

جمع‌آوری داده‌های آپشن

ما یک تاریخچه از قیمت‌ها و حجم اردرهای آپشن‌های کال و پوت نمادهای خودرو، شستا و اهرم را نیاز داریم. این داده‌ها برای یک دوره 5 ساله، از امروز تا 5 سال پیش، جمع‌آوری خواهند شد.

جزئیات جمع‌آوری داده‌ها

• نمادهای مورد نظر:

○ خودرو

○ شستا

○ اهرم

• نوع آپشن‌ها:

○ کال آپشن (Call Option)

▪ مثال: ضخود 1087

▪ مثال: ضهرم 6028

▪ <https://www.tsetmc.com/InstInfo/8898930095586153>

○ پوت آپشن (Put Option)

▪ مثال: طخود 1087

• دوره زمانی:

○ از 5 سال پیش تا امروز (فقط روزهای معاملاتی).

• فرکانس جمع‌آوری:

○ 4 بار در روز در ساعات مشخص شده:

▪ 09:05

▪ 10:05

▪ 11:05

▪ 12:05

○ این خوانش‌ها برای همه کال‌ها و پوت‌های مربوط به نمادهای مشخص شده انجام خواهد شد.

1	2	3	4
اختیارخ اهرم- 1404/06/26-22000 (ضهرم 6028)			
نوع نماد: سهامی اهرم			
آخرین معامله	1,160	(592)	[-33.79%]
قیمت بابانی	1,239	(513)	[-29.28%]
اولین قیمت	1,581		
قیمت دیروز	1,752		
تعداد معاملات	8,135		
حجم معاملات	616,074		
ارزش معاملات	763.416 B		
ارزش مفهومی معاملات	12,537.106 B		
آخرین اطلاعات قیمت	12:29:58		
وضعیت	محار		
اطلاعات تکمیلی			
موقعیت های باز	373,402	اندازه قرارداد	
ماشین حساب ارزش گذاری اختیار		ماشین حساب ضرایب پوش	
ماشین حساب نوسان پذیری ضمنی		ماشین حساب وجوه تضمین	
تعداد	حجم	فروش	خرید
1	25	1,155	1,165
1	10	1,153	1,166
1	19	1,152	1,169
2	1,000	1,150	1,172
3	112	1,146	1,208

- 1- نام نماد پایه : اهرم
- 2- قیمت اعمال : 26000
- 3- تاریخ سر رسید : 26 شهریور 1404
- 4- نام قرارداد آپشن : ضهرم 6028
- 5- سه ردیف اول اردرهای خرید (قیمت و حجم)
- 6- سه ردیف اول اردرهای فروش (قیمت و حجم)

• اطلاعات مورد نیاز برای آپشن ها:

- قیمت اردرها: سه سطر بالای اردرهای خرید و سه سطر بالای اردرهای فروش.
- حجم اردرها: حجم مربوط به هر یک از اردرهای سه سطر بالا (خرید و فروش).
- تاریخ سررسید قرارداد آپشن
- قیمت اعمال قرارداد کال یا پوت

• اطلاعات مورد نیاز برای نمادهای اصلی (پایه):

○ آخرین قیمت معامله شده: در همان 4 زمان مشخص شده در روز (09:05، 10:05، 11:05، 12:05) ذخیره خواهد شد.

○ توجه: برای نمادهای اصلی، اردرها مورد نیاز نیستند.

• حجم معاملات روزانه برای هر سررسید:

○ جمع کل حجم معاملات کال و پوت یک نماد پایه برای یک تاریخ سررسید مشخص در هر روز کاری.

○ به عنوان مثال، برای خودرو، نیاز به جمع حجم کال و پوت‌های با سررسید شهریور 1404 در هر روز کاری داریم.

قالب ذخیره‌سازی داده‌ها

• فایل اکسل: تمامی داده‌ها در یک فایل اکسل واحد یا گوگل شیت به ازای هر سهم پایه ذخیره می‌شوند. یعنی یک فایل برای اهرم یک فایل برای خودرو و یک فایل برای شستا.

• برخی از ستون‌های فایل اکسل:

○ نام نماد: مثلاً "خودرو"، "شستا"، "اهرم"

○ تاریخ:

○ نام نماد کال آپشن یا پوت آپشن

○ کال بودن یا پوت بودن (با مثبت یا منفی 1 نمایش داده شود).

○ ساعت: 09:05، 10:05، 11:05، 12:05

○ تاریخ سررسید قرارداد آپشن

○ قیمت اعمال

○ اردرهای سمت خرید (3 ردیف): شامل قیمت و حجم هر اردر. (در سه ستون)

○ اردرهای سمت فروش (3 ردیف): شامل قیمت و حجم هر اردر. (در سه ستون)

○ آخرین قیمت معامله شده نماد اصلی: در لحظه خوانش.

○ حجم کل معاملات روزانه (کال + پوت) برای تاریخ سررسید مشخص: این ستون فقط برای انتهای هر روز کاری پر می‌شود.

شناسایی "روزهای ممنوعه"

یک مکانیزم برای شناسایی "روزهای ممنوعه" بر اساس حجم معاملات روزانه در نظر گرفته شده است:

• اگر جمع کل حجم قراردادهای معامله شده (کال + پوت) مربوط به یک تاریخ سررسید در یک روز کاری، نسبت به روز کاری قبل از آن 20% یا بیشتر کاهش یابد، آن روز و روزهای بعد از آن به عنوان "روزهای ممنوعه" مشخص می‌شوند (با منفی 1 نشان داده شود)

- "روزهای ممنوعه" تا زمانی ادامه می‌یابند که یک جهش حداقل 20 درصدی در حجم معاملات همان سررسید نسبت به روز قبل از آن رخ دهد.

موارد فوق بصورت محاوره ای :

قیمت های کال آپشن ها و پوت آپشن های نمادهای خودرو - شستا - اهرم رو میخوانم
این قیمت ها از 5 سال پیش تا امروز برای من باید تهیه بشه
قیمت معامله برام اهمیتی نداره بلکه قیمت اردرهای گذاشته شده در سه سطر بالایی و حجم هر اردر مهم هست
سه سطر از اردرهای خرید و سه سطر از اردرهای فروش
و حجم اردرها

هر یک ساعت یکبار , این اعداد قیمتی و حجمی اردرها رو لازم دارم

در هر روز 4 بار باید خوانش انجام بشه

روزهای معاملاتی از 5 سال پیش تا الان

اولین خوانش برای ساعت 9:05 دقیقه باید باشه

که خوانش های بعدی میشه 10:05

11:05

12:05

دقیقه

میشه 4 بار در روز

برای همه کال ها و پوت های نمادهای مشخص شده

همه اینها باید در یک فایل اکسل ذخیره شود. به ازای هر نماد پایه یک فایل.

نام نماد و تاریخ و ساعت و اردرهای سمت خرید و سمت فروش و حجم اونها و سایر اطلاعات مورد نیاز همچنین آخرین قیمت معامله شده نماد اصلی یا پایه در همان لحظه هم باید در این جدول ذخیره شود.

برای نماد اصلی , اردرها نیاز نیست و فقط آخرین قیمت معامله مهم هست که در هر 4 تا زمان مشخص شده در روز باید در همان فایل اکسل ذخیره بشه

یکی از داده های مهم جدول , باید تاریخ سر رسید قرارداد آپشن باشه
قراردادهای آپشن, برای یک تاریخ سر رسید , شامل چند پوت و چند کال هست

که یکی دیگه از اطلاعات مورد نیاز من , حجم معامله شده در هر روز کاری , برای هر سر رسید هست

یعنی مثلا من نیاز دارم بدونم که حجم قراردادهای کال و پوت نماد خودرو برای قراردادهای با سر رسید شهریور سال 1404 در هر روز کاری چقدر هست

جمع کل پوت و کال یک نماد پایه برای یک تاریخ سر رسید مشخص برای هر روز کاری

یعنی در یک روز کاری, حجم معاملات انجام شده همه قراردادهای کال و همه قراردادهای پوت مربوط به یک سر رسید رو جمع می زنیم و با عدد روز قبل مقایسه میکنیم

سپس اگر این عدد جمع حجم قراردادهای معامله شده مربوط به یک تاریخ سر رسید در یک روز کاری نسبت به روز قبل از آن, 20 درصد کمتر شد , آن روز و روزهای بعد از آن را به عنوان روزهای ممنوعه مشخص کن و این روزهای ممنوعه تا زمانی که یک جهش حداقل 20 درصدی در حجم معاملات انجام نشده, ادامه پیدا کنه