



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره: ۳۰/۰۱۵۰۰

تاریخ: ۱۳۹۵/۱۲/۲۳

پیوست: ندارد

((اطلاعیه))

موضوع: اطلاعیه تکمیلی فرآیند اعمال قرارداد اختیار معامله سررسید اسفندماه ۹۵

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۳۹۵/۱۲/۲۳

متن اطلاعیه:

به اطلاع می‌رساند فرآیند اعمال قرارداد اختیار معامله سررسید اسفند ماه ۹۵ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. اعمال در سطح هر نماد انجام خواهد شد. بدین معنی که فرآیند اعمال و تخصیص موقعیت‌های هر نماد معاملاتی در زیرگروه هم‌ماه اسفند به صورت جداگانه و بدون در نظر گرفتن خالص موقعیت‌های مشتری در کلیه نمادهای Call و Put زیرگروه هم‌ماه اسفند محاسبه خواهد شد.
۲. 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 سکه‌های دریافتی و وجوه واریزی مشتریان از در سودترین نماد و به شرح زیر انجام خواهد شد:

✓ در خصوص سکه‌های تحویل داده شده، تخصیص ابتدا از در سودترین قرارداد Put و سپس از در سودترین قرارداد Call، انجام خواهد شد. بدین مفهوم که ابتدا سکه‌های دریافت شده به منظور اعمال قراردادهای Put مشتری (و به ترتیب از بیشترین قیمت اعمال) و باقیمانده

تهران- خیابان طالقانی
بعد از تقاطع ولی‌عصر(عج)
نبش خیابان بندر انزلی
شماره ۳۵۱
تلفن ۰۲-۸۵۶۴۰۰۰۰
دورنگار: ۸۸۳۸۳۰۰۰
WWW.IME.CO.IR
info@ime.co.ir



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره: ۳۰/۰۱۵۰۰

تاریخ: ۱۳۹۵/۱۲/۲۳

پیوست: ندارد

آن به منظور ایفای تعهدات قراردادهای Call وی (و به ترتیب از کمترین قیمت اعمال) منظور خواهد شد.

✓ در خصوص وجوه واریزی نیز تخصیص ابتدا از درسودترین قرارداد Call و سپس از درسودترین قرارداد Put 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 بیشترین قیمت اعمال) لحاظ خواهد شد.

۳. مشتریان فروشنده در قرارداد Put، که به منظور ایفای تعهدات خود موظف به واریز ارزش قرارداد هستند توجه فرمایند که وجوه مورد نیاز برای ایفای تعهداتشان، می بایست بدون در نظر گرفتن وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت های باز ایشان در سررسید اسفندماه ۹۵ (و سایر سررسیدها) باشد.
۴. درخواست های اعمال ارائه شده خریداران و ایفای تعهدات فروشندگان در نمادهای در زیان وارد فرآیند تحویل نخواهند شد.
۵. مبنای محاسبه قیمت نقدی سکه طلا، قیمت سکه در ساعت ۱۵:۱۵ اتحادیه طلا، جواهر و سکه تهران می باشد.

منتشرکننده: مدیریت توسعه بازار مشتقه