



اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش

سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب)

برای سررسید بهمن ماه ۱۴۰۱ 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 ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۱، از روز دوشنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۷/۲۵ 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
(تکرت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۱۱۶۹۴۰

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۷/۲۰

بسمه تعالی

اطلاعات مربوط به نماد قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بر روی سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۱، به شرح جدول زیر است:

نام شرکت		ذوب آهن اصفهان
نماد معاملاتی دارای پایه		ذوب
نماد معاملاتی اختیار خرید/ نام فارسی*	ضدوب ۱۱۰۰	اختیار ذوب-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۱	اختیار ذوب-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۲	اختیار ذوب-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۳	اختیار ذوب-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۴	اختیار ذوب-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۵	اختیار ذوب-۲۴۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۶	اختیار ذوب-۲۶۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۷	اختیار ذوب-۲۸۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۸	اختیار ذوب-۳۰۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۰۹	اختیار ذوب-۳۲۵۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	ضدوب ۱۱۱۰	اختیار ذوب-۳۵۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
نماد معاملاتی اختیار فروش/ نام فارسی*	طدوب ۱۱۰۰	اختیار ذوب-۱۷۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۱	اختیار ذوب-۱۸۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۲	اختیار ذوب-۱۹۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۳	اختیار ذوب-۲۰۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۴	اختیار ذوب-۲۲۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۵	اختیار ذوب-۲۴۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۶	اختیار ذوب-۲۶۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۷	اختیار ذوب-۲۸۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۸	اختیار ذوب-۳۰۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۰۹	اختیار ذوب-۳۲۵۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲
	طدوب ۱۱۱۰	اختیار ذوب-۳۵۰۰-۱۴۰۱/۱۱/۱۲

* 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
(مهرت سامی عام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-23-01

شماره: ۱۸۱/۱۱۶۹۴۰

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۷/۲۰

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی سهام شرکت ذوب آهن اصفهان (ذوب) در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۱، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (سهام)	۱,۰۰۰
ماه های قرارداد	بهمن ماه ۱۴۰۱
دوره های معاملاتی	بهمن ماه ۱۴۰۱ ۱۴۰۱/۱/۱۲ لغایت ۱۴۰۱/۷/۲۵
روزها و ساعات معاملاتی	شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)
سقف تعداد موقعیت های باز و هم جهت	بازار بدون محدودیت
	کارگزار بدون محدودیت
	مشتری حقوقی بدون محدودیت
	مشتری حقیقی بدون محدودیت
واحد پولی قیمت	ریال
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
محدودیت های معاملاتی	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد) ۱
	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد) ۱۰۰۰
	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 نزدیک ترین عدد صحیح)
فاصله قیمت اعمال	مقدار تغییرات قیمت اعمال
	بازه های قیمت اعمال
	قیمت مینا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال
	۱۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۳,۰۰۰ ریال
	۲۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۳,۰۰۰ ریال و ۴,۰۰۰ ریال
	۲۵۰ ریال
	قیمت مینا بین ۴,۰۰۰ ریال و ۸,۰۰۰ ریال
	۵۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۸,۰۰۰ ریال و ۱۶,۰۰۰ ریال
	۱,۰۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۱۶,۰۰۰ ریال و ۳۰,۰۰۰ ریال
	۲,۰۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۳۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال
	۴,۰۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال
	۶,۰۰۰ ریال
	قیمت مینا بین ۸۰,۰۰۰ ریال و ۱۶۰,۰۰۰ ریال
	۱۰,۰۰۰ ریال
	قیمت مینا بالاتر از ۱۶۰,۰۰۰ 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:

ضریب	مقدار
A	۲۰٪
B	۱۰٪
نسبت حداقل وجه تضمین	۷۰٪
ضریب گرد کردن	۱۰۰،۰۰۰

فرمول گرد کردن وجوه تضمین نیز به صورت زیر است ([] : تابع جزء صحیح):

$$\text{ضریب گرد کردن} \times \left(\left\lfloor \frac{\text{وجه تضمین}^*}{\text{ضریب گرد کردن}} \right\rfloor + 1 \right) = \text{وجه تضمین نهایی}^{**}$$

* 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 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
سرپرست مدیریت عملیات بازار
ابزارهای نوین مالی شرکت
بورس اوراق بهادار تهران