



((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنا زاکرس تحویل بهمن ماه ۱۴۰۴

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنا زاکرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۴ در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۶ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

۱. تحویل از طریق واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنا زاکرس با نماد "صندوق س.پشتوانه سکه طلا دنا زاکرس (جواهر)" امکان پذیر می‌باشد.
۲. درخواست‌های اعمال ارائه شده خریداران و ایفای تعهدات فروشندگان در نمادهای در زیان وارد فرآیند تحویل نخواهند شد.
۳. مهلت ارائه درخواست اعمال تا ۱۵ دقیقه پس از پایان معاملات آخرین روز معاملاتی می‌باشد.
۴. 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 واحدهای صندوق دنا زاکرس و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:
 - در خصوص واحدهای صندوق طلای دنا زاکرس، 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنا زاکرس، 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.
۵. وجوه مورد نیاز برای ایفای تعهدات مشتریان فروشنده در قرارداد Put، که به منظور ایفای تعهدات خود موظف به واریز ارزش قرارداد (حاصل ضرب قیمت اعمال در اندازه قرارداد) هستند، **بدون در نظر گرفتن** وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت‌های باز ایشان در سررسید بهمن (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

تاریخ: ۱۴۰۴/۱۱/۰۸

شماره: ۱۴۰۴/۳۰/۳۷۷۲۸

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

ع. مرجع قیمت نقدی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنای زاگرس در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنای زاگرس در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می باشد.

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه 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.

منتشر کننده: مدیریت بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس که مشتری نزد شرکت بورس کالا معامله نموده و اکنون ملزم به تحویل یا دریافت آن براساس مشخصات ذیل می باشد.
- ۲- **بورس کالا:** شرکت بورس کالای ایران که معاملات قراردادهای اختیار معامله توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می پذیرد.
- ۳- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل دارایی پایه قرارداد اختیار می باشد.
- ۴- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۵- **واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۶- **اندازه هر قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس:** ۱۰ واحد سرمایه گذاری

فرآیند تحویل واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده (که مطابق با تعاریف فوق ملزم به تحویل دارایی پایه هستند) موظفند حداکثر تا پایان آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دناي زاگرس در کد سهامداری خود نمایند.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

بدیهی است باتوجه به اندازه قرارداد، مشتریان فروشنده، به ازای هر موقعیت تعهدی باز خود در قرارداد اختیار معامله می بایست ۱۰ واحد سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس را تأمین نمایند.

توجه

۱- اگر مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید دارای واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس در کد سهامداری خود باشد و مشتری دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش علاوه بر ارائه درخواست اعمال، دارای واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس در کد سهامداری خود باشد بورس متناسب با موقعیت های باز این مشتریان در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری ایشان می نماید. لازم به ذکر است، عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید (متعهد به تحویل دارایی پایه می باشد)، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.

۲- در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط مشتری خریدار، واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس صادر شده به نام مشتری فروشنده باقی خواهد ماند و وی می تواند اقدام به فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس در بازار صندوق های سرمایه گذاری کالایی پس از اتمام فرآیند تحویل نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می بایست حداکثر تا ۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین روز معاملاتی اقدام به تأمین وجه ارزش اعمال قرارداد در دفتر بازار اختیار معامله خود نماید و درخواست اعمال را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد. **انتقال مالکیت واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس از مشتری فروشنده به مشتری خریدار:**

فرآیند انتقال دارایی پایه از مشتری فروشنده به مشتری خریدار به صورت انتقال مالکیت واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنا ز اگرس، از کد سهامداری مشتری فروشنده به کد سهامداری مشتری خریدار متناسب با موقعیت های قابل تحویل انجام می شود.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

سایر اطلاعات:

نماد معاملاتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنای زاگرس: صندوق س.پشتوانه طلا دنای زاگرس (جواهر)

نکات مهم:

- ۱- معاملات واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنای زاگرس طی روزهای معاملاتی در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری بورس تهران انجام می گیرد، لذا مشتریان می توانند در هر روز معاملاتی نسبت به خرید واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری طلای دنای زاگرس در این بازار و نگهداری آن تا پایان فرآیند تحویل روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۴/۱۱/۲۶ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- انجام معاملات واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنای زاگرس فقط با کد سهامداری امکان پذیر می باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی به عهده مشتری و کارگزاری می باشد.
- ۳- 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.
- ۴- 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.
- ۵- مبنای محاسبه قیمت نقدی در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق پشتوانه طلای دنای زاگرس، قیمت پایانی نماد "صندوق س.پشتوانه طلا دنای زاگرس" در آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خواهد بود.
- ۶- هر گونه مانع جهت انتقال دارایی در کد سهامداری مشتریان، به منزله عدم ایفای تعهدات می باشد.
- ۷- باتوجه به وجود مهلت مجدد در فرآیند تحویل (مطابق مشخصات قرارداد) و لزوم مسدودسازی دارایی در کد سهامداری مشتریان فروشنده می بایست کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه در بورس کالا یکسان باشند (امکان تغییر کارگزار ناظر وجود ندارد و مغایرت کارگزار ناظر دارایی پایه و کارگزار معاملات مشتقه به منزله عدم ایفای تعهدات مشتری می باشد). همچنین باتوجه به فرآیند دو روزه تحویل، حفظ دارایی تا اتمام فرآیند تحویل جهت ایفای تعهدات الزامی است.