

تاریخ: ۱۳۹۰/۰۳/۳۰  
شماره: ۱۲۱/۱۴۳۳۳۰

اداره امور کارگزاران

بخشنامه

شماره بخشنامه: ۱۱۰۱۰۰۳۶

صادر کننده: اداره امور کارگزاران

موضوع: تعدیل محدودیت‌های موضوع ماده ۱۰ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط اوراق بهادار در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس  
مخاطب: کلیه شرکت‌های کارگزاری بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران.

با احترام؛

پیرو بخشنامه شماره ۱۱۰۱۰۰۳۰ با موضوع "اعلام شرایط اخذ تائیدیة زیر ساخت دسترسی برخط بازار، نحوه اجرای ماده ۷ و محدودیت‌های موضوع ماده ۱۰ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط اوراق بهادار در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران" که طی نامه شماره ۱۲۱/۱۲۴۷۲۰ مورخ ۱۳۸۹/۰۹/۰۹ به کلیه کارگزاران اعلام گردید، به استحضار می‌رساند؛ به پیوست محدودیت‌های تعدیل شده موضوع ماده ۱۰ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط اوراق بهادار در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران ابلاغ می‌گردد. کارگزاران ارائه کننده خدمات دسترسی برخط ضمن رعایت کامل دستورالعمل اجرایی معاملات برخط اوراق بهادار در بورس تهران و فرابورس ایران می‌بایست بخشنامه اجرای ماده ۷ و محدودیت‌های تعدیل شده موضوع ماده ۱۰ دستورالعمل مذکور را که به پیوست ارسال می‌گردد همواره بصورت دقیق رعایت نمایند. بدیهی است کلیه مسئولیت‌های ناشی از عدم رعایت مقررات معاملات برخط به عهده شرکت کارگزاری می‌باشد.

لازم به ذکر است، از تاریخ ۱۳۹۰/۰۴/۰۱ محدودیت‌های قبلی لغو و محدودیت‌های تعدیل شده لازم‌الاجرا می‌گردد.

محمد عطائی

رونوشت:

- ❖ ریاست محترم سازمان
- ❖ اعضاء محترم هیأت مدیره سازمان
- ❖ مدیرعامل محترم شرکت بورس اوراق بهادار تهران
- ❖ مدیر محترم بازار شرکت بورس اوراق بهادار تهران
- ❖ مدیر محترم امور اعضاء شرکت بورس اوراق بهادار تهران
- ❖ مدیرعامل محترم شرکت فرابورس ایران
- ❖ مدیرعامل محترم شرکت سپرده‌گذاری مرکزی اوراق بهادار و تسویه وجوه
- ❖ مدیرعامل محترم شرکت مدیریت فناوری بورس تهران



تاریخ: ۱۳۹۰/۰۳/۳۰

شماره: ۱۲۱/۱۴۳۳۳۰

### اداره امور کارگزاران

- ❖ مدیر محترم نظارت بر بورس‌ها و بازارها
- ❖ مدیر محترم نظارت بر نهادهای مالی
- ❖ دبیرکل محترم کانون کارگزاران بورس و اوراق بهادار
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت رایانه تدبیرپرداز
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت رایان هم افزا
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت صحرا
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت عصر دانش افزار
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت داده‌پردازان تدبیر سرمایه (داتکس)
- ❖ مدیر عامل محترم شرکت اطلاع‌رسانی
- ❖ مدیریت محترم حراست
- ❖ اداره امور کارگزاران

اداره امور کارگزاران

محدودیت‌های موضوع ماده ۱۰ "دستورالعمل اجرایی معاملات بر خط اوراق بهادار در بورس اوراق بهادار تهران و فرابورس ایران"

۱- محدودیت در نوع سفارشات:

سفارشات مجاز برای مشتریان بر خط، از لحاظ قیمتی سفارش *Limit* از لحاظ زمانی بدون محدودیت (شامل *Day*، *Date* و *Open* ...) می‌باشد.

۲- محدودیت در حجم سفارش:

در حال حاضر محدودیتی جهت حجم سفارش علاوه بر محدودیت‌های عادی هسته معاملات وجود ندارد.

۳- محدودیت در زمان معاملات:

الف) ساعت ورود سفارش از ابتدای زمان مجاز ورود سفارشات در سامانه معاملاتی لغایت ساعت ۱۲:۰۰ می‌باشد.  
ب) سفارشات با اعتبار روزانه (*DAY*) مشتریان بر خط باید بلافاصله پس از اتمام ساعت معاملات (ساعت ۱۲:۰۰) توسط سیستم نرم افزاری بر خط، حذف گردد.

۴- محدودیت در عرضه‌های خاص:

الف) مشتریان معاملات بر خط در زمان حراج نمادهای بازگشایی شده امکان ورود سفارش با رعایت محدودیت‌های قیمتی سفارش را دارند.

ب) بورس یا فرابورس باید سهمیه مجزایی را برای هر مشتری معاملات بر خط در کلیه عرضه‌های اولیه تعیین نمایند. مشتریان معاملات بر خط می‌توانند با رعایت محدودیت حجم معامله مشتری بر خط به میزان سهمیه تعیین شده، در عرضه‌های اولیه اقدام به خرید نمایند.

ج) مشتریان بر خط حق رقابت و انجام معامله عمده را ندارند.

۵- محدودیت‌های قیمتی سفارش:

الف) درصد تفاوت مجاز قیمت سفارش با دامنه مظنه بازار صرفاً در خصوص ورود سفارش در زمان حراج بازگشایی و عرضه اولیه به شرح زیر اعمال می‌گردد:

تاریخ: ۱۳۹۰/۰۳/۳۰

شماره: ۱۲۱/۱۴۳۳۳۰

### اداره امور کارگزاران

- (۱) قیمت سفارش خرید مشتری معاملات برخط نمی تواند بیشتر از بهترین مظنه خرید بازار باشد.
  - (۲) قیمت سفارش فروش مشتری معاملات برخط نمی تواند کمتر از بهترین مظنه فروش بازار باشد.
  - (۳) در صورتی که سفارش خرید یا فروشی در زمان ورود سفارش مشتری وجود نداشته باشد، محدودیت مذکور اعمال نمی شود.
- (ب) درصد تفاوت مجاز قیمت سفارش با آخرین قیمت معامله:
- (۱) در صورتی که ارزش سفارش وارده کوچکتر یا مساوی یک میلیون ریال باشد، تفاوت قیمت سفارش خرید یا فروش با آخرین قیمت معامله حداکثر دو درصد می تواند باشد. این محدودیت بین ساعت ۹:۰۰ الی ۱۲:۰۰ اعمال می گردد.
  - (۲) در صورتی که معامله ای در روز جاری انجام نشده باشد، مبنای قیمت آخرین معامله، قیمت پایانی روز قبل است.