



## بسمه تعالی

## ((اطلاعیه))

**موضوع:** راه‌اندازی قرارداد آتی صندوق طلای دنای زاگرس تحویل بهمن ماه ۱۴۰۳

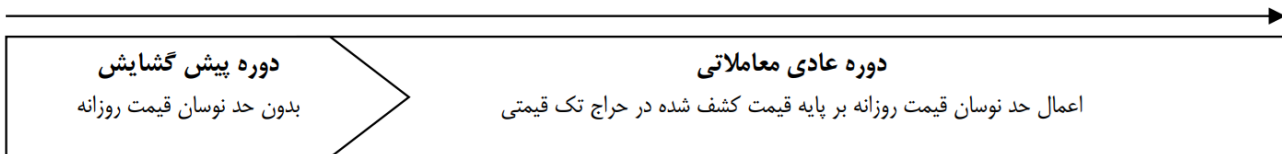
**مخاطب:** کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه

### متن اطلاعیه:

به اطلاع کلیه فعالان معاملات قراردادهای مشتقه می‌رساند، قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق سرمایه گذاری مبتنی بر طلای دنای زاگرس تحویل بهمن ماه ۱۴۰۳ مطابق مشخصات قرارداد پیوست، از روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۳/۰۹/۱۸ راه‌اندازی شده و تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۱۷ قابل معامله خواهد بود.

قراردادهای آتی در اولین روز معاملاتی، بدون حد نوسان قیمتی، با دوره پیش‌گشایش 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 صندوق‌های کالایی

## مشخصات قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر)

|               |  |  |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
|---------------|--|--|---------------|----------------|--|---------|------------------------|------------------------|-----------|------------------------|------------------------|-----|------------------------|------------------------|---------|--|--|-----------|---|--|-----|--|--|
| ۱             | دارایی پایه                                    | واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر)   |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| ۲             | قرارداد آتی پذیرش شده                          | قرارداد آتی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر)   |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| ۳             | اندازه قرارداد                                 | ۱,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر)  |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| ۴             | استاندارد تحویل                                | واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر)   |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| 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                         | ۱۰ ریال برای هر واحد سرمایه‌گذاری معادل ۱۰,۰۰۰ ریال در هر قرارداد  |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| ۱۰            | نحوه محاسبه تضامین                             | <p>الف) وجه تضمین اولیه:</p> <p>وجه تضمین اولیه با توجه به فرمول محاسباتی زیر اخذ خواهد شد که با توجه به آن، تضامین 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.</p> $\text{مبلغ وجه تضمین اولیه} = A \times \left( \left[ \frac{B \times S}{C \times 10} \right] + 1 \right) \times C \times 10$ <p>A: درصد وجه تضمین اولیه؛ معادل ۱۰٪<br/>                     B: میانگین قیمت‌های تسویه روزانه در کلیه سررسیدهای قراردادهای آتی دارایی پایه<br/>                     C: بראکت تغییرات وجه تضمین؛ معادل ۱۰۰,۰۰۰ ریال<br/>                     S: اندازه قرارداد؛ معادل ۱,۰۰۰</p> <p>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 طلای دنای زاگرس (جواهر)  |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |
| ۱۳            | کارمزدها                                       | <p>کارمزد معاملات:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; text-align: center;"> <tr> <td style="width: 33%;">کارمزد خریدار</td> <td style="width: 33%;">کارمزد فروشنده</td> <td style="width: 33%;"></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:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse; text-align: center;"> <tr> <td style="width: 33%;">کارگزار</td> <td style="width: 33%;">۰/۰۰۰۴ ارزش هر قرارداد بر حسب آخرین قیمت تسویه</td> <td style="width: 33%;"></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> | 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                                  | JZMMYY (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        | <p>سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز:</p> <p>اشخاص حقیقی و حقوقی: ۴,۰۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی.</p> <p>بازارگردان: ۱۰,۰۰۰ موقعیت در هر نماد معاملاتی و قابل افزایش تا ۱۰ درصد موقعیت‌های تعهدی باز در آن نماد در بازار.</p> <p>سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز بازار: تعداد موقعیت‌های باز کل بازار در هر نماد حداکثر معادل یک هزارم سقف واحدهای معاملاتی قابل صدور صندوق طلای دنای زاگرس (جواهر) می‌باشد.</p>   |               |                |  |         |                        |                        |           |                        |                        |     |                        |                        |         |  |  |           |   |  |     |  |  |

|    |  |   |
|----|--|---|
| ۱۸ | جریمه ها                                   | 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 می گردد.<br>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 می گردد 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 می گردد.<br>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 لحظه ای             | قیمت تسویه لحظه ای 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 سرمایه گذاری صندوق طلای دنا زاکرس) می باشد.<br>- توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قرارداد آتی واحدهای سرمایه گذاری صندوق طلای دنا زاکرس به طور همزمان با توقف و بازگشایی نماد معاملاتی صندوق طلای دنا زاکرس (جوهر) انجام می شود.  |

