

شماره: ۳۰/۰۴۶۷۹

تاریخ: ۱۳۹۸/۰۷/۱۶

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

((اطلاعیه))

موضوع: راه اندازی قرارداد آتی پسته تحویل آذر ماه ۱۳۹۸

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

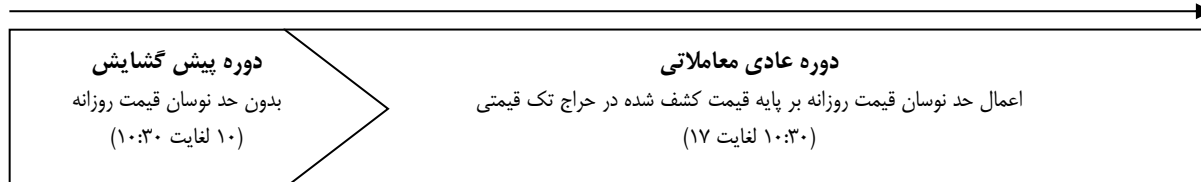
تاریخ انتشار: ۱۳۹۸/۰۷/۱۶

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قرارداد آتی پسته تحویل آذر ماه ۱۳۹۸ از روز یکشنبه مورخ ۱۳۹۸/۰۷/۲۱ راه اندازی شده و تا تاریخ ۱۳۹۸/۰۹/۳۰ قابل معامله خواهد بود.

قراردادهای آتی در اولین روز معاملاتی، بدون حد نوسان قیمتی، با دوره پیش گشایش به مدت ۳۰ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و پس از انجام حراج تک قیمتی راس ساعت ۱۰:۳۰ با دوره عادی معاملاتی و اعمال حد نوسان قیمت روزانه ادامه می‌یابد. قیمت پایه قرارداد آتی، همان قیمت کشف شده در حراج تک قیمتی خواهد بود، که مبنای حد نوسان قیمت روزانه برای ادامه معاملات در حراج پیوسته قرار خواهد گرفت. بدیهی است در صورت عدم انجام معامله در حراج تک قیمتی، قرارداد آتی متوقف و مجدداً همین فرآیند، روز کاری بعد تکرار خواهد شد.

محور زمان



منتشر کننده: مدیریت توسعه بازار مشتقه

مشخصات قرارداد آتی پسته

دارایی پایه

پسته با مشخصات کیفی جدول زیر

پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۳۲)		
ردیف	ویژگی‌ها	معیار پذیرش
۱	ناخندان و پوک (حداکثر درصد وزنی)	۳
۲	پوک (حداکثر درصد وزنی)	۰/۵
۳	گوی (حداکثر درصد وزنی)	۰/۳
۴	بد رنگ (حداکثر درصد وزنی)	۲
۵	بد شکل و ته خندان (حداکثر درصد وزنی)	۳
۶	کم خندان (حداکثر درصد وزنی)	۱۰
۷	مغز پسته آزاد (حداکثر درصد وزنی)	۲
۸	آفت زدگی آشکار (حداکثر درصد وزنی)	۰/۵
۹	مواد خارجی (حداکثر درصد وزنی)	۰/۲
۱۰	مواد خارجی غیر از پوست (حداکثر درصد وزنی)	۰/۱
۱۱	مخلوط رقم (حداکثر درصد وزنی)	۳
۱۲	مخلوط اندازه (حداکثر درصد وزنی)	۱/۵
۱۳	رطوبت (حداکثر درصد وزنی)	۵
۱۴	عیار (حداقل درصد وزنی)	۵۵
۱۵	تعداد دانه در ۲۸۳/۵ گرم (۱۰ انس)	بیش از ۳۰۰ و کمتر یا برابر ۳۲۰
۱۶	بو و مزه غیر طبیعی	عاری باشد
۱۷	آفات زنده	عاری باشد
۱۸	نمونه برداری : بر اساس استاندارد ملی شماره ۱۰۳۶ و ۱۳۵۳۴	
۱۹	روش آزمون : بر اساس استاندارد ملی شماره های ۵۹۲۵-۴۹۲۰-۲۶۳۴-۱۵	

لازم به ذکر است استاندارد فوق با اقتباس از استاندارد شماره ۱۵ استاندارد ملی ایران بوده و با مشخصات کیفی گواهی سپرده پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۳۲) بورس کالای ایران مطابقت دارد.

قرارداد آتی پسته

قرارداد آتی پذیرش شده

۱۰۰ کیلوگرم

اندازه قرارداد

استاندارد تحویل

مبنای تحویل بر اساس مشخصات کیفی دارایی پایه مطابق با بند ۱ است. پس از تاریخ اعلامی بورس، علاوه بر استاندارد بند ۱ دارندگان موقعیت تعهدی فروش می توانند پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۲۸) را نیز بر اساس مشخصات کیفی جدول بند ۱ مشخصات قرارداد (و تنها با تفاوت در مورد ۱۵ جدول که در آن تعداد دانه در ۱۰ انس بیش از ۲۸۰ و کمتر یا برابر ۳۰۰ باشد) تحویل دهد؛ میزان صرف و یا کسر قیمتی به ازای هر کیلوگرم نسبت به آخرین قیمت تسویه روزانه به صورت زیر محاسبه خواهد شد:

$$(P_1 - P_2) = \text{میزان صرف و یا کسر به ازای هر کیلوگرم}$$

P_1 میانگین موزون قیمت های پایانی گواهی سپرده پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۲۸) در تمامی نمادهای معاملاتی مربوطه در سه روز کاری منتهی به آخرین روز معاملاتی قرارداد آتی

P_2 میانگین موزون قیمت های پایانی گواهی سپرده پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۳۲) در تمامی نمادهای معاملاتی مربوطه در سه روز کاری منتهی به آخرین روز معاملاتی قرارداد آتی

دارندگان موقعیت تعهدی خریدی که در فرایند تحویل طرف مقابل آنها اقدام به تحویل پسته طبیعی خشک خندان فندق (۳۰-۲۸) نموده است، در صورتی که طبق فرمول فوق موظف به واریز صرف قیمتی باشند، در صورت کمبود موجودی، تا پایان روز کاری بعد کارگزار وی فرصت دارد از محل فروش دارایی گواهی سپرده پسته تخصیص داده شده به ایشان تعهدات وی را ایفا نماید.

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	محل تحویل: انبارهای مد نظر بورس ۱۰ روز قبل از پایان دوره معاملاتی هر نماد توسط بورس اعلام خواهد شد. دوره تحویل: مطابق تاریخ اعلام شده در اطلاعیه تحویل																
۹	حداقل تغییر قیمت سفارش	۱۰۰۰ ریال برای هر کیلوگرم معادل ۱۰۰،۰۰۰ ریال در هر قرارداد																
۱۰	نحوه محاسبه تضامین	الف) وجه تضمین اولیه: 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 قیمت‌های 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 میشود و پس از دو روز کاری اعمال می گردد، مراتب تغییرات از طریق سامانه معاملاتی ابزار مشتقه اطلاع رسانی می گردد: $A \times \left(\left[\frac{B \times S}{C \times 10} \right] + 1 \right) \times C \times 10 = \text{مبلغ وجه تضمین اولیه}$ A: درصد وجه تضمین اولیه؛ معادل ۱۰٪ B: میانگین قیمت‌های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی دارایی پایه C: براکت تغییرات وجه تضمین؛ معادل یک میلیون ریال S: اندازه قرارداد؛ معادل ۱۰۰ ب) حداقل وجه تضمین: ۷۰ درصد وجه تضمین اولیه																
۱۱	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۲۵ قرارداد																
۱۲	واحد قیمت	ریال به ازای هر کیلوگرم																
۱۳	کارمزدها	کارمزد معاملات: <table><tr><td>کارمزد خریدار</td><td>کارمزد فروشنده</td></tr><tr><td>کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td><td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td></tr><tr><td>بورس کالا -</td><td>-</td></tr><tr><td>حق نظارت سازمان -</td><td>-</td></tr><tr><td>جمع ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td><td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td></tr></table> کارمزد تسویه و تحویل: <table><tr><td>کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td><td>کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td></tr><tr><td>بورس کالا ۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td><td>بورس کالا ۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td></tr><tr><td>جمع ۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td><td>جمع 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 -	-	حق نظارت سازمان -	-	جمع ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	بورس کالا ۰/۰۰۱ 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	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 -	-																	
حق نظارت سازمان -	-																	
جمع ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																	
کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	کارگزار ۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																	
بورس کالا ۰/۰۰۱ 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	جمع ۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																	
۱۴	نماد معاملاتی	PSMYY (MM نماد اختصاری ماه قرارداد و YY سال می‌باشد).																
۱۵	ساعات معامله	شنبه تا چهارشنبه: ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۶ در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵:۳۰																
۱۶	مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل	تا ۱۵ دقیقه پس از اتمام جلسه معاملاتی آخرین روز معاملاتی																
۱۷	سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز و معاملات	سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز: • اشخاص حقیقی و حقوقی: ۲۵۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی. • بازارگردان: ۵۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی و قابل افزایش تا ۲۰ درصد موقعیت‌های تعهدی باز در آن نماد در بازار.																
۱۸	جریمه ها	الف) جریمه نکول قراردادهای، شامل جریمه عدم ارائه گواهی آمادگی تحویل مشتریان خریدار و فروشنده، جریمه عدم ارائه رسید انبار 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 می‌گردد.																

		ب) در خصوص کلیه جرائم 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	نحوه محاسبه قیمت تسویه لحظه ای	قیمت تسویه لحظه ای بر اساس میانگین قیمت ۳۰٪ پایانی حجم معاملات منتهی به هر لحظه محاسبه خواهد شد.

