

شماره

۰۷

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۲۴ اردیبهشت ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

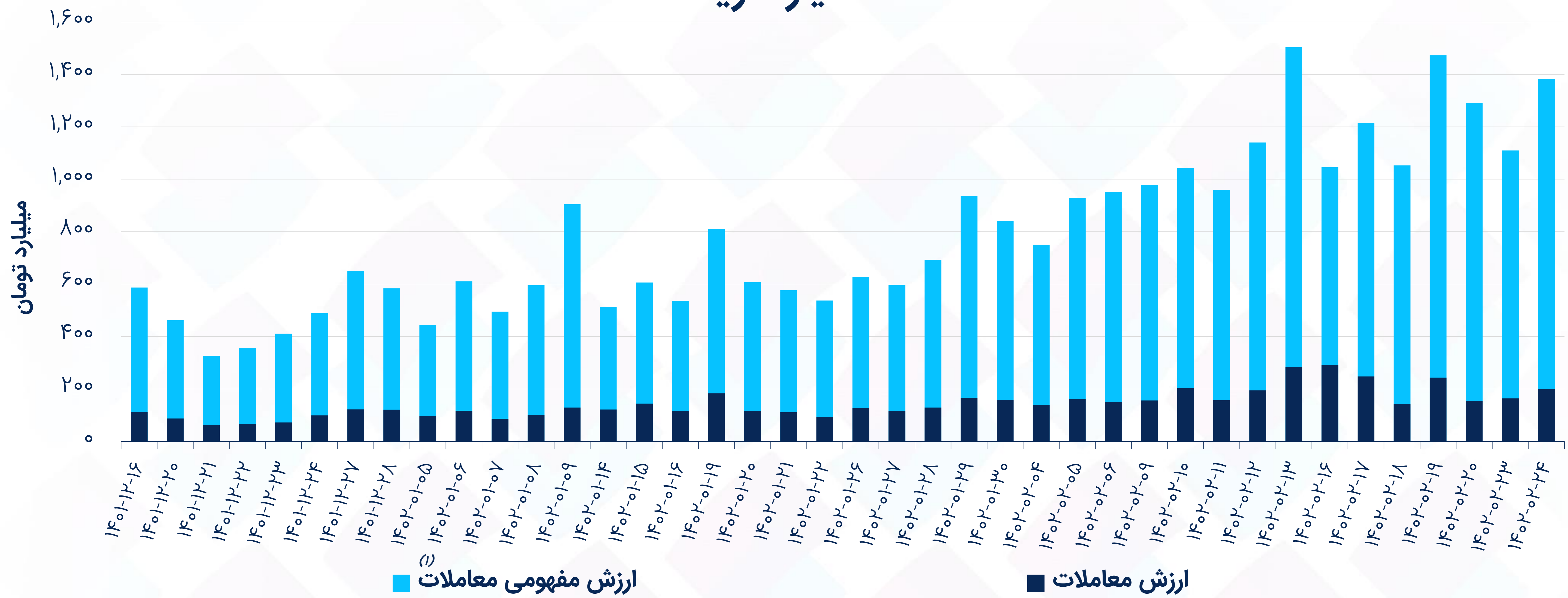




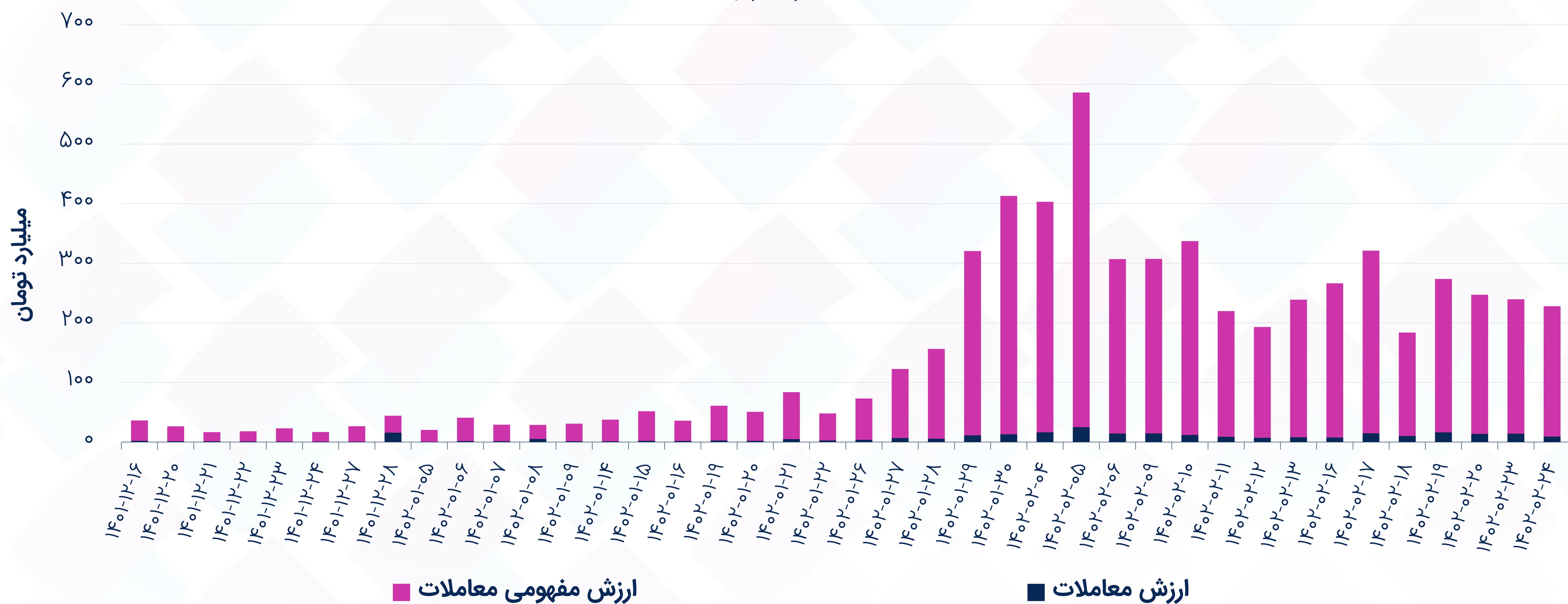
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



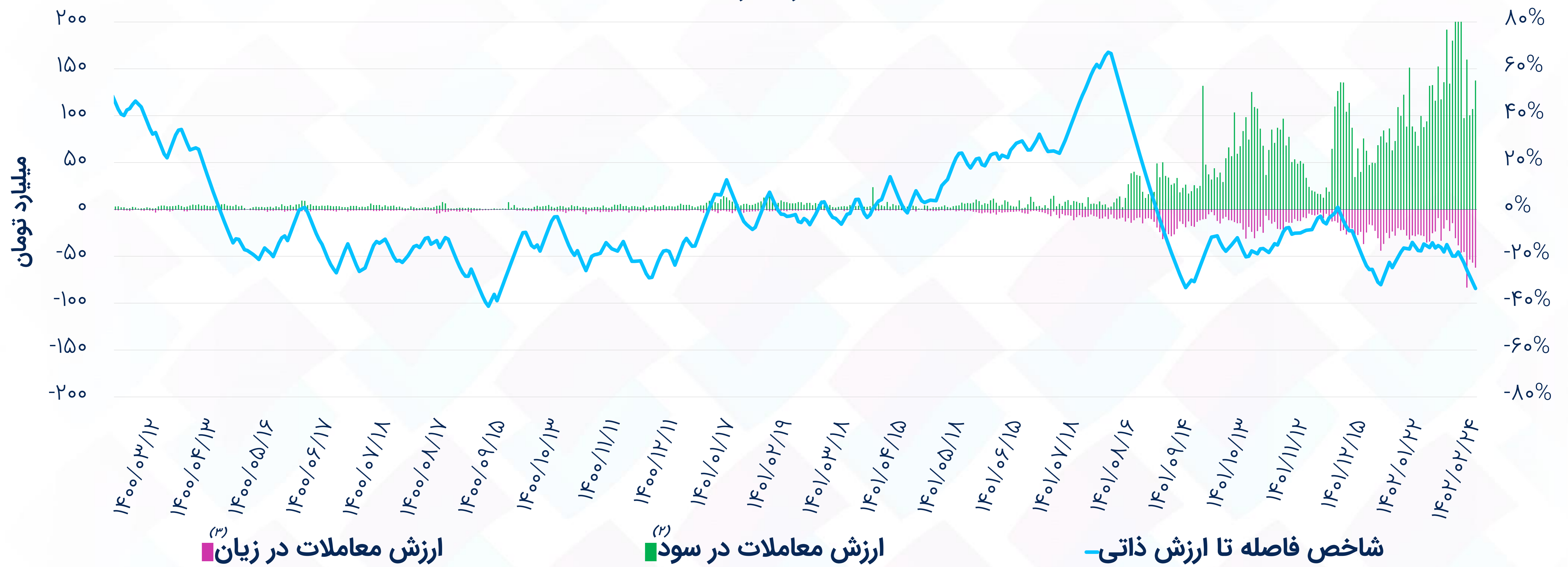
اختیار فروش



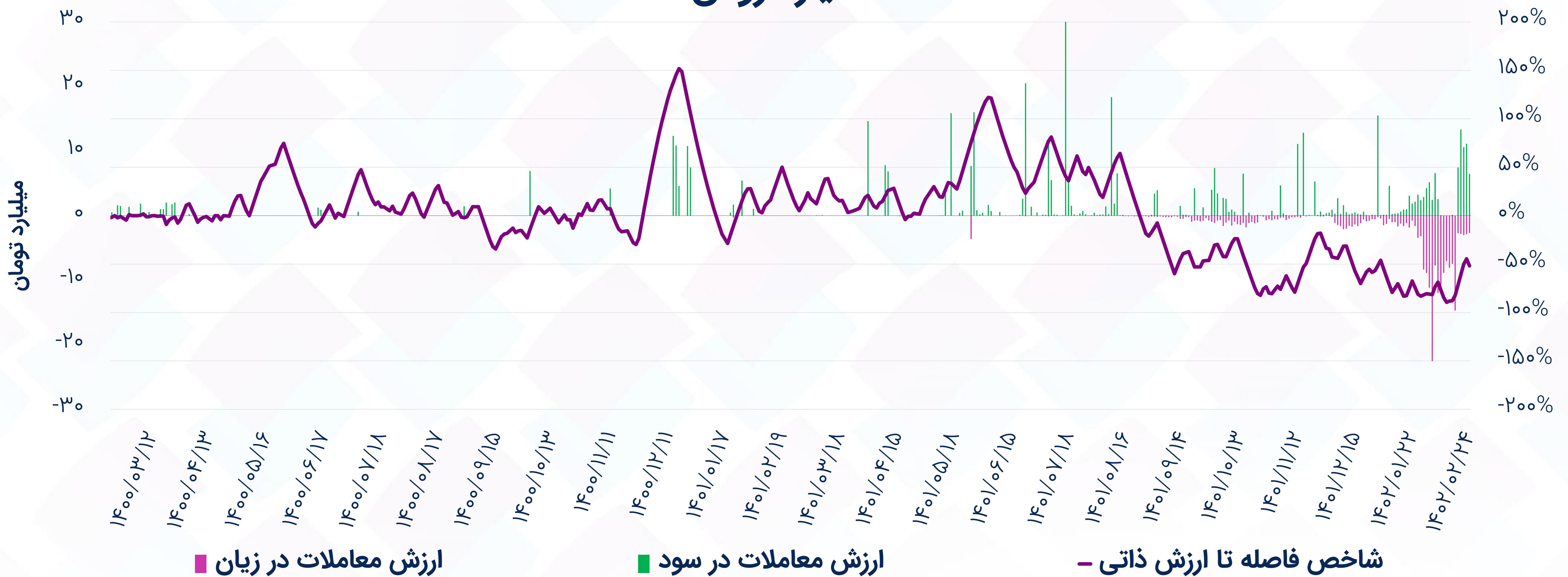
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

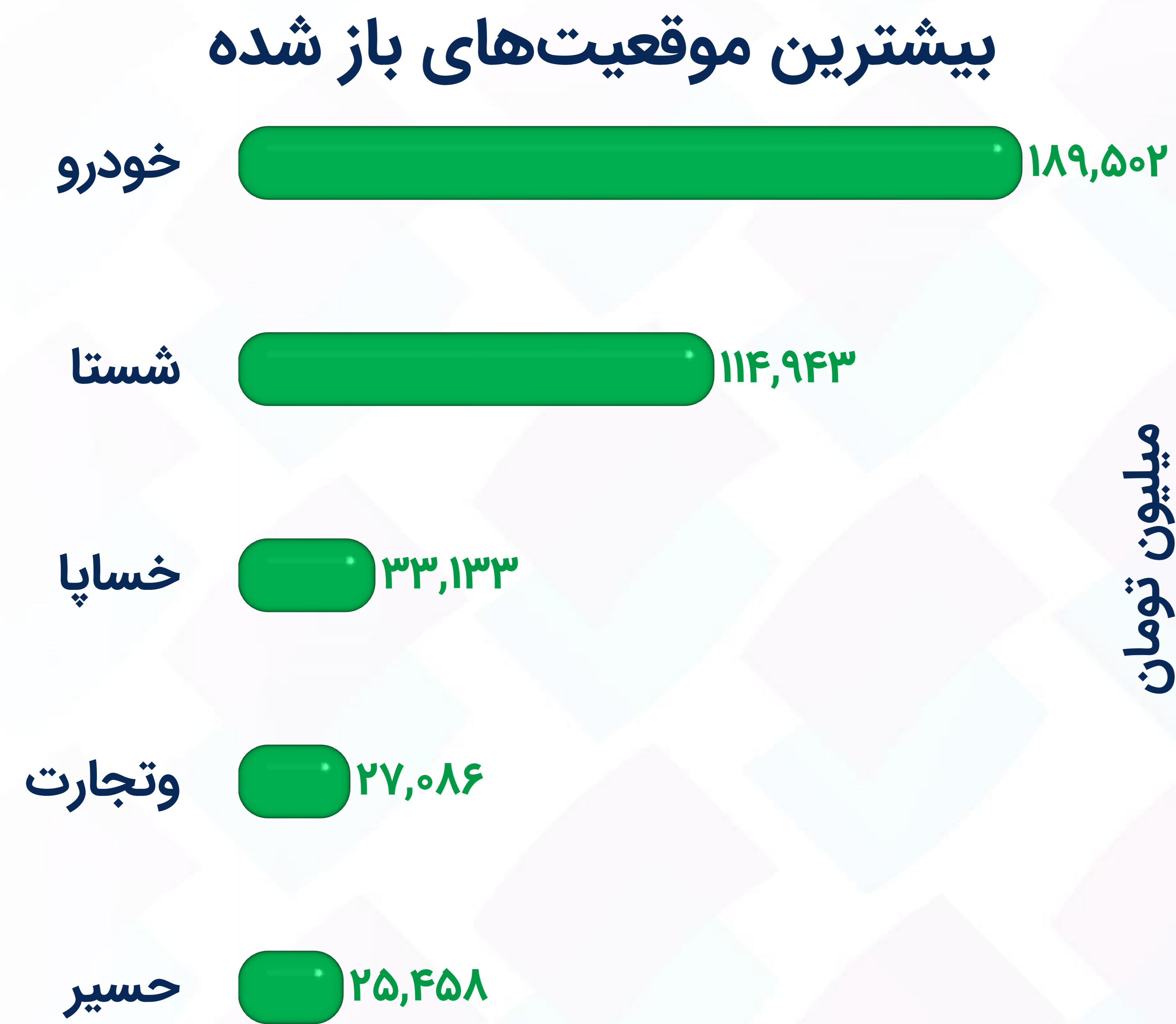
اختیار خرید

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	۳۶	۴۷.۲	۲۶۰.۸	۱۰.۵	۳۶.۷	(۶۰%)
خسپا	۲۹	۴۴.۴	۱۴۸.۰	۴۰.۵	۳.۹	(۲۳%)
خودرو	۳۸	۳۲.۲	۶۵۹.۶	۲۰.۱	۱۲.۲	(۴۸%)
دی	۱۳	۲۷.۴	۵۰.۰	۲۴.۵	۳.۰	(۲۵%)
شپنا	۱۶	۱۳.۹	۸۱.۴	۱۳.۶	۰.۲	۳%
وتجارت	۱۰	۸.۵	۲۲.۵	۷.۱	۱.۴	(۲۲%)
ذوب	۴	۵.۴	۲۳.۰	۵.۳	۰.۱	(۸%)

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	۹,۰۴۵.۷	۲۲۴,۸۴۵.۶	۶,۴۵۳.۵	۲,۵۹۲.۲	(۵۲%)
های وب	۲	۵۷.۷	۱,۹۰۲.۲	۰.۰	۵۷.۷	(۲۳%)
فولاد	۱	۳۰.۹	۱,۰۱۶.۹	۰.۰	۳۰.۹	(۱%)
توسن	۱	۱۳.۴	۹۲.۵	۱۳.۴	۰.۰	۳۴%
بساما	۱	۱.۸	۳۷.۰	۰.۰	۱.۸	(۱۰۰%)
شپنا	۱	۰.۳	۲۷.۴	۰.۳	۰.۰	۳۷۳%

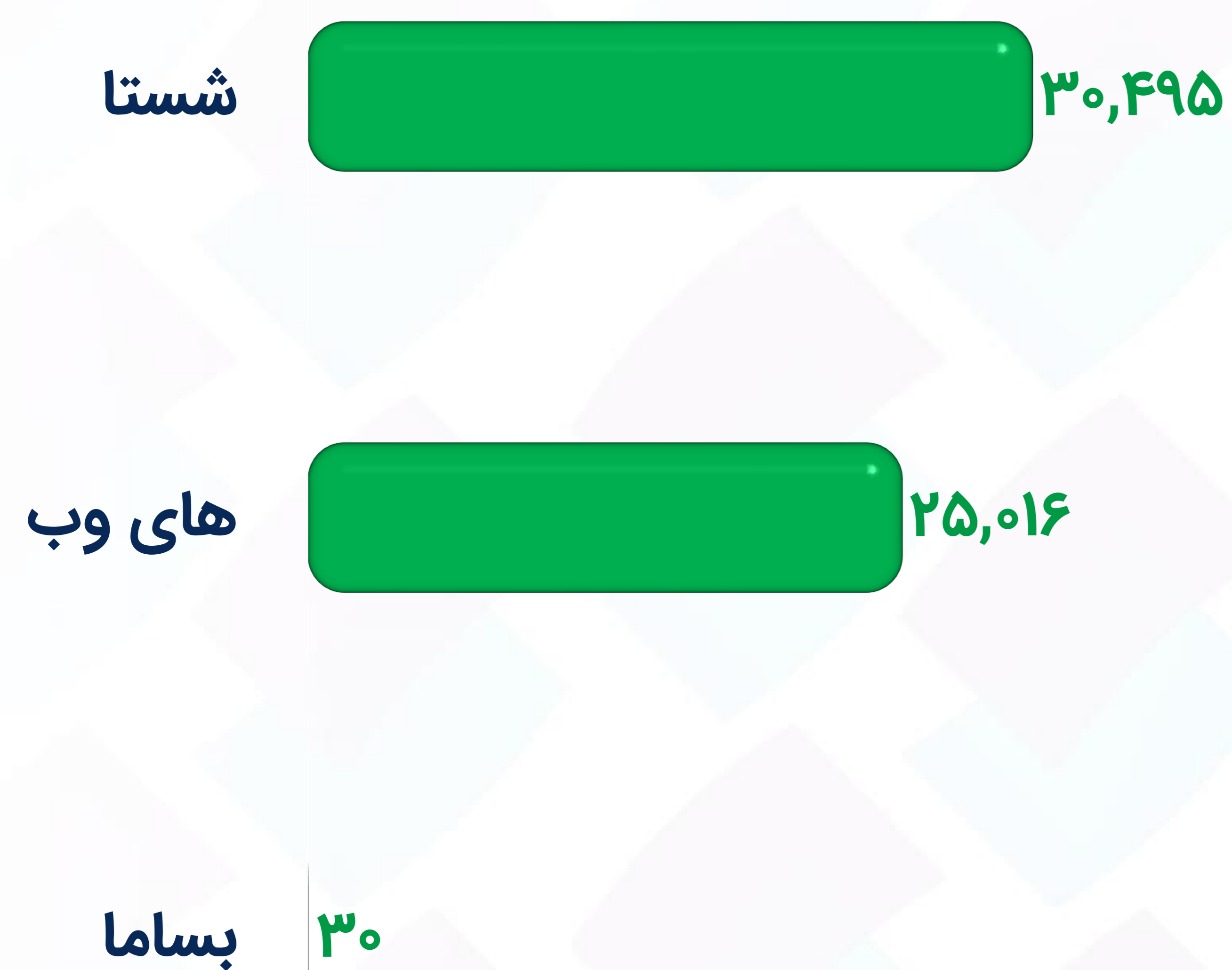
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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

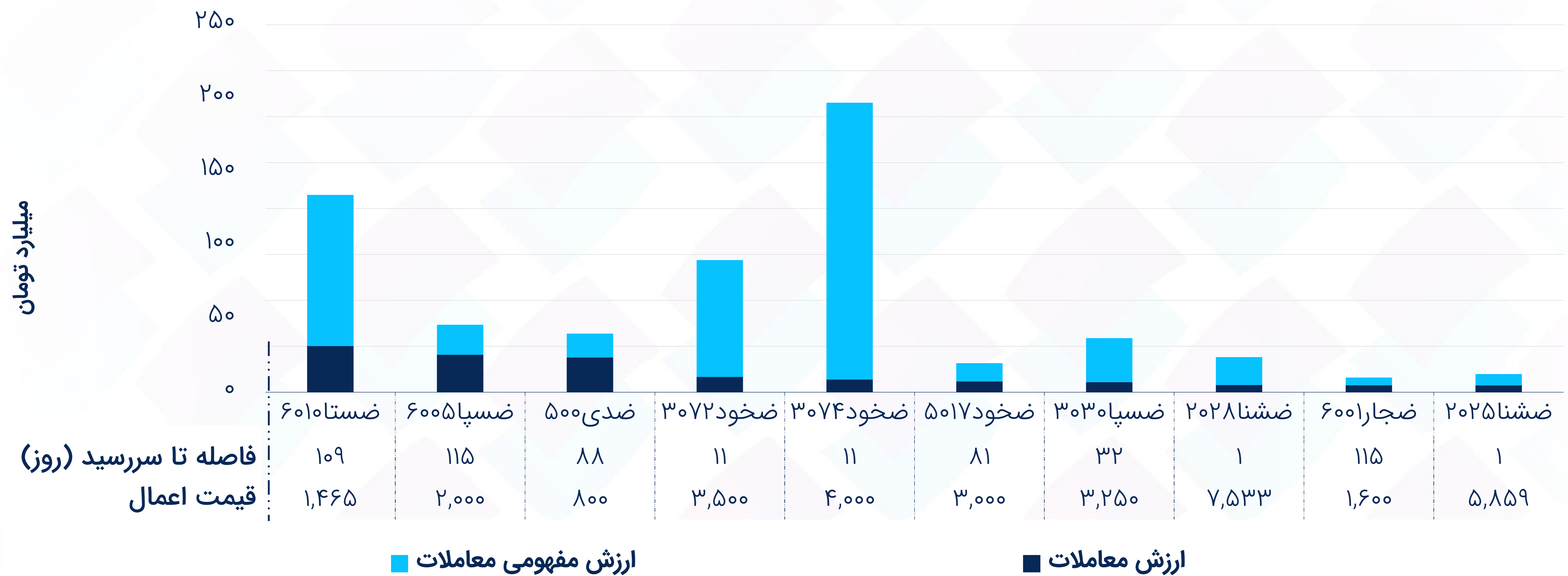
بیشترین موقعیت‌های بسته شده



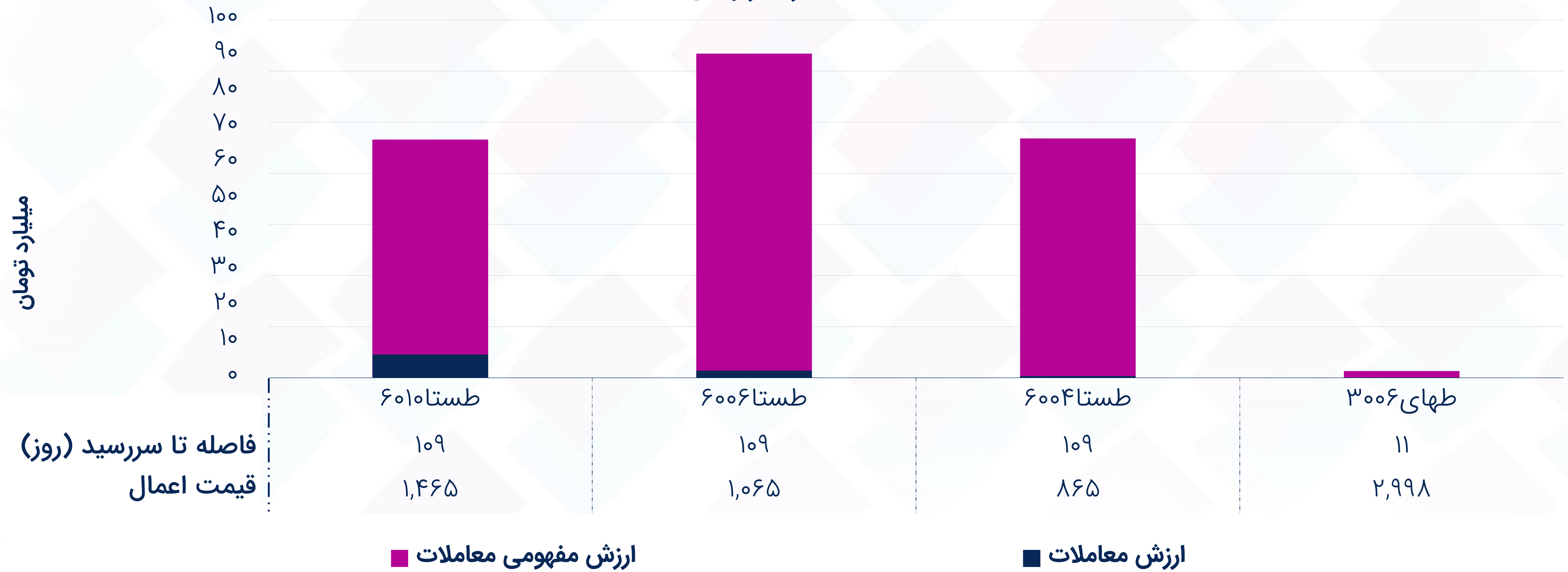
میلیون تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بک شولز

ارزانترین نسبت به 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
۱۰۲.۲%	۸۸۸	۰.۳۲	۵۱.۱	۳۶%	۲۲,۴۳۹	۱۶,۵۰۰	۴۳۹	۵۵۸.۴	۱۲۸	۲۲,۰۰۰	ضحسیر ۶۱۶
۱۵.۶%	۲,۱۶۳	۰.۳۴	۲۳.۵	۸۰%	۴۳,۸۷۰	۲۴,۴۲۰	۱,۸۷۰	۳۶.۷	۳۰۵	۴۲,۰۰۰	ضهرم ۱۲۳۲
۴.۵%	۸۵۵	۱.۰۰	۳.۳	(۰%)	۲,۷۱۸	۲,۷۲۱	۸۱۸	۵۰۱.۷	۲۵	۱,۹۰۰	ضصاد ۳۰۲۵
۴.۲%	۱۷,۷۱۰	۱.۰۰	۱.۴	۰%	۲۴,۵۰۰	۲۴,۴۲۰	۱۷,۰۰۰	۳۷.۴	۱۵۵	۷,۵۰۰	ضهرم ۷۰۰۲
۲.۸%	۱,۷۵۵	۱.۰۰	۲.۲	(۱%)	۳,۷۰۷	۳,۷۳۹	۱,۷۰۷	۱۸.۳	۱۱	۲,۰۰۰	ضخود ۳۰۶۵

گرانترین نسبت به 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	۱۶۷.۱	۳۸%	۴,۱۷۷	۳,۰۳۲	۲۵	۲۶.۶	۱۱	۴,۱۵۲	ضهای ۳۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۸۳۴.۳	۳۴%	۵,۰۰۶	۳,۷۳۹	۶	۳۶۳.۰	۱۱	۵,۰۰۰	ضخود ۳۰۷۶
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۷۹.۳	۳۳%	۱,۸۲۳	۱,۳۷۳	۲۳	۵۳۱.۶	۲۵	۱,۸۰۰	ضستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۸.۴	۵۱%	۲,۰۷۳	۱,۳۷۳	۷۳	۲,۵۳۷.۹	۵۳	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۹۹%)	۱	۰.۰۱	۳۷.۹	۲۵%	۳,۷۹۰	۳,۰۳۲	۱۰۰	۵۳.۶	۱۱	۳,۶۹۰	ضهای 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 بک شولز

ارزانترین نسبت به 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
۳۴.۲%	۳,۶۶۹	-۰.۷۷	۸.۰	۱۶%	۲۱,۸۶۵	۱۸,۸۸۰	۲,۷۳۵	۱۳.۴	۱۴۸	۲۴,۶۰۰	توسن ۷۰۹
(۰.۹%)	۲۰۱	-۰.۳۶	۳۱.۶	(۴%)	۶,۴۲۲	۶,۶۷۰	۲۰۳	۳۰.۹	۳۹	۶,۶۲۵	طلا ۳۰۲
(۲۳.۰%)	۷۱	-۰.۳۹	۳۱.۶	(۴%)	۲,۹۰۶	۳,۰۳۲	۹۲	۵۷.۷	۱۱	۲,۹۹۸	طهای ۳۰۰۶

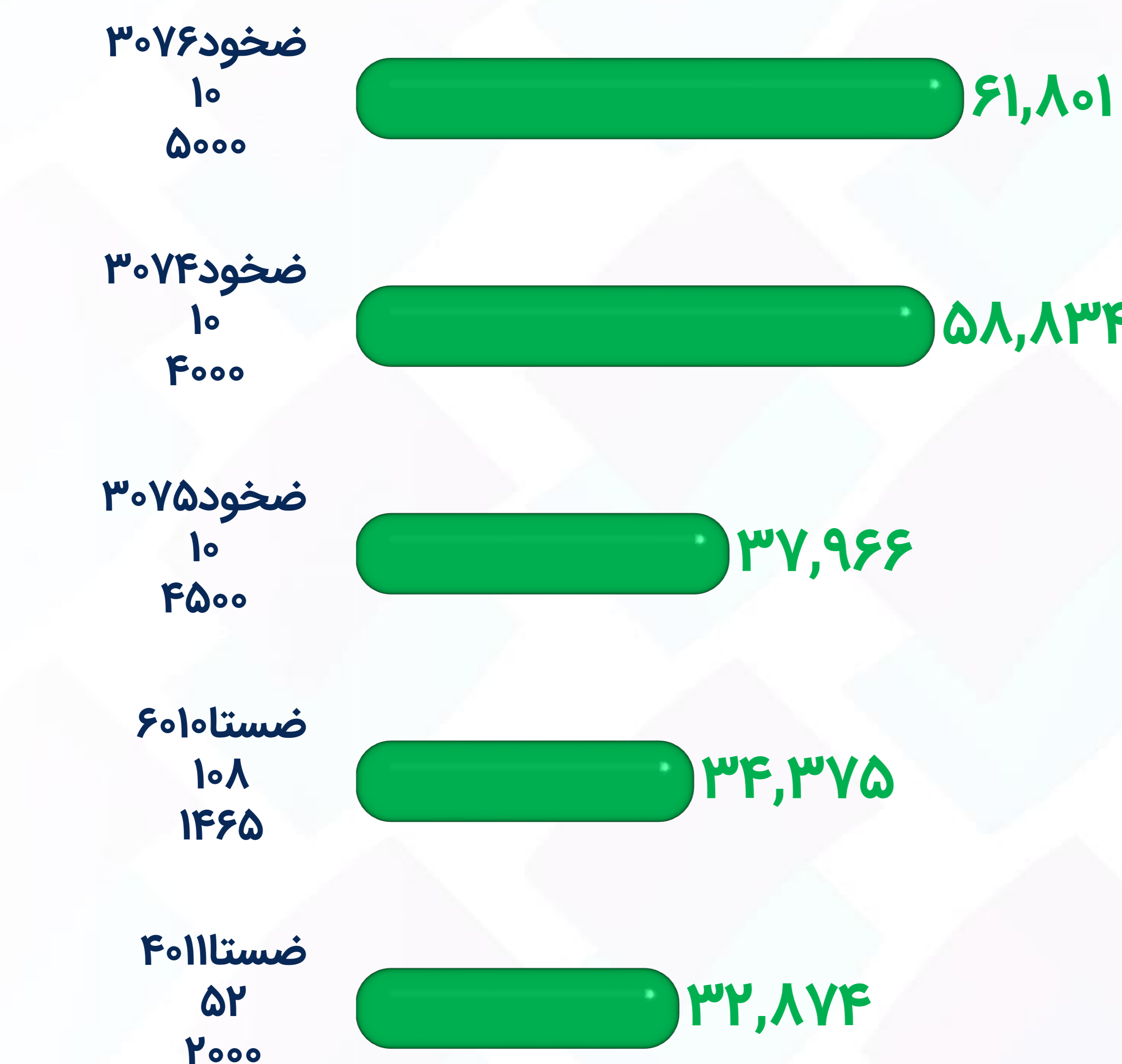
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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	۷۷.۶	(۳۸%)	۸۵۴	۱,۳۷۳	۱۱	۵۳۵.۶	۱۰۹	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۹۵%)	۰	-۰.۰۱	۱۰۶.۲	(۳۰%)	۹۵۶	۱,۳۷۳	۹	۴.۴	۱۰۹	۹۶۵	طستا ۶۰۰۵
(۹۳%)	۲	-۰.۰۲	۳۳.۴	(۲۵%)	۱,۰۳۴	۱,۳۷۳	۳۱	۲,۰۴۵.۷	۱۰۹	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶
(۴۹%)	۴۷	-۰.۲۸	۱۳.۸	(۷%)	۱,۲۷۳	۱,۳۷۳	۹۲	۵.۵	۱۰۹	۱,۳۶۵	طستا ۶۰۰۹
(۳۵%)	۸۶	-۰.۴۳	۱۰.۰	(۳%)	۱,۳۳۲	۱,۳۷۳	۱۳۳	۶,۴۵۳.۵	۱۰۹	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰

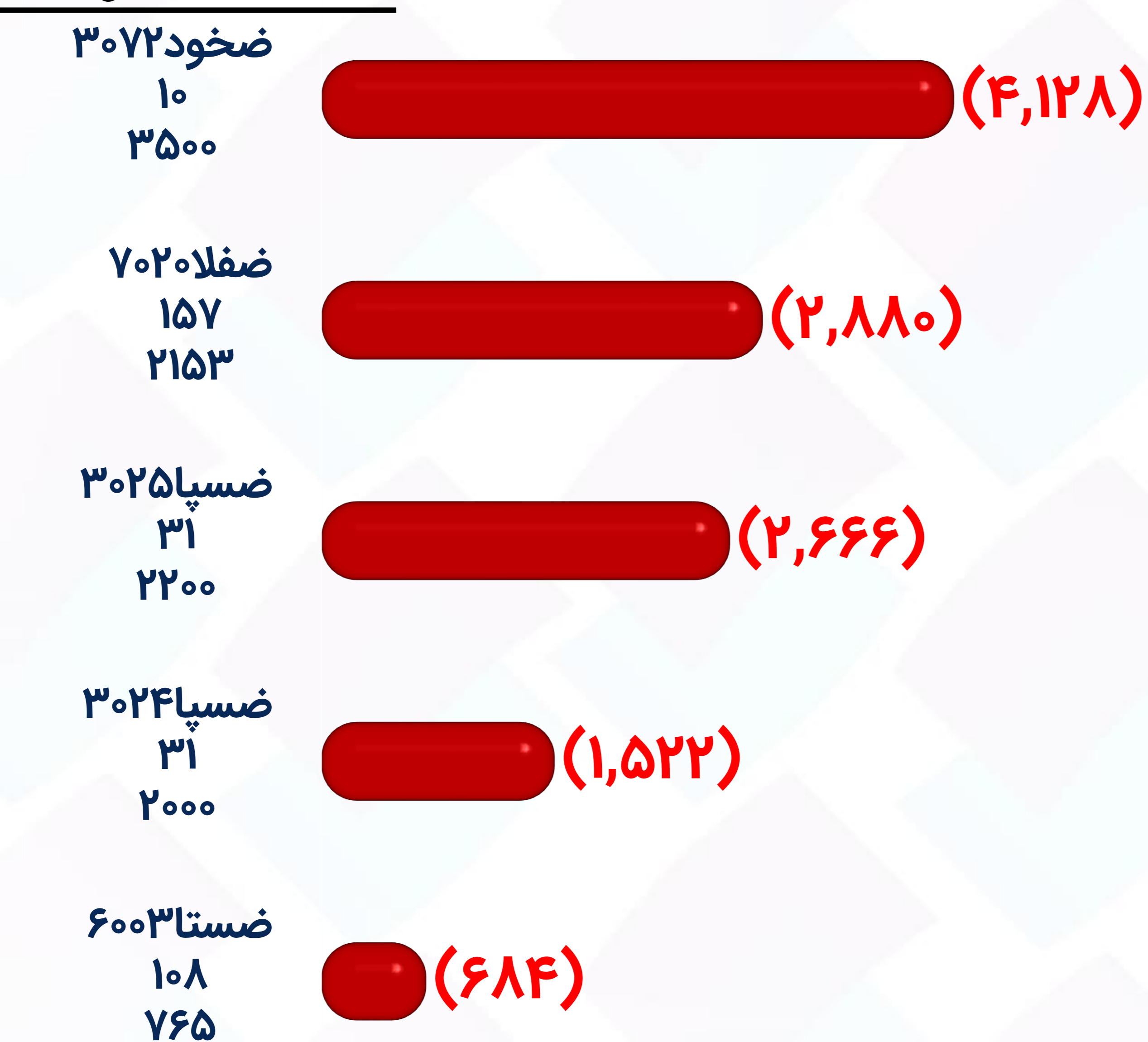
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

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



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - 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 (۱)

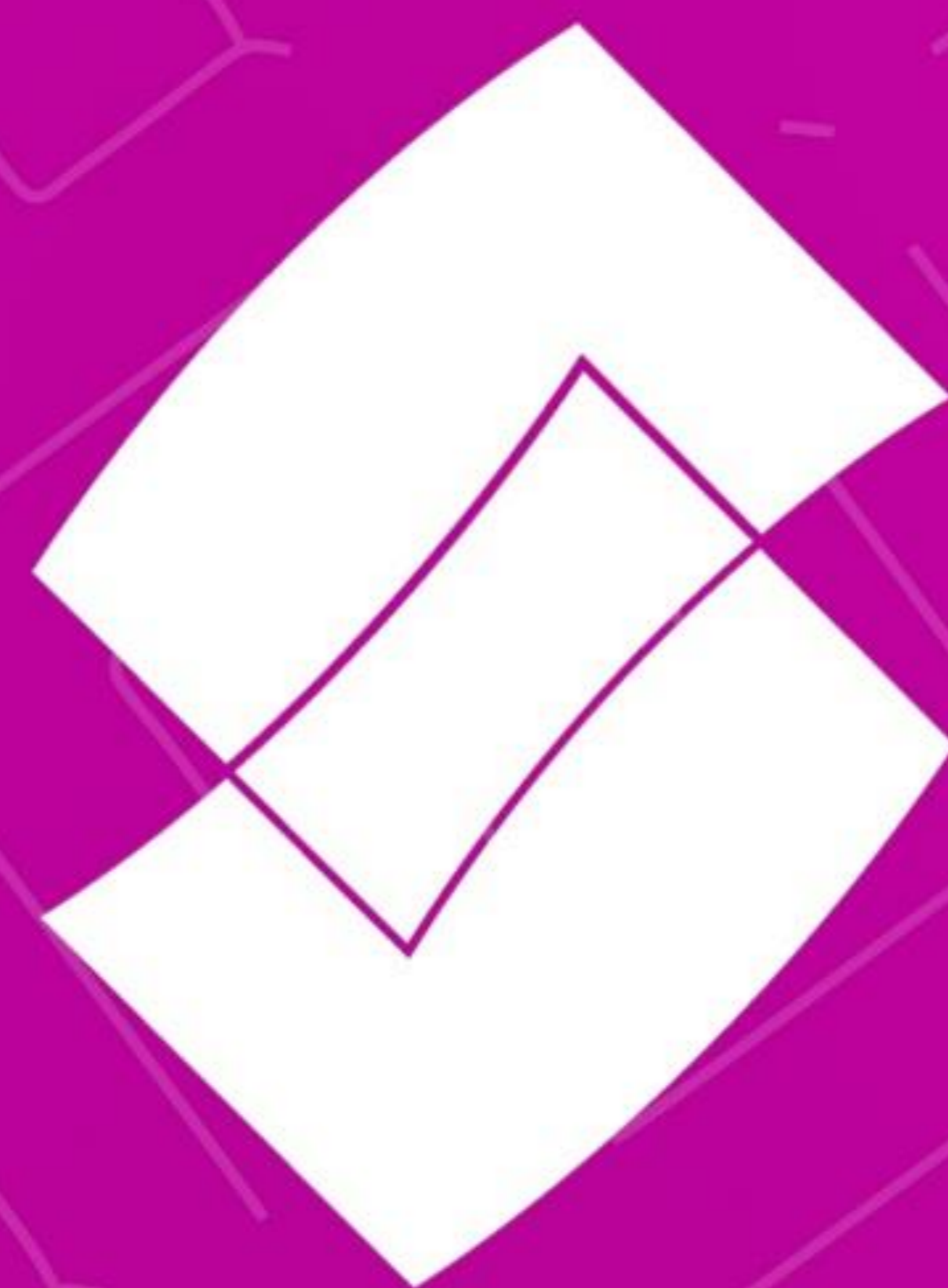
اختیار خرید



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.