



بورس اوراق بهادار تهران
(مکرت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۳۶۶۲۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۱۳

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 مهرماه 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 سلام فارابی - سهام (سلام) در سررسید مهرماه ۱۴۰۲، از روز شنبه مورخ ۱۴۰۱/۱۲/۱۳ 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 ساین نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۳۶۶۲۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۱۳

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی-سهم (سلام) در سررسید مهرماه ۱۴۰۲، به شرح جدول زیر است:

صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی		نام شرکت
سلام		نماد معاملاتی دارایی پایه
اختیارخ سلام-۱۶۰۰۰-۱۴۰۲/۰۷/۱۹	۷۰۱۰ ضسلا	نماد معاملاتی اختیار
اختیارخ سلام-۱۸۰۰۰-۱۴۰۲/۰۷/۱۹	۷۰۱۱ ضسلا	خرید / نام فارسی *
اختیارف سلام-۱۶۰۰۰-۱۴۰۲/۰۷/۱۹	۷۰۱۰ طسلا	نماد معاملاتی اختیار
اختیارف سلام-۱۸۰۰۰-۱۴۰۲/۰۷/۱۹	۷۰۱۱ طسلا	فروش / نام فارسی *

* 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 سانی مام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۳۶۶۲۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۲/۱۳

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سلام فارابی-سهام (سلام) در سررسید مهرماه ۱۴۰۲، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (واحد)		۱۰۰۰
ماه‌های قرارداد		مهر ماه ۱۴۰۲
دوره‌های معاملاتی		مهر ماه ۱۴۰۲
روزها و ساعات معاملاتی		شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی) ۱۴۰۲/۰۷/۱۹ لغایت ۱۴۰۱/۱۲/۱۳
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت		بازار
		کارگزار
		مشتری حقوقی
		مشتری حقیقی
واحد پولی قیمت		ریال
سقف وثیقه قابل دریافت از مشتری		در اختیار کارگزار
زمان بندی فرآیند اعمال		زمان تسویه نقدی
		زمان تسویه فیزیکی
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
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
		ریال ۱۰۰
		قیمت مینا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال
		ریال ۲۰۰
		قیمت مینا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۳,۰۰۰ ریال
		ریال ۲۵۰
		قیمت مینا بین ۳,۰۰۰ ریال و ۴,۰۰۰ ریال
		ریال ۵۰۰
		قیمت مینا بین ۴,۰۰۰ ریال و ۸,۰۰۰ ریال
		ریال ۱,۰۰۰
قیمت مینا بین ۸,۰۰۰ ریال و ۱۶,۰۰۰ ریال		
ریال ۲,۰۰۰		
قیمت مینا بین ۱۶,۰۰۰ ریال و ۳۰,۰۰۰ ریال		
ریال ۴,۰۰۰		
قیمت مینا بین ۳۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال		
ریال ۶,۰۰۰		
قیمت مینا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال		
ریال ۱۰,۰۰۰		
قیمت مینا بین ۸۰,۰۰۰ ریال و ۱۶۰,۰۰۰ ریال		
ریال ۲۰,۰۰۰		
قیمت مینا بالاتر از ۱۶۰,۰۰۰ 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.



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
(مگزت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۳۶۶۲۵

تاریخ: ۱۴۰۱/۱۳/۱۳

بسمه تعالی

۸) در زمان تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز فروش به طور پیش فرض، متعهد به تسویه فیزیکی همه موقعیت های باز خود می باشند.

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 می باشد، ولی 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 زمان های تسویه نقدی و تسویه فیزیکی و آخرین قیمت اعمال اعلامی توسط بورس می باشد.

۱۱) هزینه های معاملاتی بازار قراردادهای اختیار معامله (کارمزد معاملاتی و کارمزد اعمال) مطابق با مصوبات سازمان بورس و اوراق بهادار می باشد.

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 می باشد:

تعداد موقعیت های باز فروش نکول کرده × اندازه قرارداد × قیمت اعمال × ۰/۰۱ +

سرمایه گذاران محترم می توانند 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 هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار مراجعه نمایند.

وحید مطهری نیا
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین مالی