



بسمه تعالی

((اطلاعیه))

موضوع: راه اندازی قرارداد آتی صندوق طلای کهربا تحویل بهمن ماه ۱۴۰۲

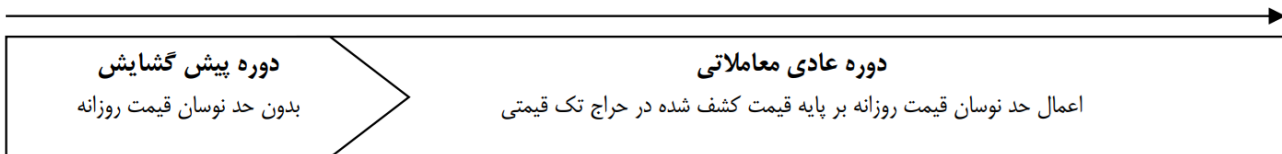
مخاطب: کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر طلای کهربا تحویل بهمن ماه ۱۴۰۲ از روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۹/۰۵ مطابق مشخصات قرارداد پیوست، راه اندازی شده و تا تاریخ ۱۴۰۲/۱۱/۲۴ قابل معامله خواهد بود.

قراردادهای آتی در اولین روز معاملاتی، بدون حد نوسان قیمتی، با دوره پیش گشایش به مدت ۳۰ دقیقه در ابتدای جلسه معاملاتی آغاز و پس از انجام حراج تک قیمتی راس ساعت ۱۰:۳۰ با دوره عادی معاملاتی و اعمال حد نوسان قیمت روزانه ادامه می‌یابد. قیمت پایه قرارداد آتی، همان قیمت کشف شده در حراج تک قیمتی خواهد بود، که مبنای حد نوسان قیمت روزانه برای ادامه معاملات در حراج پیوسته قرار خواهد گرفت. بدیهی است در صورت عدم انجام معامله در حراج تک قیمتی، قرارداد آتی متوقف و مجدداً همین فرآیند، روز کاری بعد تکرار خواهد شد.

محور زمان



منتشر کننده: مدیریت بازارهای مشتقه و صندوق های کالایی

مشخصات قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)

۱	دارایی پایه	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)																					
۲	قرارداد آتی پذیرش شده	قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (قابل معامله)																					
۳	اندازه قرارداد	۱۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)																					
۴	استاندارد تحویل	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)																					
۵	ماه قرارداد	تمامی ماه‌های سال به تشخیص شرکت بورس کالای ایران																					
۶	حد نوسان قیمت روزانه	حداکثر تا (+/-)۵٪ نسبت به قیمت تسویه روزانه‌ی روز کاری قبل																					
۷	دوره معاملات	دوره معاملاتی در هر یک از نمادها در اطلاعیه معاملاتی مربوطه اعلام خواهد شد.																					
۸	محل و دوره تحویل	تحویل مطابق با ضوابط دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای آتی																					
۹	حداقل تغییر قیمت سفارش	۱۰۰ ریال برای هر واحد سرمایه‌گذاری معادل ۱۰۰,۰۰۰ ریال در هر قرارداد																					
۱۰	نحوه محاسبه تضمین	الف) وجه تضمین اولیه: وجه تضمین اولیه با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن، تضمین طی زمان ثابت نبوده و به صورت پویا در حال تغییر خواهد بود. مبنای محاسبه وجه تضمین در این فرمول میانگین قیمت‌های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی در دارایی پایه مربوطه تعیین شده است. وجه تضمین در پایان هر روز معاملاتی بر اساس فرمول زیر تعدیل می‌شود و پس از دو روز کاری اعمال می‌گردد، مراتب تغییرات از طریق سامانه معاملاتی ابزار مشتقه اطلاع رسانی می‌گردد. $A \times \left(\left[\frac{B \times S}{C \times 10} \right] + 1 \right) \times C \times 10 = \text{مبلغ وجه تضمین اولیه}$ <p>A: درصد وجه تضمین اولیه؛ معادل ۱۰٪ B: میانگین قیمت‌های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی دارایی پایه C: برآکت تغییرات وجه تضمین؛ معادل ۱۰۰,۰۰۰ ریال S: اندازه قرارداد؛ معادل ۱۰۰۰ ب) حداقل وجه تضمین: ۷۰ درصد وجه تضمین اولیه</p>																					
۱۱	حداکثر حجم هر سفارش	حداکثر تا ۲۵ قرارداد																					
۱۲	واحد قیمت	ریال به ازای هر واحد سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)																					
۱۳	کارمزدها	کارمزد معاملات: <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>کارمزد خریدار</td> <td>کارمزد فروشنده</td> <td></td> </tr> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد</td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد</td> <td>۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد</td> </tr> </table> <p>کارمزد تسویه و تحویل: <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>کارگزار</td> <td>۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> <td></td> </tr> <tr> <td>بورس کالا</td> <td>۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> <td></td> </tr> <tr> <td>جمع</td> <td>۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> <td></td> </tr> </table></p>	کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده		کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	بورس کالا	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	جمع	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه		بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه		جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه	
کارمزد خریدار	کارمزد فروشنده																						
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد																					
بورس کالا	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۲ ارزش هر قرارداد																					
جمع	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد	۰/۰۰۰۶ ارزش هر قرارداد																					
کارگزار	۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
بورس کالا	۰/۰۰۱ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
جمع	۰/۰۰۱۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه																						
۱۴	نماد معاملاتی	KBMMYY (MM نماد اختصاری ماه قرارداد و YY سال می‌باشد).																					
۱۵	ساعات معامله	شنبه تا چهارشنبه ۱۰ الی ۱۷، پنجشنبه‌ها ۱۰ الی ۱۵، در آخرین روز معاملاتی ۱۰ الی ۱۵																					
۱۶	مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل	تا ۱۵ دقیقه پس از اتمام جلسه معاملاتی آخرین روز معاملاتی																					
۱۷	سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز و معاملات	سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز: • اشخاص حقیقی و حقوقی: ۴,۰۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی. • بازارگردان: ۱۰,۰۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی و قابل افزایش تا ۱۰ درصد موقعیت‌های تعهدی باز در آن نماد در بازار. سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز بازار: • تعداد موقعیت‌های باز کل بازار در هر نماد حداکثر باید معادل یک هزارم سقف واحدهای معاملاتی قابل صدور صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا) می‌باشد.																					

مشخصات قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا)

۱۸	جریمه‌ها	الف) جریمه نکول قراردادهای، شامل جریمه عدم ارائه گواهی آمادگی تحویل مشتریان خریدار و فروشنده، جریمه عدم تامین دارایی پایه از طرف مشتریان فروشنده و جریمه عدم واریز وجه ارزش قرارداد بر اساس قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی از طرف مشتریان خریدار، یک درصد ارزش قرارداد بر اساس قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی است که به نفع مشتری طرف مقابل از مشتری نکول کننده کسر می‌گردد. ب) در خصوص کلیه جرایم ذکر شده فوق، در صورتی که قیمت بازار نقدی دارایی پایه از قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی بیشتر باشد تفاوت این دو نرخ به نفع مشتری خریدار از فروشنده اخذ می‌گردد و همچنین در صورتی که قیمت بازار نقدی دارایی پایه از قیمت تسویه روزانه آخرین روز معاملاتی کمتر باشد تفاوت این دو نرخ به نفع مشتری فروشنده از خریدار اخذ می‌گردد. ج) در تمامی موارد فوق کارمزد تسویه و تحویل هر دو سر معامله به نفع بورس از مشتری نکول کننده دریافت خواهد شد.
۱۹	حجم معاملات مبنای محاسبه قیمت تسویه روزانه	۳۰٪ حجم معاملات انجام شده منتهی به پایان آخرین جلسه معاملاتی هر روز
۲۰	نحوه محاسبه قیمت تسویه نهایی	قیمت تسویه نهایی، قیمت تسویه روزانه در آخرین روز معاملاتی هر قرارداد است.
۲۱	نحوه محاسبه قیمت تسویه لحظه‌ای	قیمت تسویه لحظه‌ای بر اساس میانگین قیمت ۳۰٪ پایانی حجم معاملات منتهی به هر لحظه محاسبه خواهد شد.
۲۲	سایر شرایط	- حداقل اندازه تحویل برای ورود به فرآیند تحویل، حداقل یک قرارداد (معادل ۱۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا) می‌باشد. - توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا) به طور همزمان با توقف و بازگشایی نماد معاملاتی صندوق س. در اوراق بهادار مبتنی بر طلای کهربا (کهربا) انجام می‌شود.