

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۵ آبان ماه ۱۴۰۲

خلاصه ای از رویدادهای هفته گذشته بازار اختیار:

در هفته گذشته با به پایان رسیدن سررسید قرارداد های برج ۸ ایران خودرو میتوان این طور برآورد کرد که قرارداد های برج ۱۰ سایپا و سایر قرارداد ها و زنجیره های خودرو برای تبدیل شدن به ترند بازار رقابت جالبی داشته باشند.

در مورد نرخ های کاوردکال میتوان این طور بیان کرد که اگر چه در زنجیره های سایپا یا اهرم میتوان نرخ های جذابی پیدا کرد اما اگر شما سرمایه گذاری هستید که مسئله ریسک رول اوور برایتان حائز اهمیت است بهتر است در زنجیره قرارداد های ایران خودرو به دنبال پیاده سازی استراتژی کاورد کال باشید.

از آن گذشته به صورت تجربی میتوان دریافت که در بازار رنج این روزها بهتر است که استراتژی کاورد کالا در روزهای مثبت بازار اتخاذ شود. زیرا در این روزها انتظارات صعودی به نسبت بیشتر از روزهای منفی بوده و پیدا کردن قراردادهایی که بالاتر از ارزش بلک شولزشان هستند و مناسب رایت کردن می باشند راحت تر هستند.

در طرف مقابل اگر استراتژی خرید کال آپشن را در سر می پرورانید بهتر است نرخ بازدهی کاوردکال بر روی قرارداد مد نظرتان را محاسبه کنید و کمترین آن ها را برای خرید در واچ لیست خود قرار دهید.

اطلاعیه های بازار اختیار معامله در هفته ای که گذشت:

✚ تسویه نقدی اختیار معامله نماد های هم وزن و فزر، روز شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۲۹
✚ تسویه فیزیکی اختیار معامله نماد های هم وزن و فزر، روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۷/۳۰

✚ اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه گذاری صندوق واسطه گری مالی یکم با سررسید اسفندماه ۱۴۰۲.

- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق پالایشی یکم با سررسید اسفندماه ۱۴۰۲.
- اطلاعیه تغییر قیمت های اعمال قراردادهای اختیار معامله شرکت سرمایه گذاری تامین اجتماعی با سررسیدهای آبان، آذر، دی و اسفند ۱۴۰۲.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت سرمایه گذاری تامین اجتماعی با سررسید بهمن ماه ۱۴۰۲.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت ایران خودرو با سررسید فروردین ماه ۱۴۰۳.
- تسویه نقدی اختیار معامله نمادهای شستا و خودرو، روز سه شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۰۲.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت ذوب آهن اصفهان با سررسید بهمن ماه ۱۴۰۲.
- تسویه فیزیکی اختیار معامله نماد های شستا و خودرو، روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۰۳.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای صندوق سرمایه گذاری سهامی شتاب آگاه-اهرمی با سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت پالایش نفت اصفهان با سررسید اسفند ماه ۱۴۰۲.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت گسترش سرمایه گذاری ایران خودرو با سررسید اسفند ماه ۱۴۰۲.