

تاریخ: ۱۴۰۵/۰۵/۱۰

شماره: ۱۴۰۵/۳۰۰/۱۷۹۸۲

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: فرآیند تحویل قراردادهای اختیار معامله شمش طلا 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 شمش طلا سررسید مرداد ماه ۱۴۰۵ روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۵/۲۷ با در نظر گرفتن شرایط زیر انجام خواهد شد:

- ۱- تحویل از طریق گواهی سپرده شمش طلا با نماد "GoldBar" 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 سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۵/۲۷ 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 (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 (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: ۱۴۰۵/۳۰۰/۱۷۹۸۲

پیوست: دارد



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

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

شایان ذکر است فرآیند تحویل فیزیکی اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا 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 شمش طلا))

تعاریف:

- ۱- **قرارداد:** قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا 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 شمش طلا توسط خریداران و فروشندگان در آنجا صورت می‌پذیرد.
- ۳- **انبار:** انبار 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 شمش طلا یا دارنده موقعیت خرید در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده شمش طلا که در انتهای دوره معاملات وارد فرآیند تحویل شده و جهت ایفای تعهد خود ملزم به تحویل گواهی سپرده شمش طلا می‌باشد.
- ۵- **مشتری خریدار:** مشتری دارنده موقعیت تعهدی خرید در قرارداد اختیار معامله خرید گواهی سپرده شمش طلا یا دارنده موقعیت فروش در قرارداد اختیار معامله فروش گواهی سپرده شمش طلا که در انتهای دوره معاملات جهت ایفای تعهدات ملزم به واریز وجه قرارداد است.
- ۶- **اندازه هر قرارداد اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا:** یک گواهی سپرده شمش طلا (معادل ۱۰۰ سوت)
- 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.

فرآیند تحویل شمش طلا توسط مشتریان فروشنده:

- در حال حاضر امکان تحویل کالا به انبار صرفاً توسط تولیدکننده یا واردکننده مورد تایید بورس کالا وجود دارد؛ در رابطه با سایر متقاضیان بازار گواهی سپرده کالایی بورس کالای ایران در صورت ارائه مدارک و مستندات زیر و پس از طرح و تایید درخواست در کمیته مربوطه بورس، امکان تحویل شمش به خزانه بورس کالای ایران وجود دارد:



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}

- مستندات مربوط به ثبت اطلاعات شمش در سامانه جامع تجارت؛
- صورت حساب خرید.

شایان ذکر است که حداقل تعداد شمش قابل سپردن به خزانه بورس کالای ایران توسط متقاضیان در هر محموله ۵ قطعه می باشد.

- سایر مشتریان فروشنده جهت ایفای تعهدات خود در معاملات قراردادهای آتی شمش طلای خام می بایست، حداکثر تا پایان ساعت معاملات آخرین روز معاملاتی اقدام به خرید گواهی سپرده شمش طلا در معاملات روزانه گواهی سپرده شمش طلا در نماد "GoldBar" نموده و گواهی آمادگی تحویل را مطابق مهلت تعیین شده در مشخصات قرارداد ارائه نموده باشند.
- هزینه های ارزیابی، نمونه برداری و انبارداری مطابق رویه های موجود در معاملات گواهی سپرده شمش طلا می باشد.
- تراکنش های مالی مربوط به تسویه هزینه انبارداری از طریق اعتبار ریالی در دفاتر دارایی مشتریان (مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده شمش طلا) نزد بورس کالای ایران صورت می گیرد. لذا کلیه مشتریان فروشنده می بایست مبلغ هزینه انبارداری را که پس از انجام فرآیند تحویل مشخص می گردد، تا یک ساعت قبل از پایان روز معاملاتی بعد از سررسید اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا 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 شمش طلا در دفاتر دارایی مشتریان فروشنده در قرارداد اختیار معامله خواهد بود.
- اگر مشتری فروشنده در آخرین روز معاملاتی دارای گواهی سپرده شمش طلا 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 موقعیت های باز مشتری در قراردادهای اختیار معامله اقدام به برداشت دارایی از سبد دارایی وی می نماید. همچنین عدم تکافوی گواهی سپرده شمش طلا در سبد دارایی مشتری فروشنده، به منزله نکول قرارداد محسوب شده و مشمول جریمه های 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 شمش طلا یا در صورت احراز شرایط تحویل، اقدام به ارائه گواهی به انبار جهت ترخیص و دریافت شمش طلا 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 شمش طلا 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.

سایر اطلاعات:

۱- نماد معاملاتی گواهی سپرده کالایی شمش طلا: GoldBar

۲- نشانی انبارهای پذیرش شده:

- تهران، خیابان آیت الله طالقانی، بعد از تقاطع ولی عصر (عج)، شماره ۳۵۱ (خزانه بورس کالای ایران)

نکات مهم:

- ۱- معاملات گواهی سپرده کالایی شمش طلا طی روزهای معاملاتی هر هفته از طریق سامانه معاملات ابزارهای نوین بورس کالای ایران (سما) انجام می‌گیرد، لذا مشتریان می‌توانند در هر روز نسبت به خرید گواهی سپرده شمش طلا در این بازار و نگهداری آن تا پایان روز کاری آخرین روز معاملاتی ایفای تعهد فروش اقدام نمایند.
- ۲- مبنای محاسبه قیمت نقدی شمش طلا در محاسبات جرایم نکول قراردادهای اختیار معامله گواهی سپرده شمش طلا قیمت پایانی معاملات گواهی سپرده شمش طلا، در آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خواهد بود.

شماره: {شماره}

تاریخ: {تاریخ}

پیوست: {پیوست}



شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)
Iran Mercantile Exchange

۳- هرگواهی سپرده کالایی معادل یک دهم گرم (۱۰۰ سوت) از شمش طلای یک کیلوگرمی با عیار معاملاتی ۹۹۵ (قسمت در هزار) می باشد.

۴- اطلاعات مربوط به انبارداری و تحویل دارایی از انبار مطابق رویه اجرایی معاملات گواهی سپرده شمش طلا می باشد.