

پیوست شماره ۲. مصادیق ماده ۱۶ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط

شماره ماده یا بند	متن دستورالعمل	محدودیت های اعلامی سازمان
صدر ماده ۱۶	کارگزار یا کارگزار/معامله گر باید امکان اعمال محدودیت های اعلام شده از سوی سازمان به شرح موارد زیر را در زیرساخت های موضوع بندهای ۴، ۵ و ۶ ماده یک این دستورالعمل فراهم نموده و حسب اعلام سازمان اعمال نماید:	
بند ۱	محدودیت در نوع سفارش	مشابه محدودیت سامانه نامک
بند ۲	محدودیت در زمان فعالیت	الف) ساعت ورود سفارش از ابتدای زمان مجاز ورود سفارشات در سامانه معاملاتی تا پایان جلسه معاملاتی هر نماد می باشد. ب) سفارشات با اعتبار روزانه (Day) مشتریان برخط باید بلافاصله پس از اتمام جلسه معاملاتی هر نماد توسط سیستم نرم افزاری برخط، حذف گردد. ج) پس از پایان جلسه رسمی معاملاتی هر نماد، سفارشات با اعتبار روز توسط سامانه دریافت نگردد.
بند ۳	محدودیت فعالیت بر روی نماد معاملاتی، جلسه معاملاتی، تابلو، صنعت، بازار یا عرضه خاص در هر یک از بورس ها	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها
بند ۴	محدودیت در حجم سفارش شامل بخش آشکار و پنهان	ارسال سفارشات دویخیسی (Iceberg) مجاز نمی باشد.
بند ۵	محدودیت در قیمت سفارش	الف) از پذیرش و ارسال سفارشات که منجر به ایجاد نوسان قیمتی بیشتر از ۳ درصد در زمان حراج پیوسته می گردد، خودداری شود. الگوریتم پیاده سازی: چنانچه قیمت سفارش خرید (فروش) مشتری از قیمت مظنه اول فروش (خرید)، ۳ درصد بیشتر (کمتر) باشد، از پذیرش و ارسال سفارش مشتری ممانعت به عمل آید. ملاحظه: پس از سپری شدن ۲ دقیقه این محدودیت در سطح مشتری نخواهد بود. ب) از پذیرش سفارشات که احتمال معامله با خود را دارد خودداری شود.

پیوست شماره ۲. مصادیق ماده ۱۶ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط

شماره ماده یا بند	متن دستورالعمل	محدودیت های اعلامی سازمان
صدر ماده ۱۶	کارگزار یا کارگزار/معامله گر باید امکان اعمال محدودیت های اعلام شده از سوی سازمان به شرح موارد زیر را در زیرساخت های موضوع بندهای ۴، ۵ و ۶ ماده یک این دستورالعمل فراهم نموده و حسب اعلام سازمان اعمال نماید:	
بند ۶	محدودیت معاملاتی برای مشتری یا مشتریان خاص	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها
بند ۷	محدودیت در تعداد مشتریان هر کارگزار یا کارگزار/معامله گر	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها
بند ۸	محدودیت در حجم و ارزش معاملات مشتریان	الف) حداقل ارزش هر سفارش خرید ارسالی از طریق سامانه معاملات برخط، پنج میلیون ریال می باشد. ج) محدودیت های حجمی اعلامی توسط سازمان و بورس ها بایستی بلافاصله در سامانه رعایت گردد.
بند ۹	محدودیت نوسان قیمت مجاز	الزام به رعایت دامنه نوسان قیمت مجاز هر نماد معاملاتی
بند ۱۰	محدودیت درصد تفاوت قیمت سفارش با دامنه مظنه بازار	درصد تفاوت مجاز قیمت سفارش با مظنه بازار صرفاً در خصوص ورود سفارش در زمان حراج ناپیوسته به شرح زیر اعمال می گردد: 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.

پیوست شماره ۲. مصادیق ماده ۱۶ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط

شماره ماده یا بند	متن دستورالعمل	محدودیت های اعلامی سازمان
صدر ماده ۱۶	کارگزار یا کارگزار/معامله گر باید امکان اعمال محدودیت های اعلام شده از سوی سازمان به شرح موارد زیر را در زیرساخت های موضوع بندهای ۴، ۵ و ۶ ماده یک این دستورالعمل فراهم نموده و حسب اعلام سازمان اعمال نماید:	
بند ۱۱	محدودیت درصد تفاوت قیمت سفارش با قیمت آخرین معامله	۳- در صورتی که سفارش خرید یا فروشی در زمان ورود سفارش مشتری در آستانه قیمتی مجاز وجود نداشته باشد، محدودیت مذکور اعمال نمی شود. ۱- تفاوت قیمت سفارش خرید یا فروش با قیمت آخرین معامله، حداکثر ۲۰٪ دامنه نوسان باشد. ۲- در صورتی که معامله ای در روز جاری انجام نشده باشد، مبنای قیمت آخرین معامله، قیمت پایانی روز قبل است. ۳- این محدودیت در جلسه رسمی معاملاتی اجرا می گردد.
بند ۱۲	محدودیت تفاوت قیمت نسبت به معامله قبل برای سفارشات با حجم و ارزش پایین	۱- در صورتی که ارزش سفارش وارده کمتر از ۵ میلیون ریال باشد، تفاوت قیمت سفارش با قیمت آخرین معامله حداکثر ۱۰٪ دامنه نوسان باشد. ۲- در صورتی که معامله ای در روز جاری انجام نشده باشد، مبنای قیمت آخرین معامله، قیمت پایانی روز قبل است. ۳- این محدودیت در جلسه رسمی معاملاتی اجرا می گردد.
بند ۱۳	محدودیت حداقل یا حداکثر خرید	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها
بند ۱۴	محدودیت حداقل تغییر قیمت سفارش	در صورت ویرایش قیمت، حداقل تغییر قیمت بایستی معادل تیک قیمتی بورس مربوطه باشد.
بند ۱۵	محدودیت در خرید یا فروش بودن سفارش	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها
بند ۱۶	محدودیت در نحوه اجرای سفارش	حسب اعلام موردی سازمان یا بورس ها

پیوست شماره ۲. مصادیق ماده ۱۶ دستورالعمل اجرایی معاملات برخط

صدر ماده ۱۶ کارگزار یا کارگزار/معامله گر باید امکان اعمال محدودیت های اعلام شده از سوی سازمان به شرح موارد زیر را در زیرساخت های موضوع بندهای ۴، ۵ و ۶ ماده یک این دستورالعمل فراهم نموده و حسب اعلام سازمان اعمال نماید:		شماره ماده یا بند
محدودیت های اعلامی سازمان	متن دستورالعمل	
مشابه محدودیت سامانه نامک	محدودیت در اعتبار زمانی سفارش	بند ۱۷
حسب اعلام موردی سازمان یا بورس مربوطه	-	بند ۱۸ الی بند ۳۳
حسب اعلام مراجع قانونی مربوطه و در صورت نیاز تایید سازمان یا بورس ها	امکان تعیین محدودیت ثبت سفارش در خصوص اعلام سایر مراجع قانونی	بند ۳۴
تقسیم سفارش ممنوع می باشد.	سایر محدودیت ها به تشخیص بورس ها و تأیید سازمان	بند ۳۵