

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

فصل اول - تعاریف و کلیات

ماده ۱- تعاریف

کلیه اصطلاحات و واژه‌هایی که در ماده یک قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران مصوب آذرماه ۱۳۸۴ مجلس شورای اسلامی تعریف شده‌اند، به همان مفاهیم در این دستورالعمل نیز کاربرد دارند. واژه‌های دیگر دارای معانی ذیل می‌باشند.

۱. آخرین روز معاملاتی: آخرین روزی که امکان معامله یک "قرارداد آتی" در "بورس" وجود دارد.
۲. اتاق پایاپای: واحدی است که وظیفه تسویه و پایاپای "قرارداد آتی" را برعهده دارد.
۳. اختطاریه افزایش وجه تضمین: اختطاری است که به منظور افزایش وجه تضمین مشتریان تا سطح "وجه تضمین اولیه" و تضامین نقدی تعیین شده توسط کارگزار، داده می‌شود.
۴. ارزش قرارداد: ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" در زمان اخذ موقعیت تعهدی است.
۵. مکرر. اطلاعیه تحویل: اعلامیه‌ای است که جهت اطلاع مشتریان از نحوه انجام امور تحویل، در مهلت تعیین شده در این دستورالعمل توسط بورس منتشر می‌شود.
۶. اطلاعیه معاملاتی قرارداد آتی: گزارشی است که برای اطلاع سرمایه‌گذاران از وضعیت "دارایی پایه" و مشخصات "قرارداد آتی" هر نماد معاملاتی در قالب فرم‌هایی که به تصویب هیئت مدیره "بورس" می‌رسد، برای عموم منتشر می‌شود.
۷. اعلامیه تحویل: اعلامیه‌ای است که توسط اتاق پایاپای جهت اطلاع خریداران از وضعیت تحویل کالا به آنها ارائه می‌گردد.
۸. 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.
۹. بستن موقعیت: تبدیل تعهد از طریق اتخاذ یک "موقعیت تعهدی" جدید معکوس در مقابل "موقعیت تعهدی باز" مشتری
۱۰. بورس: شرکت بورس کالای ایران (سهامی عام) می‌باشد.
۱۱. به‌روز رسانی حساب‌ها: فرآیندی است که توسط اتاق پایاپای یا کارگزار و به ترتیبی که در این دستورالعمل ذکر گردیده است، با هدف کنترل وجوه تضمین مشتریان انجام می‌شود.
۱۲. 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.

۱۲. پیش پرداخت تحویل: وجهی است که خریداران باید به عنوان پیش پرداخت جهت تحویل کالا نزد "اتاق پایاپای" تودیع نمایند.

۱۳. تحویل: تسلیم دارایی پایه "قرارداد آتی" سررسید شده توسط فروشنده به خریدار.

۱۴. تسویه نقدی: توافق طرفین تعهد مبنی بر سقوط تعهدات ایشان است که بر مبنای آن تسویه نهایی حسب مورد بر اساس آخرین "قیمت تسویه روزانه" یا "قیمت تسویه نهایی" مطابق مشخصات قرارداد صورت پذیرفته و مانده وجوه مسترد می‌گردد.

۱۴ مکرر. تسویه نهایی: "تسویه نقدی" یا تحویل فیزیکی که طبق ضوابط این دستورالعمل انجام می‌شود.

۱۵. دوره عادی معاملاتی: دوره زمانی است که در آن معاملات بر مبنای "حراج پیوسته" انجام می‌شود.

۱۶. جلسه معاملات: دوره زمانی انجام معاملات یک "قرارداد آتی" است که شامل "دوره گشایش"، "دوره عادی معاملاتی" و "دوره پایانی معاملات" می‌شود.

۱۷. 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 می‌شود.

۱۸. حراج پیوسته: حراجی است که پس از "دوره گشایش" آغاز و تا پایان جلسه معاملات ادامه می‌یابد.

۱۹. 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 می‌شود.

۲۰. حساب عملیاتی مشتری: حساب بانکی مشتری است که جهت تسویه وجوه توسط "اتاق پایاپای" مورد استفاده قرار می‌گیرد.

۲۱. خریدار: شخصی است که تعهد به خرید دارایی پایه در سر رسید می‌نماید و مطابق عرف بازار خریدار نامیده می‌شود.

۲۲. دارایی پایه: دارایی موضوع "قرارداد آتی" پذیرش شده "است.

۲۲ مکرر. دوره انتقال موقعیت تعهدی باز: دوره‌ای است که در مشخصات قرارداد اعلام می‌شود و به تصویب هیئت پذیرش می‌رسد و در آن موقعیت‌های تعهدی باز مشتریان به ترتیبی که در این دستورالعمل ذکر شده است به نزدیک‌ترین سررسید قراردادهای آتی همان دارایی پایه منتقل خواهد شد.

۲۳. دوره پایانی معاملات: دوره‌ای است که بازار با آن پایان می‌یابد و طی آن ورود سفارش جدید و یا ابطال سفارشات امکان‌پذیر نمی‌باشد و صرفاً سفارشات که با تغییر قیمت، شرایط برابری قیمت خرید و فروش را احراز می‌کنند، در این دوره اجرا می‌شوند.

۲۴. دوره پیش گشایش: دوره‌ای است که در آن امکان ثبت، تغییر و حذف سفارش وجود دارد و لیکن سفارشات اجرا نمی‌شود.

۲۵. دوره تسویه روزانه: مدت زمانی است که طی آن عملیات مربوط به تسویه "قرارداد آتی" صورت می‌گیرد.

۲۶. دوره گشایش: این دوره شامل دوره "پیش گشایش" و "حراج تک قیمتی" است.

۲۷. دوره معاملات: فاصله زمانی اولین لغایت آخرین روز معاملات هر "قرارداد آتی" که در مشخصات آن قرارداد تعریف می‌شود.

۲۸. رسید انبار: سندی است که توسط انبارهای مورد تأیید "بورس" صادر شده و مالکیت شخص را بر مقدار مشخصی از یک کالا گواهی می‌کند.

۲۹. روز کاری: روزهای مجاز معاملاتی که توسط هیئت مدیره "بورس" جهت انجام معاملات آتی تعیین می‌شود.

۳۰. سفارش: دستور مشتری جهت اتخاذ "موقعیت تعهدی" خرید یا فروش

۳۱. فروشنده: شخصی است که تعهد به فروش "دارایی پایه" در سر رسید می‌نماید و مطابق عرف بازار فروشنده نامیده می‌شود.

۳۲. قرارداد آتی: قراردادی است که فروشنده براساس آن متعهد می‌شود در سر رسید معین، مقدار معینی از کالای مشخص را به قیمتی که الان تعیین می‌کنند بفروشد و در مقابل طرف دیگر قرارداد متعهد می‌شود آن کالا را با آن مشخصات خریداری کند و برای جلوگیری از امتناع طرفین از انجام قرارداد، طرفین به صورت شرط ضمن عقد متعهد می‌شوند مبلغی را به عنوان وجه تضمین نزد اتاق پایاپای بگذارند و متعهد می‌شوند 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 تصرف در اختیار دیگری قرار دهد و او حق استفاده از آن را خواهد داشت تا در سر رسید با هم تسویه کنند.

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

۳۴. قیمت تسویه روزانه: قیمتی است که روزانه جهت به روز رسانی حسابها توسط "بورس" محاسبه و اعلام می‌گردد.

۳۴ مکرر. قیمت تسویه لحظه‌ای: قیمتی است که در طی جلسه معاملاتی جهت به روز رسانی "موجودی محاسبه شده مشتریان" محاسبه می‌شود. نحوه محاسبه این قیمت در مشخصات قرارداد اعلام می‌شود و به تصویب هیئت پذیرش خواهد رسید.

۳۴ مکرر یک. قیمت تسویه نهایی: قیمتی است که در آخرین روز معاملاتی به عنوان آخرین قیمت تسویه روزانه مبنای انجام عملیات به روزرسانی حسابها، تسویه و تحویل خواهد بود. نحوه محاسبه این قیمت به تصویب هیئت پذیرش خواهد رسید و در مشخصات قرارداد نیز اعلام خواهد شد.

۳۵. کمیته آتی: کمیته‌ای است که توسط هیئت مدیره "بورس" جهت انجام وظایف مصرح در این دستورالعمل تشکیل می‌گردد. 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 می‌شود و مدیرعامل "بورس" مسئولیت نظارت بر حسن انجام وظایف این کمیته را بر عهده دارد.

۳۶. 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 می‌گردد.

- ۳۶ مکرر. گواهی سپرده کالایی: ورقه بهاداری است که به موجب دستورالعمل "پذیرش انبار و صدور، معامله و تسویه گواهی سپرده کالایی" صادر می شود و مؤید مالکیت دارنده آن بر مقدار معینی کالای سپرده شده در انبار است و پشتوانه آن قبض انباری است که توسط انباردار صادر می شود.
۳۷. ماه/روز قرارداد: ماه/روزی است که در آن "قرارداد آتی" سررسید می شود.
۳۸. مشتری: شخصی که به عنوان خریدار یا فروشنده در بازار فعالیت می کند.
- ۳۸ مکرر. موجودی محاسبه شده مشتری: موجودی محاسباتی مشتری ناشی از اجرای عملیات به روزرسانی حسابها در طی جلسه معاملاتی می باشد.
۳۹. موقعیت تعهدی: تعهد موضوع یک "قرارداد آتی" در بازار معاملات آتی است.
۴۰. موقعیت تعهدی باز: "موقعیت تعهدی" که در بازار معاملات آتی "تسویه نهایی" یا بسته نشده است.
۴۱. موقعیت تعهدی خرید: "موقعیت تعهدی" است که مشتری با اتخاذ آن، متعهد به خرید دارایی پایه ذکر شده در "قرارداد آتی" می گردد.
۴۲. موقعیت تعهدی فروش: موقعیت تعهدی است که مشتری با اتخاذ آن، متعهد به فروش دارایی پایه ذکر شده در "قرارداد آتی" می گردد.
۴۳. وجه تضمین: وجهی است که در قالب شرط ضمن عقد به شرح مندرج در بند ۳۲ این ماده از مشتریان دریافت می شود.
۴۴. وجه تضمین اضافی: وجه تضمینی است که در صورت عدم کفایت "وجه تضمین اولیه" جهت پوشش ریسک نوسانات قیمت، به عنوان بخشی از وجه تضمین اولیه و 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.
۴۵. 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.
۴۶. 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 ۲- "دارایی پایه" از بین کالا یا اوراق بهادار پذیرفته شده در "بورس" یا کالای دارای بازار نقد به تشخیص هیئت پذیرش، انتخاب می‌گردد.

ماده ۳- "قرارداد آتی" قابل معامله در بورس بر اساس "قرارداد آتی پذیرش شده" تعیین می‌شود. مشخصات "قرارداد آتی" به پیشنهاد بورس به تصویب هیئت پذیرش خواهد رسید.

ماده ۴- مشخصات "قرارداد آتی" باید حداقل شامل موارد ذیل باشد:

۱- "دارایی پایه"	۱۳- واحد قیمت
۲- "قرارداد آتی پذیرش شده"	۱۴- کارمزدها
۳- اندازه قرارداد آتی	۱۵- نماد معاملاتی
۴- استاندارد تحویل	۱۶- ساعات معامله
۵- ماه / روز قرارداد آتی	۱۷- مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل
۶- حد نوسان قیمت روزانه	۱۸- پیش پرداخت تحویل
۷- "دوره معاملات" شامل: اولین روز معاملاتی، آخرین روز معاملاتی	۱۹- سقف مجاز موقعیت‌های تعهدی باز و معاملات
۸- محل و دوره تحویل	۲۰- جریمه‌ها
۹- دوره و نحوه انتقال موقعیت‌های تعهدی باز	۲۱- حجم معاملات مبنای محاسبه قیمت تسویه روزانه
۱۰- حداقل تغییر قیمت سفارش	۲۲- نحوه محاسبه "قیمت تسویه نهایی"
۱۱- نحوه محاسبه تضامین شامل "وجه تضمین اولیه"، "حداقل وجه تضمین" و ...	۲۳- نحوه محاسبه "قیمت تسویه لحظه‌ای"
۱۲- حداکثر هر سفارش	۲۴- سایر موارد

ماده ۵- "بورس" موظف است "اطلاعیه معاملاتی قرارداد آتی" را حداقل ۳ روز کاری قبل از آغاز معاملات هر نماد معاملاتی، از طریق سایت رسمی خود به اطلاع عموم برساند.

ماده ۵ مکرر- بورس موظف است اطلاعیه‌های مربوط به تغییرات وجه تضمین اولیه را حداقل ۲ روز کاری قبل، از طریق سایت رسمی خود به اطلاع عموم برساند.

فصل سوم - ثبت سفارش مشتریان

ماده ۶- آن دسته از شرکت‌های کارگزاری یا کارگزار/ معامله‌گران، 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 می‌باشد.

ماده ۷- آن دسته از نمایندگان شرکت‌های کارگزاری امکان دسترسی به سامانه معاملات برای انجام معاملات آتی را خواهند داشت که صلاحیت‌های لازم را از نظر "سازمان" و "بورس" احراز نموده باشند.

ماده ۸- 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.

۱- 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.

۲- فرم تکمیل شده درخواست کد مشتری

۳- فرم "بیانیه ریسک" به امضای مشتری

تبصره ۱: فرم درخواست کد و "بیانیه ریسک" توسط "بورس" تهیه و ابلاغ می‌گردد.

تبصره ۲: فعالیت مشتریان دارای کد معاملاتی منوط به تکمیل فرم "بیانیه ریسک" می‌باشد.

ماده ۹- 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 ۱۰- کارگزاران موظفند سفارش مشتریان را قبل از انجام معامله، بر اساس روش‌های تعیین شده توسط سازمان و مطابق با مقررات مربوط دریافت و ثبت نمایند.

ماده ۱۱- حذف شد.

ماده ۱۲- ثبت زمان دقیق و تاریخ، در فرم‌ها و سیستم‌های ثبت سفارش کارگزاری، جهت رعایت نوبت مشتریان 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 ۱۳- 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 ۱۳ مکرر- وجه تضمین اولیه مذکور در این دستورالعمل، به صورت حداقل تعیین شده و کارگزاران مجاز به تعیین و دریافت تضامین مازاد متناسب با ریسک مشتریان‌شان می‌باشند.

تبصره ۱: در صورتی که بخشی از تضامین موضوع این ماده به صورت نقدی تعیین شود، مبلغ نقدی تعیین شده درصدی از "وجه تضمین اولیه" خواهد بود که باید علاوه بر وجه تضمین اولیه در حساب عملیاتی مشتری موجود باشد. مسئولیت احراز و کفایت این تضامین بر عهده کارگزار خواهد بود.

تبصره ۲: علاوه بر تضامین نقدی، کارگزاری می‌تواند مبادرت به تعیین و دریافت تضامین غیر نقدی نیز بنماید.

ماده ۱۳ مکرر یک- کارگزار باید حداقل دو روز کاری قبل از اعمال تضامین برای مشتریان خود، موضوع را از طریق مقتضی به ایشان اطلاع دهد. مشتریان موظف هستند تضامین تعیین شده را در مهلت زمانی مقرر، متناسب با تمامی موقعیت‌های باز خود تامین نمایند. در صورتی که مشتری، تضامین تعیین شده توسط کارگزار را تامین ننماید کارگزار می‌تواند از ثبت یا ارسال سفارشات مشتری به هر طریق، که منجر به افزایش موقعیت تعهدی باز وی گردد خودداری کند.

ماده ۱۳ مکرر دو- در صورتی که معاملات مشتری به دلایلی نظیر اشکالات فنی و اختلالات بانکی، بدون رعایت وجه تضمین اولیه متناسب با موقعیت‌های اخذ شده انجام شود، مشتری موظف است بلافاصله نسبت به تامین وجه تضمین اولیه برای موقعیت‌های اخذ شده خود اقدام نماید یا موقعیت‌های مذکور را ببندد. در غیر این صورت کارگزار موظف است تا پایان روز معاملاتی نسبت به بستن موقعیت‌های باز مشتری که تعهدات وجه تضمین آن‌ها ایفا نشده است اقدام نماید.

ماده ۱۴- 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 ۱۵- سفارشات به لحاظ اعتبار به انواع زیر دسته‌بندی می‌شود.

الف) اعتبار روزانه: اعتبار تا پایان روز معاملاتی ثبت سفارش

ب) اعتبار جلسه معامله: اعتبار تا پایان جلسه معاملاتی ثبت سفارش

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

د) اعتبار تا زمان ابطال: اعتبار تا زمان حذف سفارش

ه) اعتبار تا زمان تعیین شده: اعتبار تا زمان تعیین شده در سفارش

ماده ۱۶- حذف شد.

فصل چهارم - نحوه انجام معاملات

ماده ۱۷- ساعات و روزهای انجام معامله در "بورس" و مدت هریک از مراحل "جلسه معاملات" توسط هیئت مدیره "بورس" تعیین و اعلام می‌شود.

تبصره ۱: تغییرات ساعات و روزهای معامله حداقل ۳ روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.

تبصره ۲: مدیر عامل بورس می‌تواند ساعت شروع، خاتمه و طول جلسه معاملاتی را در صورت بروز اشکالات فنی تغییر دهد. این تغییرات باید از طریق سایت رسمی بورس اطلاع‌رسانی شود. بورس باید مستندات مربوط به اشکالات فنی را در سوابق معاملات خود نگهداری نموده و حسب درخواست به سازمان ارائه دهد.

ماده ۱۸- اجرای سفارشات براساس اولویت قیمت و در صورت تساوی قیمت‌ها براساس اولویت زمانی ورود سفارش به سامانه معاملاتی خواهد بود.

تبصره: هیئت مدیره "بورس" می‌تواند علاوه بر اولویت‌های مذکور در این ماده، اولویت‌های دیگری را حسب مورد جهت تصویب به "سازمان" پیشنهاد نماید. این تغییرات حداقل ۳ روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.

ماده ۱۹- معاملات "قرارداد آتی" با یک "حراج تک قیمتی" آغاز و با "حراج پیوسته" ادامه می‌یابد.

ماده ۲۰- "بورس" حداکثر یک ساعت پس از پایان "جلسه معاملات روزانه"، قیمت تسویه را براساس مقررات این دستورالعمل محاسبه و به عموم اعلام می‌نماید.

ماده ۲۱- دامنه نوسان قیمت روزانه هر "قرارداد آتی" و سقف حجم هر سفارش در زمان پذیرش "قرارداد آتی" مشخص می‌شود.

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 می‌باشد. این تغییرات حداقل ۳ روز کاری قبل از اعمال، باید به اطلاع عموم برسد.

ماده ۲۲- در صورت وجود اطلاعات یا وقوع شرایط اضطراری که تاثیر با اهمیتی بر قیمت "قرارداد آتی" و یا تصمیم سرمایه‌گذاران دارد "کمیته آتی" می‌تواند 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 ۳ روز کاری با دستور مدیرعامل "بورس" و بیش از آن با موافقت "سازمان" امکان پذیر می‌باشد.

ماده ۲۳- در صورت وقوع موارد موضوع ماده ۲۲ این دستورالعمل، "کمیته آتی" معاملات مبتنی یا متاثر از این موارد را تشخیص داده و به مدیرعامل "بورس" ارائه می‌کند. مدیرعامل "بورس" عدم وقوع این گونه معاملات را اعلام می‌نماید.

ماده ۲۳ مکرر- توقف و بازگشایی نمادهای معاملاتی قرارداد آتی با دارایی پایه اوراق بهادار به طور همزمان با توقف و بازگشایی نماد معاملاتی در بازار مربوطه انجام می‌شود.

ماده ۲۴- در صورتی که کارگزار خریدار یا فروشنده نسبت به معاملات انجام شده معترض باشند باید اعتراض خود را با ذکر دلایل برای رسیدگی تا ۲ ساعت قبل از شروع جلسه معاملاتی روز بعد به "بورس" اعلام نماید. تصمیم "بورس" در این خصوص لازم الاجراست.

ماده ۲۵- "بورس" گزارش آماری معاملات بازار را طبق ضوابط "سازمان" منتشر می کند.

ماده ۲۶- "موقعیت های تعهدی باز" بازار، هر کارگزار یا هر مشتری نباید از سقف مجاز تعیین شده در مشخصات "قرارداد آتی" بیشتر باشد.

تبصره ۱: در صورت عدم رعایت سقف تعیین شده به دلیل تغییر موقعیت های تعهدی باز کل بازار، مشتری باید نسبت به بستن موقعیت های تعهدی مزاد بر سقف، مطابق مشخصات قرارداد اقدام نماید.

تبصره ۲: در صورت عدم رعایت سقف تعیین شده به دلیل اشکالات فنی، مشتری باید بلافاصله نسبت به بستن موقعیت های مزاد بر سقف مجاز اقدام نماید، در غیر این صورت کارگزار موظف است تا پایان روز معاملاتی نسبت به بستن موقعیت های مزاد بر سقف مجاز موقعیت های تعهدی باز مشتری اقدام نماید.

ماده ۲۷- 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 نماد معاملاتی "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 ۲۸- هر مشتری باید جهت انجام معاملات آتی، حسابی تحت عنوان "حساب عملیاتی مشتری" نزد بانکی که بدین منظور توسط اتاق پایاپای معرفی می‌شود، افتتاح نماید. در زمان افتتاح حساب، مشتری اذن تصرف در حساب مذکور را جهت انجام عملیات "به‌روزرسانی حساب‌ها"، مطابق مقررات این دستورالعمل به اتاق پایاپای خواهد داد. تبصره: نقل و انتقالات وجوه جهت تسویه حساب مشتریان توسط "اتاق پایاپای" در پایان هر روز معاملاتی انجام می‌گیرد. در صورتی که به دلیل بروز اشکالات فنی و اختلالات در سیستم بانکی "اتاق پایاپای" نتواند تا پایان روز معاملاتی نقل و انتقال وجوه را انجام دهد باید در اولین فرصت پس از رفع اشکال فنی یا اختلال در سیستم بانکی نسبت به نقل و انتقال وجوه اقدام نماید و مستندات مربوط به این موضوع را در سوابق خود نگهداری و حسب درخواست در اختیار سازمان قرار دهد.

ماده ۲۹- "اتاق پایاپای" متناسب با تعداد "موقعیت تعهدی باز" هر مشتری و میزان "وجه تضمین اولیه" هر "قرارداد آتی"، اقدام به مسدود نمودن حساب نامبرده می‌نماید. موجودی مازاد حساب عملیاتی مشتری نسبت به وجه تضمین اولیه و تضامین نقدی تعیین شده توسط کارگزار، به درخواست وی و پس از تأیید کارگزار، قابل برداشت است.

ماده ۳۰- "دوره تسویه روزانه" بعد از پایان معاملات آغاز می‌گردد و تا یک ساعت قبل از پایان جلسه معاملات روز بعد ادامه خواهد یافت.

ماده ۳۱- اتاق پایاپای بر اساس "قیمت تسویه روزانه"، عملیات "به‌روزرسانی حساب‌ها" را به شرح زیر انجام می‌دهد:

۱- در مورد "موقعیت‌های تعهدی" منتقل شده از روز قبل، 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 عملیاتی مشتریان منظور می‌نماید.

۲- در مورد موقعیت‌های تعهدی ایجاد شده در روز جاری، تفاوت ارزش قرارداد با ارزش دارایی تعهد شده به "قیمت تسویه روزانه" روز معاملاتی جاری، محاسبه و به حساب عملیاتی مشتریان منظور می‌گردد.

۳- در صورتی که پس از انجام عملیات بندهای فوق موجودی حساب عملیاتی مشتری از سطح "حداقل وجه تضمین" کمتر شود، "خطاربه افزایش وجه تضمین" توسط اتاق پایاپای یا کارگزار مربوطه، حسب مورد صادر می‌شود.

تبصره: کارگزار، "خطاربه افزایش وجه تضمین" را بر اساس مجموع "وجه تضمین اولیه" و تضامین نقدی تعیین شده توسط خود، صادر می‌کند.

ماده ۳۲- کارگزاران موظفند بلافاصله پس از دریافت "خطاربه 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 ۱: "وجه تضمین جبرانی" حداکثر تا یک ساعت پس از شروع جلسه معاملاتی روز کاری بعد باید پرداخت شود.

تبصره ۲: ایجاد "موقعیت تعهدی باز" جدید برای مشتریانی که "خطاربه افزایش وجه تضمین" دریافت کرده‌اند، پس از پرداخت "وجه تضمین جبرانی" مقدور می‌باشد.

ماده ۳۳- در صورتیکه "مشتري" تا پايان مهلت مقرر نسبت به واريز "وجه تضمين جبراني" و اصلاح موجودي حساب خود تا سطح مجموع "وجه تضمين اوليه" و تضامين نقدي تعيين شده توسط کارگزار، اقدام ننمايد، کارگزار مربوطه اقدام به بستن تمام يا بخشي از "موقعيت‌هاي تعهدي باز" مشتري جهت تامين "وجه تضمين جبراني" مورد نياز مي‌نمايد.

ماده ۳۴- در صورتیکه کارگزار نتواند از محل بستن موقعیت معاملاتی مشتري در ساعات معاملات عادی، اقدام به تامين "وجه تضمين جبراني" نمايد، در "بازار جبراني" نسبت به اجرائی آن اقدام خواهد نمود.

تبصره: ضوابط اجرائی "بازار جبراني" به تصويب هيئت مديره "بورس" خواهد رسيد.

ماده ۳۴ مکرر: در صورتیکه موجودي حساب عملياتی مشتري پوشش دهنده تعهدات وی نباشد تعهدات مشتري از محل موجودي کارگزار مربوطه و يا تضمين‌هاي وی نزد "اتاق پایاپای" تامين می‌شود.

تبصره: کارگزار می‌تواند جهت پوشش ريسک مربوط به اين ماده، تضامين مورد نياز را از مشتري مطابق ماده ۱۳ مکرر دريافت نمايد.

ماده ۳۵- در صورتیکه مشتري اقدام به "بستن موقعيت" خود نمايد تفاوت "ارزش قرارداد" معکوس با ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" بر حسب آخرين "قيمت تسويه روزانه" به حساب مشتري منظور می‌شود.

ماده ۳۵ مکرر - بورس و کارگزاران می‌توانند در راستای مدیریت ريسک مشتريان در طی روز و به صورت مستمر، بر اساس قيمت تسويه لحظه‌ای اعلامی در مشخصات قرارداد عمليات بروزرسانی موجودي محاسبه شده مشتريان را به شرح زیر انجام دهند؛

۱- در مورد موقعيت‌هاي تعهدي منتقل شده از روز قبل، تفاوت ارزش دارایی تعهد شده در "قرارداد آتی" را بر حسب تفاوت قيمت تسويه لحظه‌ای با قيمت تسويه روز معاملاتی قبل محاسبه و به موجودي محاسبه شده مشتريان منظور می‌نمايد.

۲- در مورد موقعيت‌هاي تعهدي ايجاد شده در روز جاری، تفاوت ارزش قرارداد با ارزش دارایی تعهد شده به "قيمت تسويه لحظه‌ای" محاسبه و به موجودي محاسبه شده مشتريان منظور می‌گردد.

۳- در صورتی که پس از انجام عمليات بندهای فوق "موجودي محاسبه شده مشتري" از سطح "حداقل وجه تضمين" کمتر شود، "اخطاربه افزايش وجه تضمين" به تشخيص اتاق پایاپای يا کارگزار، حسب مورد، صادر و مراتب به مشتري اعلام می‌گردد.

تبصره ۱: کارگزار، "اخطاربه افزايش وجه تضمين" را بر اساس مجموع "وجه تضمين اوليه" و تضامين نقدي تعيين شده توسط خود، صادر می‌کند.

تبصره ۲: مبنای اخذ موقعيت تعهدي باز توسط مشتري، "موجودي محاسبه شده مشتري" يا "حساب عملياتی" هر کدام که کمتر باشد خواهد بود.

ماده ۳۵ مکرر ۱ - مشتري موظف است در صورت درخواست کارگزار، ظرف مهلت زمان اعلام شده، نسبت به واريز مابه‌التفاوت "موجودي محاسبه شده مشتري" تا سطح مجموع "وجه تضمين اوليه" و تضامين نقدي موضوع ماده ۱۳ مکرر به حساب عملياتی خود اقدام نمايد. در صورتیکه "مشتري" تا پايان مهلت زمان اعلامی کارگزار نسبت

به واریز وجه مذکور و اصلاح موجودی حساب خود اقدام نمایید، کارگزار می‌تواند اقدام به بستن آن دسته از "موقعیت‌های تعهدی باز" مشتری که تعهدات وجه تضمین آن‌ها ایفا نشده است بنماید.

ماده ۳۶- در پایان هر روز معاملاتی، "قیمت تسویه روزانه" براساس روبه‌های ذیل محاسبه می‌گردد:

الف- "قیمت تسویه روزانه"، میانگین وزنی قیمت درصدی از حجم معاملات انجام شده منتهی به پایان آخرین "جلسه معاملات" آن روز معاملاتی است. درصد مذکور در مشخصات "قرارداد آتی" هر "دارایی پایه" تعیین خواهد شد.

ب- در صورتیکه در یک روز معاملاتی "قرارداد آتی" معامله 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.

ج- در صورتی که تعیین "قیمت تسویه روزانه" به هیچ یک از روش‌های فوق ممکن نباشد، "قیمت تسویه روزانه" توسط "کمیته آتی" و بصورت تئوریک محاسبه می‌گردد. روش محاسبه تئوریک "قیمت تسویه روزانه" به پیشنهاد "کمیته آتی" به تصویب هیئت مدیره "بورس" خواهد رسید.

ماده ۳۷- اتاق پایاپای پس از اعلام "قیمت تسویه روزانه"، باید حداکثر دو ساعت پس از پایان آخرین جلسه معاملاتی همان روز گزارش تسویه را برای کارگزاران ارسال نماید. این گزارش شامل حداقل اطلاعات مربوط به هر کارگزار به تفکیک مشتریان وی به شرح ذیل می‌باشد:

۱- تعداد "موقعیت‌های تعهدی باز" موجود

۲- تعداد "موقعیت‌های تعهدی" بسته شده طی روز

۳- تعداد "موقعیت‌های تعهدی" باز شده طی روز

۴- میزان وجه تضمین موجود

۵- میزان "وجه تضمین اولیه" مورد نیاز

۶- "وجه تضمین جبرانی"

۷- کارمزدها

ماده ۳۸- کارگزاران باید پس از دریافت گزارش تسویه، آن را بررسی و در صورت هر گونه مغایرت موضوع را تا ۳۰ 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 ۳۹ - "قرارداد آتی" از آخرین روز معاملاتی، وارد دوره تحویل می‌شود و طرفین "قرارداد آتی" باید نسبت به طی فرایند تحویل اقدام نمایند. اطلاعیه تحویل حداکثر ۳ روز کاری پیش از آخرین روز معاملاتی منتشر میشود.

تبصره ۱: چنانچه دارنده موقعیت تعهدی باز خرید یا فروش تصمیم به تحویل "دارایی پایه" بگیرد، طرف مقابل موظف به تحویل طبق ضوابط این دستورالعمل خواهد بود.

تبصره ۲: در صورتی که نماد معاملاتی موضوع ماده ۲۳ مکرر، تا آخرین روز معاملاتی قرارداد آتی متوقف باشد، موقعیت‌های تعهدی باز بازار بر اساس آخرین "قیمت تسویه روزانه"، "تسویه نقدی" خواهند شد.

تبصره ۳: در صورت وجود امکان انتقال موقعیت‌های تعهدی باز در مشخصات "قرارداد آتی"، پس از اتمام فرآیند تحویل در صورت درخواست طرفین تمامی موقعیت‌های باز مشتریانی که منجر به تحویل نشده است به نزدیکترین سررسید فعال قرارداد آتی مربوطه منتقل خواهد شد.

ماده ۴۰ - حذف شد.

ماده ۴۱ - دارندگان "موقعیت تعهدی فروش" باز، باید طی مهلت ارائه "گواهی 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"، مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود و دارنده موقعیت تعهدی فروش موضوع این تبصره، مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده ۴۲ - دارندگان "موقعیت تعهدی خرید" باز، باید طی مهلت ارائه "گواهی آمادگی تحویل" توسط کارگزار مربوطه "گواهی آمادگی تحویل" را تحویل اتاق پایاپای دهند.

تبصره ۱: 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 ۲: چنانچه مدارک فوق در مهلت مذکور به "بورس" ارائه نگردد، "قرارداد آتی" بر اساس "قیمت تسویه روزانه" روز پایان مهلت ارائه گواهی آمادگی تحویل، مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود و دارنده موقعیت تعهدی خرید موضوع این تبصره، مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده ۴۳ - 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"، مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود.

ماده ۴۴ - خریداران و فروشندگانی که در روزهای معاملاتی پس از "مهلت اعلام آمادگی تحویل" اقدام به باز نمودن "موقعیت تعهدی" می‌نمایند 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 می‌باشد.

ماده ۴۵ - دارندگان "موقعیت تعهدی خرید" در پایان آخرین روز معاملاتی، تا پایان مهلت تعیین شده توسط هیئت مدیره بورس که در اطلاعیه تحویل درج می‌گردد، باید کل وجه دارایی تعهد شده "قرارداد آتی" بر حسب "قیمت تسویه نهایی" را به حساب اعلامی توسط "اتاق پایاپای" واریز نماید.

تبصره: چنانچه وجه فوق در مهلت مقرر پرداخت نگردد، "قرارداد آتی" مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، بر اساس "قیمت تسویه نهایی"، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود و دارنده موقعیت تعهدی خرید موضوع این تبصره، مشمول جریمه‌های مقرر در مشخصات "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده ۴۶ - دارندگان "موقعیت تعهدی فروش" در پایان آخرین روز معاملاتی، تا پایان مهلت تعیین شده توسط هیئت مدیره بورس که در اطلاعیه تحویل درج می‌گردد، باید "رسید انبار"، گواهی سپرده کالایی 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" مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، بر اساس "قیمت تسویه نهایی"، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود و دارنده موقعیت تعهدی فروش موضوع این تبصره، مشمول جریمه‌های مقرر در "قرارداد آتی" می‌شود.

ماده ۴۷ - اتاق پایاپای حسب ترتیب مندرج در "اطلاعیه تحویل" حداکثر تا پایان روز کاری پس از "آخرین روز معاملاتی" قرارداد، بر اساس اولویت زمانی، خریدارانی را که می‌توانند کالا را تحویل گیرند و فروشندگانی را که می‌توانند کالا را تحویل دهند، مشخص نموده و ضمن واریز وجه معامله به حساب کارگزار فروشنده، "اعلامیه تحویل" را به کارگزار خریدار ارائه می‌نماید. کارگزاران مربوطه باید "اعلامیه تحویل" را بلافاصله پس از دریافت از اتاق پایاپای به مشتریان ارائه نمایند. این اعلامیه باید شامل موارد ذیل باشد:

۱- مقدار و مشخصات کالای تحویلی

۲- زمان بندی و نحوه تحویل

۳- آدرس انبارهای محل تحویل کالا و مقدار کالا در هر انبار

۴- گزارش معاملات خریدار بر روی "قرارداد آتی" شامل زمان خرید یا فروش و تعداد قراردادهای آتی خریداری شده یا فروخته شده طی دوره

۵- مشخصات "رسید انبار"

۶- هزینه‌های خدمات و کارمزد تحویل کالا

۷- سایر اطلاعات مورد نیاز به تشخیص "بورس"

تبصره ۱: قرارداد آتی آن دسته از خریدارانی که به دلیل عدم ارائه "رسید انبار" از سوی فروشنده، یا آن دسته از فروشندگانی که به دلیل عدم واریز وجه از سوی خریدار، امکان تحویل ندارد، مطابق مشخصات قرارداد، حسب مورد، بر اساس "قیمت تسویه نهایی"، "تسویه نقدی" شده یا در صورت درخواست طرفین وارد دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز می‌شود.

تبصره ۲: 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 ۴۷ مکرر- اتاق پایاپای حداکثر تا پایان روز کاری پس از "آخرین روز معاملاتی" قرارداد، هزینه انبارداری و کارمزد تحویل کالا را محاسبه و به کارگزار فروشنده اعلام می‌نماید و در صورت لزوم هزینه انبارداری را از حساب عملیاتی فروشنده کسر و به حساب انبار واریز می‌نماید.

ماده ۴۸ - 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 داوری اعلام کند. عدم اعلام مراتب طی مهلت مقرر به منزله تأیید ایفای تعهدات فروشنده و اسقاط حق اعتراض به آن از سوی خریدار می‌باشد.

ماده ۴۸ مکرر - انتقال موقعیت‌های باز در قراردادهای آتی به شرح زیر انجام خواهد شد:

۱- تمامی موقعیت‌های باز مشتریان در نماد معاملاتی سررسید شده، با ایجاد موقعیت تعهدی باز جدید، به نماد معاملاتی با نزدیک ترین سررسید منتقل خواهد شد. نحوه این انتقال در مشخصات قرارداد آتی اعلام می‌گردد.

۲- خالص موقعیت‌های تعهدی باز مشتری در نماد معاملاتی جدید، بر اساس تعداد و خرید یا فروش بودن موقعیت‌های منتقل شده و موقعیت‌های تعهدی باز موجود در آن نماد، اعلام خواهد شد.

ماده ۴۸ مکرر یک - در دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز، نمادهای معاملاتی مربوطه متوقف خواهند بود.

تبصره: دوره انتقال موقعیت‌های تعهدی باز در مشخصات قرارداد تعیین خواهد شد.

سایر موارد

ماده ۴۹ - جریمه‌های مقرر در قراردادها از محل موجودی "حساب عملیاتی مشتری" و در صورت عدم تکافو از محل سپرده‌ها و تضامین کارگزار مربوطه نزد اتاق پایاپای کسر و به حساب طرف مقابل منظور خواهد شد.

ماده ۵۰ - 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 ۵۱ - مدیران و کارکنان شرکت‌های کارگزاری، "بورس" و "سازمان"، همسر و فرزندان تحت تکفل ایشان حق خرید و فروش "قرارداد آتی" را ندارند.

ماده ۵۱ مکرر - شرکت‌های کارگزاری مجاز به اعطای اعتبار به مشتریان در معاملات قراردادهای آتی نیستند.

ماده ۵۲ - در صورت نقض هر یک از مفاد این دستورالعمل توسط اشخاص ذی‌ربط، به تخلفات آنها توسط مرجع صالح رسیدگی به تخلفات، بر اساس مقررات مربوطه رسیدگی خواهد شد.

ماده ۵۳ - در صورت انسداد حساب بانکی مشتری از طرف بانک عامل، به هر علت از جمله دستور قضایی یا اختلالات بانکی، کارگزار موظف است بلافاصله پس از اعلام بورس، مراتب را به اطلاع مشتری برساند تا مشتری نسبت به بستن تمام موقعیت‌های تعهدی باز خود، حداکثر تا یک ساعت قبل از پایان جلسه معاملاتی همان روز اقدام نماید. در صورتیکه مشتری تا پایان مهلت مذکور نسبت به بستن موقعیت‌های تعهدی باز خود اقدام ننماید، کارگزار اقدام به بستن تمام موقعیت‌های تعهدی باز مشتری می‌نماید. در صورتیکه کارگزار نتواند در ساعات معاملات عادی، اقدام به بستن تمام موقعیت‌های تعهدی باز مشتری نماید، در "بازار جبرانی" نسبت به اجرای آن اقدام خواهد نمود.

ماده ۵۴ - نحوه اطلاع رسانی کارگزار به مشتریان در قرارداد فی ما بین مشتری و کارگزار ذکر خواهد شد.

ماده ۵۵ - در صورت بروز شرایط اضطراری مطابق بند الف این ماده، بورس می‌تواند اقدامات اجرایی موضوع بند ب این ماده را بر اساس ترتیبات مقرر در تبصره‌های ذیل آن انجام دهد:

الف) معیارهای تشخیص شرایط اضطراری

۱) افزایش یا کاهش قیمت دارایی پایه در بازار نقدی دارائی پایه به میزانی بیش از دو برابر حد نوسان قیمت روزانه بازار قراردادهای آتی مبتنی بر آن که تغییرات مذکور باید بر اساس اعلام مراجع قابل اتکا احراز و در صورت امکان مستند گردد.

۲) وقوع رویدادهای غیر مترقبه از قبیل سیل، زلزله، آتش‌سوزی، شرایط بد آب و هوایی، نا آرامی‌های اجتماعی، عملیات تروریستی، جنگ و یا هر واقعه دیگری که امکان ارائه خدمات معاملاتی و یا تسویه را برای بورس غیر ممکن سازد و یا برای آن تهدید جدی ایجاد نماید.

۳) ایجاد گره معاملاتی در معاملات قراردادهای آتی مبتنی بر یک دارایی پایه که در صورت وقوع همزمان هر دو شرط زیر احراز می‌گردد:

۳-۱) وجود صف سفارش خرید یا فروش در تمامی نمادهای معاملاتی قراردادهای آتی مبتنی بر آن دارایی پایه، به ترتیبی که در هر نماد معاملاتی صف سفارش به میزان حداقل ۳ درصد موقعیت‌های تعهدی باز بازار وجود داشته باشد.

۳-۲) در صورتی که طی یک ساعت متوالی از جلسه معاملاتی به طور میانگین کمتر از ۱ درصد موقعیت‌های تعهدی باز بازار به ازای هر نماد معاملاتی قرارداد آتی مبتنی بر آن دارایی پایه، معامله شود.

۴) عدم شفافیت اطلاعاتی درخصوص بازار دارایی پایه یا مولفه‌های تاثیرگذار بر قیمت آن و تصمیم سرمایه‌گذاران بازار قراردادهای آتی، به نحوی که مخاطرات بازار معاملات قراردادهای آتی آن دارایی را به شدت افزایش دهد.

۵) در صورتی که درصد اختلاف قیمت‌ها در بازار آتی با قیمت نقدی دارایی پایه براساس نرخ بازده بدون ریسک از سقف مشخصی که توسط هیئت مدیره بورس برای هر دارایی پایه تعیین می‌شود عبور کند.

ب) اقدامات اجرایی

- ۱) تغییر ساعت شروع و خاتمه جلسه معاملاتی تا رفع شرایط اضطراری؛
- ۲) ممانعت از اخذ موقعیت تعهدی فزاینده در یک جهت یا هر دو جهت؛
- ۳) الزام به رعایت اولویت ثبت سفارش برای مشتریان دارای اختطاریه افزایش وجه تضمین و الزام کارگزاران به ثبت سفارش مشتریان دارای اختطاریه افزایش وجه تضمین در دوره پیش‌گشایش؛
- ۴) امکان ورود موقعیت‌های باز آن دسته از مشتریانی که اختطاریه افزایش وجه تضمین دریافت نکرده‌اند به بازار جبرانی با درخواست ایشان؛

۵) تعیین سقف برای تغییرات قیمت در بازار جبرانی؛

۶) اعمال محدودیت برداشت وجوه مازاد حساب تضمین مربوط به مشتریان توسط ایشان؛

۷) عدم تشکیل بازار جبرانی حداکثر طی ۲ روز متوالی معاملاتی با موافقت کارگزاران مربوطه؛

۸) تغییر (افزایش یا کاهش) حدود نوسان قیمت قراردادهای آتی یک دارای پایه حداکثر به میزان دامنه نوسان روزانه قیمت طی یک یا چند نوبت؛

۹) تعیین سقف قیمتی برای معاملات آتی از طریق محدود کردن حدود نوسان قیمت روزانه قرارداد آتی در یک جهت؛

۱۰) الزام به کاهش درصدی از موقعیت‌های باز مشتریانی که موقعیت‌های تعهدی باز ایشان در سود است طی جلسه معاملات؛

۱۱) الزام به کاهش سقف موقعیت‌های تعهدی باز مشتریان طی جلسه معاملات؛

۱۲) الزام به بستن کلیه موقعیت‌های تعهدی باز بازار بر اساس آخرین قیمت تسویه.

تبصره ۱: اقدامات بندهای ۱ لغایت ۷ بند ب این ماده با تصمیم بورس و بندهای ۸ لغایت ۱۲ آن با تصمیم بورس و پس از اخذ موافقت سازمان قابل اجرا خواهد بود.

تبصره ۲: در صورت وقوع مورد ۵ بند الف، به ترتیب اقدامات اجرایی ۹ و ۲ تا رفع شرایط مورد مذکور قابل اعمال است. در صورت عدم رفع شرایط مذکور پس از سه روز کاری، سایر اقدامات اجرایی در دستور کار قرار خواهد گرفت.

تبصره ۳: در صورت ابلاغ هر یک از اقدامات اجرایی فوق توسط بورس، کارگزاران مکلف به اجرای اقدامات مذکور می‌باشند. عدم اجرای اقدامات ابلاغی بورس توسط کارگزار، تخلف محسوب شده و به این تخلفات طبق مقررات مربوطه رسیدگی خواهد شد.

تبصره ۴: شرایط اضطراری با رفع معیارهای موضوع بخش الف این ماده، پایان می‌یابد.

تبصره ۵: بورس باید قبل از اعمال اقدامات اجرایی فوق موضوع را از طریق سایت رسمی خود اطلاع‌رسانی نماید. در صورتی که براساس سایر مقررات، زمانبندی دیگری جهت اطلاع‌رسانی اقدامات اجرایی موضوع این ماده مشخص شده باشد، رعایت مقررات مذکور در شرایط اضطراری موضوع این ماده، ضروری نخواهد بود.

تبصره ۶: بورس می‌تواند قبل از صدور اطلاعیه اعمال اقدامات اجرایی از طریق سایت رسمی خود، نمادهای معاملاتی مربوطه را متوقف نموده و پس از صدور اطلاعیه، نسبت به برگزاری دوره پیش‌گشایش جهت ادامه فعالیت بازار اقدام نماید. مدت دوره گشایش، حفظ و یا حذف سفارش‌های قبلی با تصمیم بورس تعیین می‌گردد.

این دستورالعمل در ۶۷ ماده و ۳۸ تبصره در تاریخ ۱۳۸۶/۱۲/۱۹ و اصلاحیه‌های مورخ ۱۳۸۸/۹/۱۰ و ۱۳۹۱/۷/۸ و ۱۳۹۶/۰۶/۱۵ و ۱۳۹۷/۶/۷ و ۱۳۹۷/۱۲/۱۵ به تصویب هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار رسید.