



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

بسمه تعالی

شماره: ۳۰/۰۴۲۲۲

تاریخ: ۱۳۹۸/۰۲/۱۶

پیوست: دارد

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۱۳۹۸

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

تاریخ انتشار: ۱۳۹۸/۰۲/۱۶

متن اطلاعیه:

بدینوسیله به اطلاع مشتریان و کارگزاران معاملات قراردادهای اختیار معامله می‌رساند فرآیند تحویل در قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید اردیبهشت ماه ۹۸ در روز سه‌شنبه مورخ ۲۴ اردیبهشت ماه با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد؛

۱. تحویل از طریق گواهی سپرده زعفران نگین، در نمادهای زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا (پ)(زعف ۹۸۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۵) امکان‌پذیر است.

۲. درخواست‌های اعمال ارائه شده خریداران و ایفای تعهدات فروشندگان در نمادهای در زیان وارد فرآیند تحویل نخواهند شد.

۳. 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 گواهی‌های سپرده و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:

تهران- خیابان طالقانی
بعد از تقاطع ولی‌عصر (عج)
نبش خیابان بندرانزلی
شماره ۳۵۱
تلفن ۰۲۱-۸۵۶۴۰۰۰۰
دورنگار: ۸۸۳۸۳۰۰۰
WWW.IME.CO.IR
info@ime.co.ir



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

بسمه تعالی

شماره: ۳۰/۰۴۲۲۲

تاریخ: ۱۳۹۸/۰۲/۱۶

پیوست: دارد

- در خصوص گواهی‌های سپرده، 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 گواهی‌های سپرده 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.

۴. وجوه مورد نیاز برای ایفای تعهدات مشتریان فروشنده در قرارداد Put، که به منظور ایفای تعهدات خود موظف به واریز ارزش قرارداد هستند، بدون در نظر گرفتن وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت‌های باز ایشان در سررسید اردیبهشت ماه (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

۵. مرجع قیمت نقدی زعفران نگین در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، میانگین وزنی قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده زعفران (زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۵) در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی قرارداد اختیار معامله زعفران نگین سررسید اردیبهشت 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.

منتشرکننده: مدیریت توسعه بازار مشتقه

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



((فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله زعفران نگین 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- **انبار:** انبار پذیرش شده بورس کالای ایران که مسئولیت دریافت زعفران نگین و صدور قبض انبار موقت به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده زعفران نگین برای مشتریان که در قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین بورس کالا معامله نموده اند را بر عهده دارد. که در اینجا انبار "تعاونی روستایی خراسان رضوی" و "شرکت زرین زعفران مشرق زمین" می باشد.
- ۴- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل زعفران نگین می باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید زعفران نگین یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش زعفران نگین که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **زعفران:** دارایی پایه قرارداد اختیار معامله
- ۷- **اندازه هر قرارداد اختیار زعفران نگین:** ۱۰۰ گرم زعفران نگین
- ۸- **گواهی سپرده کالایی:** اوراق بهاداری است که موید مالکیت دارنده آن بر مقدار معینی کالای سپرده شده در انبار است و پشتوانه آن قبض انباری است که توسط انباردار صادر می گردد.

شماره:
تاریخ:
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

فرایند تحویل زعفران نگین توسط مشتریان فروشنده:

کلیه مشتریان فروشنده موظفند حداکثر تا سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد اختیار معامله برای تبدیل زعفران نگین به گواهی سپرده به انبار "تعاونی روستایی خراسان رضوی" و "شرکت زرین زعفران مشرق زمین" مراجعه نمایند. علاوه بر این مشتریان فروشنده می توانند حداکثر تا ساعت ۱۵:۳۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده زعفران نگین در معاملات روزانه گواهی سپرده زعفران نگین در نماد/نمادهای زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا (پ)، (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۵) نمایند.

تحویل و کارشناسی زعفران نگین:

صرف تحویل زعفران نگین به انبار مذکور، به منزله ایفا کردن تعهدات فروشنده نمی باشد بلکه تعداد گواهی های سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری مشتری ملاک انجام تعهدات مشتری فروشنده است.

هزینه های انبارداری و ارزیابی:

هزینه های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه های موجود در معاملات گواهی سپرده زعفران نگین می باشد.

دریافت زعفران نگین و تحویل رسید به مشتری:

انبار پس از کارشناسی و دریافت کامل زعفران نگین اقدام به صدور رسید به مشتری فروشنده می نماید. توجه: در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط خریدار، گواهی های صادر شده به نام فروشنده باقی مانده و فروشنده می تواند اقدام به فروش گواهی در بازار گواهی سپرده زعفران نگین یا ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت زعفران نگین نماید.



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:
تاریخ:
پیوست:

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ساعت ۱۶:۰۰ آخرین روز معاملاتی اقدام به تامین وجه ارزش اعمال قرارداد در حساب عملیاتی خود نماید و درخواست اعمال را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد.

انتقال مالکیت گواهی از فروشنده به خریدار:

مدیریت فناوری بورس تهران اقدام به ارسال هزینه انبارداری مشتریان به بورس کالا می‌نماید و پس از برداشت هزینه انبارداری از حساب مشتریان فروشنده، بورس اقدام به واریز به حساب عملیاتی انبار می‌نماید. در نهایت فرایند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، به صورت ترخیص گواهی سپرده زعفران نگین از کد سهامداری فروشنده و انتقال به کد سهامداری خریدار انجام می‌شود.

سایر اطلاعات:

- ۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی زعفران نگین: زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۸)، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ ۰۵)
- ۲- نشانی انبار پذیرش شده: ۱. خراسان رضوی، تربت حیدریه، خیابان فردوسی شمالی، فردوسی ۳۱، ساختمان امید، پلاک ۷، انبار شرکت زرین زعفران مشرق زمین ۲. خراسان رضوی، مشهد، بلوار شهید صادقی، جنب روزنامه خراسان



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:
تاریخ:
پیوست:

نکات مهم:

- ۱- تحویل زعفران نگین به انبار جهت تبدیل شدن به گواهی سپرده، حداکثر تا سه روز کاری قبل از سررسید امکان پذیر می باشد.
- ۲- معاملات گواهی سپرده کالایی زعفران نگین در روزهای شنبه تا چهارشنبه هر هفته از ساعت ۸:۳۰ الی ۱۵:۳۰ و در بستر معاملاتی شرکت مدیریت فناوری انجام می گیرد، لذا مشتریان می توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری ۹۸/۰۲/۲۴ جهت ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۳- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده زعفران نگین در کد سهامداری خود باشد و، در صورت نیاز، درخواست اعمال خود را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد، بورس به تعداد موقعیت های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از کد سهامداری وی می نماید. همچنین عدم تکافوی دارایی در کد سهامداری، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- ۴- مبنای محاسبه قیمت نقدی زعفران نگین در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله زعفران نگین میانگین وزنی قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده زعفران (زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا (پ)(زعف ۹۸۰۸ پ۰۸)، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ۰۵)) در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله خواهد بود.
- ۵- هر گواهی سپرده کالایی زعفران نگین در کد سهامداری شامل یک گرم زعفران نگین می باشد.
- ۶- انجام معاملات گواهی سپرده کالایی فقط با کد سهامداری امکان پذیر می باشد. همچنین استعلام وضعیت کد سهامداری مشتری در رفع هر گونه محدودیت و مانع جهت انتقال دارایی از این کد به عهده مشتری می باشد.
- ۷- جهت تحویل زعفران نگین به انبار توسط مشتری، نیازی به حضور نماینده کارگزار نمی باشد.



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

شماره:

تاریخ:

پیوست:

۸- 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.

۹- 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.

۱۰- انجام تحویل با استفاده از گواهی سپرده فقط در نمادهای زعفران ۹۸۰۸ نگین ت.روستا (پ)(زعف) ۹۸۰۸ پ۰۸، زعفران ۹۸۰۸ نگین زرین (پ) (زعف ۹۸۰۸ پ۰۵) امکان پذیر می باشد. در صورت تکمیل ظرفیت انبار جهت تحویل قراردادهای اختیار معامله با توجه به موقعیت های باز نمادهای در سود قراردادهای اختیار معامله، سه روز کاری قبل از سررسید قرارداد، تحویل زعفران نگین به صورت فیزیکی به انبار مذکور و انجام فرایند تحویل خارج از سازوکار گواهی سپرده زعفران نگین امکان پذیر خواهد بود. در این صورت تخصیص دارایی به خریداران در قالب گواهی سپرده یا تحویل فیزیکی بر اساسی اولویت زمانی أخذ موقعیت خرید صورت خواهد گرفت. همچنین شرایط در صورت تحویل فیزیکی زعفران نگین توسط فروشنده به انبار و مواعد آن تابع مفاد این اطلاعیه خواهد بود.

۱۱- پس از اتمام فرایند تحویل قرارداد اختیار معامله، مطابق مقررات و رویه حاکم بر معاملات گواهی سپرده، دارنده گواهی سپرده کالایی تعهد می نماید پیش از انقضای اعتبار گواهی سپرده کالایی تحویل گرفته شده، نسبت به تحویل گرفتن زعفران نگین از انبار و یا فروش گواهی سپرده در بازار اقدام نماید. در صورتی که به هر دلیل دارنده گواهی پس از انقضای اعتبار گواهی سپرده و مهلت تعیین شده توسط بورس جهت تحویل کالا مراجعه ننماید، انباردار خروج نهایی کالا را ثبت نموده و بورس، شرکت سپرده گذاری مرکزی و انبار پذیرش شده بورس هیچ گونه مسئولیتی در خصوص کمیت و کیفیت کالای موجود در انبار ندارند. در صورت عدم مراجعه دارنده گواهی سپرده کالایی،

شماره:
تاریخ:
پیوست:



شرکت بورس کالای ایران
(سهامی عام)

چنانچه انباردار شرایطی جهت نگهداری کالا پس از ثبت خروج کالا از انبار پذیرش شده بورس اعلام نماید، عدم مراجعه در حکم موافقت دارنده گواهی با شرایط اعلامی می باشد.

۱۲- در صورت وجود بیش از یک نماد معاملاتی گواهی سپرده زعفران نگین برای تحویل قراردادهای اختیار در صورتی که فروشنده در بیش از یک نماد دارایی داشته باشد، برداشت دارایی برای ایفای تعهدات وی از نقدشونده ترین نماد گواهی سپرده کالایی زعفران نگین صورت خواهد گرفت و تخصیص دارایی از انبارها به خریداران به صورت تصادفی انجام خواهد شد.