

شماره

۱۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۶ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

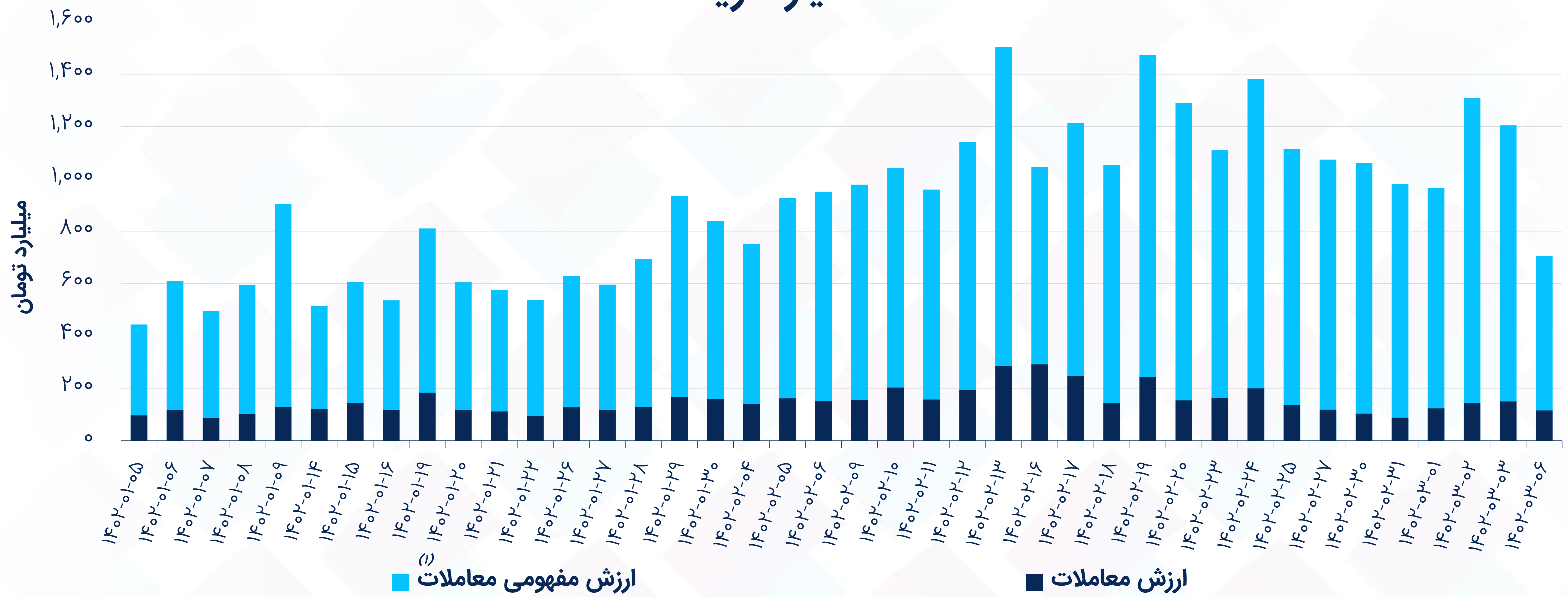




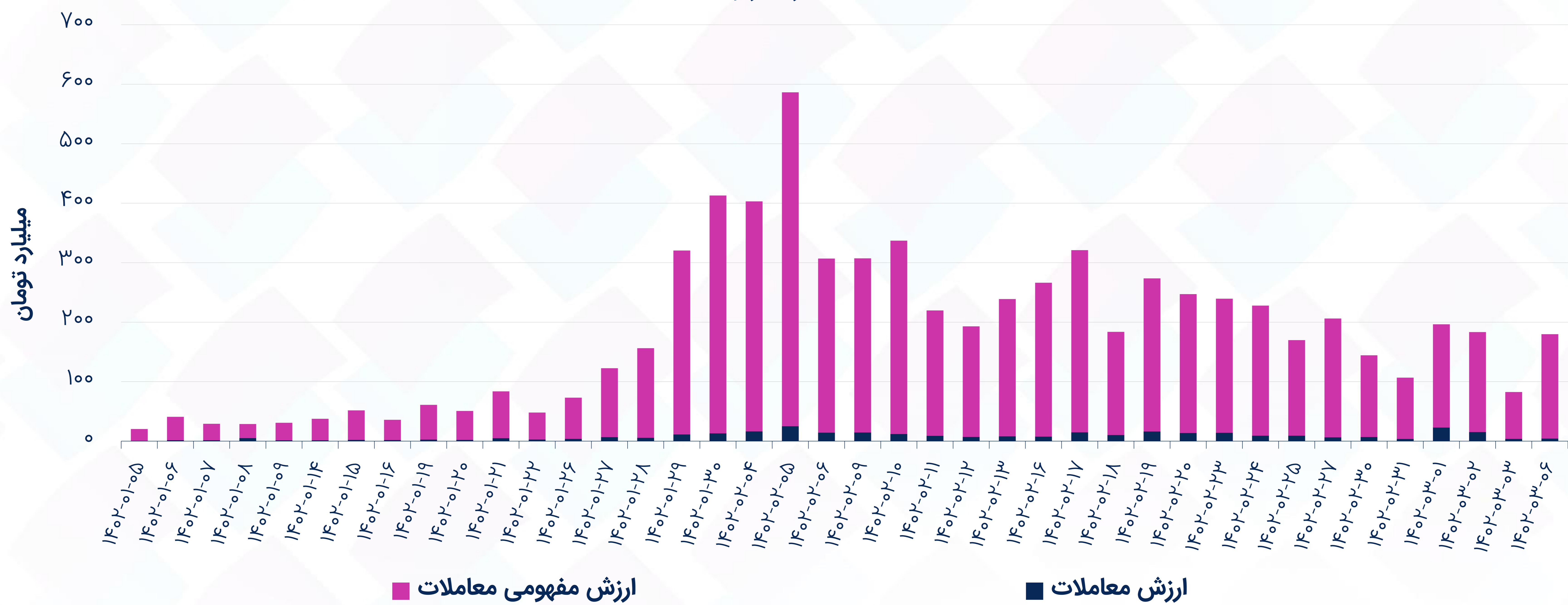
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



اختیار فروش



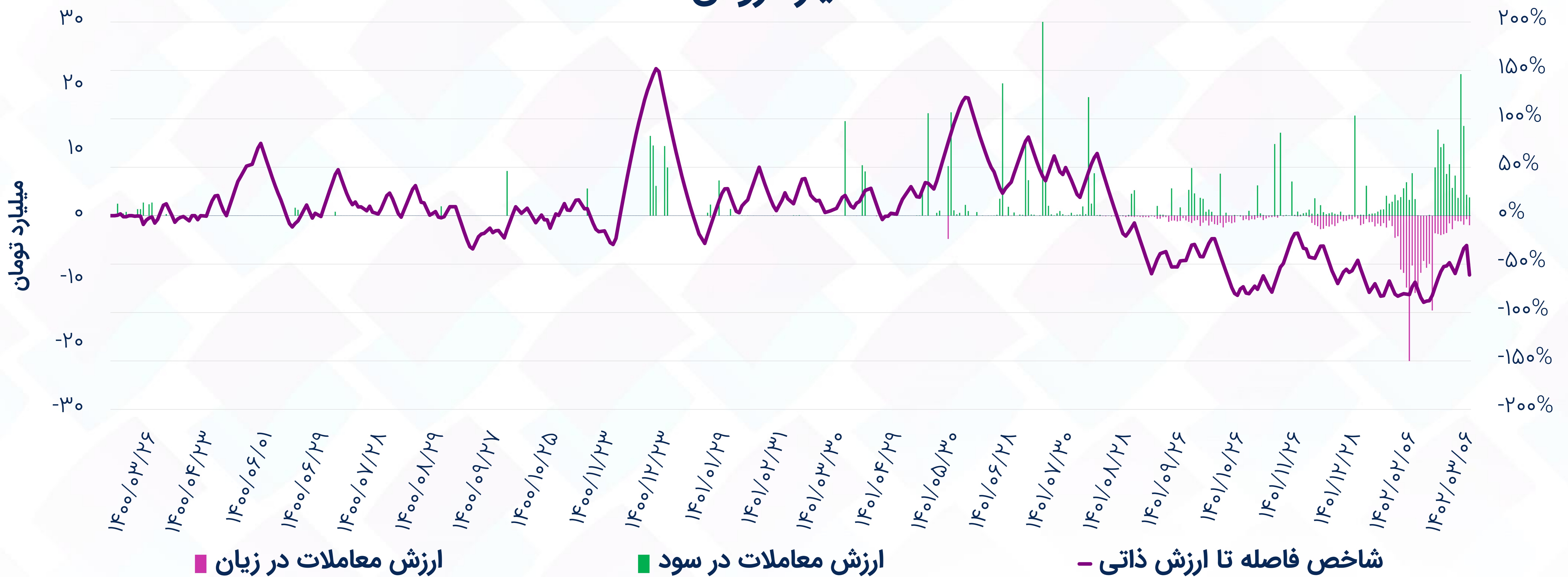
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

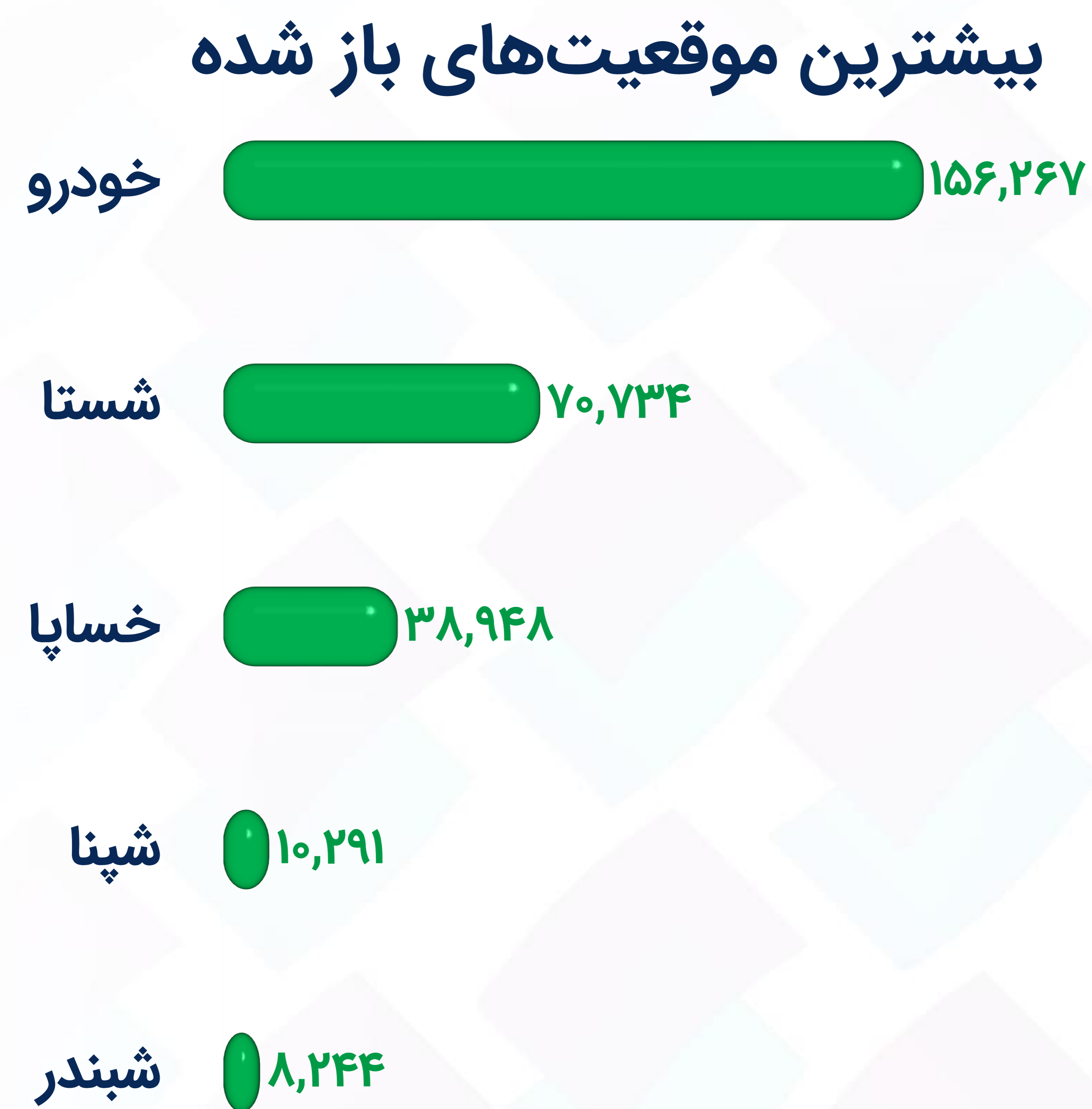
اختیار خرید

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	۲۸	۴۳.۳	۲۲۲.۹	۳۷.۲	۶.۲	(۲۷.۲%)
شستا	۳۷	۳۲.۴	۲۰۵.۳	۱۳.۱	۱۹.۳	(۳۷.۳%)
خسپا	۲۹	۱۹.۹	۱۴۲.۶	۱۸.۹	۱.۰	(۲۰.۱%)
وبملت	۱۲	۲.۸	۹.۳	۲.۷	۰.۰	۹.۳%
وبصادر	۱۷	۲.۴	۲۸.۳	۲.۳	۰.۱	(۲.۸%)
وتجارت	۱۰	۲.۱	۶.۹	۱.۹	۰.۲	(۱۳.۲%)
کرمان	۶	۱.۹	۳.۹	۱.۸	۰.۰	(۱۲.۶%)

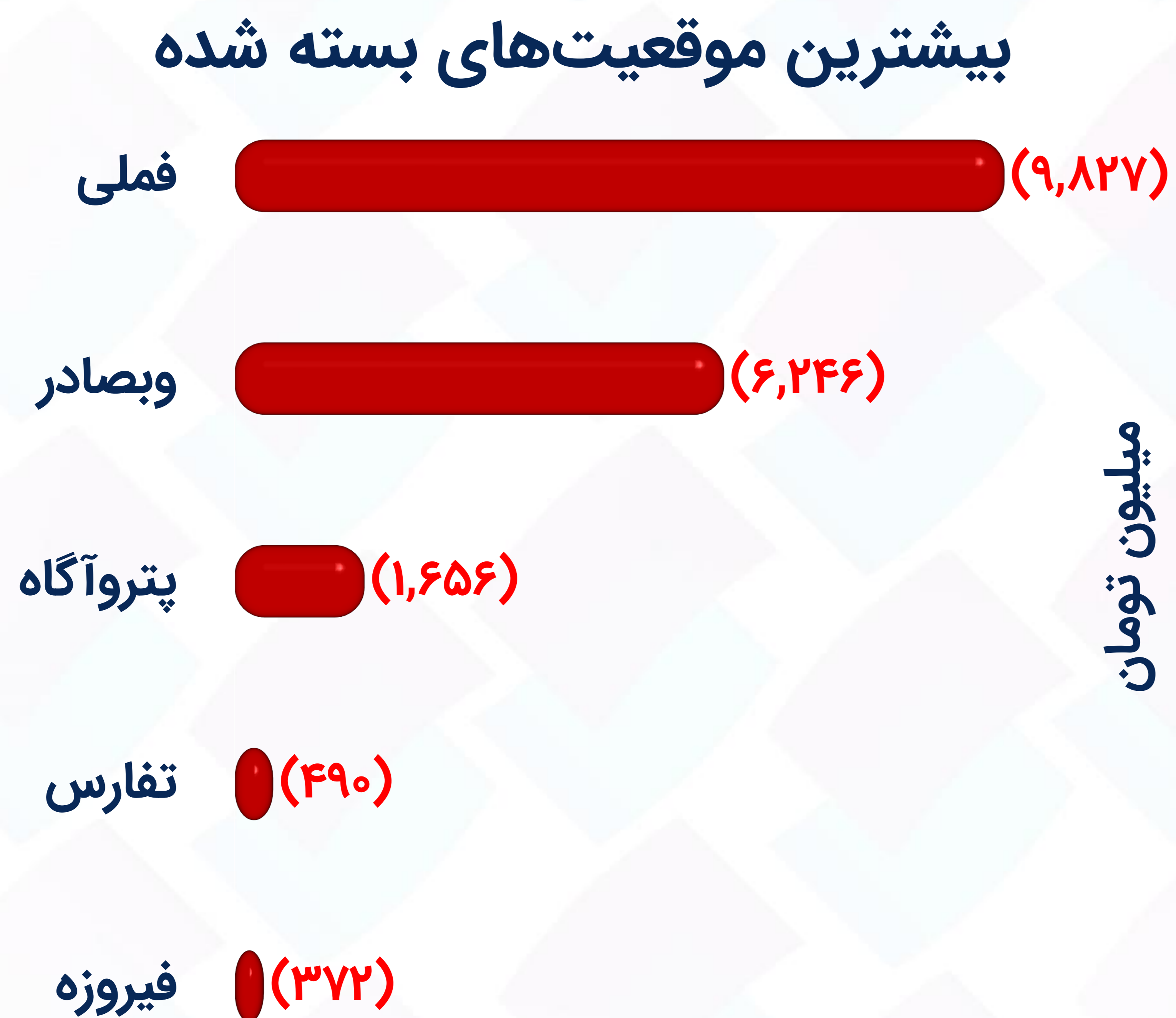
اختیار فروش

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	۱۳	۴,۲۷۹.۹	۱۷۹,۴۶۷.۶	۲,۸۰۶.۰	۱,۴۷۳.۹	(۶۱.۵%)
فولاد	۲	۸.۵	۱۱۸.۹	۸.۵	۰.۰	(۱۲.۵%)
فملی	۲	۶.۶	۱۳۱.۰	۶.۶	۰.۰	(۷.۹%)
توسن	۱	۶.۱	۳۲.۷	۶.۱	۰.۰	(۲.۴%)
شپنا	۴	۳.۸	۲۳.۴	۳.۸	۰.۰	(۱۴.۹%)
شبندر	۲	۱.۱	۱۰.۱	۱.۱	۰.۰	(۷.۱%)
شتران	۲	۰.۳	۱.۸	۰.۳	۰.۰	(۸.۰%)

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



میلیون تومان



میلیون تومان



میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

شستا ۲,۳۱۸.۰

توسن ۴۶۴.۹

سمگا ۲۰۵.۰

حسیر ۱۰۴.۱

های وب ۱۰۰.۷

بساما ۹۷.۲

فملی ۳.۰

اهرم ۲.۷

فولاد ۲.۵۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده

شستا ۲۶,۵۸۹

شپنا ۶

شبندر ۵

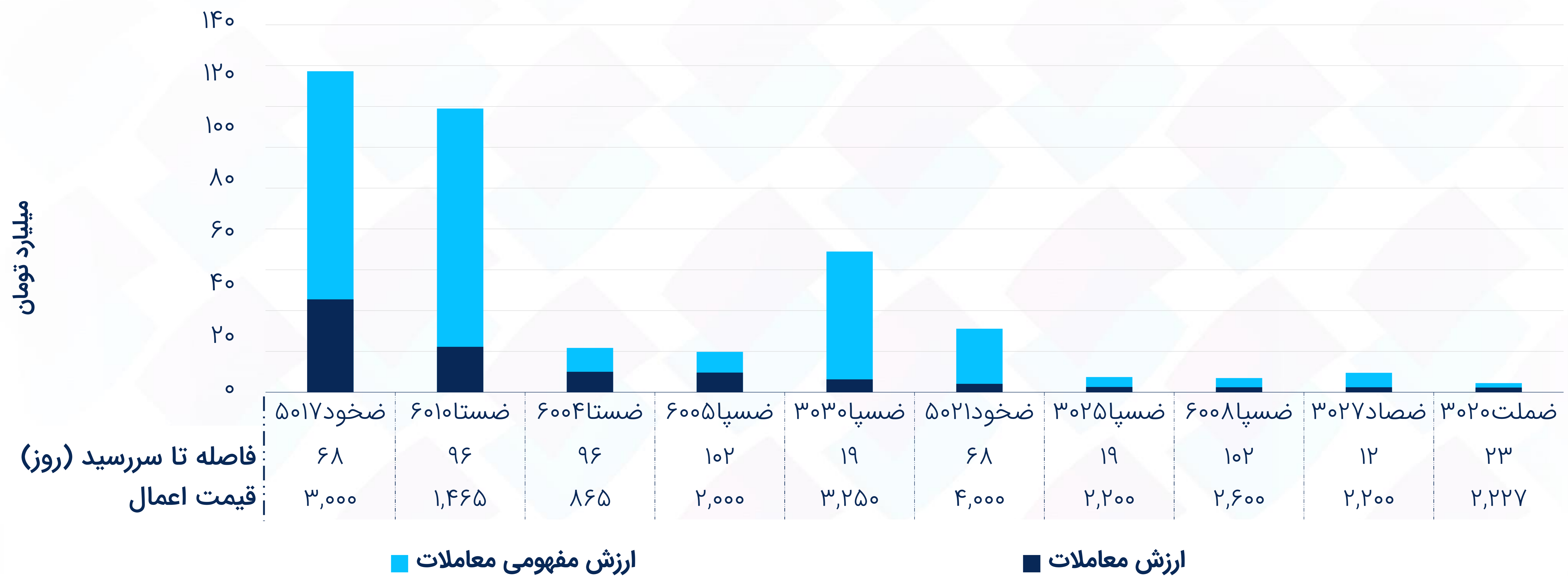
خودرو ۳

خیارس ۲

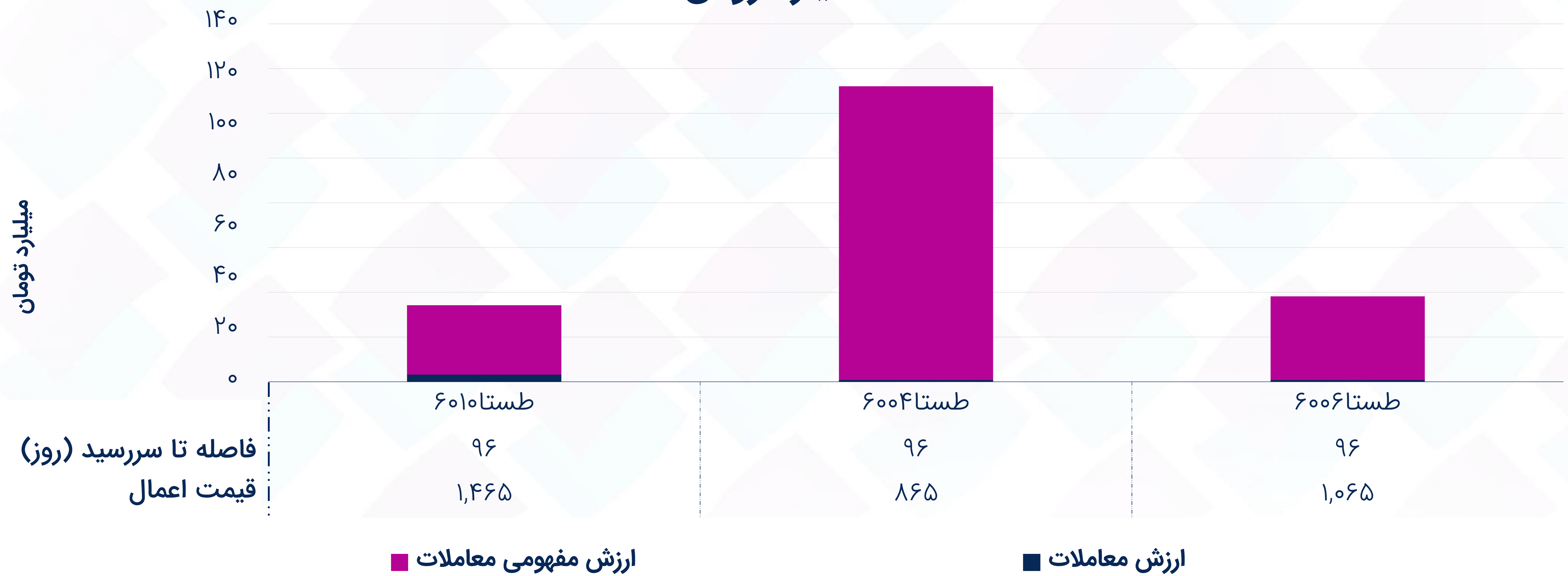
میلیون تومان

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
۶۲%	۱۱,۲۰۷	۰.۹۳	۳.۳	(۳.۵%)	۲۲,۹۱۵	۲۳,۷۴۰	۶,۹۱۵	۱۸۲.۶	۲۹۲	۱۶,۰۰۰	اهرم ۱۲۲۲
۶۰%	۸۵۹	۰.۹۲	۲۵.۳	(۱.۸%)	۱۳,۵۳۶	۱۳,۷۹۰	۵۳۶	۶.۷	۵	۱۳,۰۰۰	بساما ۳۰۶
۵۶%	۱,۸۳۳	۱.۰۰	۱۱.۲	(۴.۵%)	۱۳,۱۷۳	۱۳,۷۹۰	۱,۱۷۳	۵۲.۹	۵	۱۲,۰۰۰	بساما ۳۰۵
۴۹%	۳۰۰	۰.۸۳	۲۵.۹	(۰.۶%)	۵,۲۰۱	۵,۲۳۰	۲۰۱	۱۶۷.۲	۱۲	۵,۰۰۰	و خاور ۳۰۰۸
۲۸%	۱,۵۳۸	۱.۰۰	۲.۵	(۹.۴%)	۳,۰۰۱	۳,۳۱۴	۱,۲۰۱	۴.۸	۱۹	۱,۸۰۰	خسپا ۳۰۲۲

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	۴۵۱.۰	۲۹%	۱,۸۰۴	۱,۳۹۸	۴	۱۵.۳	۱۲	۱,۸۰۰	شستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۷۵.۱	۴۵%	۲,۰۲۷	۱,۳۹۸	۲۷	۶۸۵.۶	۴۰	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۳۰۱.۰	۲۴%	۶,۵۰۵	۵,۲۳۰	۵	۲.۲	۱۲	۶,۵۰۰	و خاور ۳۰۱۱
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۶۲.۳	۳۸%	۱,۹۳۱	۱,۳۹۸	۳۱	۱۵.۳	۴۰	۱,۹۰۰	شستا ۴۰۱۰
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۱۱۱.۰	۵۲%	۵,۵۵۰	۳,۶۶۰	۵۰	۵۸۱.۳	۳۳	۵,۵۰۰	خودرو 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 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 سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طوسن ۷۰۹	توسن	۲۴,۶۰۰	۱۳۵	۶.۱	۳,۵۹۹	۱۹,۲۲۰	۲۱,۰۰۱	۹%	۵.۸	-۰.۷۷	۳,۵۱۲	(۲.۴%)
طملی ۳۰۲۷	فملی	۸,۰۰۰	۲	۶.۶	۴۳۴	۷,۵۹۰	۷,۵۶۶	(۰%)	۱۷.۴	-۰.۹۸	۴۰۰	(۷.۸%)
طفلا ۳۰۲۵	فولاد	۶,۶۲۵	۲۶	۸.۳	۴۴۰	۶,۲۵۰	۶,۱۸۵	(۱%)	۱۴.۱	-۰.۶۵	۳۸۷	(۱۲.۲%)
طشنا ۶۰۰۷	شپنا	۱۲,۰۰۰	۸۹	۱.۴	۲,۰۴۳	۹,۷۴۰	۹,۹۵۷	۲%	۴.۹	-۰.۷۴	۱,۷۸۱	(۱۲.۸%)
طشنا ۶۰۰۶	شپنا	۱۱,۰۰۰	۸۹	۱.۶	۱,۳۲۱	۹,۷۴۰	۹,۶۷۹	(۱%)	۷.۳	-۰.۵۸	۱,۰۹۵	(۱۷.۱%)

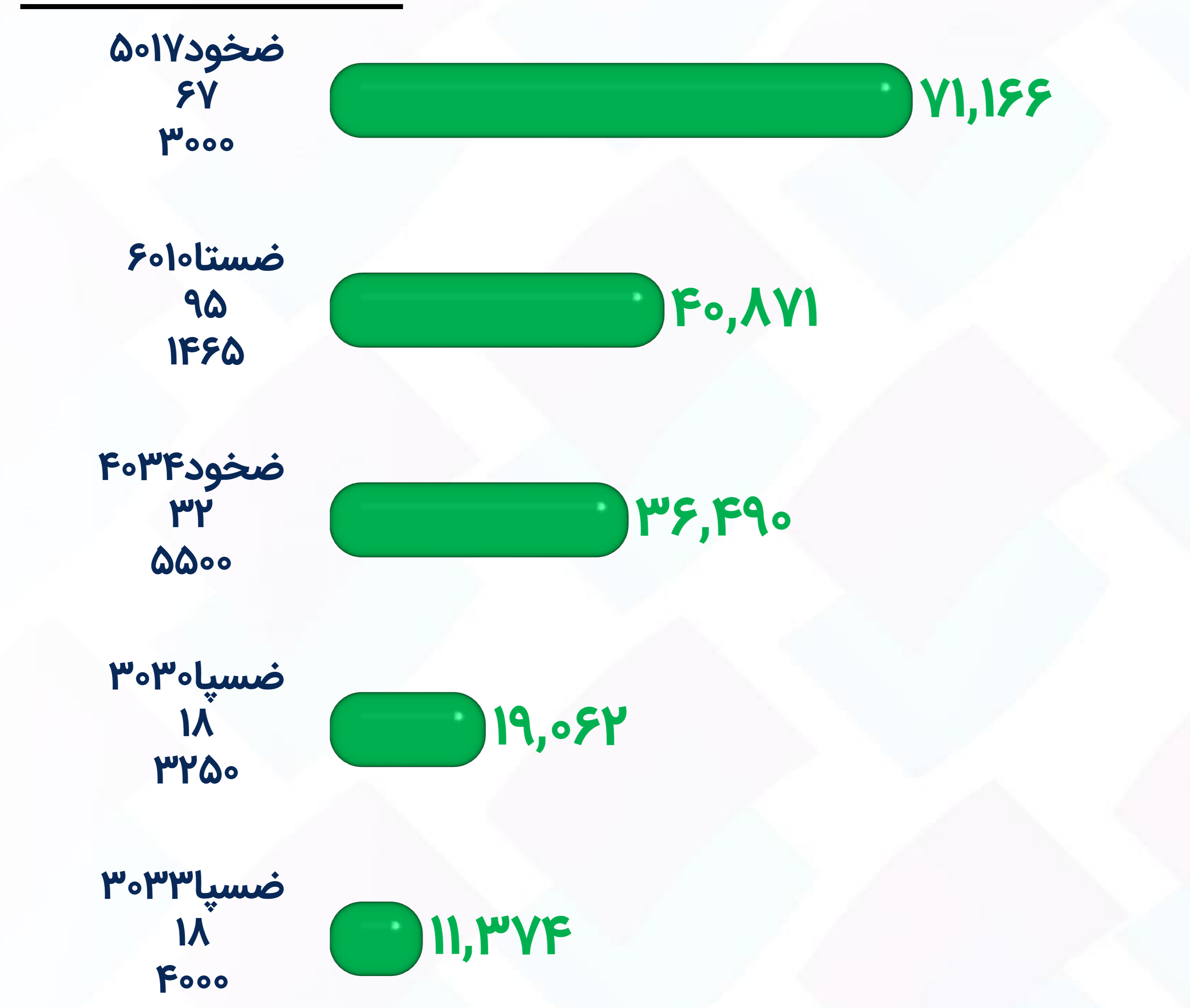
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۶۰۰۴	شستا	۸۶۵	۹۶	۷۴۴.۴	۹	۱,۳۹۸	۸۵۶	(۳۹%)	۹۵.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
طستا ۶۰۰۵	شستا	۹۶۵	۹۶	۳.۲	۱۵	۱,۳۹۸	۹۵۰	(۳۲%)	۶۳.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
طستا ۶۰۰۶	شستا	۱,۰۶۵	۹۶	۷۱۶.۱	۳۰	۱,۳۹۸	۱,۰۳۵	(۲۶%)	۳۴.۵	-۰.۰۱	۱	(۹۶%)
طستا ۶۰۰۷	شستا	۱,۱۶۵	۹۶	۱۰.۰	۶۳	۱,۳۹۸	۱,۱۰۲	(۲۱%)	۱۷.۵	-۰.۰۵	۵	(۹۱%)
طستا ۶۰۱۰	شستا	۱,۴۶۵	۹۶	۲,۸۰۴.۷	۱۳۱	۱,۳۹۸	۱,۳۳۴	(۵%)	۱۰.۲	-۰.۴۱	۷۵	(۴۲%)

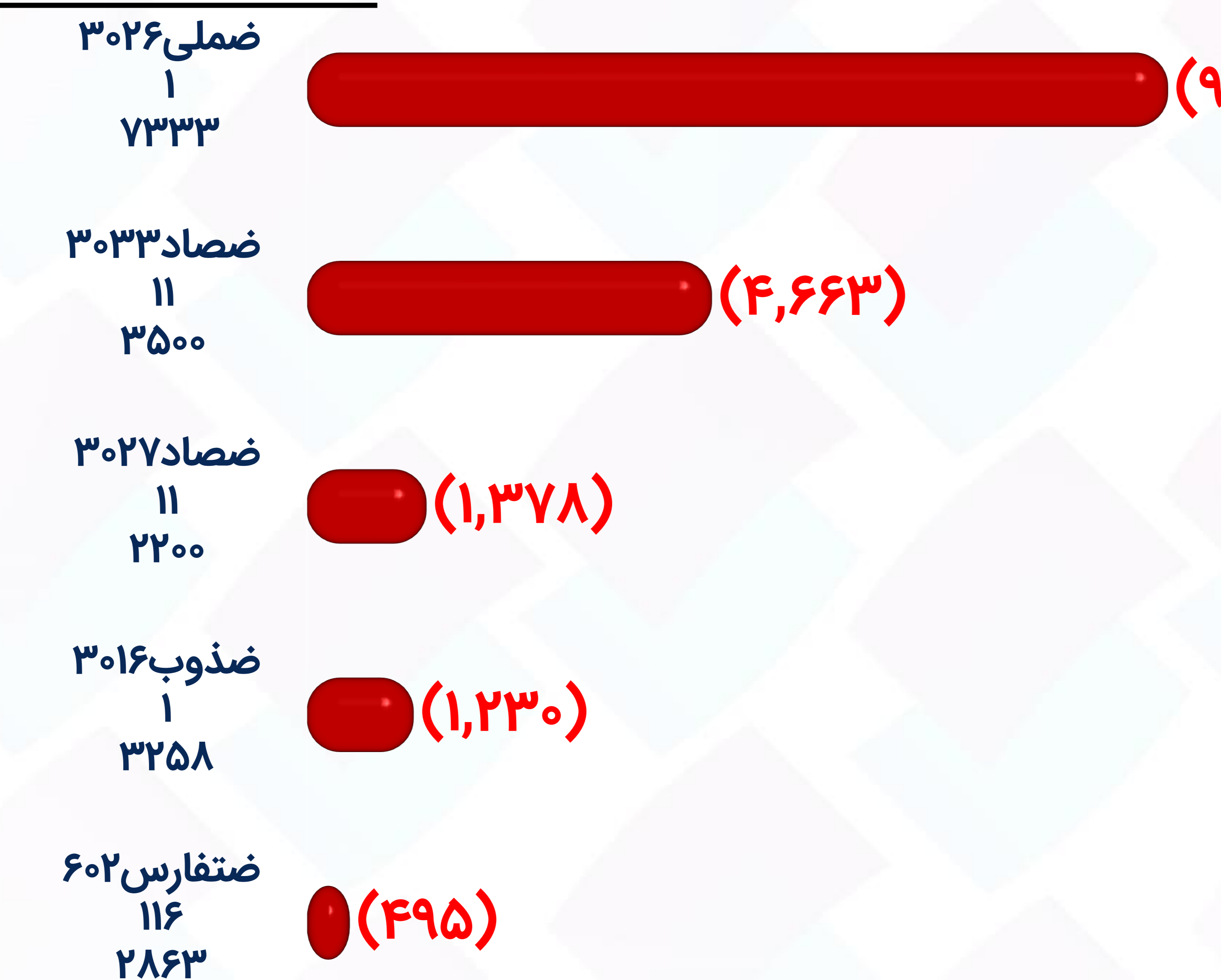
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال

طستا۰۱
۹۵
۱۴۶۵ ۱۵,۱۲۰

طستا۰۴
۹۵
۱۸۶۵ ۹,۶۸۶

طستا۰۱
۱۱
۱۶۰۰ ۱,۷۸۹

طستا۰۵
۹۵
۹۶۵ ۱۹۴

طستا۰۷
۹۵
۱۱۶۵ ۱۱۸۱

بیشترین موقعیت‌های بسته شده

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال

طستا۰۶
۹۵
۱۰۶۵ (۳۸۶)

میلیون تومان

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال

طستا۰۴
۹۵
۱۸۶۵ ۱,۰۲۱

طستا۰۶
۹۵
۱۰۶۵ ۷۴۲

طستا۰۱
۹۵
۱۴۶۵ ۵۴۰

طتوسن۰۹
۱۳۴
۲۴۶۰۰ ۳۰۱

طسمگا۰۲
۱۲۷
۷۵۰۰ ۲۰۲

طتوسن۰۸
۱۳۴
۲۲۶۰۰ ۱۶۴

طبساما۰۵
۴
۱۲۰۰۰ ۹۷

طحسیر۰۹
۱۱۴
۱۴۰۰۰ ۷۰

طهای۰۱۸
۱۳۷
۴۰۰۰ ۶۴

طحسیر۰۶
۱۱۴
۲۲۰۰۰ ۳۴

میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

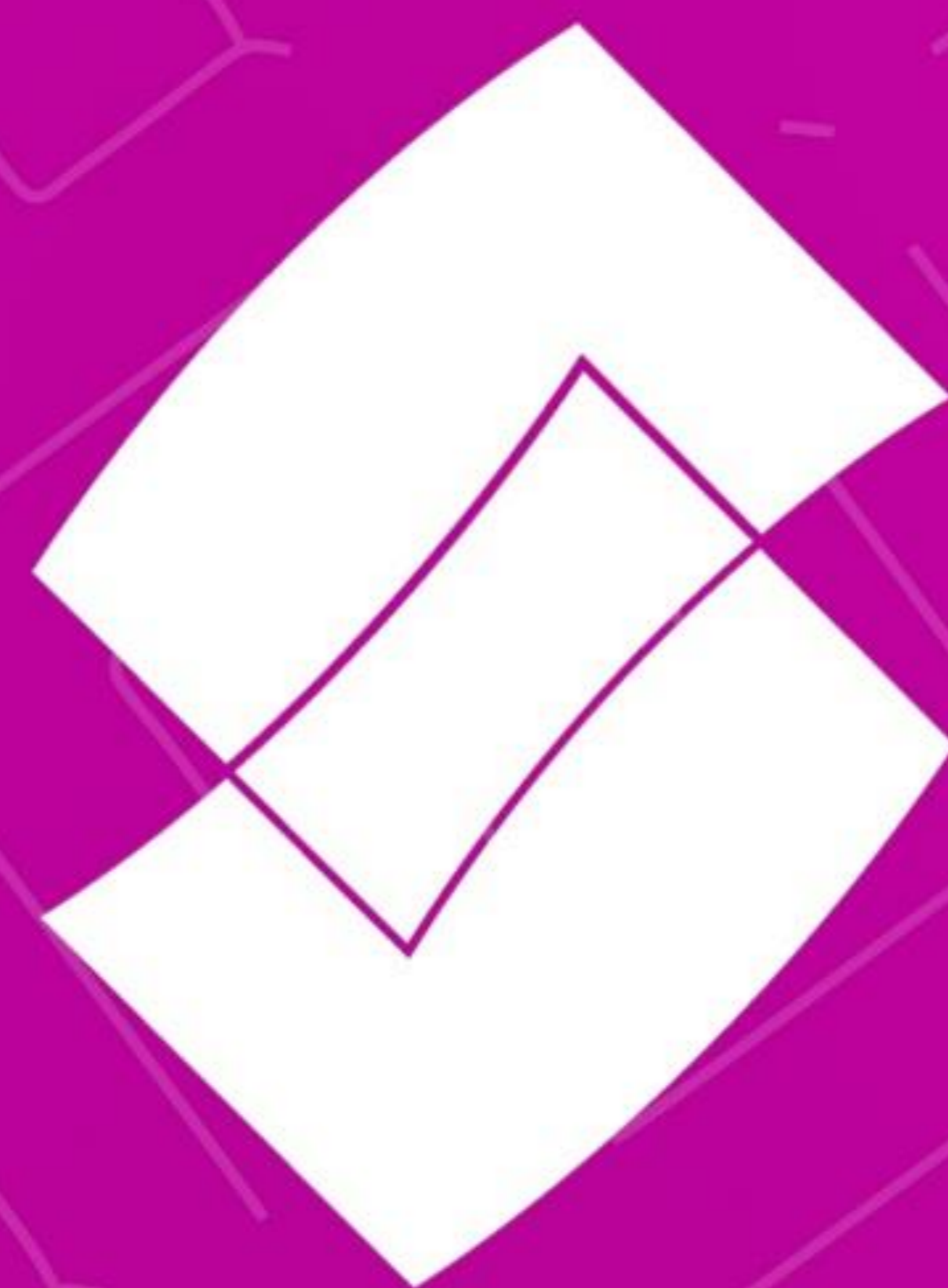
اختیار خرید



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.