



## بسمه تعالی

## ((اطلاعیه))

موضوع: راهاندازی قرارداد اختیار معامله مس کاتد سررسید مرداد ۱۴۰۵

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

### متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار معامله مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵، از روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۴/۲۳ 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 مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C180 | ۱۴۰۵/۰۵/۱۹   |
|            | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۱۹/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C190 |              |
|            | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۰/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C200 |              |
|            | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۱/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C210 |              |
|            | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۲/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C220 |              |
|            | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۳/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C230 |              |
| فروش       | قرارداد اختیار خرید مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۴/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05C240 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P180 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۱۹/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P190 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۰/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P200 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۱/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P210 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۲/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P220 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۳/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P230 |              |
|            | قرارداد اختیار فروش مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ با قیمت اعمال ۲۴/۰۰۰/۰۰۰ ریال | CUMO05P240 |              |

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

## مشخصات قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد

|    |                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----|---------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| ۱  | دارایی پایه                                 | گواهی سپرده مس کاتد                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| ۲  | نماد کالا                                   | CUMYYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می باشد)<br>CUMYYYPK (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 مس کاتد (معادل ۱ کیلوگرم)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| ۴  | فاصله قیمت اعمال                            | مضربی از ۱۰۰,۰۰۰ ریال                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| ۵  | وجه تضمین                                   | <p>(الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه موقعیت های 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 می شود:</p> $\text{مبلغ وجه تضمین اولیه} = \left( \left[ \frac{IM \times S}{C} \right] + 1 \right) \times C$ <p>IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی گواهی سپرده مس کاتد A) و (قیمت اعمال B) هر کدام که بزرگتر بود.<br/>A: ۲۰٪ B: ۱۰٪ C: ۱۰۰ ریال S: اندازه قرارداد: ۱</p> <p>(ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می شود:</p> <p>۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی گواهی سپرده مس کاتد A) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>۲- ((قیمت اعمال B) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد</p> <p>نکته: در صورتی که قیمت پایانی در بندهای ۱ و ۲، کمتر از میزان در سود بودن قرارداد باشد، میزان در سود بودن قرارداد جایگزین قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله در فرمول فوق خواهد شد.</p> <p>(ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می باشد.</p> <p>(د) موقعیت باز فروش در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید گواهی سپرده مس کاتد پوشش داده شده باشد، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.</p> |
| ۶  | سبک اعمال                                   | اعمال می تواند 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 کیلوگرم (۱ ریال به ازای هر قرارداد)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| ۹  | ماه های قرارداد                             | تمامی ماه های سال به تشخیص بورس                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| ۱۰ | دوره معاملاتی                               | دوره معاملاتی هر کدام از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| ۱۱ | واحد پولی قیمت                              | ۱ ریال به ازای هر ۱ کیلوگرم                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| ۱۲ | مهلت ارائه درخواست اعمال                    | ۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| ۱۳ | مهلت تحویل و شرایط آن                       | <p>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 می گردد و سایر مهلت های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است:</p> <p>(الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واریز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی.</p> <p>(ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست های اعمال توسط بورس و اطلاع به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی.</p> <p>(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.</p> <p>(د) مهلت ایفای تعهدات برای خریداران موضوع ۲-۸ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| ۱۴ | سقف مجاز موقعیت های باز و هم جهت            | سقف موقعیت های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| ۱۵ | خسارت ها                                    | در صورتی که موقعیت های 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 مس کاتد) به نفع خریدار خسارت می پردازد. 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 می باشند.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 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         | <p>(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. قیمت های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود.</p> <p>(ب) بورس می تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|    |                         |                                                                                  |
|----|-------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| ۱۸ | نحوه اعمال              | اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می گیرد. |
| ۱۹ | ساعات و روزهای معاملاتی | مطابق مصوبه هیئت مدیره شرکت بورس کالای ایران                                     |
| ۲۰ | کارمزدهای معاملاتی      | مطابق مصوبه هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار                                |
| ۲۱ | نوع تسویه پس از اعمال   | تحویل دارایی پایه                                                                |
| ۲۲ | حداکثر حجم هر سفارش     | حداکثر تا ۵۰۰ قرارداد                                                            |

