



بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راهاندازی قرارداد اختیار معامله شمش نقره تحویل خرداد ماه ۱۴۰۵

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار معامله شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵، از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۴/۱۲/۰۶ با مشخصات قرارداد پیوست، به شرح زیر با امکان استفاده از استراتژی کاوردکال راهاندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۴/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C450	۱۴۰۵/۰۳/۲۵
	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۵/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C500	
	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۵/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C550	
	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۶/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C600	
	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۶/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C650	
	قرارداد اختیار خرید شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۷/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05C700	
فروش	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۴/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P450	
	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۵/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P500	
	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۵/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P550	
	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۶/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P600	
	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۶/۵۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P650	
	قرارداد اختیار فروش شمش نقره سررسید خرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۷/۰۰۰/۰۰۰ ریال	SLKH05P700	

قراردادهای اختیار معامله بدون حد نوسان قیمتی، با دوره گشایش به مدت ۱۵ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و با دوره عادی معاملاتی ادامه می‌یابد.

منتشر کننده: مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی

تاریخ: ۱۴۰۴/۱۲/۰۳

شماره: ۱۴۰۴/۳۰۰/۴۱۰۱۴

پیوست: ندارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

مشخصات قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش نقره

۱	دارایی پایه	گواهی سپرده شمش نقره
۲	نماد کالا	SLMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می باشد) SLMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱ گواهی سپرده شمش نقره (معادل ۱ گرم)
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱۰۰۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه موقعیت‌های باز فروش برای هر نماد معاملاتی با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن تضمین طی زمان ثابت نبوده و به صورت پویا در حال تغییر خواهد بود. وجه تضمین اولیه در پایان هر روز معاملاتی بر اساس فرمول زیر تعدیل می‌شود: $\text{اولیه تضمین وجه مبلغ} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی گواهی سپرده شمش نقره $A \times$) و (قیمت اعمال $B \times$) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰،۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱ ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود: ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی گواهی سپرده شمش نقره $A \times$) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((قیمت اعمال $B \times$) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد نکته: در صورتی که قیمت پایانی در بندهای ۱ و ۲، کمتر از سود بودن قرارداد باشد، میزان در سود بودن قرارداد جایگزین قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله در فرمول فوق خواهد شد. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد. د) موقعیت باز فروش در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید گواهی سپرده شمش نقره پوشش داده شده باشد، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.
۶	سبک اعمال	اعمال می‌تواند صرفاً در آخرین روز معاملاتی صورت پذیرد (اختیار معامله اروپایی).
۷	روش تخصیص	اولویت زمانی
۸	حداقل تغییر قیمت	۱ ریال به ازای هر ۱ گرم (۱ ریال به ازای هر قرارداد)
۹	ماه‌های قرارداد	تمامی ماه‌های سال به تشخیص بورس
۱۰	دوره معاملاتی	دوره معاملاتی هر کدام از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.
۱۱	واحد پولی قیمت	ریال به ازای هر گرم
۱۲	مهلت ارائه درخواست اعمال	۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی
۱۳	مهلت تحویل و شرایط آن	مهلت تحویل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای اختیار معامله بوده و محل تحویل، اتاق پایاپای بورس یا محلی است که توسط بورس تعیین می‌گردد و سایر مهلت‌های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است: الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واریز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی. ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست‌های اعمال توسط بورس و انقراض به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی. ج) مهلت اطلاع نتیجه بررسی بند ب توسط کارگزار به مشتریان، تا قبل از شروع جلسه معاملاتی دارایی پایه در روز کاری بعد از آخرین جلسه معاملاتی. د) مهلت ایفای تعهدات برای خریداران موضوع ۲-۸ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.

تاریخ: ۱۴۰۴/۱۲/۰۳

شماره: ۱۴۰۴/۳۰۰/۴۱۰۱۴

پیوست: ندارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

۱۴	سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.																					
۱۵	خسارت‌ها	در صورتی که موقعیت‌های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تعهدات فروشنده، منجر به تسویه نقدی شود، فروشنده به میزان ۱ درصد ارزش فعلی معامله (حجم ضربدر قیمت پایانی گواهی سپرده شمش نقره) به نفع خریدار خسارت می‌پردازد. همچنین کارمزدهای اعمال مربوط به بورس هر دو طرف معامله از مشتری فروشنده دریافت خواهد شد. در صورت عدم ایفای شرایط اعمال توسط خریدار، قرارداد اختیار منقضی شده و خریدار و فروشنده موظف به پرداخت کارمزد بورس و کارگزار مربوط به خود می‌باشند.																					
۱۶	سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری توسط کارگزار	به اندازه ارزش اعمال مجموع قراردادهای اختیار معامله منتشر شده توسط هر مشتری دارنده موقعیت باز فروش																					
۱۷	نحوه درج نماد قرارداد اختیار معامله	الف) مطابق ماده ۸ دستورالعمل اجرایی قرارداد اختیار معامله در خصوص درج اولین نماد معاملاتی بی تفاوت، قیمت اعمال این نماد مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.																					
۱۸	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می‌گیرد.																					
۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۱:۴۵ الی ۱۸																					
۲۰	کارمزدهای معاملاتی	کارمزد معاملات: <table border="1" data-bbox="236 940 1045 1108"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۸</td> <td>ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۴</td> <td>ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۲</td> <td>ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل:</p> <table border="1" data-bbox="284 1176 997 1310"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴</td> <td>ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۱</td> <td>ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴</td> <td>ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده		کارگزار	۰/۰۰۰۸	ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۴	ارزش هر قرارداد	جمع	۰/۰۰۱۲	ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴	ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	بورس کالا	۰/۰۰۱	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	جمع	۰/۰۰۱۴	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																						
کارگزار	۰/۰۰۰۸	ارزش هر قرارداد																					
بورس کالا	۰/۰۰۰۴	ارزش هر قرارداد																					
جمع	۰/۰۰۱۲	ارزش هر قرارداد																					
کارگزار	۰/۰۰۰۴	ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																					
بورس کالا	۰/۰۰۱	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																					
جمع	۰/۰۰۱۴	ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																					
۲۱	نوع تسویه پس از اعمال	تحویل دارایی پایه																					
۲۲	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۱۰۰۰۰ قرارداد																					