



اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش

سهام بانک پارسیان (وپارس)

برای سررسیدی ماه ۱۴۰۰ 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 بانک پارسیان (وپارس) در سررسیدی ماه ۱۴۰۰، از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۰/۰۶/۳۱ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران آغاز می‌شود.

معاملات مربوط به این قراردادها تنها به صورت برخط بوده و صرفاً از طریق کارگزاریانی که مجوز معاملات برخط در این بازار را دارا باشند، قابل انجام است.

همچنین با توجه به راه‌اندازی سامانه مدیریت ریسک و امکان محاسبات وجوه تضمین براساس «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران»، **اتخاذ موقعیت باز فروش** در قراردادهای اختیار معامله، به شرط کفایت وجوه تضمین، برای تمامی فعالان بازار سرمایه امکان‌پذیر می‌باشد.



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۹۴۸۶۴

تاریخ: ۱۴۰۰/۰۶/۲۸

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام بانک پارسیان (وپارس) در سررسید دی ماه ۱۴۰۰، به شرح جدول زیر است:

بانک پارسیان		نام شرکت
وپارس		نماد معاملاتی دارای پایه
حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان		نحوه درج قرارداد*
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۱۶۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۰۹	نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی**
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۱۸۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۰	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۲۰۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۱	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۲۵۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۲	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۳۰۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۳	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۳۵۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۴	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۴۰۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۵	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۴۵۰۰-اختیارخ وپارس	ضپاس ۱۰۱۶	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۱۶۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۰۹	نماد معاملاتی اختیار فروش / نام فارسی**
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۱۸۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۰	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۲۰۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۱	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۲۵۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۲	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۳۰۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۳	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۳۵۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۴	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۴۰۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۵	
۱۴۰۰/۱۰/۲۲-۴۵۰۰-اختیارف وپارس	طپاس ۱۰۱۶	

* منظور از نحوه درج، حداقل تعداد قراردادهایی است که باید در اولین روز و طی دوره معاملاتی با توجه به جدول فاصله قیمت اعمال در سامانه معاملات وجود داشته باشد. طبق ماده ۷ دستورالعمل معاملات قراردادهای اختیار معامله، در اولین روز معاملاتی هر زیرگروه هم‌ماه، حداقل یک قرارداد اختیار معامله در سود، یک قرارداد اختیار معامله بی تفاوت و حداقل یک قرارداد اختیار معامله در زیان درج می‌شود.

** نام فارسی قراردادهای اختیار معامله مشتمل بر نوع اختیار- دارای پایه- قیمت اعمال- تاریخ سررسید است. لازم به ذکر است که نمادهای مذکور

با حروف ض (اختیار خرید) و ط (اختیار فروش) آغاز می‌شوند.



بورس اوراق بهادار تهران
(مركز سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۹۴۸۶۴

تاریخ: ۱۴۰۰/۰۶/۲۸

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی سهام بانک پارسیان (وپارس) در سررسید دی ماه ۱۴۰۰، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (سهام)		۱۰۰۰
ماههای قرارداد		دی ماه ۱۴۰۰
دورههای معاملاتی	دی ماه ۱۴۰۰	۱۴۰۰/۰۶/۳۱ لغایت ۱۴۰۰/۱۰/۲۲
روزها و ساعات معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)	
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت	بازار	بدون محدودیت
	کارگزار	بدون محدودیت
	مشتری حقوقی	بدون محدودیت
	مشتری حقیقی	بدون محدودیت
سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری	در اختیار کارگزار	
زمان بندی فرآیند اعمال	زمان تسویه نقدی	یک روز کاری پیش از سررسید
	زمان تسویه فیزیکی	سررسید
سبک اعمال	اروپایی	
نحوه اعمال	غیر خودکار	
نوع تسویه در سررسید	- تسویه فیزیکی - تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)	
تسویه نهایی	T+2	
روش تخصیص	تسهیم به نسبت	
محدودیت‌های معاملاتی	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)	۱
	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)	۱۰۰
	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 دارد.	
نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه	قیمت پایانی (گردشده به نزدیک‌ترین عدد صحیح)	
فاصله قیمت اعمال	مقدار تغییرات قیمت اعمال	بازه‌های قیمت اعمال
	۲۰۰ ریال	قیمت مبنا کمتر از ۲۰,۰۰۰ ریال
	۵۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال
	۱,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۱۰۰,۰۰۰ ریال
	۲,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۱۰۰,۰۰۰ ریال و ۲۰۰,۰۰۰ ریال
	۴,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲۰۰,۰۰۰ ریال و ۴۰۰,۰۰۰ ریال
	۸,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۴۰۰,۰۰۰ ریال و ۸۰۰,۰۰۰ ریال
۱۵,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بالای ۸۰۰,۰۰۰ ریال	



همچنین ضرایب مورد استفاده در محاسبات وجوه تضمین اولیه، لازم و حداقل وجه تضمین این قراردادها به شرح جدول زیر است:

مقدار	ضریب
۲۰٪	A
۱۰٪	B
۷۰٪	نسبت حداقل وجه تضمین
۱۰۰،۰۰۰	ضریب گرد کردن

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

$$\text{ضریب گرد کردن} \times \left(1 + \left[\frac{\text{وجه تضمین} *}{\text{ضریب گرد کردن}} \right] \right) = \text{وجه تضمین نهایی} **$$

* 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)

لازم به ذکر است که:

(۱) توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، به طور همزمان با توقف و بازگشایی دارایی پایه در بازار نقد و به یک روش انجام می شود.

(۲) چنانچه در طول دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله، سهم پایه مشمول اقدام شرکتی از نوع سود نقدی و افزایش سرمایه شود، قیمت اعمال و اندازه قرارداد اختیار معامله 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 به طور قطع وارد فرآیند اعمال قراردادهای اختیار معامله خواهند شد.

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

الف) زمان تسویه نقدی: یک روز کاری پیش از سررسید (زمان تسویه فیزیکی) می باشد.

ب) زمان تسویه فیزیکی: روز سررسید (آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله) می باشد.

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

الف) اعلام موافقت با تسویه نقدی

ب) تعیین تعداد موقعیت های مدنظر خود برای تسویه نقدی

پ) اعلام موافقت با اعمال حداکثری: در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت های مدنظر خود برای تسویه نقدی نخواهد بود.

ت) 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:

الف) اعلام موافقت با تسویه فیزیکی

ب) تعیین تعداد موقعیت های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی

پ) اعلام موافقت با اعمال حداکثری: در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی نخواهد بود.

ت) اعلام موافقت با تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی «در زیان و بی تفاوت»



۸) در زمان تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز فروش به طور پیش فرض، متعهد به تسویه فیزیکی همه موقعیت‌های باز خود می‌باشند.

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

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

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

۱۲) 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 یک درصد ارزش قرارداد بر حسب قیمت اعمال می‌باشد:

تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول کرده × 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 هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار مراجعه نمایند.

نگار نظری
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین