

 <p>مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران (شهای خاص) IRAN CURRENCY EXCHANGE</p>	<p><b>«مقررات مصوب»</b> «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»</p>	شماره: ۰۲۲ / ب م
		تاریخ تصویب: ۱۳۹۸/۰۲/۰۷
		تاریخ ابلاغ: ۱۳۹۸/۰۳/۰۱
		تاریخ آخرین اصلاح: ۱۴۰۰/۰۳/۲۳
		مرجع تصویب: هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران

## مقدمه

این دستورالعمل در اجرای تصویب نامه جلسه شماره ۱۲۶۴ مورخ ۱۳۹۷/۱۰/۱۸ شورای پول و اعتبار و «دستورالعمل اجرایی بازار متشکل معاملات ارزی» مصوب ۱۳۹۷/۱۱/۱۵ و اصلاحات آن مصوب ۱۳۹۸/۱۱/۲۱ هیئت عامل بانک مرکزی در تاریخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷ به تصویب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران رسید و در تاریخ های ۱۳۹۹/۰۴/۰۴ ، ۱۳۹۹/۰۵/۲۹ ، ۱۳۹۹/۰۷/۲۳ ، ۱۳۹۹/۰۸/۰۷ و ۱۴۰۰/۰۳/۲۳ اصلاح شد و مشتمل بر ۲۳ ماده و ۱۴ تبصره می باشد.

## فصل اول: تعاریف و اصطلاحات

**ماده ۱- اصطلاحات و واژه هایی که در دستورالعمل اجرایی بازار متشکل معاملات ارزی مصوب ۱۳۹۷/۱۱/۱۵ و اصلاحات آن مصوب ۱۳۹۸/۱۱/۲۱ هیئت عامل بانک مرکزی تعریف شده اند، در این دستورالعمل نیز به همان معانی به کار رفته اند. سایر اصطلاحات دارای معانی زیر می باشند:**

- (۱) **ایستگاه معاملاتی:** سامانه ای الکترونیکی است که پس از اخذ مجوز و نصب نرم افزارهای لازم، در اختیار کارگزاری عضو قرار داده می شود. این سیستم مستقیماً به سامانه معاملاتی متصل است و کارگزار از طریق آن به انجام معامله مبادرت می ورزد.
- (۲) **تیک قیمتی:** حداقل دامنه تغییر قیمتی سفارش و یا به عبارتی عددی است که قیمت سفارش های ثبت شده در سامانه معاملاتی باید مضربی از آن باشد.
- (۳) **حجم مبنا:** تعداد ارزی است که برای تأثیر در قیمت پایانی هر روز باید در نماد معاملاتی مربوط مورد دادوستد قرار گیرد.
- (۴) **حداقل حجم سفارش:** حداقل تعداد ارزی است که طی یک سفارش می بایست وارد سامانه معاملات گردد.
- (۵) **دامنه نوسان:** دامنه ی نوسان روزانه ی قیمت نماد معاملاتی قابل معامله در بازار متشکل ارز ایران است که نسبت به قیمت پایانی تعیین می شود و ورود سفارش ها در هر روز صرفاً در این دامنه ی قیمت مجاز است.

## «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»

مصوب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران مورخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷



- ۶) **قیمت پایانی:** قیمت هر نماد معاملاتی است که در پایان هر جلسه رسمی معاملاتی بر اساس نرخ میانگین موزون معاملات و حجم مبنا محاسبه و مبنای اعمال دامنه نوسان روزانه‌ی قیمت قرار می‌گیرد.
- ۷) **قیمت نظری گشایش:** قیمتی است که در مرحله‌ی گشایش، بر اساس سفارش‌های ثبت‌شده با استفاده از سازوکار حراج توسط سامانه معاملاتی محاسبه و معاملات مرحله‌ی گشایش با آن قیمت انجام می‌شود.
- ۸) **کیف پول:** منظور حساب ویژه‌ای است که برای هر کارگزار در دفاتر مالی "مدیریت بازار" تعریف می‌شود.
- ۹) **محدودیت حجمی:** حداکثر میزان ارزی است که طی یک سفارش قابلیت ورود در سامانه معاملات را دارد.
- ۱۰) **مشتری:** شخصی است که متقاضی خرید یا فروش ارز است.
- ۱۱) **معامله‌گر:** شخصی است که پس از اخذ مجوز معامله‌گری از مدیریت بازار می‌تواند به نمایندگی از کارگزار به سامانه معاملاتی دسترسی داشته باشد و اقدام به انجام معامله به نام و حساب کارگزار نماید.
- ۱۲) **واحد پایه سفارش:** عددی است که مبلغ سفارش باید مضربی از آن باشد.
- ۱۳) **وضعیت باز ارزی:** حاصل جمع جبری خالص معاملات محقق شده (اعم از خرید و فروش) با سفارش‌های خرید یک کارگزار در یک نماد معاملاتی در هر لحظه است.

### فصل دوم: ضوابط کلی حاکم بر معاملات

ماده ۲- کلیه معاملات در بازار متشکل ارز ایران باید با رعایت ضوابط این دستورالعمل، به صورت الکترونیکی و از طریق سامانه معاملاتی انجام شود.

ماده ۳- کلیه معاملات بر مبنای اعلام سفارش از طرف کارگزار در جلسه رسمی معاملاتی صورت می‌پذیرد.

تبصره ۱- دریافت سفارش خرید و فروش، تطبیق سفارش‌ها، انجام معاملات و تسویه آن‌ها، صرفاً از طریق سامانه معاملات صورت می‌پذیرد.

تبصره ۲- هر کارگزار می‌تواند از طریق ایستگاه معاملاتی، سفارش خرید و فروش خود را به همراه قیمت و حجم مورد نظر وارد سامانه معاملاتی نماید.

## «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»

مصوب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران مورخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷



**ماده ۴-** روزهای معاملاتی بازار متشکل ارز ایران، روزهای کاری شنبه لغایت پنجشنبه می باشد. جلسات معاملاتی روزهای شنبه تا چهارشنبه از ساعت ۹:۰۰ آغاز و در ساعت ۱۵:۳۰ خاتمه می یابد. همچنین جلسه معاملاتی روز پنجشنبه از ساعت ۹:۰۰ آغاز و در ساعت ۱۲:۳۰ خاتمه می یابد.

**تبصره ۱-** تغییر ساعت و روزهای انجام معامله و جلسات معاملاتی با تصویب مدیریت بازار امکان پذیر خواهد بود. این تغییر باید حداقل سه روز کاری قبل از اعمال، توسط مدیریت بازار به اطلاع عموم برسد.

**تبصره ۲-** مدیریت بازار می تواند ساعات شروع و خاتمه و طول جلسات معاملاتی را در صورت بروز اشکالات فنی در سامانه معاملاتی تغییر دهد. این تغییر باید بلافاصله و به نحو مقتضی به اطلاع عموم برسد.

### فصل سوم - شرایط حاکم بر معاملات

**ماده ۵-** دامنه نوسان هر نماد معاملاتی، به میزان پنج (۵) درصد نسبت به قیمت پایانی است.

**تبصره ۵-** مدیریت بازار می تواند در صورت بروز شرایط خاص، دامنه نوسان را تغییر دهد. در این صورت، مراتب می بایست به نحو مقتضی به اطلاع عموم برسد.

**ماده ۶-** حجم مبنا برای تمامی نمادهای معاملاتی، دو میلیون (۲,۰۰۰,۰۰۰) واحد است.

**تبصره ۱-** در صورتی که حجم معاملات طی یک روز به حجم مبنا نرسد، قیمت پایانی بر مبنای فرمول اعلامی مدیریت بازار اعلام خواهد شد.

**تبصره ۲-** مدیریت بازار می تواند نسبت به تغییر حجم مبنا اقدام نماید. در این صورت، مراتب می بایست پیش از اعمال به اطلاع عموم برسد.

**ماده ۷-** کارگزار خریدار ملزم است ارز خریداری شده از بازار متشکل ارز ایران را ظرف مدت حداکثر سه (۳) روز کاری از تاریخ خرید، صرفاً در قالب مصارف خاص تعیین شده در مقررات و بخشنامه های بانک مرکزی بفروشد یا در بازار متشکل ارز ایران عرضه نماید؛ به نحوی که وضعیت باز ارزی کارگزار در روز جاری نباید بیشتر از مجموع خریدهای کارگزار از بازار متشکل ارز ایران طی ۳ روز کاری گذشته باشد.

**تبصره ۷-** کارگزار می تواند ارز خریداری شده از بازار متشکل ارز ایران را حداکثر یک (۱) درصد بالاتر از قیمت پایانی که پس از آغاز مرحله معاملات پیوسته در بازه های ۱۵ دقیقه ای در سامانه معاملات منتشر می شود، در بازار خرده فروشی عرضه نماید.

## «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»

مصوب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران مورخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷



**ماده ۸-** حداقل حجم سفارش خرید هر نماد معاملاتی، دوهزار (۲,۰۰۰) واحد بوده و محدودیت حجمی سفارش خرید به تشخیص مدیریت بازار برای هر نماد معاملاتی با رعایت سقف سیصدهزار (۳۰۰,۰۰۰) واحد تعیین می‌گردد. حداقل حجم سفارش فروش هر نماد معاملاتی، دوهزار (۲,۰۰۰) واحد و بدون محدودیت حجمی می‌باشد.

**ماده ۹-** وضعیت باز ارزی کارگزار در هر لحظه نمی‌تواند مجموعاً بیش از معادل پانصد هزار (۵۰۰,۰۰۰) یورو از ارزشهای مختلف باشد.

**تبصره ۱-** در محاسبه لحظه‌ای وضعیت باز ارزی کارگزار، تفاضل خرید و فروش‌های کارگزار صرفاً در بازار متشکل ارز ایران در روز جاری، با وضعیت باز ارزی روز قبل کارگزار جمع می‌گردد. (عملکرد روز جاری کارگزار در سامانه سنا، در محاسبه وضعیت باز ارزی لحظه‌ای کارگزار لحاظ نمی‌گردد).

**تبصره ۲-** وضعیت باز ارزی کارگزار در هر روز به روش زیر محاسبه می‌شود:

مجموع فروش‌های کارگزار در بازار متشکل ارز ایران (در روز مورد نظر) و فروش‌های ثبت شده کارگزار از منبع خرید از بازار متشکل ارز ایران در سامانه سنا (در روز مورد نظر) از مجموع خریدهای کارگزار در بازار متشکل ارز ایران (در روز مورد نظر) کسر می‌گردد. نتیجه این محاسبه، با وضعیت باز ارزی روز قبل کارگزار از این محل که با همین روش محاسبه شده است، جمع می‌گردد. چنانچه وضعیت باز ارزی محاسبه شده منفی شود، وضعیت باز ارزی کارگزار در روز مورد محاسبه صفر در نظر گرفته می‌شود.

**ماده ۱۰-** تیک قیمتی هر نماد معاملاتی، ۱۰ ریال و واحد پایه سفارش هر نماد معاملاتی، ۱۰۰ واحد ارزی است.

**ماده ۱۱-** سفارش خرید/فروش فقط تا پایان جلسه معاملاتی اعتبار داشته و به صورت خودکار در پایان جلسه، از سامانه معاملات حذف می‌شوند.

**ماده ۱۲-** مدیریت بازار می‌تواند در صورتی که شرایط بازار متشکل ارز ایران ایجاب نماید، نسبت به توقف یک یا چند نماد معاملاتی اقدام نماید. در این صورت، مراتب بلافاصله باید به عموم اطلاع داده شود.

### فصل چهارم: مراحل انجام معاملات

**ماده ۱۳-** مراحل انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران به شرح زیر است:

**۱) مرحله‌ی پیش‌گشایش:** این مرحله از ساعت ۹:۰۰ شروع و در ساعت ۱۰:۰۰ خاتمه می‌یابد. در این مرحله، امکان ورود، تغییر یا

حذف سفارش کارگزاران وجود دارد؛ لیکن معامله‌ای صورت نمی‌پذیرد.

## «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»

مصوب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران مورخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷



۲) **مرحله‌ی گشایش:** رأس ساعت ۱۰:۰۰، با اجرای سفارش‌های موجود در سامانه معاملات و بر اساس سازوکار حراج انجام می‌شود.

۳) **مرحله‌ی حراج پیوسته:** مرحله‌ای است که پس از انجام مرحله‌ی گشایش در ساعت ۱۰:۰۰ آغاز و در ساعت ۱۵:۳۰ (روزهای

پنجشنبه، ساعت ۱۲:۳۰) خاتمه می‌یابد و طی آن معاملات بر اساس سازوکار حراج پیوسته انجام می‌شود.

تبصره- در مرحله‌ی پیش‌گشایش، سفارش‌های موجود در سامانه معاملاتی برای کارگزاران قابل مشاهده نخواهد بود.

### فصل پنجم: تسویه وجوه

ماده ۱۴- کارگزار باید با رعایت ضوابط اعلامی مدیریت بازار، تدبیری اتخاذ نماید که وجوه ارزی و یا ریالی موردنیاز برای سفارشی که

قصد ارسال آن طی جلسه معاملاتی جاری را دارد، قبل از ارسال سفارش در کیف پول کارگزار نزد بازار متشکل ارز ایران موجود باشد.

ماده ۱۵- مدیریت بازار پس از دریافت سفارش، از طریق سامانه معاملاتی وجوه ارزی/ریالی مربوط به معامله را به میزان مجموع مبلغ

سفارش و حسب مورد هزینه‌های مربوط، در کیف پول کارگزار نزد بازار متشکل ارز ایران مسدود می‌نماید.

ماده ۱۶- در صورتی که برخی از سفارش‌ها منجر به انعقاد معامله نشود یا معامله‌ی انجام‌شده تأیید نگردد، سامانه معاملاتی حداکثر تا پیش

از ساعت ۹:۰۰ روز کاری بعد، نسبت به رفع مسدودی وجوه مذکور و یا عودت آن به حساب کارگزار حسب مورد اقدام می‌نماید.

ماده ۱۷- تسویه وجوه ارزی/ریالی مربوط به معاملات، در همان روز و حداکثر تا پیش از ساعت ۹:۰۰ روز بعد صورت می‌پذیرد.

ماده ۱۸- مدیریت بازار هیچ مسئولیتی در قبال هرگونه خسارت مستقیم، غیرمستقیم و یا تصادفی که خارج از کنترل مدیریت بازار باشد،

عدم موفقیت در هریک از فرآیند سفارش‌گیری، انجام معامله و تسویه وجوه ارزی/ریالی، اختلالات ناشی از سرویس‌های نرم‌افزاری و یا

سخت‌افزاری مرتبط با شبکه بانکی و یا زیرساخت‌های ارتباطاتی و سایر موارد مربوط ندارد.

### فصل ششم: حدود مسئولیت، شرایط فعالیت و تعهدات کارگزاران

ماده ۱۹- انجام معامله در بازار متشکل ارز ایران به معنای اعلام آگاهی کارگزار خریدار/فروشنده از مقررات، شرایط و خطرات حاکم بر

بازار یادشده و سلب و اسقاط حق طرح هرگونه دعوی به طرفیت مدیریت بازار است.

ماده ۲۰- دسترسی به سامانه معاملات جهت ارسال سفارش خرید و فروش صرفاً در اختیار کارگزاران بوده و هر کارگزار، مسئولیت کامل

تمامی اقدامات صورت‌گرفته از طریق دسترسی مذکور را بر عهده دارد.

ماده ۲۱- مواردی که در این دستورالعمل پیش‌بینی نشده است تابع قوانین و مقررات جاری کشور از جمله قانون پولی و بانکی کشور،

قانون تجارت و لایحه اصلاحی آن، قانون تنظیم بازار غیرمتشکل پولی و آیین‌نامه‌های آن، قانون مبارزه با پولشویی، آیین‌نامه اجرایی

## «دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل ارز ایران»

مصوب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران مورخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷



و دستورالعمل‌های مرتبط با آن، سایر قوانین و مقررات ذیربط و آیین‌نامه‌ها و دستورالعمل‌های مربوطه و همچنین مصوبات شورای پول و اعتبار و دستورات و بخشنامه‌های بانک مرکزی می‌باشد.

### فصل هفتم: کارمزدها

ماده ۲۲- کارمزدهای مربوط به معاملات بازار متشکل ارز ایران، به شرح ذیل می‌باشد:

(۱) کارمزد انعقاد معاملات، معادل یک در هزار مبلغ ریالی معامله است.

(۲) کارمزد تسویه معاملات، معادل یک در هزار مبلغ ریالی معامله است.

تبصره ۱- کارمزدهای مذکور از هریک از طرفین معامله (خریدار و فروشنده) به صورت جداگانه اخذ می‌شود.

تبصره ۲- مدیریت بازار می‌تواند به کارگزاران دارای حجم معاملات بالا مطابق ضوابط مصوب خود، تخفیف در کارمزد اعطا نماید.

تبصره ۳- مدیریت بازار باید در ابتدای هر سال نسبت به تعدیل و اعلام مبلغ کارمزد یادشده اقدام نماید.

ماده ۲۳- کارمزد دسترسی به داده‌های بازار با حفظ محرمانگی برای اشخاص غیر کارگزار، به ازای هر سلول داده مبلغ یکصد (۱۰۰) ریال می‌باشد