

مشخصات قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق س. پشتوانه طلای لوتوس (طلا)

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلا)																					
۲	قرارداد آتی پذیرش شده	قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری (قابل معامله)																					
۳	اندازه قرارداد	۱۰۰۰ واحد سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلا)																					
۴	استاندارد تحویل	واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلا)																					
۵	ماه قرارداد	تمامی ماههای سال به تشخیص شرکت بورس کالای ایران																					
۶	حد نوسان قیمت روزانه	حداکثر تا (+۵/-) با توجه به قیمت تسویه روزانه روز قبل																					
۷	دوره معاملات	دوره معاملاتی در هر یک از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.																					
۸	محل و دوره تحویل	تحویل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای آتی																					
۹	حداقل تغییر قیمت سفارش	۱۰۰ ریال برای هر واحد سرمایه گذاری معادل ۱۰۰,۰۰۰ ریال در هر قرارداد																					
۱۰	نحوه محاسبه تضامین	<p>الف) وجه تضمین اولیه:</p> <p>وجه تضمین اولیه 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. مبنای محاسبه وجه تضمین در این فرمول میانگین قیمت های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی در دارایی پایه مربوطه تعیین شده است. وجه تضمین در پایان هر روز معاملاتی بر اساس فرمول زیر تعدیل می شود و پس از دو روز کاری اعمال می گردد، مراتب تغییرات از طریق سامانه معاملاتی ابزار مشتقه اطلاع رسانی می گردد:</p> $A \times \left( \left[ \frac{B \times S}{C \times 10} \right] + 1 \right) \times C \times 10 = \text{مبلغ وجه تضمین اولیه}$ <p>A: درصد وجه تضمین اولیه؛ معادل ۲۰٪                  B: میانگین قیمت های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی دارایی پایه                  C: براکت تغییرات وجه تضمین؛ معادل یک میلیون ریال                  S: اندازه قرارداد؛ معادل ۱۰۰۰</p> <p>ب) حداقل وجه تضمین:                  ۷۰ درصد وجه تضمین اولیه</p>																					
۱۱	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۲۵ قرارداد																					
۱۲	واحد قیمت	ریال به ازای هر واحد سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای لوتوس																					
۱۳	کارمزدها	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>حق نظارت سازمان</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده		کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	حق نظارت سازمان	-	-	جمع	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																						
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																					
بورس کالا	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد																					
حق نظارت سازمان	-	-																					
جمع	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد																					
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
۱۴	نماد معاملاتی	ETCMMYY (MM نماد اختصاری ماه قرارداد و YY سال می باشد).																					
۱۵	ساعات معامله	در تمامی روزها ۱۰ الی ۱۵																					
۱۶	مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل	تا ۱۵ دقیقه پس از اتمام جلسه معاملاتی آخرین روز معاملاتی																					

۱۷	سقف مجاز موقعیت های تعهدی باز و معاملات	سقف مجاز موقعیت های تعهدی باز مشتریان: <ul style="list-style-type: none"> <li>• اشخاص حقیقی و حقوقی: ۲۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی.</li> <li>• بازارگردان: ۴۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی و قابل افزایش تا ۱۰ درصد موقعیت های تعهدی باز در آن نماد در بازار.</li> </ul> سقف مجاز موقعیت های تعهدی باز بازار: <ul style="list-style-type: none"> <li>• تعداد موقعیت های باز کل بازار در هر نماد معاملاتی حداکثر باید معادل یک هزارم سقف واحدهای معاملاتی قابل صدور صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس (طلا) باشد.</li> </ul>
۱۸	جریمه ها	الف) جریمه نکول قراردادهای، شامل جریمه عدم ارائه گواهی آمادگی تحویل مشتریان خریدار و فروشنده، جریمه عدم ارائه انبار دارایی پایه از طرف مشتریان فروشنده و جریمه عدم واریز وجه ارزش قرارداد بر اساس قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی از طرف مشتریان خریدار، یک درصد ارزش قرارداد بر اساس قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی است که به نفع مشتری طرف مقابل از مشتری نکول کننده کسر می گردد. ب) در خصوص کلیه جرایم ذکر شده فوق، در صورتی که قیمت بازار نقدی دارایی پایه از قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی بیشتر باشد تفاوت این دو نرخ به نفع مشتری خریدار از فروشنده اخذ می گردد و همچنین در صورتی که قیمت بازار نقدی دارایی پایه از قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی کمتر باشد تفاوت این دو نرخ به نفع مشتری فروشنده از خریدار اخذ می گردد. ج) در تمامی موارد فوق کارمزد تسویه و تحویل هر دو سر معامله به نفع بورس از مشتری نکول کننده دریافت خواهد شد.
۱۹	حجم معاملات مبنای محاسبه قیمت تسویه روزانه	٪۳۰ حجم معاملات انجام شده منتهی به پایان آخرین جلسه معاملاتی هر روز
۲۰	نحوه محاسبه قیمت تسویه نهایی	قیمت تسویه نهایی، قیمت تسویه روزانه در آخرین روز معاملاتی هر قرارداد است.
۲۱	قیمت تسویه لحظه ای	قیمت تسویه لحظه ای بر اساس ٪۳۰ حجم معاملات پایانی در هر لحظه معاملاتی محاسبه خواهد شد.
۲۲	سایر موارد	توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری پشتوانه طلای لوتوس به طور همزمان با توقف و بازگشایی نماد معاملاتی صندوق پشتوانه طلای لوتوس (طلا) انجام می شود.