

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۱۳ تیرماه ۱۴۰۲

بازار اختیار معامله، در هفته گذشته به خصوص در روزهای پایانی شاهد رشد نسبی در ارزش معاملات بود این رشد می تواند بیانگر آماده شدن معامله گران این بازار برای یک رشد نسبی در **میان مدت** باشد با سررسید شدن قراردادهای برج ۵ خودرو، قراردادهای سررسید برج ۶ خسپا از نظر حجم معاملات در صدر بازار بودند.

با این حال در بین نمادهای **اختیار خرید** در طول هفته گذشته به ترتیب نمادهای ضسپا ۶۰۰۵، ضدی ۵۰۰، ضهرم ۱۲۱۹، ضستا ۶۰۰۴ و ضخود ۸۰۱۸ **بیشترین ارزش** معاملات را به خود اختصاص دادند و همچنین در بین **اختیار فروش** ها نیز طستا ۶۰۱۰، طستا ۶۰۰۶ و طستا ۶۰۰۴ جزو نمادهای پر معامله بودند.

از قراردادهایی که در صورت **رشد بازار** میتوانند بازده مناسبی و به نسبت کم ریسکی را متوجه خریداران کنند می توان به قرارداد **ضهرم ۱۲۱۹** اشاره کرد که سررسید قرارداد آخر امسال میباشد که حدود ۲۵ درصد بالاتر از خود نماد اهرم معامله می شود که این درصد اختلاف برای ۸ ماه ای که تا تاریخ سررسید مانده اختلاف معقولی بحساب می آید و نکته دیگری که در اختیار خرید اهرم باید به آن توجه کرد این است که **ریسک** بسته شدن نماد اهرم فوق العاده پایین تر از نمادهای دیگر می باشد که این مورد را هفته پیش در **ضخودها** مشاهده کردیم که چطور منجر به از بین رفتن و زوال زمانی آنها شد، هر چند در انتخاب قرارداد در بازار اختیار باید به فاکتورهای دیگر نیز توجه لازم را داشت.

مهم ترین رویدادهای هفته گذشته :

- مهمترین اتفاق این هفته **سررسید شدن** قراردادهای خودرو و شستا مرداد ماه و همچنین با مصادف شدن تاریخ سررسید و تسویه فیزیکی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش سهام شرکت های ایران خودرو (خودرو) و سرمایه گذاری تامین اجتماعی (شستا) با ایام تعطیلات رسمی، تاریخ سررسید و تسویه فیزیکی در مشخصات این قراردادها، به روز شنبه ۱۴۰۲/۰۵/۱۴ موکول شد.

- **دوره معاملاتی** قرارداد آتی بر روی واحدهای **صندوق سرمایه گذاری سلام** با نماد (جسلا ۰۲۰۷) با سررسید مهرماه ۱۴۰۲ در بازار مشتقه از روز ۱۴۰۲/۰۵/۱۰ بورس اوراق بهادار تهران آغاز گردید.
- **دوره معاملاتی** قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام شرکت **زامیاد** (خزامیا) در سررسید بهمن ماه سال ۱۴۰۲ از روز چهارشنبه ۱۴۰۲/۰۵/۱۱ در بازار ابزارهای مشتقه فرابورس ایران آغاز گردید.
- **تعدیل قرارداد های** اختیار معامله خرید و فروش سهام شرکت **فولاد خوزستان** (فخوز) در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۲ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران.
- اطلاعیه **تعدیل قرارداد های** اختیار معامله خرید و فروش سهام **شبندر و شپنا** در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۲ و **فولاد و فملی و های وب و و خاور** در سررسید مهر ماه ۱۴۰۲ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران.
- اطلاعیه **آغاز دوره معاملاتی** قرارداد های اختیار معامله خرید و فروش سهام **خسپا و پترول** در سررسید دی ماه ۱۴۰۲ و شتران در سررسید مهرماه ۱۴۰۲ و شپنا و خودرو در سررسید شهریور ماه ۱۴۰۲ در بازار مشتقه بورس اوراق بهادار تهران.