

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۱۹ آبان ماه ۱۴۰۲

خلاصه ای از رویدادهای هفته گذشته بازار اختیار:

با مثبت شدن روند بازار در هفته گذشته ارزش معاملات بازار اختیار معامله بهبود محسوسی داشت به نحوی که در ۲ روز پایانی ارزش معاملات بالای ۱۰۰ میلیارد تومان ثبت گردید. اگر دقیق تر این موضوع را بررسی کنیم متوجه می شویم که به صورت کلی رشد ارزش معاملات آپشن بیشتر در روزهای سبز بازار سهام اتفاق می افتد.

این پدیده یادآور دونکته مهم میباشد:

اول اینکه رفتاری جمعی از طرف هیچ کنندگان و فعالان خرد برای اتخاذ موقعیت های پوششی و شرط بندی بر علیه بازار دیده نمیشود که این مورد میتواند ناشی از عمق کم بازار باشد که نمیتوان به راحتی بر علیه بازار بازار شرط بست. دوم اینکه آموزش ها در مورد این بازار نوظهور هنوز نتوانسته که ابعاد مختلف را شامل شود که این موضوع در گذر زمان حل خواهد شد. درمجموع با همه این چالش ها و کمبودها تنها نکته غیر قابل انکار آینده روشن این بازار کم سن و سال است.

هفته گذشته رکورد بیش ترین حجم و ارزش معاملات را طی ۶۰ روز گذشته به ثبت رسانده که به ترتیب شاهد ۱۹ درصد رشد در حجم و ۳۴ درصد رشد در ارزش معاملات بوده ایم. ضمناً در هفته پیش رو ، قراردادهای مربوط به نمادهای پالایش و دارایکم سررسید خواهند شد که با توجه به موقعیت های باز در نمادهای ضدار ۸۰۰۸ و ضیلا ۸۰۰۲ انتظار می رود شاهد افزایش تحرکات در این دو نماد باشیم.

بر اساس دارایی پایه نیز بیشترین معاملات صورت گرفته همانند دوره های گذشته متعلق به نماد خودرو، خساپا و شستا می باشد.

اطلاعیه های بازار اختیار در هفته ای که گذشت

- آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار خرید و فروش سهام بانک صادرات ایران در نماد "وبصادر" با سررسید بهمن ماه ۱۴۰۲
- تسویه فیزیکی اختیار معامله نمادهای برکت و فخوز در روز یکشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۱۴
- تسویه نقدی اختیار معامله نمادهای برکت و فخوز در روز شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۱۳
- تسویه فیزیکی اختیار معامله نماد دی در روز چهارشنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۱۷
- تسویه نقدی اختیار معامله نماد دی در روز سه شنبه مورخ ۱۴۰۲/۰۸/۱۶

