

تاریخ: ۱۴۰۰/۱۰/۲۲

شماره: ۳۴۴۱/م/۰۰

## اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پتروشیمی زاگرس (زاگرس) در سررسید اسفند ماه سال ۱۴۰۰ در بازار ابزارهای مشتقه فرابورس ایران

به اطلاع کلیه سرمایه‌گذاران محترم می‌رساند، معاملات قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پتروشیمی زاگرس در سررسید اسفند ماه سال ۱۴۰۰ از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۰/۱۰/۲۲ در بازار ابزارهای مشتقه فرابورس ایران آغاز می‌گردد.  
معاملات مربوط به این قرارداد تنها به صورت برخط بوده و صرفاً از طریق کارگزارانی که مجوز معاملات برخط در این بازار را دارا باشند، قابل انجام خواهد بود.

بر اساس نامه شماره ۱۲۱/۱۰۹۴۸۸ مورخ ۱۳۹۹/۰۱/۲۷ مدیر محترم فناوری اطلاعات سازمان بورس و اوراق بهادار، جهت ارسال سفارش نمادهای قرارداد اختیار معامله در بازار ابزارهای مشتقه فرابورس ایران بایستی از مقدار عددی ۹۴ در فیلد کد شهر استفاده شود.  
همچنین، با توجه به راهنمایی سامانه مدیریت ریسک و امکان محاسبات وجه تضمین براساس «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران»، امکان اتخاذ موقعیت باز فروش در قراردادهای اختیار معامله، به شرط کفایت وجود تضمین، برای تمامی فعالان بازار سرمایه وجود دارد.

**اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پتروشیمی زاگرس (زاگرس) در سررسید اسفند ماه سال ۱۴۰۰ به شرح جدول ذیل است:**

نام شرکت	نام معاملاتی دارایی پایه	نحوه درج قرارداد*
پتروشیمی زاگرس	زاگرس	
حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان		
اختیارخ زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۲۰۰۰۰	۱۲۰۷	نماد معاملاتی اختیار خرید / نام فارسی**
اختیارخ زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۱۸۵۰۰	۱۲۰۸	
اختیارخ زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۱۷۰۰۰	۱۲۰۹	
اختیارف زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۲۰۰۰۰	۱۲۰۷	نماد معاملاتی اختیار فروش / نام فارسی**
اختیارف زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۱۸۵۰۰	۱۲۰۸	
اختیارف زاگرس-۱۴۰۰/۱۲/۰۴-۱۷۰۰۰	۱۲۰۹	

\*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 بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران، در اولین روز معاملاتی هر زیرگروه هم‌مام، حداقل یک قرارداد اختیار در سود، یک قرارداد اختیار معامله بی تفاوت و حداقل یک قرارداد اختیار معامله در زیان درج می‌شود.  
همچنین طبق ماده ۹ دستورالعمل معاملات قراردادهای اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران، بورس باید از اولین روز معاملاتی تا پنج روز کاری پیش از آخرین روز معاملاتی هر زیرگروه هم ماه، در صورت وقوع شرایط زیر، پیش از آغاز معاملات روزانه، حداقل یک قرارداد اختیار معامله جدید در آن زیرگروه هم‌مام معرفی و از طریق سامانه معاملاتی اعلام کند :

(الف) قیمت مبنای دارایی پایه در روز معاملاتی قبل، بزرگتر یا مساوی بیشترین قیمت اعمال قراردادهای اختیار معامله شود؛ یا (ب) قیمت مبنای دارایی پایه در روز معاملاتی قبل، کوچکتر یا مساوی کمترین قیمت اعمال قراردادهای اختیار معامله شود.

\*\*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 بروزی سهام شرکت پتروشیمی زاگرس (زاگرس) در سررسید اسفند ماه ۱۴۰۰ به شرح جدول زیر می‌باشد:

		اندازه قرارداد(سهم)
۱۴۰۰	ماههای قرارداد	
اسفند ماه ۱۴۰۰		
۱۴۰۰/۱۰/۲۲ - ۱۴۰۰/۱۰/۰۴	دوره معاملاتی	
شنبه تا چهارشنبه ۹:۰۰ - ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)	روزو ساعت معاملاتی	
بازار		سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم جهت
بدون محدودیت	کارگزار	
بدون محدودیت	مشتری حقوقی	
بدون محدودیت	مشتری حقیقی	
در اختیار کارگزار		سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری
تاریخ تسویه نقدی		
یک روز کاری پیش از سررسید		زمانبندی فرآیند اعمال
سررسید	تاریخ تسویه فیزیکی	
اروپایی		سبک اعمال
غیرخودکار		نحوه اعمال
تسویه فیزیکی	-	
تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)	-	نوع تسويه در سررسید
T+۲		تسویه نهایی
تسهیم به نسبت		روش تخصیص
۱	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)	
۱۰۰	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)	
۱	حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)	محدودیتهای معاملاتی
۱	کوچکترین مضرب هر سفارش (واحد)	
۱ ریال تا ۱,۰۰۰,۰۰۰ ریال		دامنه نوسان
ریال		واحد پولی قیمت
وجود دارد		امکان تسويه نقدی به کسری از اندازه قرارداد
۱ × تعداد موقعیت‌های باز نکول کرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال		خسارتخانه
قیمت پایانی (گرد شده به نزدیکترین عدد صحیح)		نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه
مقدار تغییرات قیمت اعمال		
بازه‌های قیمت اعمال		
قیمت مبنای کمتر از ۲,۰۰۰ ریال	۲۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۲,۰۰۰ و ۵,۰۰۰ ریال	۵۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۵,۰۰۰ و ۱۰,۰۰۰ ریال	۱,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۱۰,۰۰۰ و ۲۰,۰۰۰ ریال	۲,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۲۰,۰۰۰ و ۴۰,۰۰۰ ریال	۳,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۴۰,۰۰۰ و ۸۰,۰۰۰ ریال	۵,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۸۰,۰۰۰ و ۱۰۰,۰۰۰ ریال	۸,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بین ۱۰۰,۰۰۰ و ۱۵۰,۰۰۰ ریال	۱۰,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنای بالای ۱۵۰,۰۰۰ ریال	۱۵,۰۰۰ ریال	فاصله قیمت اعمال

### نحوه محاسبات وجه تضمین:

ضرایب مورد استفاده در محاسبات وجه 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 وجه تضمین نیز به صورت زیر است(]): تابع جزء صحیح است):

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

\*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)

### ساختمان موارد حائز اهمیت مطابق با فصل هفتم دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران:

- 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 می‌شود.
- چنانچه در طول دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله، سهم پایه مشمول اقدام شرکتی از نوع سود نقدی یا افزایش سرمایه شود، قیمت اعمال یا اندازه قرارداد اختیار معامله حسب مورد تعديل خواهد شد.

### نحوه اعمال اوراق اختیار معامله مطابق با فصل ششم دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران:

- پس از پایان دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، دارندگان موقعیت باز خرید در صورت تمایل به اعمال قرارداد اختیار معامله، باید در خواست اعمال و نوع تسويه خود را در مهلت مقرر در مشخصات قرارداد به روش تعیین شده در قرارداد فی مابین مشتری و کارگزار، به کارگزار ارائه کند و دارندگان موقعیت باز فروش در صورت اعمال دارندگان موقعیت باز خرید، به طور قطع وارد فرآیند اعمال خواهند شد.
- قراردادهای اختیار معامله دارای دو زمان تسويه نقدی و تسويه فیزیکی به شرح زیر می‌باشند:
  - الف) زمان تسويه نقدی: یک روز کاری پیش از سرسید (زمان تسويه فیزیکی) می‌باشد.
  - ب) زمان تسويه فیزیکی: روز سرسید (آخرین روز معاملاتی قراردادهای اختیار معامله) می‌باشد.
- در تاریخ تسويه نقدی، دارندگان موقعیت باز (اعم از خرید و فروش) که تمایل به تسويه نقدی تمام یا بخشی از موقعیت‌های باز خود

دارند، باید اقدامات زیر را انجام دهند:

- الف) اعلام موافقت با تسويه نقدی (اعلام موافقت با تسويه نقدی، به معنای اجرای نهايی اين نوع تسويه نخواهد بود.)
- ب) تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر برای تسويه نقدی یا اعلام موافقت با اعمال حداکثری (در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نيازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسويه نقدی نخواهد بود.)

\*\* چنانچه دارندگان موقعیت باز خرید تمایل به تسويه نقدی به کسری از اندازه قرارداد داشته باشند، باید موافقت خود را با تسويه نقدی به کسری از اندازه قرارداد اعلام نمایند.

٤. در تاريخ تسويه فيزيكي، دارندگان موقعیت باز خرید باید اقدامات زير را انجام دهند:

- الف) اعلام موافقت با تسويه فيزيكي
- ب) تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر برای تسويه فيزيكي یا اعلام موافقت با اعمال حداکثری (در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نيازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسويه فيزيكي نخواهد بود.)

\*\* در صورت تمایل به تسويه فيزيكي نمادهای معاملاتی در زيان یا بي تفاوت، دارندگان موقعیت‌های باز خرید باید موافقت خود را با تسويه فيزيكي نمادهای معاملاتی «در زيان یا بي تفاوت» اعلام نمایند.

٥. در زمان تسويه فيزيكي، دارندگان موقعیت باز فروش به طور پيش فرض، متعهد به تسويه فيزيكي همه موقعیت‌های باز خود می‌باشند.

٦. اعمال به روش تسويه فيزيكي برای همه قراردادها اعم از «در سود» و «در زيان» قابل انجام می‌باشد، لکن اعمال به روش تسويه نقدی تنها برای قراردادهای اختیار معامله «در سود» امکان‌پذیر است. ملاک تشخیص قرارداد در سود، بي تفاوت یا در زيان، قیمت مبنای دارايی پايه در زمان‌های تسويه نقدی و تسويه فيزيكي و آخرين قیمت اعمال اعلامي توسط فرابورس ايران می‌باشد.

٧. هزينه‌های معاملاتی قراردادهای اختیار معامله (كارمزد معاملاتی و کارمزد اعمال) مطابق با مصوبات سازمان بورس و اوراق بهادر می‌باشد.

٨. خريدار اختیار فروش و فروشنده اختیار خريد در صورت تسويه فيزيكي، ملزم به پرداخت ماليات مقطوع، مطابق با قوانين و مقررات مربوطه خواهند بود.

٩. در سرسيده فيزيكي، در صورت نکول (عدم ايفاي تعهدات) دارندگان موقعیت باز فروش، قراردادهای اختیار معامله بر اساس قیمت مبنای دارايی پايه در سرسيده فيزيكي، تسويه نقدی شده و مشمول جريمeh خواهند شد. جريمeh نکول برابر با يك درصد تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول كرده ضرب در ارزش قرارداد بر حسب قیمت اعمال می‌باشد:

تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول كرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال × ١٠٠

سرمايه‌گذاران محترم می‌توانند برای کسب اطلاعات بيشتر به «دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادر تهران و فرابورس ايران» و «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادر تهران و فرابورس اiran» مصوب ۱۳۹۷/۰۲/۲۶ هيأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادر مراجعه نمایند.

سپيده رستمی نيا

رئيس اداره بازار مشتقات