

گزارش هفتگی بازار مشتقه، منتهی به ۱۰ آذر ماه ۱۴۰۲

خلاصه ای از رویدادهای هفته گذشته بازار اختیار:

در هفته گذشته با بیشتر شدن ارزش معاملات سهام، بازار آپشن هم عمق جذابی گرفت. این روند در هفته آتی نیز تکرار پذیر است. با مثبت شدن بازار در روزهای انتهایی هفته قبل بسیاری از فعالان حوزه آپشن قصد خرید نیکد کال را داشتند. در این موضوع دو نکته قابل توجه است. بررسی اهرم های هر اختیار معامله و تلاش برای ایجاد یک پرتفو که از منظر اهرمی و ریسکی بودن با روحیات و شخصیت ما همخوانی دارد و زمان مانده تا سررسید هر قرارداد و به دنبال آن میزان تنای هر قرارداد از ضروری ترین موارد است که باید بررسی شود.

نکته جالب دیگر این است که طرفداران نظریه توطئه که هر ماه با سررسید شدن یک قرارداد مهم سر و کله شان پیدا میشود دیر یا زود باید بپذیرند دست بازار از هر دستی بالاتر است و بدانند ساختار نظام مالی ایران قبل و بعد از بازار آپشن با مشکلات مشابهی دست و پنجه نرم میکرده است و وظیفه حرفه ای هر فعال بازار کمک به توسعه ابزارهای نوین است و لاغیر.

اطلاعیه های بازار اختیار معامله در هفته ای که گذشت:

- تسویه نقدی قراردادهای اختیار فملی با ، در شنبه مورخ ۰۴/۰۹/۱۴۰۲.
- تسویه فیزیکی قراردادهای اختیار در یک شنبه مورخ ۰۵/۰۹/۱۴۰۲.
- تسویه نقدی قراردادهای اختیار خودرو در روز سه شنبه ۰۹/۰۷/۱۴۰۲.
- تسویه فیزیکی قراردادهای اختیار تخودرو در روز چهارشنبه ۰۸/۰۹/۱۴۰۲.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش بانک صادرات ایران ، سررسید: فروردین ماه ۱۴۰۳
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش شرکت ذوب آهن اصفهان، سررسید: فروردین ماه ۱۴۰۳.
- اطلاعیه آغاز دوره معاملاتی قراردادهای اختیار معامله خرید و فروش صندوق سرمایه گذاری سهامی کاریزما، سررسید: فروردین ماه ۱۴۰۳، اردیبهشت ماه ۱۴۰۳، خرداد ماه ۱۴۰۳.