



بورس اوراق بهادار تهران
(شرکت سهامی عام)

شماره: ۱۸۱/۱۰۶۳۷۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۱/۲۴

پیوست: ندارد

مدیران عامل محترم شرکت‌های کارگزاری

با سلام و احترام

با توجه به پیاده‌سازی فرایند اعمال خودکار اوراق اختیار فروش تبعی از سال جاری طبق رویه ابلاغی سازمان محترم بورس و اوراق بهادار طی نامه شماره ۱۲۲/۹۳۷۷۶ مورخ ۱۴۰۰/۰۸/۲۹، به استحضار می‌رساند نخستین اعمال اوراق تبعی با استفاده از رویه جدید مربوط به اوراق اختیار فروش تبعی پتروشیمی پارس در نماد هپارس ۱۰۲ بوده که تاریخ سررسید آن ۱۴۰۱/۰۲/۰۵ می‌باشد. از این رو نکات مهم در خصوص زمانبندی و نحوه اعمال اوراق مذکور به شرح زیر جهت اطلاع و اعلام به مشتریان آن کارگزاری تقدیم می‌گردد. مقتضی است با هماهنگی با شرکت OMS مربوطه از انجام صحیح فرایند اطمینان حاصل گردد.

- ۱) هر شرکت کارگزاری باید فقط یک شرکت OMS را به عنوان OMS اصلی به شرکت مدیریت فناوری بورس تهران معرفی نماید. تمامی تبادلات اطلاعاتی مابین شرکت مدیریت فناوری بورس تهران و شرکت کارگزاری از طریق OMS اصلی برقرار می‌شود.
- ۲) شرکت مدیریت فناوری بورس تهران، دارایی مشتریان را در اوراق اختیار فروش تبعی از ۴ روز کاری قبل از سررسید به شکل روزانه تنها برای OMS اصلی کارگزار ناظر مشتری ارسال می‌نماید. OMS اصلی کارگزار، نماد و تعداد معتبر اوراق اختیار فروش تبعی مربوط به هر مشتری را از ۳ روز کاری قبل از سررسید، به مشتریان نمایش می‌دهد. برقراری ارتباط بین OMS اصلی با سایر OMS‌های موازی کارگزار و نمایش اطلاعات مشتری در آنها، بر عهده کارگزار می‌باشد.



بورس اوراق بهادار تهران (شرکت سهامی عام)

شماره: ۱۸۱/۱۰۶۳۷۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۱/۲۴

پیوست: ندارد

۳) کارگزار ناظر اوراق اختیار فروش تبعی در هر نماد برای هر مشتری، همان کارگزار ناظر مشتری در سهام پایه نماد مذکور خواهد بود و مشتریان صرفاً از طریق کارگزار ناظر اوراق اختیار فروش تبعی خود قادر به ارسال درخواست اعمال اوراق تبعی می‌باشند.

۴) در صورتی که سهام پایه مشتری دارای کارگزار ناظر نباشد، امکان ثبت درخواست اعمال وجود نداشته و مشتری باید نسبت به تعیین کارگزار ناظر برای سهام پایه خود اقدام نماید. از یک هفته مانده به سررسید اوراق تبعی، مشتری نباید کارگزار ناظر سهام پایه‌ای که قصد اعمال آن را دارد، تغییر دهد.

۵) در هر یک از نمادهای اوراق اختیار فروش تبعی منتشر شده توسط هر یک از بورس‌ها، دسترسی مشتریان برای ارسال درخواست اعمال، توسط OMS مربوطه از ابتدای یک روز کاری قبل از سررسید تا ساعت ۱۴ روز سررسید، در صفحه معاملات آنلاین هر شخص ایجاد می‌گردد. این دسترسی در قالب صفحه‌ای جداگانه و از طریق کارگزار ناظر اوراق اختیار فروش تبعی برای کلیه مشتریان حقیقی و حقوقی فراهم می‌گردد.

۶) سهامداران از یک روز کاری قبل از سررسید هر نماد تبعی، می‌توانند نسبت به ورود و ثبت درخواست‌های اعمال خود از طریق کارگزار ناظر اوراق اختیار فروش تبعی خود اقدام نمایند. این درخواست‌ها تا ساعت ۱۴ روز سررسید از قابلیت ویرایش و یا حذف برخوردار خواهد بود.

۷) شرکت‌های OMS پس از اخذ درخواست‌های اعمال اوراق اختیار فروش تبعی، اطلاعات درخواست شده را مطابق با فرمت اعلامی شرکت مدیریت فناوری، برای شرکت‌های کارگزاری مربوطه (تنها شرکت‌های کارگزاری که OMS را به عنوان OMS اصلی انتخاب نموده‌اند)، تجمیع نموده و در بازه زمانی ۱۵:۴۵ تا ۱۶:۰۰ روز سررسید به شرکت مدیریت فناوری ارسال می‌نمایند.

۸) عرضه‌کننده اوراق تبعی باید در روز سررسید نماد اوراق اختیار فروش تبعی مربوطه و حداکثر تا ساعت ۱۴، اولویت نوع تسویه خود را از طریق کارگزار ناظر اوراق تبعی خود در صفحه مربوطه در سامانه نامک وارد نماید. در صورت عدم ورود اولویت نوع تسویه در مهلت مقرر، اولویت نوع تسویه عرضه‌کننده به شکل پیشفرض برای تمامی اوراق تبعی فروش رفته در نماد مذکور، از نوع «اول نقدی بعد فیزیکی» در نظر گرفته خواهد شد.



بورس اوراق بهادار تهران
(شرکت سهامی عام)

شماره: ۱۸۱/۱۰۶۳۷۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۱/۲۴

پیوست: ندارد

۹) مشتری اوراق تبعی می‌تواند هر دو نوع تسویه ممکن را برای بخشی از دارایی خود در اوراق تبعی انتخاب نماید. گزینه‌های قابل انتخاب برای نوع تسویه، «فیزیکی» و «اول نقدی بعد فیزیکی» می‌باشد. به عنوان مثال اگر فردی ۱۰,۰۰۰ ورقه تبعی در اختیار داشته باشد، می‌تواند اعمال تعداد ۵,۰۰۰ از دارایی خود را به شکل «فیزیکی» و تعداد ۵,۰۰۰ را به شکل «اول نقدی بعد فیزیکی» درخواست نماید. علاوه بر امکان وارد نمودن تعداد درخواست برای هر دو نوع تسویه، دو گزینه با عنوان «اعمال حداکثری» برای مشتری به شکل زیر در نظر گرفته شده است:

■ اعمال حداکثری - فیزیکی

■ اعمال حداکثری - اول نقدی بعد فیزیکی

با انتخاب اعمال حداکثری - فیزیکی تمامی اوراق تبعی معتبر شخص به شکل فیزیکی تسویه خواهد شد. با انتخاب اعمال حداکثری - اول نقدی بعد فیزیکی، تمامی اوراق تبعی معتبر شخص در صورت امکان تسویه نقدی به شکل نقدی و در غیر اینصورت به شکل فیزیکی تسویه خواهد شد. مشتری امکان انتخاب فقط یکی از دو گزینه بالا را دارا بوده و با انتخاب آن، امکان ورود تعداد درخواست در هر دو نوع تسویه غیرفعال خواهد شد.

۱۰) دریافت اطلاعات درخواست‌های اعمال توسط شرکت مدیریت فناوری تنها از طریق OMS اصلی کارگزار انجام خواهد شد. برقراری ارتباط بین OMS اصلی با سایر OMS‌های موازی کارگزار و دریافت اطلاعات درخواست‌های اعمال و انتقال آن به OMS اصلی، بر عهده کارگزار می‌باشد.

۱۱) انجام تسویه نقدی در تسویه «اول نقدی بعد فیزیکی» فقط در صورت پایین‌تر بودن قیمت پایانی سهام پایه در سررسید از قیمت اعمال انجام خواهد شد. در صورتی که قیمت پایانی سهام پایه در سررسید از قیمت اعمال بیشتر باشد، تمامی درخواست‌های تسویه دریافتی از شرکت OMS اصلی به شکل فیزیکی انجام خواهد شد.

۱۲) پس از دریافت تمامی درخواست‌های اعمال از دارنده اوراق اختیار و عرضه‌کنندگان، نحوه اعمال برای هر شخص طبق جدول زیر تعیین خواهد شد.



بورس اوراق بهادار تهران
(شرکت سهامی عام)

شماره: ۱۸۱/۱۰۶۳۷۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۱/۲۴

پیوست: ندارد

ردیف	نوع تسویه درخواستی مشتری	نوع تسویه درخواستی عرضه کننده	نوع تسویه
۱	فیزیکی	فیزیکی	فیزیکی
۲	فیزیکی	اول نقدی بعد فیزیکی	فیزیکی
۳	اول نقدی بعد فیزیکی	فیزیکی	فیزیکی
۴	اول نقدی بعد فیزیکی	اول نقدی بعد فیزیکی	نقدی
		اول نقدی بعد فیزیکی (بالا تر بودن قیمت پایانی سهام پایه در سررسید از قیمت اعمال)	فیزیکی

۱۳) تنها اوراق اختیار فروش تبعی سهامدارانی که سهام پایه را تا روز سررسید نگهداری کرده باشند، قابل اعمال خواهد بود.

۱۴) اگر مجموع درخواست‌های اعمال مشتری در دو نوع فیزیکی و اول نقدی بعد فیزیکی در یک نماد اوراق اختیار فروش تبعی، بیش از تعداد دارایی معتبر اشخاص در آن نماد باشد، ابتدا درخواست تسویه فیزیکی مشتری تا سقف دارایی معتبر ایشان در نماد اوراق تبعی لحاظ شده و سپس مانده تعداد درخواست به عنوان درخواست تسویه از نوع اول نقدی بعد فیزیکی در نظر گرفته می‌شود. به عنوان مثال اگر فردی ۱۰,۰۰۰ ورقه درخواست اعمال ارسال نموده باشد، (تعداد ۵,۰۰۰ به شکل «فیزیکی» و تعداد ۵,۰۰۰ به شکل «اول نقدی بعد فیزیکی») ولی دارایی وی در اوراق تبعی برابر با ۶,۰۰۰ ورقه باشد، نوع تسویه به شکل ۵,۰۰۰ فیزیکی و ۱,۰۰۰ اول نقدی بعد فیزیکی در نظر گرفته می‌شود.

۱۵) مازاد اوراق اختیار فروش تبعی (تعداد اوراق اختیار فروش تبعی بیش از تعداد سهام پایه یا بیش از سقف‌های اعلامی توسط بورس‌ها) قابل اعمال نخواهد بود.



شماره: ۱۸۱/۱۰۶۳۷۱

تاریخ: ۱۴۰۱/۰۱/۲۴

پیوست: ندارد

بورس اوراق بهادار تهران
(شرکت سهامی عام)

دریافت درخواست‌های اعمال تنها با رویه فوق امکان‌پذیر است. در صورت عدم ثبت درخواست اعمال در تاریخ سررسید طی مهلت اعلام شده، اوراق تبعی منقضی شده و قابلیت اعمال ندارد.

مهدی زمانی سبزی
معاون عملیات بازار

رونوشت:

جناب آقای محمود گودرزی - جناب آقای محمد کاوند - سرکار خانم عادلہ شفیعی ثابت مدیرعامل شرکت بورس اوراق بهادار تهران
جناب آقای سید مهدی پارچینی پارچین مدیر نظارت بر بورس ها
جناب آقای خواجه حق وردی معاون نظارت بر بازار شرکت فرابورس ایران
معاون عملیات و نرم افزار شرکت مدیریت فناوری بورس تهران سرکار خانم سپیده تیموریان