بسمه تعالی

بورس اوراق بهادار تهران
(شرکت سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید فروردین ماه ۱۴۰۳ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران

به اطلاع کلیه فعالان محترم بازار سرمایه می‌رساند، دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید فروردین ماه ۱۴۰۳، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۹/۱۳ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران آغاز می‌شود.

معاملات مربوط به این قراردادها تنها به صورت برخط بوده و صرفاً از طریق کارگزارانی که مجوز معاملات برخط در این بازار را دارا باشند، قابل انجام است. همچنین اتخاذ موقعیت باز فروش در قراردادهای اختیارمعامله، تنها به شرط کفایت وجوه تضمین براساس مفاد «دستورالعمل معاملات قرارداد اختیارمعامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران» امکان‌پذیر می‌باشد.

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید فروردین ماه ۱۴۰۳، به‌شرح جدول زیر است:

مشخصات نمادهای اختیار معامله		
نام دارایی پایه	ذوب آهن اصفهان	
نماد دارایی پایه	ذوب	
نماد معاملاتی اختیار خرید/نام فارسی*	ضذوب۰۱۰۰	اختیارخ ذوب-۲۸۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۱	اختیارخ ذوب-۳۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۲	اختیارخ ذوب-۳۲۵۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۳	اختیارخ ذوب-۳۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۴	اختیارخ ذوب-۳۷۵۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۵	اختیارخ ذوب-۴۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۶	اختیارخ ذوب-۴۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۷	اختیارخ ذوب-۵۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۸	اختیارخ ذوب-۵۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۰۹	اختیارخ ذوب-۶۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	ضذوب۰۱۱۰	اختیارخ ذوب-۶۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
نماد معاملاتی اختیار فروش/نام فارسی*	طذوب۰۱۰۰	اختیارف ذوب-۲۸۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۱	اختیارف ذوب-۳۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۲	اختیارف ذوب-۳۲۵۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۳	اختیارف ذوب-۳۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۴	اختیارف ذوب-۳۷۵۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۵	اختیارف ذوب-۴۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۶	اختیارف ذوب-۴۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۷	اختیارف ذوب-۵۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۸	اختیارف ذوب-۵۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۰۹	اختیارف ذوب-۶۰۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹
	طذوب۰۱۱۰	اختیارف ذوب-۶۵۰۰-۱۴۰۳/۰۱/۱۹

* نام فارسی قراردادهای اختیار معامله مشتمل بر نوع اختیار- دارایی پایه- قیمت اعمال- تاریخ سررسید است. لازم به ذکر است که نمادهای مذکور با حروف ض (اختیار خرید) و ط (اختیار فروش) آغاز می‌شوند.

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید فروردین ماه ۱۴۰۳، به‌صورت زیر است:

سایر مشخصات نمادهای اختیار معامله		
اندازهٔ قرارداد (سهم)	۱،۰۰۰	
ماه‌های قرارداد	فروردین ماه ۱۴۰۳	
دوره‌های معاملاتی	۱۴۰۲/۰۹/۱۳ تا ۱۴۰۳/۰۱/۱۹	
روزها و ساعات معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به‌جز تعطیلات رسمی)	
سقف موقعیت باز*	موقعیت‌های باز بازار	۵،۵۲۰،۴۹۲
	موقعیت‌های باز کارگزار	مطابق با اطلاعیه شماره ۱۸۱/۱۳۵۹۰۷
	موقعیت‌های باز و موقعیت‌های هم‌جهت شخص حقوقی	۲۷۶،۰۰۰
	موقعیت‌های باز و موقعیت‌های هم‌جهت شخص حقیقی	۲۰۰،۰۰۰
واحد پولی قیمت	ریال	
سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری	در اختیار کارگزار	
زمان‌بندی فرآیند اعمال	زمان تسویه نقدی: یک روز کاری پیش از سررسید زمان تسویه فیزیکی: سررسید	
سبک اعمال	اروپایی	
نحوهٔ اعمال	غیرخودکار	
نوع تسویه در سررسید	تسویه فیزیکی تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)	
تسویه نهایی	T+۲	
روش تخصیص	تسهیم به نسبت	
محدودیت‌های معاملاتی	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)	۱
	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)	۱۰۰۰
	حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)	۱
	کوچکترین مضرب هر سفارش (واحد)	۱
دامنه نوسان	ندارد.	
امکان تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد	وجود ندارد.	
نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه	قیمت پایانی (گردشده به نزدیک‌ترین عدد صحیح)	

* بورس می‌تواند حین دوره معاملاتی، ضمن انجام اطلاع رسانی قبلی، سقف‌های تعیین شده را تعدیل نماید.

* صندوق‌های سرمایه‌گذاری دارای مجوز فعالیت از سازمان بورس و اوراق بهادار، ملزم به رعایت سقف‌های تعیین شده مطابق مقررات سازمان بوده و از رعایت سقف اشخاص حقوقی معاف می‌باشند.

❖ جدول فواصل قیمت اعمال

بازه قیمت اعمال	فاصله قیمت اعمال
کمتر از ۲،۰۰۰ ریال	۱۰۰ ریال
از ۲،۰۰۰ ریال تا ۳،۰۰۰ ریال	۲۰۰ ریال
از ۳،۰۰۰ ریال تا ۴،۰۰۰ ریال	۲۵۰ ریال
از ۴،۰۰۰ ریال تا ۸،۰۰۰ ریال	۵۰۰ ریال
از ۸،۰۰۰ ریال تا ۱۶،۰۰۰ ریال	۱،۰۰۰ ریال
از ۱۶،۰۰۰ ریال تا ۳۰،۰۰۰ ریال	۲،۰۰۰ ریال
از ۳۰،۰۰۰ ریال تا ۵۰،۰۰۰ ریال	۴،۰۰۰ ریال
از ۵۰،۰۰۰ ریال تا ۸۰،۰۰۰ ریال	۶،۰۰۰ ریال
از ۸۰،۰۰۰ ریال تا ۱۶۰،۰۰۰ ریال	۱۰،۰۰۰ ریال
بالاتر از ۱۶۰،۰۰۰ ریال	۲۰،۰۰۰ ریال

❖ ضرایب وجوه تضمین

ضریب	مقدار
A	۲۰٪
B	۱۰٪
نسبت حداقل وجه تضمین	۷۰٪
ضریب گرد کردن	۱۰،۰۰۰

فرمول گرد کردن وجوه تضمین نیز به صورت زیر است ([ ]: تابع جزء صحیح):

$$\text{وجه تضمین نهایی } ** = \left(\left[\frac{\text{وجه تضمین } *}{\text{ضریب گردکردن}}\right] + ۱\right) \times \text{ضریب گردکردن}$$

* وجه تضمین (اولیه یا لازم) به ازای هر قرارداد (پیش از افزودن مبلغ ارزش معامله یا بازار قرارداد)

** مبلغ وجه تضمین نهایی (اولیه یا لازم) به ازای هر قرارداد (پیش از افزودن مبلغ ارزش معامله یا بازار قرارداد)

❖ **نکات مهم در خصوص بازار اختیار معامله**

۱) توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، به‌طور همزمان با توقف و بازگشایی دارایی پایه در بازار نقد و به یک روش انجام می‌شود.

۲) چنانچه در طول دوره معاملاتی قرارداد اختیارمعامله، سهم پایه مشمول اقدام شرکتی از نوع سود نقدی و افزایش سرمایه شود، قیمت اعمال و اندازه قرارداد اختیارمعامله حسب مورد مطابق فصل هفتم دستورالعمل «معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران» تعدیل خواهد شد.

۳) پس از پایان دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، دارندگان موقعیت باز خرید در صورت تمایل و دارندگان موقعیت باز فروش به‌طور قطع وارد فرآیند اعمال قراردادهای اختیار معامله خواهند شد.

۴) قراردادهای اختیار معامله دارای دو زمان تسویه نقدی و تسویه فیزیکی به شرح زیر می‌باشند:

- زمان تسویه نقدی: یک روز کاری پیش از سررسید (زمان تسویه فیزیکی) می‌باشد.
- زمان تسویه فیزیکی: روز سررسید (آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله) می‌باشد.

۵) در زمان تسویه نقدی، دارندگان موقعیت باز (اعم از خرید و فروش) باید اقدامات زیر را انجام دهند:

- اعلام موافقت با تسویه نقدی
- تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه نقدی
- اعلام موافقت با اعمال حداکثری: در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه نقدی نخواهد بود.
- اعلام موافقت با تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد: این گزینه صرفاً برای دارندگان موقعیت باز خرید در نظر گرفته شده است.

۶) اعلام موافقت با تسویه نقدی، به معنای اجرای نهایی این نوع تسویه نخواهد بود.

۷) در زمان تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز خرید باید اقدامات زیر را انجام دهند:

- اعلام موافقت با تسویه فیزیکی
- تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی
- اعلام موافقت با اعمال حداکثری: در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی نخواهد بود.
- اعلام موافقت با تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی «در زیان و بی‌تفاوت»

۸) در زمان تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز فروش به‌طور پیش‌فرض، متعهد به تسویه فیزیکی همه موقعیت‌های باز خود می‌باشند.

۹) در تسویه فیزیکی، امکان اعمال قرارداد اختیار معامله به میزان کسری از اندازه قرارداد وجود ندارد.

۱۰) اعمال به روش تسویه فیزیکی برای همه قراردادها اعم از «در سود» و «در زیان» قابل انجام می‌باشد، ولی اعمال به روش تسویه نقدی تنها برای قراردادهای اختیار معامله «در سود» امکان‌پذیر است. ملاک تشخیص قرارداد در سود، بی‌تفاوت یا در زیان، قیمت مبنای دارایی پایه در زمان‌های تسویه نقدی و تسویه فیزیکی و آخرین قیمت اعمال اعلامی توسط بورس می‌باشد.

۱۱) هزینه‌های معاملاتی بازار قراردادهای اختیار معامله (کارمزد معاملاتی و کارمزد اعمال) مطابق با مصوبات سازمان بورس و اوراق بهادار می‌باشد.

۱۲) خریدار اختیار فروش و فروشنده اختیار خرید در صورت تسویه فیزیکی، ملزم به پرداخت مالیات مقطوعی، مطابق با قوانین و مقررات مربوطه خواهد بود.

۱۳) در سررسید فیزیکی، در صورت نکول دارندگان موقعیت باز فروش، قرارداد اختیار معامله بر اساس قیمت مبنای دارایی پایه در سررسید فیزیکی، تسویه نقدی شده و مشمول جریمه خواهد شد. جریمه نکول برابر با یک‌درصد ارزش قرارداد بر حسب قیمت اعمال می‌باشد:

تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول‌کرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال × ۰/۰۱

سرمایه‌گذاران محترم می‌توانند برای کسب اطلاعات بیشتر به «دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران» و «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران» مصوب ۱۳۹۷/۰۲/۲۶ هیئت‌مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار مراجعه نمایند.

وحید مطهری‌نیا
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین مالی