



«مقررات مصوب»
«دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار متشکل معاملات ارز ایران»

شماره: ۱۳۹۸/م/۰۰۱

تاریخ تصویب: ۱۳۹۸/۰۲/۰۷

تاریخ ابلاغ: ۱۳۹۸/۰۳/۰۱

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 مورخ ۱۳۹۷/۱۱/۱۵ هیئت عامل بانک مرکزی، در ۲۲ ماده و ۱۳ تبصره در تاریخ ۱۳۹۸/۰۲/۰۷ به تصویب هیئت مدیره شرکت مدیریت بازار متشکل معاملات ارز ایران رسید.

فصل اول: تعاریف و اصطلاحات

ماده ۱- اصطلاحات و واژه‌هایی که در دستورالعمل اجرایی بازار متشکل معاملات ارزی، مصوب مورخ ۱۳۹۷/۱۱/۱۵ هیئت عامل بانک مرکزی، تعریف شده‌اند، در این دستورالعمل نیز به همان معانی به کار رفته‌اند. سایر اصطلاحات دارای معانی زیر می‌باشند:

- (۱) **ایستگاه معاملاتی:** سامانه‌ای الکترونیکی است که پس از اخذ مجوز و نصب نرم‌افزارهای لازم، در اختیار کارگزاری عضو قرار داده می‌شود. این سیستم مستقیماً به سامانه معاملاتی متصل است و کارگزار از طریق آن به انجام معامله مبادرت می‌ورزد.
- (۲) **حجم مبنا:** تعداد ارزی است که برای تأثیر در قیمت پایانی هر روز باید در نماد معاملاتی مربوط مورد دادوستد قرار گیرد.
- (۳) **حداقل حجم سفارش:** حداقل تعداد ارزی است که طی یک سفارش می‌بایست وارد سامانه معاملات گردد.
- (۴) **دامنه نوسان:** دامنه‌ی نوسان روزانه‌ی قیمت نماد معاملاتی قابل معامله در بازار متشکل معاملات ارزی است که نسبت به قیمت پایانی تعیین می‌شود و ورود سفارش‌ها در هر روز صرفاً در این دامنه‌ی قیمت مجاز است.
- (۵) **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.
- (۶) **قیمت نظری گشایش:** قیمتی است که در مرحله‌ی گشایش، بر اساس سفارش‌های ثبت شده با استفاده از سازوکار حراج توسط سامانه معاملاتی محاسبه و معاملات مرحله‌ی گشایش با آن قیمت انجام می‌شود.
- (۷) **محدودیت حجمی:** حداکثر میزان ارزی است که طی یک سفارش قابلیت ورود در سامانه معاملات را دارد.
- (۸) **مشتری:** شخصی است که متقاضی خرید یا فروش ارز است.

۹) **وضعیت باز ارزی:** حاصل جمع جبری خالص معاملات محقق شده (اعم از خرید و فروش) با سفارش های خرید یک کارگزار در یک نماد معاملاتی در هر لحظه است.

۱۰) **کیف پول:** منظور حساب ویژه ای است که برای هر کارگزار در دفاتر مالی "مدیریت بازار" تعریف می شود.

۱۱) **معامله گر:** شخصی است که پس از اخذ مجوز معامله گری از مدیریت بازار می تواند به نمایندگی از کارگزار به سامانه معاملاتی دسترسی داشته باشد و اقدام به انجام معامله به نام و حساب کارگزار نماید.

فصل دوم: ضوابط کلی حاکم بر معاملات

ماده ۲- کلیه معاملات در بازار متشکل معاملات ارزی 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 و به صورت عمده صورت می پذیرد.

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

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

ماده ۴- روزهای معاملاتی بازار متشکل معاملات ارزی، روزهای کاری شنبه لغایت چهارشنبه بوده و جلسات معاملاتی هر روز از ساعت ۹:۰۰ آغاز و در ساعت ۱۵:۰۰ 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 سه درصد نسبت به قیمت پایانی است.

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

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



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 معاملات ارزی را ظرف مدت حداکثر ده روز کاری از تاریخ خرید، صرفاً در قالب مصارف خاص تعیین شده در مقررات و بخشنامه های بانک مرکزی بفروشد یا در بازار متشکل معاملات ارزی عرضه نماید. **تبصره-** کارگزار می تواند ارز خریداری شده از بازار متشکل معاملات ارزی را حداکثر یک درصد بالاتر از قیمت آخرین معامله ثبت شده در سامانه معاملاتی، در بازار خرده فروشی عرضه نماید.

ماده ۸- حداقل حجم سفارش خرید هر نماد معاملاتی در هر روز، ده هزار (۱۰,۰۰۰) واحد با محدودیت حجمی صد هزار (۱۰۰,۰۰۰) واحد می باشد.

ماده ۹- وضعیت باز ارزی در هر لحظه حداکثر صد هزار (۱۰۰,۰۰۰) واحد ارزی است. کارگزار می بایست تدابیری اتخاذ نماید که معاملات صورت گرفته از وضعیت باز ارزی تجاوز ننماید.

تبصره- کارگزار دارای مجوز بازارگردانی از شمول این ماده مستثنی است.

ماده ۱۰- سفارش خرید/فروش فقط تا پایان جلسه معاملاتی اعتبار داشته و به صورت خودکار در پایان جلسه، از سامانه معاملات حذف می شوند.

ماده ۱۱- مدیریت بازار می تواند در صورتی که شرایط بازار متشکل معاملات ارزی 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 ۱۲- مراحل انجام معاملات در بازار متشکل معاملات ارزی 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.

(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 ۱۵:۰۰ 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 ۱۳- 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 معاملات ارزی موجود باشد.

ماده ۱۴- 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 معاملات ارزی مسدود می‌نماید.

ماده ۱۵- 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 ۱۶- تسویه وجوه ارزی/ریالی مربوط به معاملات، در همان روز و حداکثر تا پیش از ساعت ۹:۰۰ روز بعد صورت می‌پذیرد.

ماده ۱۷- 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 ۱۸- انجام معامله در بازار متشکل معاملات ارزی 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 ۱۹- دسترسی به سامانه معاملات جهت ارسال سفارش خرید و فروش صرفاً در اختیار کارگزاران بوده و هر کارگزار، مسئولیت کامل تمامی اقدامات صورت گرفته از طریق دسترسی مذکور را بر عهده دارد.

ماده ۲۰- 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 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 ۲۱- کارمزدهای مربوط به معاملات بازار متشکل معاملات ارزی، 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 ۲۲- کارمزد دسترسی به داده‌های بازار با حفظ محرمانگی برای اشخاص غیرکارگزار، به ازای هر سلول داده مبلغ یکصد (۱۰۰) ریال می‌باشد.