

## دستورالعمل اجرایی نحوه انجام معاملات بلوک اوراق بهادار در بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران

مصوب ۱۴۰۰/۰۷/۲۸ هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار

این دستورالعمل به منظور تسهیل انجام معاملات بلوک اوراق بهادار مبتنی بر کالا / قابل معامله در بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران و در راستای بند ۲ ماده ۷ قانون بازار به تصویب هیات مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار رسید .

### • ماده ۱:

اصطلاحات و واژه‌هایی که در این دستورالعمل به کار رفته‌اند دارای معانی زیر می‌باشند. معانی سایر اصطلاحات و واژه‌های تعریف نشده در این دستورالعمل حسب مورد مطابق تعاریف موجود در ماده یک قانون بازار اوراق بهادار جمهوری اسلامی ایران مصوب آذرماه ۱۳۸۴ مجلس شورای اسلامی، دستورالعمل معاملات کالا و اوراق بهادار مبتنی بر کالا در شرکت بورس کالای ایران و دستورالعمل معاملات کالا و اوراق بهادار قابل معامله شرکت بورس انرژی ایران خواهد بود .

### ○ بند ۱:

معامله بلوک : معامله‌ای که تعداد یا ارزش اوراق بهادار قابل معامله در آن از حد نصاب بازار عادی بالاتر بوده و حد نصاب مذکور حسب مورد توسط بورس تعیین و حداقل ۳ روز کاری پس از اطلاع رسانی اعمال می‌شود .

### ○ بند ۲:

بازار بلوک : یکی از بازارهای سامانه معاملات است که در آن معاملات بلوک طبق ضوابط این دستورالعمل انجام می‌شود .

### ○ بند ۳:

بورس: منظور حسب مورد بورس کالای ایران و بورس انرژی ایران است.

### ○ بند ۴:

سامانه معاملات بلوک : سامانه‌ای است که عملیات مربوط به ثبت پیشنهاد معاملات بلوک از طریق آن انجام شده و سفارش‌های تطبیق یافته، پس از تأیید بورس جهت انجام معامله به سامانه معاملاتی ارسال می‌شود .

### ○ بند ۵:

کارگزار پیشنهاد دهنده: کارگزاری که در سامانه معاملات بلوک اقدام به ثبت پیشنهاد خرید یا فروش می‌نماید .

○ بند ۶:

کارگزار پذیرنده پیشنهاد: کارگزاری که بر اساس پیشنهادهای ارائه شده در سامانه معاملات بلوک، پیشنهاد خرید یا فروش ثبت شده توسط کارگزار پیشنهاد دهنده را برای مشتری خود می پذیرد .

○ بند ۷:

تسویه خارج از پایاپای: در این روش ظرف مهلت تسویه، سند تسویه خارج از پایاپای به تأیید فروشنده و کارگزار فروشنده رسیده و به همراه سایر مستندات لازم توسط کارگزار خریدار به اتاق پایاپای ارائه می شود. ارائه سند تسویه خارج از پایاپای به منزله تحقق قطعی و پایان فرآیند معامله و تسویه آن است و بورس و اتاق پایاپای در خصوص ایفای تعهدات ناشی از معامله از سوی طرفین، هیچ گونه مسئولیتی نخواهند داشت .

• ماده ۲:

جلسات رسمی و روزهای انجام معامله انواع اوراق بهادار در بازار بلوک، ساعت آغاز، خاتمه و طول هر جلسه معاملاتی توسط بورس تعیین و به نحو مقتضی اطلاع رسانی می شود .

• ماده ۳:

معاملات در بازار بلوک در نمادی مجزا از معاملات بازار عادی انجام می شود و در محاسبه قیمت پایانی لحاظ نمی شود .

• ماده ۴:

محدوده مجاز نوسان قیمت در بازار بلوک مشابه بازار عادی است.

○ تبصره:

محدوده مجاز نوسان قیمت در بازار بلوک گواهی سپرده کالایی توسط بورس تعیین و با رعایت مقررات اطلاع رسانی می گردد.

• ماده ۵:

در بازار بلوک صرفاً سفارش به قیمت معین قابل اجرا است.

• ماده ۶:

مادامی که نماد معاملاتی در بازار عادی متوقف باشد، نماد معاملاتی در بازار بلوک نیز متوقف خواهد بود .

• ماده ۷:

روش انجام معاملات بلوک در بازار بلوک به شرح زیر است:

○ بند ۱:

پیشنهاد خرید یا فروش مشتری توسط کارگزار پیشنهاد دهنده در سامانه معاملات بلوک با قیمت معین ثبت می شود. کارگزار پیشنهاد دهنده فروش می تواند روش تسویه این معاملات را "صرفاً نقدی" یا "با امکان تسویه خارج از پایاپای" ثبت کند.

○ بند ۲:

کارگزار پذیرنده پیشنهاد جهت پاسخ دادن به پیشنهاد ثبت شده در سامانه معاملات بلوک اقدام به انتخاب آن نموده و پذیرش خود را جهت ارسال به کارگزار پیشنهاد دهنده در سامانه معاملات بلوک ثبت می کند.

○ بند ۳:

در صورتی که پیشنهاد فروش ارائه شده "با امکان تسویه خارج از پایاپای" باشد، کارگزار پذیرنده پیشنهاد فروش می تواند پیشنهاد ارائه شده را با یکی از شروط "صرفاً خارج از پایاپای" یا "نقدی و خارج از پایاپای" بپذیرد.

○ بند ۴:

در صورتی که روش تسویه پیشنهاد فروش ارائه شده، "صرفاً نقدی" باشد سفارش های تطبیق یافته جهت تأیید به بورس ارسال می شود.

○ بند ۵:

در صورتی که روش تسویه پیشنهاد فروش ارائه شده، "با امکان تسویه خارج از پایاپای" باشد، درخواست کارگزار پذیرنده پیشنهاد برای کارگزار پیشنهاد دهنده فروش ارسال می شود. در این صورت حالت های زیر متصور است:

۱- در صورت تأیید تسویه خارج از پایاپای توسط کارگزار پیشنهاد دهنده فروش، سفارش تطبیق یافته با عنوان تسویه خارج از پایاپای به بورس ارسال می شود.

۲- در صورت عدم تأیید تسویه خارج از پایاپای توسط کارگزار پیشنهاد دهنده فروش، منوط بر این که کارگزار پذیرنده پیشنهاد، شرط "نقدی و خارج از پایاپای" را پذیرفته باشد، معامله با عنوان تسویه نقدی جهت تأیید به بورس ارسال می شود.

۳- در صورت عدم تأیید تسویه خارج از پایاپای توسط کارگزار پیشنهاد دهنده فروش، منوط بر این که کارگزار پذیرنده پیشنهاد، شرط "صرفاً خارج از پایاپای" را پذیرفته باشد، درخواست کارگزار پذیرنده پیشنهاد رد می شود و پیشنهاد فروش مجدداً در سامانه معاملات بلوک ثبت می شود.

○ بند ۶:

در صورت عدم مغایرت سفارش های تطبیق یافته با قوانین و مقررات، بورس معامله را تأیید می نماید و سفارش های تطبیق یافته جهت انجام معامله و ثبت نهایی به سامانه معاملات ارسال و در نماد معاملاتی مربوط به بازار بلوک ثبت می شود.

○ تبصره:

ثبت پیشنهاد خرید به قیمت‌های بزرگ‌تر یا مساوی قیمت بهترین پیشنهاد فروش و ثبت پیشنهاد فروش به قیمت‌های کوچک‌تر یا مساوی قیمت بهترین پیشنهاد خرید در طرف مقابل امکان پذیر نیست و کارگزار باید جهت انجام معامله ابتدا به پیشنهادات بهتر طرف مقابل پاسخ دهد .

• ماده ۸:

زمان بندی انجام معاملات بلوک با تسویه نقدی و تسویه خارج از پایاپای توسط بورس اطلاع رسانی می‌شود، به گونه‌ای که حداقل ۲ ساعت پیش از اتمام جلسه‌ی معاملاتی، شرایط جهت رقابت متقاضیان نقدی فراهم گردد و در صورت عدم حضور متقاضیان در این بخش، امکان رقابت متقاضیان تسویه خارج از پایاپای تا پایان جلسه معاملاتی فراهم گردد .

• ماده ۹:

تسویه خارج از پایاپای در معاملات بلوک پس از تکمیل فرم‌های مربوطه توسط کارگزار و تأیید بورس و ابلاغ آن به شرکت سپرده‌گذاری مرکزی در همان روز معاملاتی امکان‌پذیر است .

○ تبصره ۱:

تسویه خارج از پایاپای پس از پرداخت کارمزدهای مربوط به معاملات بلوک انجام می‌شود .

○ تبصره ۲:

فرم‌های موضوع این ماده حسب مورد توسط بورس تهیه می‌شود.

• ماده ۱۰:

فرآیند تسویه نقدی معاملات بلوک همانند فرآیند تسویه در بازار عادی است.

• ماده مؤخره:

این دستورالعمل در ۱۰ ماده و ۴ تبصره در تاریخ ۱۴۰۰/۰۷/۲۸ به تصویب هیئت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار رسید .