

شماره

۱۱

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

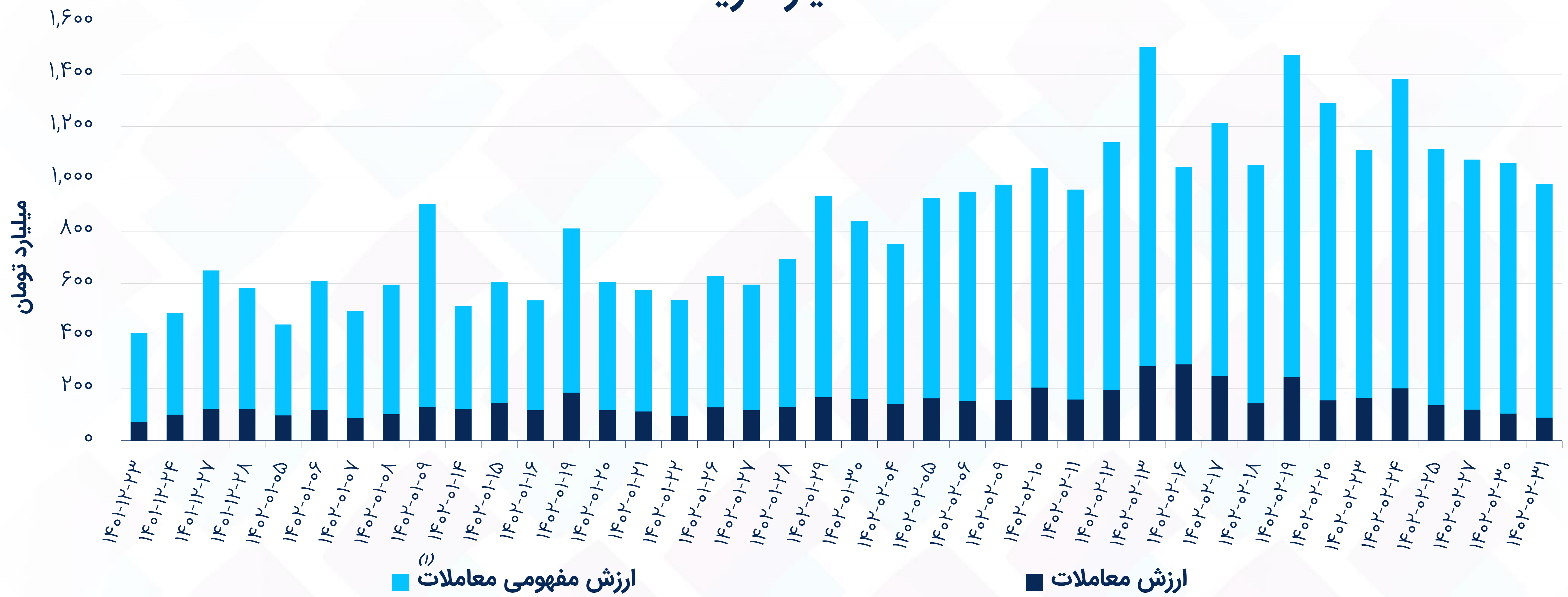




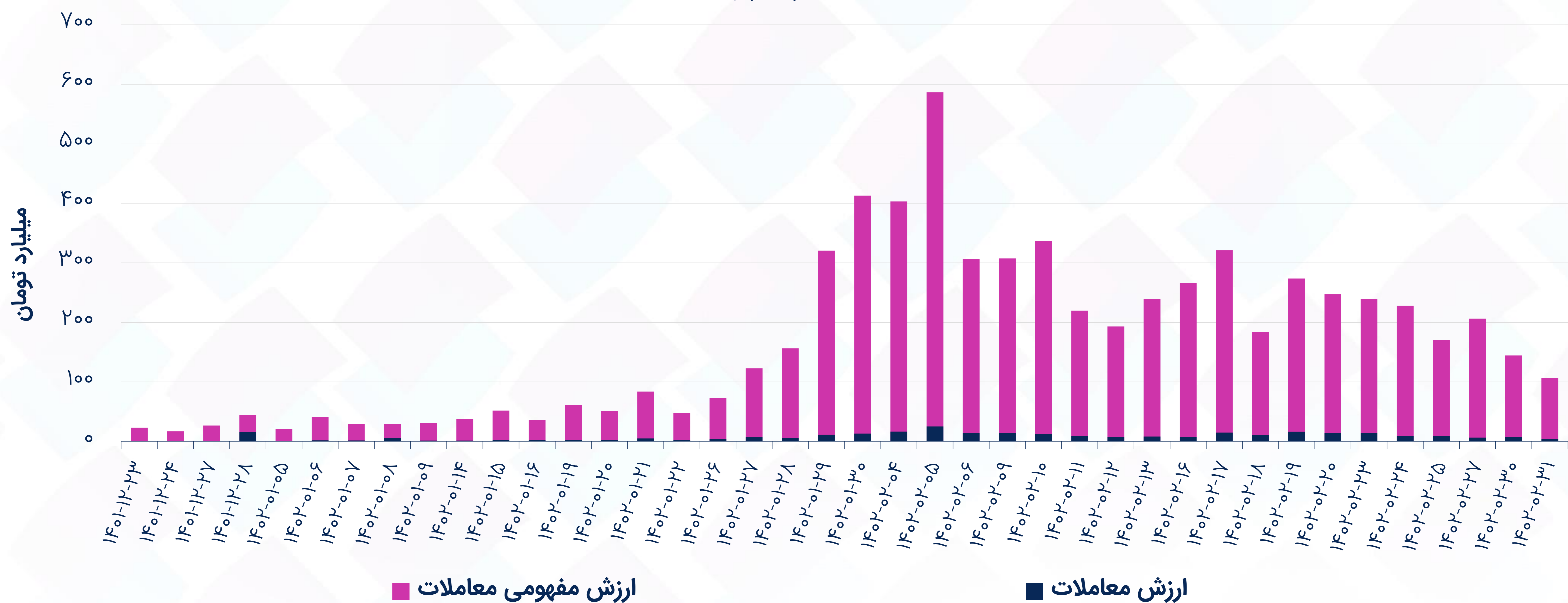
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



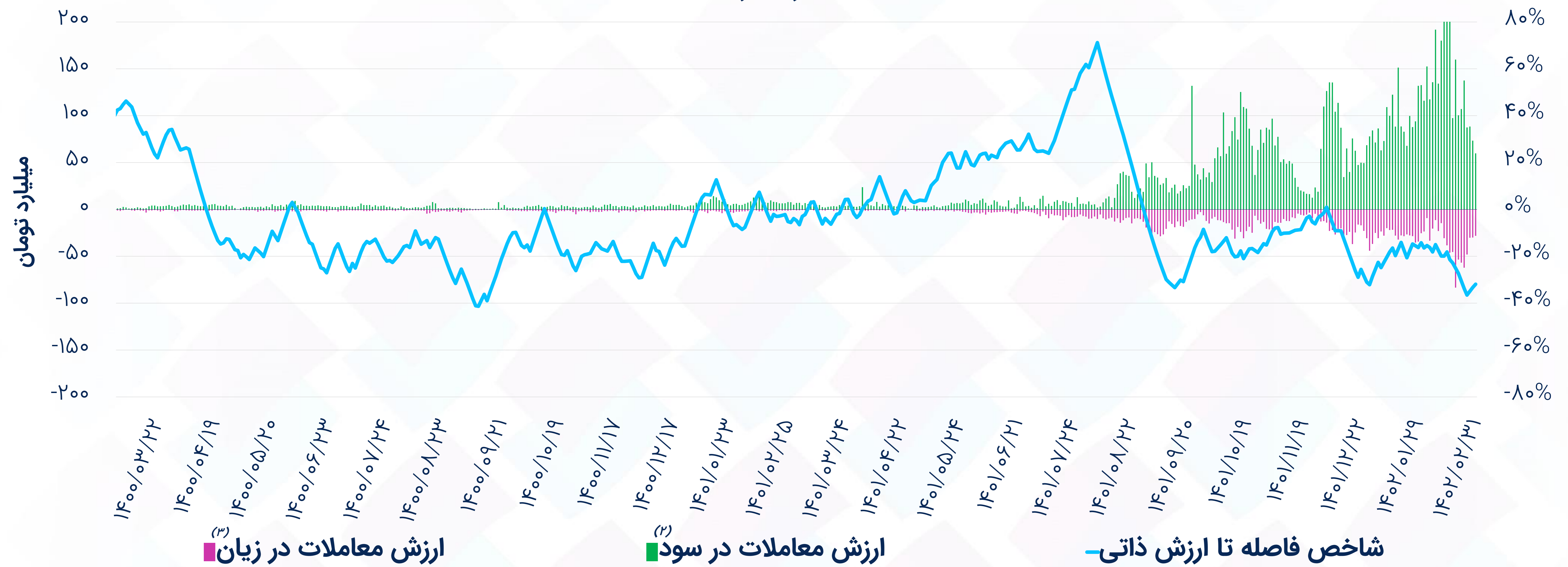
اختیار فروش



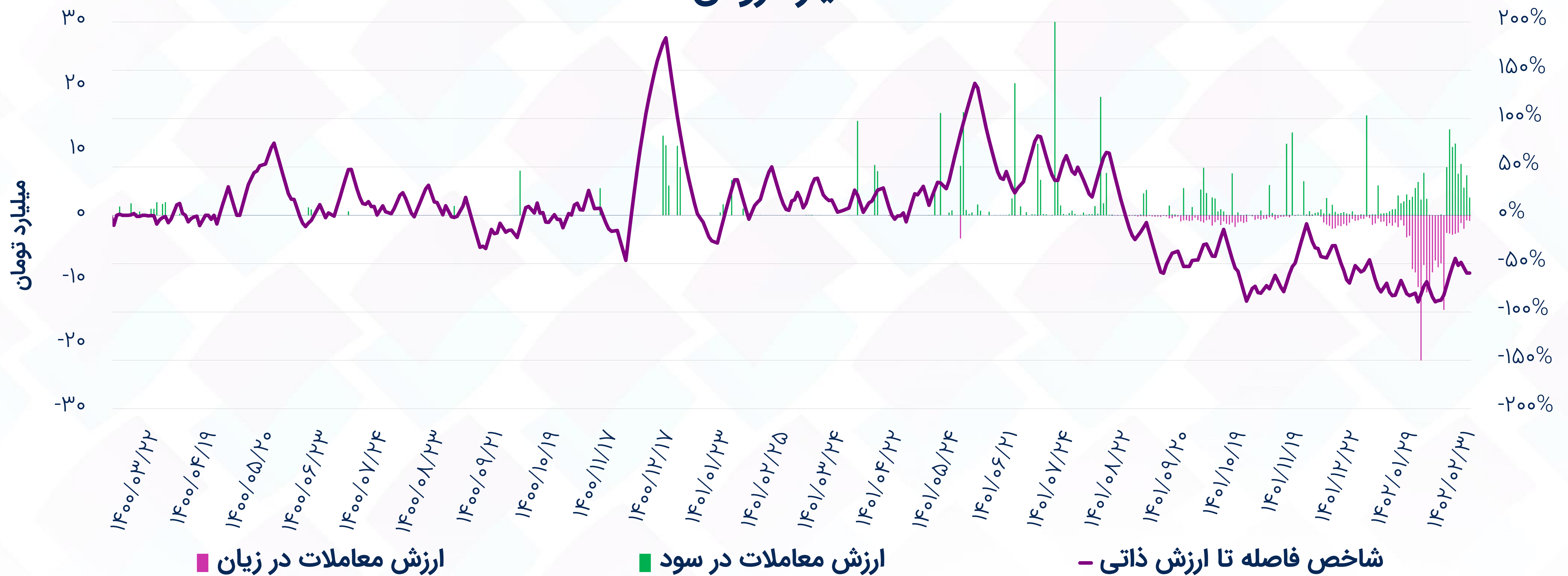
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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 (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

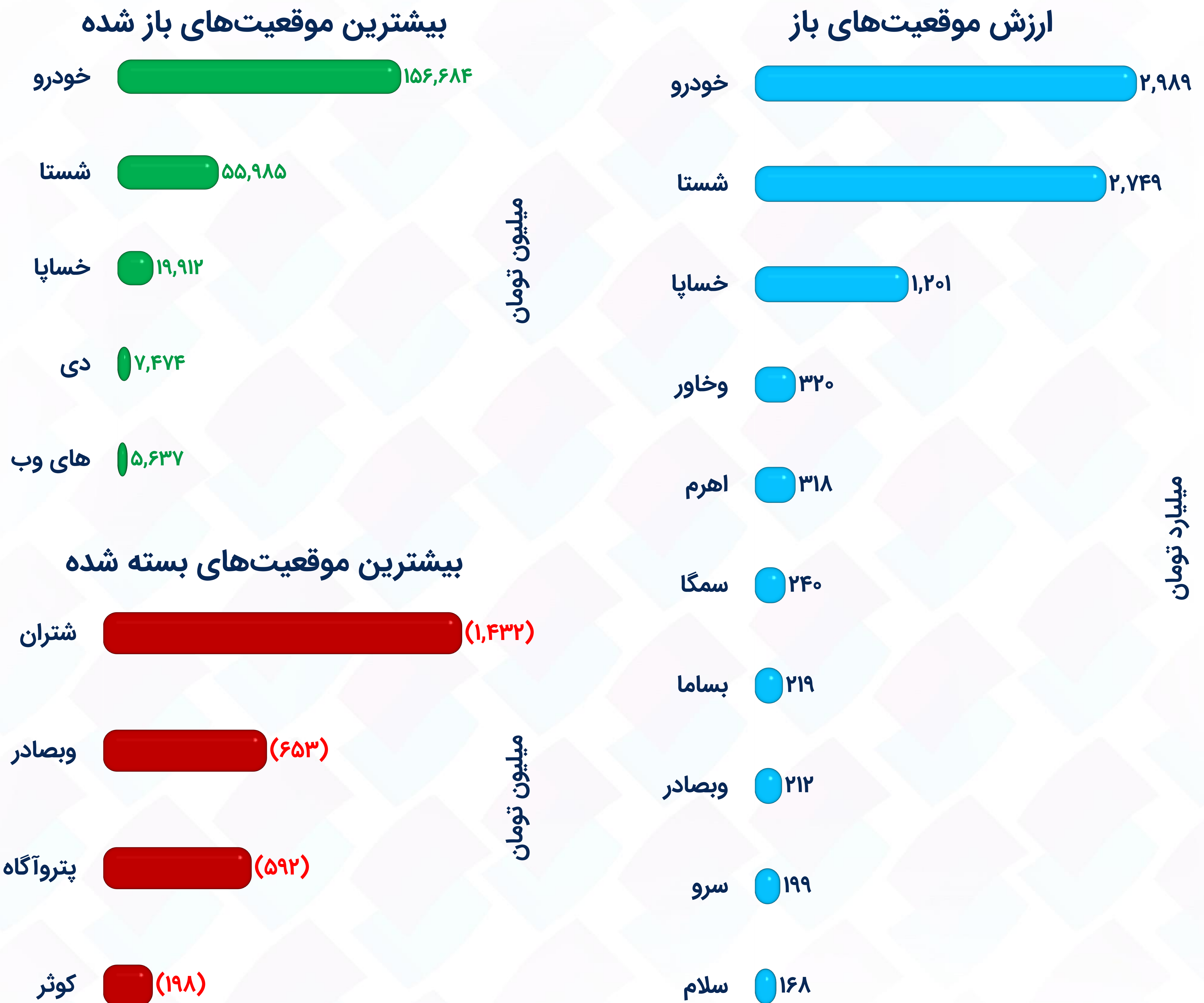
اختیار خرید

| 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 | ۳۵ | ۲۵.۱ | ۱۵۵.۳ | ۵.۶ | ۱۹.۴ | (۵۲.۸%) |
| خودرو | ۳۸ | ۲۱.۱ | ۶۳۵.۸ | ۱۷.۱ | ۴.۰ | (۲۸.۳%) |
| خسپا | ۲۷ | ۱۴.۲ | ۷۶.۱ | ۱۱.۹ | ۲.۳ | (۳۰.۲%) |
| دی | ۱۴ | ۹.۳ | ۱۹.۴ | ۹.۱ | ۰.۲ | (۲۰.۷%) |
| وتجارت | ۱۰ | ۵.۰ | ۱۵.۷ | ۳.۸ | ۱.۲ | (۲۲.۲%) |
| وبملت | ۱۴ | ۳.۰ | ۹.۰ | ۳.۰ | ۰.۰ | ۰.۱% |
| اهرم | ۱۹ | ۱.۷ | ۳.۶ | ۱.۶ | ۰.۱ | (۲۴.۳%) |

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 | ۵ | ۳,۵۷۷.۸ | ۱۰۴,۷۴۸.۱ | ۲,۷۲۴.۲ | ۸۵۳.۵ | (۵۹.۳%) |
| فولاد | ۳ | ۲۱.۸ | ۴۵۳.۱ | ۲۱.۸ | ۰.۰ | (۷.۲%) |
| های وب | ۲ | ۱۵.۲ | ۱,۴۸۵.۹ | ۰.۰ | ۱۵.۲ | (۱.۴%) |
| شبندر | ۱ | ۱.۶ | ۲۲.۳ | ۱.۶ | ۰.۰ | (۳۲.۰%) |
| شتران | ۴ | ۱.۶ | ۱۲.۵ | ۱.۶ | ۰.۰ | (۹.۹%) |
| شپنا | ۴ | ۱.۴ | ۸.۶ | ۱.۴ | ۰.۰ | (۱۴.۵%) |
| وتجارت | ۱ | ۰.۲ | ۱.۱ | ۰.۲ | ۰.۰ | (۱۸.۲%) |

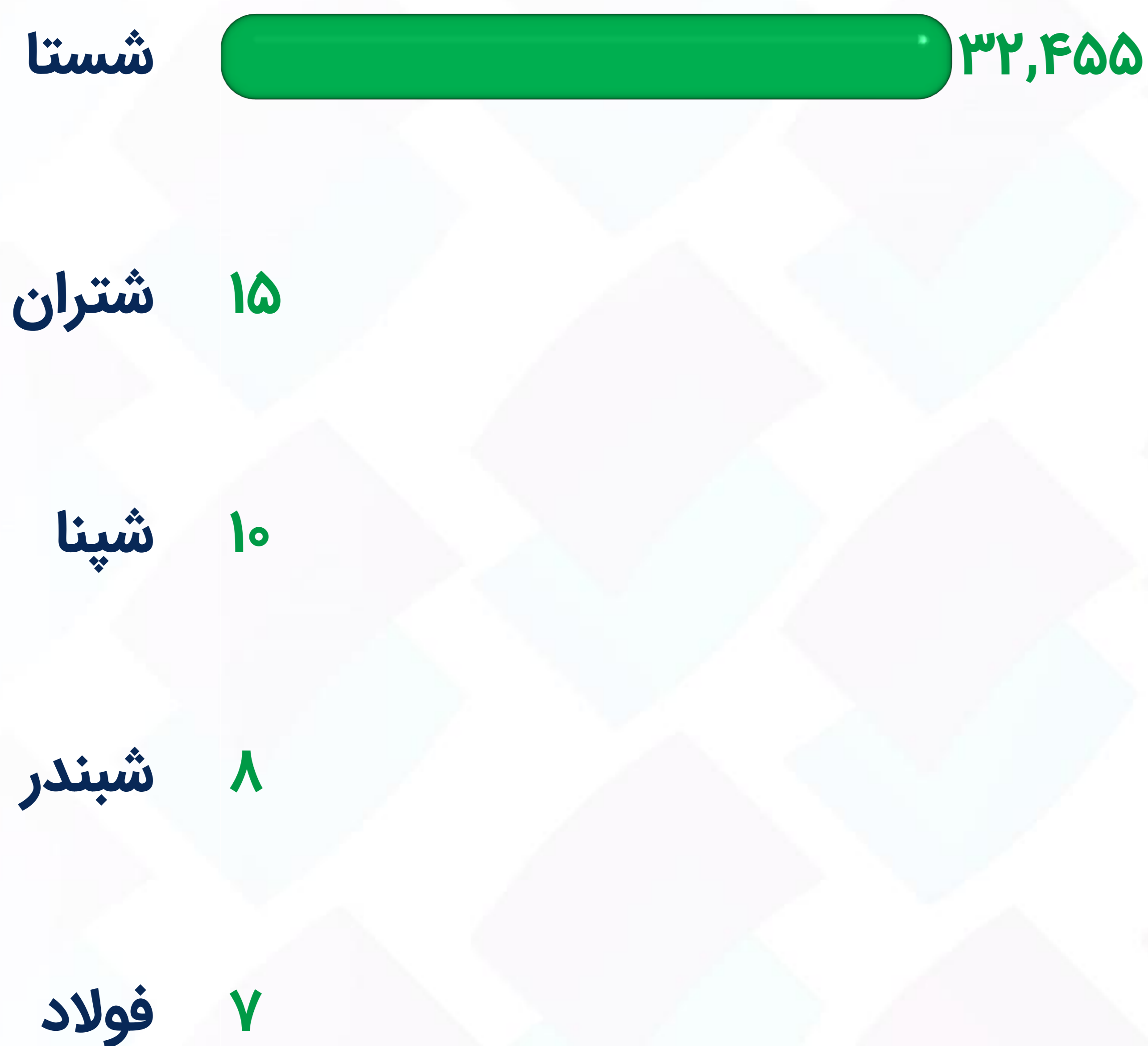
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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



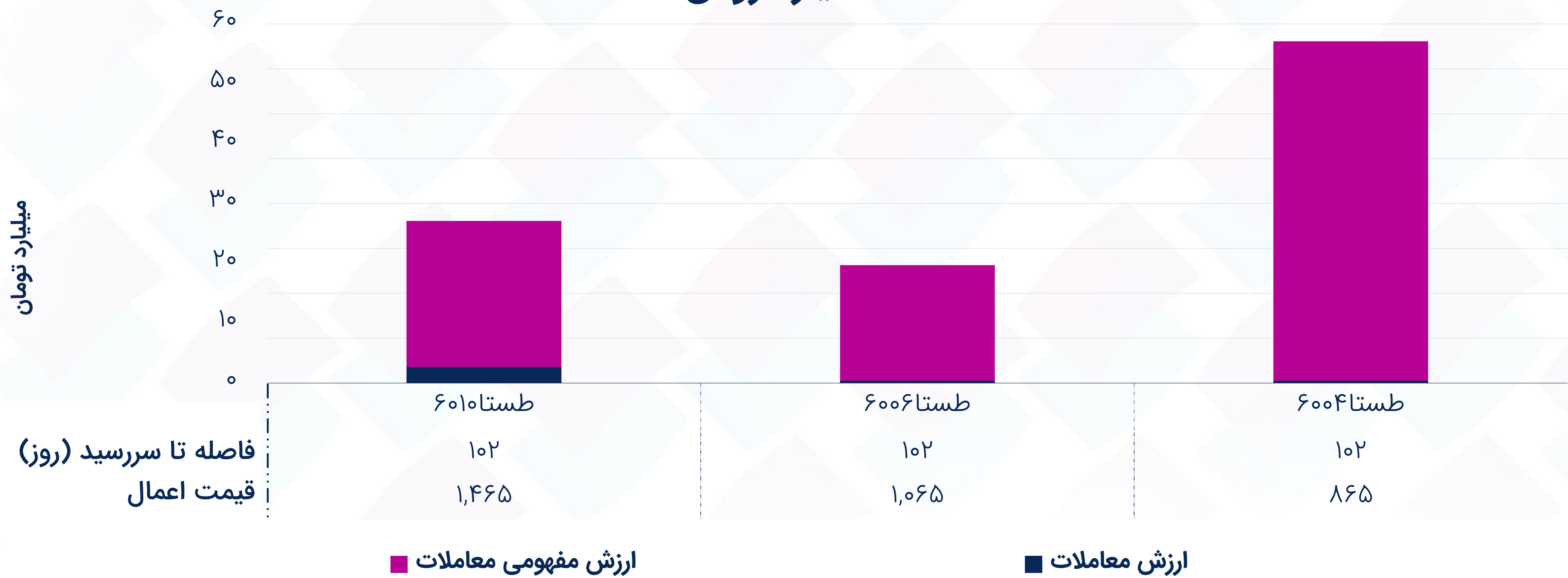
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش 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 |
|--------------------|---------------------|------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|-----------------|
| ۳۷% | ۱,۸۹۵ | ۱.۰۰ | ۳.۵ | (۸.۶%) | ۴,۸۸۸ | ۵,۳۵۰ | ۱,۳۸۸ | ۰.۷ | ۱۸ | ۳,۵۰۰ | ضخا و خاور ۳۰۰۴ |
| ۳۶% | ۱,۳۶۳ | ۰.۹۵ | ۱۳.۰ | (۱.۹%) | ۱۳,۰۰۰ | ۱۳,۲۵۰ | ۱,۰۰۰ | ۰.۴ | ۱۱ | ۱۲,۰۰۰ | ضیسا ما ۳۰۵ |
| ۳۲% | ۲۱۳ | ۰.۸۷ | ۱۲.۱ | (۰.۵%) | ۱,۹۶۲ | ۱,۹۷۱ | ۱۶۲ | ۰.۱ | ۲۲ | ۱,۸۰۰ | ضخپارس ۳۰۶ |
| ۲۲% | ۲,۸۷۲ | ۰.۶۴ | ۱۰.۴ | ۱۲.۲% | ۲۴,۳۵۱ | ۲۱,۷۱۰ | ۲,۳۵۱ | ۰.۲ | ۱۰۲ | ۲۲,۰۰۰ | ضبرک ۶۰۰۴ |
| ۲۰% | ۱,۴۰۱ | ۱.۰۰ | ۴.۴ | (۳.۳%) | ۵,۱۷۲ | ۵,۳۵۰ | ۱,۱۷۲ | ۴۰۳.۲ | ۱۸ | ۴,۰۰۰ | ضخا و خاور 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 | ۵,۰۰۱.۰ | ۳۶% | ۵,۰۰۱ | ۳,۶۶۴ | ۱ | ۰.۳ | ۴ | ۵,۰۰۰ | ضخود ۳۰۷۶ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۴,۱۵۳.۰ | ۳۶% | ۴,۱۵۳ | ۳,۰۴۵ | ۱ | ۴.۴ | ۴ | ۴,۱۵۲ | ضهای ۳۰۱۰ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۴,۵۰۱.۰ | ۲۳% | ۴,۵۰۱ | ۳,۶۶۴ | ۱ | ۲۷.۹ | ۴ | ۴,۵۰۰ | ضخود ۳۰۷۵ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱,۸۴۶.۰ | ۲۱% | ۳,۶۹۲ | ۳,۰۴۵ | ۲ | ۳.۶ | ۴ | ۳,۶۹۰ | ضهای ۳۰۰۹ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱۵۱.۰ | ۲۹% | ۱,۸۱۲ | ۱,۴۰۲ | ۱۲ | ۱۴۸.۳ | ۱۸ | ۱,۸۰۰ | ضستا 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 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 |
|--------------------|---------------------|-------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|------------------|
| (۰.۲%) | ۳۵ | -۰.۳۴ | ۸۴.۷ | (۳%) | ۲,۹۶۳ | ۳,۰۴۵ | ۳۵ | ۱۵.۰ | ۴ | ۲,۹۹۸ | طهای ۳۰۰۶ های وب |
| (۶.۹%) | ۲۸۸ | -۰.۵۰ | ۲۰.۴ | (۲%) | ۶,۳۱۶ | ۶,۴۴۰ | ۳۰۹ | ۲۱.۵ | ۳۲ | ۶,۶۲۵ | طفلا ۳۰۲۵ فولاد |
| (۸.۰%) | ۱,۳۸۱ | -۰.۹۸ | ۴.۰ | ۱% | ۶,۰۰۰ | ۵,۹۷۰ | ۱,۵۰۰ | ۰.۲ | ۲۹ | ۷,۵۰۰ | طترا ۳۰۳۱ شتران |
| (۹.۰%) | ۹۱۰ | -۰.۹۱ | ۶.۰ | ۱% | ۶,۰۰۰ | ۵,۹۷۰ | ۱,۰۰۰ | ۱.۱ | ۲۹ | ۷,۰۰۰ | طترا ۳۰۳۰ شتران |
| (۱۰.۵%) | ۴۹۲ | -۰.۷۲ | ۱۰.۸ | (۰%) | ۵,۹۵۰ | ۵,۹۷۰ | ۵۵۰ | ۰.۲ | ۲۹ | ۶,۵۰۰ | طترا ۳۰۲۹ شتران |

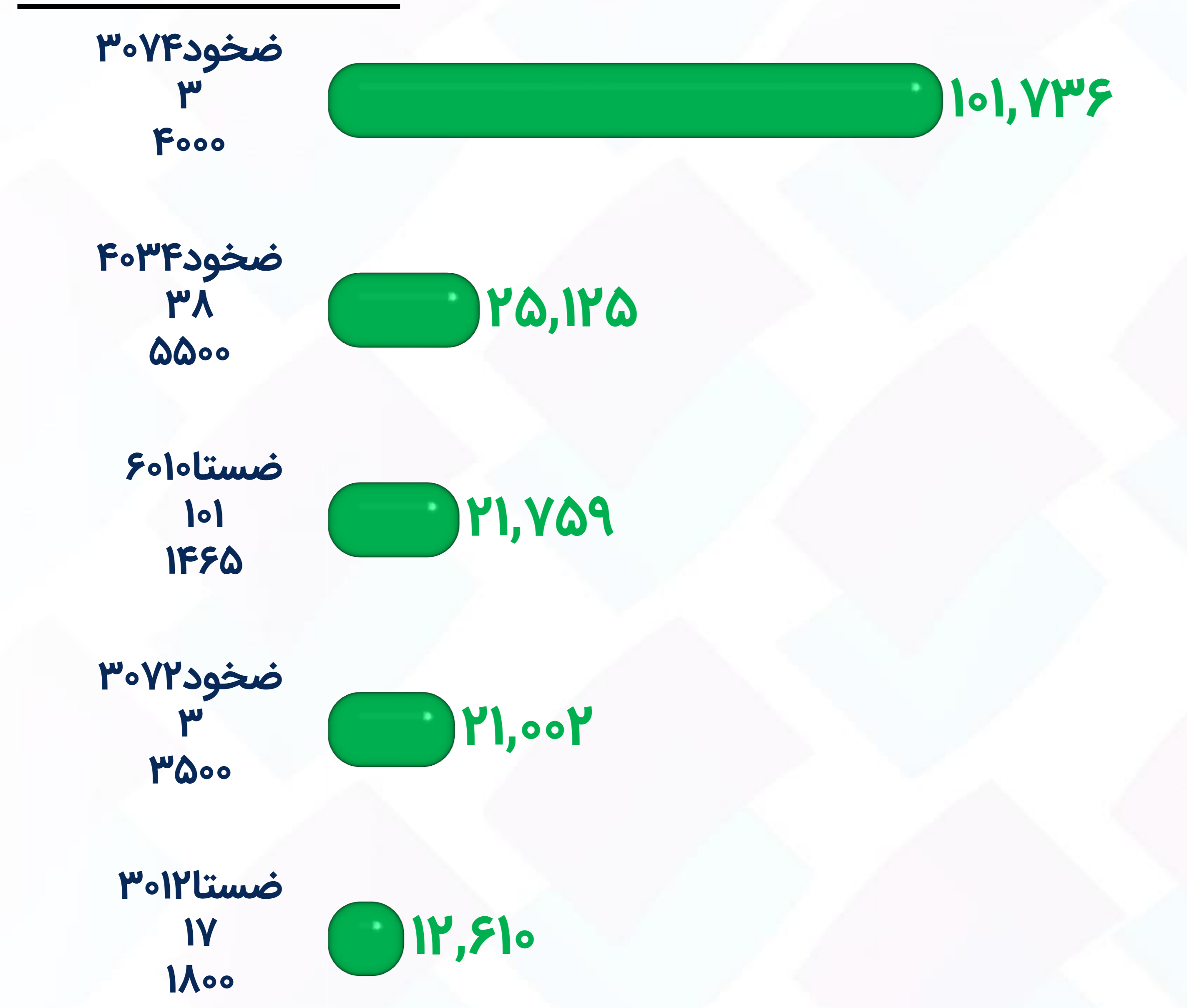
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

| 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 | ۸۵.۵ | (۳۹%) | ۸۵۵ | ۱,۴۰۲ | ۱۰ | ۴۰۷.۳ | ۱۰۲ | ۸۶۵ | طستا ۶۰۰۴ شستا |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۸۶۰.۰ | (۱۵%) | ۲,۵۸۰ | ۳,۰۴۵ | ۳ | ۰.۲ | ۴ | ۲,۵۸۳ | طهای ۳۰۰۴ های وب |
| (۹۹%) | ۱ | ۰.۰۰ | ۳۱.۷ | (۴۸%) | ۱,۷۴۵ | ۳,۳۴۹ | ۵۵ | ۰.۰ | ۱۰۸ | ۱,۸۰۰ | طسپا ۶۰۰۳ خسپا |
| (۹۹%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۲.۶ | (۳۲%) | ۹۴۷ | ۱,۴۰۲ | ۱۸ | ۱۱.۶ | ۱۰۲ | ۹۶۵ | طستا ۶۰۰۵ شستا |
| (۹۸%) | ۲ | -۰.۰۱ | ۱۹.۰ | (۴۳%) | ۱,۹۰۰ | ۳,۳۴۹ | ۱۰۰ | ۰.۰ | ۱۰۸ | ۲,۰۰۰ | طسپا ۶۰۰۵ خسپا |

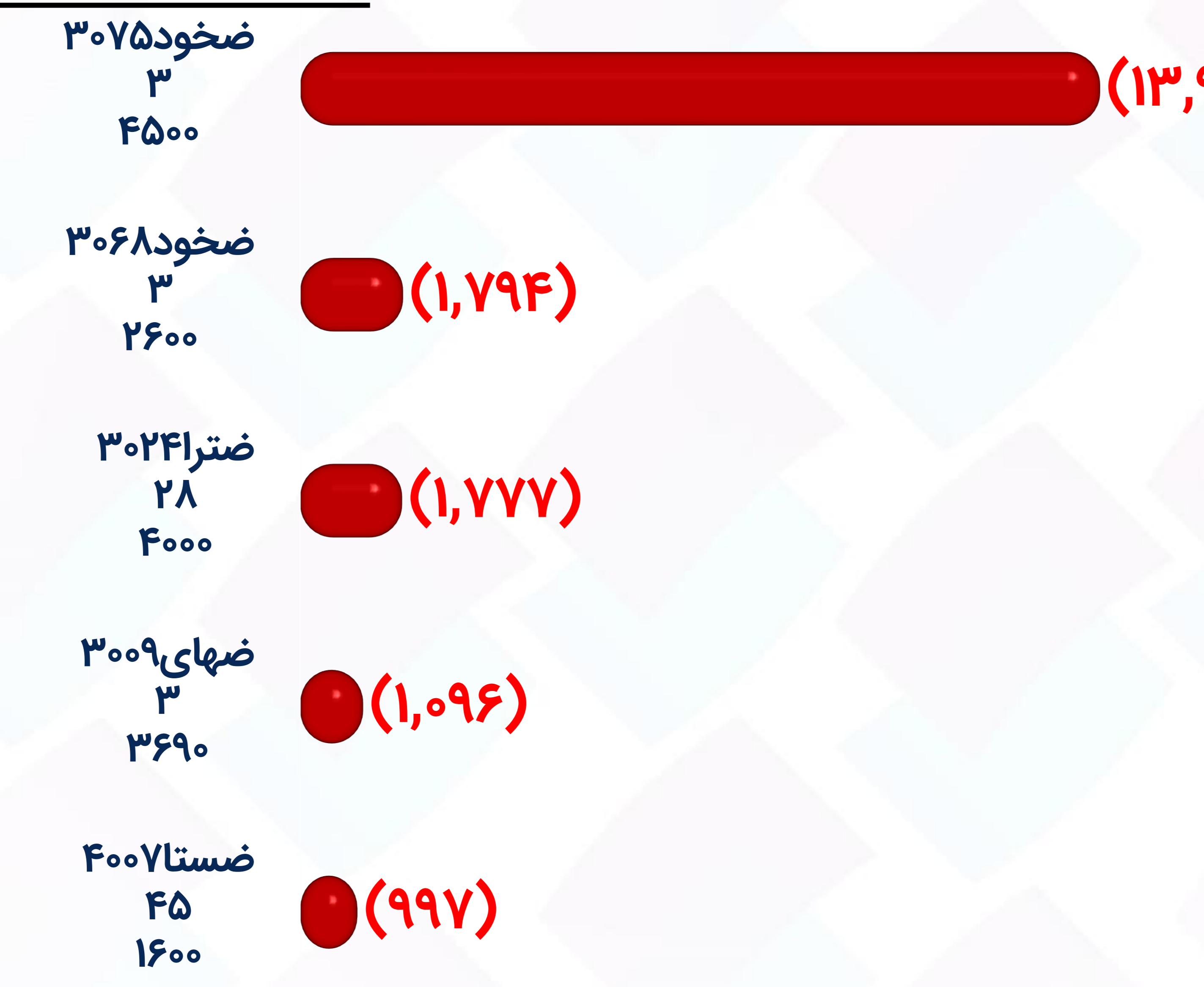
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده

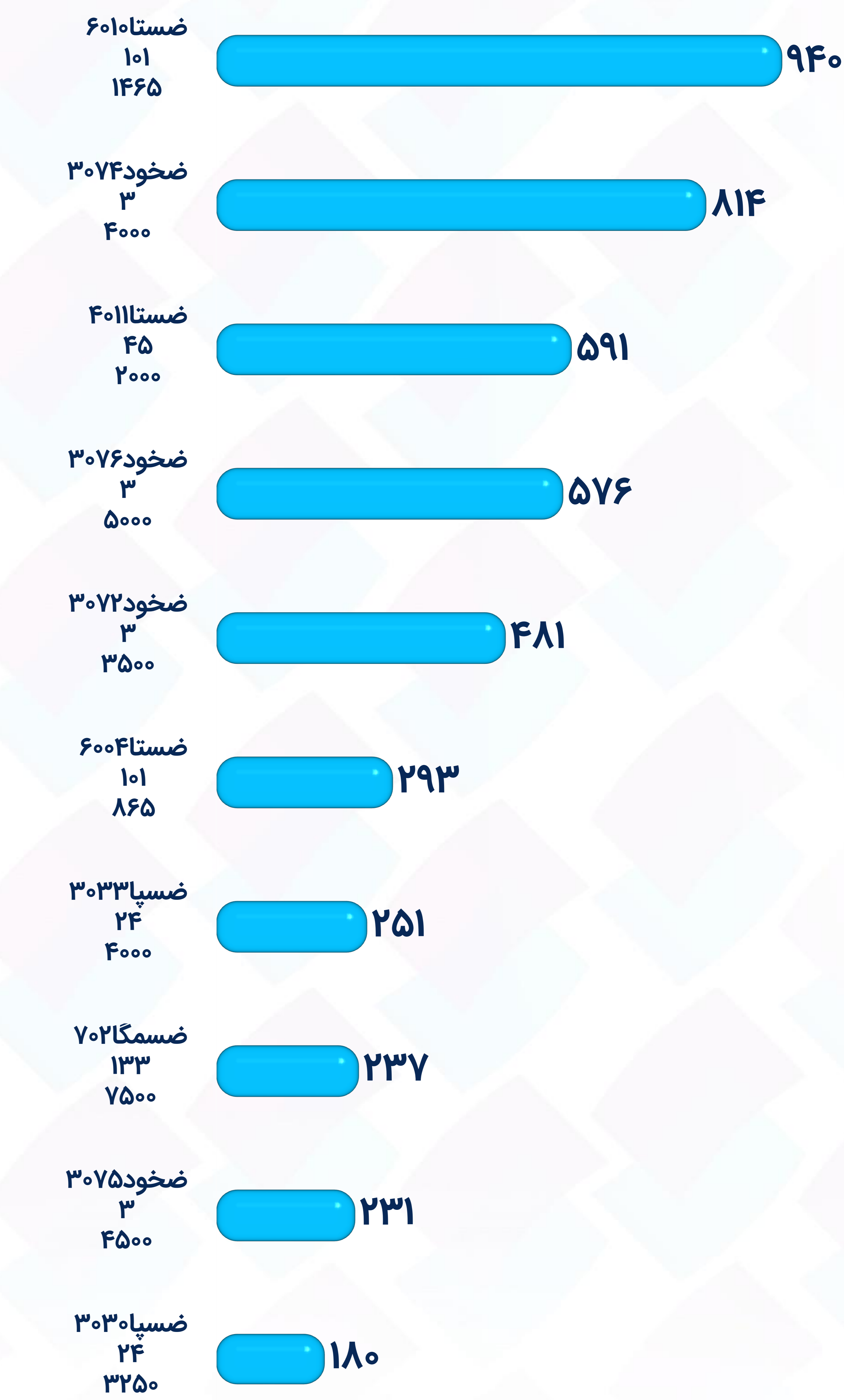


بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



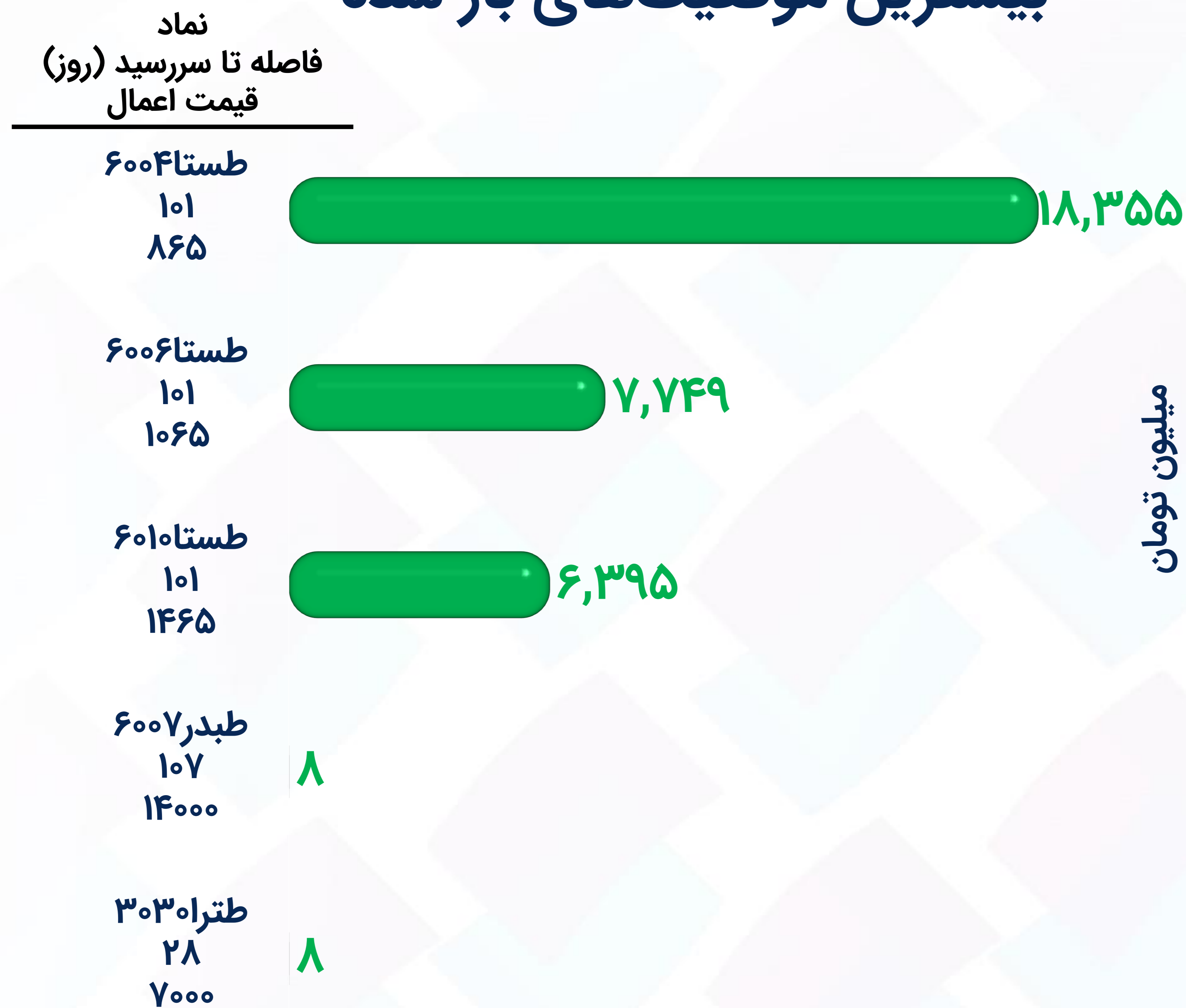
میلیون تومان

میلیون تومان

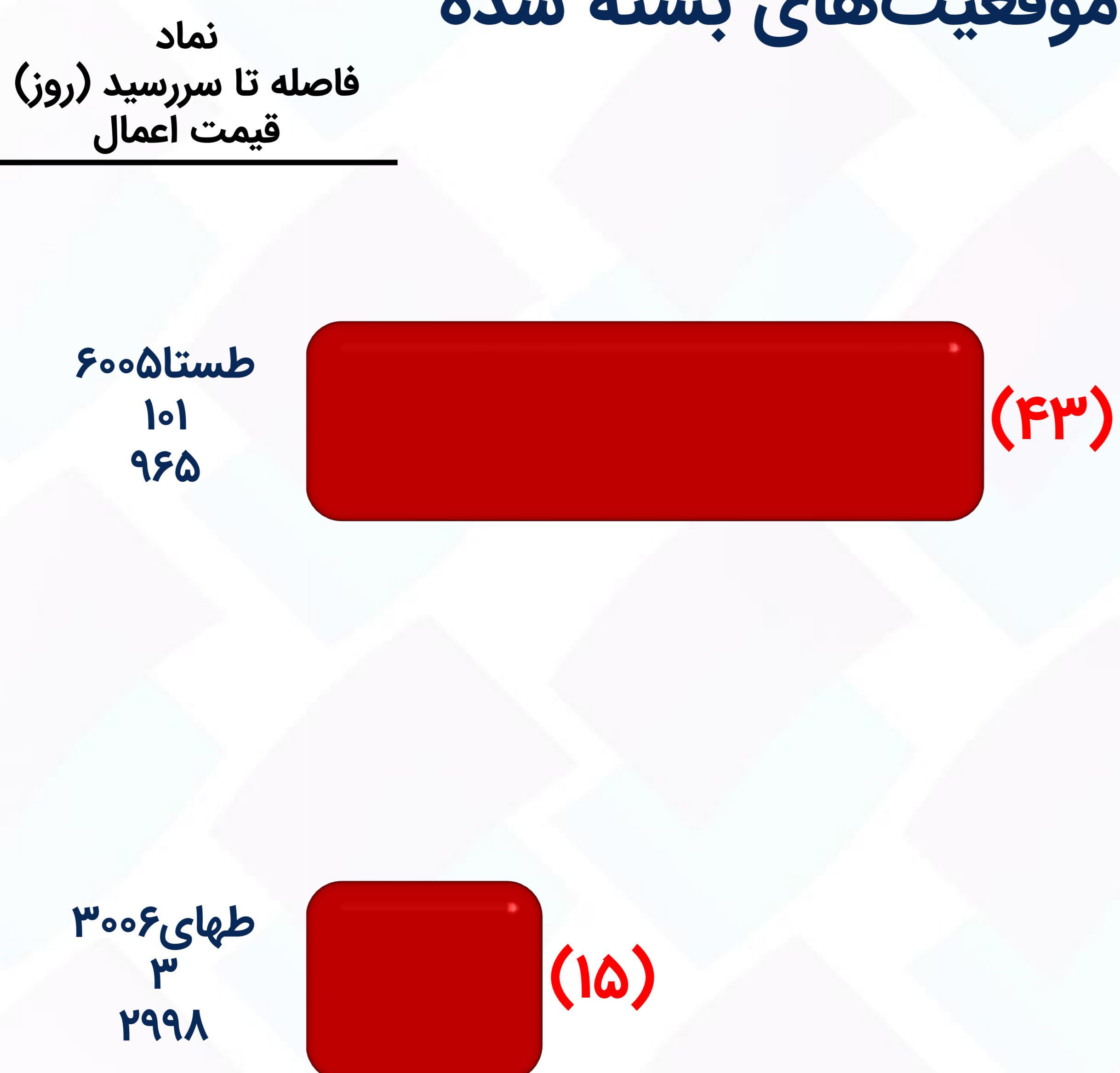
میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

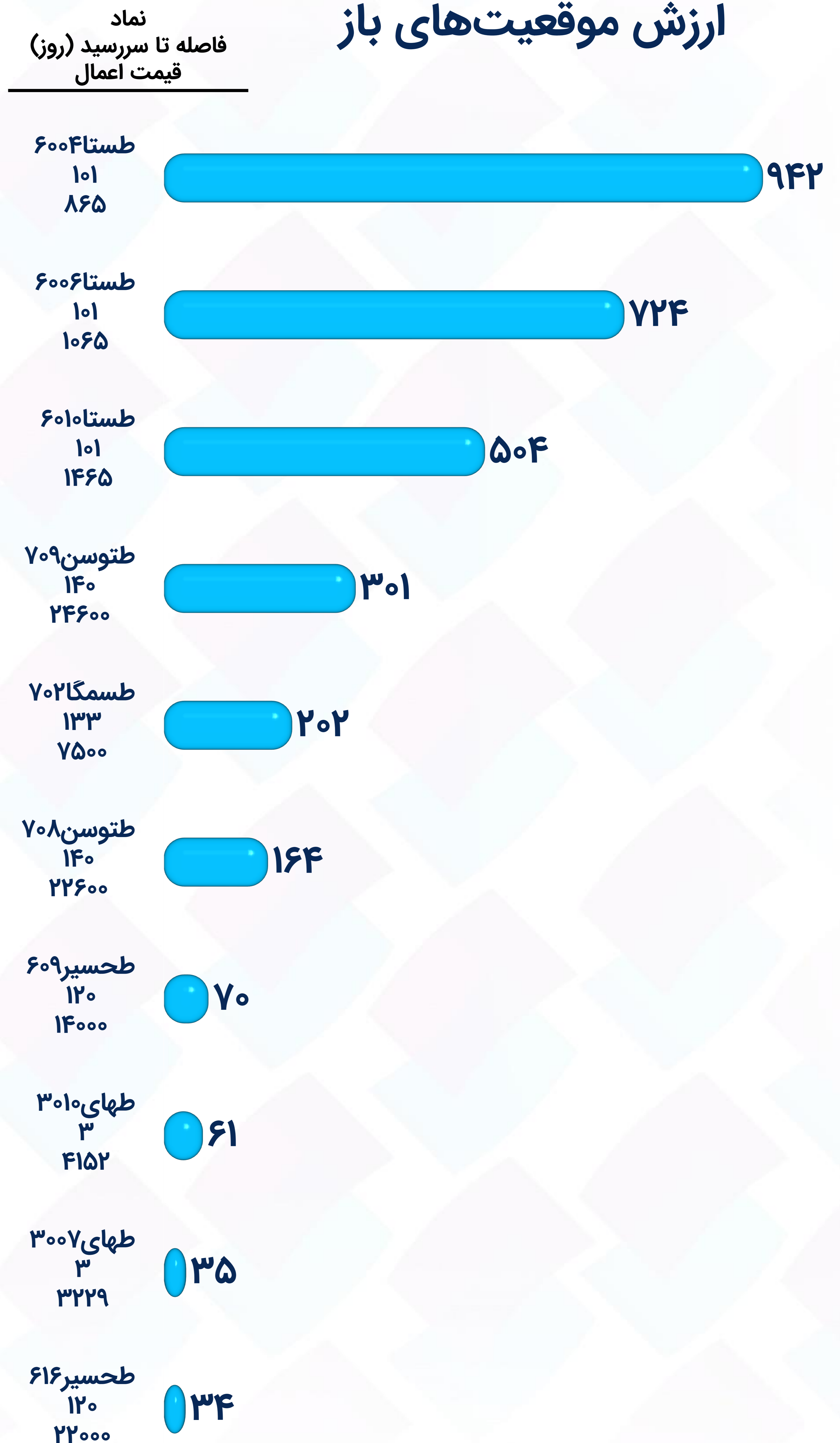
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



میلین تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

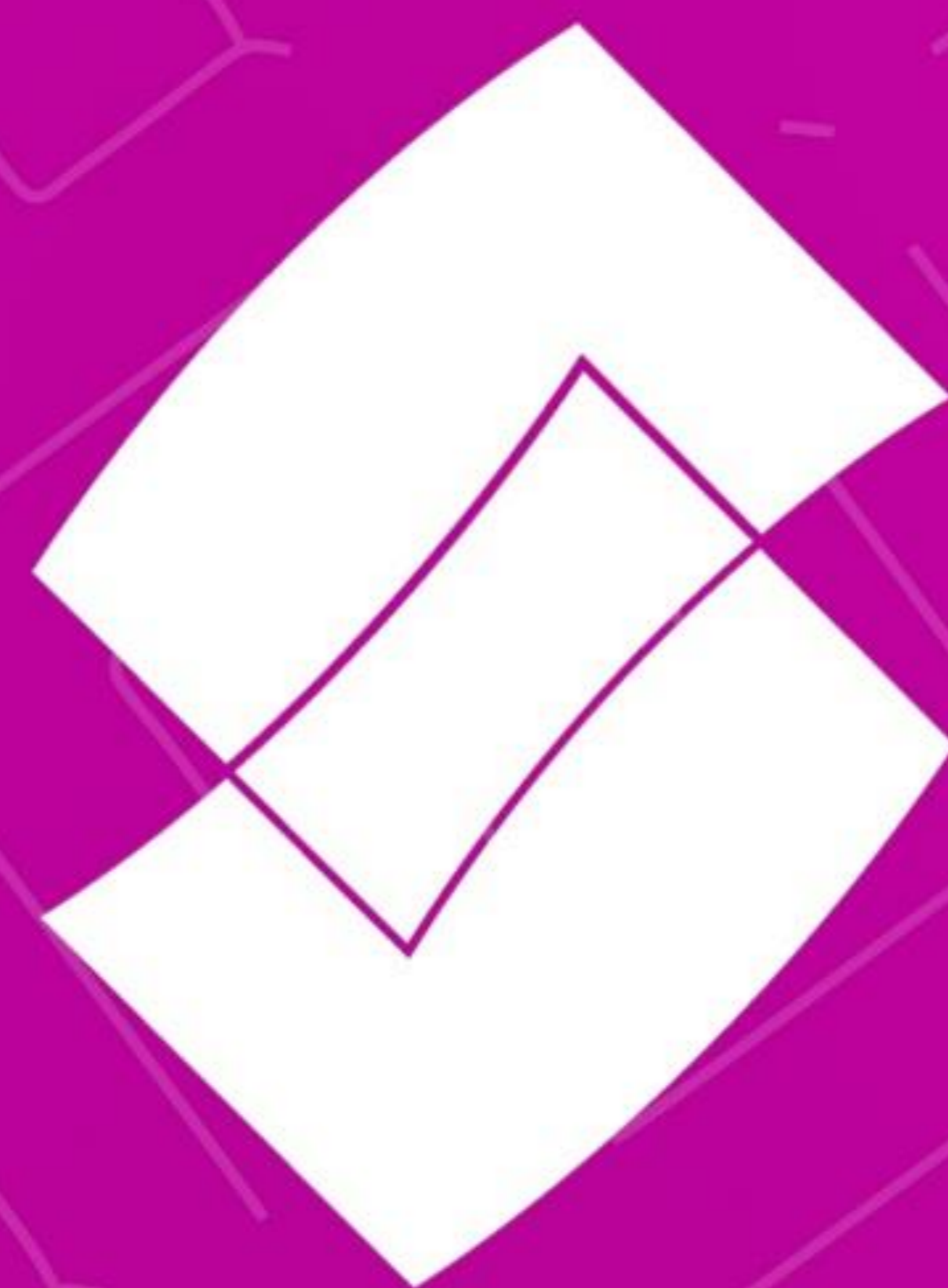
اختیار خرید



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.