

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۳/۲۲

شماره: ۰۱/م/۳۸۴۵

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پلی اکریل ایران (شپلی) در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۱ در بازار ابزارهای مشتقه فرا بورس ایران

به اطلاع کلیه سرمایه‌گذاران محترم می‌رساند، معاملات قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پلی اکریل ایران در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۱ از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۳/۲۵ در بازار ابزارهای مشتقه فرا بورس ایران آغاز می‌گردد. معاملات مربوط به این قرارداد تنها به صورت برخط بوده و صرفاً از طریق کارگزاری 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 فرا بورس ایران بایستی از مقدار عددی ۹۴ در فیلد کد شهر استفاده شود. همچنین، با توجه به راه‌اندازی سامانه مدیریت ریسک و امکان محاسبات وجه تضمین براساس «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرا بورس ایران»، امکان اتخاذ موقعیت باز فروش در قراردادهای اختیار معامله، به شرط کفایت وجوه تضمین، برای تمامی فعالان بازار سرمایه وجود دارد.

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت پلی اکریل ایران (شپلی) در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۱ به شرح جدول ذیل است:

پلی اکریل ایران		نام شرکت	
شپلی		نماد معاملاتی دارایی پایه	
حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان		نحوه درج قرارداد*	
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۵۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۰ ضشپلی	نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی**	
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۶۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۱ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۷۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۲ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۸۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۳ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۹۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۴ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۰۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۵ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۲۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۶ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۴۰۰۰ - اختیارخ شپلی	۹۰۷ ضشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۵۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۰ طشپلی		نماد معاملاتی اختیار فروش/ نام فارسی**
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۶۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۱ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۷۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۲ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۸۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۳ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۹۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۴ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۰۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۵ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۲۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۶ طشپلی		
۱۴۰۱۰۹۲۷ - ۱۴۰۰۰ - اختیاریف شپلی	۹۰۷ طشپلی		

* 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 فرا بورس ایران، در اولین روز معاملاتی هر زیر گروه هم‌ماه، حداقل یک قرارداد اختیار 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.

سایر مشخصات قرارداد نامدهای اختیار معامله بروی سهام شرکت پلی اکریل ایران (شپلی) در سررسید آذر ماه ۱۴۰۱ به شرح جدول زیر می باشد:

اندازه قرارداد (سهم)	۱,۰۰۰	
ماه های قرارداد	آذر ماه ۱۴۰۱	
دوره معاملاتی	۱۴۰۱/۰۳/۲۵ لغایت ۱۴۰۱/۰۹/۲۷	
روز و ساعات معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)	
سقف تعداد موقعیت های باز و هم جهت	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	تاریخ تسویه نقدی	یک روز کاری پیش از سررسید
	تاریخ 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+۲	
روش تخصیص	تسهیم به نسبت	
محدودیت های 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	
واحد پولی قیمت	ریال	
امکان تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد	وجود دارد	
خسارت	۰.۰۱ × تعداد موقعیت های باز نکول کرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال	
نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه	قیمت پایانی (گرد شده به نزدیک ترین عدد صحیح)	
فاصله قیمت اعمال	مقدار تغییرات قیمت اعمال	بازه های قیمت اعمال
	۲۰۰ ریال	قیمت مبنا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال
	۵۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۵,۰۰۰ ریال
	۱,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۵,۰۰۰ ریال و ۱۰,۰۰۰ ریال
	۲,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۱۰,۰۰۰ ریال و ۲۰,۰۰۰ ریال
	۳,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲۰,۰۰۰ ریال و ۴۰,۰۰۰ ریال
	۸,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۴۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال
	۱۵,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بالای ۸۰,۰۰۰ ریال

نحوه محاسبات وجه تضمین:

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 است):

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

*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)

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

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 می‌شود.
۲. 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 تعدیل خواهد شد.

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

۱. پس از پایان دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، دارندگان موقعیت باز خرید در صورت تمایل به اعمال قرارداد اختیار معامله، باید درخواست اعمال و نوع تسویه خود را در مهلت مقرر در مشخصات قرارداد به روش تعیین شده در قرارداد فی‌مابین 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.
۲. قراردادهای اختیار معامله دارای دو زمان تسویه نقدی و تسویه فیزیکی به شرح زیر می‌باشند:

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

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

۳. در تاریخ تسویه نقدی، دارندگان موقعیت باز (اعم از خرید و فروش) که تمایل به تسویه نقدی تمام یا بخشی از موقعیت‌های باز خود دارند، باید اقدامات زیر را انجام دهند:

الف) اعلام موافقت با تسویه نقدی (اعلام موافقت با تسویه نقدی، به معنای اجرای نهایی این نوع تسویه نخواهد بود.)
ب) **تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر برای تسویه نقدی یا اعلام موافقت با اعمال حداکثری** (در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه نقدی نخواهد بود.)

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

۴. در تاریخ تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز خرید باید اقدامات زیر را انجام دهند:

الف) اعلام موافقت با تسویه فیزیکی
ب) **تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر برای تسویه فیزیکی یا اعلام موافقت با اعمال حداکثری** (در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی نخواهد بود.)

** در صورت تمایل به تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی در زیان یا بی تفاوت، دارندگان موقعیت‌های باز خرید باید موافقت خود را با تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی «در زیان یا بی تفاوت» اعلام نمایند.

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

۶. اعمال به روش تسویه فیزیکی برای همه قراردادهای اعم از «در سود» و «در زیان» قابل انجام می‌باشد، لکن اعمال به روش تسویه نقدی تنها برای قراردادهای اختیار معامله «در سود» امکان پذیر 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 فرابورس ایران می‌باشد.

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

۸. خریدار اختیار فروش و فروشنده اختیار خرید در صورت تسویه فیزیکی، ملزم به پرداخت مالیات مقطوع، مطابق با قوانین و مقررات مربوطه خواهند بود.

۹. در سررسید فیزیکی، در صورت نکول (عدم ایفای تعهدات) دارندگان موقعیت باز فروش، قراردادهای اختیار معامله بر اساس قیمت مبنای دارایی پایه در سررسید فیزیکی، تسویه نقدی شده و مشمول جریمه خواهند شد. جریمه نکول برابر با یک درصد تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول کرده ضرب در 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 هیأت مدیره محترم سازمان بورس و اوراق بهادار مراجعه نمایند.

سپیده رستمی نیا
رئیس اداره بازار مشتقات