



## اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش

### سهام بانک صادرات ایران (وبصادر)

### برای سررسید خرداد ماه ۱۴۰۱ 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 صادرات ایران (وبصادر) در سررسید خرداد ماه ۱۴۰۱، از روز سه‌شنبه مورخ ۱۴۰۰/۱۰/۰۷ 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 سامی نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۱۰۰۶۳۳

تاریخ: ۱۴۰۰/۱۰/۰۴

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام بانک صادرات ایران (وبصادر) در سررسید خرداد ماه ۱۴۰۱، به شرح جدول زیر است:

بانک صادرات ایران		نام شرکت
وبصادر		نماد معاملاتی دارای پایه
حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان		نحوه درج قرارداد*
اختیارخ وبصادر-۱۲۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۱۳۰	نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی**
اختیارخ وبصادر-۱۴۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۲۳۰	
اختیارخ وبصادر-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۳۳۰	
اختیارخ وبصادر-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۴۳۰	
اختیارخ وبصادر-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۵۳۰	
اختیارخ وبصادر-۲۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۶۳۰	
اختیارخ وبصادر-۳۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۷۳۰	
اختیارخ وبصادر-۳۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	ضصاد۱۸۳۰	
اختیارف وبصادر-۱۲۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۱۳۰	نماد معاملاتی اختیار فروش/ نام فارسی**
اختیارف وبصادر-۱۴۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۲۳۰	
اختیارف وبصادر-۱۶۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۳۳۰	
اختیارف وبصادر-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۴۳۰	
اختیارف وبصادر-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۵۳۰	
اختیارف وبصادر-۲۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۶۳۰	
اختیارف وبصادر-۳۰۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۷۳۰	
اختیارف وبصادر-۳۵۰۰-۱۴۰۱/۰۳/۱۱	طصاد۱۸۳۰	

\* 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  
(مگرت سامی نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۱۰۰۶۳۳

تاریخ: ۱۴۰۰/۱۰/۰۴

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی سهام بانک صادرات ایران (وبصادر) در سررسید خرداد ماه ۱۴۰۱، به صورت زیر است:

۱.۰۰۰		اندازه قرارداد (سهام)
خرداد ماه ۱۴۰۱		ماه های قرارداد
۱۴۰۱/۰۳/۱۱ لغایت ۱۴۰۰/۱۰/۰۷	خرداد ماه ۱۴۰۱	دوره های معاملاتی
شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)		روزها و ساعات معاملاتی
بدون محدودیت	بازار	سقف تعداد موقعیت های باز و هم جهت
بدون محدودیت	کارگزار	
بدون محدودیت	مشتری حقوقی	
بدون محدودیت	مشتری حقیقی	
در اختیار کارگزار		سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری
یک روز کاری پیش از سررسید	زمان تسویه نقدی	زمان بندی فرآیند اعمال
سررسید	زمان تسویه فیزیکی	
اروپایی		سبک اعمال
غیر خودکار		نحوه اعمال
- تسویه فیزیکی - تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)		نوع تسویه در سررسید
T+2		تسویه نهایی
تسهیم به نسبت		روش تخصیص
۱	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)	محدودیت های معاملاتی
۱۰۰	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)	
۱	حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)	
۱	کوچکترین مضرب هر سفارش (واحد)	
ندارد.		دامنه نوسان
وجود دارد.		امکان تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد
قیمت پایانی (گردشده به نزدیک ترین عدد صحیح)		نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه
بازه های قیمت اعمال	مقدار تغییرات قیمت اعمال	فاصله قیمت اعمال
قیمت مبنا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال	۲۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۵,۰۰۰ ریال	۵۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۵,۰۰۰ ریال و ۱۰,۰۰۰ ریال	۱,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۱۰,۰۰۰ ریال و ۲۰,۰۰۰ ریال	۲,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۲۰,۰۰۰ ریال و ۴۰,۰۰۰ ریال	۴,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۴۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال	۸,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بالای ۸۰,۰۰۰ ریال	۱۵,۰۰۰ 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):

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

\* 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) 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، بی تفاوتی 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 یک درصد ارزش قرارداد بر حسب قیمت اعمال می‌باشد:

**تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول کرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال × ۰.۱٪**

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 مطهری نیا  
سرپرست مدیریت عملیات بازار  
ابزارهای نوین مالی شرکت  
بورس اوراق بهادار تهران