

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۱۲ آبان ماه ۱۴۰۲

خلاصه ای از رویدادهای هفته گذشته بازار اختیار:

در هفته گذشته تغییر فاحشی در ارزش معاملات اختیار نسبت به هفته های گذشته رخ نداد. همان طور که قبلا هم ذکر کردیم، ارزش معاملات تا زمانی که ارزش بازار نقدی سهام رونق نگیرد تغییر خاصی نخواهد داشت. نکته جالب در چند وقت اخیر افزایش ارزش معاملات قراردادهای اختیار فروش به شکل بسیار چشمگیری بوده که البته بیشتر با نیت کسب بازده از روند نزولی بوده تا بیمه کردن پورتفو. این برای اولین بار است که معامله گران بورس در بازار خرسی سعی در کسب بازده از طریق بازار آپشن را دارند.

از دلایل این اتفاق می توان به فضای نزولی فرسایشی بازار در طی مدت اخیر اشاره کرد که سبب شد سفته بازی در بازار اختیار معامله در زمین اختیار فروش ها بیش از پیش جذاب شود. همچنین استراتژی های متفاوت که بخشی از آنها با خرید و فروش پوت آپشن ها امکان پذیر است، دست معامله گران و پوشش دهندگان ریسک را بیش از پیش باز گذاشته است. در شرایط فعلی که شاید فضای شک و تردید در بازار زیاد باشد می توان به استراتژی بدون اسپرد روی آورد تا بتوان تا حدودی ریسک را کنترل کرد. همچنین نباید از اتخاذ این استراتژی با پوت ها غافل شویم که مزایای نسبی به کال بول اسپرد دارد.

اطلاعیه های بازار اختیار در هفته ای که گذشت

- آغاز دوره معاملاتی آتی نماد شتاب در سررسید اردیبهشت ماه ۱۴۰۳ و نماد شتران با سررسید بهمن ۱۴۰۲
- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد خزامیا در سررسید بهمن ماه ۱۴۰۲
- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد های وب در سررسید آذر ماه ۱۴۰۲
- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد خسپا در سررسید دی ماه ۱۴۰۲
- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد برکت و فخور در سررسید اسفند ماه ۱۴۰۲

- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد سرو در سررسید خرداد ماه 1403
- آغاز دوره معاملاتی قرارداد اختیار معامله خرید و فروش نماد خاور در سررسید فروردین ماه 1403

