

اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق

سرمایه گذاری سهامی سپند کاریزما (کاریس) در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۵

به اطلاع متقاضیان و سرمایه گذاران محترم می‌رساند؛ معاملات قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سهامی سپند کاریزما در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۵ از روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۵/۰۶/۲۲ آغاز می‌گردد. معاملات مربوط به این قراردادها تنها به صورت برخط بوده و صرفاً از طریق کارگزاری که مجوز معاملات برخط در این بازار را دارا باشند، قابل انجام خواهد بود. همچنین اتخاذ موقعیت باز فروش در قراردادهای اختیار معامله، تنها به شرط کفایت وجوه تضمین براساس مفاد «دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران» امکان پذیر می‌باشد.

اطلاعات مربوط به نماد معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری سهامی سپند کاریزما در سررسید آذر ماه ۱۴۰۵ به شرح جدول ذیل است:

نام شرکت	صندوق سرمایه گذاری سهامی سپند کاریزما
نماد معاملاتی دارایی پایه	کاریس
نحوه درج قرارداد*	حداقل سه قرارداد: حداقل یک قرارداد در سود، یک قرارداد بی تفاوت، حداقل یک قرارداد در زیان
نماد معاملاتی اختیار معامله خرید / نام فارسی**	ضکاریس ۹۲۷ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۵۵,۰۰۰
	ضکاریس ۹۲۸ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۶۰,۰۰۰
	ضکاریس ۹۲۹ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۶۵,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۰ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۷۰,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۱ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۷۵,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۲ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۸۰,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۳ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۸۵,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۴ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۹۰,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۵ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۹۵,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۶ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۱۰۰,۰۰۰
	ضکاریس ۹۳۷ - اختیارخ کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۱۱۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۲۷ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۵۵,۰۰۰
	طکاریس ۹۲۸ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۶۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۲۹ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۶۵,۰۰۰
نماد معاملاتی اختیار معامله فروش / نام فارسی**	طکاریس ۹۳۰ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۷۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۱ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۷۵,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۲ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۸۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۳ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۸۵,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۴ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۹۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۵ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۹۵,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۶ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۱۰۰,۰۰۰
	طکاریس ۹۳۷ - اختیارف کاریس - ۱۴۰۵۰۹۲۲-۱۱۰,۰۰۰
آذر ماه ۱۴۰۵	
ماه های قرارداد	
دوره معاملاتی	۱۴۰۵/۰۶/۲۲ لغایت ۱۴۰۵/۰۹/۲۲

* 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 ۸ دستورالعمل معاملات قراردادهای اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران، در اولین روز معاملاتی هر زیر گروه 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 معامله - دارایی پایه - قیمت اعمال - تاریخ سررسید است. لازم به ذکر است که نمادهای مذکور با حروف ضی (اختیار معامله خرید) و ط (اختیار معامله فروش) آغاز می‌شوند.

سایر مشخصات نمادهای قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری سهامی سپند کاریزما در سررسید آذر ماه سال ۱۴۰۵ به شرح جدول زیر می‌باشد:

۱,۰۰۰		اندازه قرارداد (واحد)
شنبه تا چهارشنبه ۹:۰۰ الی ۱۲:۳۰ (به جز تعطیلات رسمی)		روز و ساعات معاملاتی
بدون محدودیت	بازار	سقف تعداد موقعیت‌های باز و هم جهت
بدون محدودیت	کارگزار	
۵۰,۰۰۰	مشتري حقوقي	
۱۰,۰۰۰	مشتري حقيقي	
در اختيار کارگزار		سقف وثيقه قابل دریافت از مشتري
یک روز کاری پیش از سررسید	تاریخ تسویه نقدي	زمانبندی فرآیند اعمال
سررسید	تاریخ تسویه فیزیکی	
اروپایی		سبک اعمال
غير خودکار		نحوه اعمال
تسویه فیزیکی یا تسویه نقدي (در صورت توافق طرفین)		نوع تسویه در سررسید
T+۲		تسویه نهایی
تسهیم به نسبت		روش تخصیص
۱	حداقل مقدار هر سفارش (قرارداد)	محدودیت‌های معاملاتی
۱,۰۰۰	حداکثر مقدار هر سفارش (قرارداد)	
۱	حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)	
۱	کوچکترین مضرب هر سفارش (قرارداد)	
ندارد		دامنه نوسان
ریال		واحد پولی قیمت
وجود دارد		امکان تسویه نقدي به کسری از اندازه قرارداد
۰.۰۱ × تعداد موقعیت‌های باز نکول کرده × اندازه قرارداد × قیمت مبنای دارایی پایه (قیمت پایانی)		خسارت
قیمت پایانی (گرد شده به نزدیک‌ترین عدد صحیح)		نحوه تعیین قیمت مبنای دارایی پایه
بازده‌های قیمت اعمال	مقدار تغییرات قیمت اعمال	فاصله قیمت اعمال
قیمت مبنا کمتر از ۱,۰۰۰ ریال	۵۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۱,۰۰۰ ریال و ۲,۰۰۰ ریال	۱۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۲,۰۰۰ ریال و ۵,۰۰۰ ریال	۲۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۵,۰۰۰ ریال و ۱۰,۰۰۰ ریال	۵۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۱۰,۰۰۰ ریال و ۲۰,۰۰۰ ریال	۱,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۲۰,۰۰۰ ریال و ۵۰,۰۰۰ ریال	۲,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بین ۵۰,۰۰۰ ریال و ۱۰۰,۰۰۰ ریال	۵,۰۰۰ ریال	
قیمت مبنا بالای ۱۰۰,۰۰۰ ریال	۱۰,۰۰۰ ریال	

سارا فرخی
مدیر عملیات ابزارهای نوین مالی

پیوست ۱- نحوه محاسبات وجه تضمین:

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
نسبت حداقل وجه تضمین	۷۰٪
ضریب گرد کردن	۱۰,۰۰۰

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

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

*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)

پیوست ۲: نحوه اعمال اوراق اختیار معامله (مطابق با فصل ششم دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرا بورس ایران)

۱. پس از پایان دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله، دارندگان موقعیت باز خرید در صورت تمایل به اعمال قرارداد اختیار معامله، باید درخواست اعمال و نوع تسویه خود را در مهلت مقرر در مشخصات قرارداد به روش تعیین شده در قرارداد فی مابین مشتری و کارگزار، به کارگزار ارائه کند و دارندگان موقعیت باز فروش در صورت اعمال دارندگان موقعیت باز خرید، به طور قطع وارد فرآیند اعمال خواهند شد.
۲. 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.
۳. در تاریخ تسویه نقدی، دارندگان موقعیت باز (اعم از خرید و فروش) که تمایل به تسویه نقدی تمام یا بخشی از موقعیت های باز خود دارند، باید اقدامات زیر را انجام دهند:
الف) اعلام موافقت با تسویه نقدی (اعلام موافقت با تسویه نقدی، به معنای اجرای نهایی این نوع تسویه نخواهد بود).
ب) تعیین تعداد موقعیت های مدنظر برای تسویه نقدی یا 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).
*** چنانچه دارندگان موقعیت باز خرید تمایل به تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد داشته باشند، باید موافقت خود را با تسویه نقدی به کسری از اندازه قرارداد اعلام نمایند.
۴. در تاریخ تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز خرید باید اقدامات زیر را انجام دهند:
الف) اعلام موافقت با تسویه فیزیکی

ب) تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر برای تسویه فیزیکی یا اعلام موافقت با اعمال حداکثری (در صورت اعلام موافقت با اعمال حداکثری، نیازی به تعیین تعداد موقعیت‌های مدنظر خود برای تسویه فیزیکی نخواهد بود).

*** در صورت تمایل به تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی در زبان یا بی تفاوت، دارندگان موقعیت‌های باز خرید باید موافقت خود را با تسویه فیزیکی نمادهای معاملاتی «در زبان یا بی تفاوت» اعلام نمایند.

۵. در زمان تسویه فیزیکی، دارندگان موقعیت باز فروش به‌طور پیش‌فرض، متعهد به تسویه فیزیکی همه موقعیت‌های باز خود می‌باشند.

۶. اعمال به روش تسویه فیزیکی برای همه قراردادهای اعم از «در سود» و «در زیان» قابل انجام می‌باشد، لکن اعمال به روش تسویه نقدی تنها برای قراردادهای اختیار معامله «در سود» امکان‌پذیر 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 فرا بورس ایران می‌باشد.

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

۸. خریدار اختیار معامله فروش و فروشنده اختیار معامله خرید در صورت تسویه فیزیکی، ملزم به پرداخت مالیات مقطوع، مطابق با قوانین و مقررات مربوطه خواهند بود.

۹. در سررسید فیزیکی، در صورت نکول (عدم ایفای تعهدات) دارندگان موقعیت باز فروش، قراردادهای اختیار معامله بر اساس قیمت مبنای دارایی پایه در سررسید فیزیکی، تسویه نقدی شده و مشمول جریمه خواهند شد. جریمه نکول برابر با یک درصد تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول کرده ضرب در ارزش قرارداد بر حسب (قیمت پایانی) قیمت مبنای دارایی پایه می‌باشد:

تعداد موقعیت‌های باز فروش نکول کرده $\times$ اندازه قرارداد $\times$ (قیمت پایانی) قیمت مبنای دارایی پایه $\times 0.01$

سرمایه‌گذاران محترم می‌توانند برای کسب اطلاعات بیشتر به «دستورالعمل معاملات قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرا بورس ایران» و «ضوابط وجه تضمین قرارداد اختیار معامله در بورس اوراق بهادار تهران و فرا بورس ایران» مراجعه نمایند.