

شماره

۰۶

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۲۳ اردیبهشت ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

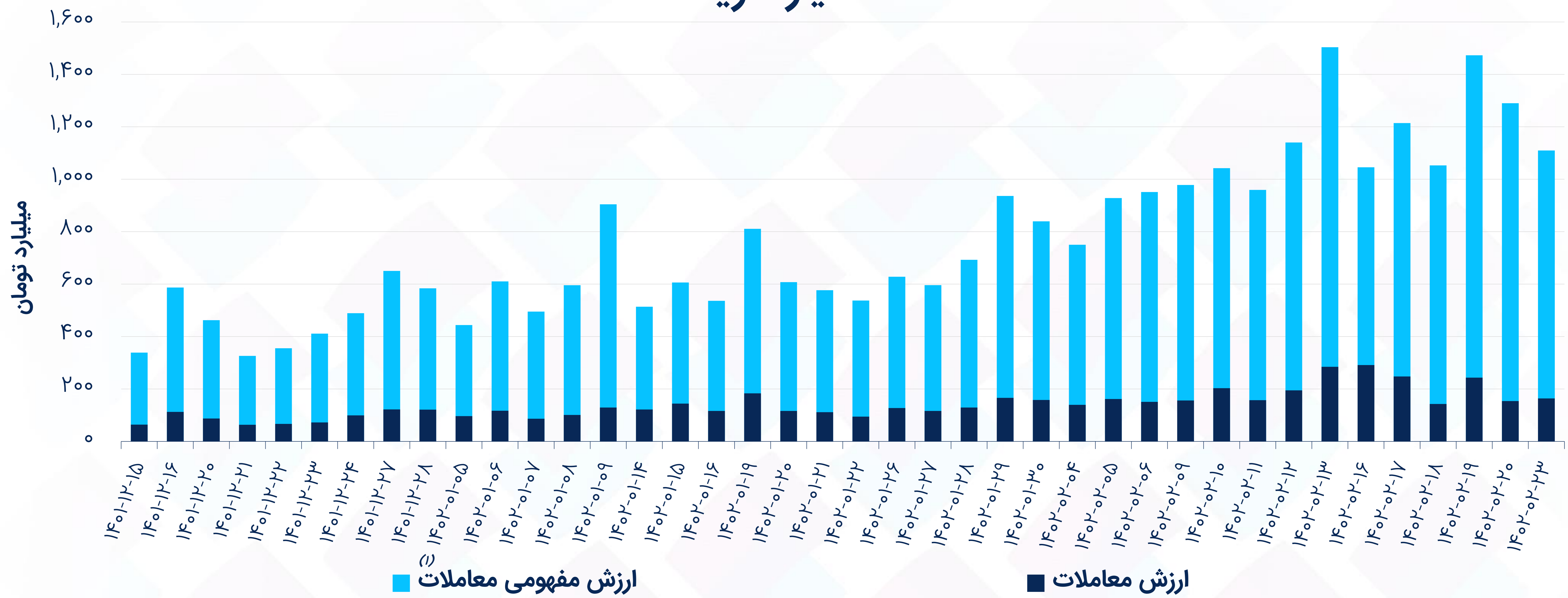




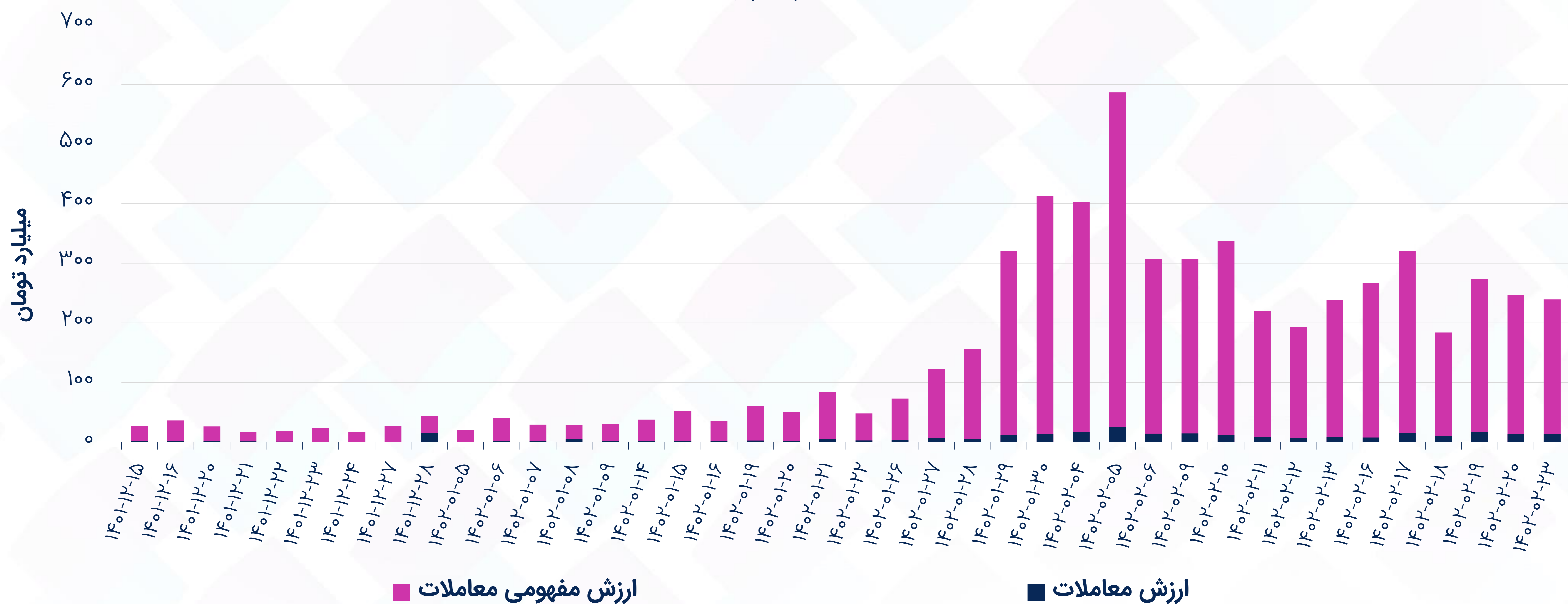
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



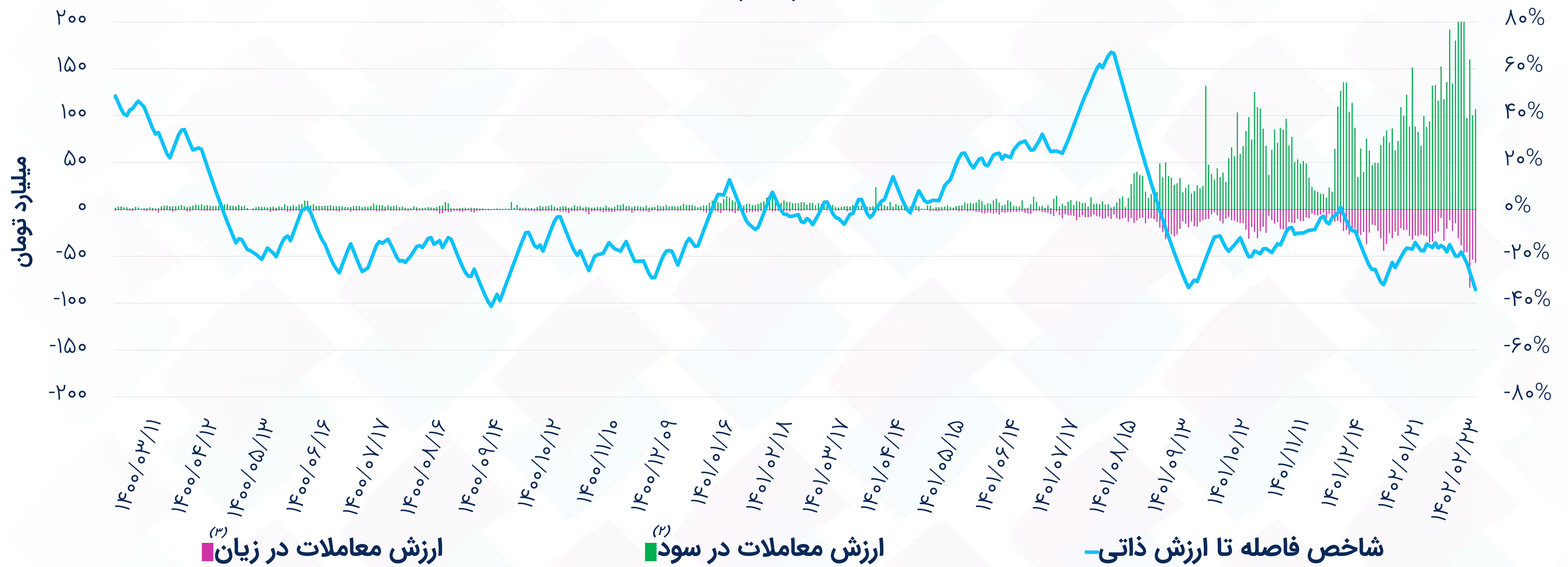
اختیار فروش



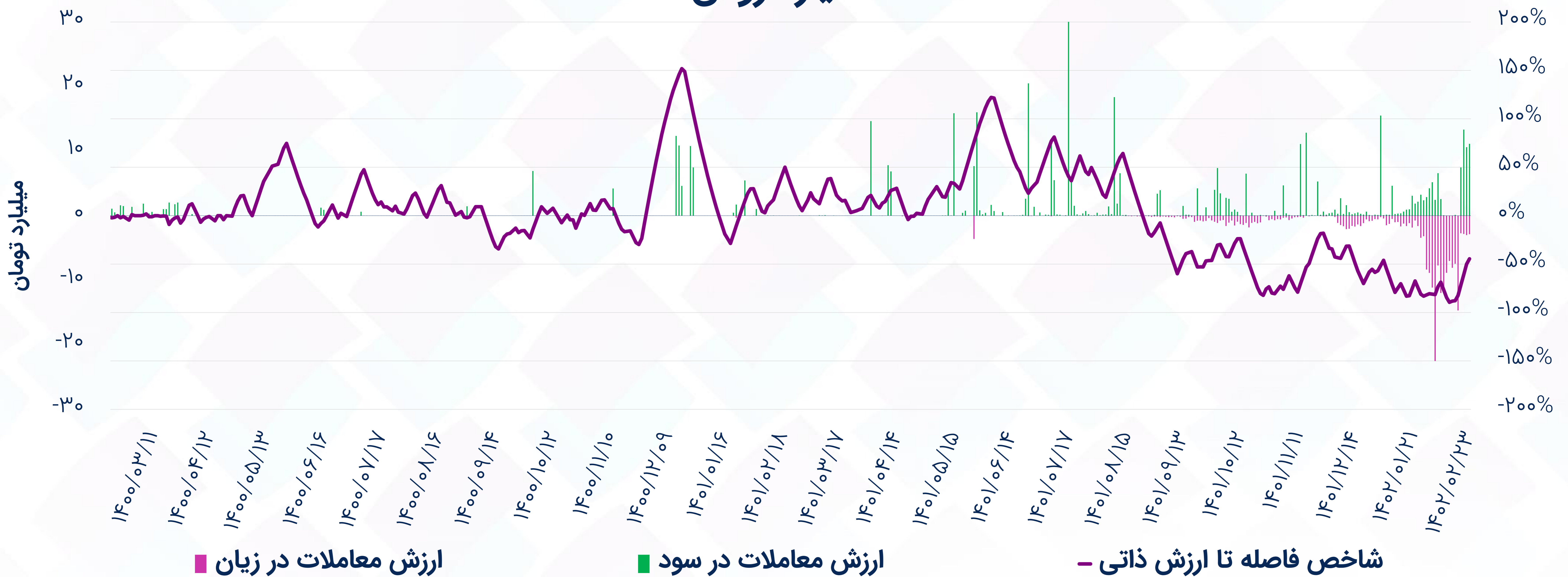
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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 (نمودار به صورت Smooth نشان داده شده است).
 (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

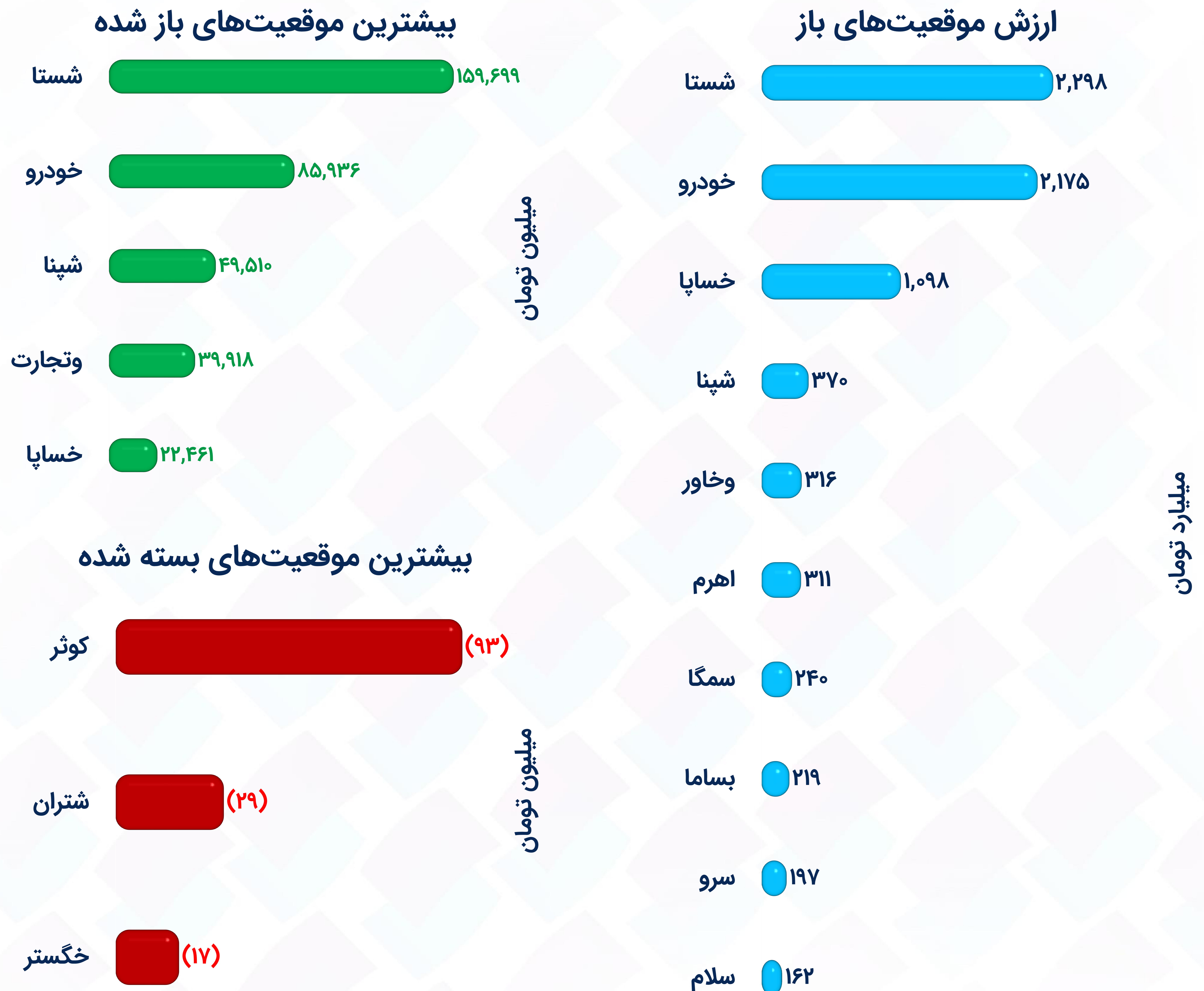
اختیار خرید

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	۴۶	۴۶.۸	۲۷۲.۰	۱۲.۷	۳۴.۲	(۵۹%)
خسپا	۲۵	۳۸.۲	۱۴۵.۹	۳۵.۳	۲.۹	(۱۹%)
خودرو	۳۵	۲۶.۵	۴۸۰.۶	۱۶.۸	۹.۷	(۵۰%)
تجارت	۱۱	۲۴.۰	۷۰.۸	۱۹.۹	۴.۲	(۲۲%)
اهرم	۲۳	۵.۴	۱۳.۶	۳.۲	۲.۲	(۲۴%)
شپنا	۱۲	۴.۸	۴۱.۶	۴.۵	۰.۳	۵%
فولاد	۱۳	۴.۶	۹.۲	۴.۵	۰.۰	۳۷%

اختیار فروش

نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
شستا	۷	۱۳,۵۶۲.۲	۲۳۱,۱۱۹.۸	۱۰,۷۰۰.۸	۲,۸۶۱.۴	(۴۶%)
های وب	۲	۲۸۶.۴	۶,۰۹۵.۹	۲۸۶.۴	۰.۰	۲۰%
فولاد	۱	۱۱۳.۳	۱,۴۶۹.۹	۱۱۳.۳	۰.۰	(۳۹%)
توسن	۱	۱۲.۸	۷۸.۹	۱۲.۸	۰.۰	۲۰%
سمگا	۱	۱۲.۰	۱۵۲.۱	۱۲.۰	۰.۰	۳%
شتران	۲	۲.۶	۱۶.۶	۲.۶	۰.۰	(۲۱%)
شپنا	۲	۲.۰	۴۳.۹	۲.۰	۰.۰	(۸%)

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

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده

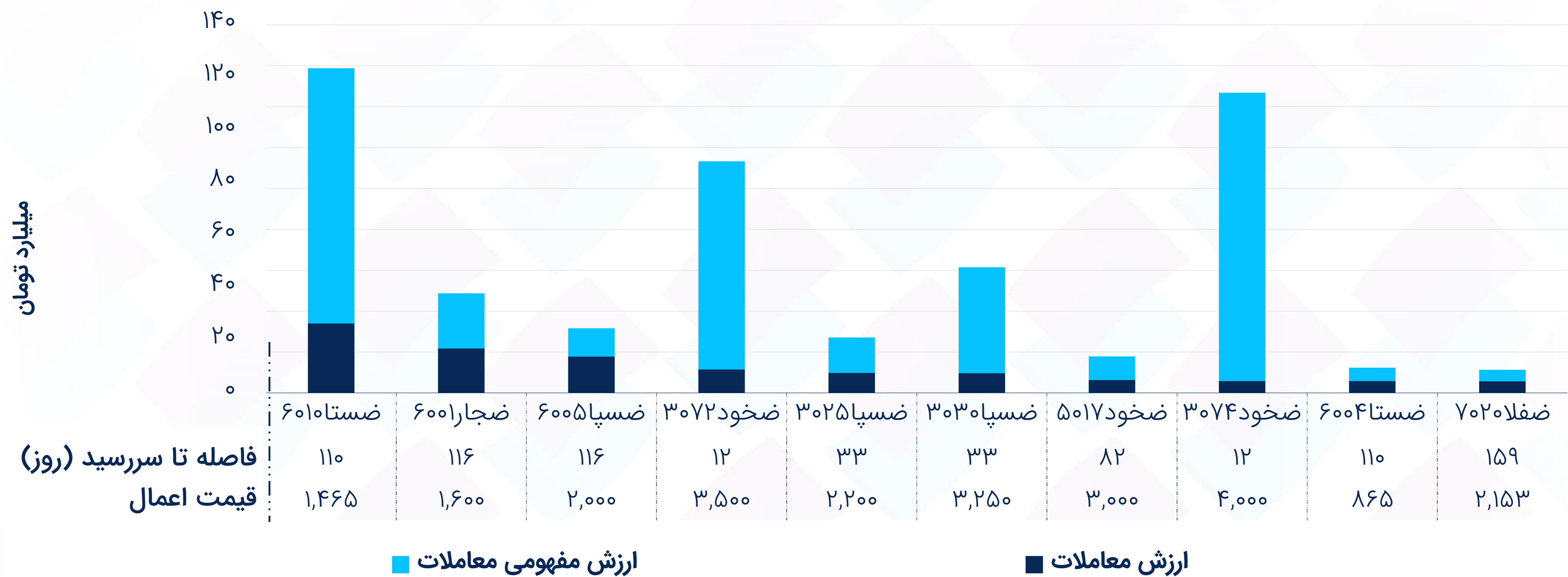


میلیون تومان

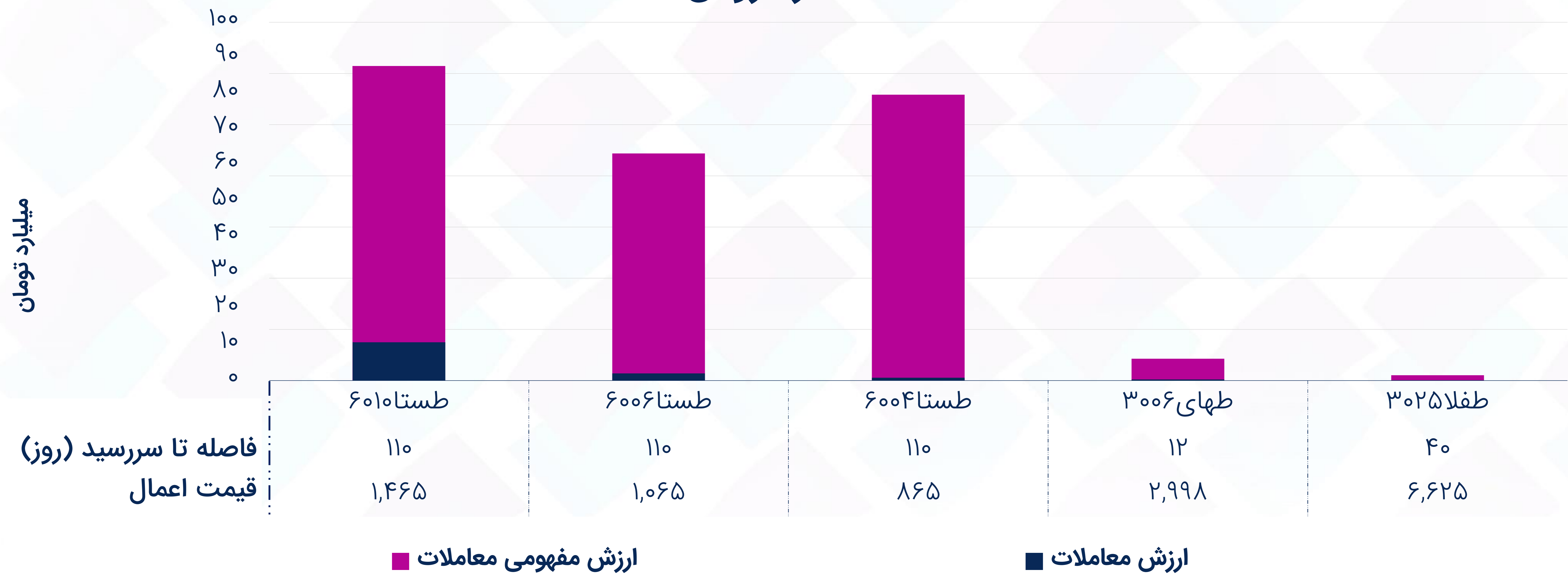


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک 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
۱۲۷.۰%	۷,۵۶۶	۰.۸۵	۵.۸	(۰%)	۱۹,۳۳۳	۱۹,۳۷۶	۳,۳۳۳	۹۰.۰	۲۹۷	۱۶,۰۰۰	توان ۱۲۰۱
۴۷.۵%	۸۷۶	۱.۰۰	۵.۷	(۷%)	۳,۳۹۴	۳,۶۵۱	۵۹۴	۲۰.۵	۱۲	۲,۸۰۰	خودرو ۳۰۶۹
۳۸.۸%	۴,۵۰۸	۱.۰۰	۱.۷	(۱۶%)	۵,۴۰۰	۶,۴۲۰	۳,۲۴۷	۴,۴۲۶.۸	۱۵۹	۲,۱۵۳	فولاد ۷۰۲۰
۲۳.۶%	۷۵۸	۱.۰۰	۴.۱	(۴%)	۲,۵۱۳	۲,۶۲۱	۶۱۳	۶۱.۷	۲۶	۱,۹۰۰	وبصادر ۳۰۲۵
۱۱.۸%	۴,۳۶۱	۱.۰۰	۱.۶	(۳%)	۶,۲۱۹	۶,۴۲۰	۳,۹۰۰	۱۱.۸	۱۵۹	۲,۳۱۹	فولاد ۷۰۲۱

گرانترین نسبت به 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
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۸۹.۷	۴۶%	۴,۱۷۴	۲,۸۶۳	۲۲	۲۱.۸	۱۲	۴,۱۵۲	های وب ۳۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۱۳.۵	۳۷%	۵,۰۱۶	۳,۶۵۱	۱۶	۶۹۰.۰	۱۲	۵,۰۰۰	خودرو ۳۰۷۶
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۸۲.۸	۳۸%	۱,۸۲۲	۱,۳۲۲	۲۲	۳۳۲.۳	۲۶	۱,۸۰۰	شستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۲.۷	۵۶%	۲,۰۶۳	۱,۳۲۲	۶۳	۳,۱۱۸.۹	۵۴	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۶۵.۷	۳۱%	۳,۷۴۷	۲,۸۶۳	۵۷	۵۵.۰	۱۲	۳,۶۹۰	های وب ۳۰۰۹

(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

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهای ۳۰۰۶	های وب	۱۲	۲۸۵.۱	۱۳۴	۲,۸۶۳	۲,۸۶۴	۰%	۲۱.۴	-۰.۶۶	۱۶۱	۲۰.۲%
طوسن ۷۰۹	توسن	۱۴۹	۱۲.۸	۳,۰۴۶	۱۸,۷۹۰	۲۱,۵۵۴	۱۵%	۷.۱	-۰.۷۷	۳,۶۵۳	۱۹.۹%
طسمگا ۷۰۳	سمگا	۱۴۲	۱۲.۰	۶۶۵	۸,۴۱۰	۷,۸۳۵	(۷%)	۱۱.۸	-۰.۳۲	۶۸۷	۳.۴%
طهای ۳۰۰۹	های وب	۱۲	۱.۳	۸۳۰	۲,۸۶۳	۲,۸۶۰	(۰%)	۳.۴	-۱.۰۰	۷۹۴	(۴.۳%)
طشنا ۲۰۳	شپنا	۲	۱.۳	۳۰۰	۸,۹۷۰	۸,۹۰۷	(۱%)	۲۹.۷	-۰.۷۹	۲۵۳	(۱۵.۵%)

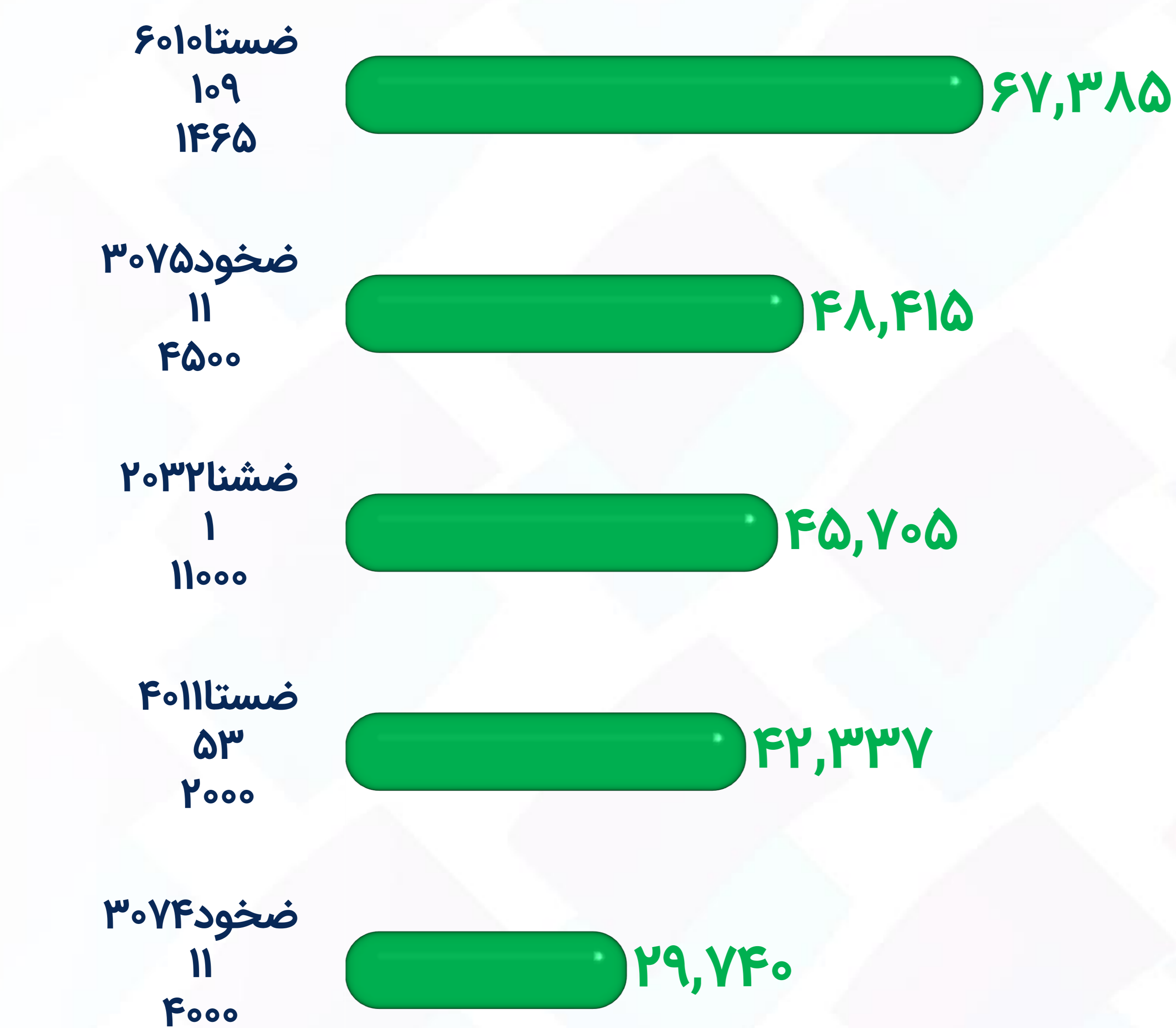
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طهرم ۷۰۰۰	اهرم	۱۵۶	۱.۰	۵۰	۲۲,۶۳۰	۶,۴۵۰	(۷۱%)	۱۲۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
طستا ۶۰۰۴	شستا	۱۱۰	۸۴۴.۷	۱۴	۱,۳۲۲	۸۵۱	(۳۶%)	۶۰.۸	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
طستا ۶۰۰۶	شستا	۱۱۰	۲,۰۱۴.۶	۴۲	۱,۳۲۲	۱,۰۲۳	(۲۳%)	۲۴.۴	-۰.۰۴	۴	(۹۲%)
طستا ۶۰۰۸	شستا	۱۱۰	۱.۳	۸۶	۱,۳۲۲	۱,۱۷۹	(۱۱%)	۱۳.۷	-۰.۲۱	۳۰	(۶۵%)
طستا ۶۰۰۹	شستا	۱۱۰	۳.۸	۱۰۹	۱,۳۲۲	۱,۲۵۶	(۵%)	۱۱.۵	-۰.۳۵	۶۱	(۴۴%)

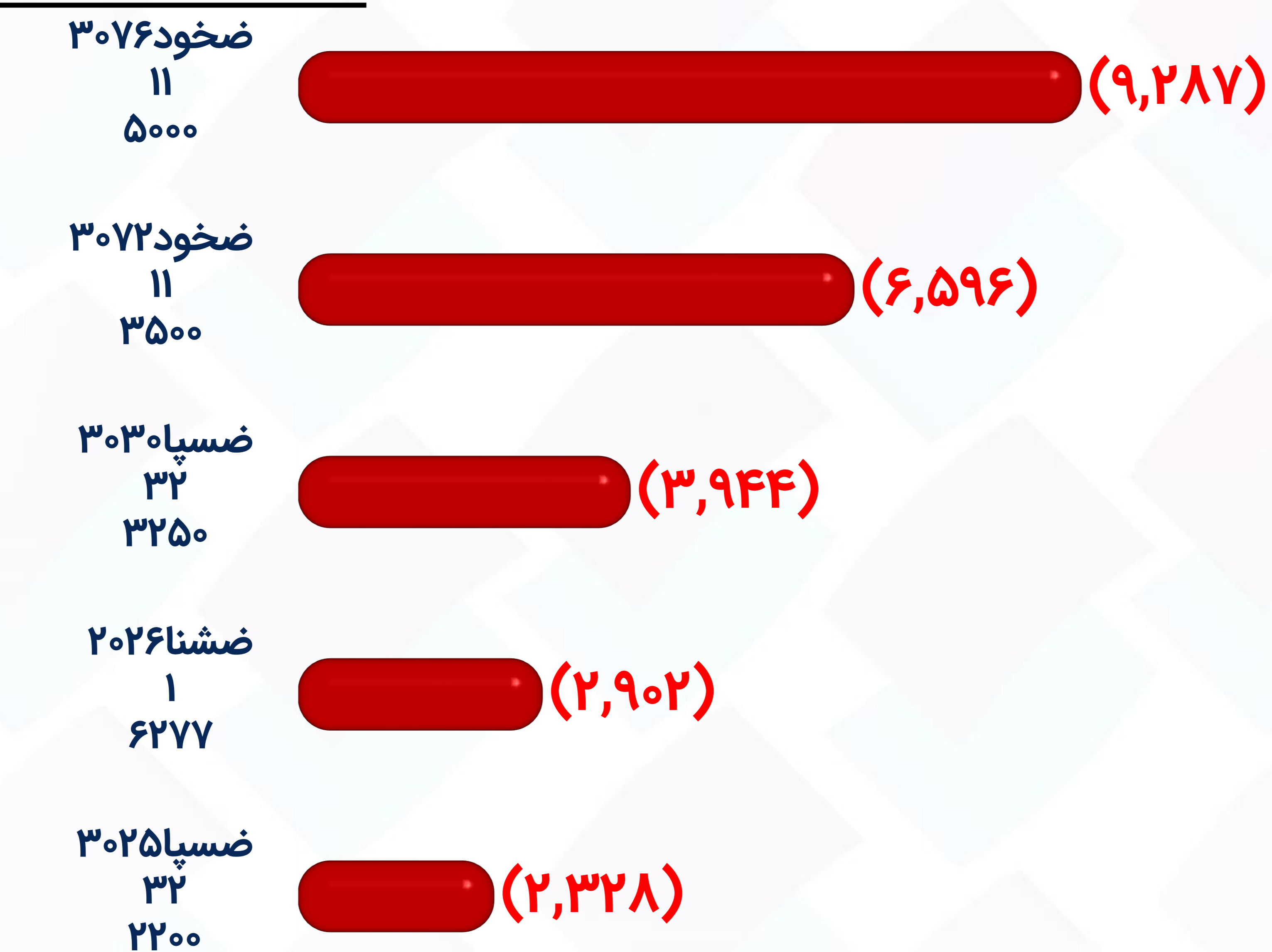
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



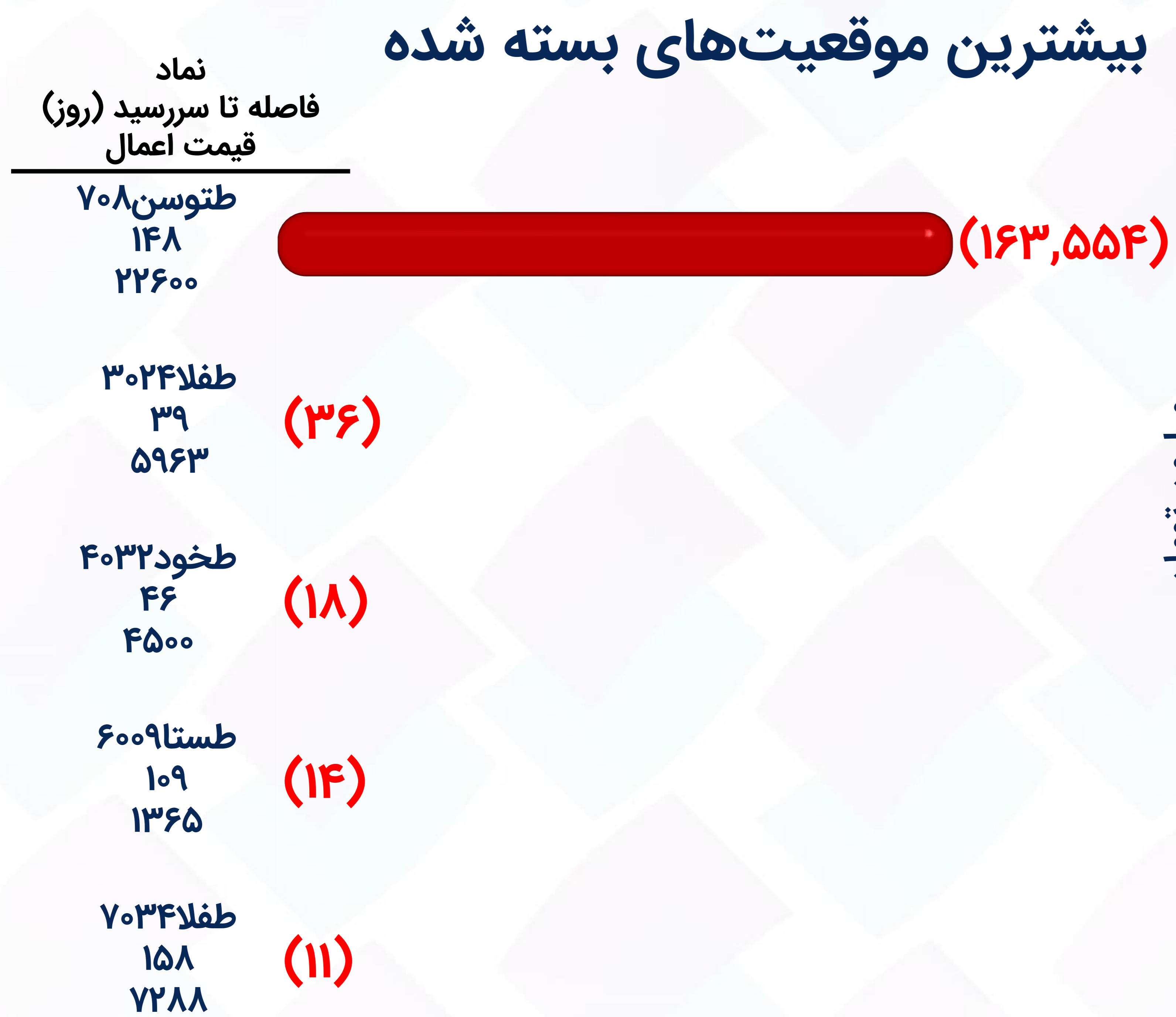
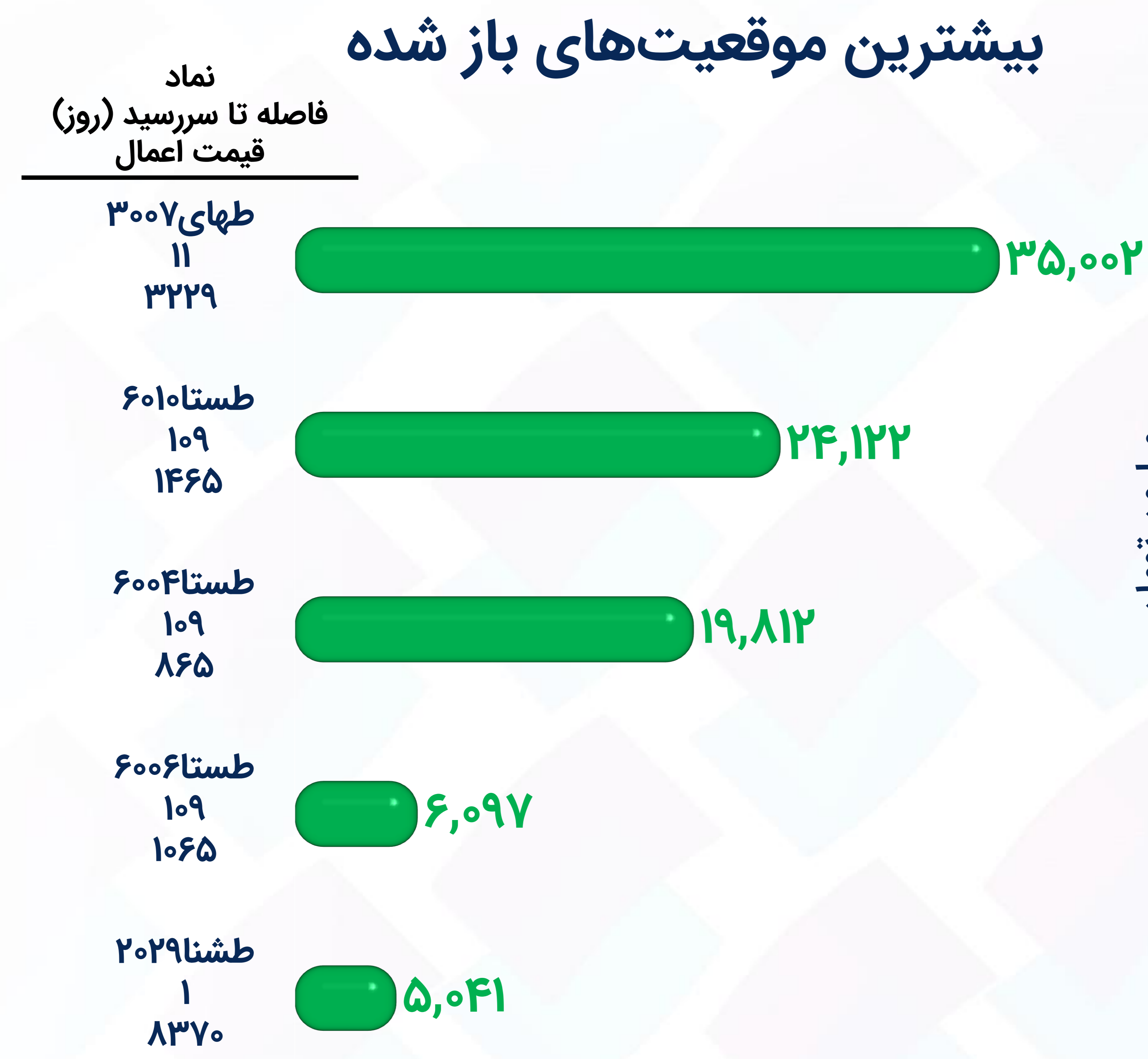
ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

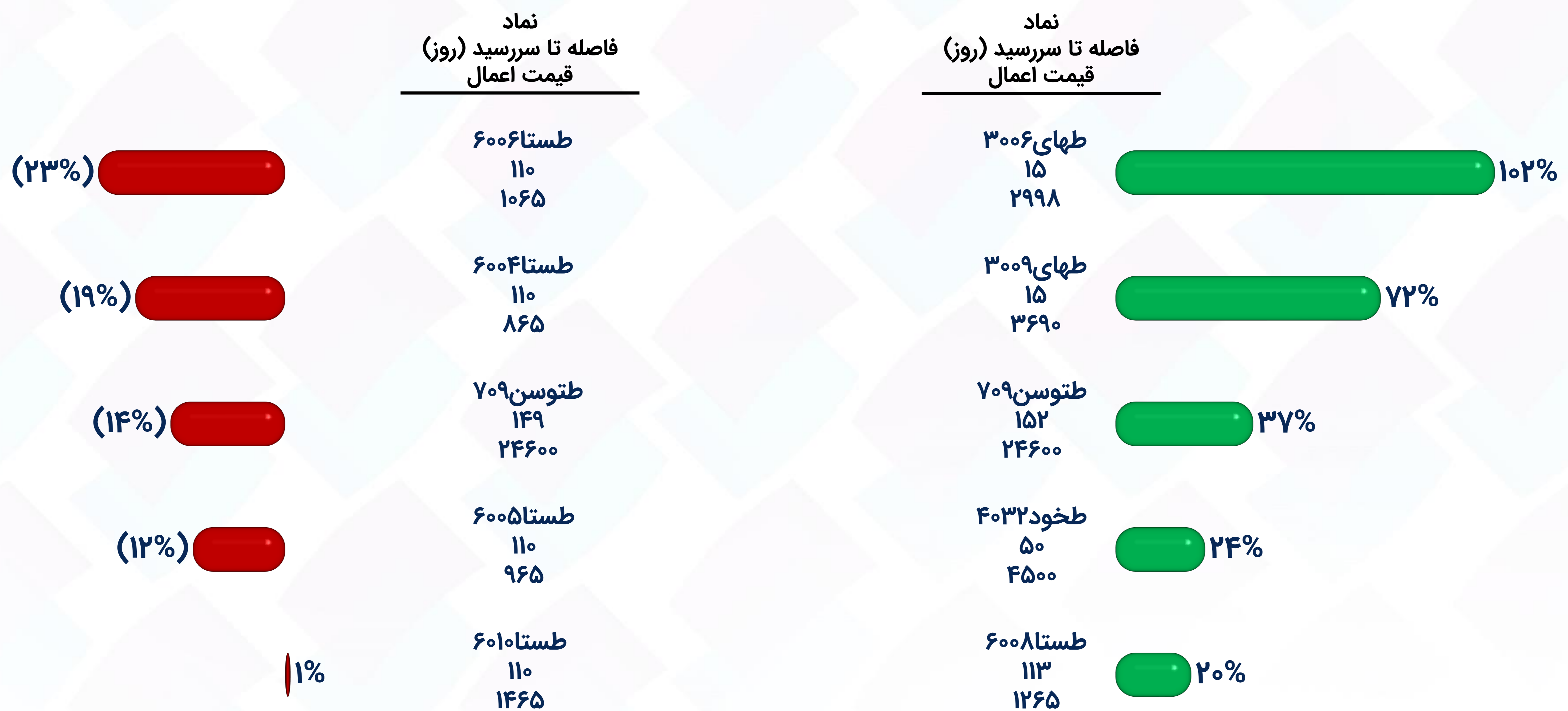


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

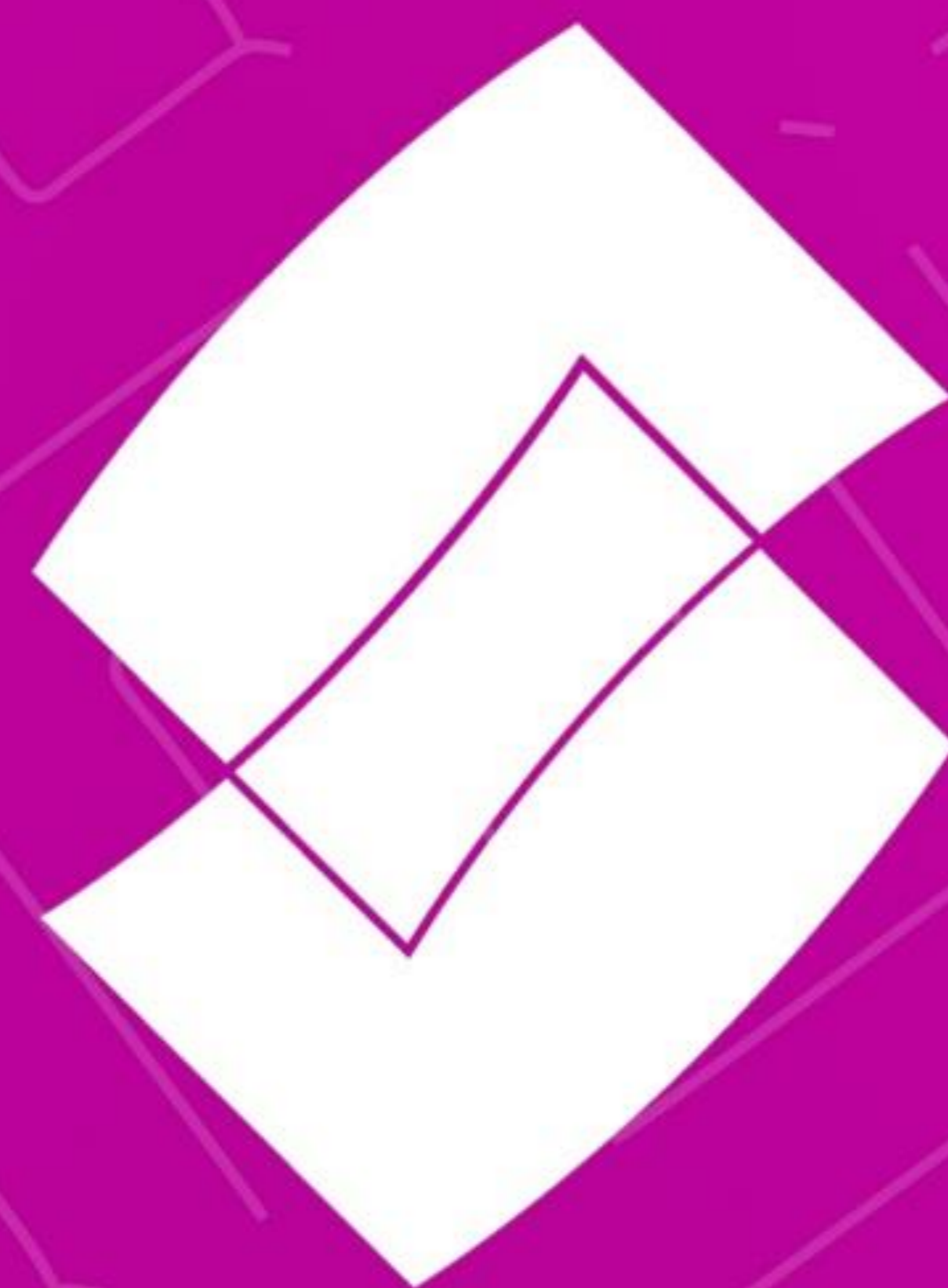
اختیار خرید



اختیار فروش



(۱) تنها قراردادهای دارای معامله طی دو روز معاملاتی منتهی به روز جاری لحاظ شده‌اند.



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.