

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۳ آذر ماه ۱۴۰۲

ارزش معاملات در بازار آپشن در هفته گذشته به مراتب کمتر از هفته های پیشین بود اما پیش بینی میشود با توجه به نزدیک شدن سررسید برج ۹ زنجیره قرارداد های ایران خودرو، شاهد رشد ارزش معاملات به صورت مقطعی باشیم. ساختار قیمتی آپشن متشکل از دو بخش ارزش ذاتی و زمانی است. ارزش ذاتی تحت تاثیر رفتار قیمتی دارایی پایه و ارزش زمانی متاثر از زمان.

نکته مهم این است که زمانی که اقدام به خرید آپشن میکنید اگر قرارداد بی تفاوت (at the money) را انتخاب کنید در واقع بیشترین پول را برای ارزش زمانی میدهید زیرا در قرارداد های بی تفاوت ارزش زمانی در حد اکثر خود است لذا بیشتر از گذر زمان متاثر خواهید شد. قراردادهای در سود (in the money) و قراردادهای در زیان (out of the money) ارزش زمانی کمتری نسبت به این نوع قراردادها دارند.

در هفته ای که گذشت:

- بازگشایی قرارداد اختیار معامله سهام خبهمن سررسید بهمن ۱۴۰۲ از شنبه ۲۷ آبان
- بازگشایی قرارداد اختیار معامله سهام صندوق سرمایه گذاری دریا سررسید خرداد ۱۴۰۳ از چهارشنبه ۰۹/۰۱
- بازگشایی قرارداد اختیار معامله سهام صبا فولاد خلیج فارس، فضا سررسید بهمن ۱۴۰۲ از شنبه ۰۹/۰۴
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش واحدهای صندوق سرمایه گذاری دریای آبی فیروزه-سهام سررسید خرداد ماه ۱۴۰۳

گزارش های عملکرد آبان ماه

این هفته گزارش عملکرد آبان ماه شرکت ها منتشر می شود. البته از اواخر هفته ی پیش این انتشار گزارش ها شروع شده است آبان از نظر شرکت هایی که در بورس کالا اقدام به فروش محصول می کنند، تحول خاصی نسبت به مهر نداشت. اما در شرکت هایی که اطلاعات دیگری برای سنجش عملکرد فروش آنها نیست، گزارش آبان ها می تواند بر روند قیمت نماد مربوط تاثیرگذار باشد. در کل به دلیل رکود انتظار رشد درآمد خاصی وجود ندارد

