



اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش

سهام بانک ملت (وبملت)

برای سررسید بهمن ماه ۱۴۰۰ 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 بانک ملت (وبملت) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۰، از روز شنبه مورخ ۱۴۰۰/۰۷/۱۰ 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 وجوه 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
(تکرت سهامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۹۵۳۳۱

تاریخ: ۱۴۰۰/۰۷/۰۴

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام بانک ملت (وبملت) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۰، به شرح جدول زیر است:

بانک ملت		نام شرکت
وبملت		نماد معاملاتی دارای پایه
حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان		نحوه درج قرارداد*
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۲۰۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۱	نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی**
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۲۵۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۲	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۳۰۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۳	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۳۵۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۴	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۴۰۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۵	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۴۵۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۶	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۵۰۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۷	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۶۰۰۰-اختیار وبملت	ضممت ۱۱۳۸	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۲۰۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۱	نماد معاملاتی اختیار فروش/ نام فارسی**
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۲۵۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۲	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۳۰۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۳	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۳۵۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۴	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۴۰۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۵	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۴۵۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۶	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۵۰۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۷	
۱۴۰۰/۱۱/۱۳-۶۰۰۰-اختیار وبملت	طملت ۱۱۳۸	

* 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- دارای 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 نمادهای اختیار معامله بر روی سهام بانک ملت (وبملت) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۰، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (سهام)		۱۰۰۰
ماههای قرارداد		بهمن ماه ۱۴۰۰
دورههای معاملاتی	بهمن ماه ۱۴۰۰	۱۴۰۰/۰۷/۱۰ لغایت ۱۴۰۰/۱۱/۱۳
روزها و ساعات معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)	
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت	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	زمان تسویه نقدی	یک روز کاری پیش از سررسید
	زمان 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+2	
روش تخصیص	تسهیم به نسبت	
محدودیت‌های 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.	
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
	۲۰۰ ریال	قیمت مبنا کمتر از ۲۰,۰۰۰ ریال
	۵۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال
	۱,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۱۰۰,۰۰۰ ریال
	۲,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۱۰۰,۰۰۰ ریال و ۲۰۰,۰۰۰ ریال
	۴,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۲۰۰,۰۰۰ ریال و ۴۰۰,۰۰۰ ریال
	۸,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بین ۴۰۰,۰۰۰ ریال و ۸۰۰,۰۰۰ ریال
۱۵,۰۰۰ ریال	قیمت مبنا بالای ۸۰۰,۰۰۰ 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»



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

۹) 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» 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 بورس می‌باشد.

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

۱۱) خریدار اختیار فروش و فروشنده اختیار خرید در صورت تسویه فیزیکی، ملزم به پرداخت مالیات مقطوعی، مطابق با قوانین و مقررات مربوطه خواهد بود.

۱۲) 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 هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار مراجعه نمایند.

نگار نظری
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین