



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا تحویل شهریور ماه ۱۴۰۴

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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا سررسید شهریور ماه ۱۴۰۴ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۰ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا با نماد "صندوق س.پشتوانه سکه طلا کهربا (کهربا)" امکان پذیر می‌باشد.
۲. درخواست‌های اعمال ارائه شده خریداران و ایفای تعهدات فروشندگان در نمادهای در زیان وارد فرآیند تحویل نخواهند شد.
۳. مهلت ارائه درخواست اعمال تا ۱۵ دقیقه پس از اتمام بازار در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۰ می‌باشد.
۴. 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 واحدهای صندوق طلای کهربا و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:
 - در خصوص واحدهای صندوق طلای کهربا، 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای کهربا، 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.
۵. وجوه مورد نیاز برای ایفای تعهدات مشتریان فروشنده در قرارداد Put، که به منظور ایفای تعهدات خود موظف به واریز ارزش قرارداد (حاصل ضرب قیمت اعمال در اندازه قرارداد) هستند، **بدون در نظر گرفتن** وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت‌های باز ایشان در سررسید شهریور (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

تاریخ: ۱۴۰۴/۰۶/۰۴

شماره: ۱۴۰۴/۳۰۰/۱۶۹۸۸

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

ع. مرجع قیمت نقدی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می باشد.

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای کهربا سررسید شهریور ماه 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.

منتشر کننده: مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا 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- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل دارایی پایه قرارداد اختیار می‌باشد.
- ۴- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۵- **واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۶- **اندازه هر قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا:** ۱۰ واحد سرمایه‌گذاری

فرآیند تحویل واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده (که مطابق با تعاریف فوق ملزم به تحویل دارایی پایه هستند) موظفند حداکثر تا پایان آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا در کد سهامداری خود نمایند. بدیهی است باتوجه به اندازه قرارداد، مشتریان فروشنده، به ازای هر موقعیت تعهدی باز خود در قرارداد اختیار معامله می‌بایست ۱۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا را تأمین نمایند.

توجه

- ۱- اگر مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید دارای واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا در کد سهامداری خود باشد و مشتری دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

علاوه بر ارائه درخواست اعمال، دارای واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا در کد سهامداری خود باشد بورس متناسب با موقعیت‌های باز این مشتریان در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری ایشان می‌نماید. لازم به ذکر است، عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید (متعهد به تحویل دارایی پایه می‌باشد)، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.

۲- در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط مشتری خریدار، واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا صادر شده به نام مشتری فروشنده باقی خواهد ماند و وی می‌تواند اقدام به فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا در بازار صندوق‌های سرمایه‌گذاری کالایی پس از اتمام فرآیند تحویل نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ۳۰ دقیقه پس از پایان 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا از مشتری فروشنده به مشتری خریدار:

فرآیند انتقال دارایی پایه از مشتری فروشنده به مشتری خریدار به صورت انتقال مالکیت واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا، از کد سهامداری مشتری فروشنده به کد سهامداری مشتری خریدار متناسب با موقعیت‌های قابل تحویل انجام می‌شود.

سایر اطلاعات:

نماد معاملاتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا: صندوق س. پشتوانه سکه طلا کهربا نکات مهم:

۱- معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا طی روزهای معاملاتی هر هفته در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری بورس تهران انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز معاملاتی نسبت به خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری طلای کهربا در این بازار و نگهداری آن تا پایان فرآیند تحویل روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۰۶/۳۰ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.

۲- انجام معاملات واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا فقط با کد سهامداری امکان پذیر می‌باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی به عهده مشتری و کارگزاری می‌باشد.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- ۳- 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.
- ۴- 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.
- ۵- مبنای محاسبه قیمت نقدی در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای کهربا، قیمت پایانی نماد "صندوق س.پشتوانه سکه طلا کهربا" در آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خواهد بود.
- ۶- هر گونه مانع جهت انتقال دارایی در کد سهامداری مشتریان، به منزله عدم ایفای تعهدات می باشد.
- ۷- باتوجه به وجود مهلت مجدد در فرآیند تحویل (مطابق مشخصات قرارداد) و لزوم مسدودسازی دارایی در کد سهامداری مشتریان فروشنده می بایست کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه در بورس کالا یکسان باشند (امکان تغییر کارگزار ناظر وجود ندارد و مغایرت کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه به منزله عدم ایفای تعهدات مشتری می باشد). همچنین باتوجه به فرآیند دو روزه تحویل، حفظ دارایی تا اتمام فرآیند تحویل جهت ایفای تعهدات الزامی است.