

شماره
۱۳

اولین گزارش تخصصی روزانه از

بازار اختیار معامله

۲ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

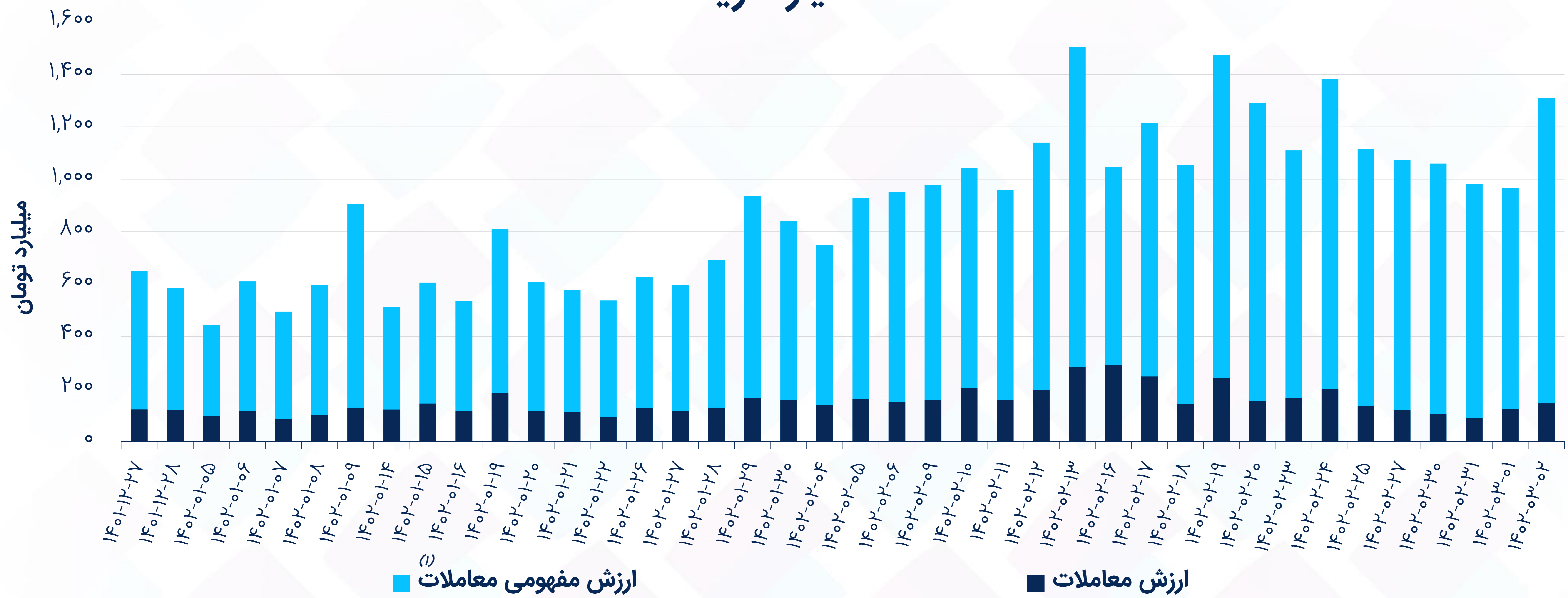




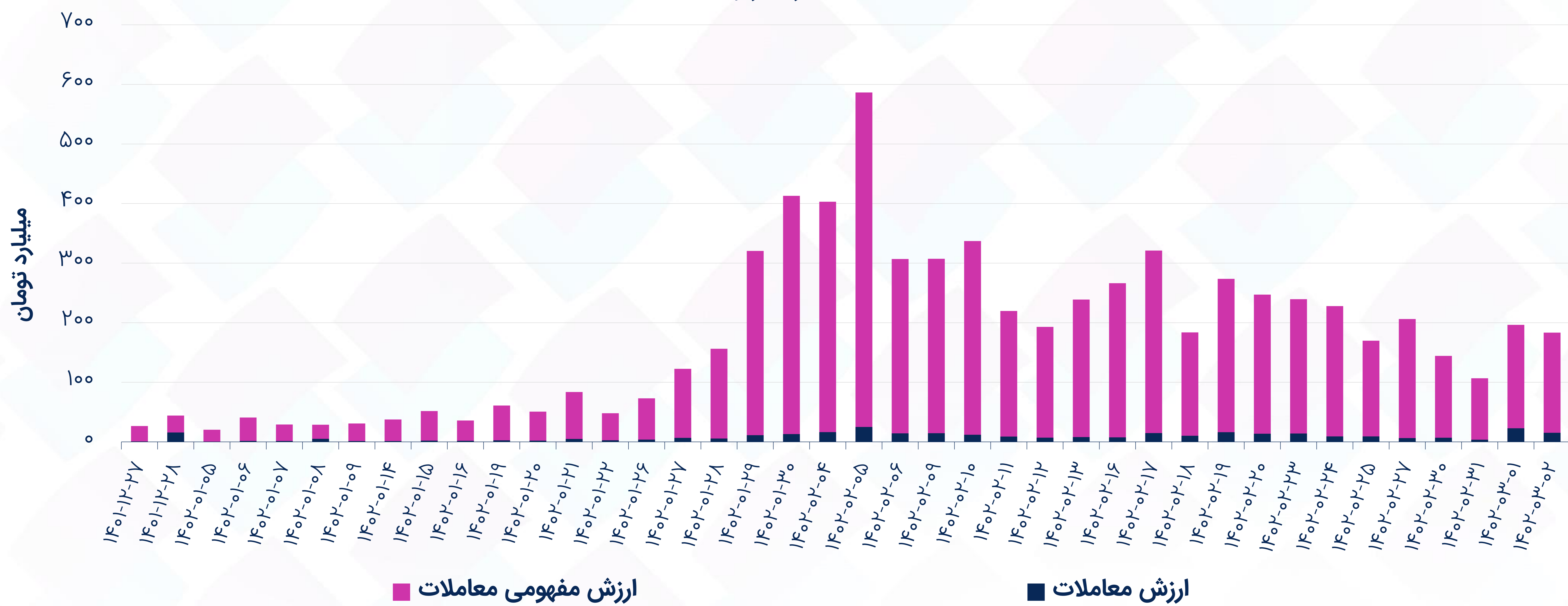
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



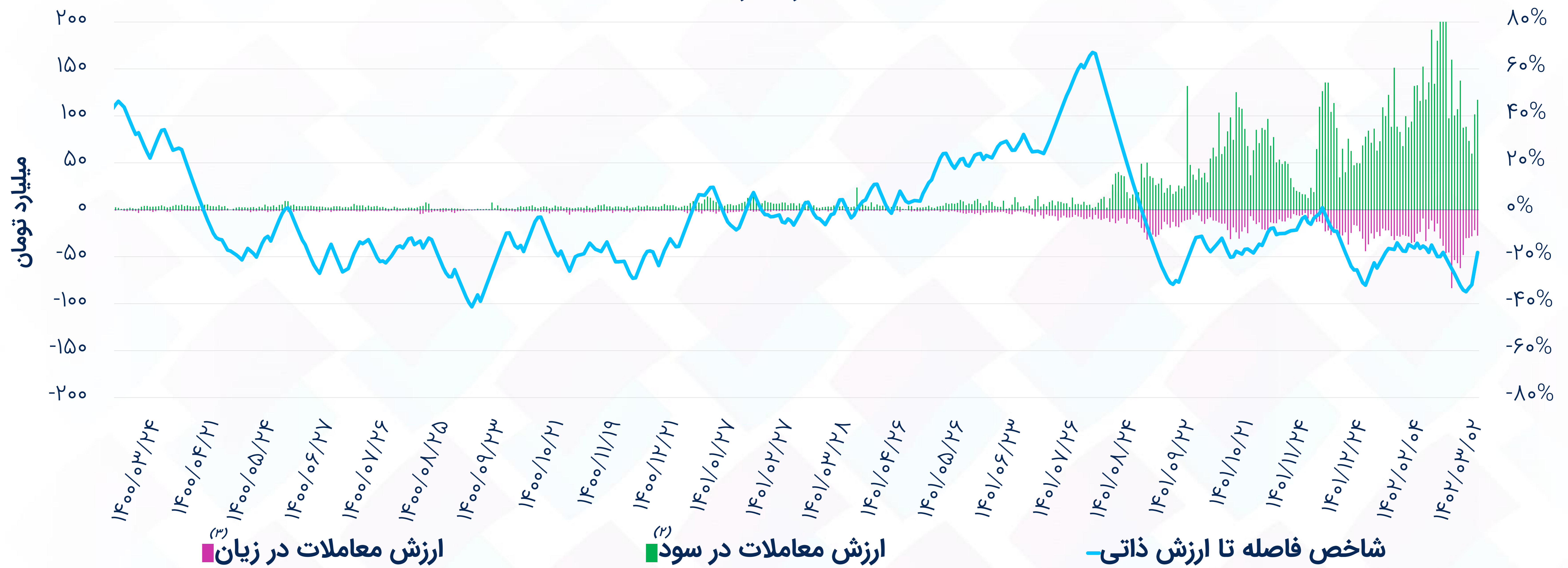
اختیار فروش



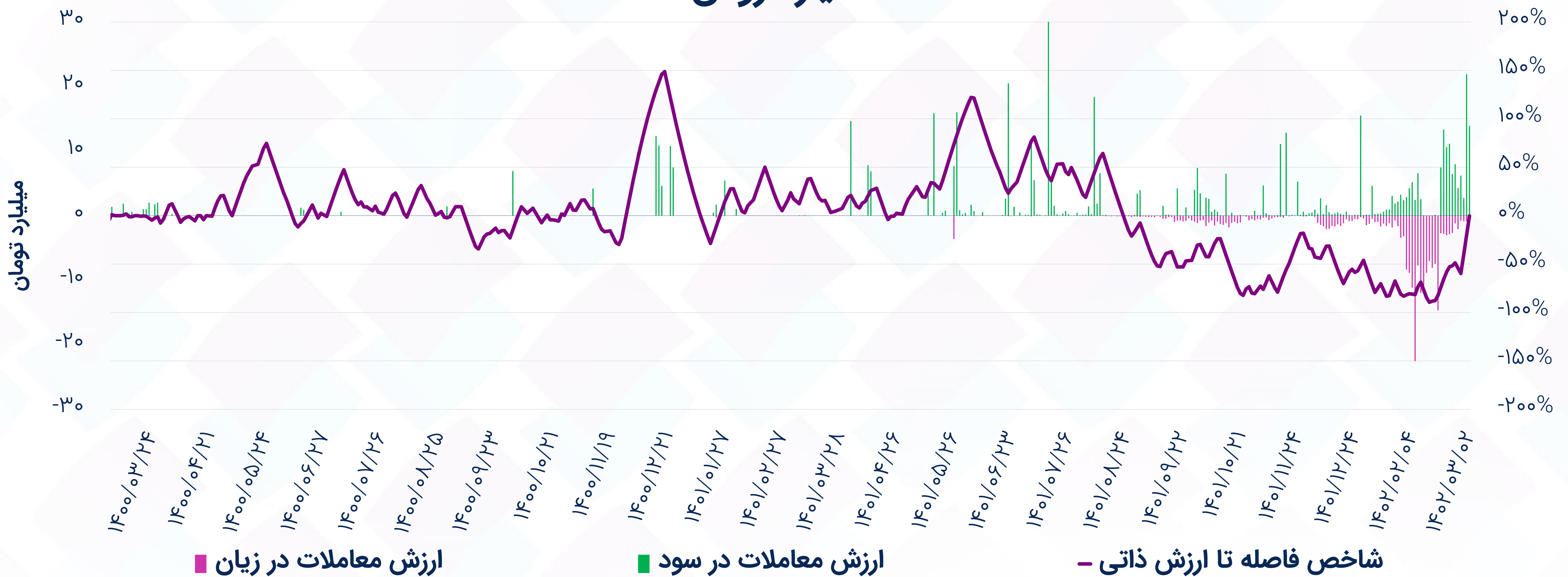
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۲.۸	۷۸۳.۱	۴۰.۰	۲.۸	(۸.۵%)
شستا	۳۴	۳۷.۲	۲۳۶.۹	۱۶.۰	۲۱.۳	(۴۲.۵%)
دی	۱۲	۱۷.۹	۳۸.۵	۱۷.۹	۰.۰	(۱۵.۳%)
خسپا	۲۶	۱۶.۳	۹۲.۹	۱۴.۲	۲.۱	(۲۲.۹%)
وبملت	۱۱	۷.۶	۱۸.۱	۷.۶	۰.۰	۵.۸%
وبصادر	۲۱	۴.۶	۲۴.۱	۴.۴	۰.۲	(۲.۲%)
بساما	۱	۴.۱	۴۷.۰	۴.۱	۰.۰	۳۰.۹%

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	۶	۱۱,۰۶۵.۲	۲۶,۲۹۸.۷	۱۱,۰۵۵.۷	۹.۵	۲۴.۳%
شستا	۶	۳,۷۰۰.۹	۱۱۰,۷۸۵.۳	۲,۸۱۲.۷	۸۸۸.۲	(۶۰.۲%)
بساما	۱	۵۰۶.۲	۴۵,۷۶۳.۲	۰.۰	۵۰۶.۲	(۹۶.۰%)
فولاد	۱	۲۷.۳	۴۷۱.۳	۲۷.۳	۰.۰	(۱۳.۰%)
ذوب	۳	۱.۱	۶.۶	۱.۱	۰.۰	(۲۴.۷%)
شبندر	۱	۰.۸	۱۸.۱	۰.۸	۰.۰	۶.۸%
خسپا	۱	۰.۴	۱.۷	۰.۴	۰.۰	(۲۰.۱%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

شستا ۲,۲۵۷.۰

توسن ۴۶۴.۹

سمگا ۲۰۵.۰

های وب ۱۸۵.۸

حسیر ۱۰۴.۱

بساما ۹۷.۲

فملی ۳.۰

اهرم ۲.۷

فولاد ۲.۵۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده

بساما ۹۷,۱۵۸

شستا ۴۶,۲۸۲

های وب ۳۶,۶۱۴

فملی ۳۰

وبصادر ۲۳

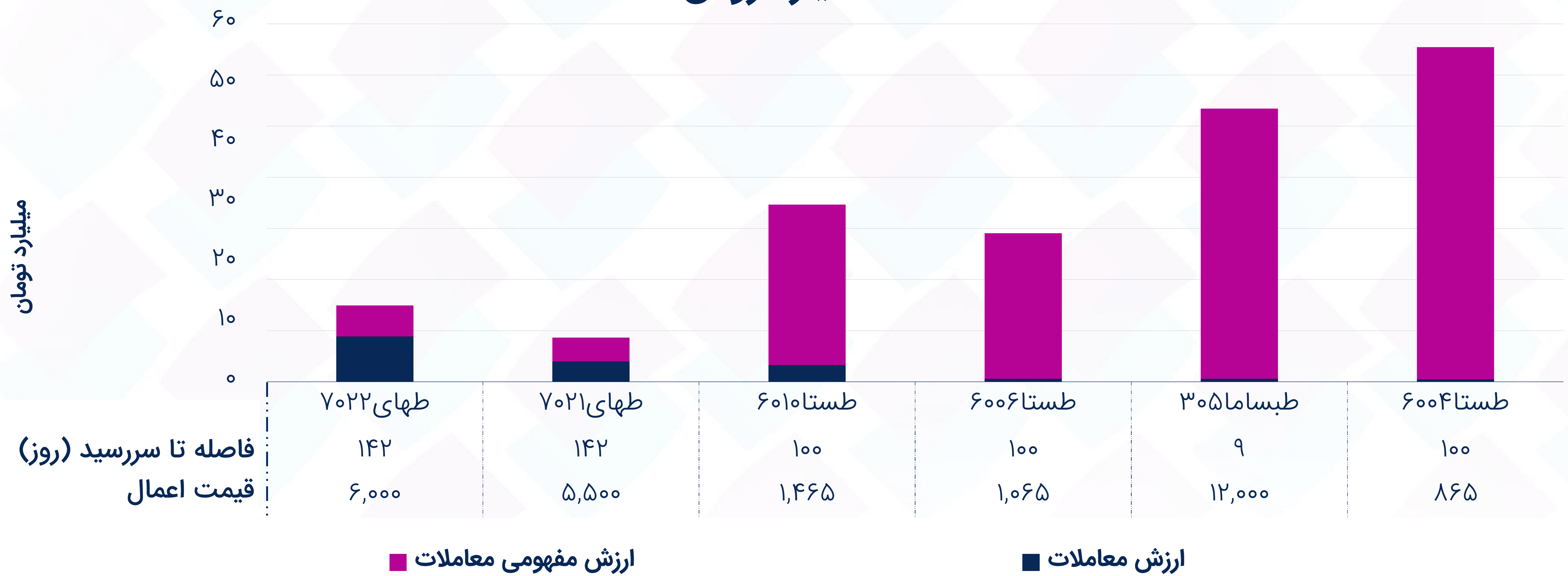
میلیون تومان

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
۳۱%	۱,۵۵۳	۰.۹۸	۱۱.۱	(۲.۱%)	۱۳,۱۸۷	۱۳,۴۷۰	۱,۱۸۷	۴,۱۳۹.۷	۹	۱۲,۰۰۰	بساما ۳۰۵
۲۹%	۱,۱۸۴	۱.۰۰	۴.۶	(۵.۷%)	۴,۱۷۵	۴,۴۲۸	۹۱۷	۹۱.۰	۶	۳,۲۵۸	ذوب ۳۰۱۶
۲۱%	۸۴۹	۰.۹۰	۵.۹	۴.۴%	۴,۱۳۶	۳,۹۶۰	۷۰۱	۶.۱	۱۲۱	۳,۴۳۵	تفارس ۶۰۴
۱۸%	۸,۵۵۰	۱.۰۰	۲.۴	(۱.۹%)	۱۷,۲۴۹	۱۷,۵۸۰	۷,۲۴۹	۵۶.۵	۱۴۲	۱۰,۰۰۰	سلام ۷۰۰۴
۱۶%	۳۵,۶۶۰	۰.۸۹	۴.۹	۱۰.۷%	۱۵۰,۷۰۵	۱۳۶,۰۹۰	۳۰,۷۰۵	۵.۶	۲۱۹	۱۲۰,۰۰۰	سرو ۱۰۲۱

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	۲۲۶.۰	۲۸%	۱,۸۰۸	۱,۴۱۴	۸	۷۰.۵	۱۶	۱,۸۰۰	شستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴۹.۸	۴۴%	۲,۰۴۱	۱,۴۱۴	۴۱	۲,۰۲۱.۹	۴۴	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۹۹%)	۱	۰.۰۱	۲۷.۰	۴۰%	۱,۹۷۳	۱,۴۱۴	۷۳	۱.۰	۴۴	۱,۹۰۰	شستا ۴۰۱۰
(۹۸%)	۱	۰.۰۱	۸۰.۷	۴۸%	۵,۵۶۹	۳,۷۵۲	۶۹	۴۸۹.۹	۳۷	۵,۵۰۰	خودرو ۴۰۳۴
(۹۷%)	۲	۰.۰۳	۲۶.۷	۳۲%	۱,۸۷۰	۱,۴۱۴	۷۰	۳۲.۷	۴۴	۱,۸۰۰	شستا ۴۰۰۹

(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

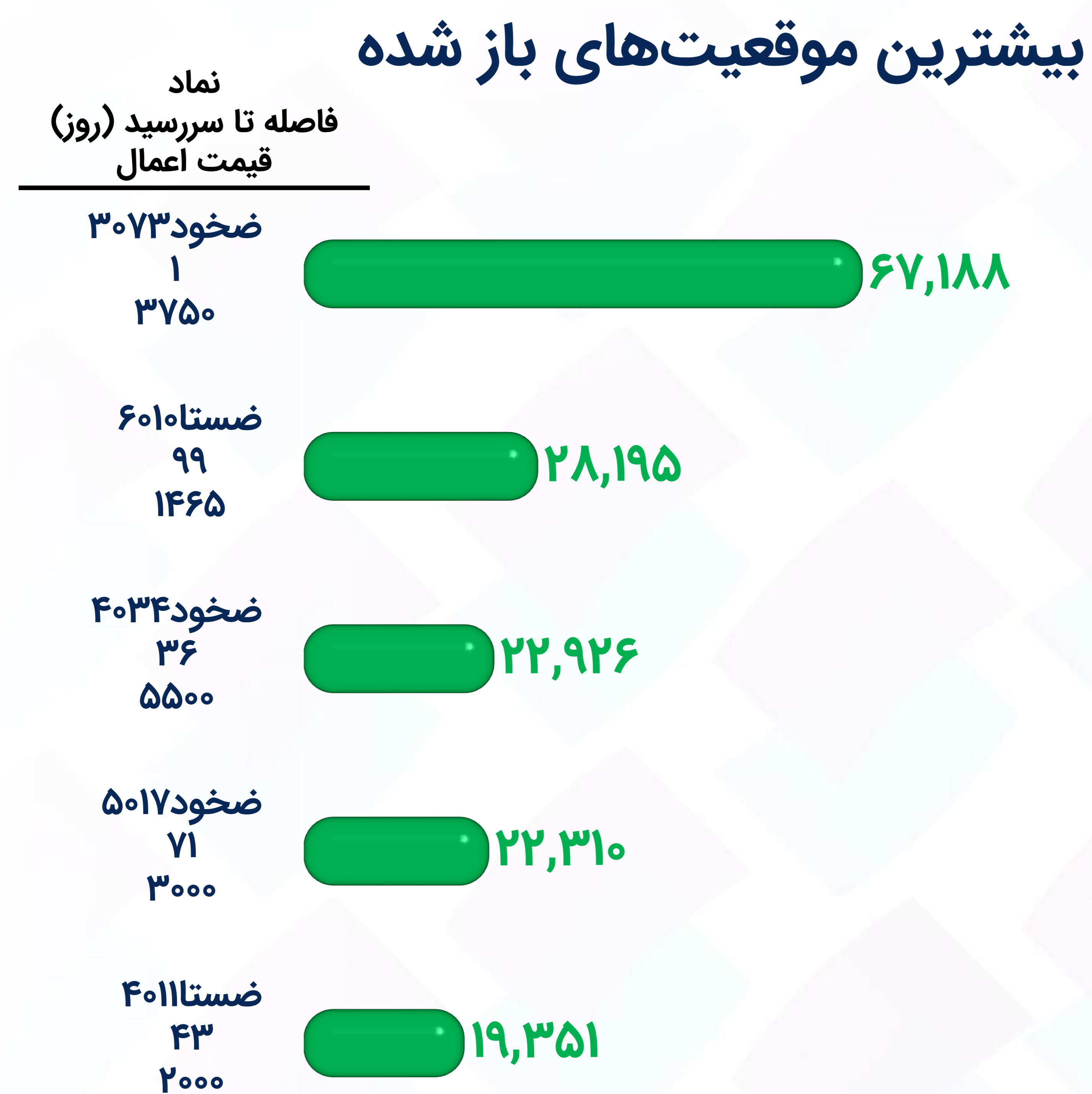
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۲۸.۱%	۱,۸۵۷	-۰.۹۳	۲.۸	۲۹%	۴,۰۵۰	۳,۱۳۷	۱,۴۵۰	۳,۳۹۹.۹	۱۴۲	۵,۵۰۰	طهای ۷۰۲۱ های وب
۲۲.۷%	۲,۲۹۵	-۰.۹۶	۲.۲	۳۲%	۴,۱۳۰	۳,۱۳۷	۱,۸۷۰	۷,۶۴۱.۹	۱۴۲	۶,۰۰۰	طهای ۷۰۲۲ های وب
۳.۳%	۵۴۸	-۱.۰۰	۶.۰	۱%	۳,۱۶۰	۳,۱۳۷	۵۳۰	۱۳.۸	۲	۳,۶۹۰	طهای ۳۰۰۹ های وب
(۱۳.۰%)	۳۲۱	-۰.۵۵	۱۷.۰	(۲%)	۶,۲۵۶	۶,۳۷۰	۳۶۹	۲۷.۳	۳۰	۶,۶۲۵	طفلا ۳۰۲۵ فولاد

گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

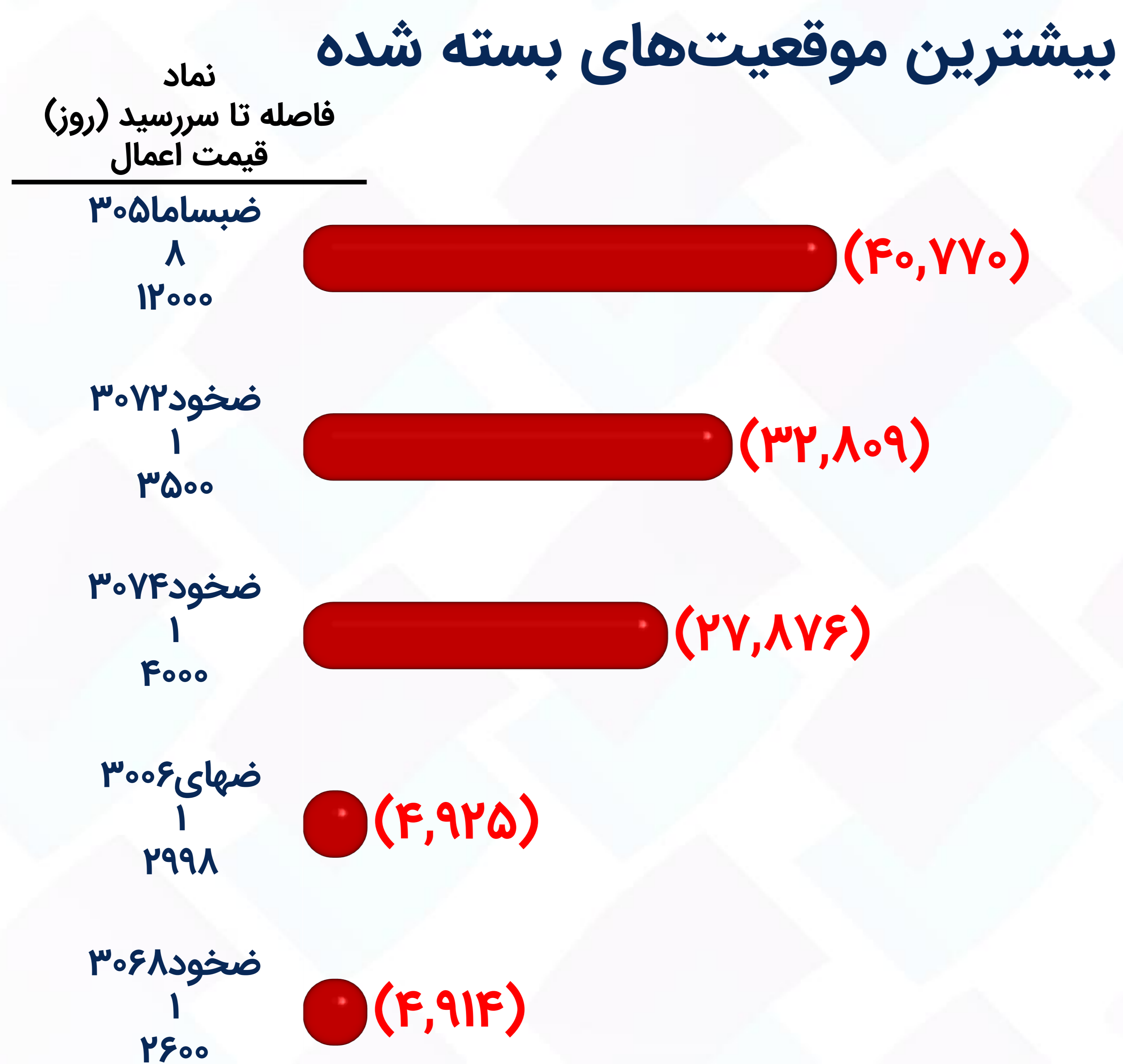
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۹۵.۱	(۳۹%)	۸۵۶	۱,۴۱۴	۹	۳۵۷.۲	۱۰۰	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴ شستا
(۹۶%)	۱	-۰.۰۱	۳۴.۵	(۲۷%)	۱,۰۳۵	۱,۴۱۴	۳۰	۵۲۸.۹	۱۰۰	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶ شستا
(۹۳%)	۵	-۰.۰۵	۱۶.۹	(۲۲%)	۱,۱۰۰	۱,۴۱۴	۶۵	۲.۰	۱۰۰	۱,۱۶۵	طستا ۶۰۰۷ شستا
(۴۸%)	۶۹	-۰.۳۸	۹.۹	(۶%)	۱,۳۳۱	۱,۴۱۴	۱۳۴	۲,۸۱۲.۷	۱۰۰	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰ شستا
(۱۶%)	۴	-۰.۰۸	۵۹۸.۶	(۵%)	۲,۹۹۳	۳,۱۳۷	۵	۹.۳	۲	۲,۹۹۸	طهای ۳۰۰۶ های وب

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

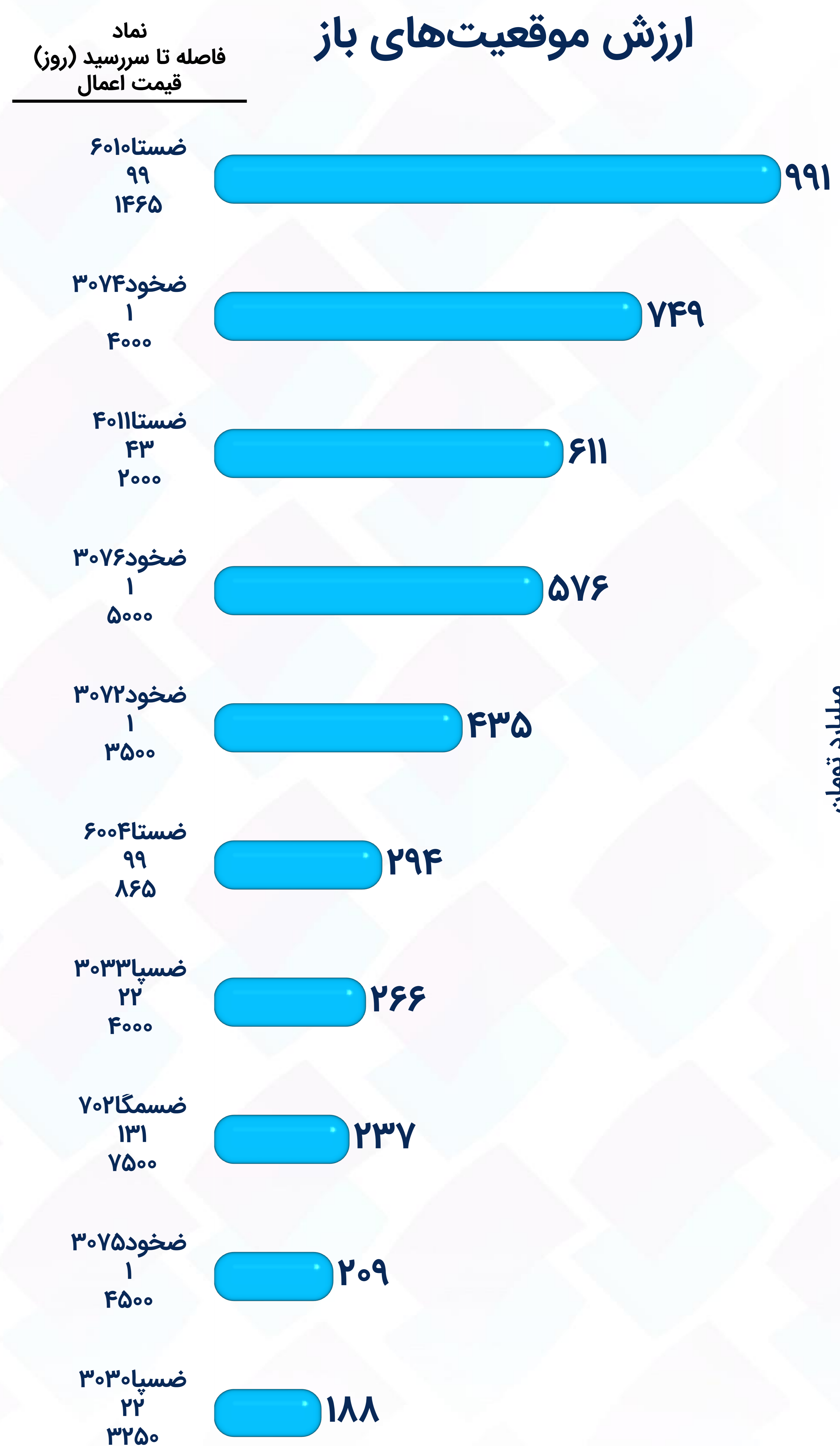
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



میلیون تومان

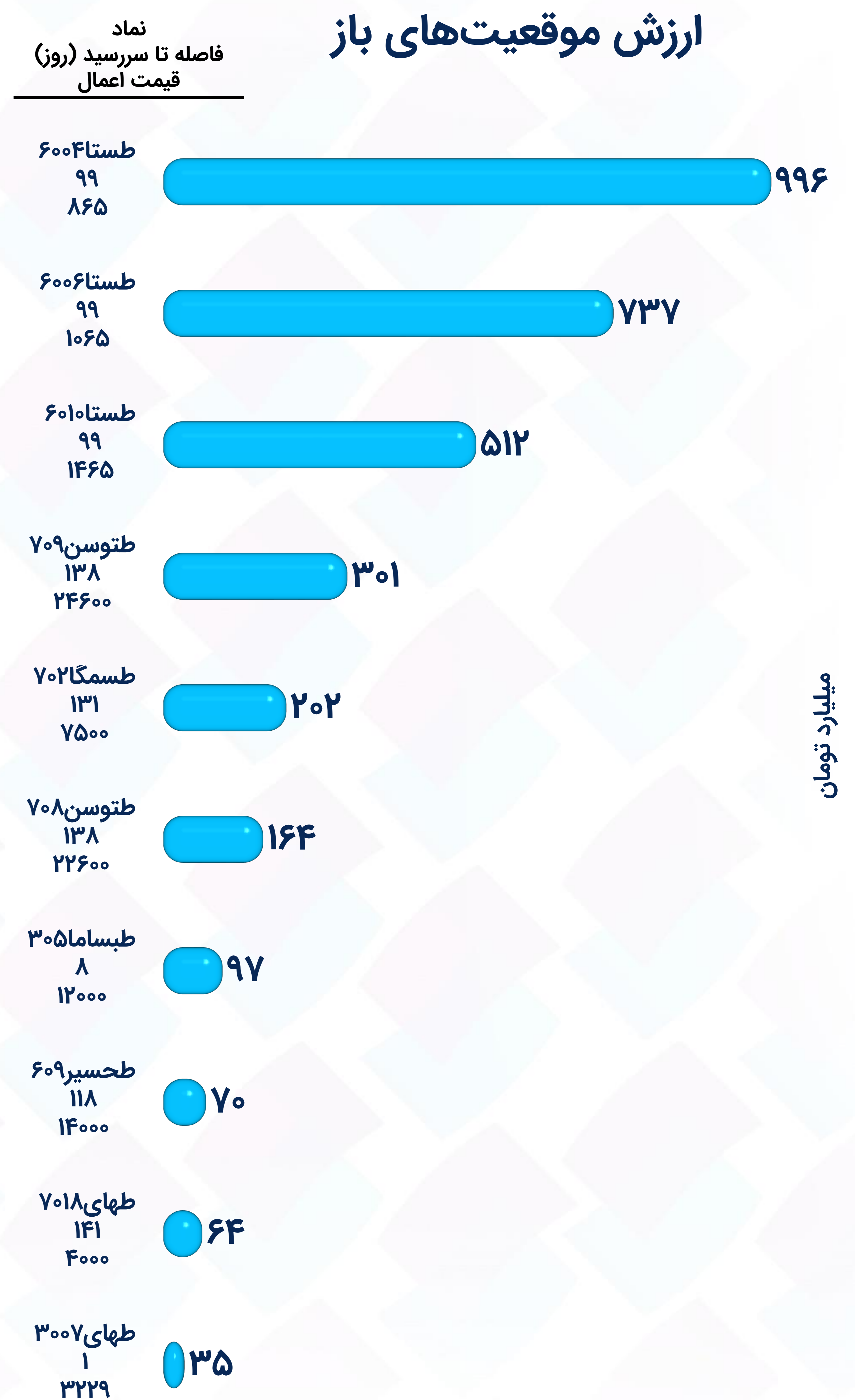
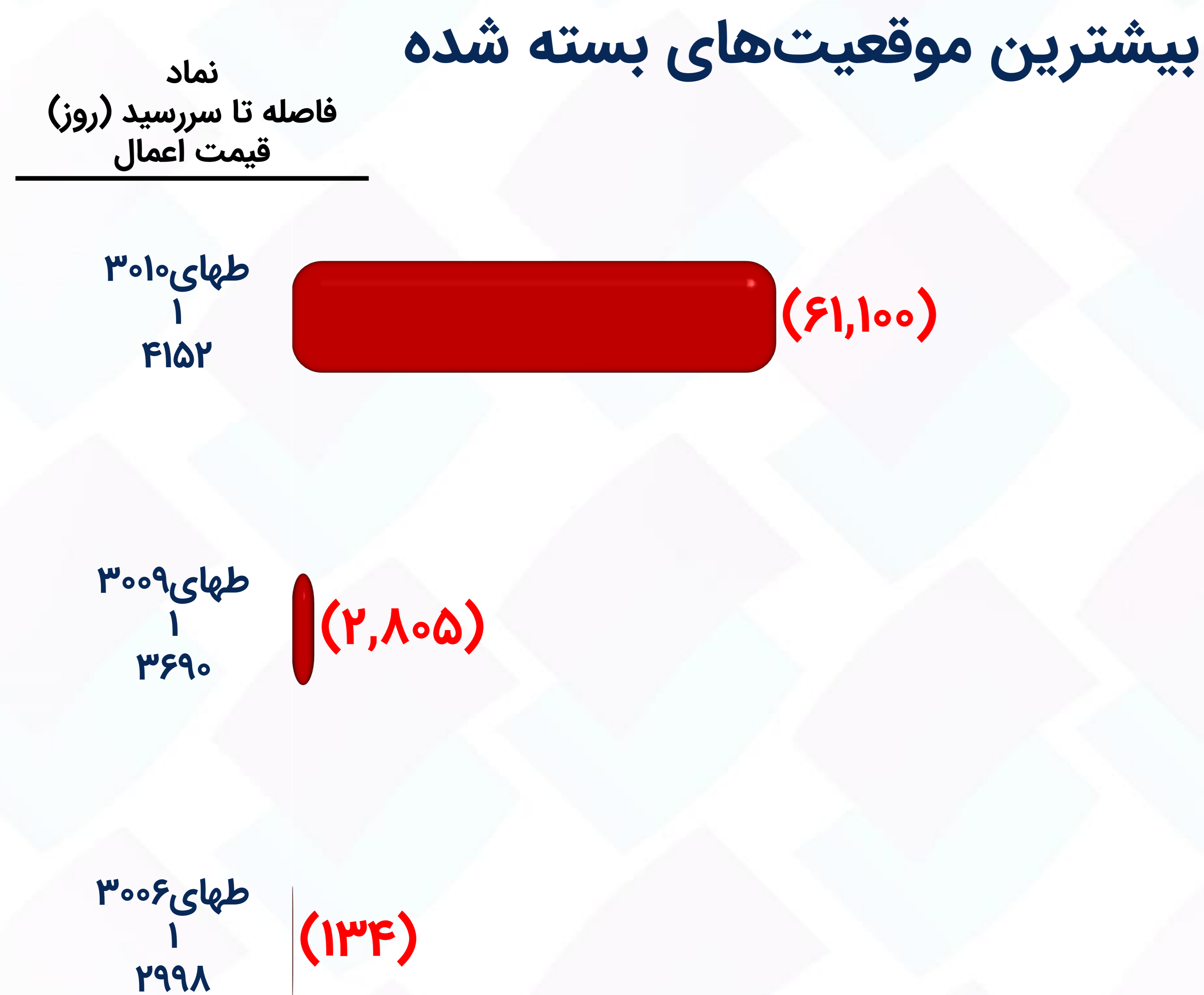
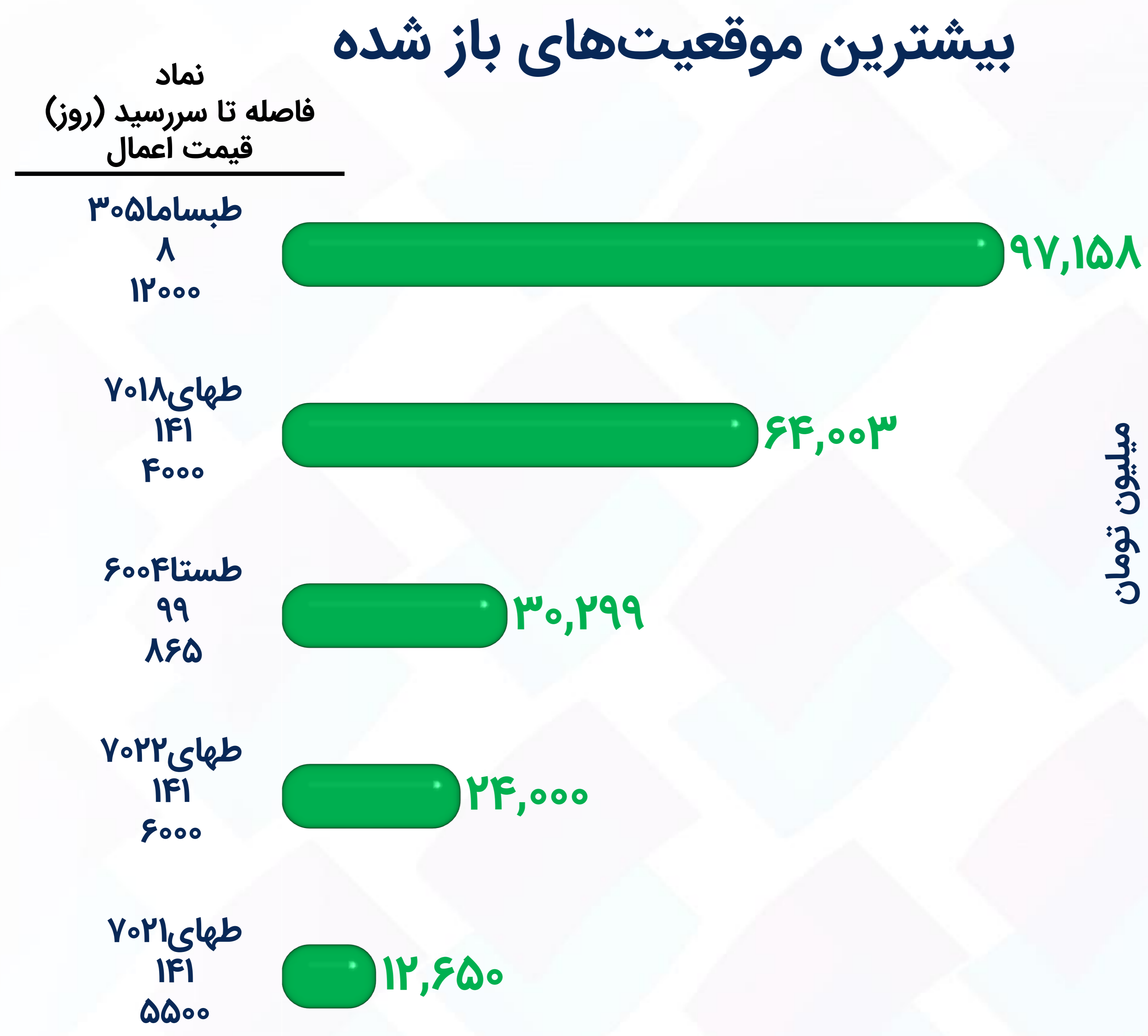


میلیون تومان



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

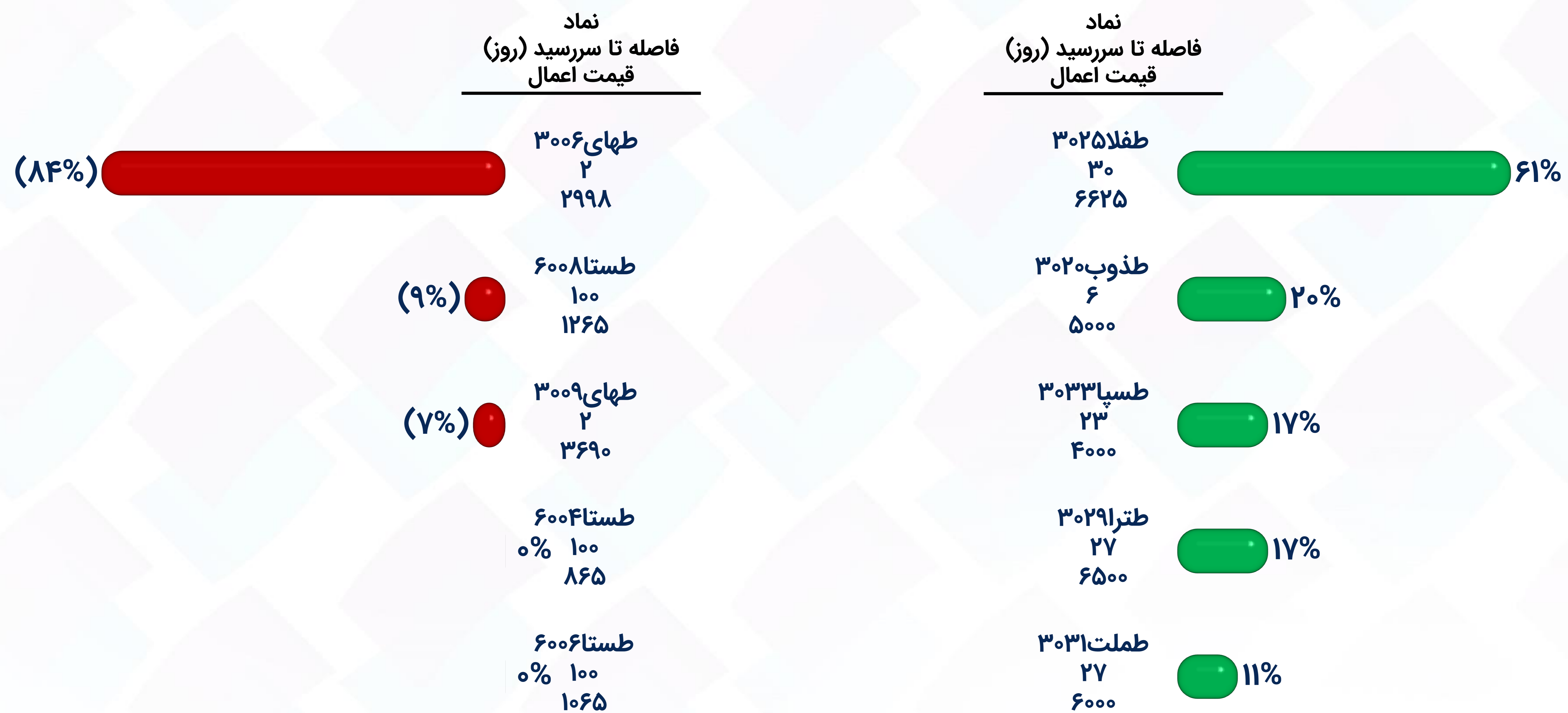


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

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.