اعمال خود را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد، بورس به تعداد موقعیت های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری وی می نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۴- مبنای محاسبه قیمت نقدی زعفران نگین در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین میانگین وزنی قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده زعفران در نمادهای زیر در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله خواهد بود:
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ) (زعف ۰۰۸ پ ۰۸)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)
 - زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)
- ۵- هرگواهی سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری شامل یک گرم زعفران نگین می باشد.



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:
تاریخ:
پیوست:

۶- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد سهامداری امکان پذیر می باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی از این کد به عهده مشتری می باشد.

۷- جهت تحویل زعفران نگین به انبار توسط مشتری، نیازی به حضور نماینده کارگزار نمی باشد.

۸- تمامی مشتریان دارای موقعیت تعهدی خرید و فروش باید جهت اطلاع از وضعیت کد سهامداری خود، که تحویل در بورس بر مبنای آن انجام خواهد شد، به کارگزار مربوطه مراجعه نمایند و هر گونه تغییر در وضعیت کد سهامداری خود را از طریق کارگزار مربوطه به بورس اطلاع دهند.

۹- کارگزاران می توانند نسبت به مشاهده کد سهامداری مشتریان، مراتب را در سامانه معاملات ابزار مشتقه (سما) در بخش گزارش ها/ مشتریان، ملاحظه نموده و به مشتریان خود اطلاع رسانی لازم را انجام دهند.

۱۰- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده در نمادهای زیر:

— زعفران ۰۰۰۸ نگین زرین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۵)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین روستا (پ) (زعف ۰۰۸ پ ۰۸)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین نوین (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۰۹)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین طلای سرخ (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۰)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین سحرخیز (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۱)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین بیرجند (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۶)

— زعفران ۰۰۰۸ نگین بهرامن (پ)(زعف ۰۰۰۸ پ ۱۸)

امکان پذیر می باشد. در صورت تکمیل ظرفیت انبار جهت تحویل قراردادهای اختیار معامله با توجه به موقعیت های باز نمادهای در سود قراردادهای اختیار معامله، سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد، تحویل زعفران نگین به صورت فیزیکی به انبار مذکور و انجام فرایند تحویل خارج از سازوکار گواهی سپرده زعفران نگین امکان پذیر خواهد بود. در این صورت تخصیص دارایی به خریداران در قالب گواهی سپرده یا تحویل فیزیکی بر اساسی اولویت زمانی اخذ موقعیت خرید صورت خواهد گرفت. همچنین شرایط در صورت تحویل فیزیکی زعفران نگین توسط فروشنده به انبار و مواعد آن تابع مفاد این اطلاعیه خواهد بود.

۱۱- پس از اتمام فرایند تحویل قرارداد اختیار معامله، مطابق مقررات و رویه حاکم بر معاملات گواهی سپرده، دارنده گواهی سپرده کالایی تعهد می نماید پیش از انقضای اعتبار گواهی سپرده کالایی تحویل گرفته شده، نسبت به تحویل گرفتن زعفران نگین از انبار و یا فروش گواهی سپرده در بازار اقدام نماید. در صورتی که به هر دلیل دارنده گواهی پس از انقضای اعتبار گواهی سپرده و مهلت تعیین شده توسط بورس جهت تحویل

شماره:

تاریخ:

پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

کالا مراجعه ننماید، انباردار خروج نهایی کالا را ثبت نموده و بورس، شرکت سپرده‌گذاری مرکزی و انبار پذیرش شده بورس هیچ‌گونه مسئولیتی در خصوص کمیت و کیفیت کالای موجود در انبار ندارند. در صورت عدم مراجعه دارنده گواهی سپرده کالایی، چنانچه انباردار شرایطی جهت نگهداری کالا پس از ثبت خروج کالا از انبار پذیرش شده بورس اعلام نماید، عدم مراجعه در حکم موافقت دارنده گواهی با شرایط اعلامی می‌باشد. ۱۲- در صورت وجود بیش از یک نماد معاملاتی گواهی سپرده زعفران نگین برای تحویل قراردادهای اختیار در صورتی که فروشنده در بیش از یک نماد دارایی داشته باشد، برداشت دارایی برای ایفای تعهدات وی از نقدشونده ترین نماد گواهی سپرده کالایی زعفران نگین صورت خواهد گرفت و تخصیص دارایی از انبارها به خریداران به صورت تصادفی انجام خواهد شد.