

شماره

۱۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

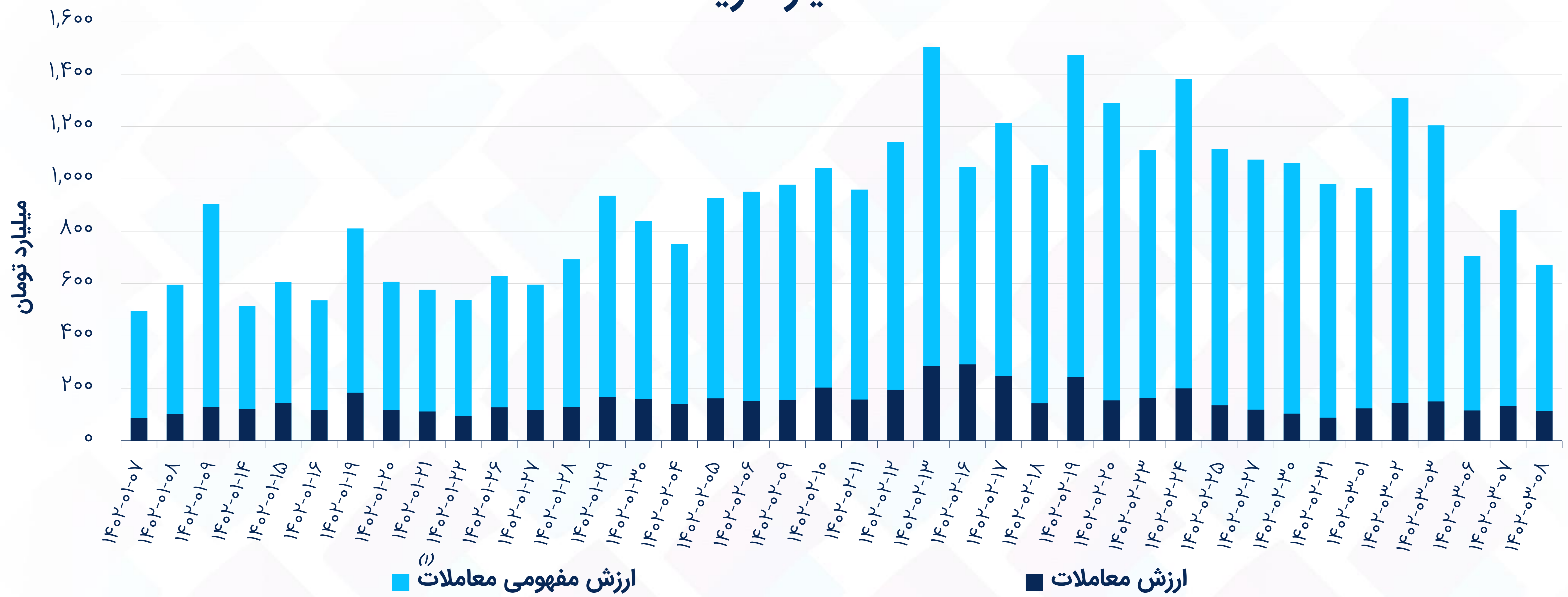




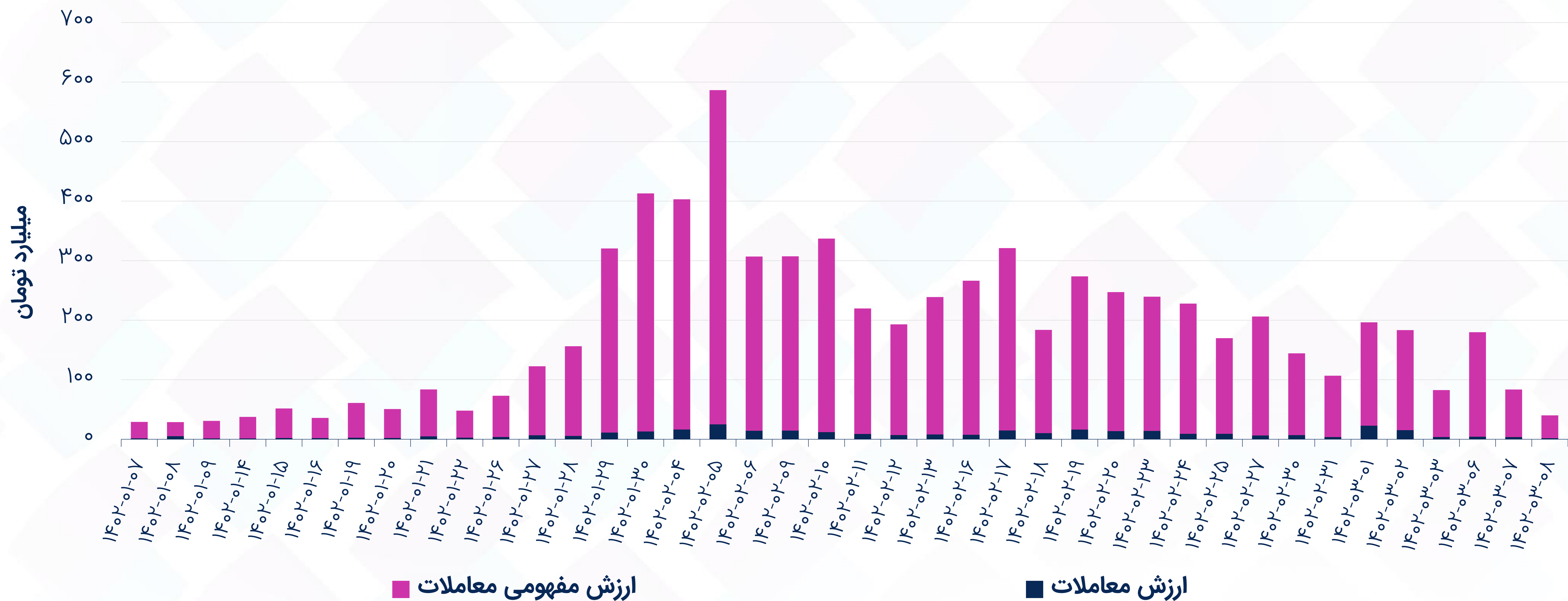
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



اختیار فروش



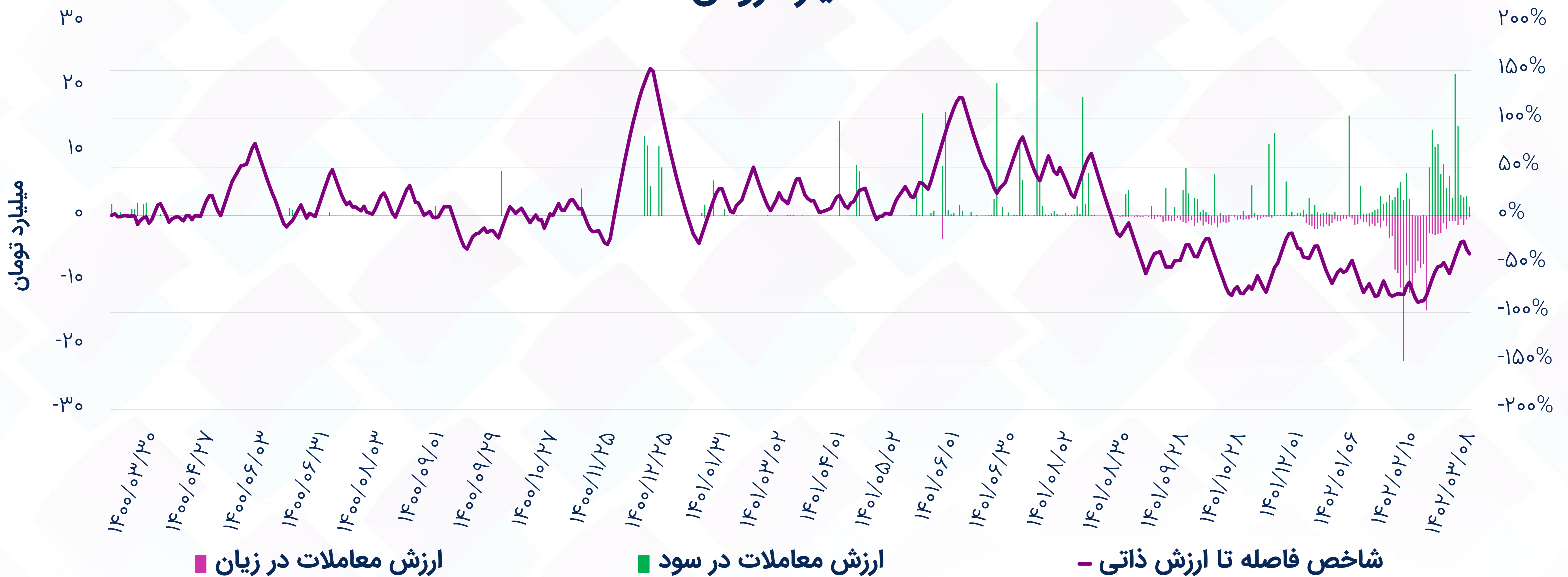
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

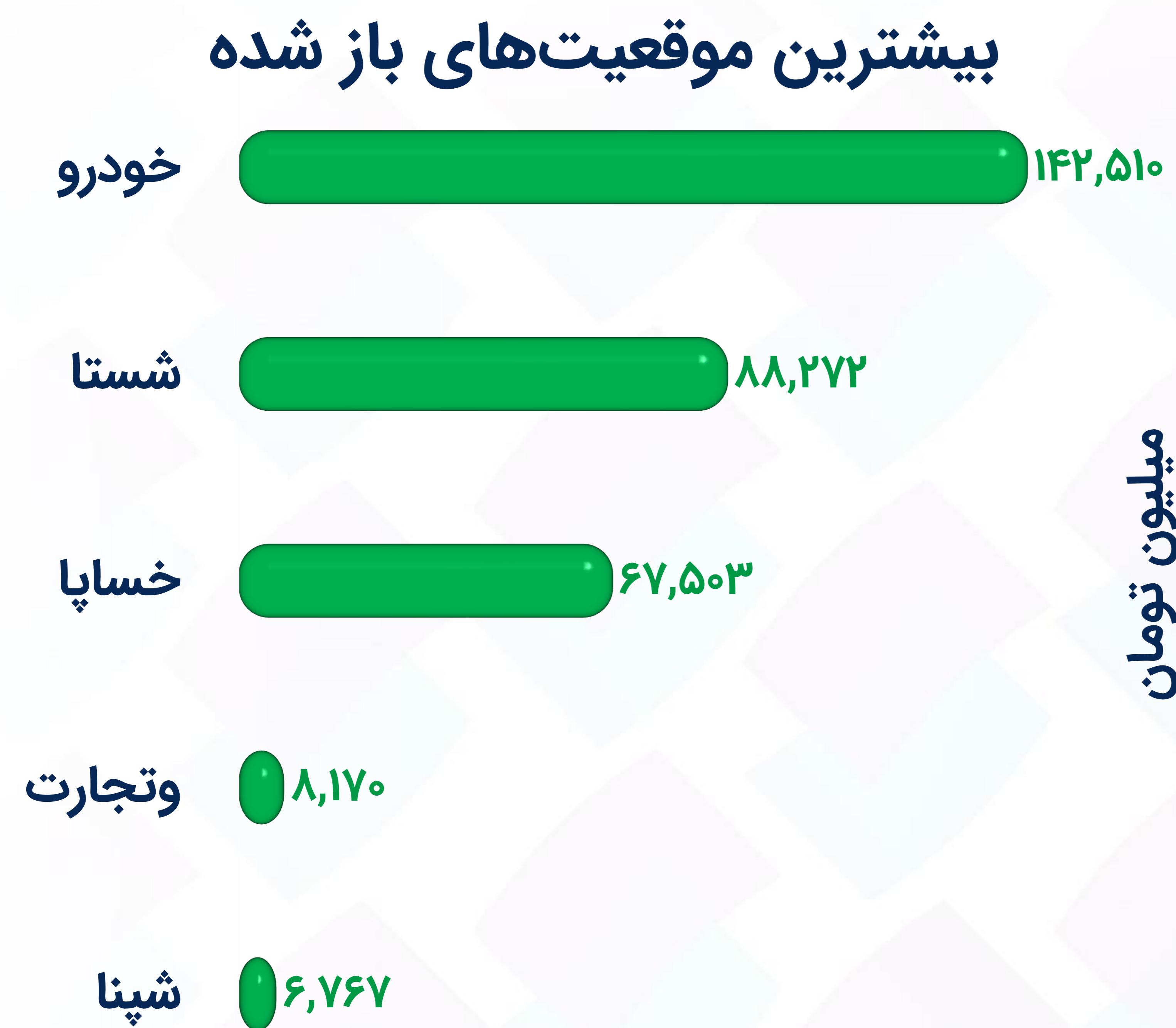
اختیار خرید

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
خودرو	۳۱	۳۸.۶	۲۵۰.۷	۳۰.۴	۸.۲	(۳۰.۲%)
شستا	۴۱	۲۰.۸	۱۷۱.۷	۹.۷	۱۱.۱	(۳۶.۳%)
اهرم	۱۳	۲۰.۱	۳۲.۶	۲۰.۰	۰.۱	(۱۳.۱%)
خسپا	۲۲	۱۶.۹	۱۳۵.۸	۱۲.۶	۴.۳	(۱۷.۶%)
دی	۶	۳.۶	۷.۶	۳.۶	۰.۰	(۵.۶%)
وبصادر	۱۸	۲.۱	۱۶.۴	۱.۵	۰.۶	(۱۱.۳%)
وتجارت	۱۰	۲.۰	۸.۵	۱.۷	۰.۳	(۲۳.۹%)

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
شستا	۷	۱,۶۳۶.۶	۴۰,۱۰۰.۷	۱,۳۹۹.۴	۲۳۷.۳	(۳۹.۵%)
توسن	۱	۲.۳	۱۳.۴	۲.۳	۰.۰	۱۰.۹%
فولاد	۱	۱.۵	۲۲.۲	۱.۵	۰.۰	۱۰.۳%
شبندر	۱	۱.۰	۱۴.۰	۰.۰	۱.۰	(۳۶.۲%)
سمگا	۱	۰.۱	۰.۹	۰.۰	۰.۱	(۱۰.۳%)

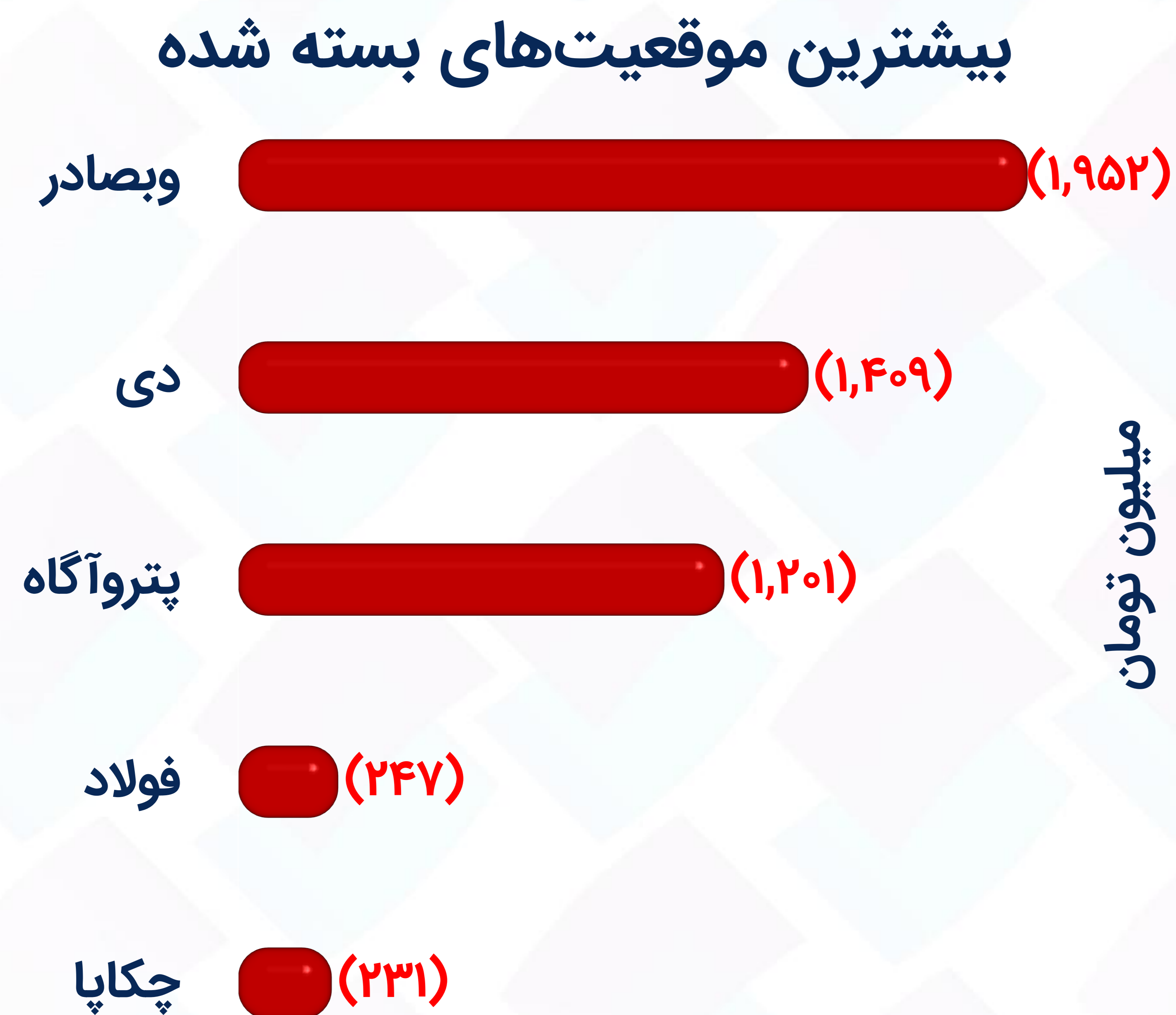
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



میلیون تومان



میلیارد تومان



میلیون تومان

(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

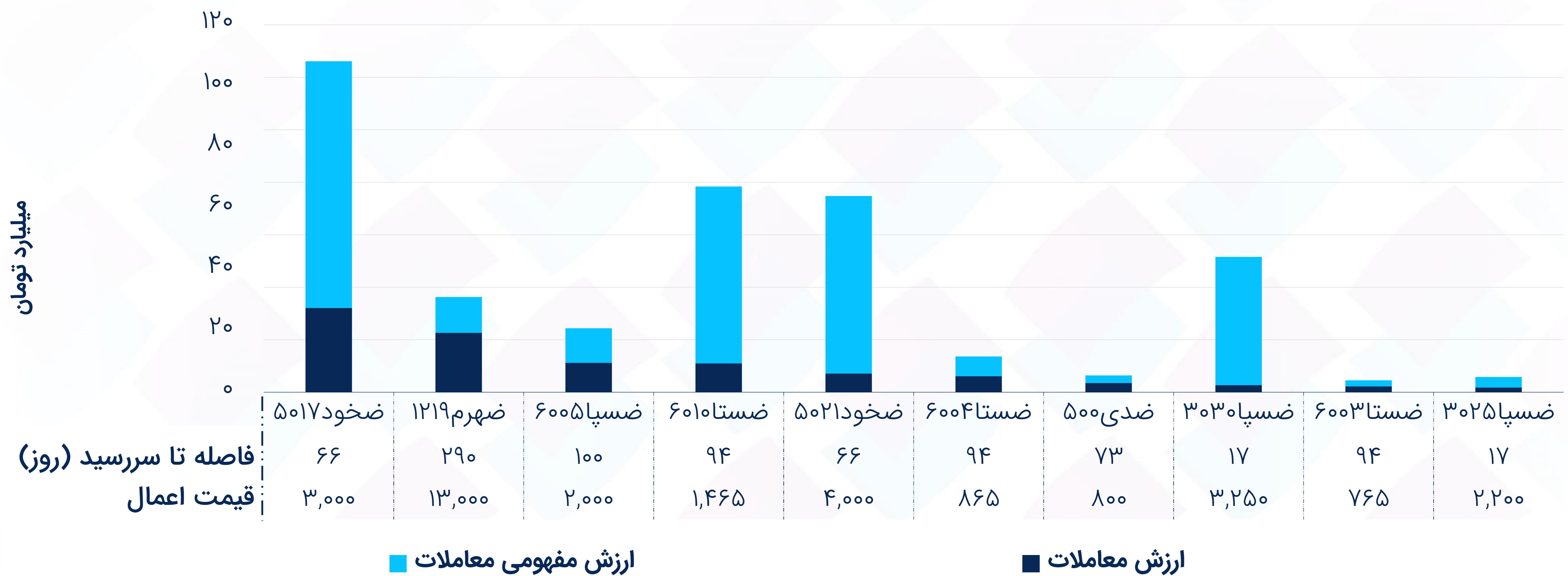
ارزش موقعیت‌های باز



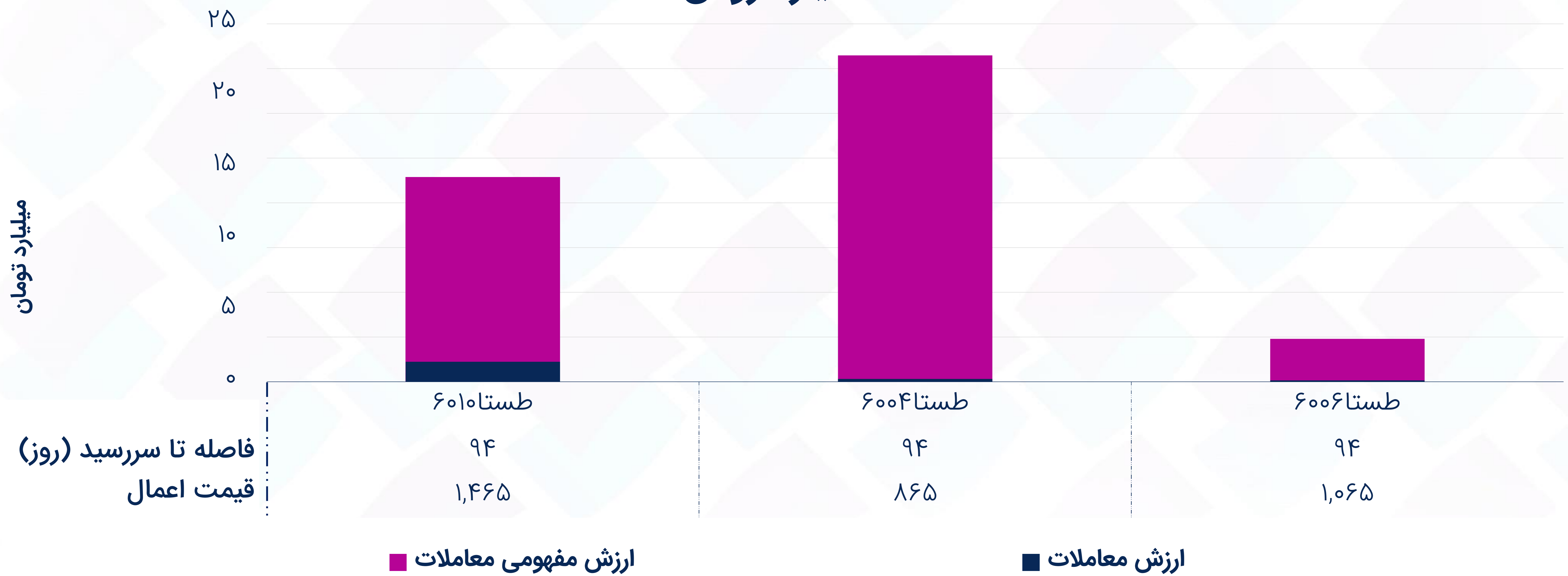
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش 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
۲۱۸%	۱,۹۰۷	۱.۰۰	۸.۲	(۲۰.۱%)	۴,۹۰۶	۶,۱۴۰	۶۰۰	۲.۱	۲۴	۴,۳۰۶	ضفلا ۳۰۲
۱۱۹%	۶,۶۸۶	۰.۸۰	۶.۹	۵.۳%	۲۱,۰۵۹	۱۹,۹۹۲	۳,۰۵۹	۵۸.۱	۲۸۱	۱۸,۰۰۰	ضتوان ۱۲۰۳
۸۷%	۲۶۳	۰.۸۲	۳۶.۵	(۱.۱%)	۵,۱۴۱	۵,۲۰۰	۱۴۱	۱۳۱.۰	۱۰	۵,۰۰۰	ضخا و ۳۰۰۸
۳۵%	۷۱۱	۰.۹۹	۲.۷	(۸.۱%)	۱,۴۲۷	۱,۵۵۳	۵۲۷	۴۳.۲	۹۲	۹۰۰	ضکرمان ۶۰۰
۳۳%	۲۷۱	۰.۶۴	۶۴.۷	۰.۶%	۱۳,۲۰۴	۱۳,۱۳۰	۲۰۴	۱.۲	۳	۱۳,۰۰۰	ضبساما ۳۰۶

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	۱,۸۰۱.۰	۳۲%	۱,۸۰۱	۱,۳۶۰	۱	۱۸.۴	۱۰	۱,۸۰۰	ضستا ۳۰۱۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۰۶.۳	۴۸%	۲,۰۱۹	۱,۳۶۰	۱۹	۳۳۵.۱	۳۸	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۳۱.۸	۵۰%	۶,۰۲۶	۴,۰۲۱	۲۶	۲.۲	۲۸	۶,۰۰۰	ضچکا ۴۰۱۳
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۸۳.۶	۴۱%	۱,۹۲۳	۱,۳۶۰	۲۳	۱۵.۰	۳۸	۱,۹۰۰	ضستا ۴۰۱۰
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۴۵۹.۳	۵۸%	۵,۵۱۲	۳,۴۹۱	۱۲	۱۳۴.۵	۳۱	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 بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

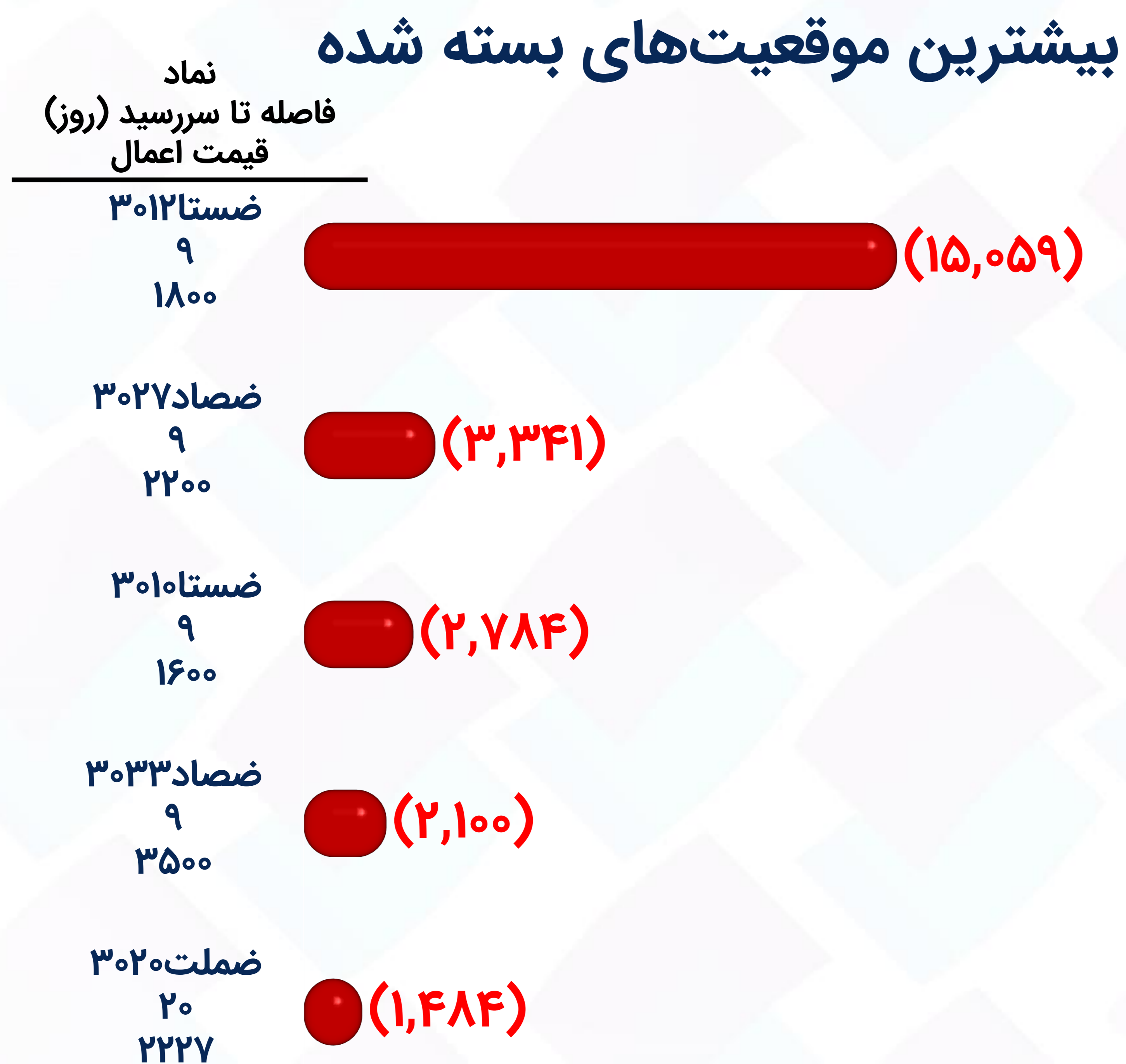
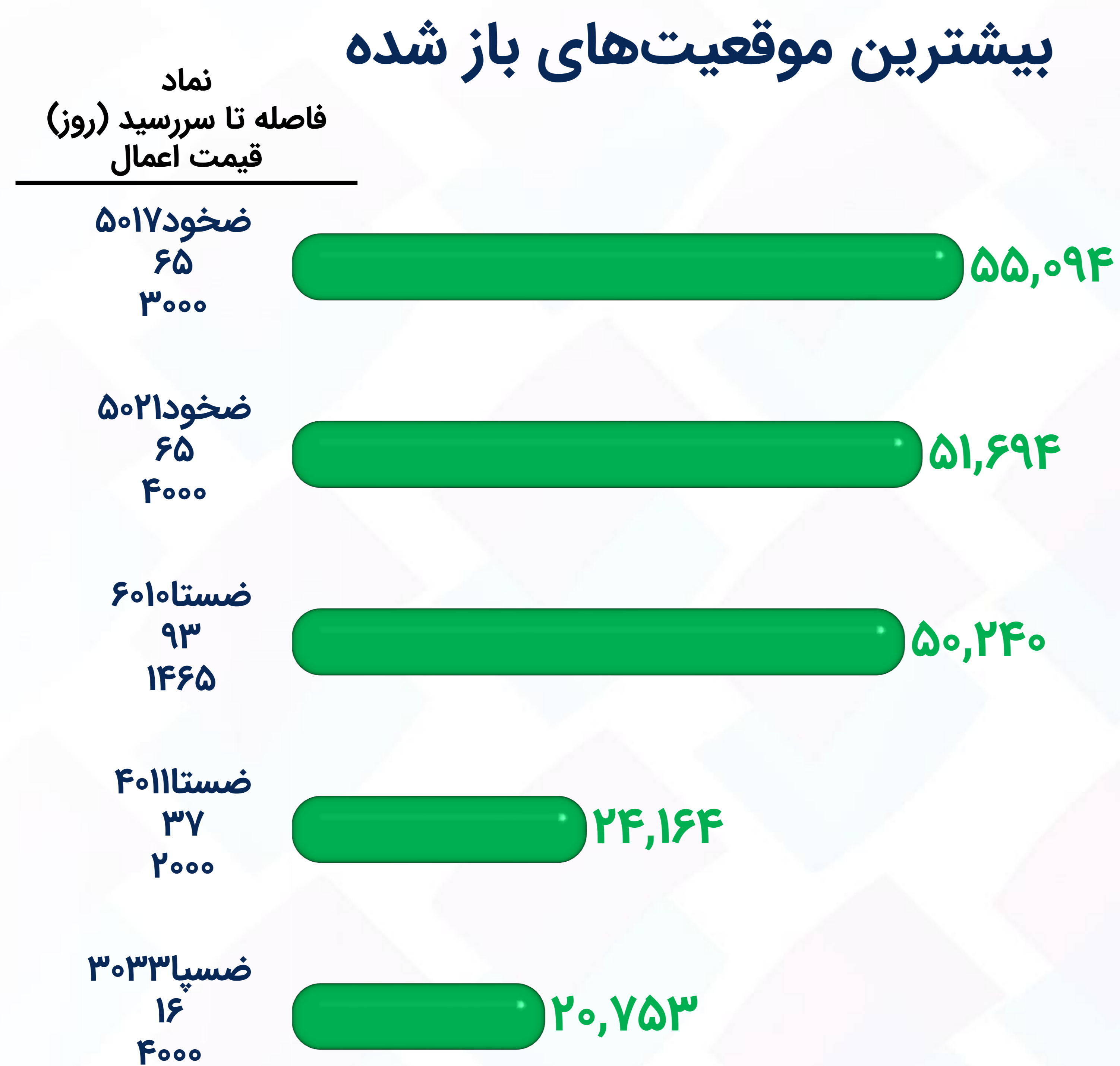
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۱۰.۹%	۳,۶۴۵	-۰.۷۹	۶.۵	۱۲%	۲۱,۳۱۲	۱۹,۱۱۰	۳,۲۸۸	۲.۳	۱۳۳	۲۴,۶۰۰	توسن ۷۰۹
۱۰.۳%	۴۶۲	-۰.۷۳	۱۴.۸	۱%	۶,۲۰۶	۶,۱۴۰	۴۱۹	۱.۵	۲۴	۶,۶۲۵	طلا ۳۰۲۵

گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

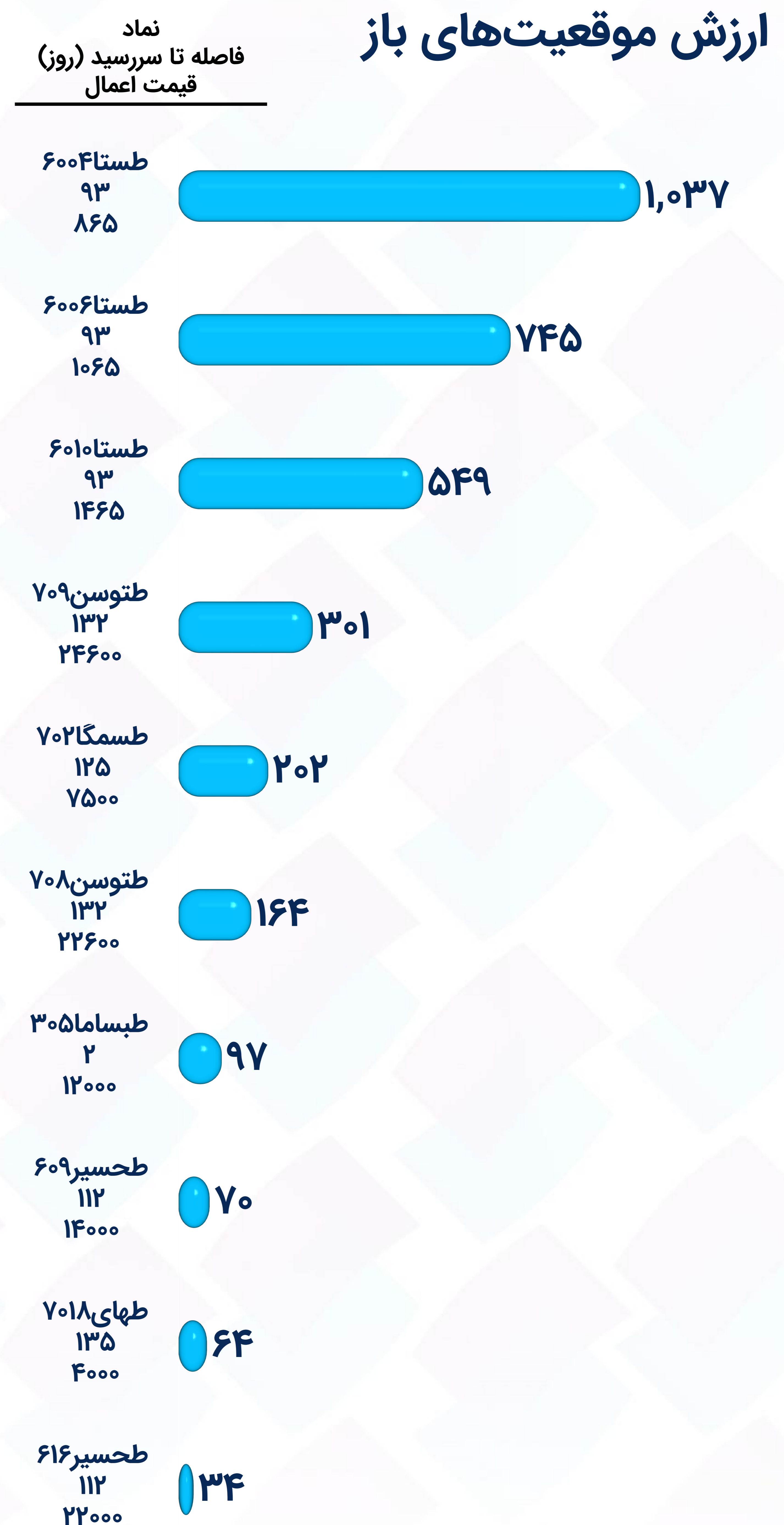
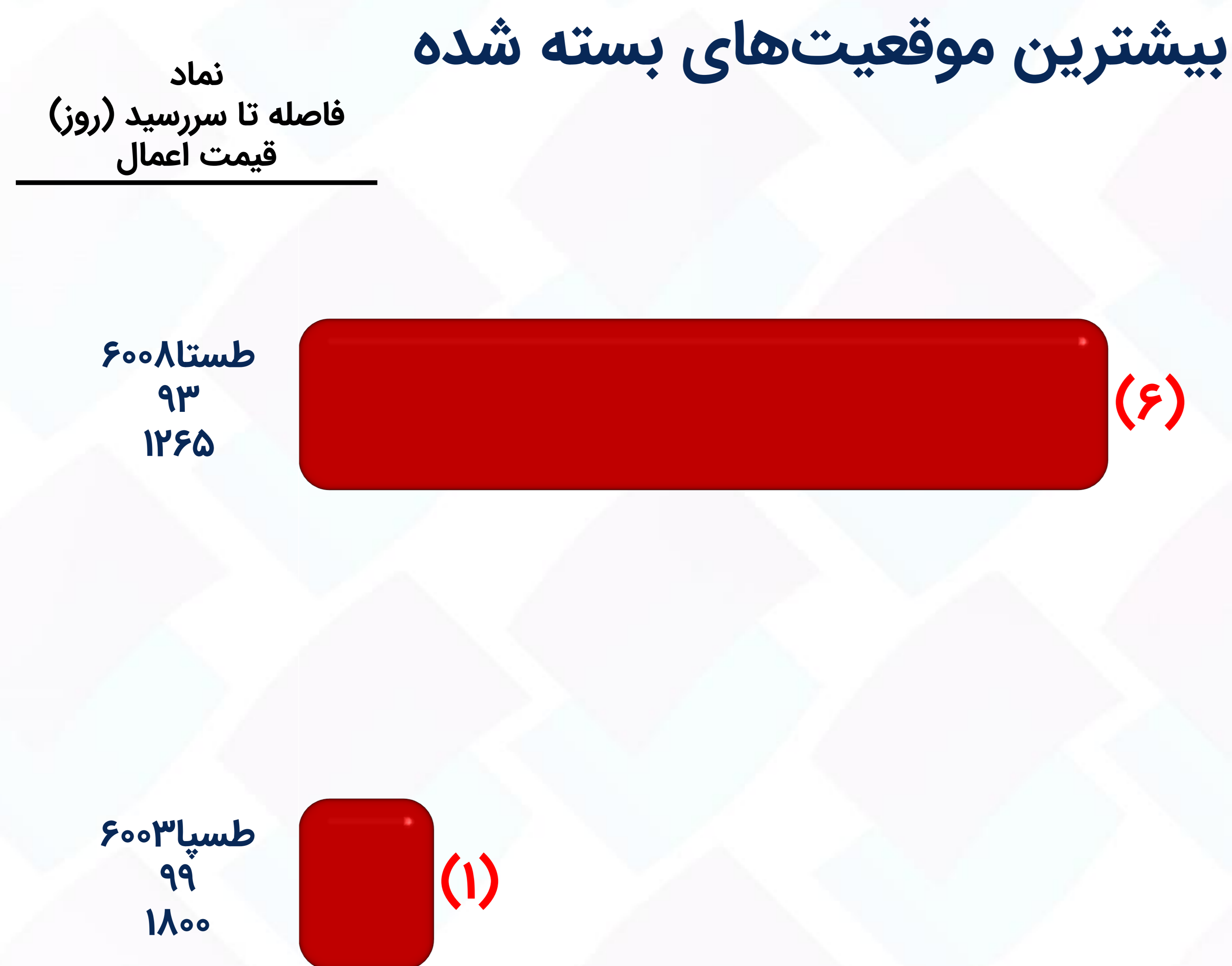
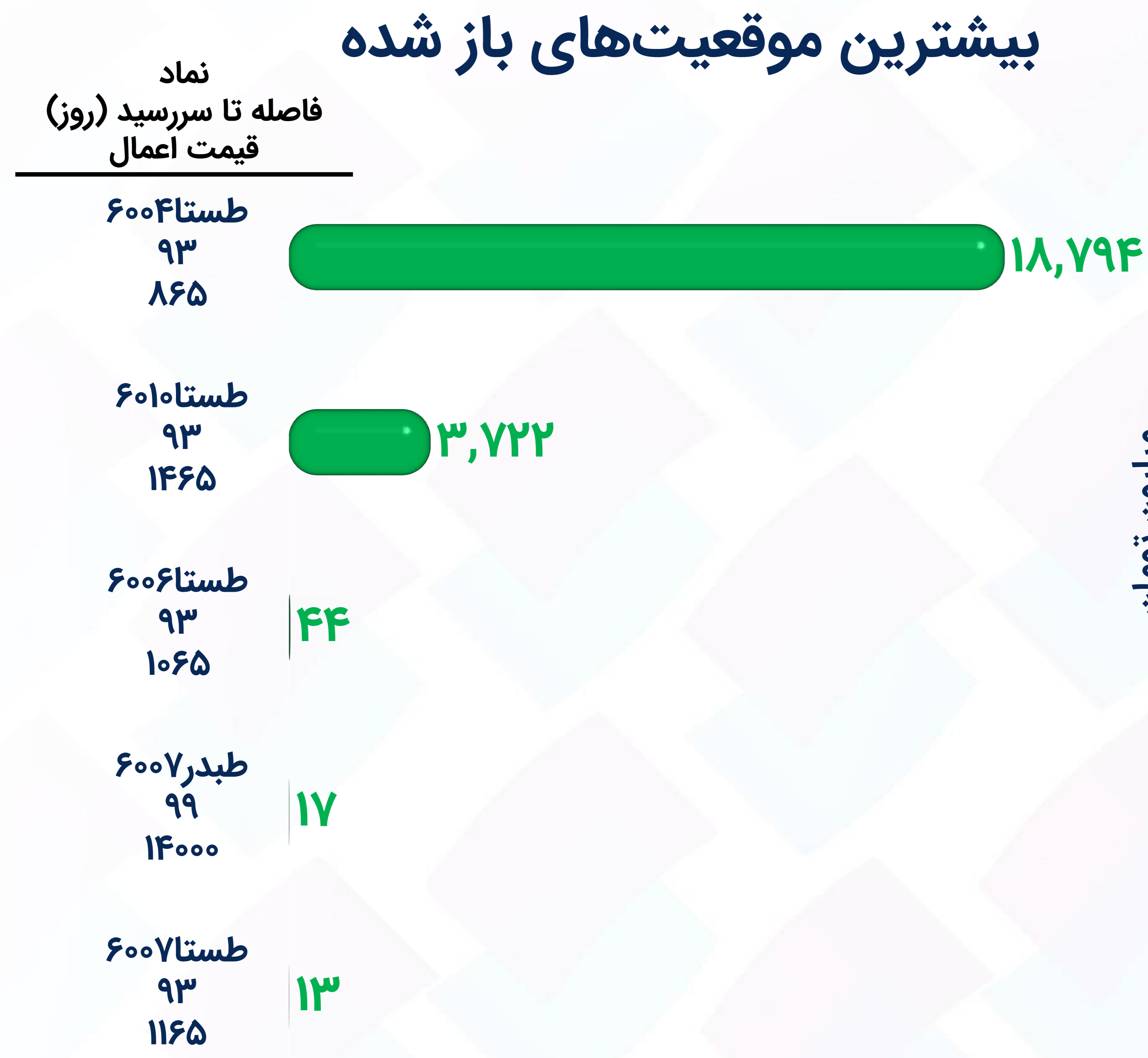
فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۸۵.۵	(۳۷%)	۸۵۵	۱,۳۶۰	۱۰	۱۶۷.۳	۹۴	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۹۴%)	۲	-۰.۰۲	۳۳.۴	(۲۴%)	۱,۰۳۴	۱,۳۶۰	۳۱	۶۸.۴	۹۴	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶
(۶۸%)	۲۲	-۰.۱۷	۱۷.۱	(۱۲%)	۱,۱۹۵	۱,۳۶۰	۷۰	۱.۱	۹۴	۱,۲۶۵	طستا ۶۰۰۸
(۳۰%)	۹۴	-۰.۴۹	۱۰.۰	(۲%)	۱,۳۳۲	۱,۳۶۰	۱۳۳	۱,۳۹۹.۰	۹۴	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰

(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



میلیارد تومان

میلیون تومان

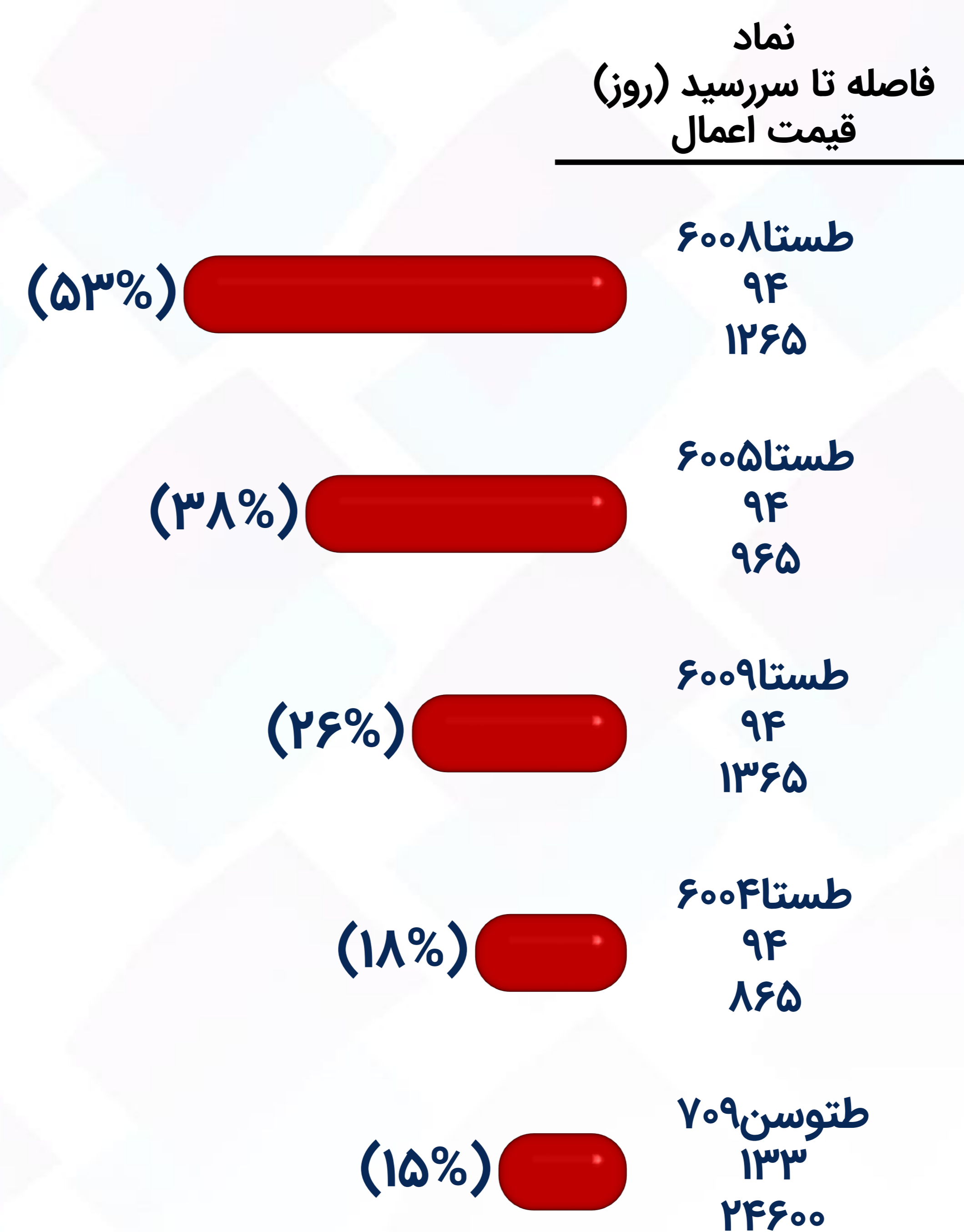
میلیون تومان

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 اتخاذ تصمیمات مالی و
سرمایه گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.