

شماره: ۹۹/۳۰۰/۳۲۰۷

تاریخ: ۱۳۹۹/۰۶/۲۲

پیوست: دارد

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران تحویل شهریور ماه ۱۳۹۹

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۳۹۹/۰۶/۲۲

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله زعفران سررسید شهریور ماه ۹۹ در روز شنبه مورخ ۱۳۹۹/۰۶/۲۹ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده زعفران با نمادهای زعفران ۹۹۰۸ نگین ت.روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰)، زعفران ۹۹۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶) امکان پذیر می باشد.

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 شهریور ماه ۹۹ (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی زعفران نگیں در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، میانگین موزون قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نمادهای زعفران ۹۹۰۸ نگیں ت.روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں زرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگیں طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶) در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

شماره: ۹۹/۳۰۰/۳۲۰۷

تاریخ: ۱۳۹۹/۰۶/۲۲

پیوست: دارد

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید شهریور 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



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:
تاریخ:
پیوست:

((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 انبار "تعاونی روستایی خراسان رضوی"، "شرکت زرین زعفران مشرق زمین" نگین طلای سرخ، نگین نوین "شرکت سحرخیز و شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی" می‌باشد.
- 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 ایفای 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 ایفای 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 کالایی سپرده شده در انبار است و پشتوانه آن قبض انباری است که توسط انباردار صادر می‌گردد.



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:

تاریخ:

پیوست:

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 تعاونی روستایی خراسان رضوی " و "شرکت زرین زعفران مشرق زمین" نگین طلای سرخ، نگین نوین، شرکت سحرخیز و شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی مراجعه نمایند. علاوه بر این مشتریان فروشنده می‌توانند حداکثر تا ساعت ۱۵:۰۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده زعفران نگین در معاملات روزانه گواهی سپرده زعفران نگین در نماد/نمادهای زعفران ۹۹۰۸ نگین ت.روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰) زعفران ۹۹۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶) نمایند.

تحویل و کارشناسی زعفران نگین:

صرف تحویل زعفران نگین به انبار مذکور، به منزله ایفا کردن تعهدات فروشنده نمی‌باشد بلکه تعداد گواهی‌های سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری مشتری ملاک انجام تعهدات مشتری فروشنده است.

هزینه‌های انبارداری و ارزیابی:

هزینه‌های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه‌های موجود در معاملات گواهی سپرده زعفران نگین می‌باشد.

دریافت زعفران نگین و تحویل رسید به مشتری:

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



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:

تاریخ:

پیوست:

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست 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 می‌نماید و پس از برداشت هزینه انبارداری از حساب مشتریان فروشنده، بورس اقدام به واریز به حساب عملیاتی انبار می‌نماید. در نهایت فرایند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، به صورت ترخیص گواهی سپرده زعفران نگیں از کد سهامداری فروشنده و انتقال به کد سهامداری خریدار انجام می‌شود.

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی زعفران نگیں: زعفران ۹۹۰۸ نگیں ت. روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں زیرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگیں طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰) زعفران ۹۹۰۸ نگیں سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگیں بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶)

۲- نشانی انبار پذیرش شده: ۱. خراسان رضوی، تربت حیدریه، خیابان فردوسی شمالی، فردوسی ۳۱، ساختمان امید، پلاک ۷، انبار شرکت زرین زعفران مشرق زمین ۲. خراسان رضوی، مشهد، بلوار شهید صادقی، جنب روزنامه خراسان، اتحادیه تعاونیهای روستایی استان خراسان رضوی، خراسان رضوی، شهرک صنعتی توس، بعد از میدان تلاش، مجتمع خوشه زعفران واحد ۸۰۴، شرکت طلای سرخ گلشید ایرانیان، خراسان رضوی، شهرک صنعتی توس، فاز دوم، بلوار اندیشه ۶، بلوک ۳۰۶، شرکت نوین زعفران، خراسان



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:

تاریخ:

پیوست:

رضوی مشهد شهرک صنعتی توس فاز ۱ نبش تلاش شمالی ۶ شرکت سحرخیز، شرکت صندوق حمایت از توسعه بخش کشاورزی خراسان جنوبی

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 ۹۹/۰۶/۲۹ 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 موقعیت‌های 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 جریمه‌های 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 نگین ۹۹۰۸ نگین ت. روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰)، زعفران ۹۹۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶) در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله خواهد بود.
- ۵- هر گواهی سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری شامل یک گرم زعفران نگین می باشد.



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 زعفران ۹۹۰۸ نگین ت.روستا (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۹۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۵)، زعفران ۹۹۰۸ نگین نوین (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۰۹) و زعفران ۹۹۰۸ نگین طلای سرخ (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۰)، زعفران ۹۹۰۸ نگین سحرخیز (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۱)، زعفران ۹۹۰۸ نگین بیرجند (پ) (زعف ۹۹۰۸ پ ۱۶) 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 أخذ 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.



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:

تاریخ:

پیوست:

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 کالا مراجعه ننماید، انباردار خروج نهایی کالا را ثبت نموده و بورس، شرکت سپرده گذاری مرکزی و انبار پذیرش شده بورس هیچ گونه 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 می باشد.

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.