

دستورالعمل اجرایی معاملات قراردادهای آتی در شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام)

مصوب مورخ 1386/12/19، اصلاحی مورخ 1388/09/10 هیئت مدیره سازمان (شامل ماده 52 و 23 تبصره)

فصل اول - تعاریف و کلیات

ماده 1- تعاریف

کلیه اصطلاحات و واژه‌هایی که در ماده یک قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران مصوب آذرماه 1384 مجلس شورای اسلامی تعریف شده‌اند، به همان مفاهیم در این دستورالعمل نیز کاربرد دارند. واژه‌های دیگر دارای معانی ذیل می‌باشند.

1. آخرین روز معاملاتی: آخرین روزی که امکان معامله یک "قرارداد آتی" در "بورس" وجود دارد.
2. اتاق پایاپای: واحدی است که وظیفه تسویه و پایاپای "قرارداد آتی" را برعهده دارد.
3. اختطاریه افزایش وجه تضمین: اختطاری است که به منظور افزایش وجه تضمین مشتریان تا سطح "وجه تضمین اولیه" داده می‌شود.
4. ارزش قرارداد: ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" در زمان اخذ موقعیت تعهدی است.
5. اطلاعیه معاملاتی قرارداد آتی: گزارشی است که برای اطلاع سرمایه‌گذاران از وضعیت "دارائی پایه" و مشخصات "قرارداد آتی" هر نماد معاملاتی در قالب فرم‌هایی که به تصویب هیئت مدیره "بورس" می‌رسد، برای عموم منتشر می‌شود.
6. اعلامیه تحویل: اعلامیه‌ای است که توسط اتاق پایاپای جهت اطلاع خریداران از وضعیت تحویل کالا به آنها ارائه می‌گردد.
7. بازار جبرانی: بازاری است که پس از پایان معاملات روزانه تشکیل می‌گردد. در این بازار محدودیت‌های قیمتی و مقداری معاملات تغییر می‌یابد و معاملات آن تأثیری در محاسبه "قیمت تسویه روزانه" ندارد.
8. بستن موقعیت: تبدیل تعهد از طریق اتخاذ یک "موقعیت تعهدی" جدید معکوس در مقابل "موقعیت تعهدی باز" مشتری
9. بورس: شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام) می‌باشد.
10. به‌روز رسانی حساب‌ها: فرآیندی است که پس از پایان "جلسه معاملات" توسط "اتاق پایاپای" و به ترتیبی که در این دستورالعمل ذکر گردیده است، با هدف کنترل وجوه تضمین مشتریان انجام می‌شود.
11. بیانیه ریسک: فرمی است که قبل از فعالیت در بازار معاملات آتی باید به امضا مشتری رسیده باشد و حاکی از اقرار شخص مذکور نسبت به آگاهی کامل وی از ریسک موجود در این معاملات می‌باشد.
12. پیش پرداخت تحویل: وجهی است که خریداران باید به عنوان پیش پرداخت جهت تحویل کالا نزد "اتاق پایاپای" تودیع نمایند.
13. تحویل: تسلیم دارایی پایه "قرارداد آتی" سررسید شده توسط فروشنده به خریدار.
14. تسویه نقدی: توافق طرفین تعهد مبنی بر سقوط تعهدات ایشان است که بر مبنای آن تسویه نهایی بر حسب آخرین "قیمت تسویه روزانه" صورت پذیرفته و مانده وجوه مسترد می‌گردد.
15. دوره عادی معاملاتی: دوره زمانی است که در آن معاملات بر مبنای "حراج پیوسته" انجام می‌شود.

16. جلسه معاملات: دوره زمانی انجام معاملات یک "قرارداد آتی" است که شامل "دوره گشایش"، "جلسه عادی معاملاتی" و "دوره پایانی معاملات" می شود.
17. حداقل وجه تضمین: حداقلی از سطح "وجه تضمین اولیه" است که برای هر موقعیت تعهدی باز باید موجود باشد. حداقل مذکور در مشخصات هر "قرارداد آتی" تعیین می شود.
18. حراج پیوسته: حراجی است که پس از "دوره گشایش" آغاز و تا پایان جلسه معاملات ادامه می یابد.
19. حراج تک قیمتی: حراجی است که پس از "دوره پیش گشایش" جهت کشف یک نرخ برای اجرای سفارشات ثبت شده و شروع حراج پیوسته انجام می شود.
20. حساب عملیاتی مشتری: حساب بانکی مشتری است که جهت تسویه وجوه توسط "اتاق پایاپای" مورد استفاده قرار می گیرد.
21. خریدار: شخصی است که تعهد به خرید دارایی پایه در سر رسید می نماید و مطابق عرف بازار خریدار نامیده می شود.
22. دارائی پایه: دارائی موضوع "قرارداد آتی پذیرش شده" است.
23. دوره پایانی معاملات: دوره ای است که بازار با آن پایان می یابد و طی آن ورود سفارش جدید و یا ابطال سفارشات امکان پذیر نمی باشد و صرفاً سفارشات که با تغییر قیمت، شرایط برابری قیمت خرید و فروش را احراز می کنند، در این دوره اجرا می شوند.
24. دوره پیش گشایش: دوره ای است که در آن امکان ثبت، تغییر و حذف سفارش وجود دارد و لیکن سفارشات اجرا نمی شود.
25. دوره تسویه روزانه: مدت زمانی است که طی آن عملیات مربوط به تسویه "قرارداد آتی" صورت می گیرد.
26. دوره گشایش: این دوره شامل دوره "پیش گشایش" و "حراج تک قیمتی" است.
27. دوره معاملات: فاصله زمانی اولین لغایت آخرین روز معاملات هر "قرارداد آتی" که در مشخصات آن قرارداد تعریف می شود.
28. رسید انبار: سندی است که توسط انبارهای مورد تأیید "بورس" صادر شده و مالکیت شخص را بر مقدار مشخصی از یک کالا گواهی می کند.
29. روز کاری: روزهای مجاز معاملاتی که توسط هیئت مدیره "بورس" جهت انجام معاملات آتی تعیین می شود.
30. سفارش: دستور مشتری جهت اتخاذ "موقعیت تعهدی" خرید یا فروش
31. فروشنده: شخصی است که تعهد به فروش "دارایی پایه" در سر رسید می نماید و مطابق عرف بازار فروشنده نامیده می شود.
32. قرارداد آتی: قراردادی است که فروشنده براساس آن متعهد می شود در سر رسید معین، مقدار معینی از کالای مشخص را به قیمتی که الان تعیین می کنند بفروشد و در مقابل طرف دیگر قرارداد متعهد می شود آن کالا را با آن مشخصات خریداری کند و برای جلوگیری از امتناع طرفین از انجام قرارداد، طرفین به صورت شرط ضمن عقد متعهد می شوند مبلغی را به عنوان وجه تضمین نزد اتاق پایاپای بگذارند و متعهد می شوند متناسب با تغییرات قیمت آتی، وجه تضمین را تعدیل کنند و اتاق پایاپای از طرف آنان وکالت دارد متناسب با تغییرات، بخشی از وجه تضمین هر یک از طرفین را به عنوان اباحه

صرف در اختیار دیگری قرار دهد و او حق استفاده از آن را خواهد داشت تا در سررسید با هم تسویه کنند .

33. قرارداد آتی پذیرش شده: اوراق بهادار مبتنی بر کالایی است که توسط هیئت پذیرش " بورس " به منظور معاملات آتی در " بورس " پذیرش شده است.

34. قیمت تسویه روزانه: قیمتی است که روزانه جهت به روز رسانی حسابها توسط " بورس " محاسبه و اعلام می گردد.

35. کمیته آتی: کمیته ای است که توسط هیأت مدیره " بورس " جهت انجام وظایف مصرح در این دستورالعمل تشکیل می گردد. اعضای این کمیته باید بر اساس مقررات و با رعایت بی طرفی و انصاف عمل کنند. ضوابط اجرایی فعالیت کمیته توسط هیئت مدیره " بورس " تعیین می شود و مدیرعامل " بورس " مسئولیت نظارت بر حسن انجام وظایف این کمیته را بر عهده دارد.

36. گواهی آمادگی تحویل: سندی است که توسط خریدار و فروشنده " قرارداد آتی " و به منظور آگاهی اتاق پایاپای از آمادگی وی جهت تحویل کالا در قالب فرمهای بورس ارائه می گردد.

37. ماه قرارداد: ماهی است که در آن " قرارداد آتی " سررسید می شود.

38. مشتری: شخصی که به عنوان خریدار یا فروشنده در بازار فعالیت می کند.

39. موقعیت تعهدی: تعهد موضوع یک " قرارداد آتی " در بازار معاملات آتی است.

40. موقعیت تعهدی باز: " موقعیت تعهدی " که در بازار معاملات آتی تسویه نهائی نشده است.

41. موقعیت تعهدی خرید: " موقعیت تعهدی " است که مشتری با اتخاذ آن ، متعهد به خرید دارائی پایه ذکر شده در " قرارداد آتی " می گردد.

42. موقعیت تعهدی فروش: موقعیت تعهدی است که مشتری با اتخاذ آن ، متعهد به فروش دارائی پایه ذکر شده در " قرارداد آتی " می گردد.

43. وجه تضمین: وجهی است که در قالب شرط ضمن عقد از مشتریان دریافت می شود.

44. وجه تضمین اضافی: وجه تضمینی است که در صورت عدم کفایت " وجه تضمین اولیه " جهت پوشش ریسک نوسانات قیمت، از کلیه مشتریان دارای " موقعیت تعهدی باز " اخذ می گردد. این وجه با اعلام اتاق پایاپای و طی مهلت اعلام شده از سوی این اتاق باید توسط مشتریان پرداخت گردد. میزان این وجه توسط " بورس " تعیین می شود.

45. وجه تضمین اولیه: وجه تضمینی است که جهت تضمین ایفای تعهدات مشتریان برای ایجاد یک " موقعیت تعهدی " اخذ می شود. میزان این وجه در مشخصات هر " قرارداد آتی " تعیین می شود.

46. وجه تضمین جبرانی: وجه تضمینی است که مشتریان بعد از دریافت " اخطاریه افزایش وجه تضمین "، باید نزد " اتاق پایاپای " تودیع نمایند.

فصل دوم - مشخصات "قرارداد آتی"

ماده 2- "دارایی پایه" از بین محصولات پذیرفته شده در "بورس" یا کالاهای دارای بازار نقدی قوی به تشخیص هیئت پذیرش، انتخاب می گردد.

ماده 3- "قرارداد آتی" قابل معامله در بورس بر اساس "قرارداد آتی پذیرش شده" تعیین می شود. مشخصات "قرارداد آتی" به پیشنهاد بورس به تصویب هیئت پذیرش خواهد رسید.

ماده 4- مشخصات "قرارداد آتی" باید شامل موارد ذیل باشد:

1- "دارایی پایه"	11- "وجه تضمین اولیه"
2- "قرارداد آتی پذیرش شده"	12- "حداقل وجه تضمین"
3- اندازه قرارداد آتی	13- حداکثر هر سفارش
4- استاندارد تحویل	14- واحد قیمت
5- ماه قرارداد آتی	15- کارمزد معاملات
6- حد نوسان قیمت روزانه	16- نماد معاملاتی
7- "دوره معاملات" شامل:	17- ساعات معامله
- اولین روز معاملاتی	18- مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل
- آخرین روز معاملاتی	19- پیش پرداخت تحویل
8- تاریخ تحویل	20- سقف مجاز موقعیت های معاملاتی باز
9- محل تحویل	21- جریمه ها
10- حداقل تغییر قیمت سفارش	

ماده 5- "بورس" موظف است "اطلاعیه معاملاتی قرارداد آتی" را حداقل 3 روز کاری قبل از آغاز معاملات هر نماد معاملاتی، از طریق سایت رسمی خود به اطلاع عموم برساند.

فصل سوم - ثبت سفارش مشتریان

ماده 6- آن دسته از شرکت های کارگزاری یا کارگزار/ معامله گران، مجاز به انجام معامله آتی خواهند بود که مجوز انجام معاملات آتی را از "سازمان" اخذ نموده و بدین منظور در "بورس" پذیرش شده باشند. فعالیت در این بازار به منزله پذیرش مفاد این دستورالعمل می باشد.

ماده 7- آن دسته از نمایندگان شرکت های کارگزاری امکان دسترسی به سامانه معاملات برای انجام معاملات آتی را خواهند داشت که صلاحیت های لازم را از نظر "سازمان" و "بورس" احراز نموده باشند.

ماده 8- کد مشتری باید قبل از معاملات به درخواست مشتری، توسط کارگزار اخذ شده باشد. جهت اخذ کد مشتری کارگزار باید مدارک زیر را از مشتری دریافت نماید.

1- برای اشخاص حقیقی کپی شناسنامه و کارت ملی که توسط کارگزار برابر اصل شده باشد و برای اشخاص حقوقی مدارک تأسیس و دارندگان امضای مجاز و کپی شناسنامه صاحبان امضای مجاز که توسط کارگزار برابر اصل شده باشد.

2- فرم تکمیل شده درخواست کد مشتری

3- فرم "بیانیه ریسک" به امضای مشتری

تبصره 1: فرم درخواست کد و "بیانیه ریسک" توسط "بورس" تهیه و ابلاغ می‌گردد.

تبصره 2: فعالیت مشتریان دارای کد معاملاتی منوط به تکمیل فرم "بیانیه ریسک" می‌باشد.

ماده 9- فعالیت مشتری در بازار معاملات آتی منوط به افتتاح حساب بانکی توسط مشتری جهت معاملات آتی خواهد بود. بانک یا بانک‌های مورد نظر و نحوه افتتاح حساب توسط "بورس" اعلام خواهد شد.

ماده 10- کارگزاران می‌توانند سفارش مشتریان را به صورت کتبی، تلفنی، از طریق اینترنت و یا سایر روش‌های تعیین شده توسط "بورس" دریافت نمایند، لیکن موظفند کلیه سفارش‌های مذکور را در فرم‌های ثبت سفارش که توسط "بورس" ابلاغ می‌گردد، ثبت نمایند.

ماده 11- کارگزاران مکلفند فرم‌های ثبت سفارش را برای هر مشتری به ترتیب شماره سریال بایگانی و حسب درخواست به "بورس" و یا "سازمان" ارائه نمایند.

ماده 12- جهت رعایت نوبت مشتریان ثبت زمان دقیق و تاریخ، هنگام تکمیل فرم سفارش الزامی است. این قاعده در مورد سفارش‌های الکترونیکی یا تلفنی نیز لازم الاجرا است. کارگزاران مکلفند بر اساس اولویت زمانی دریافت سفارش مشتری، نسبت به اجرای سفارش اقدام نمایند.

ماده 13- کارگزار مکلف است قبل از ثبت سفارش هر مشتری، واریز "وجه تضمین اولیه" به "حساب عملیاتی مشتری" را احراز نماید. در غیر اینصورت مسئولیت پرداخت وجه تضمین اولیه با کارگزار خواهد بود.

ماده 14- انواع سفارشات قابل ارائه توسط مشتری به شرح ذیل می‌باشد:

الف) سفارش به قیمت معین: سفارشی است که باید در قیمت تعیین شده یا بهتر معامله شود.

ب) سفارش به قیمت بازار: سفارشی است که باید با قیمت بازار معامله شود.

ج) سفارش جلوگیری از زیان: سفارشی است که در صورت رسیدن قیمت بازار به یک قیمت مشخص، اجرا می‌شود.

تبصره: سایر انواع سفارشات به پیشنهاد "بورس" به تصویب "سازمان" می‌رسد.

ماده 15- سفارشات به لحاظ اعتبار به انواع زیر دسته‌بندی می‌شود.

الف) اعتبار روزانه [1]: اعتبار تا پایان روز معاملاتی ثبت سفارش

ب) اعتبار جلسه معامله [2]: اعتبار تا پایان جلسه معاملاتی ثبت سفارش

ج) اعتبار همه یا هیچ [3]: اجرای سفارش به شرط انجام تمام آن و در غیر این صورت حذف سفارش

د) اعتبار تا زمان ابطال [4]: اعتبار تا زمان حذف سفارش

ه) اعتبار تا زمان تعیین شده [5]: اعتبار تا زمان تعیین شده در سفارش

ماده 16- سقف اعتباری معاملات هر مشتری و هر کارگزار توسط هیئت مدیره "بورس" تعیین می‌گردد.

فصل چهارم - نحوه انجام معاملات

ماده 17- ساعات و روزهای انجام معامله در "بورس" و مدت هریک از مراحل "جلسه معاملات" توسط هیئت مدیره "بورس" تعیین و اعلام می شود.

تبصره 1: تغییرات ساعات و روزهای معامله حداقل 3 روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.
تبصره 2: در صورت تغییر اضطراری ساعت شروع، خاتمه یا طول مدت جلسه رسمی معاملاتی در اثر اشکالات فنی، بورس باید تغییرات را قبل از اعمال، از طریق سایت رسمی خود اعلام و مستندات مربوط به دلایل بروز شرایط اضطراری را در سوابق خود نگهداری نماید و حسب درخواست، مستندات را به سازمان ارائه نماید.

ماده 18- اجرای سفارشات براساس اولویت قیمت و در صورت تساوی قیمت‌ها براساس اولویت زمانی ورود سفارش به سامانه معاملاتی خواهد بود.

تبصره: هیات مدیره "بورس" می تواند علاوه بر اولویت های مذکور در این ماده، اولویت های دیگری را حسب مورد جهت تصویب به "سازمان" پیشنهاد نماید. این تغییرات حداقل 3 روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.

ماده 19- معاملات "قرارداد آتی" با یک "حراج تک قیمتی" آغاز و با "حراج پیوسته" ادامه می یابد.

ماده 20- "بورس" حداکثر یک ساعت پس از پایان "جلسه معاملات روزانه"، قیمت تسویه را براساس مقررات این دستورالعمل محاسبه و به عموم اعلام می نماید.

ماده 21- دامنه نوسان قیمت روزانه هر "قرارداد آتی" و سقف حجم هر سفارش در زمان پذیرش "قرارداد آتی" مشخص می شود.

تبصره: تغییر دامنه نوسان قیمت و سقف حجم هر سفارش در طول دوره معاملاتی "قرارداد آتی" با پیشنهاد "بورس" و پس از تصویب هیئت پذیرش امکان پذیر می باشد. این تغییرات حداقل 3 روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.

ماده 22- در صورت وجود اطلاعات یا وقوع شرایط اضطراری که تاثیر با اهمیتی بر قیمت "قرارداد آتی" و یا تصمیم سرمایه گذاران دارد "کمیته آتی" می تواند معاملات را حداکثر به مدت یک جلسه معاملاتی متوقف نموده و موضوع را جهت رفع موارد توقف پیگیری نماید.

تبصره: توقف معاملات بیش از یک جلسه معاملاتی تا 3 روز کاری با دستور مدیرعامل "بورس" و بیش از آن با موافقت "سازمان" امکان پذیر می باشد.

ماده 23- در صورت وقوع موارد موضوع ماده 22 این دستورالعمل، "کمیته آتی" معاملات مبتنی یا متاثر از این موارد را تشخیص داده و به مدیرعامل "بورس" ارائه می کند. مدیرعامل "بورس" عدم وقوع این گونه معاملات را اعلام می نماید.

ماده 24- در صورتی که کارگزار خریدار یا فروشنده نسبت به معاملات انجام شده معترض باشند باید اعتراض خود را با ذکر دلایل برای رسیدگی تا 2 ساعت قبل از شروع جلسه معاملاتی روز بعد به "بورس" اعلام نماید. تصمیم "بورس" در این خصوص لازم الاجراست.

ماده 25- "بورس" گزارش آماری معاملات بازار را طبق ضوابط "سازمان" منتشر می کند.

ماده 26- "موقعیت های تعهدی باز" هر کارگزار یا مشتری نباید از سقف مجاز تعیین شده برای نامبرده بیشتر باشد.

تبصره: سقف مجاز "موقعیت های تعهدی باز" هر مشتری یا کارگزار طبق ضوابط "بورس" تعیین می شود.
ماده 27- در صورتیکه ظن استفاده از اطلاعات نهانی یا دستکاری قیمت در معاملات وجود داشته باشد و یا تغییرات غیرعادی قیمت مشاهده گردد، "سازمان" می تواند دستور توقف نامدعاملاتی "قرارداد آتی" را صادر نمایند. در این حالت "بورس" باید بلافاصله اقدام به توقف نماد معاملاتی مربوطه نموده و تا رفع دلایل توقف نماد، موضوع را پیگیری نماید. بازگشایی مجدد نماد با موافقت "سازمان" امکان پذیر خواهد بود.

فصل پنجم - تسویه

ماده 28- هر مشتری باید جهت انجام معاملات آتی، حسابی تحت عنوان "حساب عملیاتی مشتری" نزد بانکی که بدین منظور توسط اتاق پایاپای معرفی می شود، افتتاح نماید. در زمان افتتاح حساب، مشتری اذن تصرف در حساب مذکور را جهت انجام عملیات "به روز رسانی حسابها"، مطابق مقررات این دستورالعمل به اتاق پایاپای خواهد داد.

تبصره: نقل و انتقالات وجوه جهت تسویه حساب مشتریان توسط "اتاق پایاپای" انجام می گیرد.

ماده 29- "اتاق پایاپای" متناسب با تعداد "موقعیت تعهدی باز" هر مشتری و میزان "وجه تضمین اولیه" هر "قرارداد آتی"، اقدام به مسدود نمودن حساب نامبرده می نماید.

ماده 30- "دوره تسویه روزانه" بعد از پایان معاملات آغاز می گردد و تا یک ساعت قبل از پایان جلسه معاملات روز بعد ادامه خواهد یافت.

ماده 31- اتاق پایاپای بر اساس "قیمت تسویه روزانه"، عملیات "به روز رسانی حسابها" را به شرح زیر انجام می دهد:

1- در مورد "موقعیت های تعهدی باز"، تفاوت ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" را بر حسب تفاوت "قیمت تسویه روزانه" روز معاملاتی جاری با روز معاملاتی قبل محاسبه و به حساب مشتریان منظور می نماید.

2- در صورتی که پس از انجام عملیات بند فوق "وجه تضمین اولیه" مشتری از سطح "حداقل وجه تضمین" کمتر شود، اتاق پایاپای "اخطاریه افزایش وجه تضمین" را برای کارگزار مربوطه ارسال می نماید.

ماده 32- کارگزاران موظفند بلافاصله پس از دریافت "اخطاریه افزایش وجه تضمین" مراتب را به اطلاع مشتری مربوطه برسانند تا وی نسبت به پرداخت "وجه تضمین جبرانی" خود ظرف مهلت زمانی مقرر اقدام نماید.

تبصره 1: "وجه تضمین جبرانی" حداکثر تا یک ساعت قبل از پایان جلسه معاملاتی روز کاری بعد باید پرداخت شود.

تبصره 2: ایجاد "موقعیت تعهدی باز" جدید برای مشتریانی که "اخطاریه افزایش وجه تضمین" دریافت کرده اند، پس از پرداخت "وجه تضمین جبرانی" مقدور می باشد.

ماده 33- در صورتیکه "مشتري" تا پايان مهلت مقرر نسبت به واريز "وجه تضمين جبراني" و اصلاح موجودی حساب خود تا سطح "وجه تضمين اوليه" اقدام ننمايد، کارگزار مربوطه حسب دستور اتاق پایاپای اقدام به بستن تمام یا بخشی از "موقعیهای تعهدی باز" مشتري جهت تامین "وجه تضمين جبراني" مورد نیاز می نماید.

ماده 34- در صورتیکه کارگزار نتواند از محل بستن موقعیت معاملاتی مشتري در ساعات معاملات عادی، اقدام به تامین "وجه تضمين جبراني" نماید، در "بازار جبراني" نسبت به اجرای آن اقدام خواهد نمود.

تبصره 1: ضوابط اجرایی "بازار جبراني" به تصویب هیئت مدیره "بورس" خواهد رسید.
تبصره 2: در صورتیکه بستن موقعیت های تعهدی مشتري در "بازار جبراني" پوشش دهنده تعهدات وی نباشد، این تعهدات از محل موجودی کارگزار مربوطه و یا تضمین های وی نزد "اتاق پایاپای" تامین می شود.

ماده 35- در صورتیکه مشتري اقدام به "بستن موقعیت" خود نماید تفاوت "ارزش قرارداد" معکوس با ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" بر حسب آخرین "قیمت تسویه روزانه" به حساب مشتري منظور می شود.

ماده 36- در پايان هر روز معاملاتی، "قیمت تسویه روزانه" براساس رویه های ذیل محاسبه می گردد:
الف - "قیمت تسویه روزانه"، میانگین وزنی قیمت معاملات انجام شده طی 30 دقیقه پایانی آخرین "جلسه معاملات" آن روز معاملاتی است.

ب - در صورتیکه حجم معاملات در دوره زمانی بند الف کمتر از 20 درصد کل معاملات همان روز باشد، "قیمت تسویه روزانه"، میانگین وزنی قیمت معاملات انجام شده طی یک ساعت پایانی آخرین "جلسه معاملات" آن روز معاملاتی است.

ج - در صورتیکه حجم معاملات در دوره زمانی بند ب کمتر از 20 درصد کل معاملات همان روز باشد، "قیمت تسویه روزانه" میانگین وزنی قیمت کل معاملات روزانه "قرارداد آتی" می باشد.

د - در صورتیکه در یک روز معاملاتی، "قرارداد آتی" معامله انجام نشود، میانگین قیمت بهترین سفارش خرید و فروش ثبت شده در سامانه معاملاتی که در محدوده مجاز نوسان قیمت روزانه قرار داشته باشد، در لحظه اتمام آخرین "جلسه معاملات" آن روز، محاسبه و به عنوان "قیمت تسویه روزانه" در نظر گرفته خواهد شد.
ه - در صورتی که تعیین "قیمت تسویه روزانه" به هیچیک از روش های فوق ممکن نباشد، "قیمت تسویه روزانه" توسط "کمیته آتی" و بصورت تئوریک محاسبه می گردد. روش محاسبه تئوریک "قیمت تسویه روزانه" به پیشنهاد "کمیته آتی" به تصویب هیئت مدیره "بورس" خواهد رسید.

ماده 37- اتاق پایاپای پس از اعلام "قیمت تسویه روزانه"، باید تا پايان ساعات کاری همان روز گزارش تسویه را برای کارگزاران ارسال نماید. این گزارش شامل حداقل اطلاعات مربوط به هر کارگزار به تفکیک مشتريان وی به شرح ذیل می باشد:

- 1- تعداد "موقعیت های تعهدی باز" موجود
- 2- تعداد "موقعیت های تعهدی" بسته شده طی روز
- 3- تعداد "موقعیت های تعهدی" باز شده طی روز
- 4- میزان وجه تضمين موجود

5- میزان "وجه تضمین اولیه" مورد نیاز

6- "وجه تضمین جبرانی"

7- کارمزدها

ماده 38- کارگزاران باید پس از دریافت گزارش تسویه، آن را بررسی و در صورت هر گونه مغایرت موضوع را تا 30 دقیقه قبل از شروع بازار روز کاری بعد کتباً به "بورس" گزارش کنند. عدم ارائه گزارش طی مهلت مقرر به "بورس" به منزله تأیید گزارش تسویه و اسقاط حق اعتراض به آن از سوی کارگزاران می‌باشد.

فصل ششم - تحویل کالا و تسویه نهایی

ماده 39 - "قرارداد آتی" پس از آخرین روز معاملاتی، وارد دوره تحویل می‌شود و طرفین "قرارداد آتی" باید نسبت به طی فرایند تحویل اقدام نمایند.

تبصره: چنانچه دارنده موقعیت تعهدی باز خرید یا فروش تصمیم به تحویل کالا بگیرد، طرف مقابل موظف به تحویل طبق ضوابط این دستورالعمل خواهد بود.

ماده 40 - دوره تحویل از روز کاری بعد از آخرین روز معاملاتی شروع و تا پایان "ماه قرارداد" ادامه می‌یابد.

ماده 41 - دارندگان "موقعیت تعهدی فروش" باز، باید طی "مهلت اعلام آمادگی تحویل" توسط کارگزار مربوطه "گواهی آمادگی تحویل" را تحویل اتاق پایاپای دهند.

تبصره: چنانچه مدارک فوق در مهلت مذکور به "بورس" ارائه نگردد، "قرارداد آتی" بر اساس "قیمت تسویه روزانه" روز پایان "مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل" ، "تسویه نقدی" شده و دارنده موقعیت تعهدی فروشی که طبق این تبصره "تسویه نقدی" شده است، مشمول جریمه های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده 42 - دارندگان "موقعیت تعهدی خرید" باز، باید طی "مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل" توسط کارگزار مربوطه "گواهی آمادگی تحویل" را تحویل اتاق پایاپای دهند.

تبصره 1: در صورتی که هیئت پذیرش در مشخصات قرارداد آتی "پیش پرداخت تحویل" تعیین نموده باشد، دارندگان "موقعیت تعهدی خرید" باز مکلفند پیش پرداخت تعیین شده را به حساب اتاق پایاپای واریز نموده و فیش واریز وجه را به همراه "گواهی آمادگی تحویل" به اتاق پایاپای ارائه نمایند.

تبصره 2: چنانچه مدارک فوق در مهلت مذکور به "بورس" ارائه نگردد ، "قرارداد آتی" بر اساس "قیمت تسویه روزانه" روز پایان "مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل" ، "تسویه نقدی" شده و دارنده موقعیت تعهدی خریدی که طبق این تبصره "تسویه نقدی" شده است، مشمول جریمه های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده 43 - پس از پایان "مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل" ، اتاق پایاپای بر اساس اولویت زمانی خریدارانی را که می‌توانند کالا را تحویل گیرند و فروشندگانی را که می‌توانند کالا را تحویل دهند، مشخص نموده و به کارگزاران مربوطه اعلام می‌نماید.

تبصره: قرارداد آتی آندسته از خریداران و فروشندگانی که علی رغم اعلام آمادگی تحویل، به دلیل عدم اعلام آمادگی تحویل از سوی طرف مقابل امکان تحویل ندارد، بر اساس "قیمت تسویه روزانه" روز پایان مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل "، " تسویه نقدی" می شود.

ماده 44 - خریداران و فروشندگانی که در روزهای معاملاتی پس از "مهلت اعلام آمادگی تحویل" اقدام به باز نمودن "موقعیت تعهدی" می نمایند باید "گواهی آمادگی تحویل" را نیز همزمان ارائه نمایند. به هر ترتیب باز نمودن موقعیت تعهدی جدید طی دوره مذکور به منزله اعلام آمادگی تحویل کالای موضوع قرارداد از سوی مشتری نیز می باشد.

ماده 45 - دارندگان "موقعیت تعهدی خرید" در پایان آخرین روز معاملاتی، حداکثر تا ساعت 12 روز کاری بعد از آخرین روز معاملاتی باید کل وجه دارایی تعهد شده "قرارداد آتی" بر حسب "قیمت تسویه روزانه" آخرین روز معاملاتی را به حساب "اتاق پایاپای" واریز و فیش واریزی را توسط کارگزار مربوطه به "اتاق پایاپای" ارائه نمایند.

تبصره: چنانچه وجه فوق در مهلت مقرر پرداخت نگردد، "قرارداد آتی" بر حسب "قیمت تسویه روزانه" آخرین روز معاملاتی " تسویه نقدی" شده و دارنده موقعیت تعهدی خریدی که طبق این تبصره "تسویه نقدی" شده است، مشمول جریمه های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می شود.

ماده 46 - دارندگان "موقعیت تعهدی فروش" در پایان آخرین روز معاملاتی، حداکثر تا ساعت 12 روز کاری بعد از آخرین روز معاملاتی باید "رسید انبار" یا اصل کالای مورد تعهد را حسب تعیین و اعلام بورس، توسط کارگزار مربوطه به "اتاق پایاپای" ارائه نمایند.

تبصره: چنانچه تعهدات موضوع این ماده طی مهلت مقرر انجام نشود، "قرارداد آتی" بر حسب "قیمت تسویه روزانه" آخرین روز معاملاتی " تسویه نقدی" شده و دارنده موقعیت تعهدی فروشی که طبق این تبصره "تسویه نقدی" شده است، مشمول جریمه های مقرر در "قرارداد آتی" می شود.

ماده 47 - اتاق پایاپای حداکثر تا پایان روز کاری پس از "آخرین روز معاملاتی" قرارداد، بر اساس اولویت زمانی، خریدارانی را که می توانند کالا را تحویل گیرند و فروشندگانی را که می توانند کالا را تحویل دهند، مشخص نموده و ضمن واریز وجه معامله به حساب کارگزار فروشنده، "اعلامیه تحویل" را " به کارگزار خریدار ارائه می نماید. کارگزاران مربوطه باید "اعلامیه تحویل" را بلافاصله پس از دریافت از اتاق پایاپای به مشتریان ارائه نمایند. این اعلامیه باید شامل موارد ذیل باشد.

- 1- مقدار و مشخصات کالای تحویلی
- 2- نام فروشنده کالا
- 3- زمان بندی و نحوه تحویل
- 4- آدرس انبارهای محل تحویل کالا و مقدار کالا در هر انبار
- 5- نام و آدرس نماینده فروشنده که خریدار برای تحویل گرفتن باید با آن در تماس باشد
- 6- گزارش معاملات خریدار بر روی "قرارداد آتی" شامل زمان خرید یا فروش و تعداد قراردادهای آتی خریداری شده یا فروخته شده طی دوره
- 7- مشخصات "رسید انبار"
- 8- هزینه های خدمات و کارمزد تحویل کالا

9- سایر اطلاعات مورد نیاز به تشخیص "بورس"

تبصره 1: قرارداد آتی آندسته از خریدارانی که به دلیل عدم ارائه "رسید انبار" از سوی فروشنده یا فروشنده‌گانی که به دلیل عدم واریز وجه از سوی خریدار، امکان تحویل ندارد، بر اساس "قیمت تسویه روزانه" آخرین روز معاملاتی، "تسویه نقدی" می‌شود.

تبصره 2: چنانچه خریدار در موعد مقرر نسبت به دریافت کالا از انبار معرفی شده از طرف فروشنده اقدام ننماید، کلیه هزینه‌ها و خسارات مترتبه بعد از آن تاریخ به عهده خریدار می‌باشد.

ماده 48 - چنانچه خریدار پس از دریافت کالا هرگونه اختلافی در مورد مشخصات کالای دریافتی با مشخصات "قرارداد آتی" مشاهده نماید، باید مراتب را حداکثر تا پانزده روز کاری بعد از پایان دوره تحویل کتباً به "بورس" و هیئت داورى اعلام کند. عدم اعلام مراتب طی مهلت مقرر به منزله تأیید ایفای تعهدات فروشنده و اسقاط حق اعتراض به آن از سوی خریدار می‌باشد.

سایر موارد

ماده 49 - جریمه‌های مقرر در قراردادها از محل موجودی "حساب عملیاتی مشتری" و در صورت عدم تکافو از محل سپرده‌ها و تضامین کارگزار مربوطه نزد اتاق پایپای کسر و به حساب طرف مقابل منظور خواهد شد.

ماده 50 - چنانچه مواعد تعیین شده در این دستورالعمل مصادف با روز تعطیل باشد، آن روز به حساب نمی‌آید و روز پس از تعطیل موعد محسوب می‌شود.

ماده 51 - مدیران و کارکنان شرکت‌های کارگزاری، "بورس" و "سازمان"، همسر و فرزندان تحت تکفل ایشان حق خرید و فروش "قرارداد آتی" را ندارند.

ماده 52 - در صورت نقض هر یک از مفاد این دستورالعمل توسط اشخاص ذی‌ربط، "بورس" موظف است براساس مقررات مربوطه به تخلفات آنها رسیدگی یا حسب مورد مراتب را به مرجع ذی‌صلاح گزارش نماید.