

شماره

۰۲

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۱۷ اردیبهشت ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

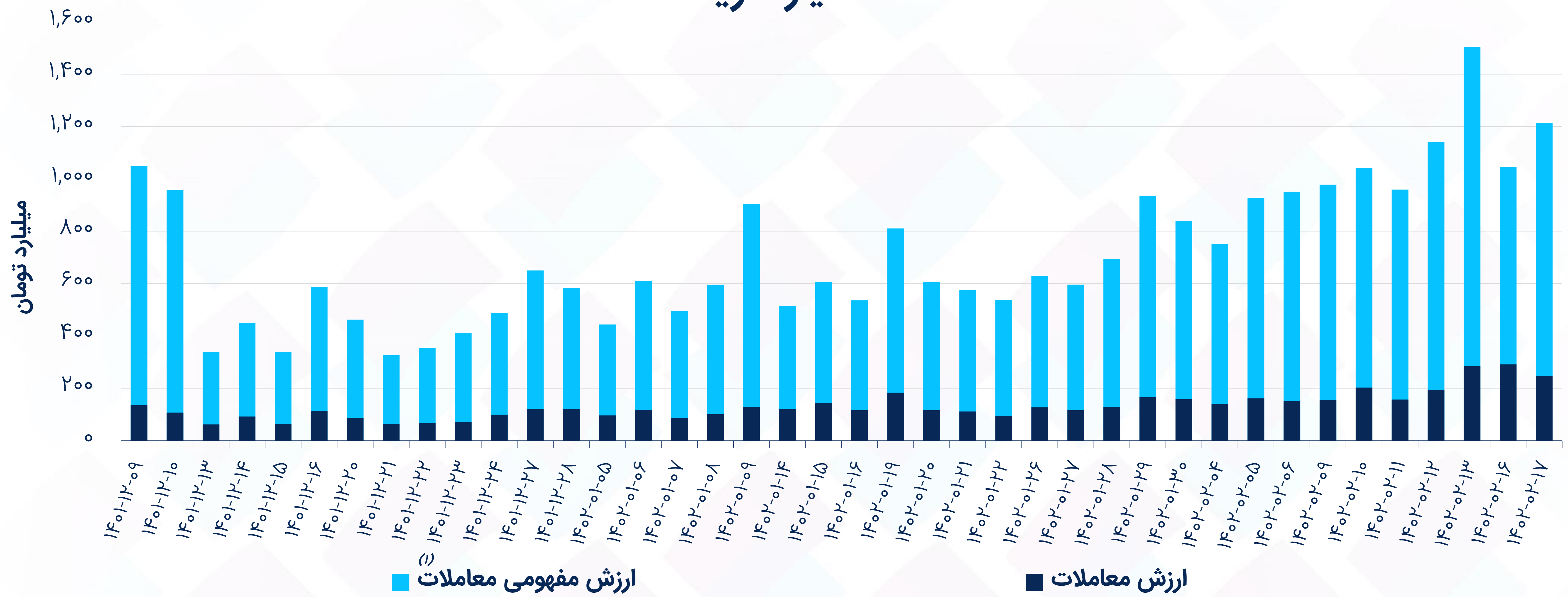




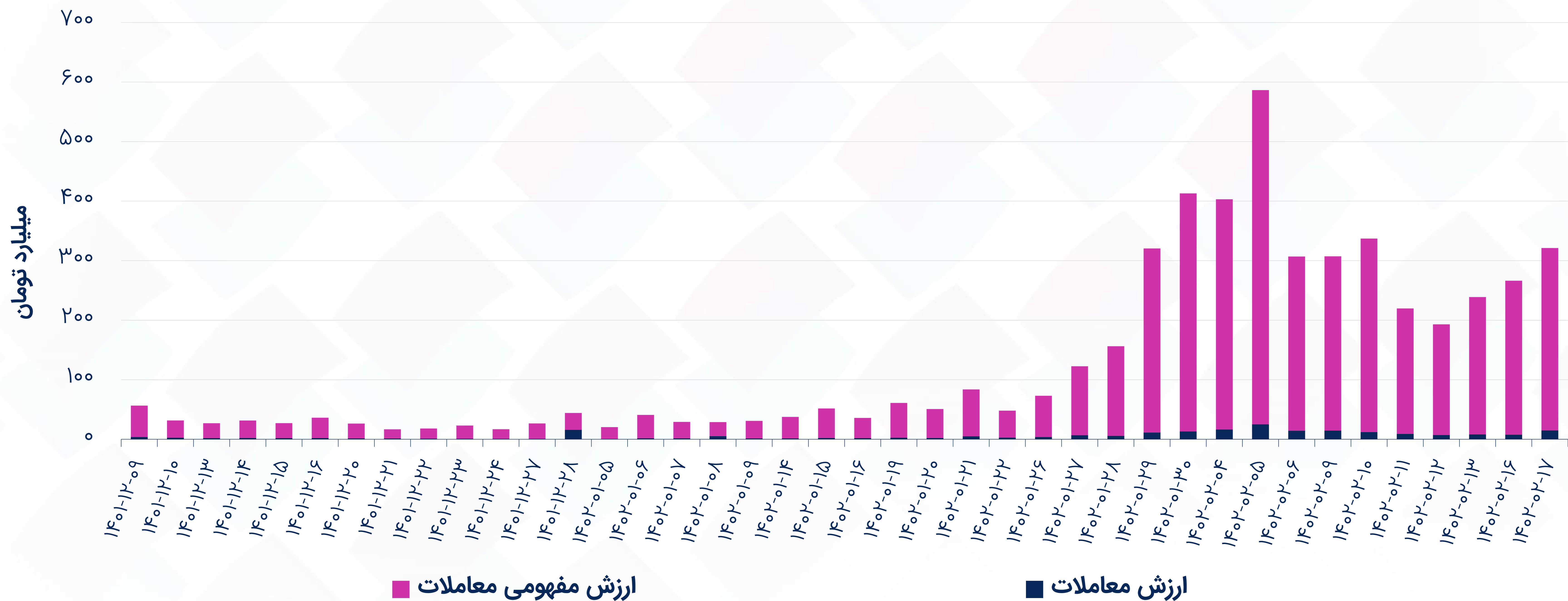
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



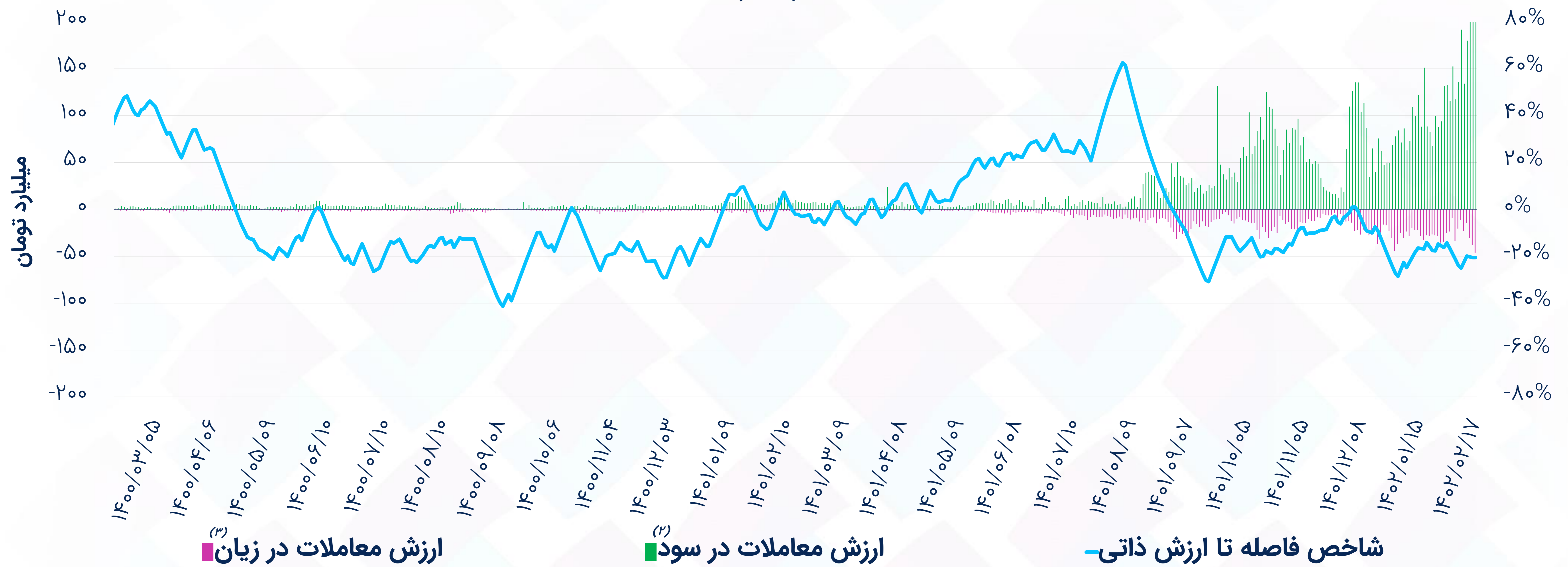
اختیار فروش



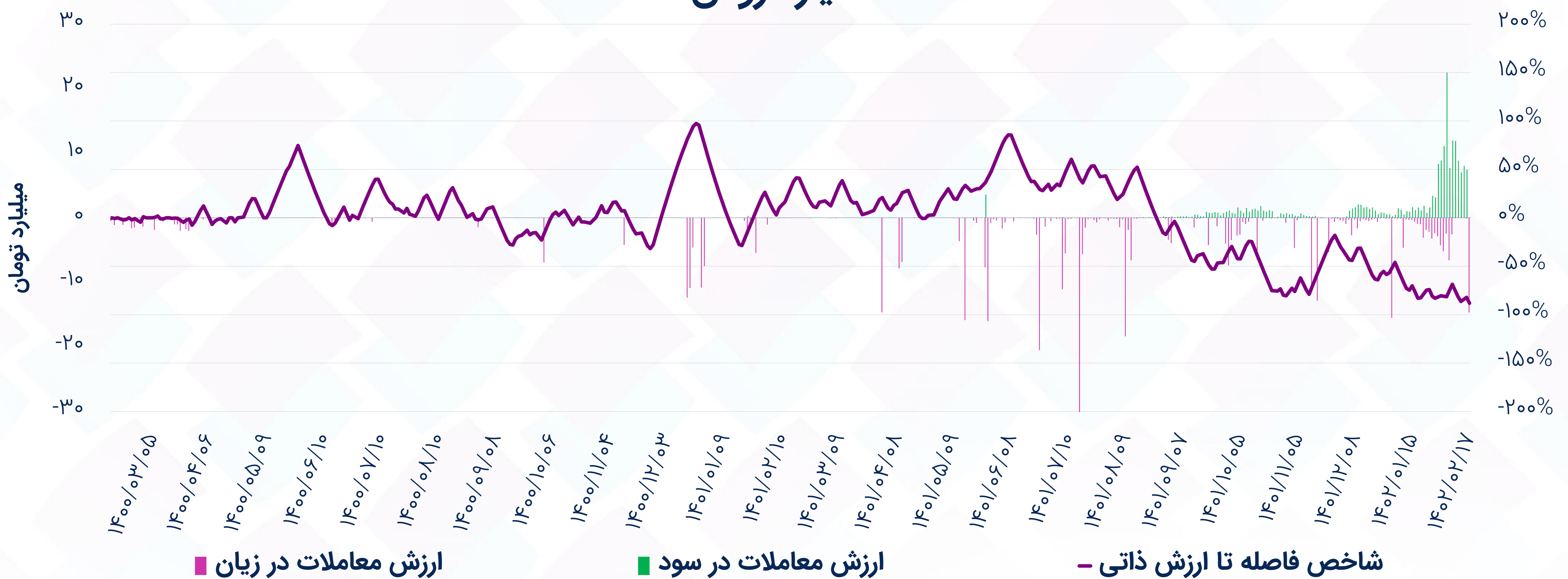
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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
خسپا	۲۷	۷۴.۲	۲۵۸.۳	۵۴.۴	۱۹.۹	(۲۸%)
شستا	۳۹	۵۱.۹	۲۴۶.۰	۳۹.۶	۱۲.۳	(۵۳%)
خودرو	۴۲	۵۰.۵	۳۸۸.۳	۴۱.۲	۹.۲	(۲۷%)
دی	۲۳	۲۰.۴	۵۶.۹	۲۰.۴	۰.۰	۱۷%
وتجارت	۲۲	۱۹.۸	۱۳۳.۰	۱۸.۱	۱.۸	۲%
اهرم	۲۰	۶.۰	۱۳.۴	۵.۹	۰.۱	(۷%)
شپنا	۱۷	۴.۳	۲۳.۵	۴.۱	۰.۲	(۵%)

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	۷	۱۴,۶۶۰	۳۱۹,۹۲۲	۰	۱۴,۶۶۰	(۸۲%)
های وب	۲	۲۷.۱	۱,۲۰۲.۰	۱۱.۲	۱۵.۹	(۷۳%)
شتران	۲	۶.۵	۷۴.۵	۳.۶	۲.۹	(۴۹%)
فملی	۱	۱.۵	۲۴.۵	۰.۰	۱.۵	(۷۴%)
فولاد	۱	۰.۴	۱۰.۴	۰.۰	۰.۴	(۴۶%)
شپنا	۲	۰.۴	۱۰.۲	۰.۳	۰.۰	(۴۱%)
خودرو	۱	۰.۱۰	۰.۴۳	۰.۱۰	۰.۰۰	(۷۲%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

(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

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده

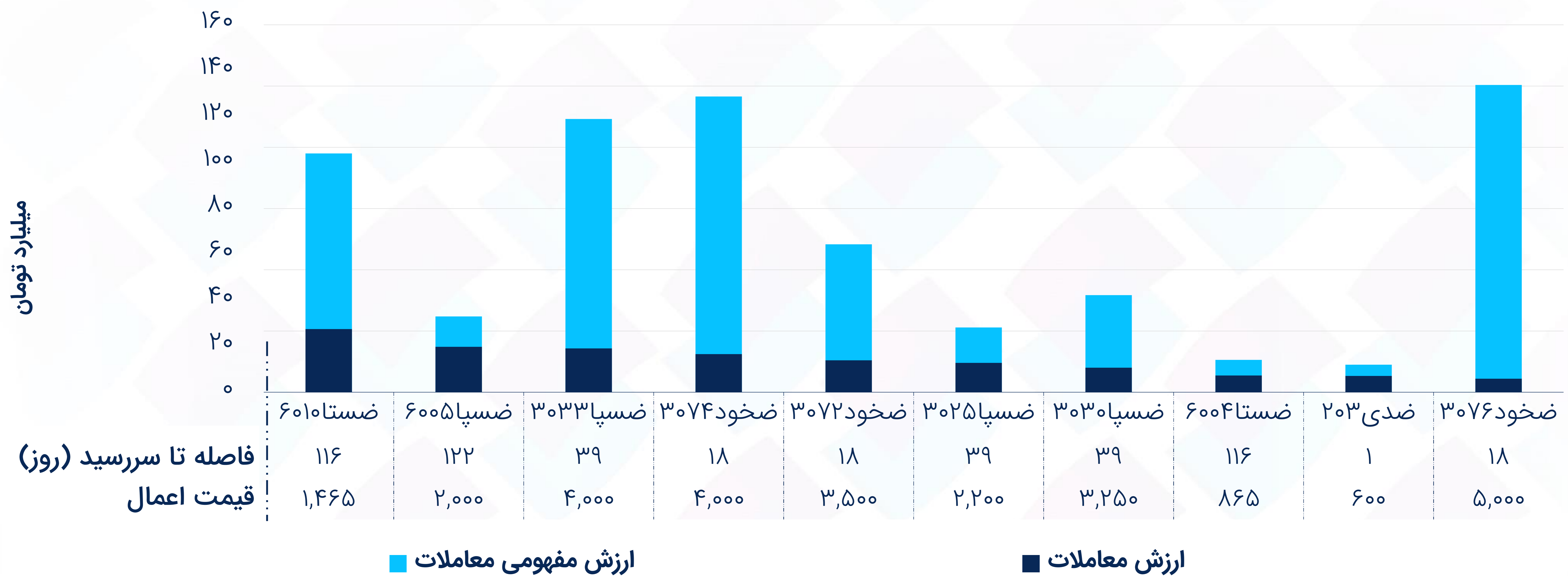


میلیون تومان

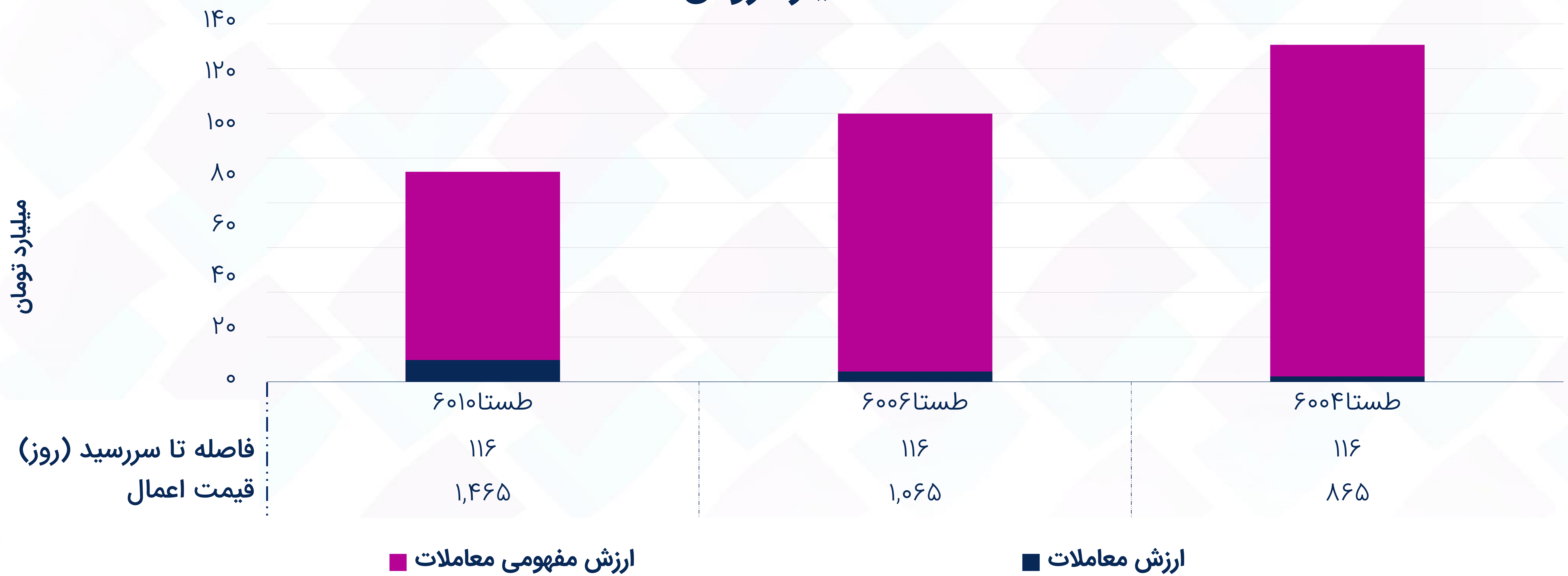


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بک شولز

بیشترین فاصله تا ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۹۰.۴%	۲,۶۶۶	۱.۰۰	۴.۲	(۱۷%)	۵,۹۰۰	۷,۱۴۰	۱,۴۰۰	۴۱.۳	۸	۴,۵۰۰	خگستر ۲۰۰۸
۷۵.۲%	۱,۱۷۷	۰.۹۹	۹.۹	(۷%)	۶,۶۷۲	۷,۱۴۰	۶۷۲	۲۰.۱	۸	۶,۰۰۰	خگستر ۲۰۱۱
۵۹.۹%	۴۳۰	۱.۰۰	۶.۲	(۹%)	۱,۶۶۹	۱,۸۲۹	۲۶۹	۳,۴۲۷.۹	۱	۱,۴۰۰	دی ۲۱۵
۵۸.۲%	۳۰۵	۱.۰۰	۷.۲	(۶%)	۱,۳۹۳	۱,۴۷۸	۱۹۳	۱۸.۸	۳۲	۱,۲۰۰	شستا ۳۰۰۶
۵۱.۸%	۵۳۰	۱.۰۰	۴.۷	(۱۰%)	۱,۶۴۹	۱,۸۲۹	۳۴۹	۱۲۷.۲	۱	۱,۳۰۰	دی ۲۱۴

کمترین فاصله تا ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک 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
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۶۵.۹	۲۴%	۱۲,۱۸۵	۹,۸۱۰	۱۸۵	۸۸.۴	۹	۱۲,۰۰۰	شپنا ۲۰۳۳
(۹۷%)	۴	۰.۰۵	۱۶.۲	۳۸%	۲,۱۳۲	۱,۵۴۵	۱۳۲	۷,۷۹۳.۷	۶۱	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۹۷%)	۸	۰.۰۳	۴۶.۳	۱۵%	۱۱,۲۴۳	۹,۸۱۰	۲۴۳	۱۱۷.۸	۹	۱۱,۰۰۰	شپنا ۲۰۳۲
(۹۵%)	۹	۰.۱۱	۱۰.۷	۳۶%	۲,۰۹۶	۱,۵۴۵	۱۹۶	۱۲۵.۷	۶۱	۱,۹۰۰	شستا ۴۰۱۰
(۹۵%)	۵	۰.۰۹	۱۷.۵	۲۴%	۱,۹۰۹	۱,۵۴۵	۱۰۹	۱۷۴.۲	۳۳	۱,۸۰۰	شستا ۳۰۱۲

(۱) سر به سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
 (۲) فاصله تا سر به سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سر به سر)
 (۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سر به سر

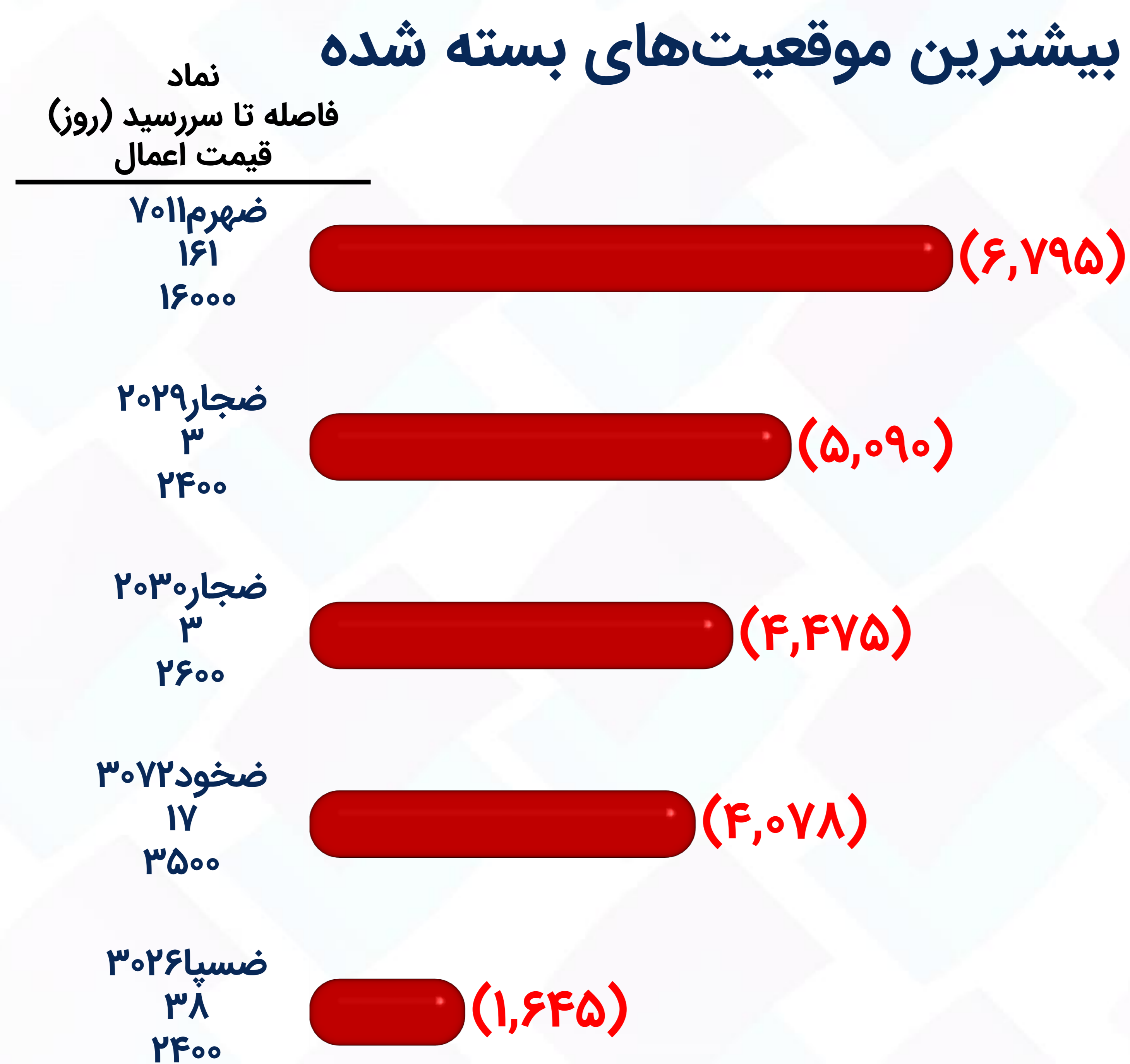
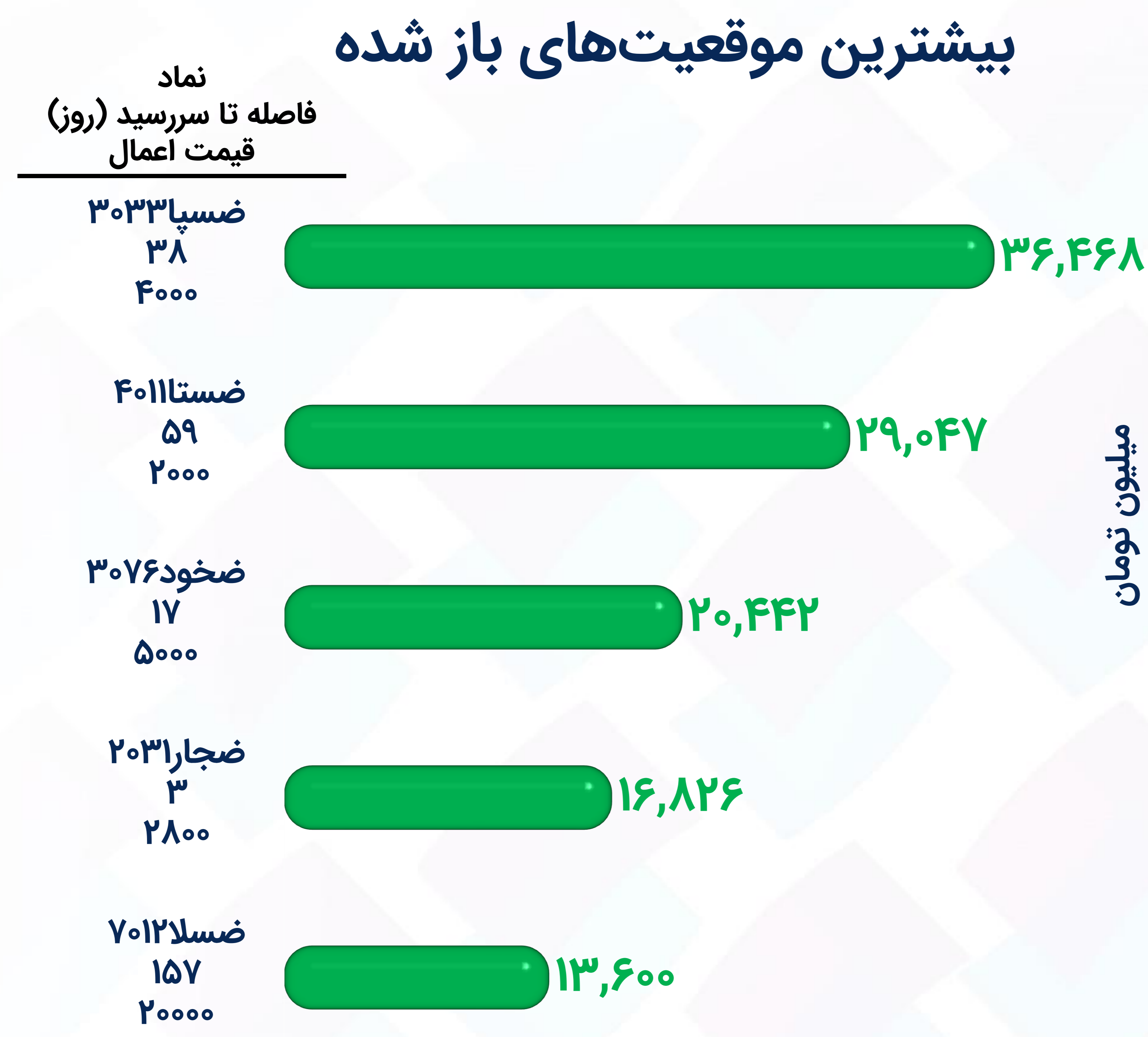
فاصله بهای اختیار فروش تا ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش بلک شولز

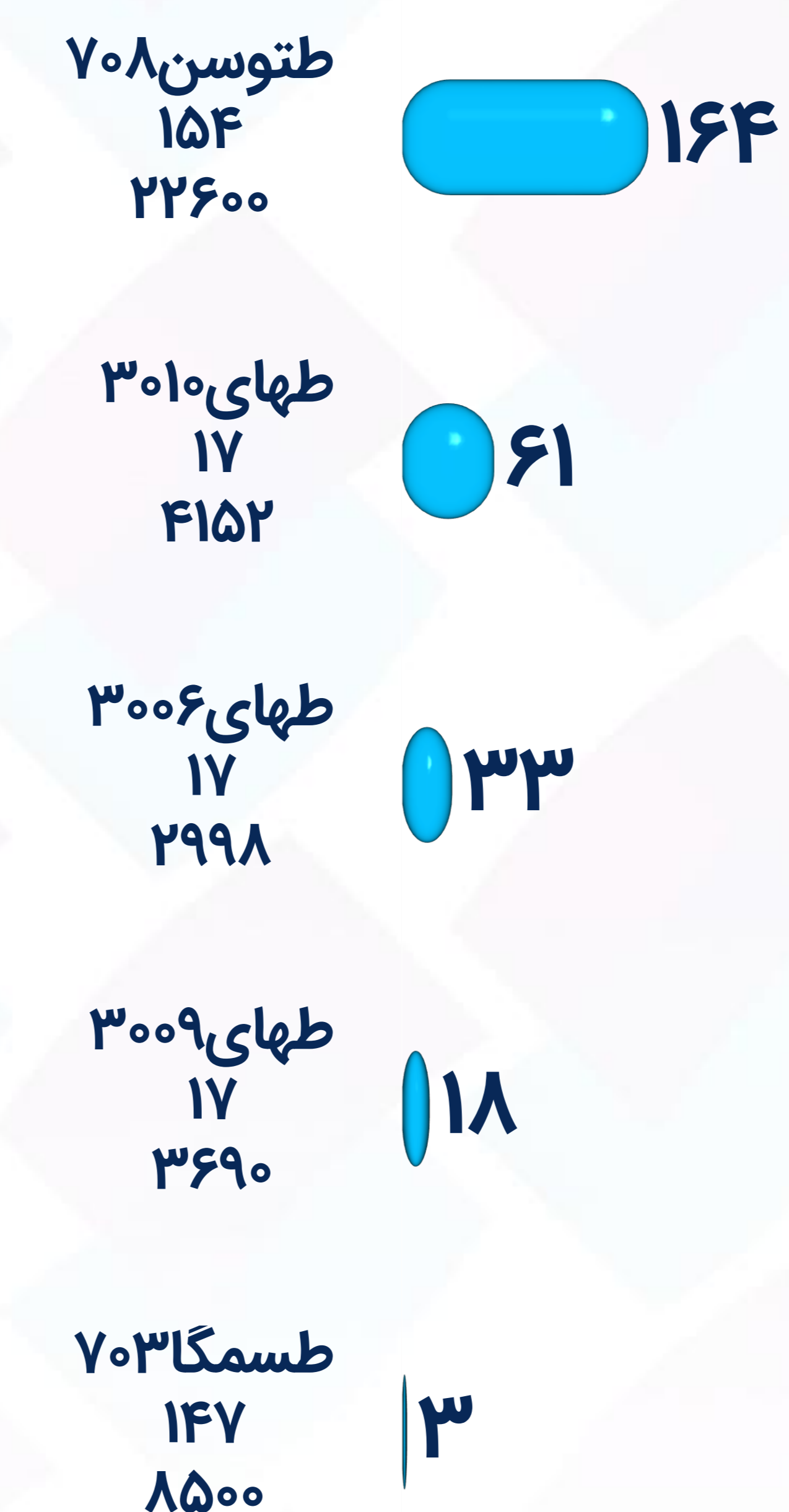
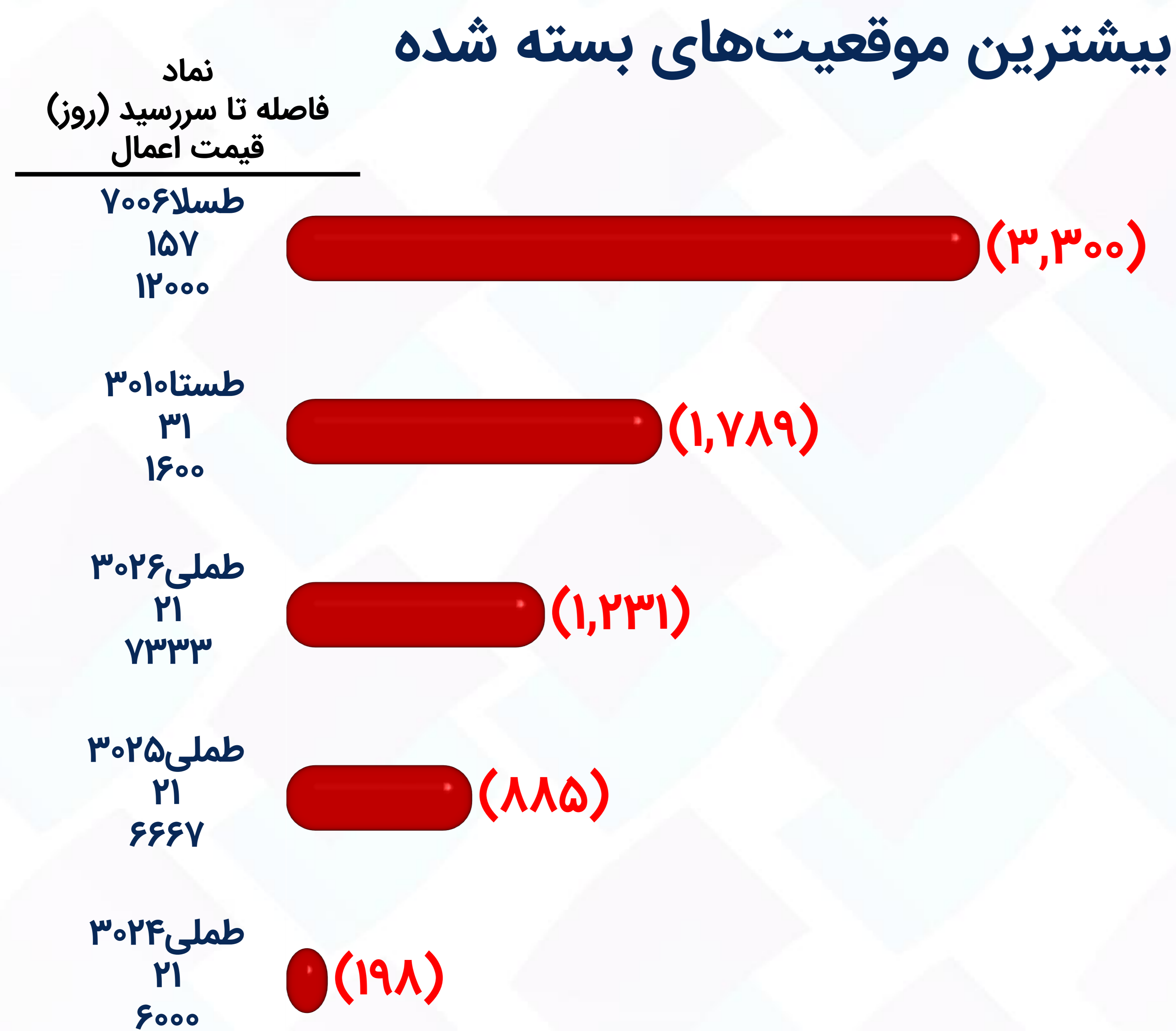
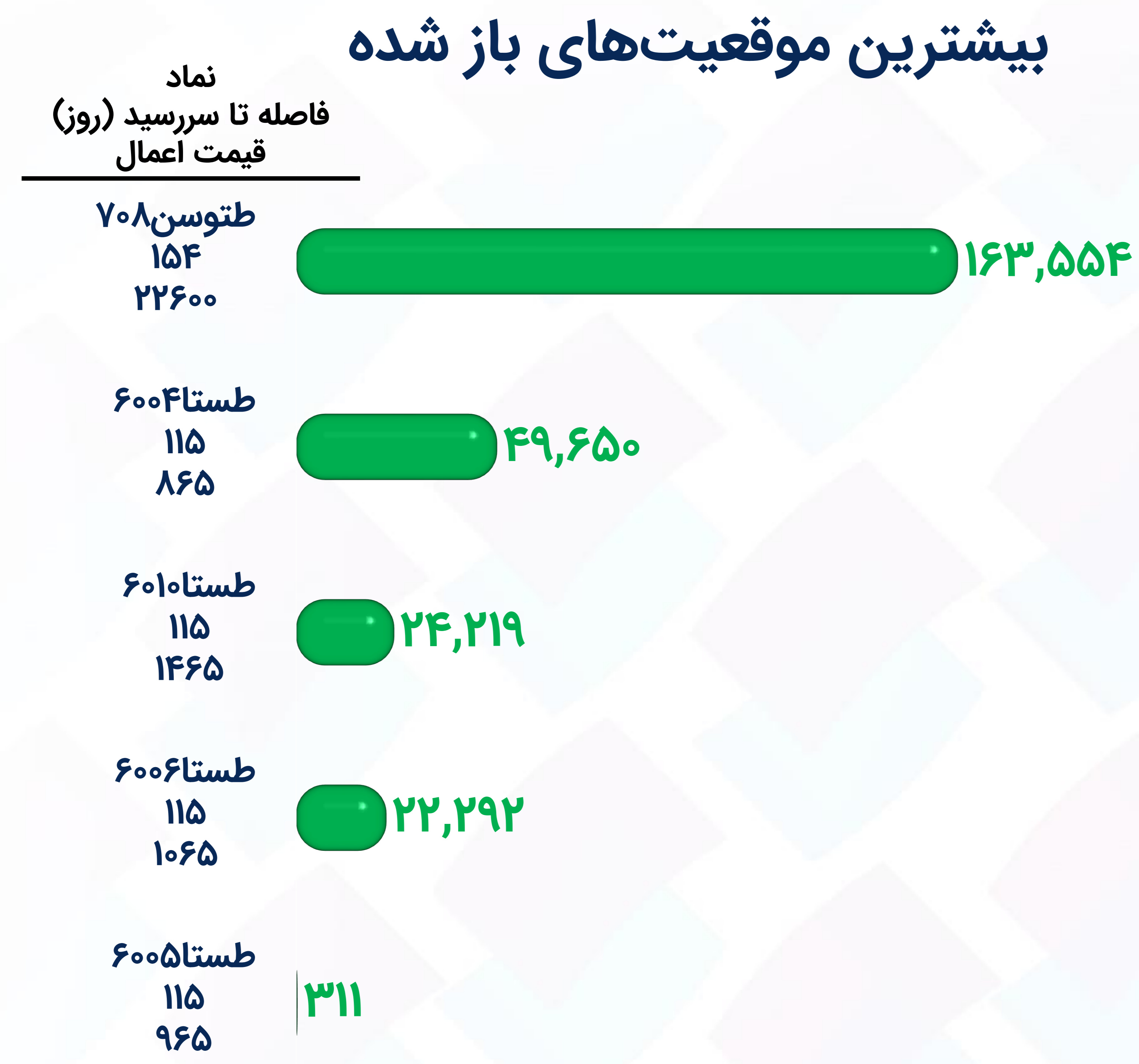
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه	قیمت اعمال	نماد
(۴۲%)	۱۹۱	-۰.۴	۱۷.۱	(۶%)	۵,۶۶۹	۶,۰۱۰	۳۳۱	۲.۹	۴۳	شتران	۶,۰۰۰	۳۰۲۸۱
(۴۲%)	۱۶۳	-۰.۵	۱۲.۰	(۶%)	۳,۴۰۷	۳,۶۰۷	۲۸۳	۱۱.۲	۱۸	های وب	۳,۶۹۰	۳۰۰۹
(۵۴%)	۴۵۸	-۰.۶	۵.۶	(۸%)	۵,۵۱۱	۶,۰۱۰	۹۸۹	۳.۶	۴۳	شتران	۶,۵۰۰	۳۰۲۹۱
(۷۰%)	۴۶	-۰.۳	۸.۶	(۱۱%)	۱,۳۱۲	۱,۴۷۸	۱۵۳	۸,۵۰۵.۵	۱۱۶	شستا	۱,۴۶۵	۶۰۱۰
(۷۴%)	۱۳۰	-۰.۳	۱۵.۲	(۸%)	۷,۵۰۵	۸,۱۸۰	۴۹۵	۱.۵	۲۲	فملی	۸,۰۰۰	۳۰۲۷
(۹۱%)	۹	-۰.۱	۱۱.۷	(۲۱%)	۱,۱۶۵	۱,۴۷۸	۱۰۰	۲۰.۰	۱۱۶	شستا	۱,۲۶۵	۶۰۰۸
(۹۵%)	۳	-۰	۵۴.۵	(۱۸%)	۲,۹۴۴	۳,۶۰۷	۵۴	۱۵.۹	۱۸	های وب	۲,۹۹۸	۳۰۰۶
(۹۶%)	۳	-۰	۱۷.۲	(۲۶%)	۱,۱۰۱	۱,۴۷۸	۶۴	۵.۵	۱۱۶	شستا	۱,۱۶۵	۶۰۰۷
(۹۹%)	۱	-۰	۱۸.۰	(۳۲%)	۱,۰۰۹	۱,۴۷۸	۵۶	۳,۹۷۳.۴	۱۱۶	شستا	۱,۰۶۵	۶۰۰۶
(۱۰۰%)	۰	-۰	۲۷.۴	(۳۷%)	۹۳۱	۱,۴۷۸	۳۴	۱۴.۷	۱۱۶	شستا	۹۶۵	۶۰۰۵
(۱۰۰%)	۰	-۰	۳۵.۰	(۴۳%)	۸۴۱	۱,۴۷۸	۲۴	۲,۱۴۰.۶	۱۱۶	شستا	۸۶۵	۶۰۰۴

(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیارد تومان

میلیون تومان

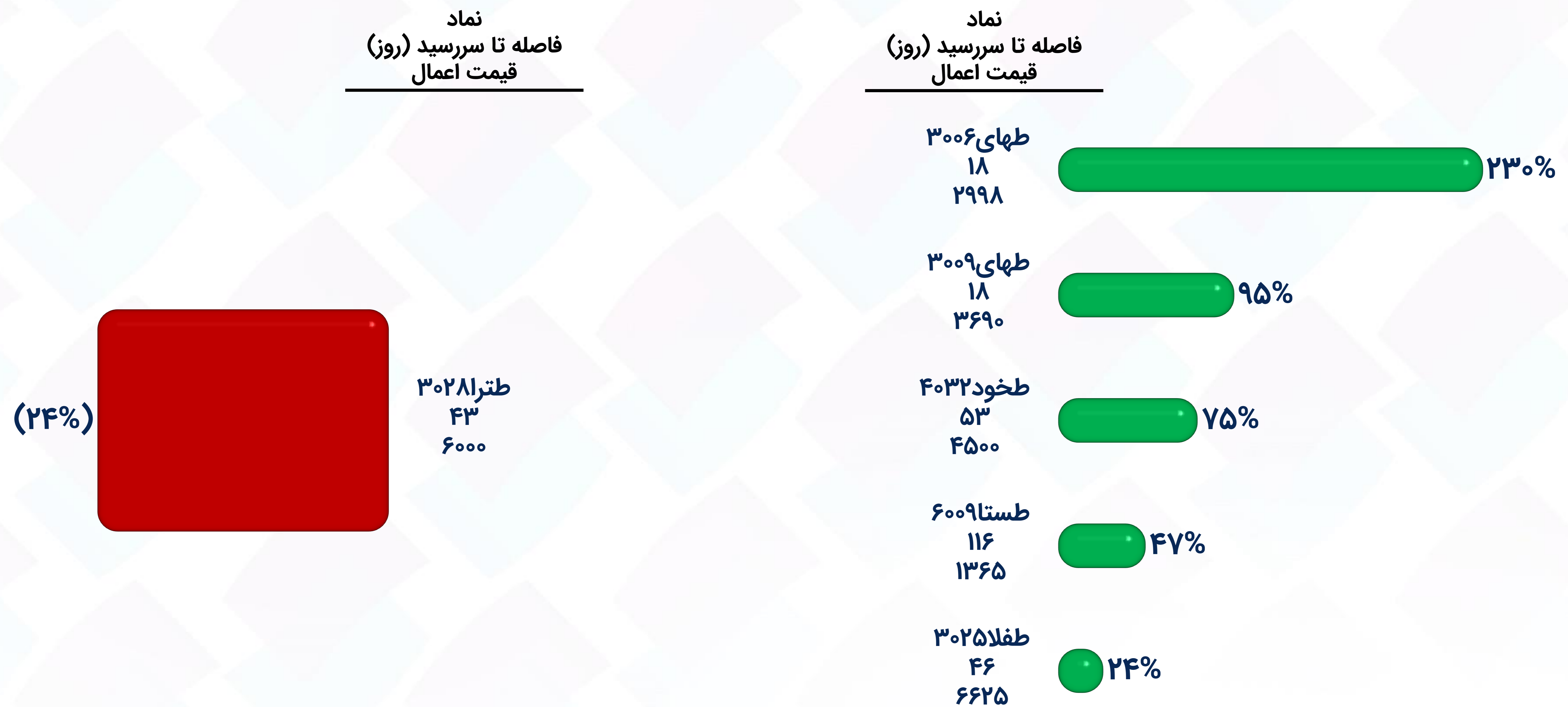
میلیون تومان

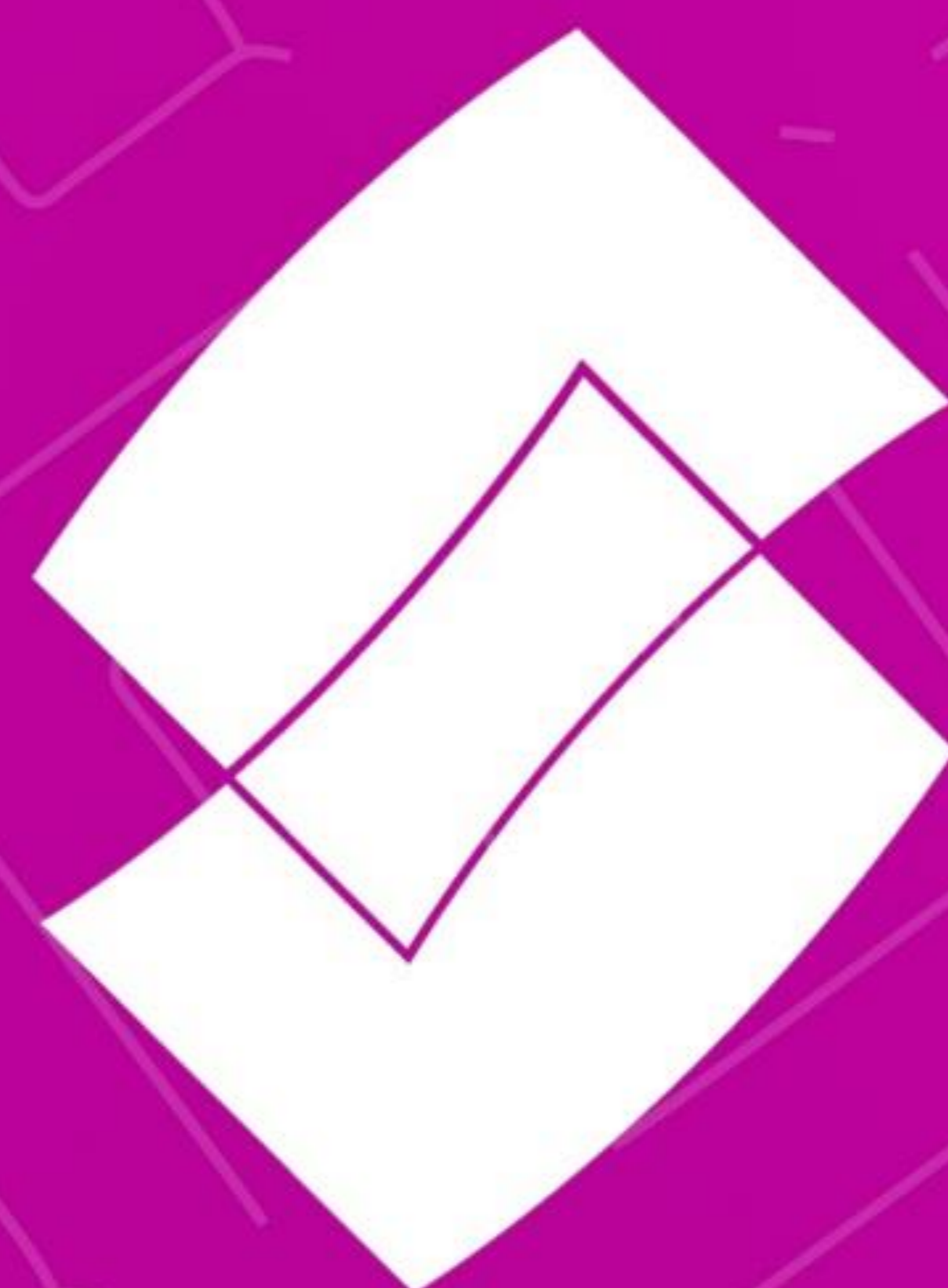
بیشترین تغییرات قیمت

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 واحد تحلیل: علیرضا پیامی

کارشناسان واحد تحلیل: زهره عباسی، محمد حسین 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.