

شماره: 30/4506

تاریخ: 1394/11/21

پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

((اطلاعیه))

موضوع: اطلاعیه عرضه اولیه اوراق سلف استاندارد کنسانتره سنگ آهن شرکت معدنی و صنعتی گل گهر (سهامی عام)

مخاطب: کلیه فعالان بازار

تاریخ انتشار: ۱۳۹۴/۱۱/۲۱

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان بازار می‌رساند، عرضه اولیه اوراق سلف استاندارد کنسانتره سنگ آهن شرکت معدنی و صنعتی گل گهر (سهامی عام) به میزان ۷۵۰.۰۰۰ تن و با قیمت ۱.۴۹۵.۰۰۰ ریال به ازای هر تن (۱.۴۹۵.۰۰۰ ریال به ازای هر قرارداد) به روش عرضه با قیمت ثابت، از طریق شبکه کارگزاران بورس کالای ایران در روز دوشنبه مورخ ۱۳۹۴/۱۱/۲۶ انجام خواهد شد. معاملات ثانویه آن از تاریخ ۱۳۹۴/۱۲/۱۰ لغایت ۱۳۹۵/۱۱/۲۶ 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.

منتشر کننده: مدیریت توسعه بازار مشتقه

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



مشخصات قرارداد سلف موازی استاندارد کنسانتره سنگ آهن

مشخصات کلی ابزار تأمین مالی و دارایی پایه

نام ابزار تأمین مالی	اوراق سلف موازی استاندارد کنسانتره سنگ آهن (منضم به اختیار خرید و فروش تبعی)
نوع اوراق	با نام، قابل معامله در بورس کالا، معاف از مالیات
دارایی پایه	کنسانتره سنگ آهن
مشخصات و استاندارد دارایی پایه	کنسانتره سنگ آهن ۸۰٪ زیر ۶۰۰ میکرون و ۲۰٪ زیر ۱۵۰ میکرون و رطوبت حداکثر ۸٪
هدف از عرضه	تأمین مالی طرح‌های توسعه شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر
بازار عرضه اولیه و معاملات ثانویه	بورس کالای ایران

مشخصات اوراق سلف

حجم عرضه اولیه	حداکثر ۷۵۰.۰۰۰ تن کنسانتره سنگ آهن
حداکثر حجم قابل عرضه	محدود به حجم عرضه اولیه
اندازه هر قرارداد	یک تن کنسانتره سنگ آهن
روش عرضه اولیه	عرضه گسترده با 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	۱.۴۹۵.۰۰۰ ریال
قیمت اعمال در اختیار فروش تبعی	۱/۲۵ برابر قیمت عرضه اولیه در سررسید اوراق
قیمت اعمال در اختیار خرید تبعی	۱/۲۸ برابر قیمت عرضه اولیه در سررسید اوراق
قیمت خرید بازارگردان در معاملات ثانویه	قیمت عرضه اولیه به علاوه سود معادل ۲۲ درصد روزشمار ساده سالانه
بازده اوراق	در صورتی که قیمت کنسانتره سنگ آهن بر اساس قیمت‌های مندرج در سامانه معاملات شرکت بورس کالای ایران در سررسید کمتر از ۱/۲۵ برابر قیمت پایه در عرضه اولیه باشد، دارندگان اوراق سلف می‌توانند از اختیار فروش استفاده نموده و نسبت به فروش اوراق به قیمت ۱/۲۵ برابر قیمت پایه در عرضه اولیه به شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر اقدام نمایند. بدین ترتیب حداقل بازدهی اوراق سلف طی ۱ سال معادل ۲۵ درصد خواهد بود. در صورتی که قیمت کنسانتره سنگ آهن بر اساس قیمت‌های مندرج در سامانه معاملات شرکت بورس کالای ایران در بازه ۱/۲۵ و ۱/۲۸ برابر قیمت عرضه اولیه باشد، سرمایه‌گذاران می‌توانند نسبت به تسویه نقدی بر مبنای قیمت روز کنسانتره سنگ آهن و یا دریافت فیزیکی کالا اقدام نمایند. در صورتی که قیمت قرارداد کنسانتره سنگ آهن بر اساس قیمت‌های مندرج در سامانه معاملات شرکت بورس کالای ایران در سررسید بیشتر از ۱/۲۸ برابر قیمت پایه در عرضه اولیه باشد، شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر می‌تواند از اختیار خرید تبعی استفاده نموده و نسبت به خرید قرارداد کنسانتره سنگ آهن به قیمت ۱/۲۸ برابر قیمت پایه در عرضه اولیه، اقدام نماید. بدین ترتیب حداکثر بازدهی اوراق سلف طی ۱ سال ۲۸ درصد خواهد بود. در این حالت سرمایه‌گذارانی که همچنان تمایل به تحویل فیزیکی کالا دارند باید با پرداخت مابه‌التفاوت



مشخصات قرارداد سلف موازی استاندارد کنسانتره سنگ آهن

مقاطع پرداخت سود	قیمت روز و قیمت اعمال اختیار خرید، کنسانتره سنگ آهن را تحویل بگیرند.
مدت قرارداد (عمر اوراق)	اوراق سلف سود بین دوره‌ای ندارد. در پایان دوره خریدار می‌تواند نسبت به تحویل فیزیکی یا تسویه نقدی با توجه شرایط مندرج در امید نامه اقدام نماید.
دوره عرضه اولیه	۱ سال از تاریخ عرضه اولیه
	۱ روز

معاملات ثانویه

معاملات ثانویه	از طریق شبکه کارگزاری‌های دارای مجوز معاملات سلف موازی استاندارد و براساس ضوابط معاملات بورس کالا ۱۰ روز پس از پایان عرضه اولیه
حداقل سفارش انباشته بازارگردان	۱٪ حجم کل اوراق
حداقل تعهد معاملات روزانه	۱۰٪ حجم کل اوراق
نقد شوندگی اوراق قبل از سررسید	شرکت تامین سرمایه امید بر اساس مدل بازارگردانی تضمین حداقل قیمت، نقدشوندگی اوراق سلف کنسانتره سنگ آهن را قبل از سررسید تعهد نموده و اوراق سلف را طی عمر اوراق با نرخ ۲۲ درصد روزشمار ساده سالانه به علاوه قیمت اوراق در عرضه اولیه باز خرید خواهد نمود.
کارمزد خرید و فروش اوراق	بر اساس مصوبه هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار

سررسید و شرایط تحویل

سررسید قرارداد (اوراق)	یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه
تاریخ ارائه درخواست تحویل فیزیکی	۱۰ روز کاری قبل از سررسید قرارداد. (پس از ارائه درخواست، دارنده اوراق حق فروش اوراق را نخواهد داشت)
دوره‌ی تحویل	دوره یک ماهه پس از سررسید قرارداد. زمانبندی تحویل در این دوره بر عهده شرکت گل گهر است.
مکان تحویل	درب کارخانه
نحوه تسویه در سررسید	در صورتیکه قیمت قرارداد کنسانتره سنگ آهن در سررسید کمتر از ۱.۸۶۸.۷۵۰ ریال باشد، تسویه به صورت اعمال اختیار فروش یا تسویه فیزیکی صورت خواهد گرفت. در صورتیکه قیمت قرارداد کنسانتره سنگ آهن در سررسید بین ۱.۸۶۸.۷۵۰ ریال تا ۱.۹۱۳.۶۰۰ ریال باشد، تسویه نقدی بر اساس قیمت روز کنسانتره سنگ آهن یا تسویه فیزیکی صورت خواهد گرفت. در صورتیکه قیمت قرارداد کنسانتره سنگ آهن در سررسید بیش از ۱.۹۱۳.۶۰۰ ریال باشد، تسویه به صورت اعمال اختیار خرید صورت خواهد گرفت. در صورت تمایل دارنده اوراق به دریافت کالا، تسویه فیزیکی با پرداخت مابه‌التفاوت قیمت روز و قیمت اعمال اختیار خرید، صورت خواهد گرفت.
حداقل اوراق جهت تسویه فیزیکی	معادل ۲۰۰۰ تن
شرایط لازم جهت تحویل فیزیکی کالا	مطابق شرایط فصل ۳ امیدنامه
خسارت ناشی از عدم تحویل دارایی	مطابق شرایط فصل ۳ امیدنامه

ارکان عرضه

تولیدکننده و عرضه‌کننده	شرکت معدنی و صنعتی گل گهر (فصل ۴)
مشاور پذیرش	شرکت تأمین سرمایه امید (فصل ۴)
متعهد خرید در عرضه اولیه	شرکت تأمین سرمایه امید



مشخصات قرارداد سلف موازی استاندارد کنسانتره سنگ آهن		
بازارگردان	شرکت تأمین سرمایه امید	
عامل عرضه	کارگزاری‌های دارای مجوز معاملات سلف موازی استاندارد	
محل انجام معاملات	بورس کالای ایران و در بستر سامانه معاملاتی شرکت مدیریت فناوری بورس تهران	
سایر اطلاعات مهم		
تاریخ‌های مهم	دوره عرضه اولیه قرارداد: ۱۳۹۴/۱۱/۲۶ به مدت ۱ روز دوره معاملاتی قرارداد: حداقل ۱۰ روز پس از پایان دوره عرضه اولیه تاریخ ارائه درخواست برای تحویل فیزیکی: حداقل ۱۰ روز کاری قبل از سررسید قرارداد (سرمایه‌گذاران پس از ارائه درخواست تحویل فیزیکی حق فروش اوراق را نخواهند داشت). سررسید قرارداد: یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه تاریخ اعمال اختیار فروش: یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه تاریخ اعمال اختیار خرید: یک سال پس از تاریخ عرضه اولیه دوره تحویل فیزیکی: دوره یک ماهه پس از سررسید قرارداد	
اطلاع رسانی	اطلاعیه‌های مرتبط با اوراق سلف در پایگاه رسمی شرکت معدنی و صنعتی گل‌گهر به نشانی www.geg.ir شرکت بورس کالای ایران www.ime.co.ir و شرکت تأمین سرمایه امید به نشانی www.omidib.com درج خواهد شد.	
نکات مهم	مبنای قیمت کنسانتره سنگ آهن در کل دوره عرضه اولیه بر اساس قیمت اعلامی در اطلاعیه عرضه اولیه خواهد بود و تغییری در قیمت‌ها لحاظ نخواهد شد. در مهلت عرضه اولیه و تا زمان بازگشایی نماد، امکان فروش یا بازخرید اوراق وجود ندارد و از آن تاریخ به بعد دارندگان اوراق می‌توانند نزد کارگزاران بورس و در بستر معاملاتی مدیریت فناوری بورس تهران بر اساس شرایط اعلامی در امیدنامه نسبت به فروش اوراق خود اقدام نمایند. در صورتی که تاریخ‌های اعلامی در امیدنامه جزء تعطیلات رسمی جمهوری اسلامی ایران باشد، روز کاری بعد از آن ملاک عمل خواهد بود.	

- با توجه به اینکه قیمت کنسانتره سنگ آهن در دوره عرضه اولیه بر اساس ۱۳ درصد آخرین قیمت معامله شمش بلم شرکت فولاد خوزستان در تابلوی معاملاتی بورس کالای ایران مشخص می‌گردد، اعداد این امیدنامه فرضی است و به منظور آشنایی سرمایه‌گذاران 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.