

شماره

۰۱

اولین گزارش تخصصی روزانه از

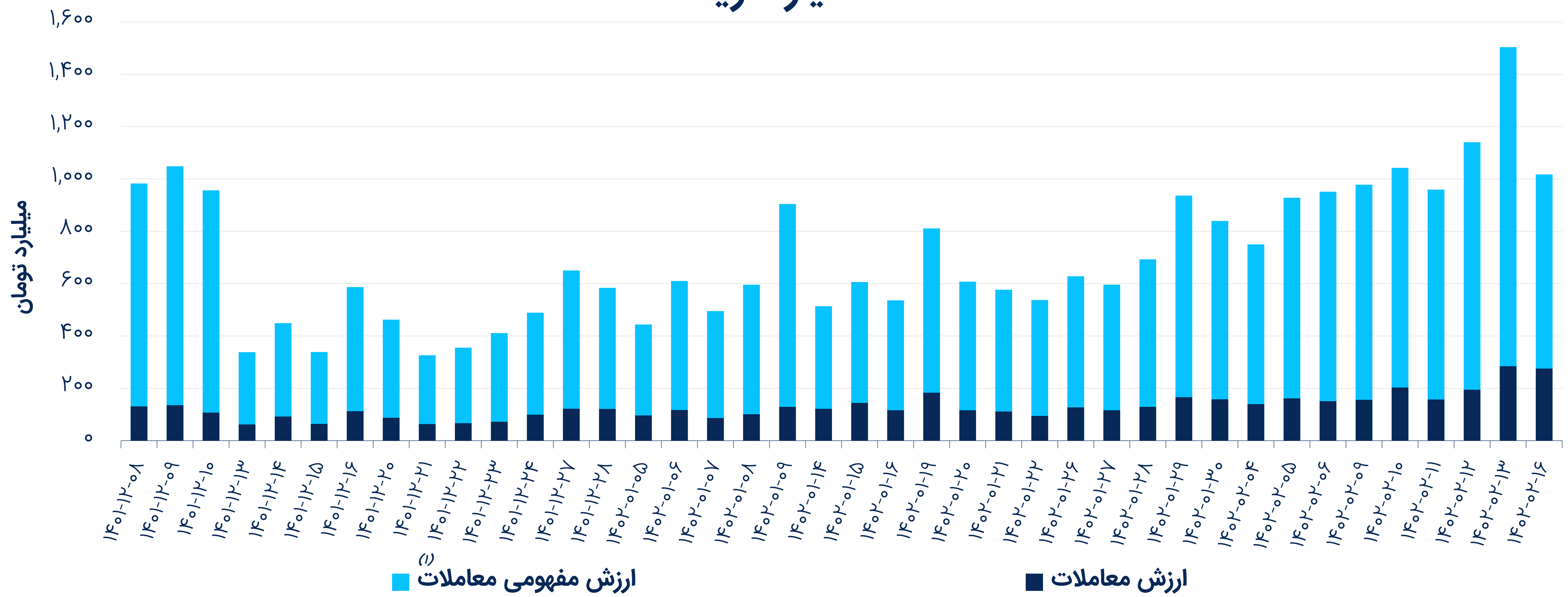
بازار اختیار معامله

۱۶ اردیبهشت ۱۴۰۲

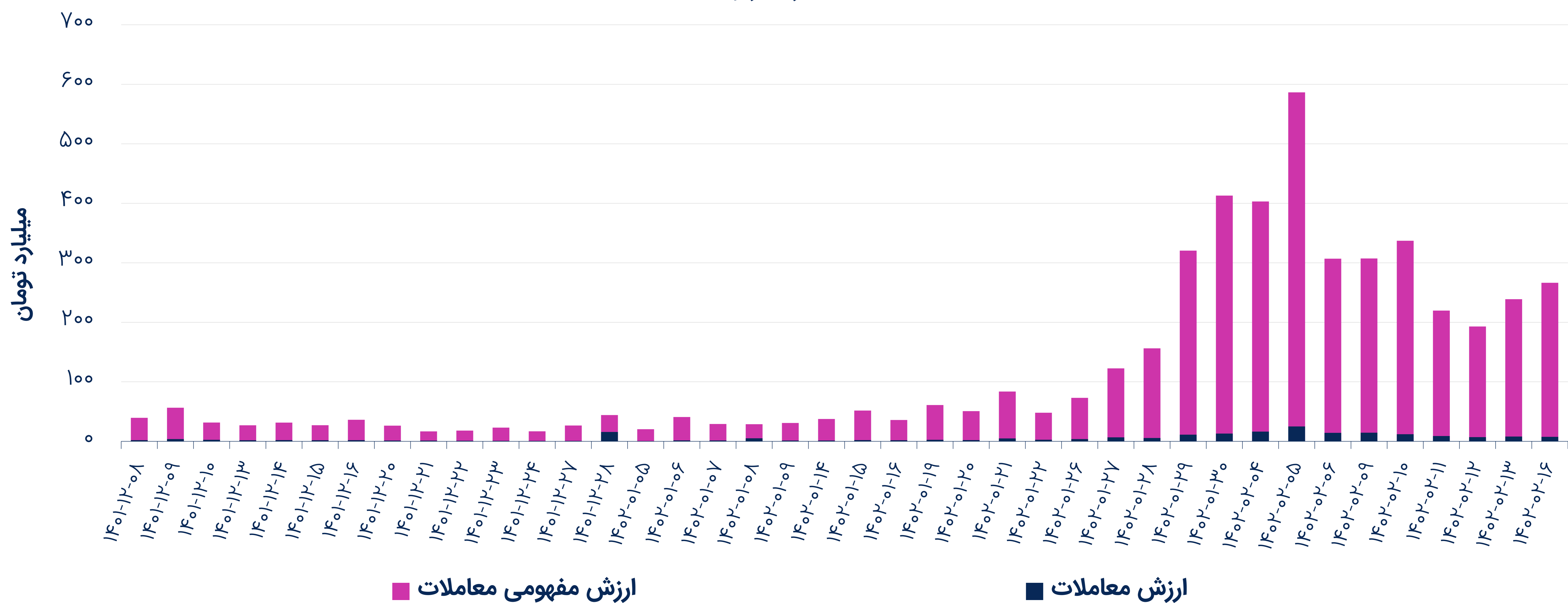


ارزش معاملات

اختیار خرید



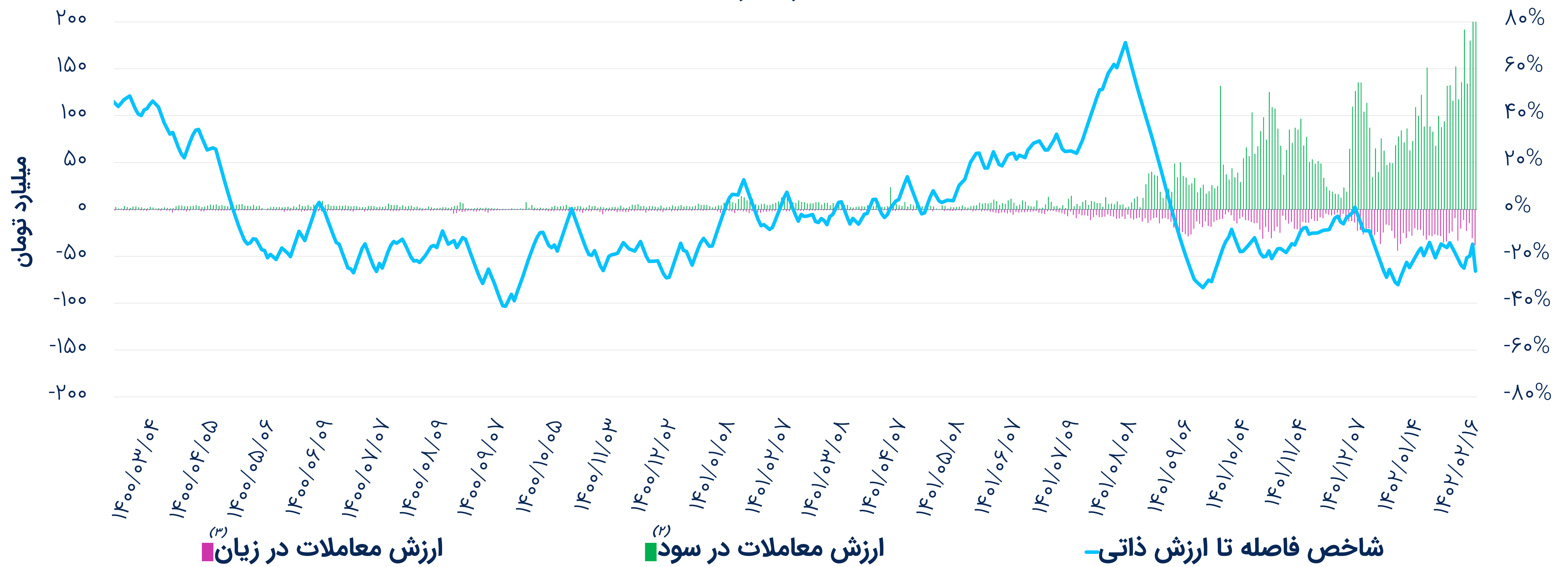
اختیار فروش



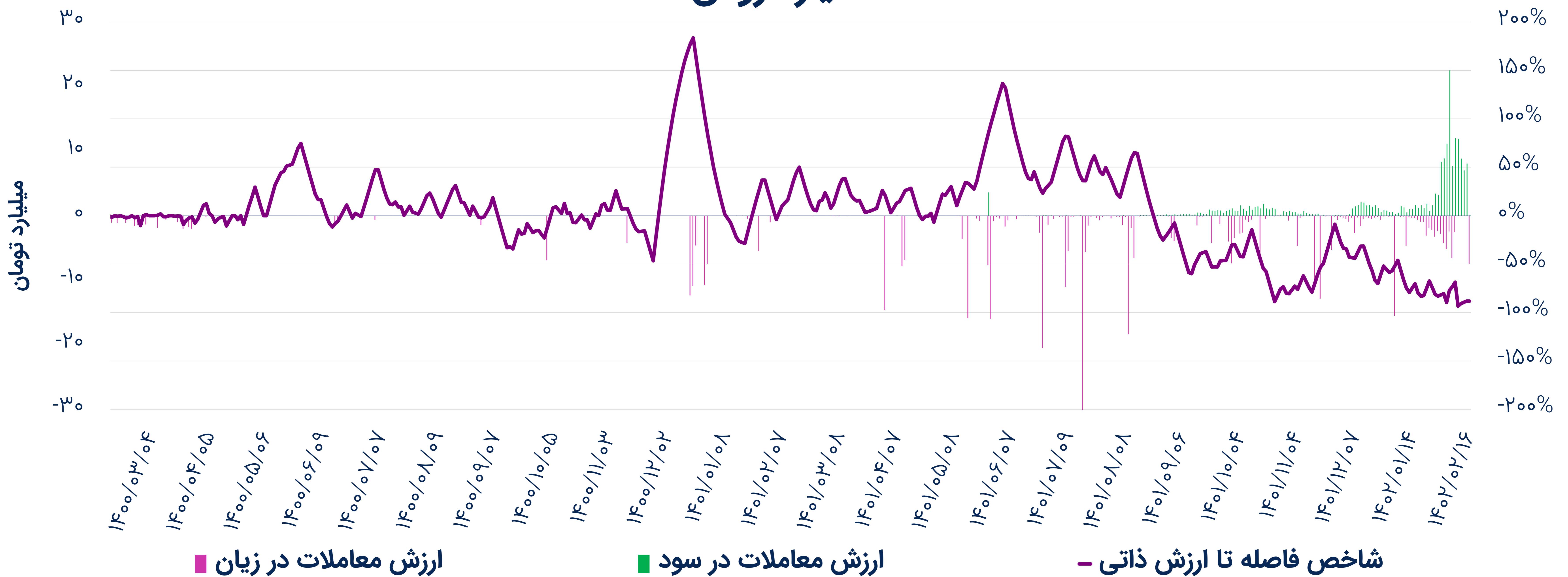
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (۱)

اختیار خرید



اختیار فروش



(۱) شاخص فاصله تا ارزش ذاتی: میانگین موزون فواصل قیمت هر اختیار با ارزش بلک شولز بر اساس ارزش معاملات
 (۲) قرارداد در سود: اختیار خرید (قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه)، اختیار فروش (قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه)
 (۳) قرارداد در زیان: اختیار خرید (قیمت اعمال < قیمت دارایی پایه)، اختیار فروش (قیمت اعمال > قیمت دارایی پایه)

بیشترین ارزش معاملات اختیار به تفکیک دارایی پایه

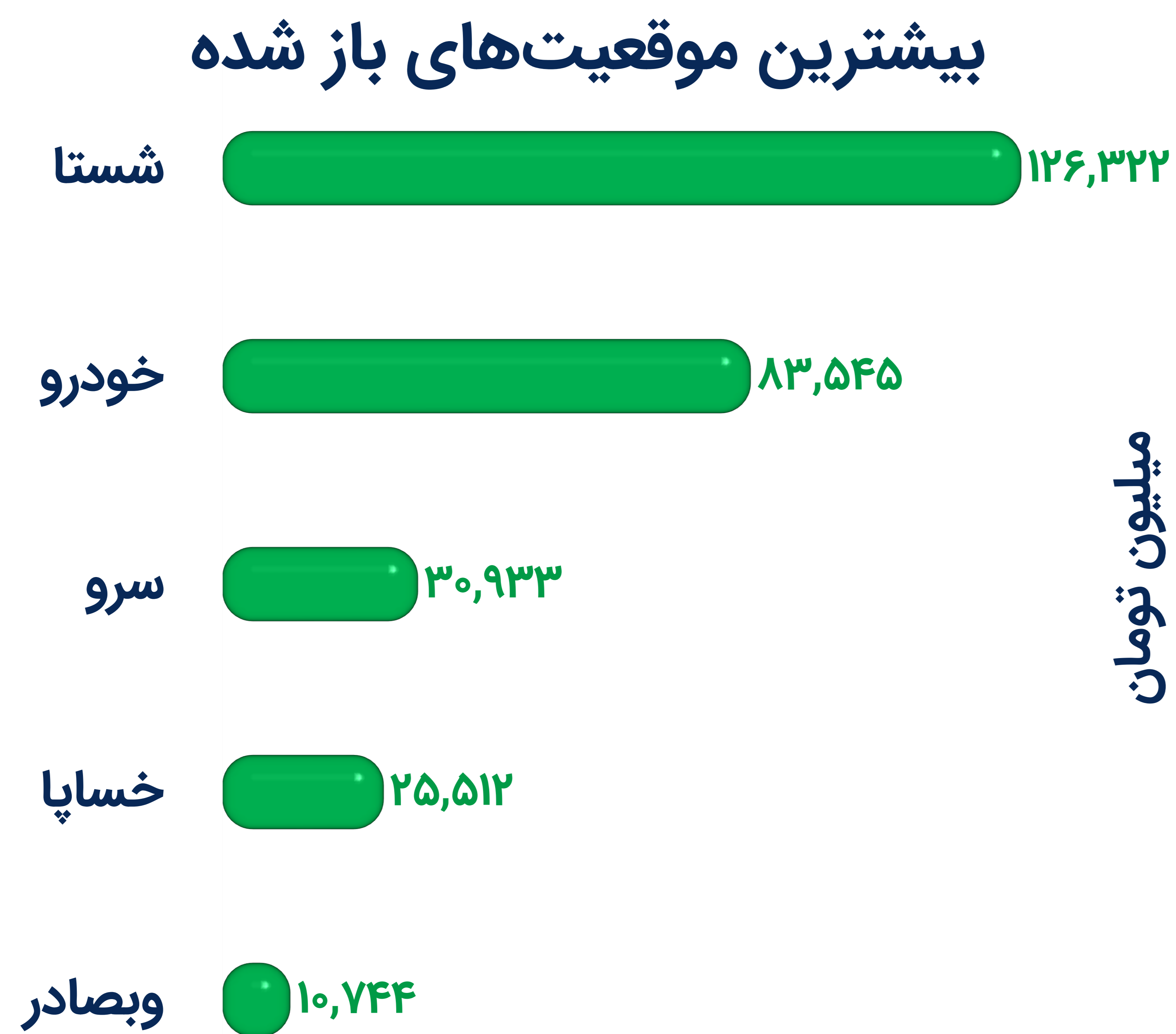
اختیار خرید

نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
شستا	۳۶	۶۳.۶	۲۵۹.۰	۵۰.۲	۱۳.۴	(۴۵%)
دی	۲۷	۵۳.۹	۱۱۸.۴	۵۳.۹	۰.۰	۳%
خسپا	۲۵	۳۸.۶	۹۳.۹	۳۰.۷	۷.۹	(۴۴%)
خودرو	۳۵	۳۸.۴	۲۱۰.۲	۲۹.۰	۹.۵	(۴۴%)
وتجارت	۲۳	۲۰.۶	۱۰۳.۵	۲۰.۶	۰.۰	(۵%)
سلام	۱۰	۱۱.۳	۳۴.۴	۹.۴	۱.۸	(۱۳%)
وبصادر	۱۸	۹.۶	۳۰.۲	۸.۹	۰.۶	(۲۳%)

اختیار فروش

نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
شستا	۶	۷,۴۸۵	۲۵۸,۳۲۶	۱۱۲	۷,۳۷۳	(۸۸%)
سلام	۱	۲۶.۵	۵,۰۱۱.۲	۰.۰	۲۶.۵	(۹۹%)
فولاد	۱	۲۵.۹	۹۳۰.۹	۰.۰	۲۵.۹	(۶۷%)
های وب	۳	۲۴.۴	۱,۷۲۷.۱	۰.۰	۲۴.۴	(۴۵%)
توسن	۱	۶.۱	۳۸.۹	۶.۱	۰.۰	۴%
شتران	۲	۳.۴	۵۱.۱	۰.۶	۲.۹	(۵۹%)
وبصادر	۱	۱.۰۳	۳۲.۲۹	۰.۰۰	۱.۰۳	(۱۰۰%)

موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

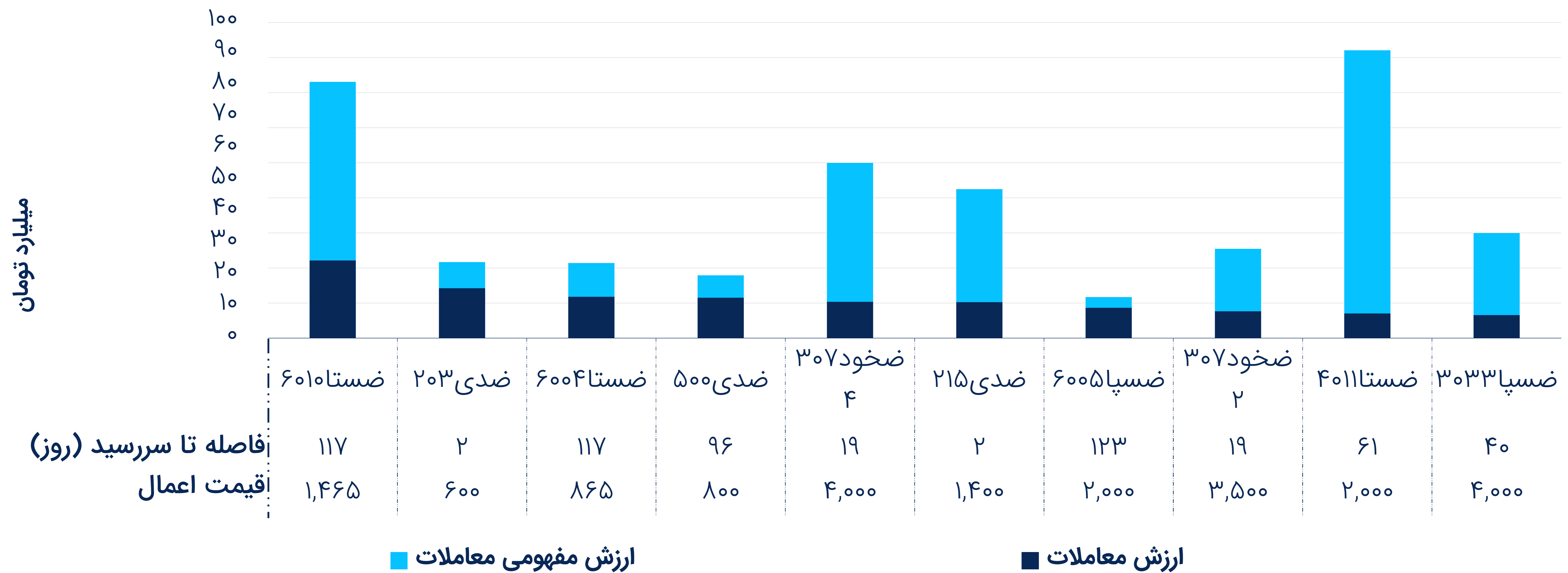
ارزش موقعیت‌های باز



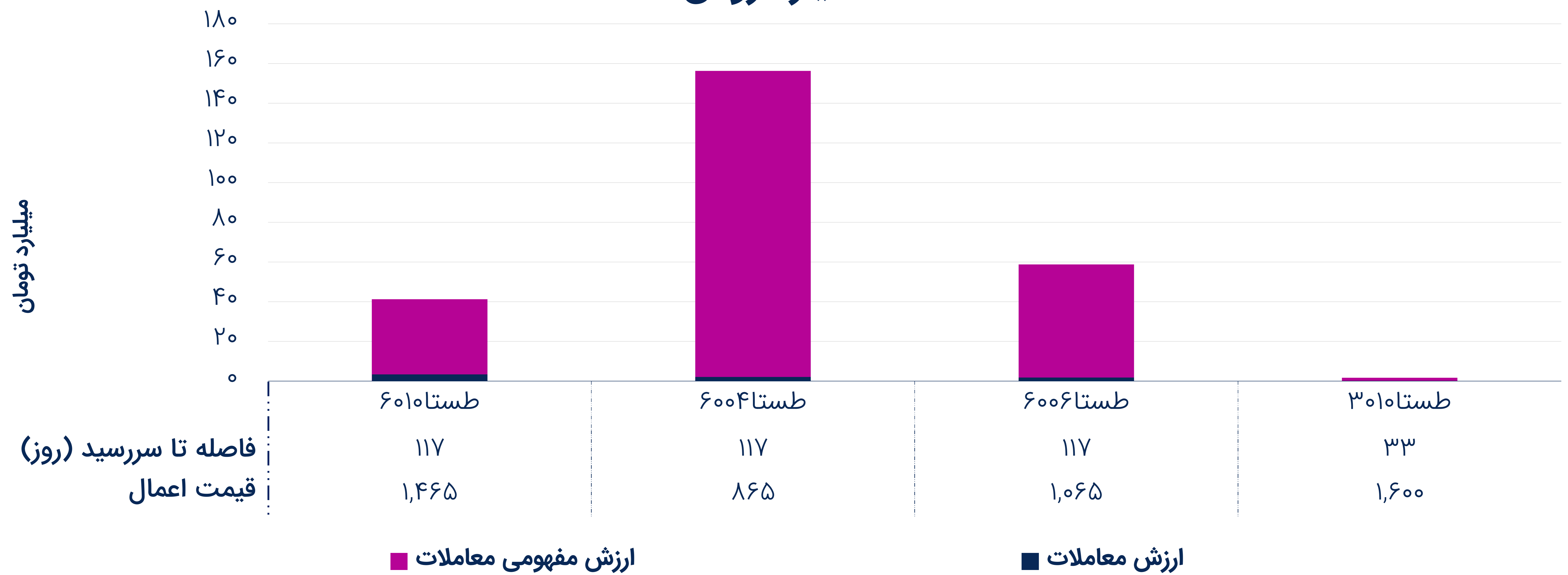
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

بیشترین فاصله تا ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم ^(۱)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضحسیر ۶۱۶	حسیر	۱۳۶	۵۷۸.۳	۱,۰۶۴	۲۰,۲۶۰	۲۳,۰۶۴	۱۴%	۲۱.۷	۰.۵۸	۲,۵۸۹	۱۴۳.۴%
ضهرم ۱۲۱۹	اهرم	۳۱۳	۱۶۸.۱	۱۳,۸۹۲	۲۹,۴۲۰	۲۶,۸۹۲	(۹%)	۱.۹	۰.۹۹	۱۹,۰۷۸	۳۷.۳%
ضهرم ۷۰۰۴	اهرم	۱۶۳	۶۴.۳	۱۷,۳۶۵	۲۹,۴۲۰	۲۶,۳۶۵	(۱۰%)	۱.۵	۱.۰۰	۲۱,۴۱۵	۲۳.۳%
ضبرک ۶۰۰۴	برکت	۱۱۷	۳۶۱.۵	۴,۶۵۸	۲۵,۲۱۰	۲۶,۶۵۸	۶%	۵.۷	۰.۸۳	۵,۶۴۹	۲۱.۳%
ضصاد ۳۰۲۳	وبصادر	۳۳	۶۰.۴	۱,۲۵۳	۳,۱۳۵	۲,۹۵۳	(۶%)	۲.۴	۱.۰۰	۱,۴۷۵	۱۷.۷%

کمترین فاصله تا ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضشنا ۲۰۳۳	شپنا	۹	۸۸.۴	۱۸۵	۹,۸۱۰	۱۲,۱۸۵	۲۴%	۶۵.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۱۱	شستا	۶۱	۷,۷۹۳.۷	۱۳۲	۱,۵۴۵	۲,۱۳۲	۳۸%	۱۶.۲	۰.۰۵	۴	(۹۷%)
ضشنا ۲۰۳۲	شپنا	۹	۱۱۷.۸	۲۴۳	۹,۸۱۰	۱۱,۲۴۳	۱۵%	۴۶.۳	۰.۰۳	۸	(۹۷%)
ضستا ۴۰۱۰	شستا	۶۱	۱۲۵.۷	۱۹۶	۱,۵۴۵	۲,۰۹۶	۳۶%	۱۰.۷	۰.۱۱	۹	(۹۵%)
ضستا ۳۰۱۲	شستا	۳۳	۱۷۴.۲	۱۰۹	۱,۵۴۵	۱,۹۰۹	۲۴%	۱۷.۵	۰.۰۹	۵	(۹۵%)

(۱) اهرم: حاصل تقسیم قیمت سربه‌سر به بهای اختیار معامله

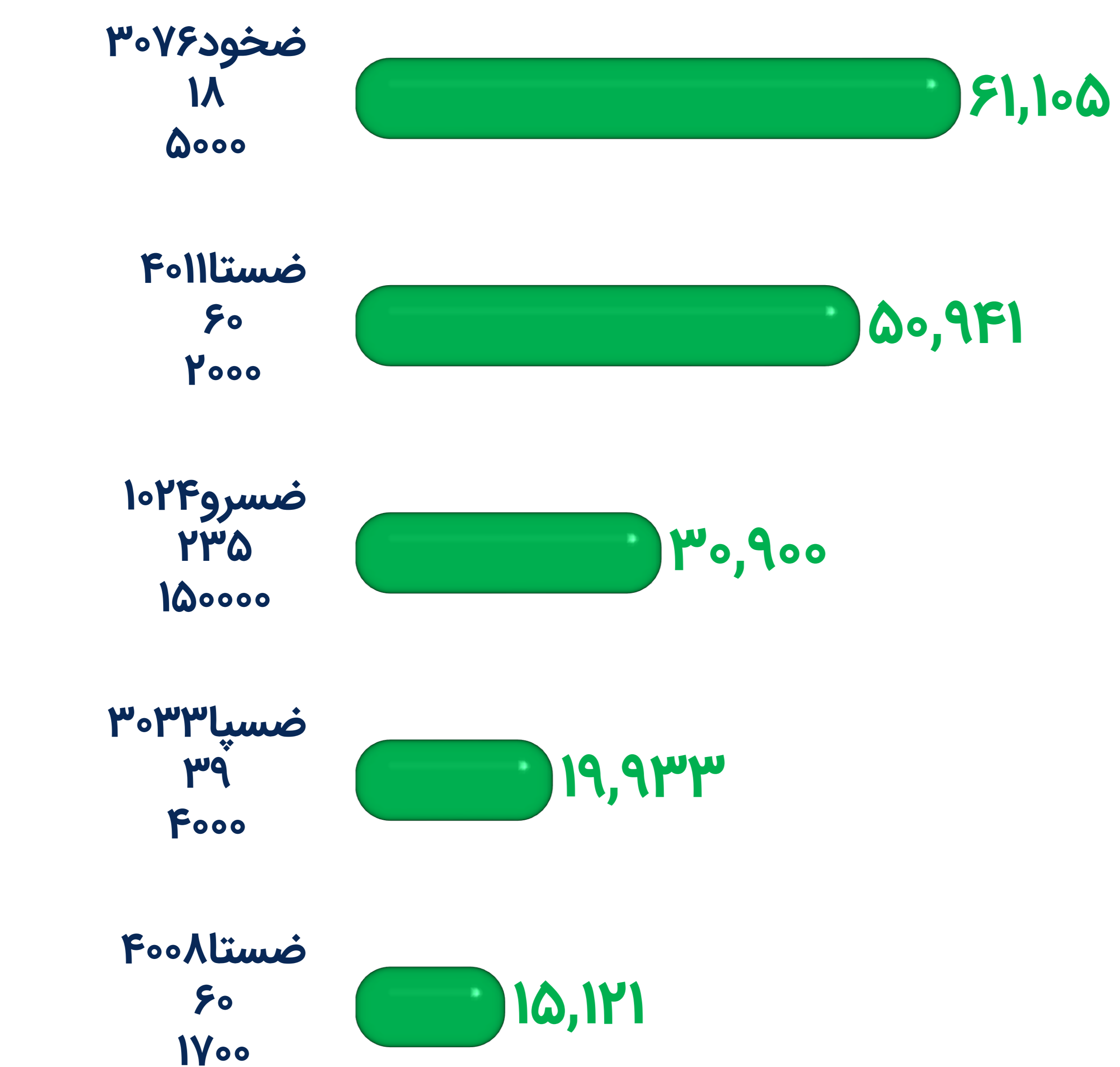
فاصله بهای اختیار فروش تا ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۴%	۳,۱۵۹	-۰.۷	۷.۱	۱۱%	۲۱,۵۵۱	۱۹,۴۶۰	۳,۰۴۹	۶.۰۹۹	۱۵۶	۲۴,۶۰۰	توسن ۷۰۹
(۳۰%)	۹۰	-۰.۳	۲۸	(۶%)	۳,۵۶۲	۳,۷۸۵	۱۲۸	۱۸.۷۸۴۳۱۱	۱۹	۳,۶۹۰	طهای ۳۰۰۹
(۳۴%)	۶۶	-۰.۵	۱۵	(۳%)	۱,۵۰۰	۱,۵۴۵	۱۰۰	۱۱۱.۷۹	۳۳	۱,۶۰۰	طستا ۳۰۱
(۶۴%)	۱۴۲	-۰.۳	۱۴	(۹%)	۵,۶۰۳	۶,۱۶۰	۳۹۷	۲.۸۹۹۵	۴۴	۶,۰۰۰	طترا ۳۰۲۸
(۶۷%)	۶۷	-۰.۱	۳۲	(۱۱%)	۶,۴۲۴	۷,۲۳۰	۲۰۱	۲۵.۸۷۹۳۵	۴۷	۶,۶۲۵	طفلا ۳۰۲۵
(۷۷%)	۳۰	-۰.۲	۱۰	(۱۴%)	۱,۳۳۶	۱,۵۴۵	۱۲۹	۳۴۳۷.۷۴۸۸	۱۱۷	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱
(۹۵%)	۵	-۰	۱۲	(۲۵%)	۱,۱۶۵	۱,۵۴۵	۱۰۰	۲۲.۷۰۸۱	۱۱۷	۱,۲۶۵	طستا ۶۰۰۸
(۹۵%)	۱	-۰	۱۴۹	(۲۱%)	۲,۹۷۸	۳,۷۸۵	۲۰	۴.۹۹۰۹۵۲۸	۱۹	۲,۹۹۸	طهای ۳۰۰۶
(۹۹%)	۱	-۰	۱۱۹	(۳۷%)	۱۱,۹۰۰	۱۸,۹۱۰	۱۰۰	۲۶.۵	۱۵۹	۱۲,۰۰۰	طسلا ۷۰۰۶
(۹۹%)	۰	-۰	۲۲	(۳۴%)	۱,۰۱۸	۱,۵۴۵	۴۷	۱۷۸۷.۵۹۷۳	۱۱۷	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



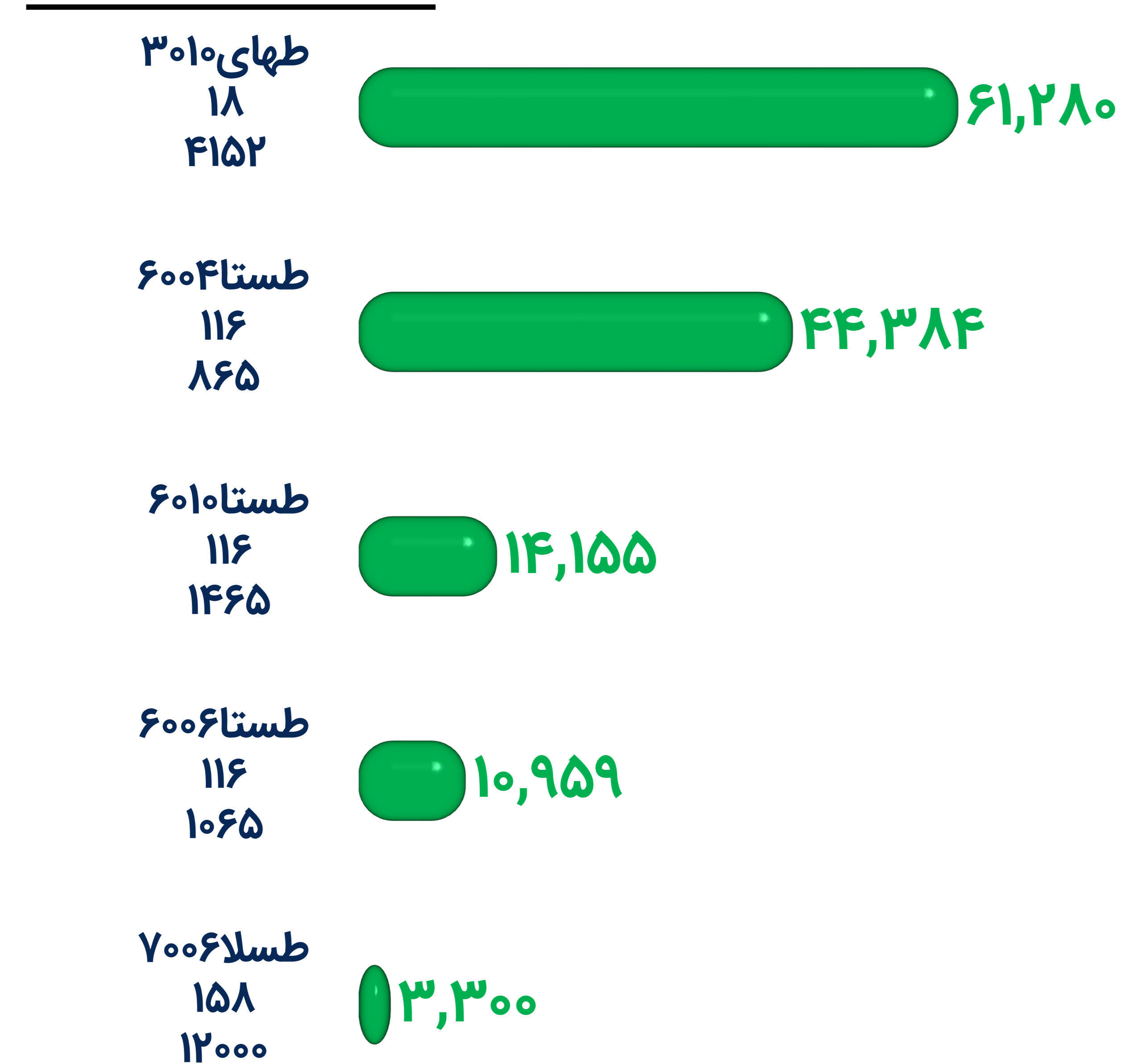
ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

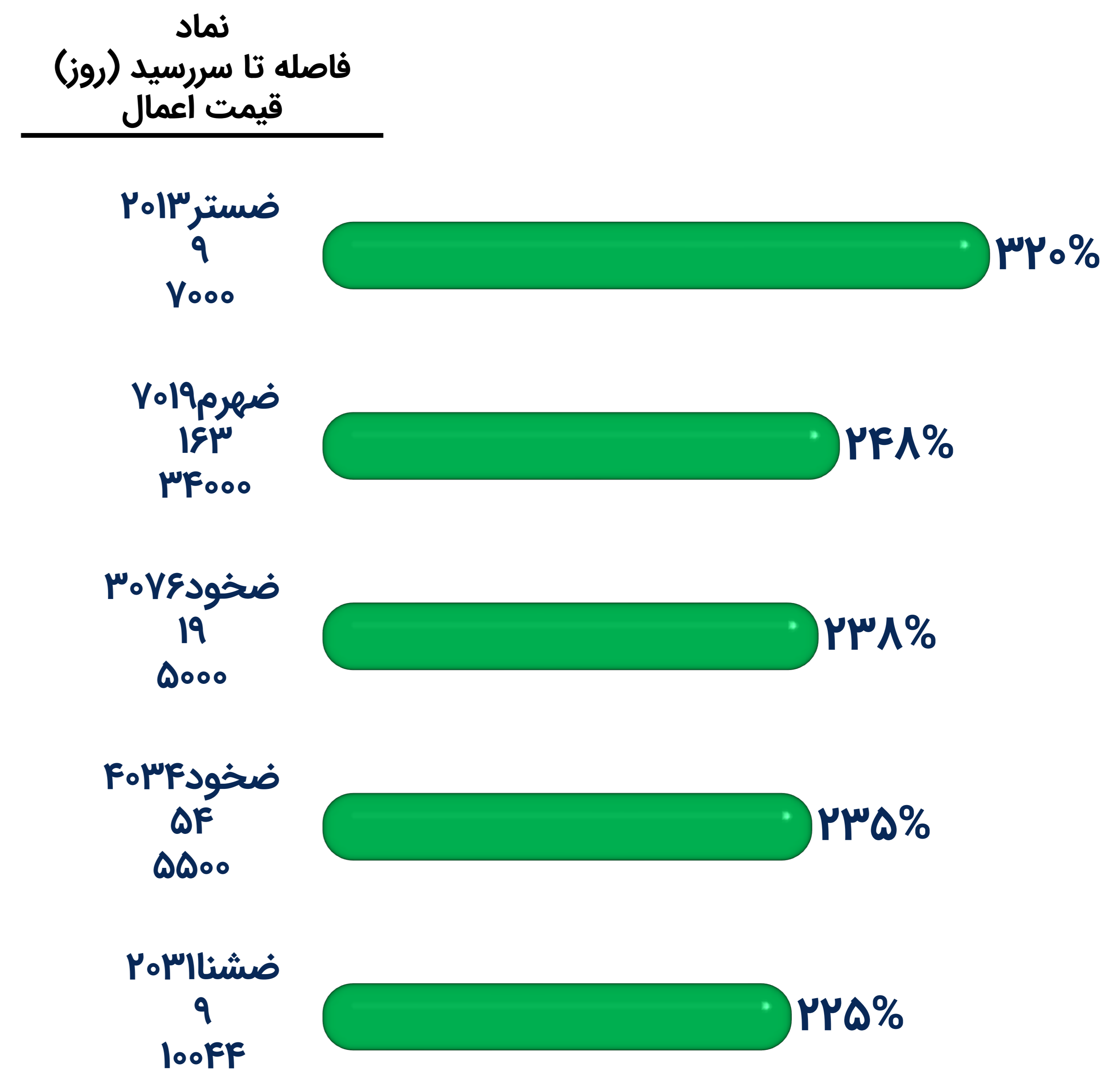
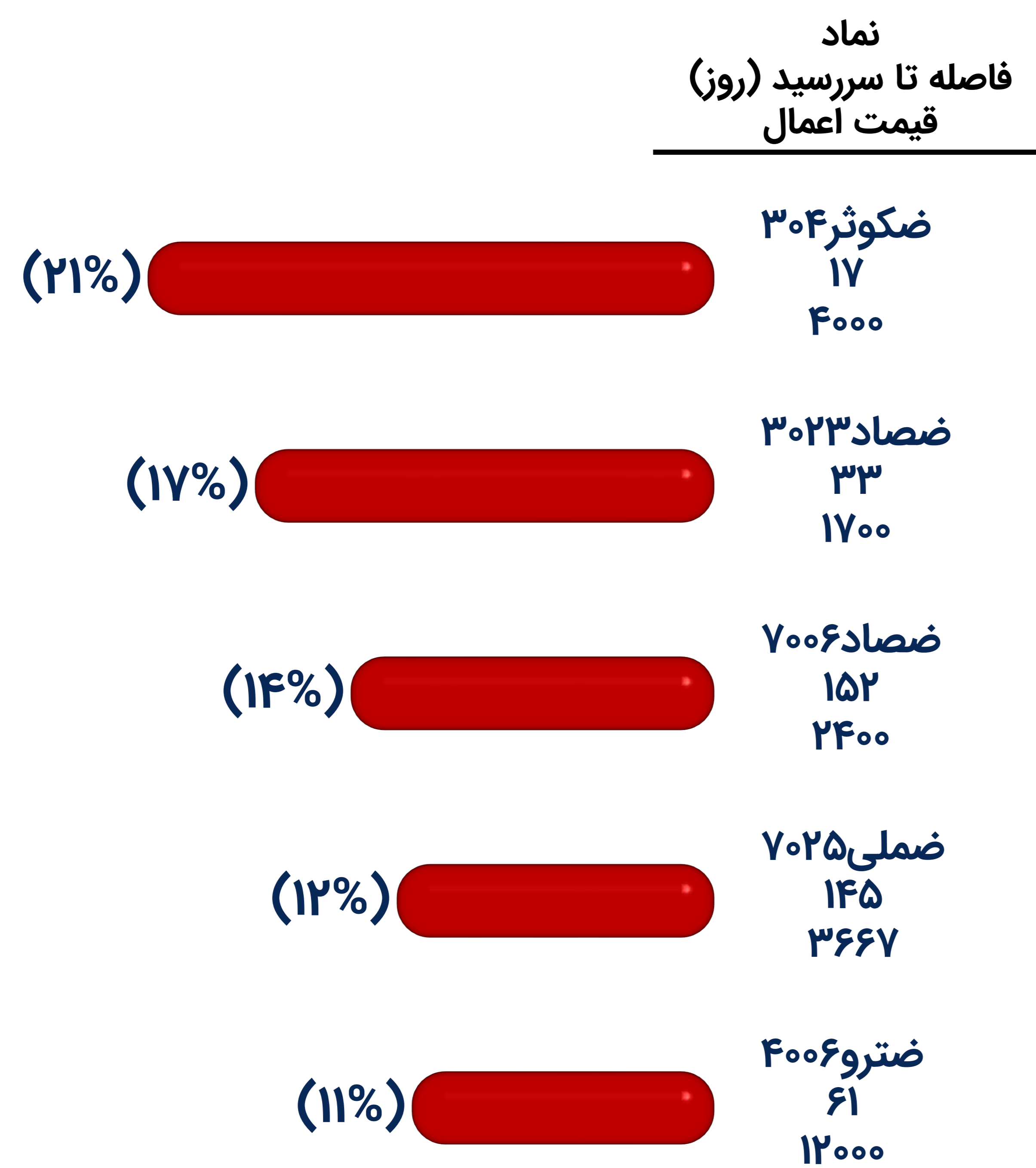
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



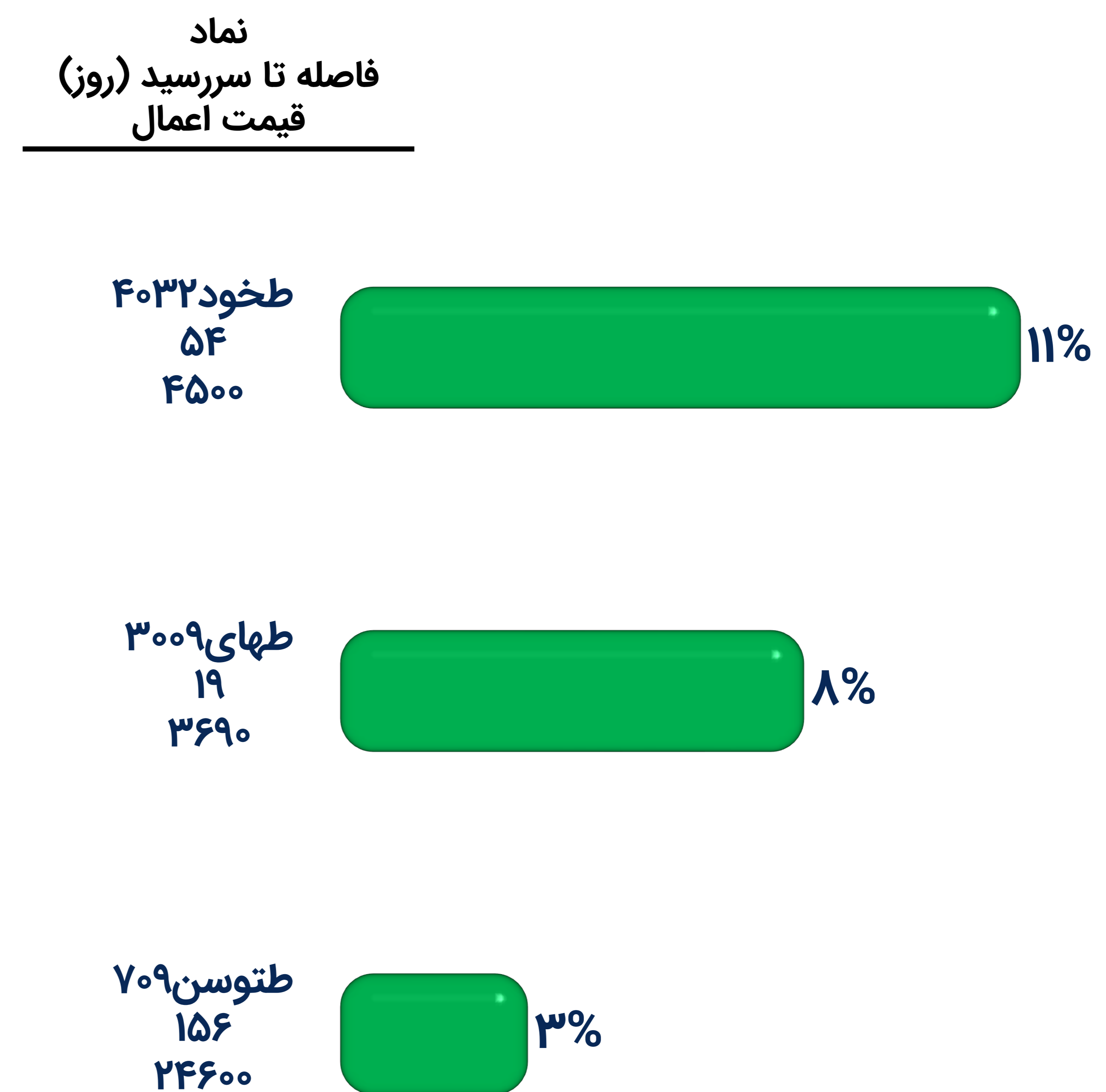
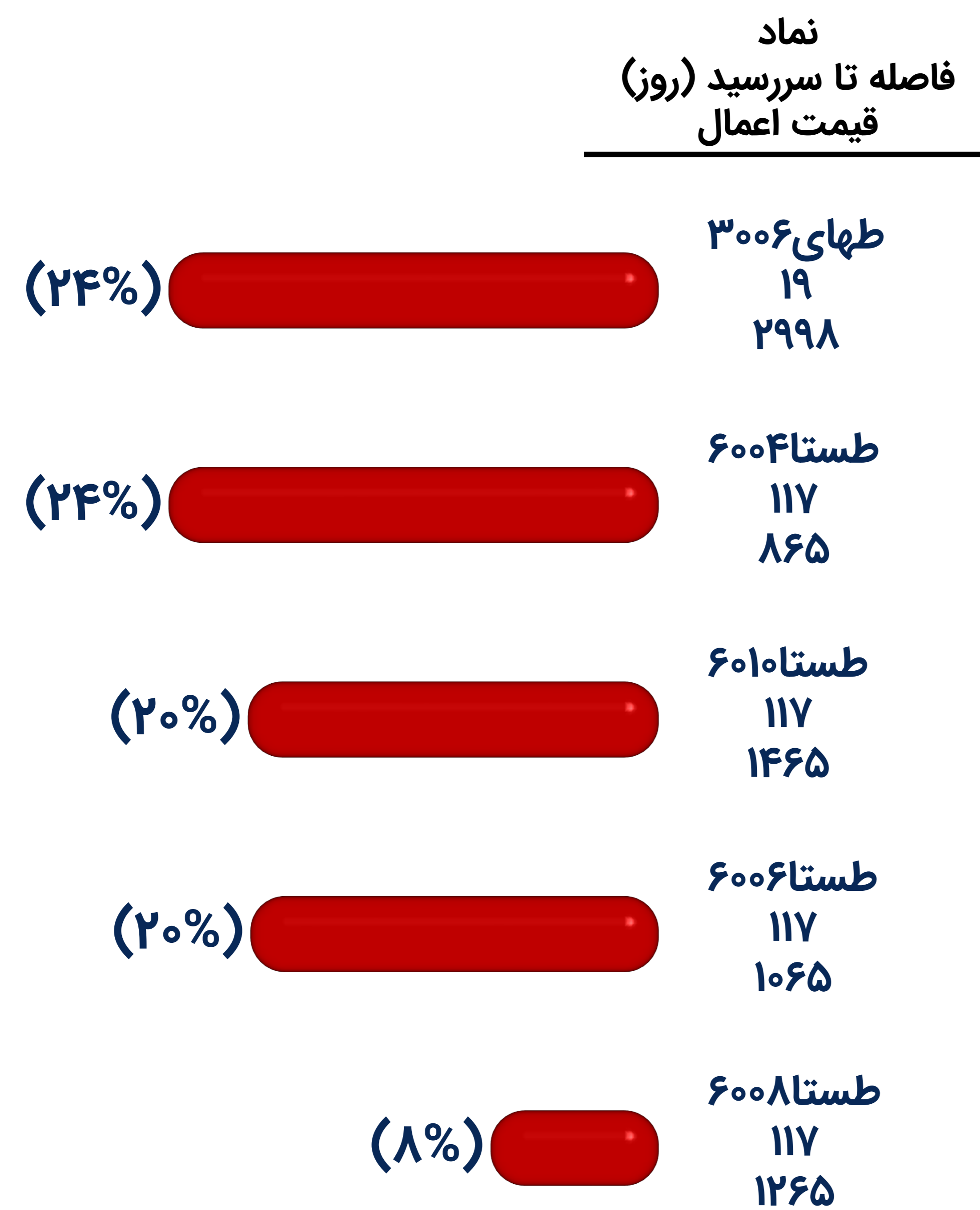
میلیارد تومان

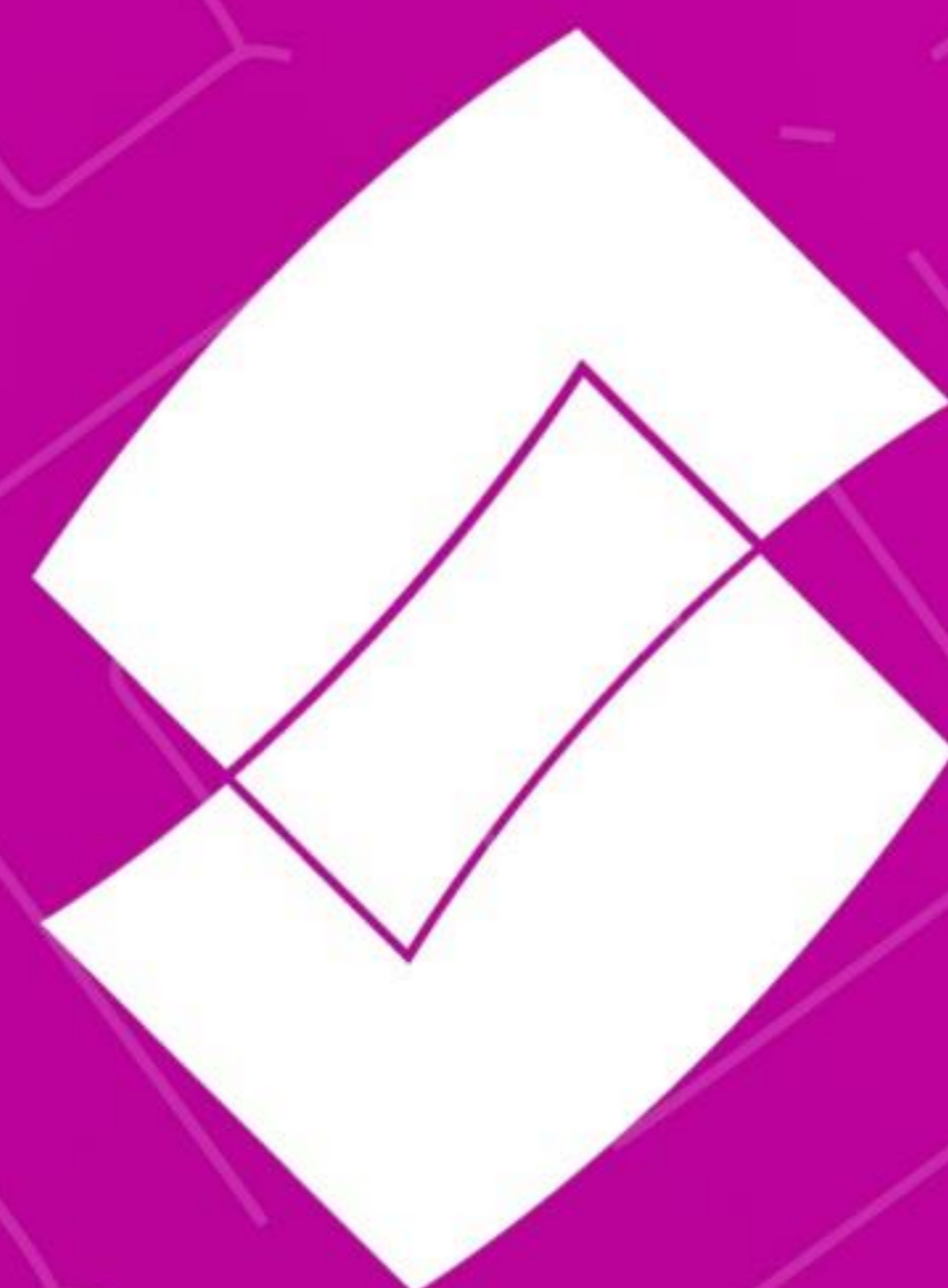
بیشترین تغییرات قیمت

اختیار خرید



اختیار فروش





کارگزاری تأمین سرمایه نوین

وبسایت

nibb.ir
my.nibb.ir

تلفن

۰۲۱ ۸۶۷۹ ۱۰۰۰

آدرس

تهران، بلوار نلسون ماندلا، بلوار
گل آذین، پلاک ۲۳ طبقه ۲

تهیه و تنظیم: واحد تحلیل کارگزاری تامین سرمایه نوین

سرپرست تحلیل: علیرضا پیامی

کارشناسان تحلیل: زهره عباسی، محمدحسین نادعلی

این گزارش صرفاً جهت اطلاع از شرایط بازارها تهیه شده است،
محتوی آن نباید به تنهایی جهت اخذ تصمیمات مالی و سرمایه
گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.