

شماره: 30/4658
تاریخ: 1394/12/12
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

((اطلاعیه))

موضوع: اطلاعیه عرضه اولیه اوراق سلف استاندارد تیرآهن ۱۴ شرکت ذوب آهن اصفهان

مخاطب: کلیه فعالان بازار

تاریخ انتشار: ۱۳۹۴/۱۲/۱۲

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان بازار می‌رساند، عرضه اولیه اوراق سلف استاندارد تیرآهن ۱۴ شرکت ذوب آهن اصفهان به روش "عرضه گسترده با قیمت ثابت" تا سقف ۱۱۱،۱۱۲ تن و با قیمت ۱۳،۵۰۰،۰۰۰ ریال به ازای هر تن (معادل یک قرارداد)، از طریق شبکه کارگزاران بورس کالای ایران در روز دوشنبه مورخ ۱۳۹۴/۱۲/۱۷ انجام خواهد شد و معاملات ثانویه آن از تاریخ ۱۳۹۵/۰۱/۱۰ لغایت ۱۳۹۵/۱۲/۱۷ ادامه خواهد داشت. مشخصات قرارداد این اوراق به شرح پیوست می‌باشد. جهت کسب اطلاعات بیشتر و دریافت امیدنامه این اوراق، به بخش اوراق سلف استاندارد در قسمت بازارها در سایت بورس کالا مراجعه فرمایید.

منتشرکننده: مدیریت توسعه بازار مشتقه

تهران- خیابان طالقانی
بعد از تقاطع ولیعصر (عج)
نبش خیابان بندرانزلی
شماره ۳۵۱
تلفن ۲-۸۵۶۴۰۰۰۰
دورنگار: ۸۸۳۸۳۰۰۰
WWW.IME.CO.IR
info@ime.co.ir



مشخصات قرارداد سلف موازی استاندارد تیرآهن	
نام ابزار تأمین مالی	اوراق سلف موازی استاندارد تیرآهن (منضم به اختیار خرید و فروش تبعی)
نوع اوراق	بانام، قابل معامله در بورس کالای ایران و معاف از مالیات
دارایی پایه	تیرآهن
مشخصات و استاندارد دارایی پایه	تیرآهن ۱۴ طبق آنالیز ارائه شده در امید نامه سلف موازی استاندارد تیرآهن
هدف از عرضه	تأمین سرمایه در گردش شرکت ذوب آهن اصفهان
بازار عرضه اولیه و معاملات ثانویه	بورس کالای ایران
مشخصات اوراق سلف	
حجم عرضه اولیه	حجم عرضه اولیه حداکثر ۲۰۰,۰۰۰ تن به شرط آنکه ارزش اوراق از ۲۵۰۰ میلیارد ریال بیشتر و کمتر نباشد. اوراق طی دو مرحله شامل ۱۵۰۰ میلیارد ریال در مرحله اول و ۱۰۰۰ میلیارد ریال در مرحله دوم عرضه خواهد شد.
حداکثر حجم قابل عرضه	محدود به حجم عرضه اولیه
اندازه هر قرارداد	۱ برگ (معادل ۱ تن)
روش عرضه اولیه	روش عرضه گسترده به قیمت ثابت
سقف حجم هر سفارش	نامحدود
حداقل تغییر قیمت هر سفارش	یک ریال
دامنه نوسان قیمت روزانه	-
واحدهای پولی قیمت و ارز مورد تسویه	ریال
قیمت خرید هر قرارداد	قیمت ریالی دارایی پایه بر مبنای قیمت معاملاتی آن دارایی در بورس کالای ایران تعیین می شود.
قیمت اعمال اختیار فروش تبعی	۱۲۴٪ قیمت عرضه اولیه در سررسید اوراق
قیمت اعمال اختیار خرید تبعی	۱۲۷٪ قیمت عرضه اولیه در سررسید اوراق
قیمت خرید بازارگردان در معاملات ثانویه	قیمت عرضه ی اولیه به علاوه ی سود معادل ۲۳ درصد سالانه به صورت روزشمار



بازده اوراق	در صورتی که قیمت دارایی پایه در سررسید کمتر از (۱.۲۴ × قیمت پایه در عرضه اولیه) باشد سرمایه‌گذاران می‌توانند از اختیار فروش استفاده کرده و نسبت به فروش قرارداد به قیمت (۱.۲۴ × قیمت پایه در عرضه اولیه) به شرکت ذوب آهن اصفهان اقدام کنند. بدین ترتیب بازده سالانه اوراق سلف، حداقل ۲۴ درصد خواهد بود. در صورتی که قیمت دارایی پایه در سررسید بیشتر از (۱.۲۷ × قیمت پایه در عرضه اولیه) باشد، شرکت ذوب آهن اصفهان می‌تواند از اختیار خرید استفاده کرده و نسبت به خرید قرارداد تیرآهن به قیمت (۱.۲۷ × قیمت پایه در عرضه اولیه) از دارندگان اوراق اقدام می‌کند. در این حالت، قیمت تسویه ۱۲۷ درصد قیمت عرضه اولیه خواهد بود. بدین ترتیب بازدهی سالانه اوراق سلف حداکثر ۲۷ درصد است.
مقاطع پرداخت سود	اوراق سلف موازی استاندارد سود بین دوره‌ای ندارد. در پایان دوره خریدار می‌تواند نسبت به تحویل فیزیکی یا تسویه نقدی با توجه به قیمت دارایی پایه در سررسید و بر اساس قیمت اعمال اختیار فروش تبعی یا اختیار خرید تبعی اقدام کند.
مدت قرارداد	یک سال از تاریخ عرضه‌ی اولیه
دوره عرضه اولیه	در اطلاعیه‌ی عرضه مشخص خواهد شد.
معاملات ثانویه	
معاملات ثانویه	از طریق شبکه کارگزاران مورد تأیید سازمان بورس بر اساس ضوابط معاملات بورس کالا حداکثر ۱۰ روز کاری پس از پایان عرضه اولیه
شرایط بازارگردانی طی دوره معاملاتی	بازارگردان موظف است ضمن عملیات بازارگردانی، تقاضاهای فروش اوراق سلف موازی استاندارد موضوع این قرارداد را در حداقل قیمت تضمین شده شامل اصل مبلغ پرداخت شده در روز عرضه عمومی و سود ۲۳٪ سالانه روزشمار برای هر ورق بر اساس مقررات معاملات اوراق بهادار در بورس کالا خریداری نموده و تقاضاهای خرید اوراق سلف موازی استاندارد موضوع این قرارداد را تا سقف اوراق در اختیار به متقاضیان عرضه کند. توضیحات مندرج در بخش نحوه انجام معاملات (فصل سوم) امید نامه سلف موازی استاندارد تیرآهن.
حداقل سفارش انباشته بازار گردان	۱٪ حجم کل اوراق
سقف تعهد معاملات روزانه بازار گردان	۵٪ حجم کل اوراق
نقد شوندگی اوراق قبل از سررسید	تأمین سرمایه امین بر اساس مدل بازار گردانی تضمین حداقل قیمت، نقد شوندگی اوراق سلف موازی تیرآهن را قبل از سررسید تعهد می‌کند و اوراق سلف را طی دوره معاملاتی با نرخ سود ۲۳ درصد سالانه به صورت روزشمار به علاوه قیمت اوراق در عرضه اولیه، بازخرید خواهد کرد.
کارمزد خرید و فروش اوراق	بر اساس مصوبه هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار
سررسید و شرایط تحویل	
سررسید اوراق	یک سال پس از تاریخ عرضه‌ی اولیه
تاریخ ارائه درخواست تحویل فیزیکی	۱۰ روز پیش از سررسید
دوره‌ی تحویل	حداکثر دو ماه پس از تاریخ سررسید
مکان تحویل	درب کارخانه (اصفهان، کیلومتر ۴۵ جاده اصفهان شهرکرد)



امکان تحویل فیزیکی و تسویه نقدی در پایان دوره معاملاتی	دوره تحویل فیزیکی پس از زمان سررسید اوراق شروع و به مدت دو ماه ادامه خواهد داشت. عدم ارائه درخواست جهت تحویل فیزیکی، ۱۰ روز پیش از تاریخ سررسید اوراق به منزله انصراف خریدار از تحویل دارایی پایه و انجام تسویه نقدی خواهد بود.
حداقل اوراق جهت تسویه فیزیکی	۲۴ قرارداد (معادل ۲۴ تن)
شرایط لازم جهت تحویل کالا	➤ منوط به اعلام آمادگی تحویل از سوی دارندگان قراردادهای سلف موازی استاندارد (به ترتیبی که هیئت مدیره شرکت سپرده گذاری مرکزی تعیین و اعلام می کند) حداکثر تا پایان ساعت معاملاتی، ۱۰ روز پیش از سررسید اوراق خواهد بود ➤ حداقل تعداد قرارداد جهت تحویل فیزیکی ۲۴ قرارداد معادل ۲۴ تن تیر آهن است ➤ در صورتی که در سررسید قیمت قرارداد بالاتر از قیمت اعمال اختیار خرید شرکت ذوب آهن اصفهان ۱۲۷٪ بوده و با شرط اعمال اختیار شرکت ذوب آهن اصفهان، چنانچه دارنده اوراق تمایل به تحویل کالای موضوع قرارداد داشته باشد، دارنده اوراق می تواند با پرداخت مابه التفاوت قیمت روز (بر مبنای روشی که محاسبه قیمت خرید هر قرارداد ارائه شد) و قیمت اختیار خرید شرکت ذوب آهن اصفهان نسبت به تحویل کالا اقدام نماید. عملیات اجرایی تحویل: ➤ تحویل کالا در سررسید در محل کارخانه خواهد بود.
خسارت ناشی از عدم تحویل کالا	شرکت متعهد به پرداخت جریمه ای معادل ۰.۲۵ درصد کالای تسویه نشده به ازای هر روز دیر کرد است (طبق استاندارد بورس کالای ایران).
ارکان عرضه	
	عرضه کننده شرکت ذوب آهن اصفهان
	مشاور پذیرش تأمین سرمایه امین
	متعهد خرید در عرضه اولیه تأمین سرمایه امین
	بازار گردان تأمین سرمایه امین
	عامل عرضه کارگزاری امین آوید
	محل انجام معاملات بورس کالای ایران



تاریخ‌های مهم	دوره عرضه اولیه قرارداد: در اطلاعیه عرضه مشخص خواهد شد؛ دوره معاملاتی قرارداد: حداکثر ۱۰ روز پس از پایان دوره عرضه اولیه؛ تاریخ ارائه درخواست برای تحویل فیزیکی: ۱۰ روز پیش از سررسید قرارداد؛ سررسید قرارداد: یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه؛ تسویه نقدی قرارداد: یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه؛ دوره تحویل فیزیکی: حداکثر دو ماه پس از سررسید قرارداد.
اطلاع‌رسانی	اطلاعیه‌های مرتبط با اوراق سلف موازی استاندارد تیرآهن در پایگاه رسمی شرکت ذوب آهن اصفهان به نشانی www.esfahansteel.com و بورس کالای ایران به نشانی www.ime.co.ir و تأمین سرمایه امین به نشانی www.aminib.com درج خواهد شد.

- با توجه به اینکه قیمت تیرآهن در دوره عرضه اولیه بر اساس قیمت بورس کالای قبل از عرضه اولیه مشخص می‌شود، اعداد این امیدنامه فرضی است و به منظور آشنایی سرمایه‌گذاران علاقه‌مند به خرید اوراق سلف تیرآهن ارائه گردیده است. تاریخ‌ها و قیمت‌های نهایی بر اساس اعداد و ارقام واقعی و قطعی در اطلاعیه عرضه درج خواهد گردید.
- به استناد تبصره ۲ ماده ۱۳ دستورالعمل معاملات کالا و اوراق بهادار مبتنی بر کالا در بورس کالای ایران مصوب ۱۳۸۹/۰۷/۰۵ شورای عالی بورس و اوراق بهادار، اطلاعات منتشره در قالب امیدنامه جزء لاینفک اطلاعیه عرضه است.