

تاریخ: ۱۴۰۵/۰۵/۱۰

شماره: ۱۴۰۵/۳۰۰/۱۷۹۸۳

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵

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 مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۵/۱۹ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

- ۱- تحویل از طریق گواهی سپرده مس کاتد با نماد "CopperCthd" امکان‌پذیر 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 اتمام بازار در روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۵/۱۹ 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 گواهی‌های سپرده و وجوه واریزی مشتریان به شرح زیر انجام خواهد شد:

- 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 (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 (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 هستند، بدون در نظر گرفتن وجوه تضمین لازم بلوکه شده موقعیت‌های باز ایشان در سررسید مرداد (و سایر سررسیدها) می‌باشد.

تاریخ: ۱۴۰۵/۰۵/۱۰

شماره: ۱۴۰۵/۳۰۰/۱۷۹۸۳

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

۶- مرجع قیمت نقدی گواهی سپرده مس کاتد در آخرین روز معاملاتی جهت تسویه نقدی و محاسبه جرائم نکول، قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده نماد "CopperCthd" در آخرین روز معاملاتی قرارداد اختیار معامله می‌باشد.

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ 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 پایاپای بازار مشتقه و ابزارهای نوین مالی



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

((فرآیند تحویل قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد که مشتری نزد شرکت بورس کالا معامله نموده و اکنون ملزم به تحویل یا دریافت آن براساس مشخصات ذیل می‌باشد.
- ۲- **بورس کالا:** شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام) که معاملات قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می‌پذیرد.
- ۳- **انبار:** انبارهای پذیرش شده بورس کالای ایران که مسئولیت دریافت کالا و صدور قبض انبار به منظور تبدیل شدن به گواهی سپرده را بر عهده دارد.
- ۴- **مشتری فروشنده:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی فروش در قرارداد اختیار معامله خرید گواهی سپرده مس کاتد یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده مس کاتد که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل گواهی سپرده مس کاتد می‌باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید گواهی سپرده مس کاتد یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده مس کاتد که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **اندازه هر قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد:** یک گواهی سپرده مس کاتد
- ۷- **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 می‌گردد.

فرایند تحویل مس کاتد توسط مشتریان فروشنده:

- متقاضیان مورد تایید بورس، به منظور سپرده گذاری مس کاتد می بایست با ارائه صورت حساب تایید شده در سامانه جامع تجارت تا سه روز کاری قبل از سررسید **صرفاً به انبار «شرکت دنیای مس کاشان»** مراجعه کنند. حداقل تحویل مس کاتد به انبار مطابق با اطلاعیه گشایش انبار مس کاتد شرکت دنیای مس کاشان، ۲۱ تن بوده و جدول ضرایب تبدیل یک کیلوگرم مس کاتد به گواهی سپرده کالایی در این انبار بر اساس تولید شرکت های مختلف به شرح جدول ذیل می باشد.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

جدول ضرایب تبدیل یک کیلوگرم مس کاتد به گواهی سپرده کالایی در انبار شرکت دنیای مس کاشان

ضریب تبدیل	کالا
۰.۹۹	کاتد لیچینگ تولید شرکت ملی مس ایران
۰.۹۹	کاتد لیچینگ تولید شرکت بابک مس ایرانیان
۰.۹۹	کاتد لیچینگ تولید شرکت کویر مس مشرق زمین
۰.۹۹	کاتد لیچینگ تولید شرکت نوید فرآیند البرز

شایان ذکر است متقاضیان تنها امکان تحویل کاتد لیچینگ را دارند و به هیچ عنوان امکان تحویل کاتد الکترولیت وجود ندارد.

- سایر مشتریان فروشنده جهت ایفای تعهدات خود در معاملات قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد می‌بایست، حداکثر تا پایان ساعت معاملات آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده مس کاتد در معاملات روزانه گواهی سپرده مس کاتد در نماد "CopperCthd" نموده و گواهی آمادگی تحویل را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشند.
- هزینه‌های ارزیابی، نمونه برداری، تحویل و انبارداری مطابق رویه‌های موجود در معاملات گواهی سپرده مس کاتد می‌باشد.
- تراکنش‌های مالی مربوط به تسویه هزینه انبارداری از طریق اعتبار ریالی در دفاتر دارایی مشتریان (مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده مس کاتد) نزد بورس کالای ایران صورت می‌گیرد. لذا کلیه مشتریان فروشنده می‌بایست مبلغ هزینه انبارداری را که پس از انجام فرآیند تحویل مشخص می‌گردد، تا یک ساعت قبل از پایان روز معاملاتی بعد از سررسید قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد در دفاتر دارایی انبار خود شارژ نمایند. در صورت عدم تامین هزینه انبارداری طی مهلت مذکور، کارگزار مربوطه موظف به تامین وجه مذکور حداکثر تا پایان روز معاملاتی پس از سررسید قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد در دفاتر دارایی مشتریان فروشنده در قرارداد اختیار معامله خواهد بود.
- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده مس کاتد در سبد دارایی خود باشد و در صورت نیاز، درخواست اعمال خود را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد، بورس به تعداد موقعیت‌های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از سبد دارایی وی می‌نماید. همچنین عدم تکافوی گواهی سپرده مس کاتد در سبد دارایی مشتری فروشنده، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

توجه: در صورت عدم واریز وجه قرارداد توسط خریدار، گواهی‌های صادر شده به نام فروشنده باقی مانده و فروشنده می‌تواند اقدام به فروش گواهی در بازار گواهی سپرده مس کاتد یا در صورت احراز شرایط تحویل، اقدام به ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت مس کاتد نماید.

فرآیند تحویل خریداران:

مشتری خریدار می‌بایست حداکثر تا ۱۵ دقیقه پس از پایان جلسه معاملاتی آخرین روز معاملاتی اقدام به تامین وجه ارزش اعمال قرارداد در دفتر اختیار معامله خود نماید و درخواست اعمال را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشد.

انتقال مالکیت گواهی از فروشنده به خریدار:

- جهت انتقال مالکیت گواهی سپرده مس کاتد از فروشنده به خریدار می‌بایست دفتر دارایی برای کلیه اشخاص ذی‌نفع معامله ایجاد شود. لذا کلیه مشتریان خریدار موظفند نسبت به به‌روزرسانی اطلاعات خود در سامانه جدید مشتریان اقدام نمایند. عدم به‌روزرسانی اطلاعات در سامانه جدید مشتریان که منجر به عدم ایجاد دفتر دارایی برای خریداران می‌شود، نکول از طرف خریدار محسوب شده و مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات قرارداد خواهد شد.
- در نهایت فرایند تحویل به صورت انتقال مالکیت گواهی سپرده، از فروشنده به خریدار انجام می‌شود. لازم به ذکر است در رابطه با تحویل دارایی از انبار، هزینه‌های مربوط به مالیات بر ارزش افزوده، هزینه‌های بارگیری و حمل و ... مطابق با رویه‌های موجود در معاملات گواهی سپرده مس کاتد می‌باشد.

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی مس کاتد: CopperCthd

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- متقاضیان می‌توانند جهت دریافت آخرین اطلاعات انبارهای پذیرش شده به سایت بورس کالا به نشانی <https://www.ime.co.ir> مراجعه کرده و از قسمت «انبارها - فهرست انبارهای پذیرش شده - لیست انبارها» اطلاعات مورد نیاز را دریافت کنند.



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

نکات مهم:

- ۱- معاملات گواهی سپرده کالایی مس کاتد طی روزهای معاملاتی هر هفته از طریق سامانه معاملات ابزارهای نوین بورس کالای ایران (سما) انجام می گیرد، لذا مشتریان می توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده مس کاتد در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری آخرین روز معاملاتی ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- مبنای محاسبه قیمت نقدی مس کاتد در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده مس کاتد قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده مس کاتد، در آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خواهد بود.
- ۳- هر گواهی سپرده کالایی معادل ۱ کیلوگرم مس کاتد الکترولیت با عیار ۹۹/۹۹۴ می باشد.
- ۴- اطلاعات مربوط به انبارداری و تحویل دارایی از انبار مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده مس کاتد می باشد.