



بورس اوراق بهادار تهران
(مکرت ساهام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۱۳۲۷۵۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۲۴

بسمه تعالی

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما- اهرمی (اهرم) برای سررسید اسفندماه 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 واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم) در سررسید اسفندماه ۱۴۰۱، از روز شنبه مورخ ۱۴۰۱/۰۵/۲۹ 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: ۱۸۱/۱۱۳۲۷۵۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۲۴

بسمه تعالی

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

در سررسید اسفندماه ۱۴۰۱، به شرح جدول زیر است:

صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما		نام شرکت
اهرم		نماد معاملاتی دارایی پایه
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۷۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۰	نماد معاملاتی اختیار خرید / نام فارسی *
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۷۵۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۱	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۸۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۲	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۹۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۳	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۰۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۴	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۱۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۵	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۲۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۶	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۳۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۷	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۴۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۸	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۵۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۹	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۶۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۱۰	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۸۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۱۱	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۷۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۰	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۷۵۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۱	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۸۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۲	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۹۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۳	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۰۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۴	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۱۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۵	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۲۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۶	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۳۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۷	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۴۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۸	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۵۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۰۹	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۶۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۱۰	
۱۴۰۱/۱۲/۲۲-۱۸۰۰۰-اختیار اهرم	۱۲۱۱	

* 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 بی‌تفاوت 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: ۱۸۱/۱۱۳۲۷۵۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۲۴

بسمه تعالی

سایر مشخصات قرارداد نمادهای اختیار معامله بر روی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی کاریزما - اهرمی (اهرم) در سررسید اسفندماه ۱۴۰۱، به صورت زیر است:

اندازه قرارداد (واحد)		۱۰۰۰	
ماه‌های قرارداد		اسفند ماه ۱۴۰۱	
دوره‌های معاملاتی		اسفندماه ۱۴۰۱	
روزها و ساعات معاملاتی		شنبه تا چهارشنبه، ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به‌جز تعطیلات رسمی)	
سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم‌جهت	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	
زمان‌بندی فرآیند اعمال		زمان تسویه نقدی	یک روز کاری پیش از سررسید
		زمان تسویه فیزیکی	سررسید
سیک 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)	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 نزدیک‌ترین عدد صحیح)	
فاصله قیمت اعمال		مقدار تغییرات قیمت اعمال	بازه‌های قیمت اعمال
		ریال ۱۰۰	قیمت مبنا کمتر از ۲,۰۰۰ ریال
		ریال ۲۰۰	قیمت مبنا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۳,۰۰۰ ریال
		ریال ۲۵۰	قیمت مبنا بین ۳,۰۰۰ ریال و ۴,۰۰۰ ریال
		ریال ۵۰۰	قیمت مبنا بین ۴,۰۰۰ ریال و ۸,۰۰۰ ریال
		ریال ۱,۰۰۰	قیمت مبنا بین ۸,۰۰۰ ریال و ۱۶,۰۰۰ ریال
		ریال ۲,۰۰۰	قیمت مبنا بین ۱۶,۰۰۰ ریال و ۳۰,۰۰۰ ریال
		ریال ۴,۰۰۰	قیمت مبنا بین ۳۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال
		ریال ۶,۰۰۰	قیمت مبنا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۸۰,۰۰۰ ریال
		ریال ۱۰,۰۰۰	قیمت مبنا بین ۸۰,۰۰۰ ریال و ۱۶۰,۰۰۰ ریال
ریال ۲,۰۰۰	قیمت مبنا بالاتر از ۱۶۰,۰۰۰ 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، 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
(مگرت ساین نام)

مدیریت ابزارهای نوین مالی

بسمه تعالی

MN-FO-۲۳-۰۱

شماره: ۱۸۱/۱۱۳۳۷۵۴

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۵/۲۴

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 قراردادها 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.

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 × ۰.۱٪

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.

وحید مطهری نیا
سرپرست مدیریت عملیات بازار
ابزارهای نوین مالی شرکت
بورس اوراق بهادار تهران