



بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راه‌اندازی قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳

مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قراردادهای اختیار معامله واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳، از روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۳/۰۷/۲۴ به شرح زیر با امکان استفاده از استراتژی کاور دکال و اندازه قرارداد ۱۰ واحد سرمایه‌گذاری به شرح مشخصات قرارداد پیوست، راه‌اندازی شده و قابل معامله خواهد بود.

نوع اختیار	شرح نماد	نماد	تاریخ سررسید
خرید	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۴/۰۰۰ ریال	JZBA03C14	۱۴۰۳/۱۱/۲۸
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۶/۰۰۰ ریال	JZBA03C16	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰ ریال	JZBA03C18	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۰/۰۰۰ ریال	JZBA03C20	
	قرارداد اختیار خرید صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۲/۰۰۰ ریال	JZBA03C22	
فروش	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۴/۰۰۰ ریال	JZBA03P14	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۶/۰۰۰ ریال	JZBA03P16	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۱۸/۰۰۰ ریال	JZBA03P18	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۰/۰۰۰ ریال	JZBA03P20	
	قرارداد اختیار فروش صندوق طلای دنای زاگرس سررسید بهمن ماه ۱۴۰۳ با قیمت اعمال ۲۲/۰۰۰ ریال	JZBA03P22	

قراردادهای اختیار معامله بدون حد نوسان قیمتی، با دوره گشایش به مدت ۳۰ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و با دوره عادی معاملاتی ادامه می‌یابد.

منتشر کننده: مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق‌های کالایی

مشخصات قرارداد اختیار معامله واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنا زاکرس (جواهر)

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنا زاکرس (جواهر)
۲	نماد کالا	JZMMYYCK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و C نشان دهنده اختیار خرید می‌باشد) JZMMYYPK (K نمایان کننده قیمت اعمال، MM علامت اختصاری ماه قرارداد و YY سال و P نشان دهنده اختیار فروش می‌باشد)
۳	اندازه قرارداد	۱۰ واحد سرمایه‌گذاری
۴	فاصله قیمت اعمال	مضربی از ۱,۰۰۰ ریال
۵	وجه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه موقعیت‌های 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 می‌شود: $\text{IM} = \left(\left[\frac{\text{IM} \times \text{S}}{\text{C}} \right] + 1 \right) \times \text{C}$ IM: (مقدار در زیان بودن قرارداد - قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای دنا زاکرس (جواهر) \times A) و (قیمت اعمال \times B) هر کدام که بزرگتر بود. A: ۲۰٪، B: ۱۰٪، C: ۱۰۰ ریال، S: اندازه قرارداد: ۱۰ ب) وجه تضمین لازم: در هر روز به صورت پویا بر اساس روند زیر، هر کدام که بزرگتر بود، محاسبه می‌شود: ۱- (مقدار در زیان بودن قرارداد - (قیمت پایانی صندوق سرمایه‌گذاری طلای دنا زاکرس \times A) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد ۲- ((قیمت اعمال \times B) + قیمت پایانی قرارداد اختیار معامله) ضربدر اندازه قرارداد 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. ج) حداقل وجه تضمین: حداقل وجه تضمین معادل ۷۰ درصد وجه تضمین لازم می‌باشد. د) موقعیت باز فروش در قرارداد اختیار معامله خرید که با خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری طلای دنا زاکرس پوشش داده شده باشد، نیاز به تودیع وجه تضمین ندارد.
۶	سبک اعمال	اعمال می‌تواند صرفاً در آخرین روز معاملاتی صورت پذیرد (اختیار معامله اروپایی).
۷	روش تخصیص	اولویت زمانی
۸	حداقل تغییر قیمت	۱ ریال
۹	ماه‌های قرارداد	تمامی ماه‌های سال به تشخیص بورس
۱۰	دوره معاملاتی	دوره معاملاتی هر کدام از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.
۱۱	واحد پولی قیمت	ریال به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری (۱۰ ریال به ازای هر قرارداد)
۱۲	مهلت ارائه درخواست اعمال	۱۵ دقیقه پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی
۱۳	مهلت تحویل و شرایط آن	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 می‌گردد و سایر مهلت‌های موضوع تبصره ماده ۴۳ به شرح زیر است: الف) مهلت تامین دارایی (در اختیار خرید) و واریز وجه (در اختیار فروش) توسط دارنده موقعیت فروش تا پایان ساعت معاملاتی آخرین جلسه معاملاتی. ب) مهلت بررسی دارایی و درخواست‌های اعمال توسط بورس و اطلاع به کارگزار، تا پایان روز آخرین جلسه معاملاتی. 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. د) مهلت ایفای تعهدات برای خریداران موضوع ۲-۸ بند ۸ ماده ۴۳ تا پایان ساعت معاملاتی جلسه معاملاتی روز کاری بعد.
۱۴	سقف مجاز موقعیت‌های باز و هم جهت	سقف موقعیت‌های باز و هم جهت مشتریان حقیقی و حقوقی در هر نماد معاملاتی برای دارندگان موقعیت باز: بدون سقف.
۱۵	خسارت‌ها	در صورتی که موقعیت‌های باز خرید در نتیجه عدم ایفای تعهدات فروشنده، منجر به تسویه نقدی شود، فروشنده به میزان ۱ درصد ارزش فعلی معامله (حجم ضربدر اندازه قرارداد ضربدر قیمت پایانی واحدهای سرمایه‌گذاری) به نفع خریدار خسارت می‌پردازد. 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 می‌باشند.
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	الف) مطابق ماده ۸ دستورالعمل اجرایی قرارداد اختیار معامله در خصوص درج اولین نماد معاملاتی بی‌تفاوت، قیمت اعمال این نماد مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. قیمت‌های اعمال تمامی نمادهای ایجاد شده پس از آن نیز مضربی از فاصله قیمت اعمال خواهد بود. ب) بورس می‌تواند نمادهای معاملاتی مربوط به قیمت‌های اعمالی که فاقد موقعیت باز هستند را از لیست نمادهای موجود حذف نماید.

۱۸	نحوه اعمال	اعمال قرارداد اختیار معامله تنها به درخواست دارنده موقعیت باز خرید صورت می گیرد.																								
۱۹	ساعات و روزهای معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵																								
۲۰	کارمزدهای معاملاتی	<p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>حق نظارت سازمان</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل:</p> <table border="1"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید</td> <td></td> </tr> </table>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده		کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	حق نظارت سازمان	-	-	جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید		بورس کالا	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید		جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید	
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																									
کارگزار	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۸ ارزش هر قرارداد																								
بورس کالا	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																								
حق نظارت سازمان	-	-																								
جمع	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۱۲ ارزش هر قرارداد																								
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش بازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
بورس کالا	۰/۰۰۰۱ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش ازار دارایی پایه هر قرارداد در سررسید																									
۲۱	نوع تسویه پس از اعمال	تحویل دارایی پایه																								
۲۲	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۵۰۰۰ قرارداد																								

