

اطلاعیه عرضه اوراق اختیار فروش تبعی با هدف بیمه واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات امین شهر از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۳/۱۲/۰۱

به اطلاع فعالان محترم می‌رساند، بانک شهر (سهامی عام) در نظر دارد اوراق اختیار فروش تبعی با هدف بیمه واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات امین شهر یکم (با نماد امین‌شهر) را منتشر نماید. عرضه اوراق فوق از روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۳/۱۲/۰۱ با شرایط ذیل در فرا بورس ایران آغاز می‌شود:

مشخصات اوراق اختیار فروش تبعی:

نماد معاملاتی	هامین شهر ۰۴۱۲
دارایی پایه	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات امین شهر یکم (امین شهر)
عرضه کننده	بانک شهر
کارگزار عرضه کننده	کارگزاری شهر
حداقل حجم عرضه روزانه	۱,۰۰۰,۰۰۰ ورقه
کل حجم عرضه	۸۴۰,۰۰۰,۰۰۰ ورقه
محدودیت‌های خرید هر کد معاملاتی	اشخاص حقیقی و حقوقی: بدون محدودیت
دامنه نوسان	ندارد
محدودیت‌های معاملاتی	حداقل مقدار هر سفارش (ورقه)
	۱
	حداکثر مقدار هر سفارش (ورقه)
	مطابق با پیام ناظر در روز عرضه
محدودیت‌های معاملاتی	حداقل تغییر قیمت هر سفارش (ریال)
	۱
محدودیت‌های معاملاتی	مضرب هر سفارش
	۱
قیمت اعمال	۱۶,۶۳۲ ریال
دوره معاملاتی	از تاریخ ۱۴۰۳/۱۲/۰۱ لغایت ۱۴۰۴/۱۲/۰۱
سررسید	۱۴۰۴/۱۲/۰۱
شرایط تسویه تعهدات	- خرید واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات امین شهر یکم (نماد امین‌شهر) توسط بانک شهر به قیمت اعمال از دارنده اوراق اختیار فروش تبعی - تسویه نقدی در صورت توافق طرفین
معاملات ثانویه	ندارد
نحوه تعیین قیمت مبنا دارایی پایه	قیمت پایانی واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری املاک و مستغلات امین شهر یکم (نماد امین‌شهر) پایه گرد شده به نزدیک‌ترین عدد صحیح
واحد پول قیمتی	ریال
ساعات و روزهای معاملاتی	از روز شنبه تا چهارشنبه (به جز ایام تعطیل رسمی) از ساعت ۰۹:۰۰ تا ساعت ۱۵:۰۰
زمان‌بندی فرآیند اعمال	ارسال درخواست اعمال اوراق در سررسید

خسارت عدم ایفای تعهدات عرضه کننده در تاریخ سررسید، به شرح ذیل می باشد:

۱. در صورت نکول عرضه کننده در سررسید، برای آن دسته از دارندگان اوراق اختیار فروش تبعی که دارایی پایه اوراق را تا پایان جلسه معاملاتی روز سررسید در کد معاملاتی خود داشته و درخواست اعمال خود را طی مهلت مقرر به سپرده گذاری مرکزی و تسویه وجوه ارسال کرده اند، خسارتی به شرح زیر محاسبه شده و به دارنده اوراق اختیار فروش تبعی پرداخت می شود:

$$(2\% \times \text{قیمت پایانی دارایی پایه در سررسید}) + (\text{قیمت پایانی دارایی پایه در سررسید} - \text{قیمت اعمال اوراق اختیار فروش تبعی}) = \text{مبلغ خسارت به ازای هر ورقه}$$

مابه التفاوت قیمت اعمال اوراق اختیار فروش تبعی و قیمت پایانی دارایی پایه در سررسید در صورتی که دارنده اوراق پرداخت می شود که قیمت اعمال اوراق اختیار فروش تبعی بیشتر از قیمت پایانی دارایی پایه در سررسید باشد. همچنین چنانچه قیمت پایانی دارایی پایه در سررسید به تشخیص بورس منصفانه نباشد، بورس می تواند قیمت پایانی دارایی پایه را تعدیل نموده و تمامی محاسبات خسارت مربوط به بند فوق براساس قیمت پایانی تعدیل شده انجام می شود.

۲. برای آن دسته از دارندگان اوراق اختیار فروش تبعی که درخواست اعمال خود را طی مهلت مقرر ارسال کرده و دارایی پایه را تا زمان ایفای کامل تعهدات عرضه کننده در کد مالکیت خود داشته باشند، علاوه بر خسارت بند ۱، خسارتی به ازای روزهای تقویمی بین زمان سررسید تا زمان ایفای تعهدات عرضه کننده حسب مورد از محل واریز وجه به حساب شرکت سپرده گذاری مرکزی و یا تضامین، به صورت روزانه برحسب قیمت اعمال اوراق اختیار فروش تبعی و متناسب با تعداد دارایی پایه موجود در کد مالکیت، به شرح زیر محاسبه و به آن ها پرداخت می شود.

$$\left(\frac{6\% + \text{نرخ سود سپرده بانکی یک ساله}}{365} \right) \times (\text{ارزش اعمال اوراق اختیار فروش تبعی}) = \text{مبلغ خسارت به ازای هر روز تقویمی}$$

سایر نکات حائز اهمیت در خصوص اوراق اختیار فروش تبعی به شرح ذیل می باشد:

۳. مطابق با تبصره ۲ ماده ۲۳ دستورالعمل "معاملات اوراق اختیار فروش تبعی در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران"، در شرایطی که اوراق اختیار فروش تبعی به منظور حمایت از دارایی پایه مورد انتشار منتشر شود، در صورتی که در انتهای روز معاملاتی خرید اوراق تبعی، خریدار اوراق اختیار فروش تبعی، دارایی پایه را تحت مالکیت نداشته باشد یا بیش از تعداد دارایی پایه در اختیار، اوراق اختیار فروش تبعی خریداری نموده باشد یا مجموع خرید روز و مانده دارایی شخص در نماد تبعی مذکور از سقف خرید اعلامی در اطلاعیه عرضه برای هر کد بیشتر باشد، اوراق اختیار فروش تبعی مازاد فاقد اعتبار بوده و وجه پرداختی جهت خرید پس از کسر هزینه های احتمالی در صورت وجود، به خریدار اوراق اختیار فروش تبعی بازگردانده خواهد شد و تنها اوراق اختیار فروش تبعی دارندگانی که دارایی پایه را تا روز سررسید نگهداری کرده باشند قابل اعمال خواهد بود.

۴. مطابق ماده ۳۱ دستورالعمل مذکور و با لحاظ مفاد بند قبلی این اطلاعیه، در صورتی که در سررسید، نماد معاملاتی دارایی پایه متوقف باشد، تسویه تعهدات به صورت پرداخت مابه التفاوت قیمت اعمال و قیمت مبنای دارایی پایه به صورت نقدی از سوی عرضه کننده به دارندة اوراق اختیار فروش تبعی بوده و تسویه براساس آخرین قیمت اعمال اعلامی فرابورس و آخرین قیمت مبنای دارایی پایه، انجام می شود. همچنین با توجه به سیستمی شدن اعمال اختیار فروش تبعی با هدف حمایت از دارایی پایه مورد انتشار جهت کسب اطلاعات بیشتر به اطلاعیه شماره ۳۶۸۶/م/۰۱ مورخ ۱۴۰۱/۰۲/۰۶ شرکت فرابورس ایران در خصوص فرایند اجرایی اعمال سیستمی اوراق اختیار فروش تبعی مراجعه نمایید.

۵. هزینه های معاملاتی (کارمزد معاملاتی و کارمزد اعمال) اوراق اختیار خرید و فروش تبعی براساس [نرخ های مصوب](#) سازمان بورس و اوراق بهادار می باشد.

۶. چنانچه هر یک از مواعد تعیین شده در اطلاعیه عرضه مصادف با روزهای تعطیل رسمی باشد، اولین روز کاری پس از ایام تعطیل، ملاک محاسبه است.

جهت کسب اطلاعات بیشتر و آگاهی از شرایط اعمال و سایر نکات قابل توجه، به "[دستورالعمل معاملات اوراق اختیار فروش تبعی در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران](#)" مصوب ۱۳۹۷/۰۶/۱۴ هیأت مدیره محترم سازمان بورس و اوراق بهادار و اصلاحات بعدی آن، مراجعه نمایند.

میرزا زارع زاده
مدیر بازار و نهادهای مالی
نظریه