

## گزارش هفتگی بورس اوراق بهادار، منتهی به ۲۱ مهر ماه ۱۴۰۲

### خلاصه ای از رویدادهای هفته گذشته بازار اختیار

ارزش معاملات در بازار اختیار معامله همانند هفته های قبل تر در هفته گذشته ادامه یافت و از ۷۴ تا ۸۹ میلیارد تومان متغیر بود. نکته حائز اهمیت در وضعیت فعلی بازار این است که با توجه به رنج بودن بازار سهام، سهم معاملات ریسکی را کاهش دهیم از این رو یکی از روش ها می تواند خرید قراردادهایی باشند که ارزش زمانی آن کم بوده و اصطلاحاً نرخ تامین مالی کمتری به خریدار اختیار تحمیل میشود. بدیت ترتیب میتوان اینطور اذعان کرد که این روش منجر به کم شدن هزینه های مالی پرتفو شده و باعث خواهد شد که نوسانات کوچک بازار هم برای پرتفوی های عایداتی فراهم کنند. بعلاوه موضوع نوسان پذیری دارایی های پایه به خصوص در خرید اختیار خرید باید در نظر گرفته شود تا محدوده احتمالی قیمت سهم تا سررسید شمایی در ذهن معامله گر داشته باشد.

### بیشترین ارزش معاملات هفتگی در قراردادهای اختیار معامله در اختیار خرید

ضخود ۸۰۱۸، ضسپا ۱۰۰۲، ضرهم ۱۲۱۹، ضخود ۸۰۱۹، ضستا ۱۲۱۲ و در اختیار فروش  
طخود ۸۰۱۹، طخود ۸۰۱۸، طستا ۱۲۱۵، طستا ۱۲۱۶.

📈 در هفته ای که گذشت سررسید قراردادهای اهرم ۰۷/۲۳، شتران ۰۷/۲۳،  
پتروآگاه ۰۷/۲۶، فولاد ۰۷/۲۶، وبملت ۰۷/۲۶ را داشتیم.

### مهمترین رویدادهای بازار اختیار معامله در هفته ای که گذشت:

اولین رویداد توقف نماد شستا جهت برگزاری مجمع عمومی عادی سالیانه و مجمع فوق العاده در پایان روز معاملاتی سه شنبه ۰۷/۲۵ را داشتیم.  
دومین رویداد مهم فراهم شدن امکان اخذ موقعیت باز فروش قرارداد اختیار معامله خرید پوشش داده شده با خرید دارایی پایه بدون نیاز به تودیع وجه تضمین از روز سه شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۸ که با شرایط زیر فراهم شد:

- این استراتژی فقط در قرارداد اختیار معامله خرید مبتنی بر دارایی (گواهی سپرده سکه طلا، واحدهای صندوق طلای کهربا و گواهی سپرده شمش طلا) قابل استفاده خواهد بود.
- کارگزار معاملات مشتقه مشتری و کارگزار ناظر دارایی تحت مالکیت مشتری در تمامی دارائی های پایه باید یکسان باشد.
- دارایی پایه حتما باید مسدود گردد. مسدود سازی دارایی پایه شامل جلوگیری از تغییر کارگزار ناظر و جلوگیری از فروش دارایی به هر نحوی است.
- فرایند اجرایی برای مسدودسازی دارایی های نزد شرکت سپرده گذاری مرکزی (صندوق کهربا و سکه طلا) و دارایی های نزد اتاق پایاپای بورس کالای ایران (گواهی سپرده شمش طلا) متفاوت است.

#### اطلاعیه های بازار اختیار معامله در هفته ای که گذشت:

- ❖ تسویه نقدی اختیار معاملات خاور و توسن در روز شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۵ از ساعت ۱۲:۳۰ الی ۱۵
- ❖ تسویه فیزیکی اختیار معاملات خاور و توسن در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۶ از ساعت ۱۲:۳۰ الی ۱۵
- ❖ تسویه نقدی اختیار معاملات سلام و های وب در روز سه شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۱۸ از ساعت ۱۲:۳۰ الی ۱۵
- ❖ آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش سهام بانک تجارت (وتجارن) در سررسید اسفندماه ۱۴۰۲
- ❖ تسویه نقدی اختیار معاملات سلام و های وب و و خاور در روز چهارشنبه ۱۴۰۲/۰۷/۱۹ از ساعت ۱۲:۳۰ الی ۱۵