



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۱۳۷۷۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۳۰

بسمه تعالی

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش

سهام شرکت سرمایه‌گذاری تامین اجتماعی (شستا)

برای سررسید شهریورماه ۱۴۰۲ 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 شرکت سرمایه‌گذاری تامین اجتماعی (شستا) در سررسید شهریور ۱۴۰۲، از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۶/۰۲ 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
(مگزت سامی مام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۱۳۷۷۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۳۰

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام شرکت سرمایه‌گذاری تامین اجتماعی (شستا) در سررسید

شهریور ۱۴۰۲، به شرح جدول زیر است:

| سرمایه‌گذاری تامین اجتماعی | | نام شرکت |
|-----------------------------|-----------|--|
| شستا | | نماد معاملاتی دارایی پایه |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۶۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۰ ضستا | نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی* |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۷۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۱ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۸۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۲ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۹۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۳ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۰۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۴ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۱۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۵ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۲۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۶ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۳۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۷ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۴۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۸ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۵۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۹ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۶۰۰-اختیار شستا | ۶۰۱۰ ضستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۶۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۰ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۷۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۱ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۸۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۲ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۹۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۳ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۰۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۴ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۱۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۵ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۲۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۶ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۳۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۷ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۴۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۸ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۵۰۰-اختیار شستا | ۶۰۰۹ طستا | |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸-۱۶۰۰-اختیار شستا | ۶۰۱۰ طستا | |

* 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: ۱۸۱/۱۱۳۷۷۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۳۰

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی سهام شرکت سرمایه‌گذاری تامین اجتماعی (شستا) در سررسید شهریور ۱۴۰۲، به صورت زیر است:

| | | |
|---|----------------------------------|---|
| ۱,۰۰۰ | | اندازه قرارداد (سهام) |
| شهریورماه ۱۴۰۲ | | ماه‌های قرارداد |
| ۱۴۰۲/۰۶/۰۸ لغایت ۱۴۰۱/۰۶/۰۲ | شهریورماه ۱۴۰۲ | دوره‌های معاملاتی |
| شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی) | | روزها و ساعات معاملاتی |
| بدون محدودیت | بازار | سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت |
| بدون محدودیت | کارگزار | |
| بدون محدودیت | مشتری حقوقی | |
| بدون محدودیت | مشتری حقیقی | |
| ریال | | واحد پولی قیمت |
| در اختیار کارگزار | | سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری |
| یک روز کاری پیش از سررسید | زمان تسویه نقدی | زمان‌بندی فرآیند اعمال |
| سررسید | زمان تسویه فیزیکی | |
| اروپایی | | سبک اعمال |
| غیرخودکار | | نحوه اعمال |
| - تسویه فیزیکی - تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین) | | نوع تسویه در سررسید |
| T+۲ | | تسویه نهایی |
| تسهیم به نسبت | | روش تخصیص |
| ۱ | حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد) | محدودیت‌های معاملاتی |
| ۱۰۰۰ | 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 نزدیک‌ترین عدد صحیح) | | نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه |
| بازه‌های قیمت اعمال | | فاصله قیمت اعمال |
| قیمت مینا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۳,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۳,۰۰۰ ریال و ۴,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۴,۰۰۰ ریال و ۸,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۸,۰۰۰ ریال و ۱۶,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۱۶,۰۰۰ ریال و ۳۰,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۳۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بین ۸۰,۰۰۰ ریال و ۱۶۰,۰۰۰ ریال | | |
| قیمت مینا بالاتر از ۱۶۰,۰۰۰ ریال | | |
| مقدار تغییرات قیمت اعمال | | |
| ۱۰۰ ریال | | |
| ۲۰۰ ریال | | |
| ۲۵۰ ریال | | |
| ۵۰۰ ریال | | |
| ۱,۰۰۰ ریال | | |
| ۲,۰۰۰ ریال | | |
| ۴,۰۰۰ ریال | | |
| ۶,۰۰۰ ریال | | |
| ۱۰,۰۰۰ ریال | | |
| ۲۰,۰۰۰ 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»



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت ساینام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۱۳۷۷۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۳۰

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 × ۰.۱٪

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