

تاریخ: ۱۳۹۶/۳/۳

شماره: ۹۶/۲/۶۳۳۴۸

پیوست: دارد

شماره ابلاغیه: ۹۶/۰۰۷

صادر کننده: معاونت عملیات و نظارت بازار

موضوع: معاملات خودکار (Algorithm Trading) و معاملات پر بسامد (High Frequency Trading)
مخاطب: کارگزاران و معامله‌گران حقوقی عضو فرا بورس ایران، شرکت‌های نرم‌افزاری ارائه دهنده خدمات بر خط

با سلام و احترام،

عطف به نامه شماره ۱۲۱/۳۰۰۹۵ مورخ ۱۳۹۶/۰۲/۲۰ سازمان بورس و اوراق بهادار (پیوست این ابلاغیه) در خصوص معاملات خودکار (Algorithm Trading) و معاملات پر بسامد (High Frequency Trading)، به استحضار می‌رساند؛ کارگزاران عضو که از ابزارهای مذکور جهت انجام معاملات استفاده می‌نمایند و نیز شرکت‌های نرم‌افزاری ارائه دهنده خدمات برخط، می‌بایست اطلاعات زیر را به صورت دوره‌ای و در فواصل زمانی حداکثر سه ماهه به فرا بورس ایران و سازمان بورس و اوراق بهادار ارائه نمایند.

- اطلاعات هویتی معامله‌گر سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد؛
- کد سهامداری معامله‌کننده توسط معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد؛
- تعیین نوع دسترسی معامله‌گر به سامانه معاملات شامل دسترسی مستقیم (Direct Market Access) یا غیرمستقیم (برخط فردی از کانال یک شرکت کارگزاری)؛
- آمار معاملات انجام شده شامل حجم، ارزش و دفعات معاملات انجام شده از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک هر نماد معاملاتی؛
- آمار معاملات شامل حجم، ارزش و دفعات معاملات از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک هر صنعت؛
- آمار معاملات شامل حجم، ارزش و دفعات معاملات از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک هر بازار؛
- آمار کل معاملات ایستگاه‌های فعال هر یک از شرکت‌های کارگزاری شامل حجم، ارزش و دفعات معاملات به تفکیک شهر محل استقرار ایستگاه مربوطه (منطقه جغرافیایی هر ایستگاه) به همراه سرجمع معاملات؛
- آمار کل معاملات سیستم‌های معاملاتی خودکار یا پر بسامد شامل حجم، ارزش و دفعات معاملات به تفکیک شهر محل استقرار هر یک از سیستم‌های مذکور (منطقه جغرافیایی هر ایستگاه)؛
- آمار کل معاملات سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک حجم، ارزش و دفعات معامله؛
- تعداد کل سفارش‌های ارسال شده به سامانه معاملات از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد؛
- تعداد کل سفارش‌های ارسال شده به سامانه معاملات از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک هر نماد معاملاتی؛
- تعداد کل سفارش‌های معامله شده ارسالی از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد؛
- تعداد کل سفارش‌های معامله شده ارسالی از طریق سیستم معاملات خودکار یا معاملات پر بسامد به تفکیک هر نماد معاملاتی؛



مراتب جهت استحضار ایفاد می گردد.

بهنام محسنی
معاون عملیات و نظارت بازار

رونوشت:

- ✓ جناب آقای دکتر عراقچی - عضو محترم هیأت مدیره و معاون اجرایی سازمان بورس و اوراق بهادار
- ✓ جناب آقای دکتر سعیدی - نایب رئیس محترم هیأت مدیره و معاون نظارت بر نهادهای مالی سازمان بورس و اوراق بهادار
- ✓ جناب آقای دکتر امیری - عضو محترم هیأت مدیره و معاون نظارت بر بورس ها و ناشران سازمان بورس و اوراق بهادار
- ✓ جناب آقای هامونی - مدیرعامل محترم
- ✓ جناب آقای میرصانعی - دبیر کل محترم کانون کارگزاران بورس و اوراق بهادار
- ✓ جناب آقای عطایی - مدیر محترم نظارت بر کارگزاران سازمان بورس و اوراق بهادار
- ✓ سرکار خانم اروجی - مدیر محترم عملیات بازار و اعضا



تاریخ:

شماره:

عضو هیات مدیره و معاون اجرایی

جناب آقای دکتر قالیباف، مدیر عامل محترم شرکت بورس اوراق بهادار تهران
جناب آقای هامونی، مدیر عامل محترم شرکت فرابورس ایران

سلام علیکم؛

در راستای توسعه ابزارهای معاملاتی، گسترش ضریب نفوذ و تسهیل هر چه بیشتر معاملات در بورس های اوراق بهادار به آگاهی می رسد انجام معاملات خودکار (Algorithm Trading) و نیز معاملات پرسامند (High Frequency Trading) از نظر سازمان بورس و اوراق بهادار بلامانع بوده و معامله گران می توانند برای انجام این معاملات از ابزارهای مبتنی بر فناوری های اطلاعات استفاده نمایند. بکارگیری این ابزارها نیاز به اخذ مجوز از سازمان بورس و اوراق بهادار ندارد، لیکن رعایت مقررات و دستورالعمل های ناظر بر انجام معاملات و سایر موارد مرتبط لازم الاجرا خواهند بود.

لطفا ترتیبی اتخاذ گردد تا آمار معاملات به تفکیک نوع آنها به صورت دوره ای و حداکثر هر سه ماه یکبار به این سازمان ارسال گردد.

سید احمد عراقچی

رونوشت:

- جناب آقای ایلیاتی، مدیرعامل محترم شرکت پیشگامان فناوری اطلاعات سگال
- جناب آقای باهر، مدیرعامل محترم شرکت ویستا سامانه آسا
- جناب آقای روحانی، مدیرعامل محترم گروه نرم افزاری صحرا
- جناب آقای شهری، مدیرعامل محترم شرکت تدبیرپرداز
- جناب آقای عبدالله پور، مدیرعامل محترم شرکت رایان هم افزا
- جناب آقای عبدالهی، مدیرعامل محترم شرکت داده پردازان تدبیر سرمایه
- جناب آقای قاسمی، مدیرعامل محترم شرکت توسعه فناوری سوشیانت
- مدیرعامل محترم شرکت مدیریت فناوری بورس تهران
- مدیریت محترم روابط عمومی و امور بین الملل
- مدیریت محترم فناوری اطلاعات سازمان