

قراردادهای تحویل آتی

تالیف:

اسماعیل فرامند حسن آبادی



انتشارات موجک



سازمان اسناد و کتابخانه ملی جمهوری اسلامی ایران

سرشناسه : فرهمند حسن آبادی، اسماعیل، ۱۳۵۸ -

عنوان و نام پدیدآور : قراردادهای تحویل آتی / تألیف اسماعیل فرهمند حسن آبادی.

مشخصات نشر : تهران: انتشارات موجک، ۱۳۹۶.

مشخصات ظاهری : ۹۴ ص.

شابک : ۸-۰۷-۸۷۹۹-۶۰۰-۹۷۸، ۱۷۰۰۰۰ ریال

وضعیت فهرست نویسی : فیا

موضوع : معاملات آتی سهام -- ایران

موضوع : Single stock futures -- Iran

موضوع : بورس -- ایران

موضوع : Stock exchanges -- Iran

رده بندی کنگره : ۱۳۹۶ ق ۴ / ۶۰۲ H

رده بندی دیویی : ۳۳۲/۶۴۵۰۹۵۵

شماره کتابشناسی ملی : ۴۷۰۶۳۱۲

انتشارات موجک

تلگرام : ۰۹۰۱۷۶۷۲۵۰۲

کانال : telegram.me/mojak1

تلفن مرکز پخش : ۰۲۶۳۲۴۰۳۵۱۶ - ۰۲۶۳۲۴۰۳۵۱۳ - ۰۲۱۶۱۱۰۰۰۳

ایمیل : mojakpublication@yahoo.com

سایت : www.mojak.ir

عنوان : قراردادهای تحویل آتی

تألیف : اسماعیل فرهمند حسن آبادی

طراح جلد : سیده زهرا روشنایی

مشخصات ظاهری : ۹۴ صفحه، قطع وزیری

چاپ اول : بهار ۱۳۹۶، تیراژ : ۱۰۰۰ جلد

قیمت : ۱۷۰۰۰۰ ریال، شابک : ۸-۰۷-۸۷۹۹-۶۰۰-۹۷۸

حقوق چاپ و نشر برای ناشر محفوظ است.



انتشارات
موجک
شماره
۱۰-۲۲۸

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

بخش اول: قراردادهای تحویل آتی ۱

فصل اول: اختیار معامله ۳

۱-۱ مقدمه ۳

۱-۲ تعریف مشتقات ۳

۱-۳ تعریف اختیار معامله ۴

۱-۴ انواع و اقسام اختیار معامله ۴

۱-۴-۱ اختیار معامله با توجه به نوع معامله ۴

۱-۴-۲ اختیار معامله با توجه به نحوه اعمال ۴

۱-۵ تقسیم‌بندی اختیار معامله در بورس‌های معتبر ۵

۱-۵-۱ معامله سهام ۵

۱-۵-۲ اختیار معامله شاخص ۵

۱-۵-۳ اختیار معامله اوراق قرضه ۵

۱-۵-۴ پیمان‌های آتی ۶

۱-۵-۵ اختیار معامله ارز ۶

فصل دوم: قرارداد تحویل آتی ۷

۱-۲ تعریف قرارداد تحویل آتی ۷

۲-۲ اصطلاحات رایج در قراردادهای آتی ۹

- ۹-۲-۱ اتاق پایابای
- ۱۰-۲-۲ حساب ودیعه
- ۱۱-۲-۳ نکول
- ۱۱-۲-۴ موقعیت تعهدی خرید (فروش)
- ۱۱-۲-۵ موقعیت تعهدی باز
- ۱۱-۲-۶ تسویه فیزیکی
- ۱۲-۲-۷ تسویه نقدی
- ۱۲-۳-۳ بار وجه شروع معاملات آتی
- ۱۳-۲-۴ دسته‌بندی قرارداد های آتی
- ۱۳-۲-۴-۱ قرارداد های تحویل آتی اختصاصی
- ۱۴-۲-۴-۲ قرارداد های تحویل آتی قابل معامله
- ۱۴-۲-۵ انواع قرارداد آتی
- ۱۴-۲-۵-۱ قرارداد آتی نرخ ارز
- ۱۵-۲-۵-۲ قرارداد آتی نرخ سود
- ۱۵-۲-۵-۳ قرارداد آتی اوراق بهادار
- ۱۵-۲-۵-۴ قرارداد آتی روی کالاها

۱۷- فصل سوم: ویژگی قرارداد های تحویل آتی

- ۱۷-۳-۱ مشکلات قرارداد در بازار قرارداد آتی
- ۱۷-۳-۲ ویژگی ها و شرایط قراردادهای آتی
- ۱۸-۳-۳ شیوه تهاتر قراردادهای تحویل آتی
- ۱۸-۳-۳-۱ تهاتر از طریق تعدیل روزانه موقعیت سرمایه گذاری
- ۱۹-۳-۳-۲ تهاتر از طریق انجام معاملات خشی کننده
- ۱۹-۳-۳-۳ تهاتر معاملات از طریق تحویل
- ۱۹-۳-۳-۴ تهاتر از طریق تسویه نقدی

- ۴-۳ انواع معامله کنندگان بازار آتی ۱۹
- ۳-۴-۱ پوشش دهندگان ۱۹
- ۳-۴-۲ سفته‌بازان یا بورس‌بازان ۲۰
- ۳-۴-۳ آربیتراژ کنندگان ۲۰
- ۵-۳ کاربرد قراردادهای تحویل آتی ۲۱
- ۳-۵-۱ استراتژی فروش قرارداد تحویل آتی ۲۱
- ۳-۵-۲ استراتژی خرید قرارداد تحویل آتی ۲۲
- ۳-۶ قراردادهای تحویل آتی و انواع قراردادهای اسلامی مشابه آن ۲۳
- ۳-۶-۱ قرارداد تحویل آتی بعنوان عقد غیر معین (تعهد به بیع) ۲۳
- ۳-۶-۲ قرارداد تحویل آتی بعنوان عقد بیع مآجل ۲۴
- ۳-۶-۳ قرارداد تحویل آتی بعنوان عقد صلح ۲۴
- ۷-۳ مزایای معاملات آتی ۲۵
- ۳-۷-۱ پوشش ریسک ۲۵
- ۳-۷-۲ تضمین معاملات توسط اتاق پایاپای بورس ۲۵
- ۳-۷-۳ استفاده از اهرم مالی ۲۶
- ۳-۷-۴ نقد شوندگی بالای معاملات ۲۶

فصل چهارم: اوراق بهادار ۲۷

- ۴-۱ دسته‌بندی اوراق بهادار ۲۷
- ۴-۱-۱ دسته‌بندی اوراق بهادار براساس ماهیت ۲۷
- ۴-۱-۲ دسته‌بندی اوراق بهادار بر اساس جریان‌های نقدی ۲۷
- ۴-۲ بورس اوراق بهادار ۲۷
- ۴-۳ بازارهای معامله اوراق بهادار ۲۸
- ۴-۳-۱ بازار اولیه ۲۸
- ۴-۳-۲ بازار ثانویه و بورس اوراق بهادار ۲۹

فصل پنجم: پیشینه داخلی قراردادهای آتی ۳۱

فصل ششم: پیشینه خارجی قراردادهای آتی ۴۱

بخش دوم: مطالعه موردی (بررسی امکان‌سنجی به کارگیری قرارداد تحویل آتی روی اوراق
مالی در بازارهای بورس اوراق بهادار ایران) ۴۷

فصل هفتم: کلیات ۴۹

۱-۷ مقدمه ۴۹

۲-۷ تعریف مسئله ۵۰

۳-۷ اهمیت مسئله ۵۲

۴-۷ اهداف ۵۳

۵-۷ فرضیه‌ها ۵۳

۶-۷ تعریف واژه‌ها و اصطلاحات ۵۴

فصل هشتم: مراحل انجام و راهکارهای آن ۵۷

۱-۸ مقدمه ۵۷

۲-۸ روش ۵۸

۳-۸ جامعه آماری ۵۹

۴-۸ حجم نمونه و روش نمونه‌گیری ۶۰

۵-۸ مقیاس و طیف ابزار اندازه‌گیری ۶۰

۶-۸ پایایی پرسش‌نامه ۶۱

۷-۸ روایی پرسش‌نامه ۶۲

۸-۸ روش تجزیه و تحلیل داده‌ها ۶۲

۹-۸ مراحل اجرای تکنیک (AHP) ۶۳

فصل نهم: تجزیه و تحلیل داده‌ها ۶۹

۱-۹ مقدمه ۶۹

۲-۹ تجزیه و تحلیل توصیفی داده‌ها ۶۹

۳-۹ بررسی فرضیه‌های مربوط به پرسش‌نامه‌ی اول ۷۳

۱-۳-۹ بررسی فرضیه اول ۷۴

۲-۳-۹ بررسی فرضیه دوم ۷۵

۳-۳-۹ بررسی فرضیه سوم ۷۷

۴-۳-۹ بررسی فرضیه چهارم ۷۹

۵-۳-۹ بررسی فرضیه پنجم ۸۱

۴-۹ رتبه‌بندی عوامل مؤثر بر قرارداد تحویل آتی اوراق مالی ۸۲

۱-۴-۹ معیار فنی و مالی ۸۳

۲-۴-۹ معیار بازارسنجی ۸۴

۳-۴-۹ نتایج رتبه‌بندی دو معیار ادلی ۸۶

۵-۹ خلاصه نتایج آزمون فرضیه ۸۶

فصل دهم: نتیجه‌گیری و پیشنهادها ۸۹

۱-۱۰ مقدمه ۸۹

۲-۱۰ نتایج کلی ۸۹

۳-۱۰ رتبه‌بندی عوامل مؤثر در قرارداد تحویل آتی اوراق مالی ۹۲

۴-۱۰ پیشنهاد کاربردی ۹۳

۵-۱۰ پیشنهاد علمی - محتوایی ۹۳