



بورس اوراق بهادار تهران
(مکرت سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۴۶۹۸۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۲۰

بسمه تعالی

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم) برای سررسید اسفندماه 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم) در سررسید اسفندماه ۱۴۰۲، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۲ 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 سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۴۶۹۸۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۲۰

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم)

در سررسید اسفندماه ۱۴۰۲، به شرح جدول زیر است:

صندوق سرمایه گذاری سهامی کاریزما		نام شرکت
اهرم		نماد معاملاتی دارایی پایه
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۱۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۱۷	نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی *
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۲۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۱۸	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۳۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۱۹	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۴۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۰	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۵۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۱	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۶۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۲	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۸۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۳	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۰۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۴	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۲۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۵	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۴۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۶	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۶۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۷	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۸۰۰۰-اختیار اهرم	ضهرم ۱۲۲۸	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۱۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۱۷	نماد معاملاتی اختیار فروش / نام فارسی *
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۲۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۱۸	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۳۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۱۹	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۴۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۰	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۵۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۱	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۶۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۲	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۱۸۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۳	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۰۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۴	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۲۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۵	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۴۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۶	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۶۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۷	
۱۴۰۲/۱۲/۲۳-۲۸۰۰۰-اختیار اهرم	طهرم ۱۲۲۸	

* 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: ۱۸۱/۱۳۶۹۸۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۲۰

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم) در سررسید

اسفندماه ۱۴۰۲، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (واحد)		۱۰۰۰
ماه‌های قرارداد		اسفندماه ۱۴۰۲
دوره‌های معاملاتی		اسفندماه ۱۴۰۲
روزها و ساعات معاملاتی		شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت		بازار
		کارگزار
		مشتری حقوقی
		مشتری حقیقی
سقف محدودیت**		بدون محدودیت**
واحد پولی قیمت		ریال
سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری		در اختیار کارگزار
زمان‌بندی فرآیند اعمال		زمان تسویه نقدی
		زمان تسویه فیزیکی
سبک اعمال		اروپایی
نحوه اعمال		غیرخودکار
نوع تسویه در سررسید		- تسویه فیزیکی - تسویه نقدی (در صورت توافق طرفین)
تسویه نهایی		T+۲
روش تخصیص		تسهیم به نسبت
محدودیت‌های معاملاتی		حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)
		حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)
		حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)
		کوچکترین مضرب هر سفارش (واحد)
دامنه نوسان		ندارد.
امکان تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد		وجود دارد.
نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه		قیمت پایانی (گردشده به نزدیک‌ترین عدد صحیح)
فاصله قیمت اعمال		مقدار تغییرات قیمت اعمال
		بازه‌های قیمت اعمال
		قیمت مینا کمتر از ۲۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۲۰۰۰ ریال و ۳۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۳۰۰۰ ریال و ۴۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۴۰۰۰ ریال و ۸۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۸۰۰۰ ریال و ۱۶۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۱۶۰۰۰ ریال و ۳۰۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۳۰۰۰۰ ریال و ۵۰۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۵۰۰۰۰ ریال و ۸۰۰۰۰ ریال
		قیمت مینا بین ۸۰۰۰۰ ریال و ۱۶۰۰۰۰ ریال
قیمت مینا بالاتر از ۱۶۰۰۰۰ ریال		

* بورس می‌تواند حین دوره معاملاتی، ضمن اطلاع رسانی به کارگزاری مربوطه، برای هر یک از مشتریان حقیقی/حقوقی سقف تعداد موقعیت‌های باز را تعیین کرده و در صورت لزوم، گزارشات و مستندات مقتضی را از کارگزار مطالبه نماید.

** بورس می‌تواند حین دوره معاملاتی، ضمن انجام اطلاع رسانی قبلی، محدودیت‌هایی را در این خصوص اعمال نماید.



بورس اوراق بهادار تهران
(مگرت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۴۶۹۸۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۲۰

بسمه تعالی

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
۱۰،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)



بورس اوراق بهادار تهران
(مکرت سامی نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۳۶۹۸۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۳/۲۰

بسمه تعالی

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 موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی

پ) اعلام موافقت با اعمال حداکثری: در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های 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 قراردادهای 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
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین مالی