



«مقررات مصوب»
«دستورالعمل نحوه انجام معاملات در بازار
متشکل معاملات ارزی»

شماره: ۱۳۹۹/م/۰۰۱

تاریخ تصویب: ۱۳۹۹/۰۴/۰۴

تاریخ ابلاغ: ۱۳۹۹/۰۴/۰۴

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 ۱۳۹۸/۱۱/۲۱ هیئت عامل بانک مرکزی، در ۲۳ ماده و ۱۴ تبصره در تاریخ ۱۳۹۹/۰۴/۰۴ 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 ۱۳۹۸/۱۱/۲۱ 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) **تیک قیمتی:** حداقل دامنه تغییر قیمتی سفارش و یا به عبارتی عددی است که قیمت سفارش‌های ثبت شده در سامانه معاملاتی باید مضربی از آن باشد.

(۳) **حجم مینا:** 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 می‌بایست وارد سامانه معاملات گردد.

(۵) **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.

(۶) **قیمت پایانی:** قیمت هر نماد معاملاتی است که در پایان هر جلسه رسمی معاملاتی بر اساس نرخ میانگین موزون معاملات و حجم مینا محاسبه و مبنای اعمال دامنه نوسان روزانه‌ی قیمت قرار می‌گیرد.

(۷) **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.

(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) **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.
- 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 سفارش های 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 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 ۱۵:۳۰ 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 سه درصد نسبت به قیمت پایانی است.

تبصره - 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 مینا برای تمامی نمادهای معاملاتی، دو میلیون (۲,۰۰۰,۰۰۰) واحد است.

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

تبصره ۲- مدیریت بازار می تواند نسبت به تغییر حجم مینا 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 ۱۵ روز تقویمی از تاریخ خرید، صرفاً در قالب مصارف خاص تعیین شده در مقررات و بخشنامه های بانک مرکزی عرضه نماید؛ به نحوی که وضعیت باز ارزی کارگزار در روز جاری نباید بیشتر از مجموع خریدهای کارگزار از بازار متشکل معاملات ارزی طی ۱۵ روز تقویمی گذشته باشد.

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، ده هزار (۱۰,۰۰۰) واحد با محدودیت حجمی صد هزار (۱۰۰,۰۰۰) واحد می باشد. حداقل حجم سفارش فروش هر نماد معاملاتی، ده هزار (۱۰,۰۰۰) واحد و بدون محدودیت حجمی می باشد.

ماده ۹- وضعیت باز ارزی کارگزار در هر لحظه نمی تواند مجموعاً بیش از معادل ۳۰۰ هزار یورو از ارزشهای مختلف باشد.

تبصره ۱- در محاسبه لحظه ای وضعیت باز ارزی کارگزار، تفاضل خرید و فروش های کارگزار صرفاً در بازار متشکل معاملات ارزی در روز جاری، با وضعیت باز ارزی روز قبل کارگزار جمع می گردد. (عملکرد روز جاری کارگزار در سامانه سنا، در محاسبه وضعیت باز ارزی لحظه ای کارگزار لحاظ نمی گردد).

تبصره ۲- وضعیت باز ارزی کارگزار در هر روز به روش زیر محاسبه می شود:

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

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 می شوند.

ماده ۱۲- 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 ۱۳- مراحل انجام معاملات در بازار متشکل معاملات ارزی به شرح زیر است:

- (۱) **مرحله ی پیش گشایش:** این مرحله از ساعت ۹:۰۰ شروع و در ساعت ۱۰:۰۰ خاتمه می یابد. در این مرحله، امکان ورود، تغییر یا حذف سفارش کارگزاران وجود دارد؛ لیکن معامله ای صورت نمی پذیرد.
 - (۲) **مرحله ی گشایش:** رأس ساعت ۱۰:۰۰، با اجرای سفارش های موجود در سامانه معاملات و بر اساس سازوکار حراج انجام می شود.
 - (۳) **مرحله ی حراج پیوسته:** مرحله ای است که پس از انجام مرحله ی گشایش در ساعت ۱۰:۰۰ آغاز و در ساعت ۱۵:۳۰ خاتمه می یابد و طی آن معاملات بر اساس سازوکار حراج پیوسته انجام می شود.
- تبصره- در مرحله ی پیش گشایش، سفارش های 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 مورد نیاز 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 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 معاملات ارزی مسدود می‌نماید.

ماده ۱۶- در صورتی که برخی از سفارش‌ها منجر به انعقاد معامله نشود یا معامله‌ی انجام شده 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 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 ۲۰- 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 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

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