

شماره

۰۹

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۲۷ اردیبهشت ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

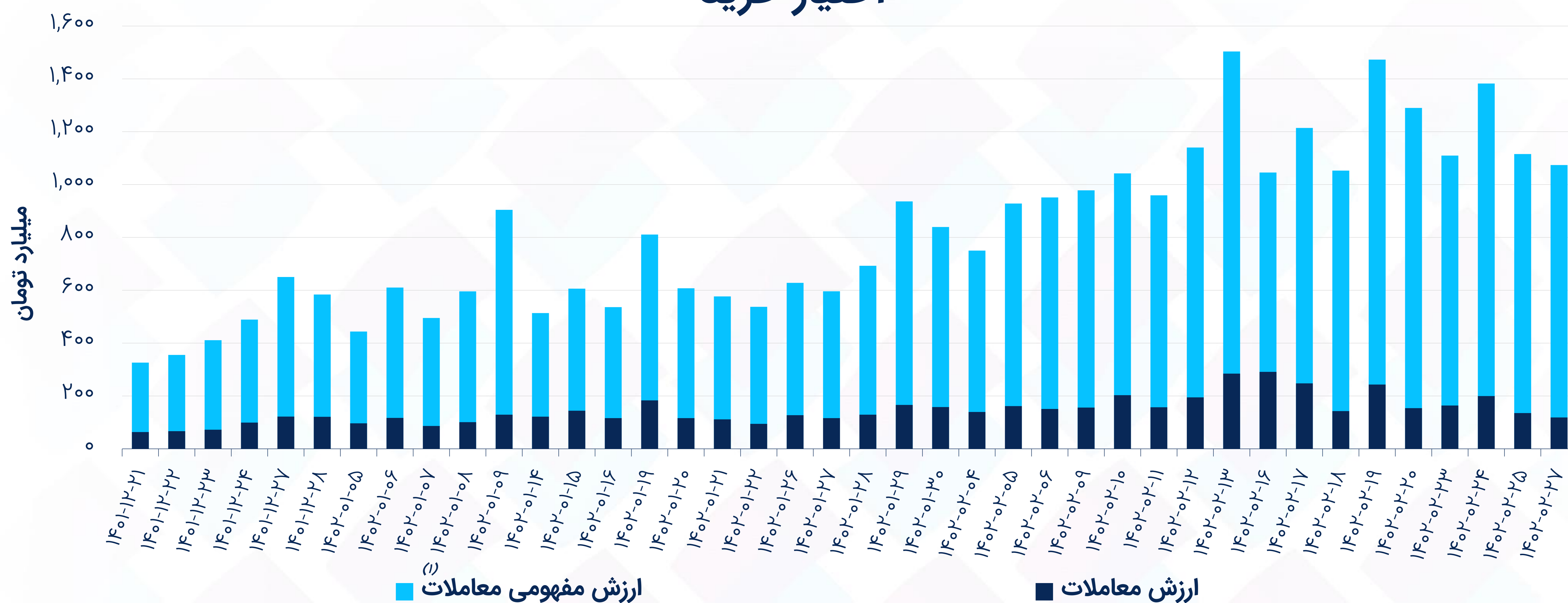




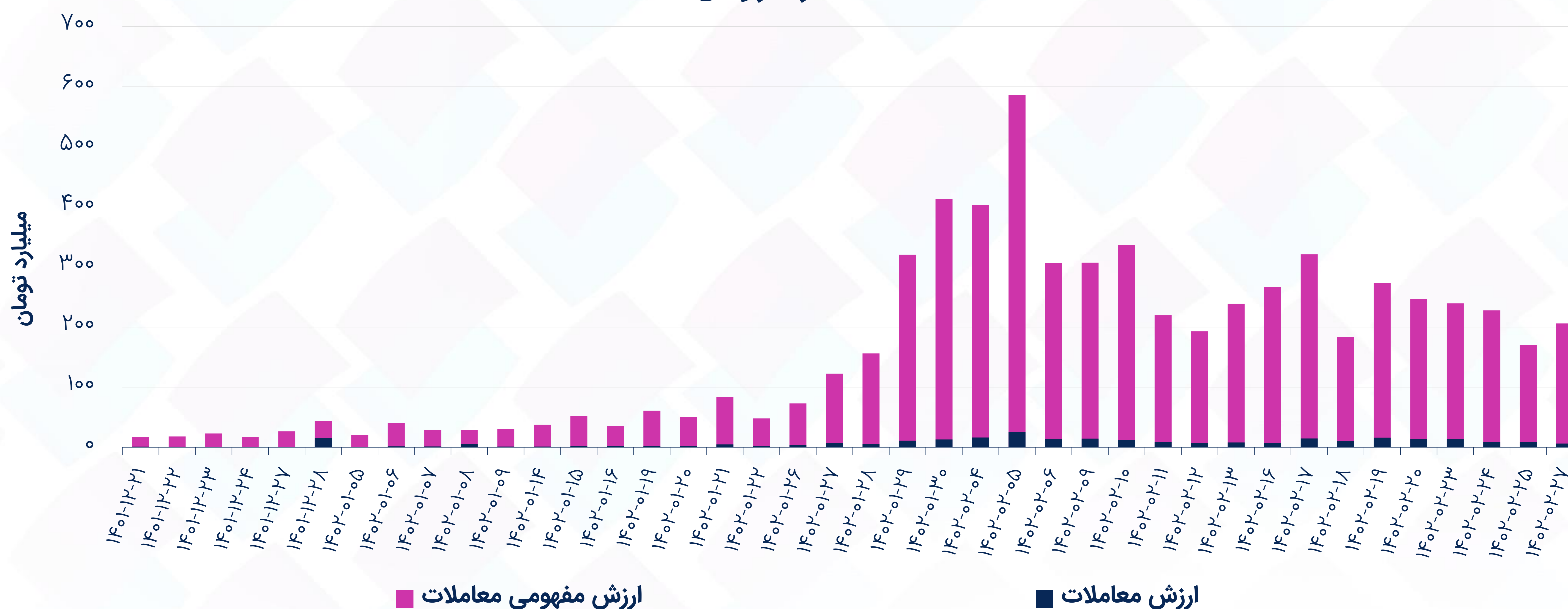
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



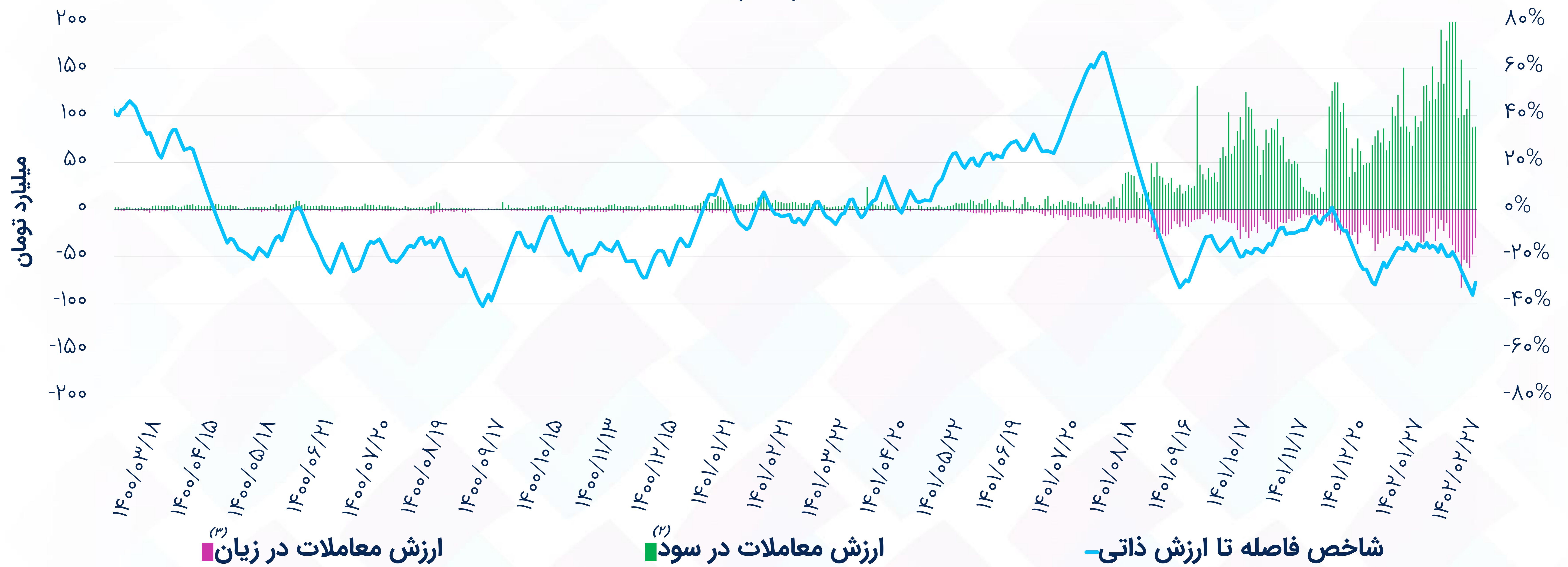
اختیار فروش



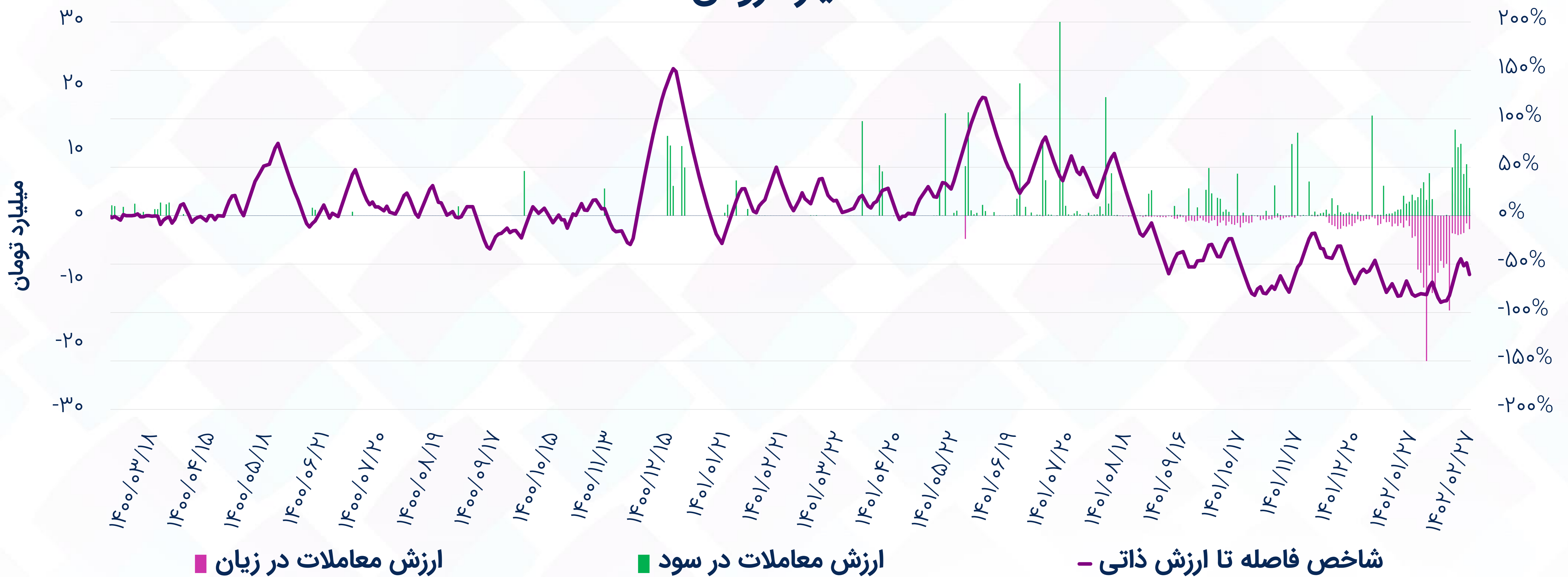
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

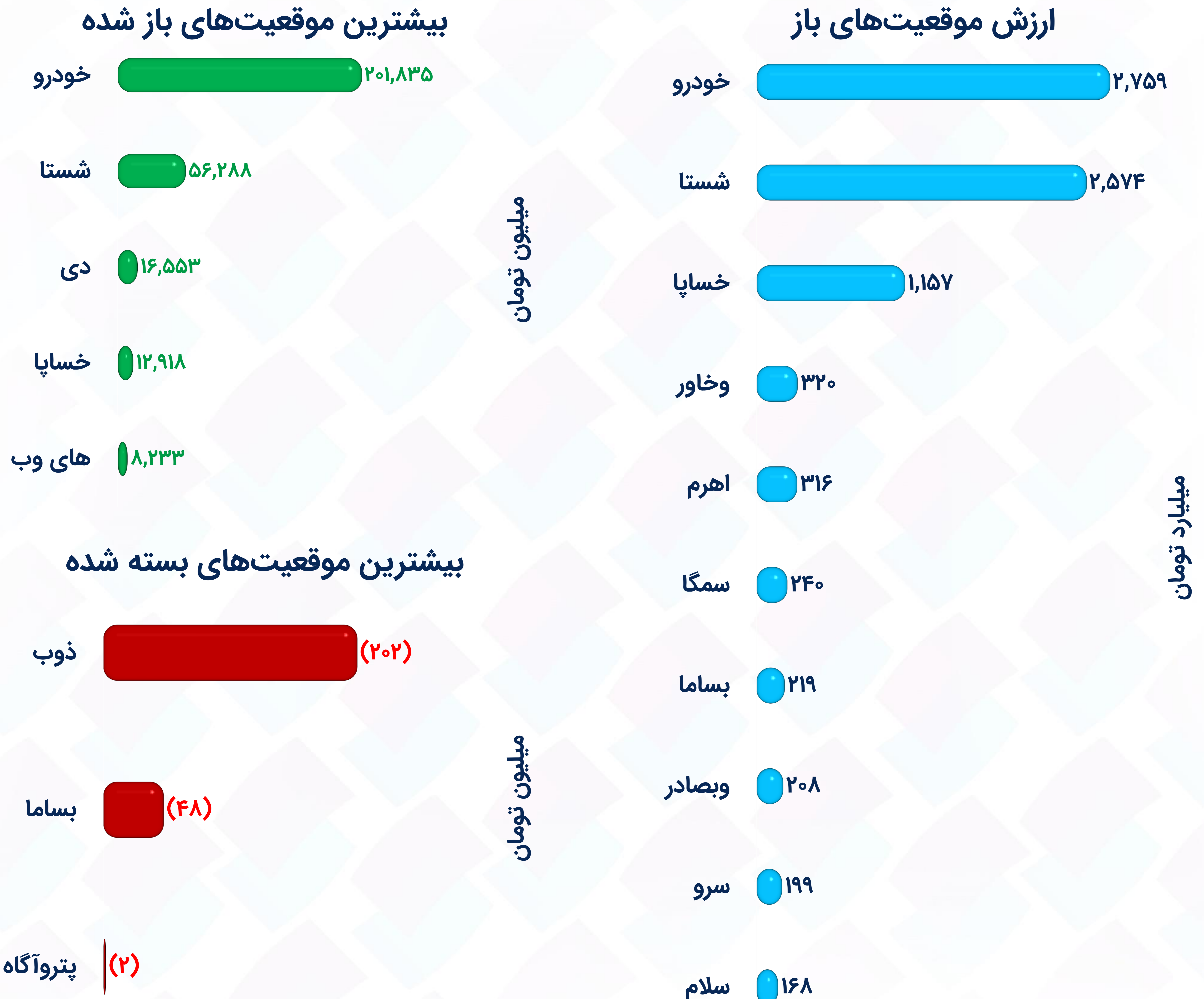
اختیار خرید

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
خودرو	۳۸	۳۴.۲	۶۷۹.۷	۲۶.۹	۷.۳	(۲۹%)
شستا	۳۹	۲۳.۱	۱۶۶.۶	۶.۴	۱۶.۷	(۵۵%)
دی	۱۶	۲۲.۴	۴۵.۰	۲۱.۹	۰.۶	(۲۷%)
خسپا	۲۴	۲۰.۰	۹۴.۹	۱۶.۵	۳.۵	(۲۸%)
وبملت	۱۱	۳.۱	۹.۶	۳.۱	۰.۰	(۸%)
وبصادر	۱۶	۲.۷	۱۹.۲	۲.۳	۰.۴	(۲۲%)
وتجارت	۹	۲.۷	۷.۲	۲.۱	۰.۶	(۲۰%)

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	۶,۳۳۲.۶	۲۰۵,۰۱۵.۷	۴,۲۶۵.۳	۲,۰۶۷.۴	(۶۱%)
توسن	۱	۲۱.۷	۱۰۷.۲	۲۱.۷	۰.۰	(۱۰%)
های وب	۳	۲۰.۷	۱,۰۴۷.۱	۳.۰	۱۷.۸	(۱۵%)
حسیر	۱	۱.۶	۳.۴	۰.۰	۱.۶	(۹۵%)
شتران	۳	۱.۳	۷.۲	۱.۳	۰.۰	(۱۶%)
شپنا	۴	۰.۹	۴.۸	۰.۹	۰.۰	(۲۱%)
شبندر	۱	۰.۵	۱.۴	۰.۵	۰.۰	(۳۳%)

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

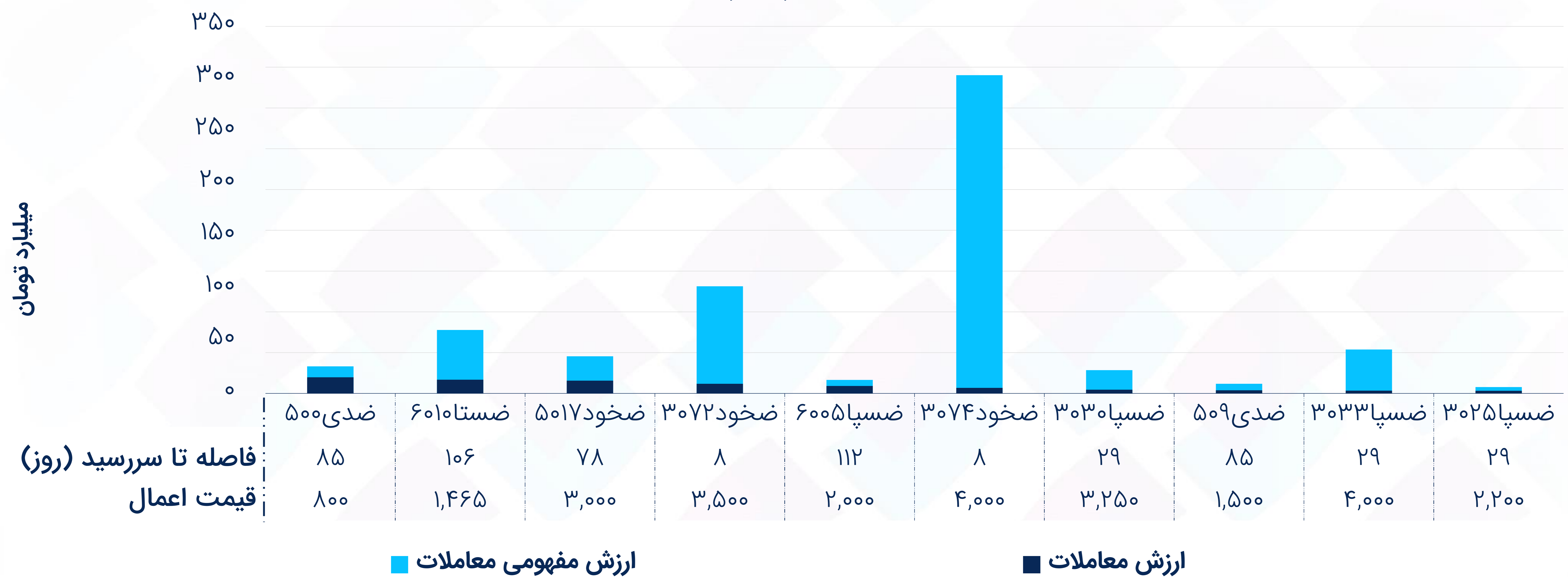


میلیون تومان

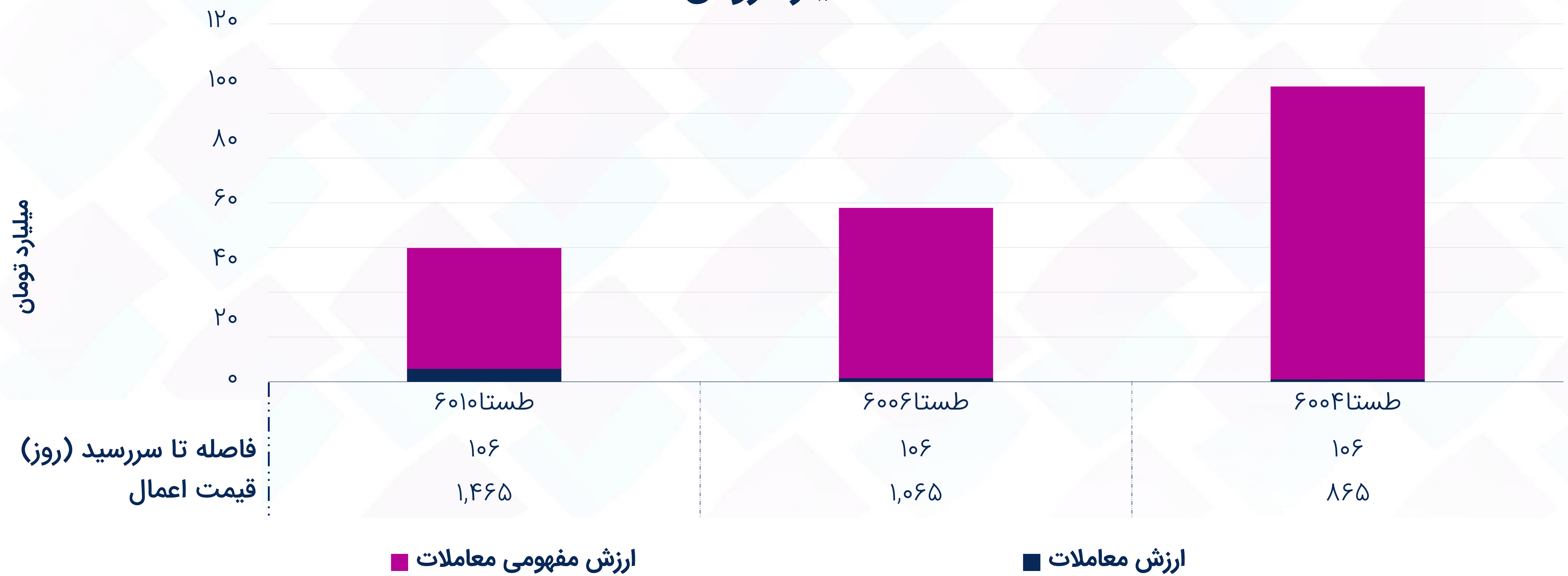


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۸%	۲,۱۰۳	۱.۰۰	۱.۸	(۱.۱%)	۳,۴۵۰	۳,۴۸۷	۱,۹۵۰	۱,۰۸۶.۹	۱۱۲	۱,۵۰۰	خسپا ۶۰۰
۴%	۹۷۴	۱.۰۰	۳.۱	(۰.۱%)	۲,۹۴۰	۲,۹۴۳	۹۴۰	۳۷.۳	۲۲	۲,۰۰۰	ضصاد ۳۰۲۶
۴%	۱,۲۴۲	۱.۰۰	۲.۵	(۱.۰%)	۳,۰۴۴	۳,۰۷۶	۱,۱۹۹	۱۳۰.۱	۸	۱,۸۴۵	ضهای ۳۰۰۰
۳%	۱,۰۷۳	۱.۰۰	۲.۸	(۰.۲%)	۲,۹۳۷	۲,۹۴۳	۱,۰۳۷	۱۸۸.۳	۲۲	۱,۹۰۰	ضصاد ۳۰۲۵
۳%	۱,۶۶۳	۱.۰۰	۱.۸	(۱.۱%)	۲,۹۱۰	۲,۹۴۳	۱,۶۱۰	۱۶.۱	۲۲	۱,۳۰۰	ضصاد ۳۰۱۹

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	۵,۰۰۱.۰	۳۳%	۵,۰۰۱	۳,۷۵۷	۱	۳۳.۲	۸	۵,۰۰۰	ضخود ۳۰۷۶
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۱۳.۵	۳۰%	۱,۸۱۶	۱,۴۰۱	۱۶	۱۷۳.۶	۲۲	۱,۸۰۰	ضستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴۲.۷	۴۶%	۲,۰۴۸	۱,۴۰۱	۴۸	۲,۱۹۵.۶	۵۰	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۹۹%)	۰	۰.۰۱	۱۴۲.۹	۲۱%	۳,۷۱۶	۳,۰۷۶	۲۶	۱۹.۳	۸	۳,۶۹۰	ضهای ۳۰۰۹
(۹۸%)	۳	۰.۰۱	۴۸.۸	۴۹%	۵,۶۱۵	۳,۷۵۷	۱۱۵	۶۴۰.۶	۴۳	۵,۵۰۰	ضخود ۴۰۳۴

(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

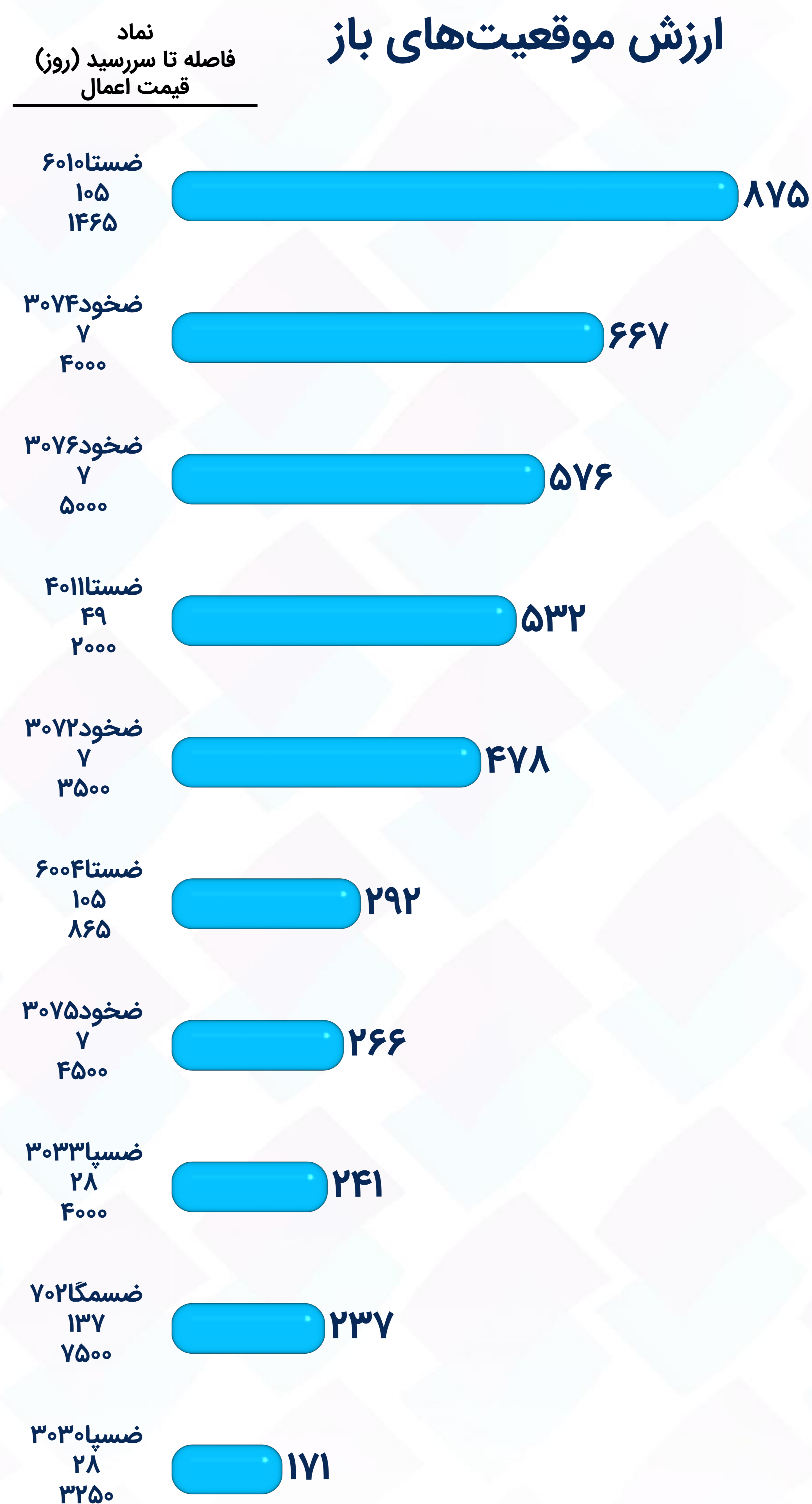
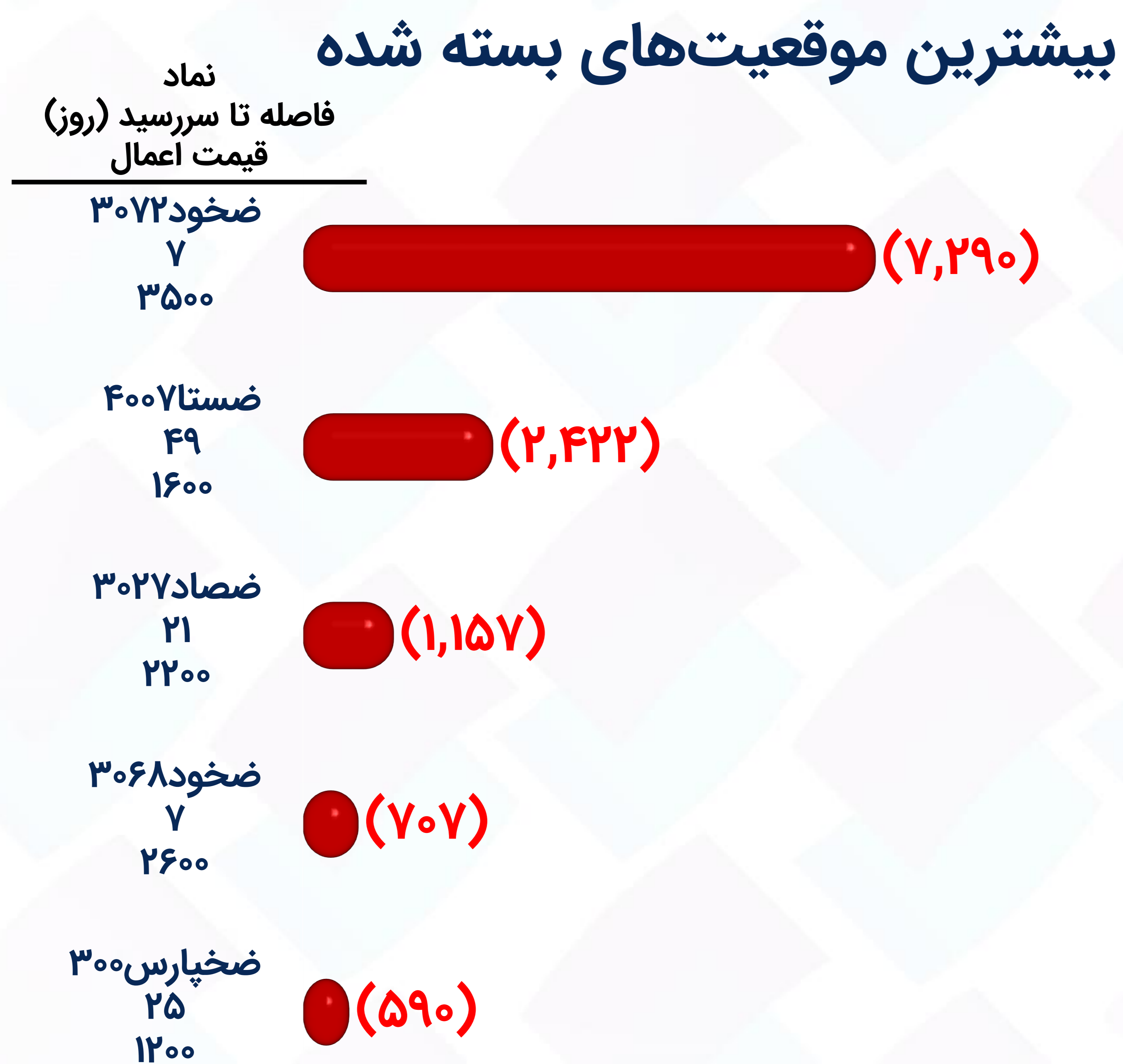
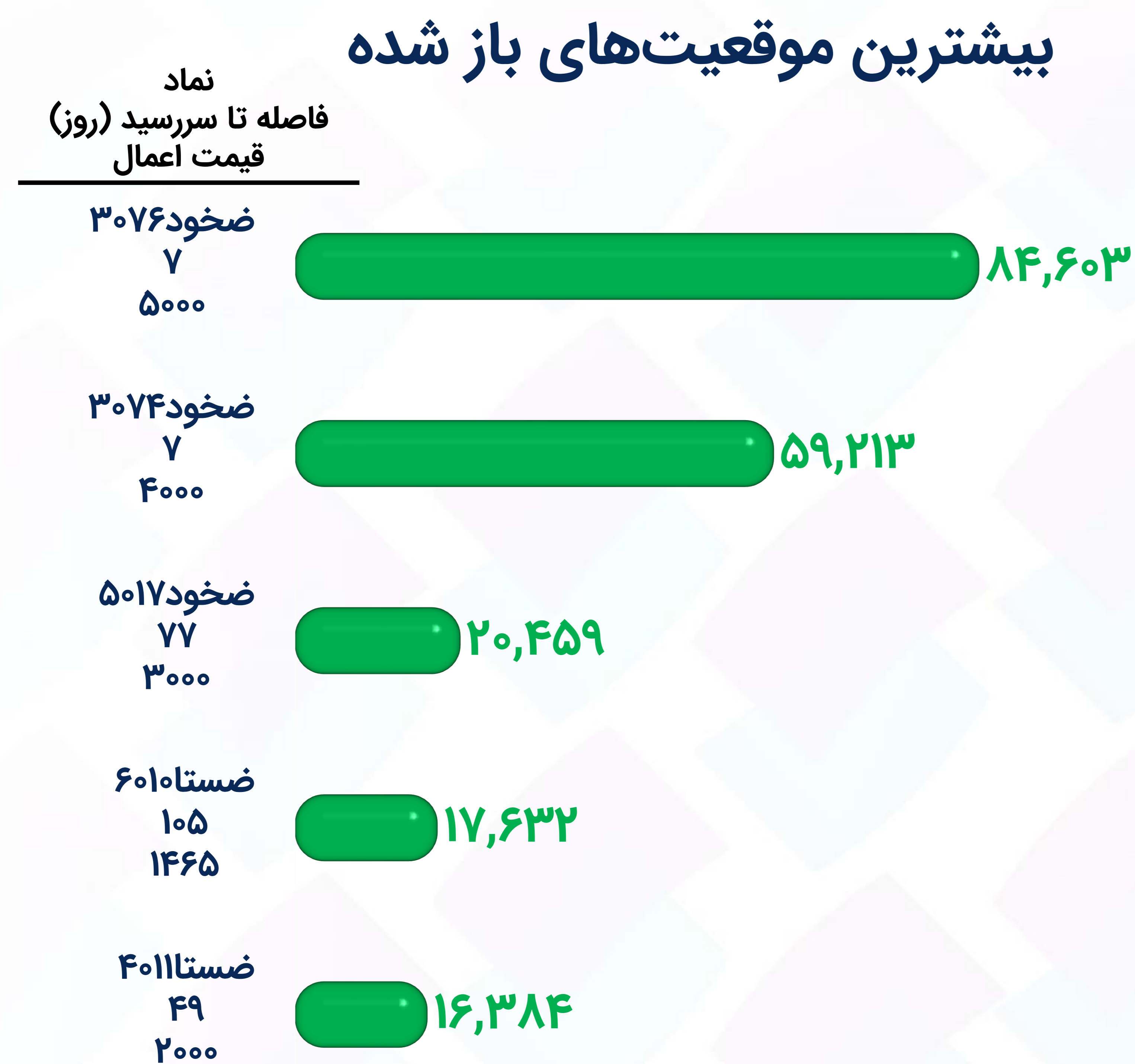
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۶%)	۵۹۳	-۰.۹۹	۴.۹	(۱%)	۳,۰۶۰	۳,۰۷۶	۶۳۰	۲.۹	۸	۳,۶۹۰	طهای ۳۰۰۹ های وب
(۱۰%)	۳,۴۹۸	-۰.۷۶	۵.۴	۸%	۲۰,۷۲۶	۱۹,۱۴۰	۳,۸۷۴	۲۱.۷	۱۴۵	۲۴,۶۰۰	طوسن ۷۰۹ توسن
(۱۷%)	۴۴	-۰.۳۱	۵۵.۶	(۴%)	۲,۹۴۵	۳,۰۷۶	۵۳	۱۷.۸	۸	۲,۹۹۸	طهای ۳۰۰۶ های وب
(۴۴%)	۷۵	-۰.۳۹	۱۰.۰	(۵%)	۱,۳۳۲	۱,۴۰۱	۱۳۳	۴,۲۶۵.۳	۱۰۶	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱ شستا

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	(۳۹%)	۸۵۴	۱,۴۰۱	۱۱	۷۷۷.۳	۱۰۶	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴ شستا
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۴۷.۳	(۳۳%)	۹۴۵	۱,۴۰۱	۲۰	۳۸.۸	۱۰۶	۹۶۵	طستا ۶۰۰۵ شستا
(۹۵%)	۳۹۶	-۰.۱۳	۰.۸	(۶۵%)	۶,۰۲۲	۱۷,۲۰۰	۷,۹۷۸	۱.۶	۱۲۵	۱۴,۰۰۰	طحسیر ۶۰۹ حسیر
(۹۵%)	۲	-۰.۰۲	۳۴.۵	(۲۶%)	۱,۰۳۵	۱,۴۰۱	۳۰	۱,۲۴۹.۴	۱۰۶	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶ شستا
(۸۶%)	۱۷	-۰.۱۳	۹.۶	(۱۸%)	۱,۱۴۶	۱,۴۰۱	۱۱۹	۱.۲	۱۰۶	۱,۲۶۵	طستا ۶۰۰۸ شستا

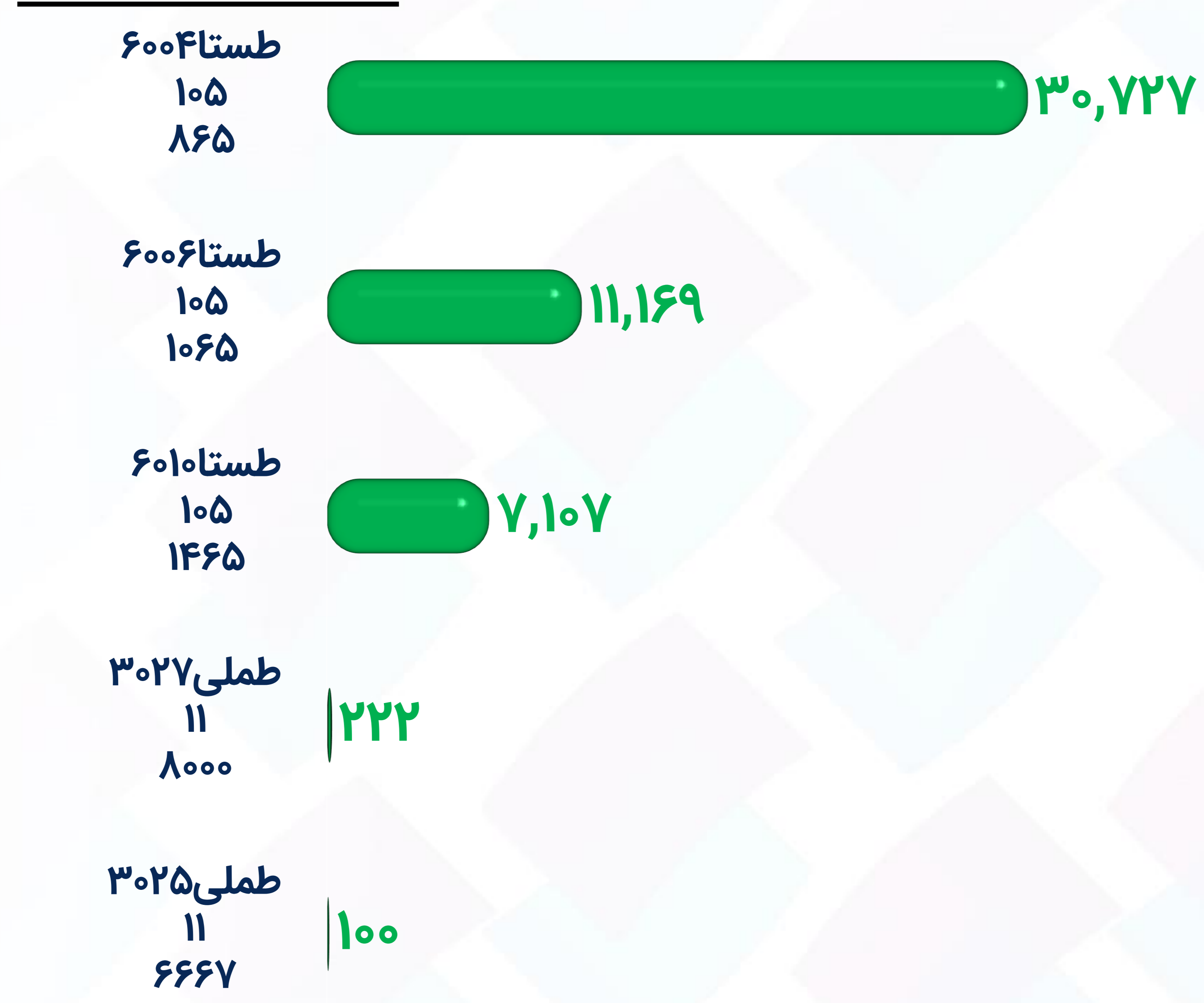
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

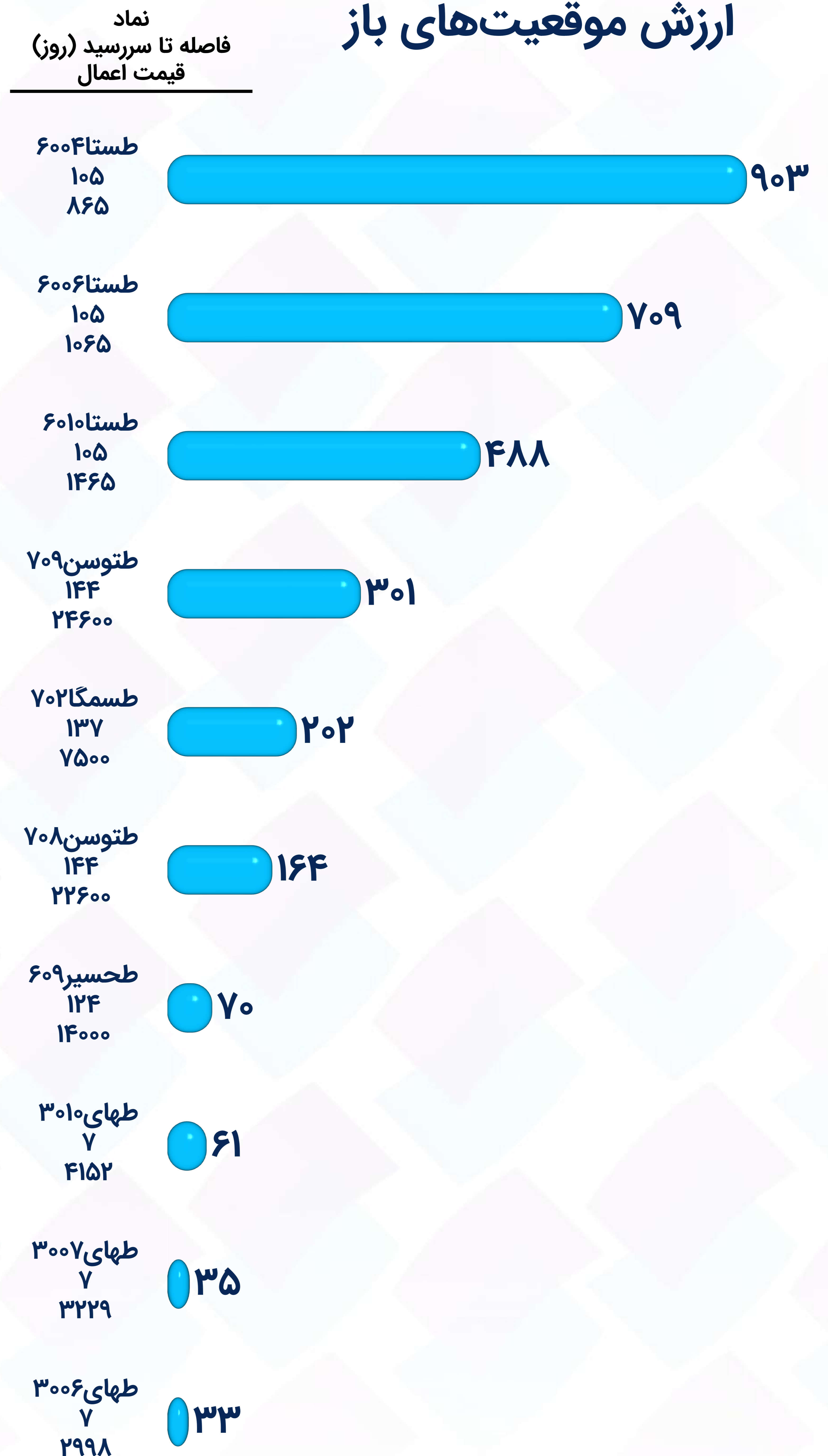
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

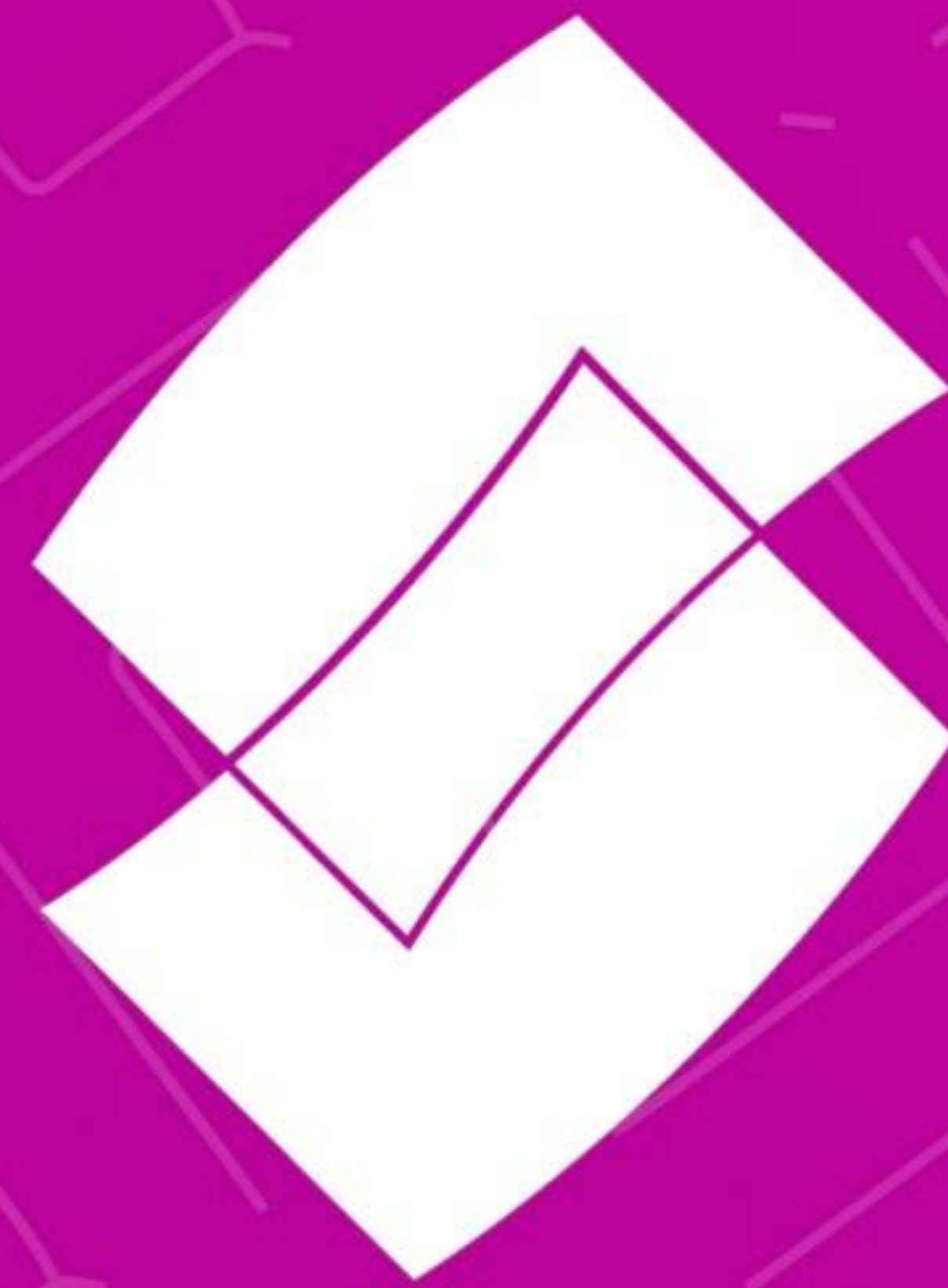
اختیار خرید



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.