



اطلاعیه تعیین سقف موقعیت بازرگانی در هر شرکت کارگزاری در بازار قراردادهای اختیار معامله بورس اوراق بهادار تهران

به اطلاع کلیه فعالان محترم بازار سرمایه می‌رساند، سقف موقعیت بازرگانی بر مبنای تعهدات هر شرکت کارگزاری، جهت فعالیت در بازار قراردادهای اختیار معامله بورس تهران به شرح زیر تعیین شده و شرکت‌های کارگزاری از تاریخ ۱۴۰۲/۰۶/۰۴، ملزم به اجرای آن هستند.

- موقعیت‌های بازرگانی پوشش داده نشده برای تمامی نمادهای اختیار معامله در هر شرکت کارگزاری، از کسر موقعیت‌های فروش «اختیار خرید پوشش داده شده با خرید سهم پایه»، «نامتقارن خوش‌بینانه قرارداد اختیار معامله خرید» و «نامتقارن بدبینانه قرارداد اختیار معامله فروش» از کل موقعیت‌های بازرگانی هر کد معاملاتی در تمامی نمادهای اختیار معامله حاصل می‌شود.
- مجموع ارزش تعهدات موقعیت‌های بازرگانی پوشش داده نشده هر کارگزاری در هر سررسید قراردادهای اختیار معامله، نباید از ۱۵ درصد حد اعتباری آن کارگزاری بیشتر شود.
- در صورت بیشتر شدن مجموع ارزش تعهدات پوشش داده نشده از سقف فوق، باید امکان اخذ موقعیت فروش فزاینده در کارگزار و سررسید مربوطه، مسدود گردد.
- شرکت‌های کارگزاری که توسط کمیته پایش ریسک بازار به عنوان شرکت‌های کارگزاری پر ریسک طبقه‌بندی شده‌اند، امکان اخذ موقعیت فروش فزاینده در بازار قراردادهای اختیار معامله را ندارند.

وحید مطهری نیا
مدیر عملیات بازار ابزارهای نوین مالی