



بورس اوراق بهادار تهران
(مکرت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۸۱/۱۱۰۱۸۸

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۴/۰۱

بسمه تعالی

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحد های سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی - سهام (سلام) برای سررسید شهریور 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 واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سلام فارابی - سهام (سلام) در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۱، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۴/۰۶ 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 امکان پذیر می‌باشد.



بورس اوراق بهادار تهران
(مگزت سامی نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۸۱/۱۱۰۱۸۸

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۴/۰۱

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی-سهام (سلام) در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۱، به شرح جدول زیر است:

صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی		نام شرکت
سلام		نماد معاملاتی دارایی پایه
اختیارخ سلام-۶۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۰	نماد معاملاتی اختیار خرید / نام فارسی *
اختیارخ سلام-۶۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۱	
اختیارخ سلام-۷۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۲	
اختیارخ سلام-۷۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۳	
اختیارخ سلام-۸۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۴	
اختیارخ سلام-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۵	
اختیارخ سلام-۱۰۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۶	
اختیارخ سلام-۱۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۷	
اختیارخ سلام-۱۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۸	
اختیارخ سلام-۱۳۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۰۹	
اختیارخ سلام-۱۴۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	ضسلا۶۰۱۰	
اختیارف سلام-۶۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۰	
اختیارف سلام-۶۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۱	
اختیارف سلام-۷۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۲	
اختیارف سلام-۷۵۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۳	
اختیارف سلام-۸۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۴	
اختیارف سلام-۹۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۵	
اختیارف سلام-۱۰۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۶	
اختیارف سلام-۱۱۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۷	
اختیارف سلام-۱۲۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۸	
اختیارف سلام-۱۳۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۰۹	
اختیارف سلام-۱۴۰۰۰-۱۴۰۱/۰۶/۰۲	طسلا۶۰۱۰	

* 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- 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.



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت سامی نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۱۰۱۸۸/۸۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۴/۰۱

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی-سهام (سلام) در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۱، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (واحد)		۱۰۰۰
ماه‌های قرارداد		شهریور ماه ۱۴۰۱
دوره‌های معاملاتی		شهریور ماه ۱۴۰۱
روزها و ساعات معاملاتی		شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به‌جز تعطیلات رسمی)
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت		بازار
		بدون محدودیت
		کارگزار
		بدون محدودیت
واحد پولی قیمت		مشتری حقوقی
		بدون محدودیت
سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری		مشتری حقیقی
		بدون محدودیت
در اختیار کارگزار		ریال
زمان بندی فرآیند اعمال		زمان تسویه نقدی
		یک روز کاری پیش از سررسید
سبک اعمال		زمان تسویه فیزیکی
		سررسید
نحوه اعمال		اروپایی
نوع تسویه در سررسید		غیر خودکار
تسویه نهایی		- تسویه فیزیکی
		- تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)
روش تخصیص		T+۲
محدودیت‌های معاملاتی		تسهیم به نسبت
		حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)
		حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)
		حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)
دامنه نوسان		کوچکترین مضرب هر سفارش (واحد)
		۱
امکان تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد		ندارد.
نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه		وجود دارد.
فاصله قیمت اعمال		قیمت پایانی (گردشده به نزدیک‌ترین عدد صحیح)
		مقدار تغییرات قیمت اعمال
		بازه‌های قیمت اعمال
		۱۰۰ ریال
		قیمت مبنا کمتر از ۲۰۰۰ ریال
		۲۰۰ ریال
		قیمت مبنا بین ۲۰۰۰ ریال و ۳۰۰۰ ریال
		۲۵۰ ریال
		قیمت مبنا بین ۳۰۰۰ ریال و ۴۰۰۰ ریال
		۵۰۰ ریال
		قیمت مبنا بین ۴۰۰۰ ریال و ۸۰۰۰ ریال
۱۰۰۰ ریال		
قیمت مبنا بین ۸۰۰۰ ریال و ۱۶۰۰۰ ریال		
۲۰۰۰ ریال		
قیمت مبنا بین ۱۶۰۰۰ ریال و ۳۰۰۰۰ ریال		
۴۰۰۰ ریال		
قیمت مبنا بین ۳۰۰۰۰ ریال و ۵۰۰۰۰ ریال		
۶۰۰۰ ریال		
قیمت مبنا بین ۵۰۰۰۰ ریال و ۱۶۰۰۰۰ ریال		
۱۰۰۰۰ ریال		
قیمت مبنا بالاتر از ۱۶۰۰۰۰ ریال		
۲۰۰۰۰ 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، دارایی 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»



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت ساینام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۸۱/۱۱۰۱۸۸

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۴/۰۱

بسمه تعالی

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 تفاوت 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 × ۰/۰۱ +

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