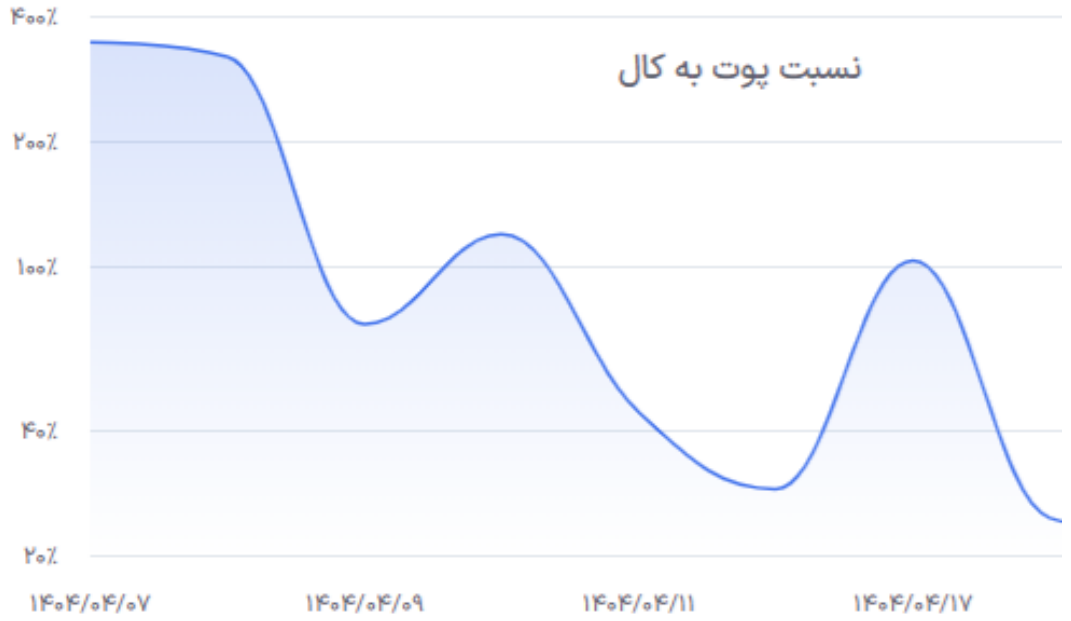
کارگزاری فارابی
FARABI BROKERAGE

گزارش هفتگی بازار مشتقه

هفته منتهی به ۱۸ تیر ۱۴۰۴

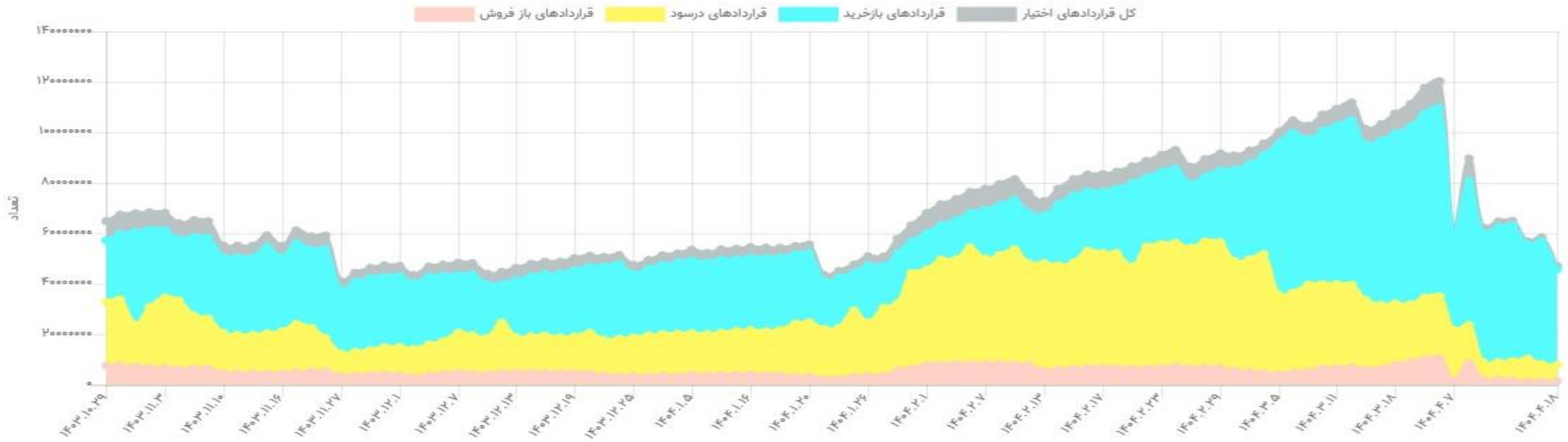
شروع مثبت بازار سرمایه در ابتدای هفته معاملاتی منجربه تغییر نسبت حجم و ارزش معاملات قراردادهای اختیار خرید و فروش شد. اما در مجموع کاهش حدود ۳ درصدی در شاخص کل را شاهد بودیم که نهایتا در ساعت پایانی معاملات روز ۱۸ تیرماه حقوقی ها اقدام به خرید صفوف فروش و ایجاد تعادل در تابلو برخی نمادها نمودند.

همچنین با توافق صندوق توسعه بازار سرمایه و صندوق های اهرمی اقدامی در جهت ایجاد تعادل در بازار سرمایه صورت گرفت.



باتوجه به روند نزولی بازار و ایجاد تغییرات در برخی استراتژی ها همچنین به دلیل به سقف رسیدن سررسید تیرماه اهرم، موقعیت های باز طی هفته گذشته کاهش پیدا کرد.

اختیار معامله	
ارزش معاملات(میلیون ریال)	۷,۲۳۳,۰۰۰
حجم معاملات	۳۱,۴۲۸,۲۴۲
ارزش مفهومی (میلیون ریال)	۱۷۰,۰۰۰,۰۰۰

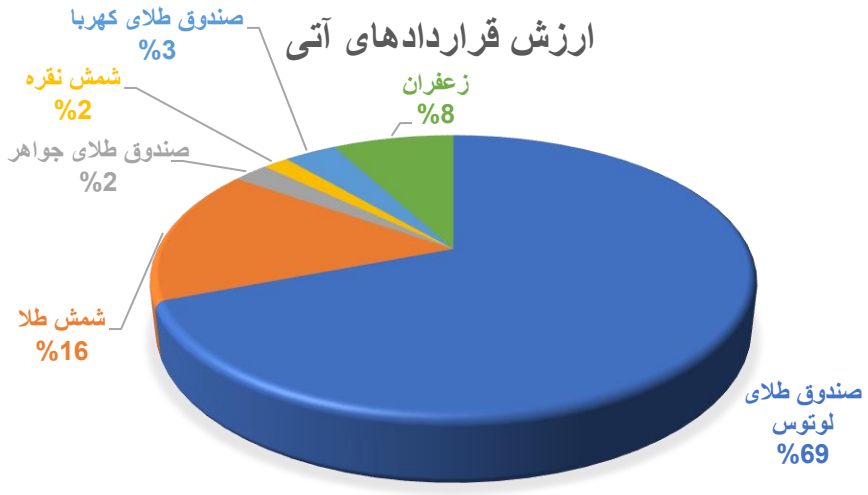


جهت کاهش ریسک سرمایه گذاران، صندوق تثبیت بازار سرمایه اقدام به انتشار اختیار فروش تبعی با نرخ ۲۰% جهت حمایت از سهامداران خرد با پرتفو زیر ۵۰۰ میلیون تومان نمود. تاریخ محاسبه پرتفو ۱۷ تیرماه ۱۴۰۴ می باشد.

کارگزاری فارابی
FARABI BROKERAGE

آمار معاملات هفتگی بازار مشتقه بورس کالا

	قراردادهای آتی	اختیار معامله
ارزش معاملات(میلیون ریال)	۳,۰۰۰,۸۶۱	۳۳,۷۵۴
حجم معاملات	۱۶,۰۶۹	۲۳۱,۸۴۸

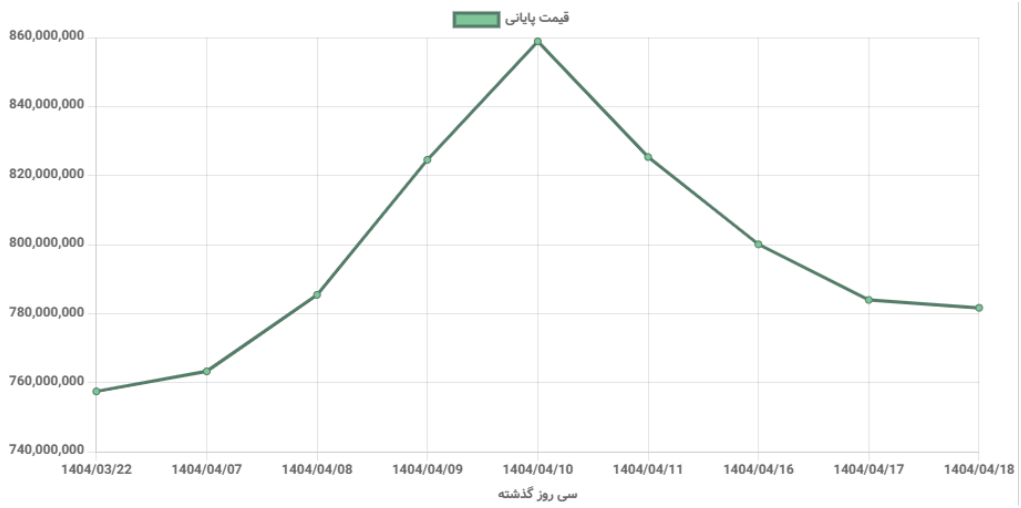


گواهی سپرده سکه بهار آزادی با کاهش حدود ۸ درصدی طی یک هفته معاملاتی در روز پایانی هفته مثبت معامله شد.

شمش طلا نیز کاهش حدود ۵ درصدی را تجربه کرد.

	سکه بهار آزادی	شمش
ارزش معاملات(میلیون ریال)	۵,۳۲۸,۸۲۴	۱۸,۵۰۳,۹۰۲
حجم معاملات	۶,۷۲۶	۱,۹۷۸,۷۴۱

ارزش معاملات گواهی سپرده سکه بهار آزادی



حجم معاملات شمش نقره در طی هفته گذشته از ابتدای راه اندازی این ابزار در بورس کالای ایران با ثبت حجم ۲۰ تن رکورد شکنی کرد.

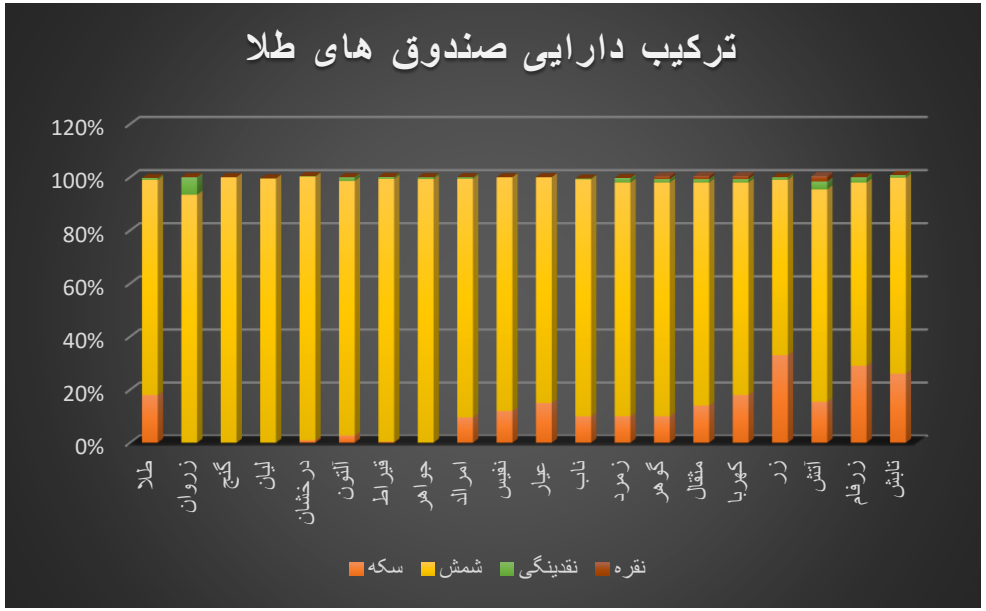
در پی افزایش تنش های تجاری و سیاسی در سطح جهانی نیز نقره در کنار طلا به عنوان دارایی امن برای سرمایه گذاران مورد توجه قرار گرفته و در پایان هفته هر انس نقره به بیش از ۳۸ دلار و به سقف قیمتی ۱۴ ساله اخیر خود رسید.

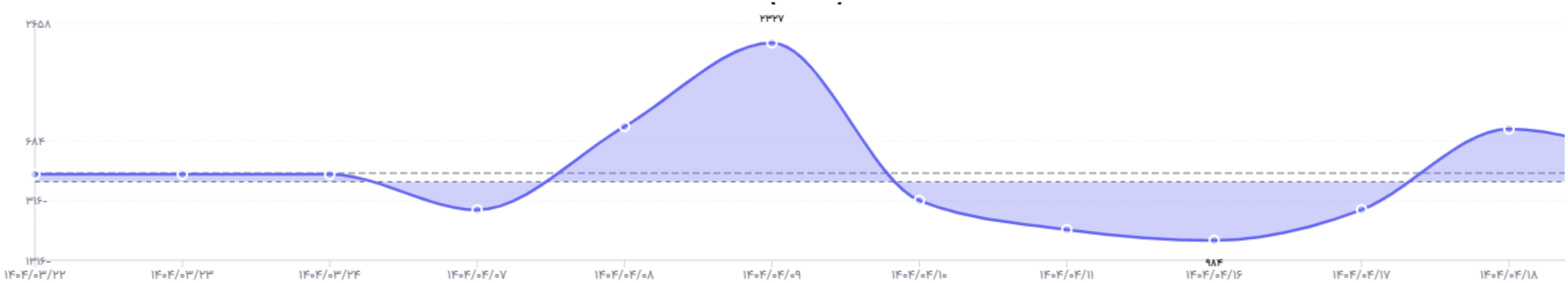
گواهی سپرده نقره	
ارزش معاملات(میلیون ریال)	۶۷۰,۴۸۹
حجم معاملات	۶۸۷,۴۴۴

کارگزاری فارابی
FARABI BROKERAGE

صندوق های طلا

ارزش معاملات(میلیون ریال)	۸۹,۴۶۷,۵۸۹
حجم معاملات	۱,۱۴۸,۳۵۳,۴۴۵





جریان ورود و خروج پول در صندوق های طلا
(ماهانه)

	صندوق های زعفران	گواهی سپرده زعفران	آتی زعفران
ارزش معاملات(میلیون ریال)	۶۸۷/۸۵۲	۴۹۲/۷۹۷	۲۳۴/۸۱۵
حجم معاملات	۱۹/۳۷۴/۲۷۸	۴۷۴/۰۶۱	۲/۱۸۷

با سپاس از توجه شما