

شماره

۱۲

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۱ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

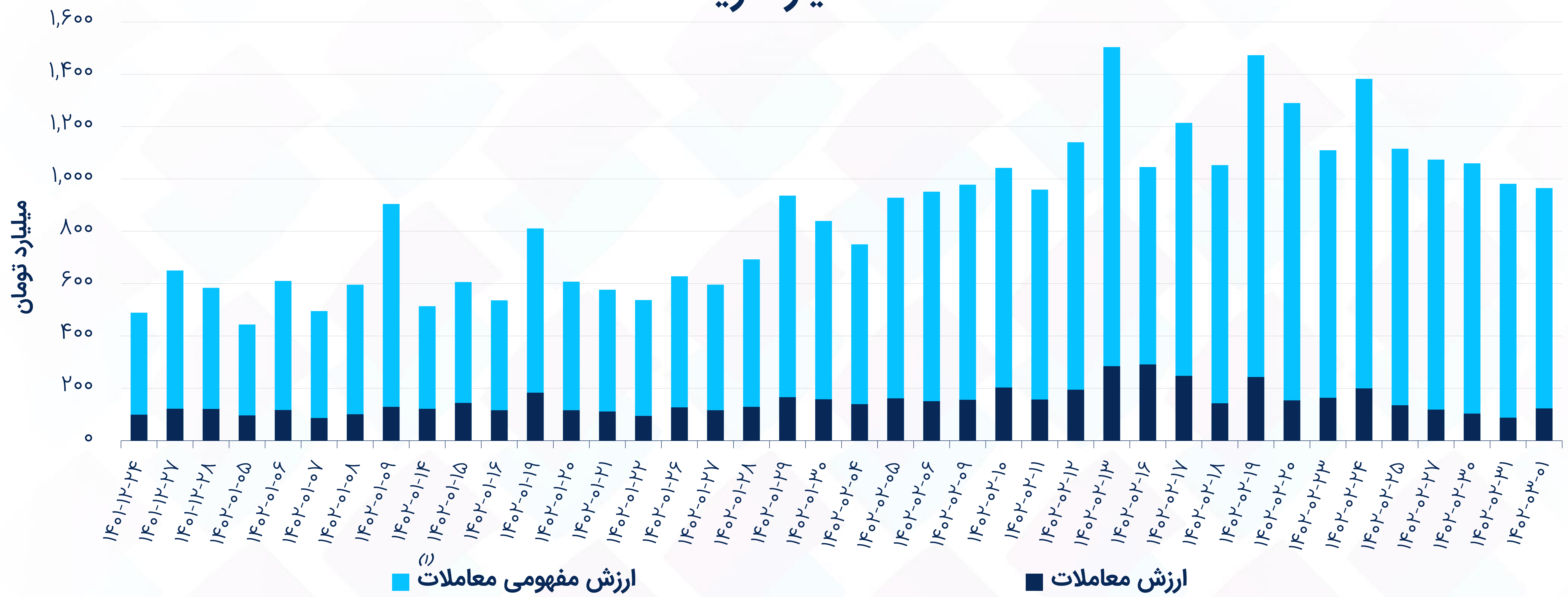




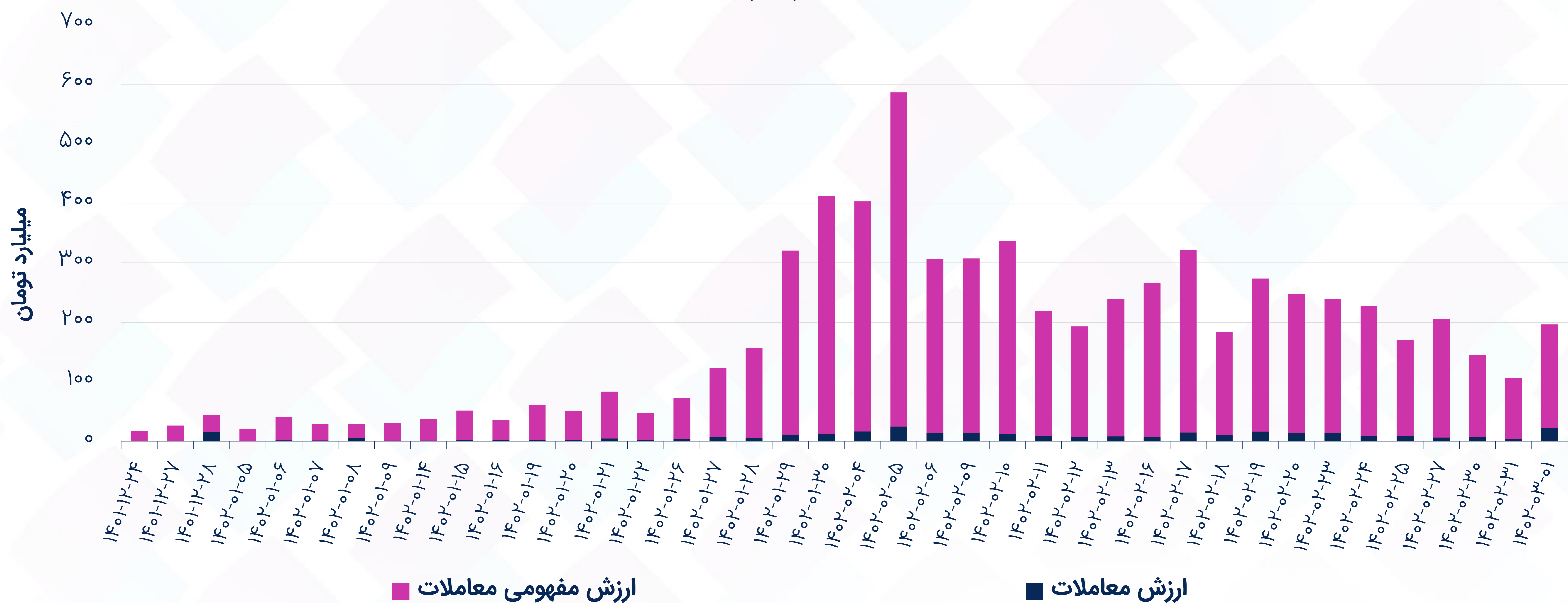
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



اختیار فروش



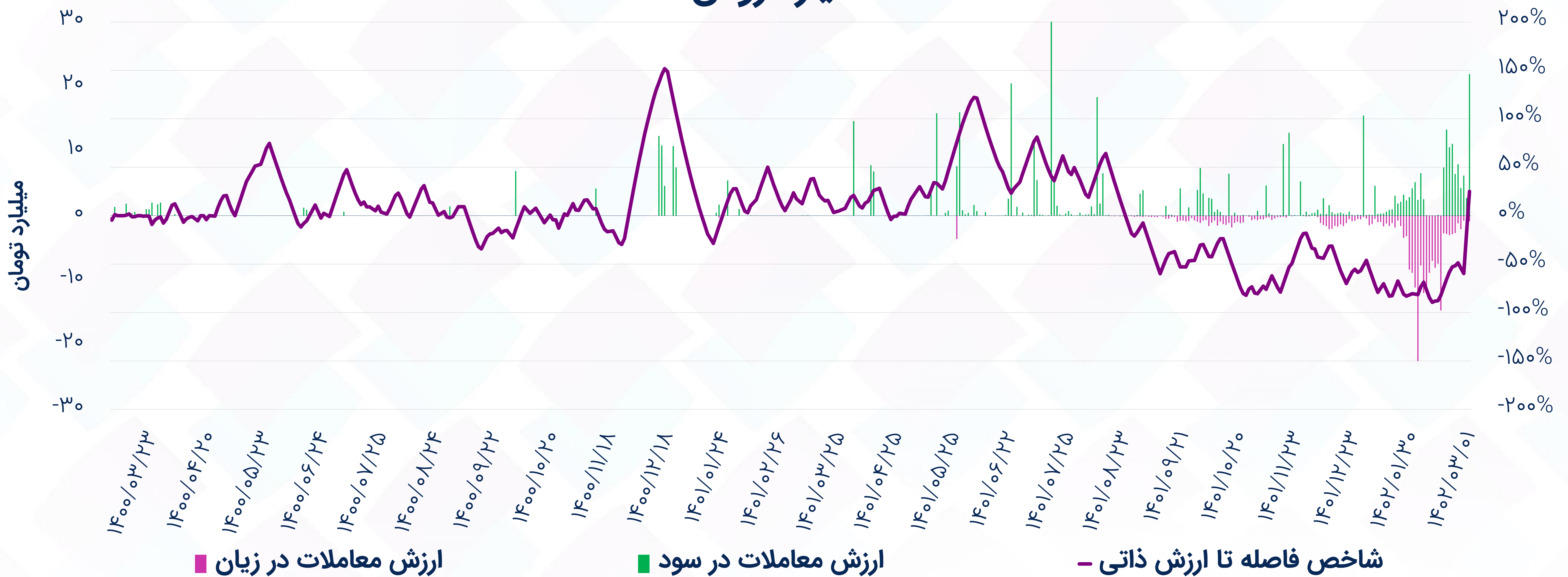
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

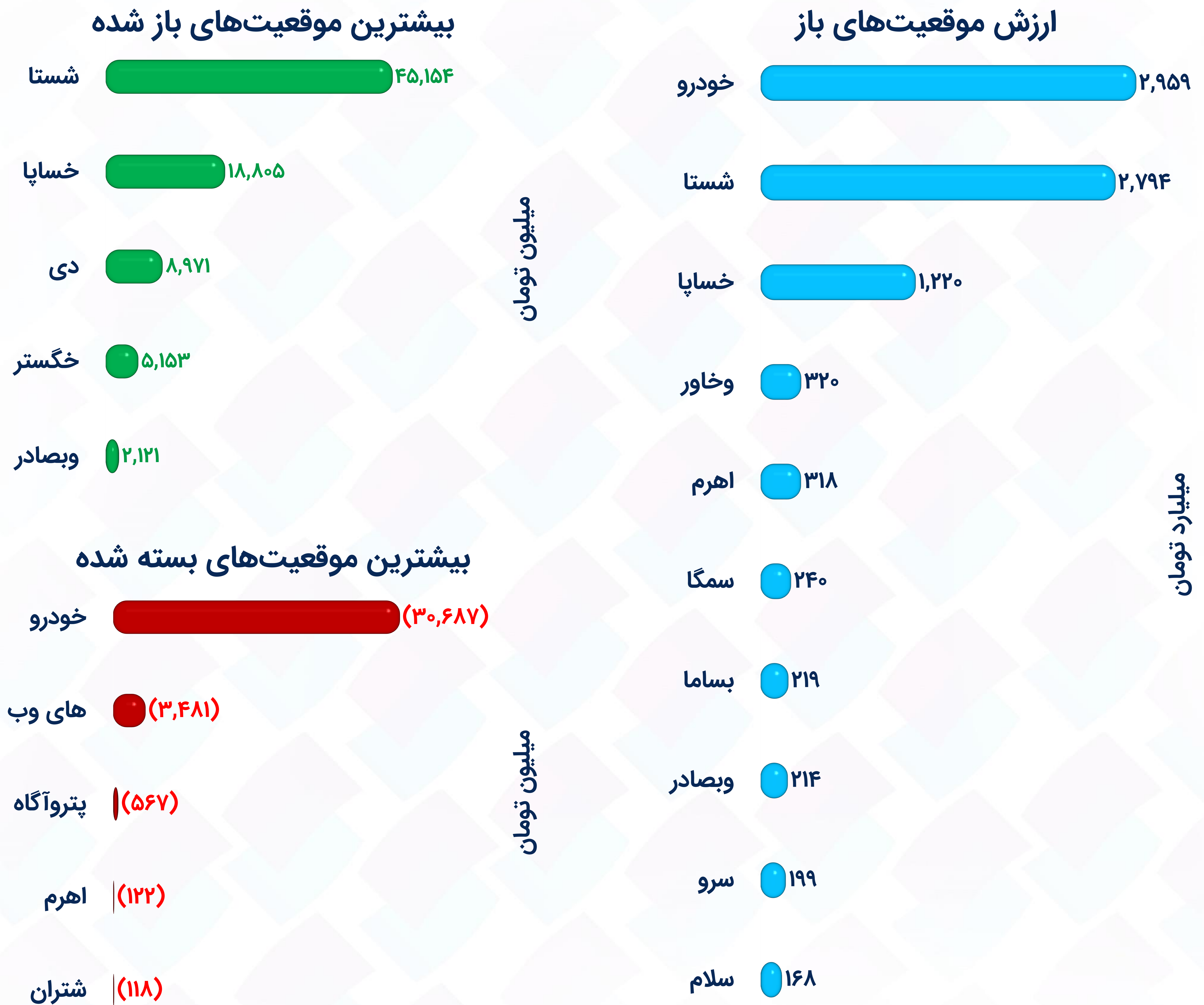
اختیار خرید

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	۴۱	۴۳.۳	۶۱۷.۰	۳۷.۷	۵.۶	(۹.۲%)
دی	۱۲	۱۹.۶	۳۸.۰	۱۹.۴	۰.۲	(۱۵.۲%)
شستا	۳۴	۱۷.۴	۱۱۵.۹	۵.۸	۱۱.۶	(۴۸.۹%)
خسپا	۲۵	۱۵.۰	۸۹.۵	۱۲.۴	۲.۶	(۲۷.۷%)
وبملت	۱۵	۱۲.۲	۳۳.۶	۱۲.۱	۰.۱	۱.۵%
وتجارت	۱۰	۴.۹	۱۴.۰	۴.۶	۰.۳	(۱۱.۴%)
وبصادر	۱۶	۲.۸	۱۳.۵	۲.۴	۰.۳	(۶.۱%)

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
های وب	۴	۲۰,۰۰۵.۰	۹۸,۵۰۰.۸	۱۹,۹۹۶.۴	۸.۶	۳۷.۳%
شستا	۶	۲,۷۵۸.۸	۹۷,۴۲۵.۵	۱,۹۰۴.۲	۸۵۴.۶	(۶۳.۴%)
فولاد	۳	۱۵.۱	۳۸۶.۴	۱۵.۰	۰.۱	۱۹.۶%
توسن	۱	۵.۸	۳۲.۲	۵.۸	۰.۰	۸.۰%
شبندر	۳	۲.۱	۲۳.۸	۲.۱	۰.۰	۳.۴%
خودرو	۵	۱.۷	۴.۵	۱.۶	۰.۰	(۲۴.۵%)
شپنا	۵	۱.۶	۴.۸	۱.۶	۰.۰	(۱۸.۸%)

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

بیشترین موقعیت‌های بسته شده

های وب



(۱)

میلیون تومان

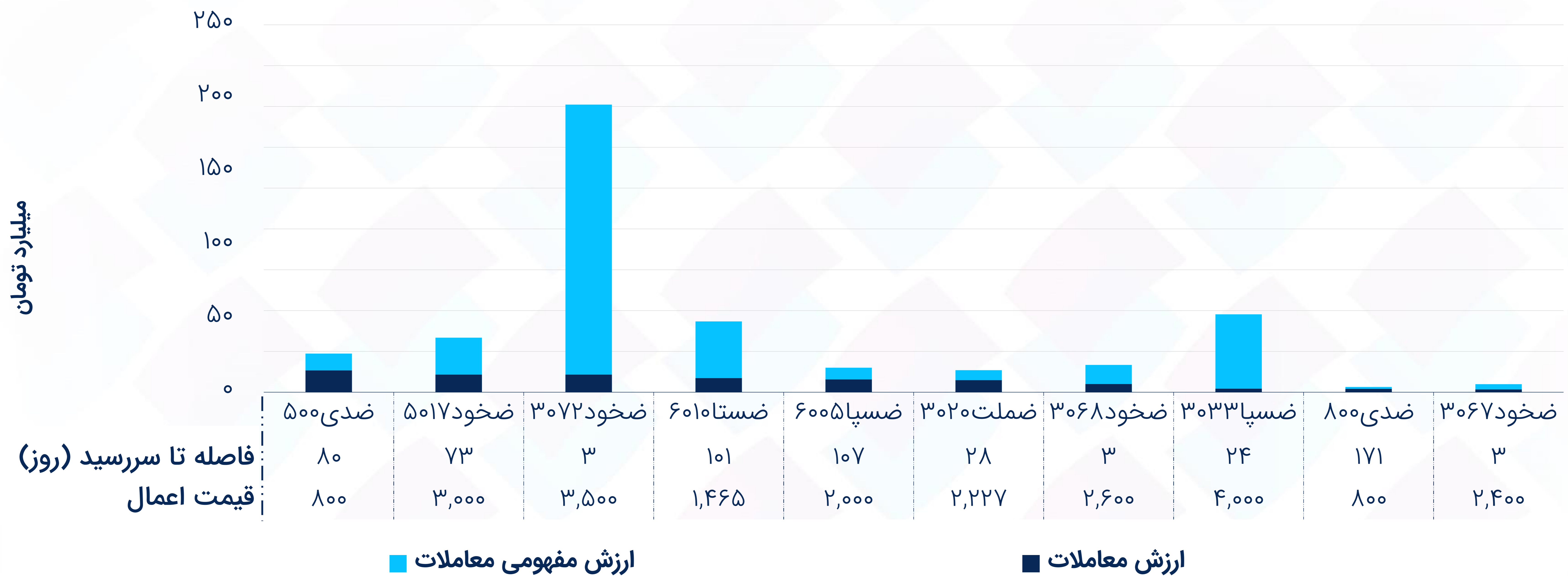
ارزش موقعیت‌های باز



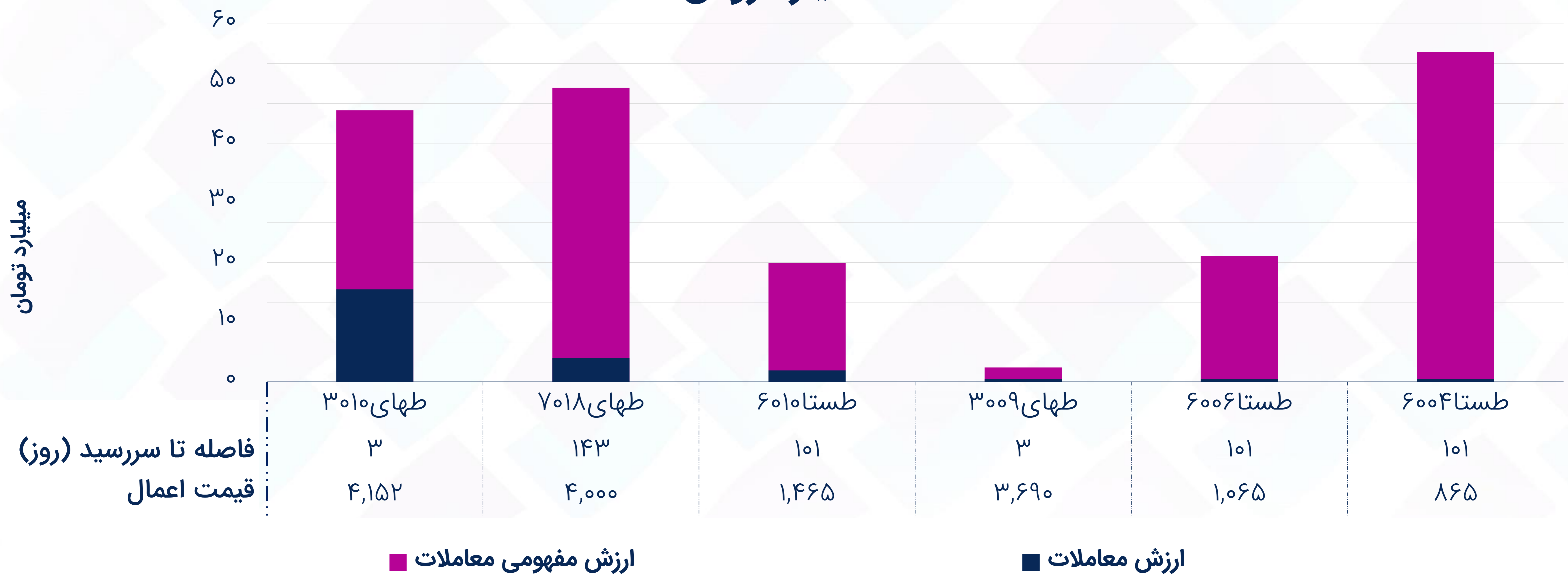
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضملی ۳۰۲۴	فملی	۶,۰۰۰	۷	۱۶.۷	۴۱۹	۷,۷۹۰	۶,۴۱۹	(۱۷.۶%)	۱۵.۳	۱.۰۰	۱,۸۲۰	۳۳۴%
ضحسیر ۶۱۵	حسیر	۲۰,۰۰۰	۱۲۰	۲.۱	۹۶۴	۱۷,۲۲۰	۲۰,۹۶۴	۲۱.۷%	۲۱.۷	۰.۴۸	۱,۶۰۶	۶۷%
ضهای ۳۰۰۵	های وب	۲,۷۶۸	۳	۶۸.۹	۲۴۲	۳,۰۸۰	۳,۰۱۰	(۲.۳%)	۱۲.۴	۱.۰۰	۳۱۸	۳۱%
ضهای ۳۰۰۶	های وب	۲,۹۹۸	۳	۷۱.۲	۸۶	۳,۰۸۰	۳,۰۸۴	۰.۱%	۳۵.۹	۰.۷۶	۱۰۷	۲۴%
ضخپارس ۳۰۶	خپارس	۱,۸۰۰	۲۱	۵.۸	۱۸۹	۱,۹۹۲	۱,۹۸۹	(۰.۲%)	۱۰.۵	۰.۸۹	۲۳۰	۲۱%

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 سرربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضهای ۳۰۰۹	های وب	۳,۶۹۰	۳	۱.۶	۱	۳,۰۸۰	۳,۶۹۱	۲۰%	۳,۶۹۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۱۲	شستا	۱,۸۰۰	۱۷	۵۵.۶	۱۰	۱,۴۱۱	۱,۸۱۰	۲۸%	۱۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۱۱	شستا	۲,۰۰۰	۴۵	۷۹۳.۰	۴۱	۱,۴۱۱	۲,۰۴۱	۴۵%	۴۹.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۱۰	شستا	۱,۹۰۰	۴۵	۱.۴	۷۰	۱,۴۱۱	۱,۹۷۰	۴۰%	۲۸.۱	۰.۰۱	۱	(۹۹%)
ضخود ۴۰۳۴	خودرو	۵,۵۰۰	۳۸	۳۶۲.۴	۸۰	۳,۷۴۷	۵,۵۸۰	۴۹%	۶۹.۸	۰.۰۱	۱	(۹۸%)

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

(۲) فاصله تا سرربه‌سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سربه‌سر)

(۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سربه‌سر

فاصله بهای اختیار فروش تا ارزش بک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بک شولز

نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهای ۷۰۱۸	های وب	۴,۰۰۰	۱۴۳	۴,۰۱۶.۶	۲۵۱	۳,۰۸۰	۳,۷۴۹	۲۲%	۱۴.۹	-۰.۶۶	۷۰۶	۱۸۱.۵%
طفلا ۳۰۲۵	فولاد	۶,۶۲۵	۳۱	۱۴.۷	۲۴۸	۶,۴۱۰	۶,۳۷۷	(۱%)	۲۵.۷	-۰.۵۲	۳۰۰	۲۱.۱%
طوسن ۷۰۹	توسن	۲۴,۶۰۰	۱۴۰	۵.۸	۳,۴۰۰	۱۸,۹۵۰	۲۱,۲۰۰	۱۲%	۶.۲	-۰.۷۹	۳,۶۷۱	۸.۰%
طهای ۳۰۰۹	های وب	۳,۶۹۰	۳	۴۵۳.۳	۵۹۰	۳,۰۸۰	۳,۱۰۰	۱%	۵.۳	-۱.۰۰	۶۰۲	۲.۰%
طهای ۳۰۱۰	های وب	۴,۱۵۲	۳	۱۵,۵۲۶.۶	۱,۰۵۲	۳,۰۸۰	۳,۱۰۰	۱%	۲.۹	-۱.۰۰	۱,۰۶۳	۱.۰%

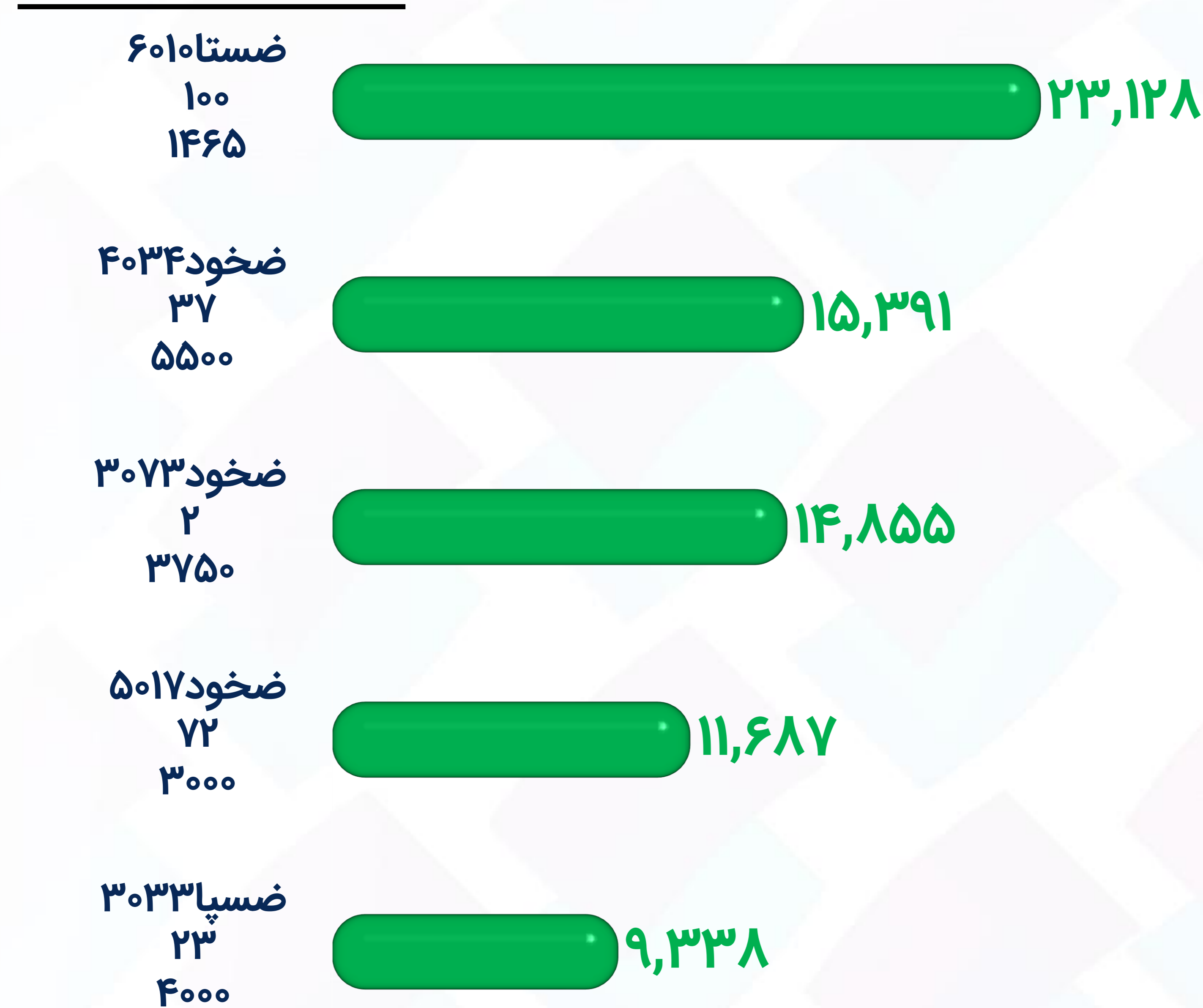
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سرربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۶۰۰۴	شستا	۸۶۵	۱۰۱	۳۹۱.۸	۱۰	۱,۴۱۱	۸۵۵	(۳۹%)	۸۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
طستا ۶۰۰۵	شستا	۹۶۵	۱۰۱	۱۱.۶	۱۵	۱,۴۱۱	۹۵۰	(۳۳%)	۶۳.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
طستا ۶۰۰۶	شستا	۱,۰۶۵	۱۰۱	۴۴۸.۶	۳۰	۱,۴۱۱	۱,۰۳۵	(۲۷%)	۳۴.۵	-۰.۰۱	۱	(۹۶%)
طستا ۶۰۰۷	شستا	۱,۱۶۵	۱۰۱	۱.۸	۶۲	۱,۴۱۱	۱,۱۰۳	(۲۲%)	۱۷.۸	-۰.۰۵	۵	(۹۲%)
طستا ۶۰۱۰	شستا	۱,۴۶۵	۱۰۱	۱,۹۰۴.۲	۱۳۵	۱,۴۱۱	۱,۳۳۰	(۶%)	۹.۹	-۰.۳۸	۷۰	(۴۸%)

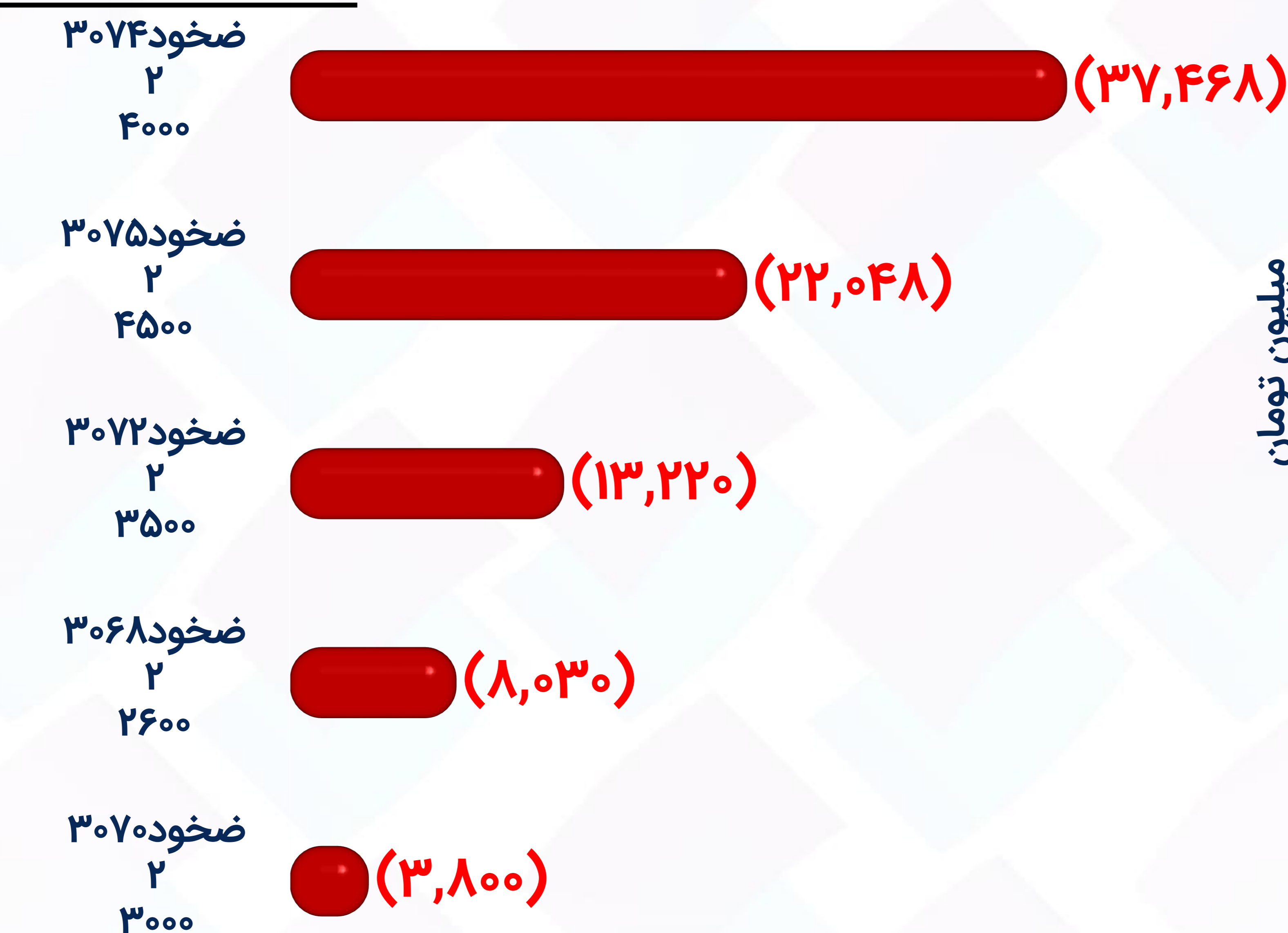
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده

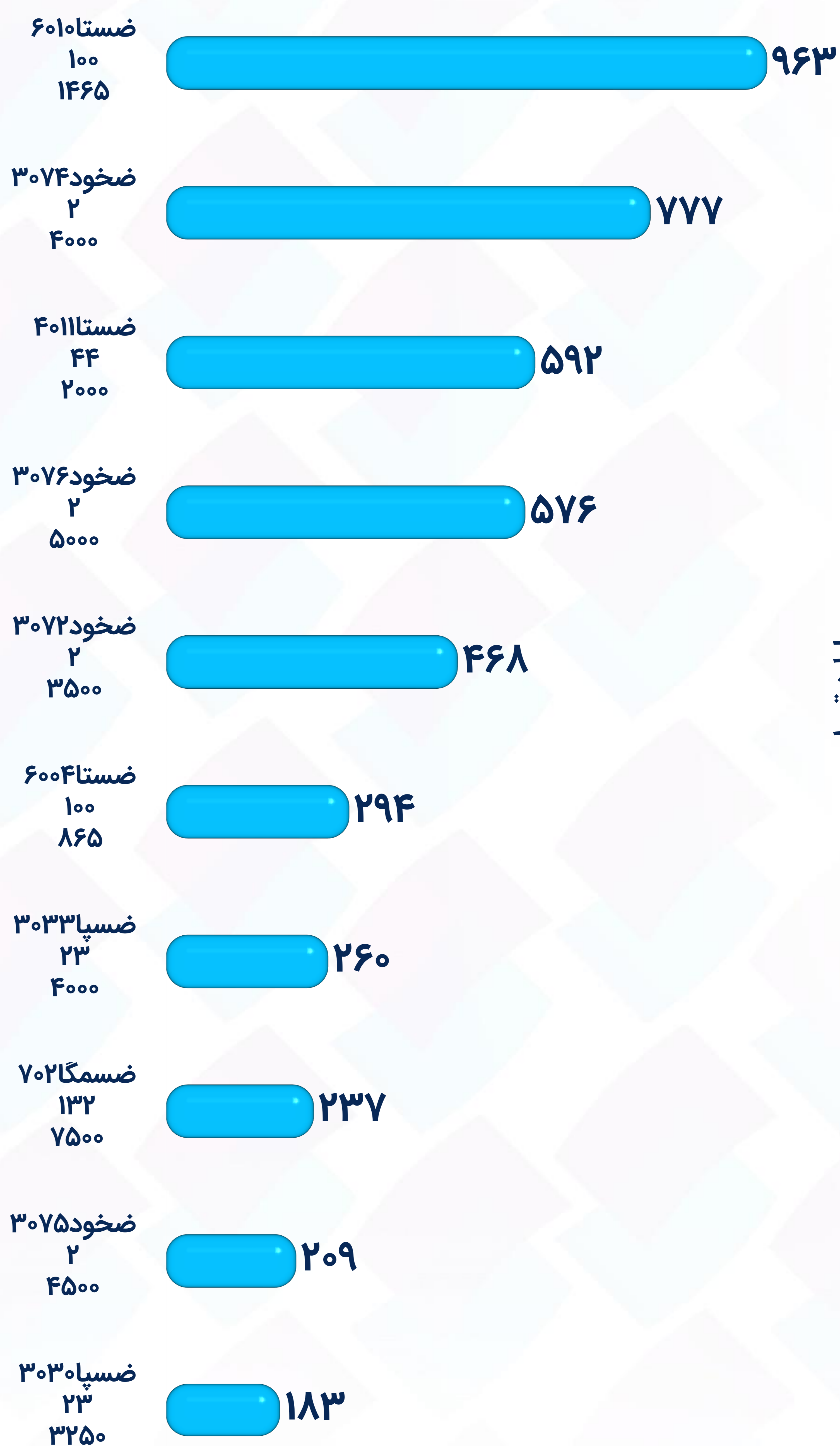


بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

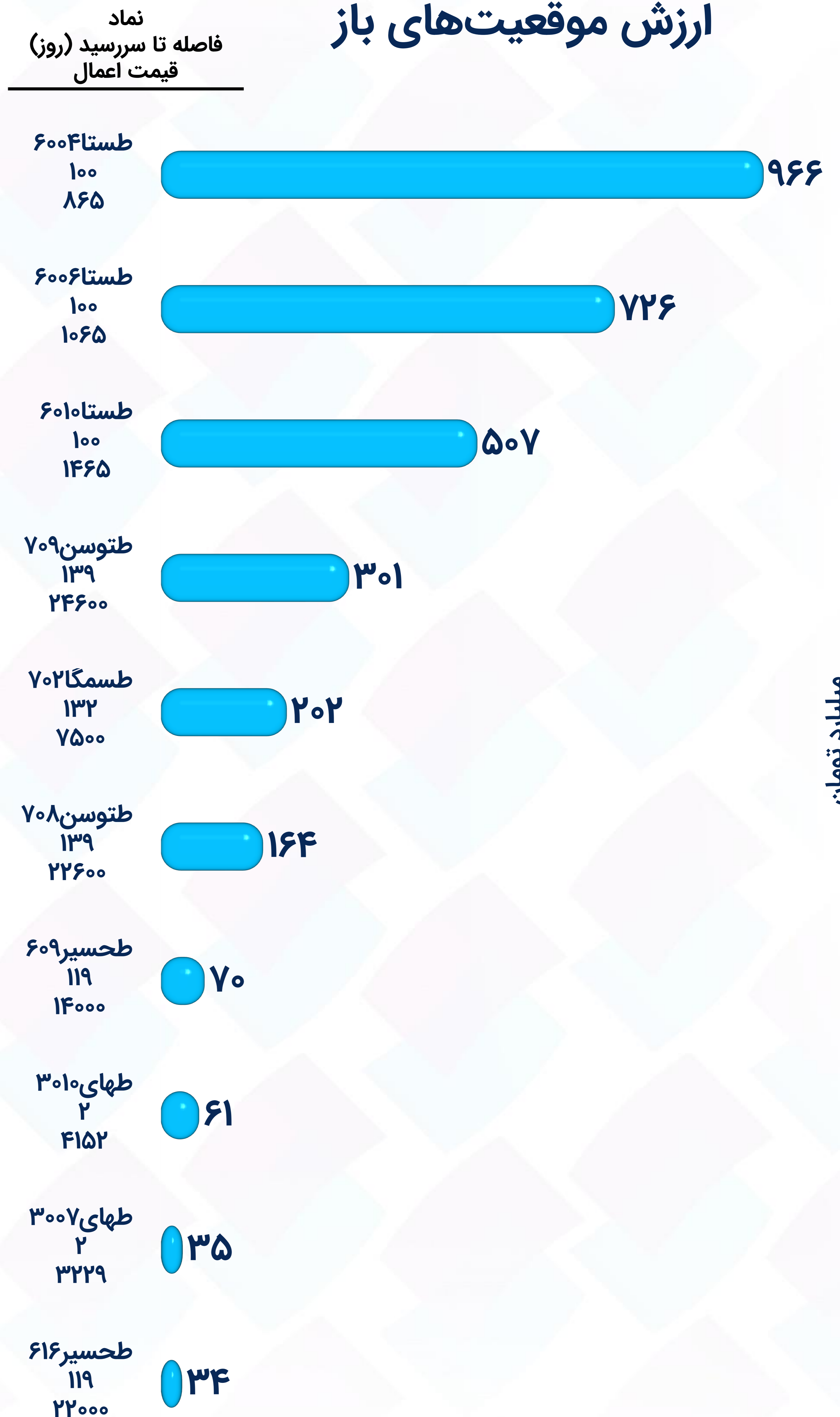
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

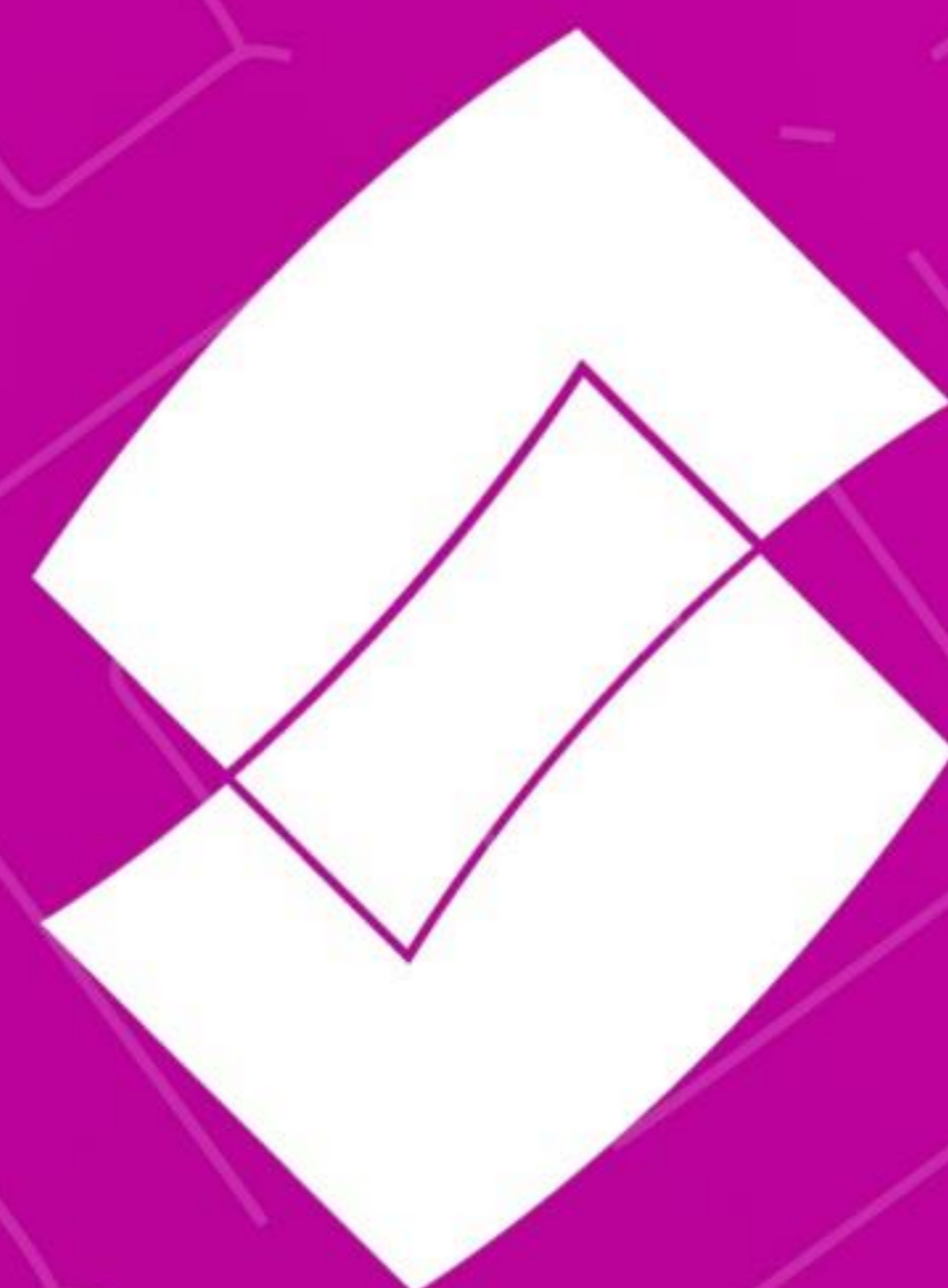
اختیار خرید



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.