

شماره

۱۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

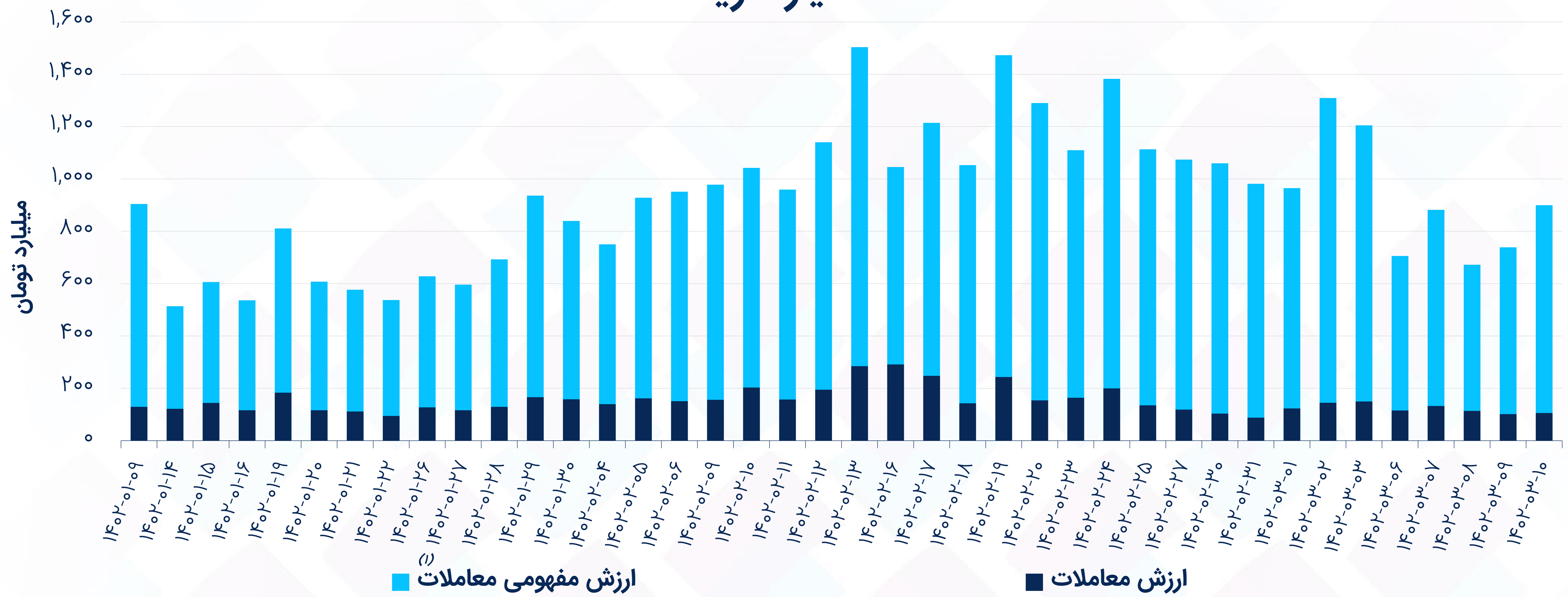




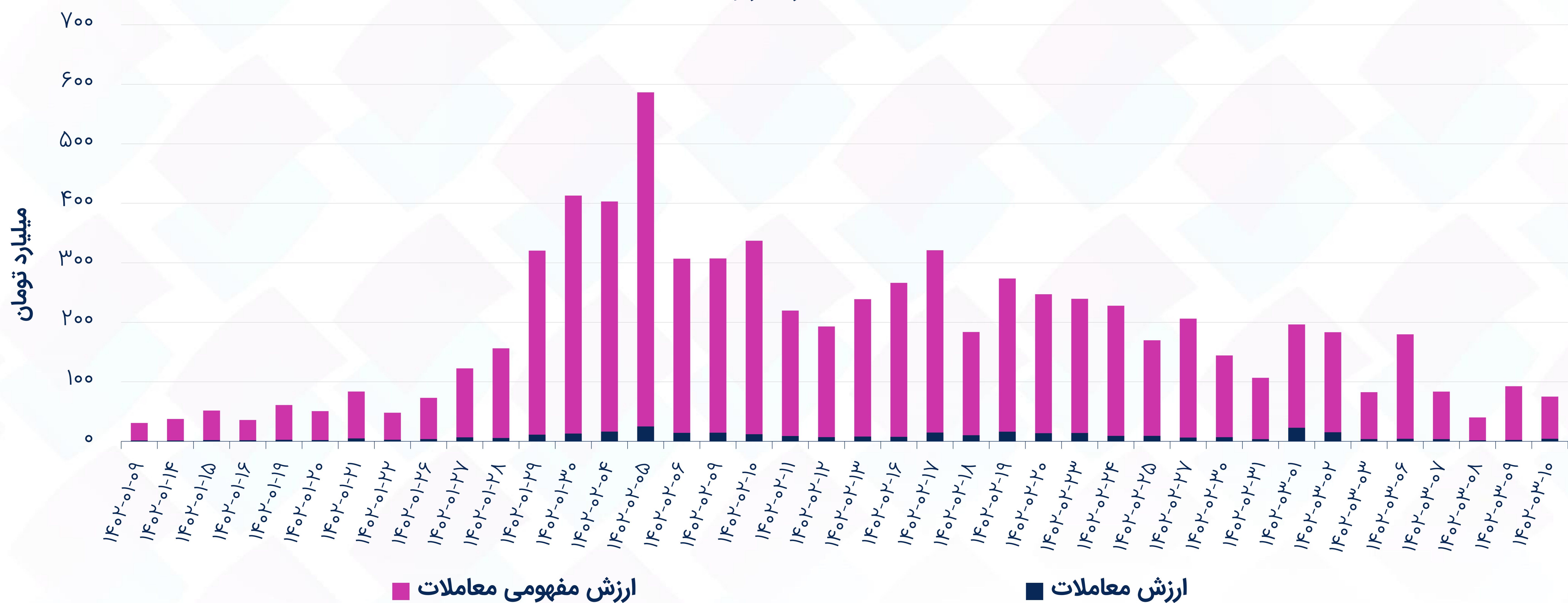
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



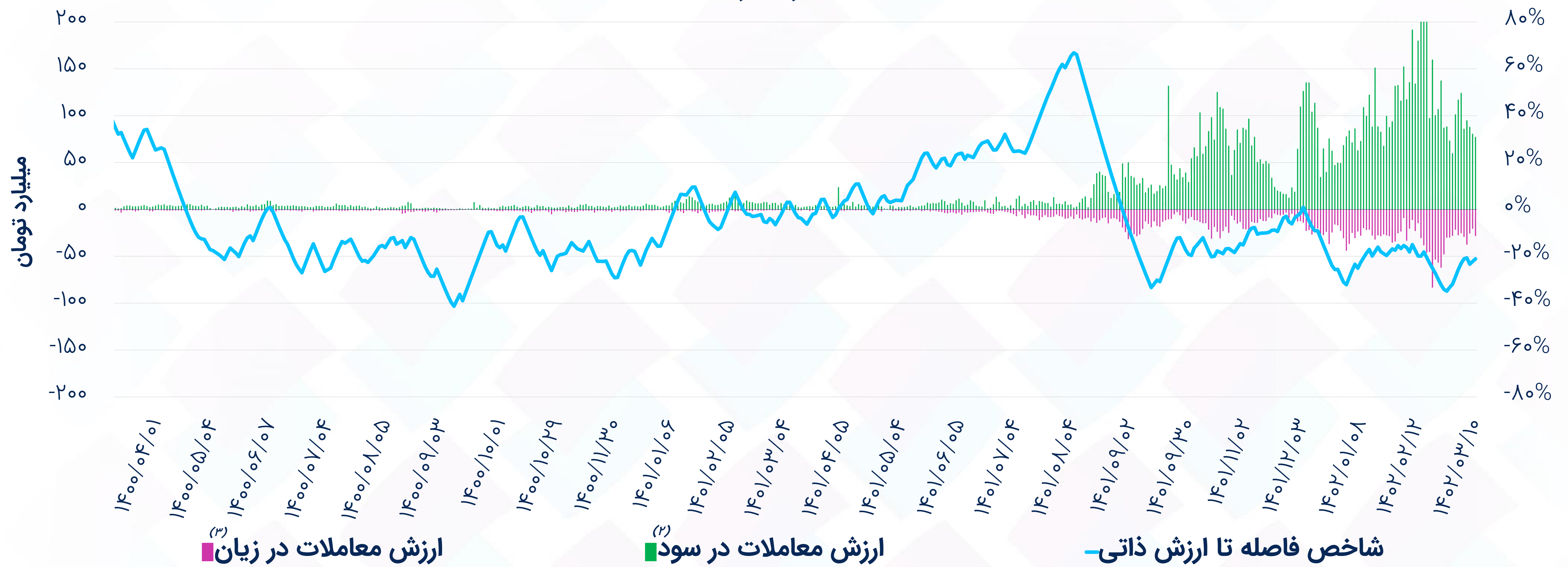
اختیار فروش



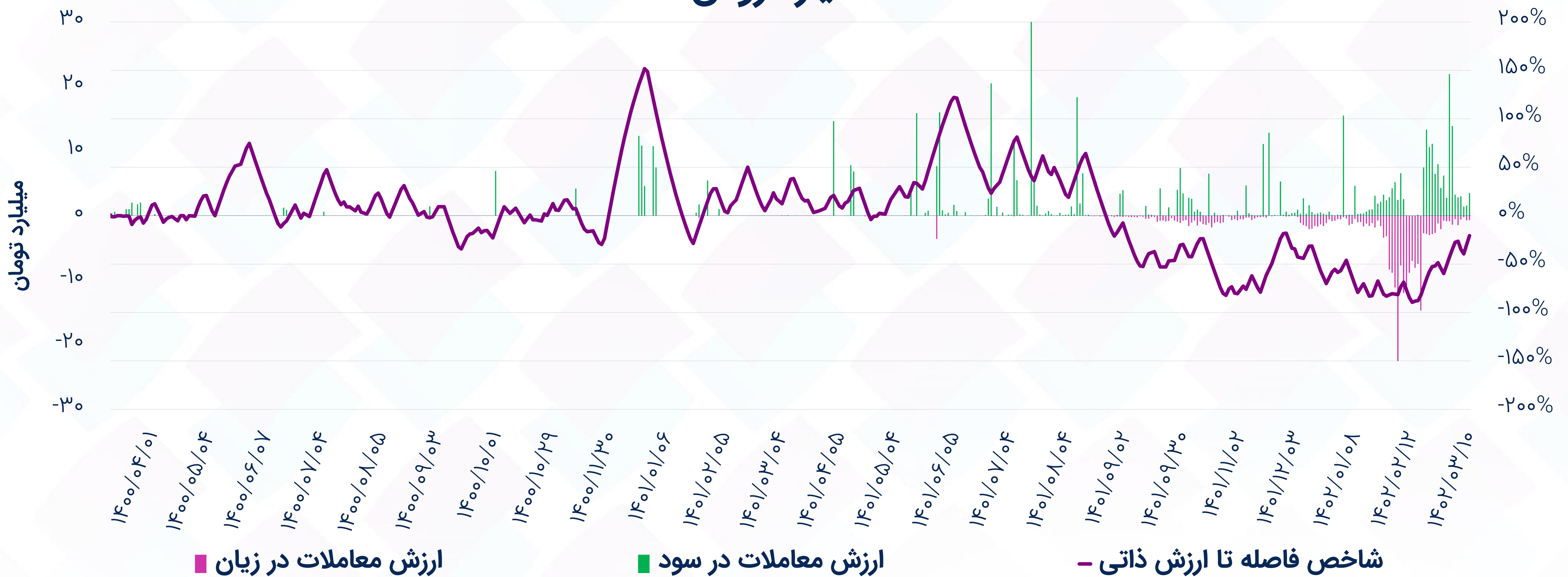
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

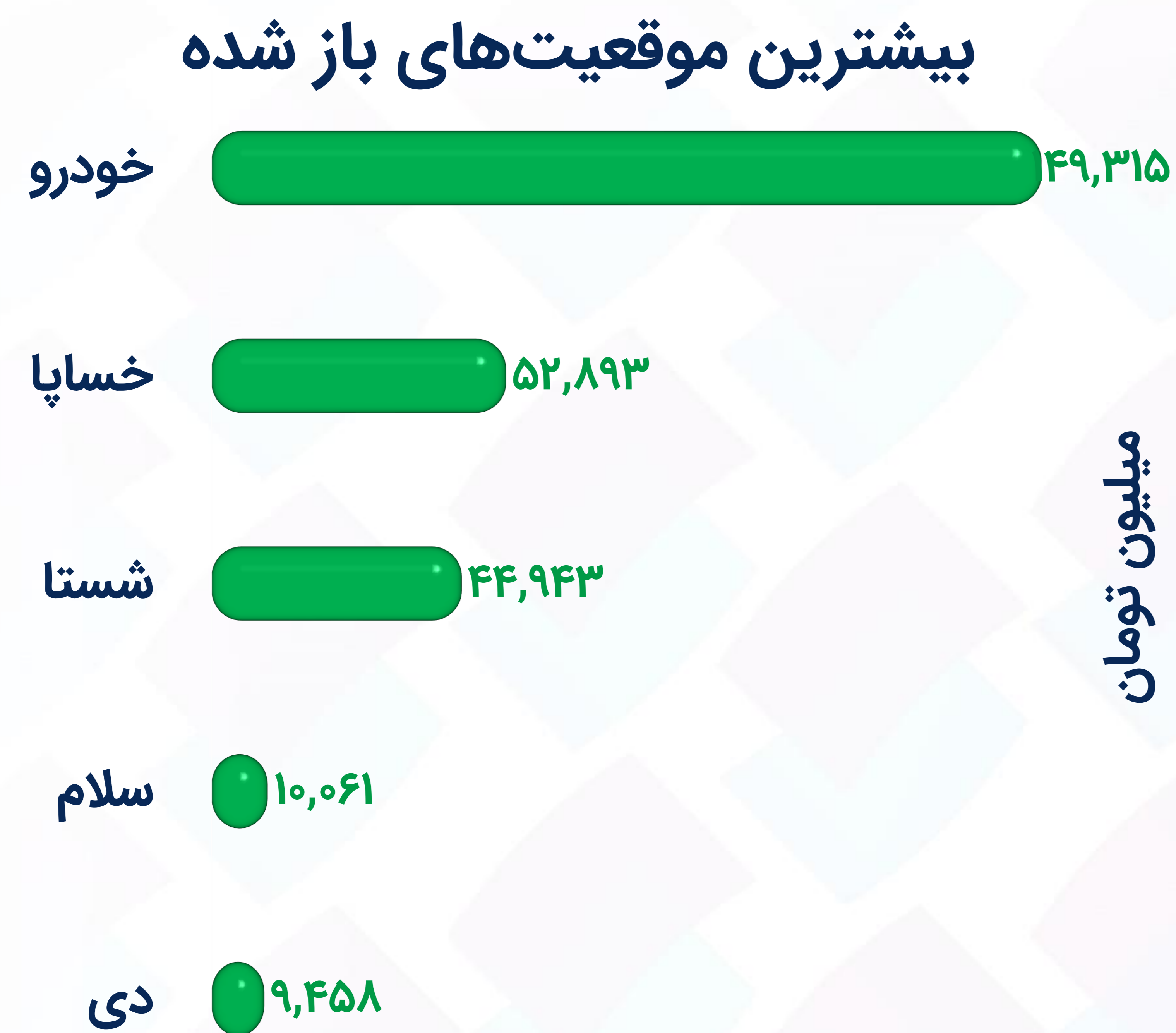
اختیار خرید

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	۳۴	۳۴.۹	۲۹۸.۵	۲۶.۸	۸.۲	(۲۹.۳%)
خسایا	۳۰	۲۸.۷	۳۰۰.۴	۲۳.۷	۵.۰	(۹.۲%)
شستا	۳۶	۱۵.۰	۱۵۶.۶	۳.۵	۱۱.۵	(۴۶.۰%)
دی	۱۴	۹.۵	۲۸.۹	۷.۵	۲.۰	(۱۱.۱%)
وبملت	۱۹	۴.۶	۱۲.۰	۴.۶	۰.۰	۳.۹%
اهرم	۱۷	۳.۸	۶.۵	۳.۶	۰.۳	(۲۰.۷%)
وتجارت	۱۰	۲.۵	۹.۸	۲.۱	۰.۴	(۶.۸%)

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	۲,۱۸۸.۰	۶۷,۴۹۵.۵	۱,۵۰۸.۹	۶۷۹.۱	(۴۷.۵%)
حسیر	۱	۱,۹۹۸.۰	۷,۲۸۱.۰	۱,۹۹۸.۰	۰.۰	۸.۵%
سمگا	۱	۶.۷	۸۳.۶	۶.۷	۰.۰	۵.۵%
اهرم	۳	۲.۸	۱۸۶.۰	۰.۰	۲.۸	۶۳.۵%
شپنا	۴	۲.۷	۲۰.۷	۲.۷	۰.۰	۵.۸%
توان	۱	۲.۵	۹۸.۲	۰.۰	۲.۵	۴۲.۲%
فولاد	۲	۰.۹	۲۳.۰	۰.۸	۰.۰	۶۹.۱%

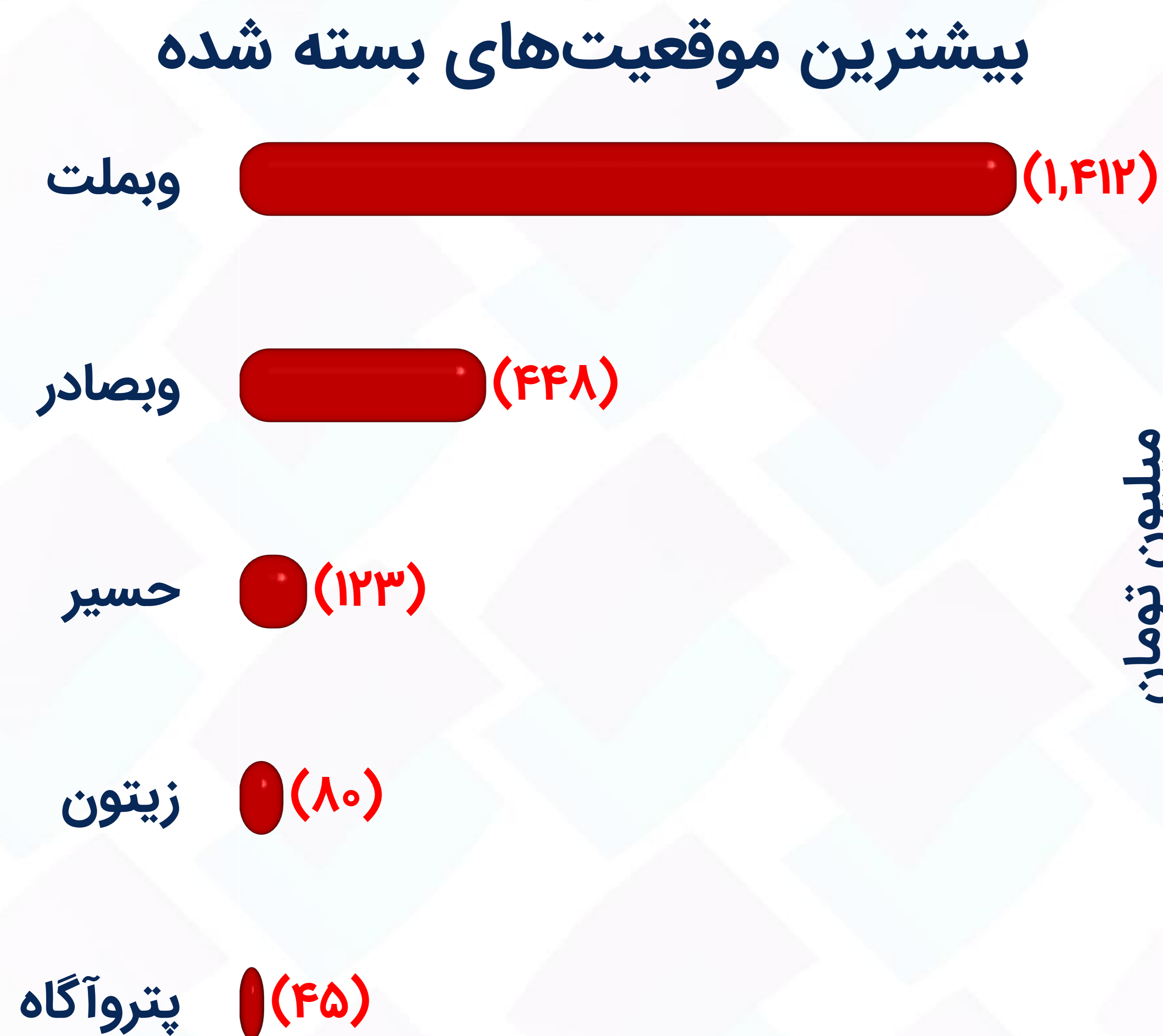
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

ارزش موقعیت‌های باز

شستا ۲,۳۸۱.۹

توسن ۴۶۴.۹

سمگا ۲۰۵.۰

حسیر ۱۱۴.۰

های وب ۱۰۰.۷

بساما ۹۱.۸

سلام ۳.۳

اهرم ۲.۸

فولاد ۲.۵۹

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده

شستا ۱۱,۴۱۷

حسیر ۹,۹۰۰

اهرم ۱۴۷

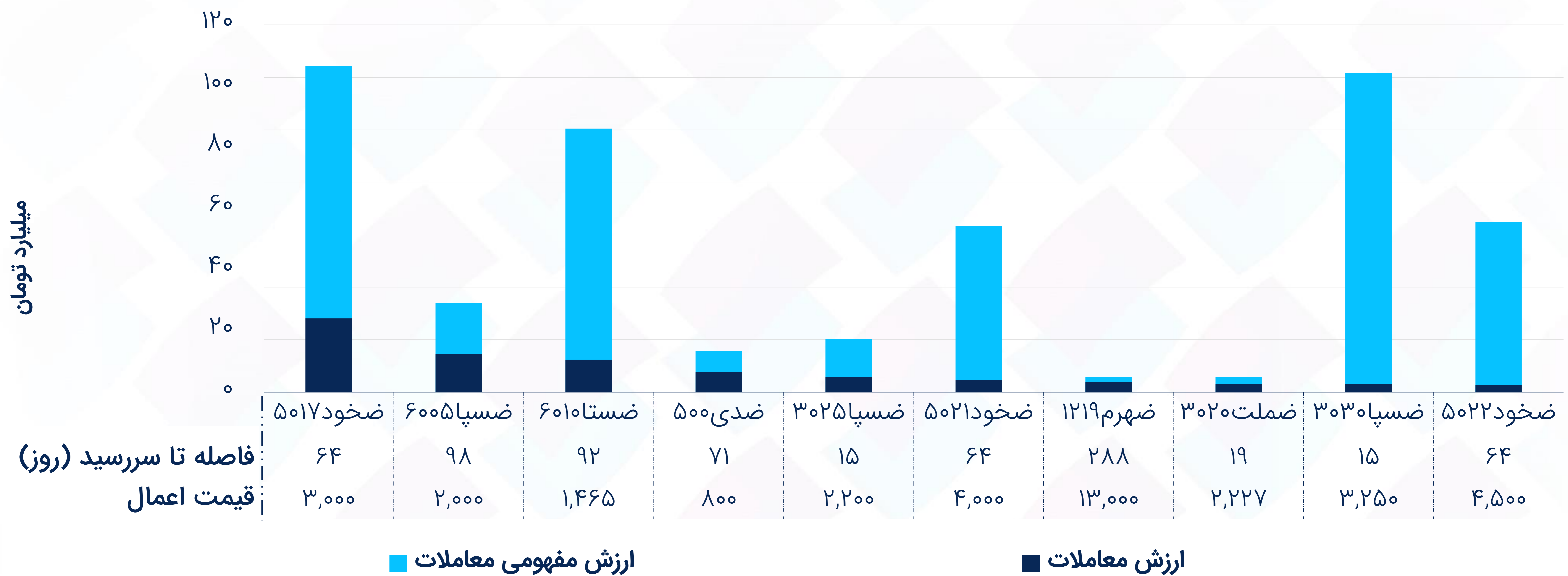
توان ۸۵

شپنا ۳۹

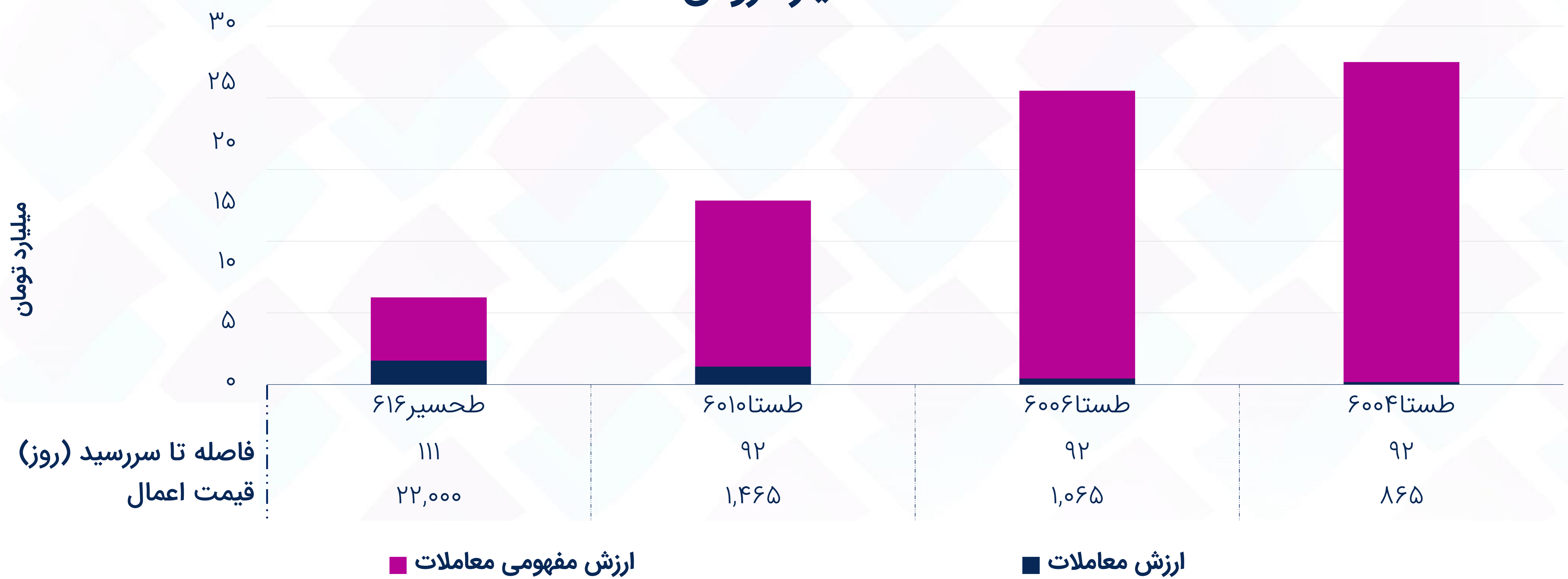
میلیون تومان

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
۱۵۵%	۸۷۸	۰.۹۹	۸.۵	(۱۴.۰%)	۲,۹۴۵	۳,۴۲۵	۳۴۵	۳.۵	۲۹	۲,۶۰۰	خودرو ۴۰۲۵
۱۰۲%	۱۹۴	۰.۷۵	۵۳.۱	(۰.۷%)	۵,۰۹۶	۵,۱۳۰	۹۶	۳۴.۲	۸	۵,۰۰۰	خاوار ۳۰۰۸
۸۳%	۹۱	۰.۶۱	۵۷.۰	۰.۸%	۲,۸۵۰	۲,۸۲۷	۵۰	۲۴.۷	۸	۲,۸۰۰	وبصادر ۳۰۳۰
۶۴%	۱۰	۰.۰۹	۹۱۷.۷	۷.۳%	۵,۵۰۶	۵,۱۳۰	۶	۳.۷	۸	۵,۵۰۰	خاوار ۳۰۰۹
۵۵%	۲۰۷	۰.۵۹	۳۰.۰	۳.۴%	۳,۹۹۳	۳,۸۶۱	۱۳۳	۲.۲	۲۶	۳,۸۶۰	چکاپا ۴۰۰۸

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	۲۰۱.۰	۴۹%	۲,۰۱۰	۱,۳۵۳	۱۰	۱۷۸.۶	۳۶	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۹.۱	۳۴%	۷,۶۹۷	۵,۷۴۰	۱۹۷	۱۱۲.۳	۱۹	۷,۵۰۰	شتران ۳۰۳۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۹۶.۰	۴۲%	۱,۹۲۰	۱,۳۵۳	۲۰	۳.۰	۳۶	۱,۹۰۰	شستا ۴۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۵۵۱.۰	۶۱%	۵,۵۱۰	۳,۴۲۵	۱۰	۶۶.۹	۲۹	۵,۵۰۰	خودرو ۴۰۳۴
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۱,۶۰۱.۰	۱۸%	۱,۶۰۱	۱,۳۵۳	۱	۱۳.۸	۸	۱,۶۰۰	شستا ۳۰۱۰

(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
۴۹.۳%	۶۷۲	-۰.۱۵	۳۹.۰	(۲۰%)	۱۷,۵۵۰	۲۱,۸۸۰	۴۵۰	۱.۱	۱۳۸	۱۸,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۲
۴۲.۲%	۷۱۱	-۰.۱۹	۳۳.۰	(۱۶%)	۱۶,۵۰۰	۱۹,۶۴۶	۵۰۰	۲.۵	۹۶	۱۷,۰۰۰	طتوان ۶۰۲
۸.۴%	۴,۸۱۵	-۰.۷۴	۴.۰	۹%	۱۷,۵۶۰	۱۶,۱۸۰	۴,۴۴۰	۱,۹۹۸.۰	۱۱۱	۲۲,۰۰۰	طحسیر ۶۱۶
۵.۶%	۱,۳۲۳	-۰.۶۶	۷.۸	۴%	۹,۷۴۷	۹,۴۰۰	۱,۲۵۳	۲.۰	۸۵	۱۱,۰۰۰	طشنا ۶۰۰۶
۵.۵%	۷۱۱	-۰.۳۴	۱۱.۶	(۷%)	۷,۸۲۶	۸,۴۴۰	۶۷۴	۶.۷	۱۲۴	۸,۵۰۰	طسمگا ۷۰۳

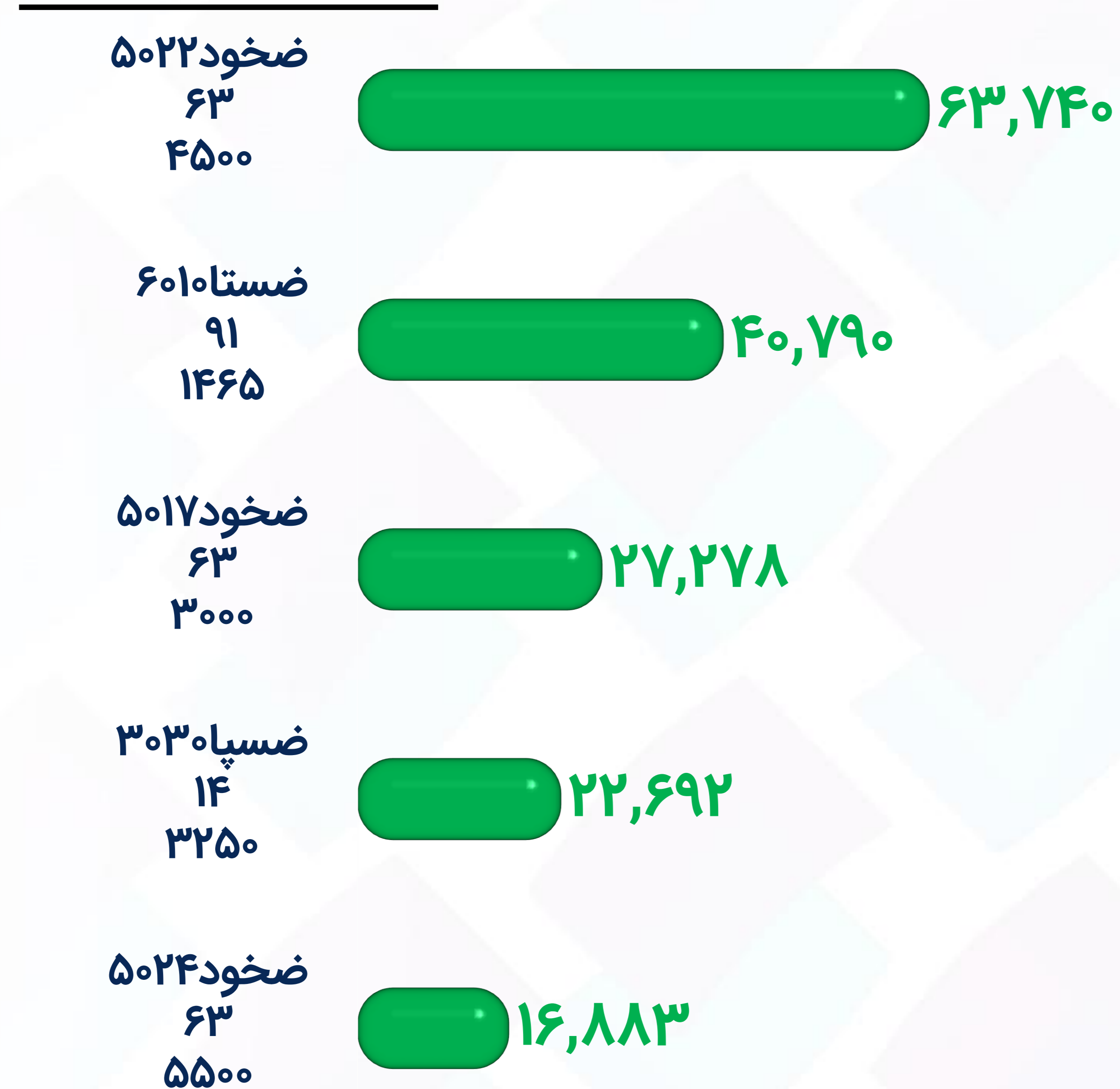
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۹۵.۱	(۳۷%)	۸۵۶	۱,۳۵۳	۹	۱۷۹.۶	۹۲	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۶۳.۳	(۳۰%)	۹۵۰	۱,۳۵۳	۱۵	۴.۸	۹۲	۹۶۵	طستا ۶۰۰۵
(۸۰%)	۸	-۰.۰۸	۲۶.۷	(۱۷%)	۱,۱۲۳	۱,۳۵۳	۴۲	۴.۲	۹۲	۱,۱۶۵	طستا ۶۰۰۷
(۲۶%)	۹۸	-۰.۵۱	۱۰.۰	(۲%)	۱,۳۳۲	۱,۳۵۳	۱۳۳	۱,۵۰۸.۹	۹۲	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰

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

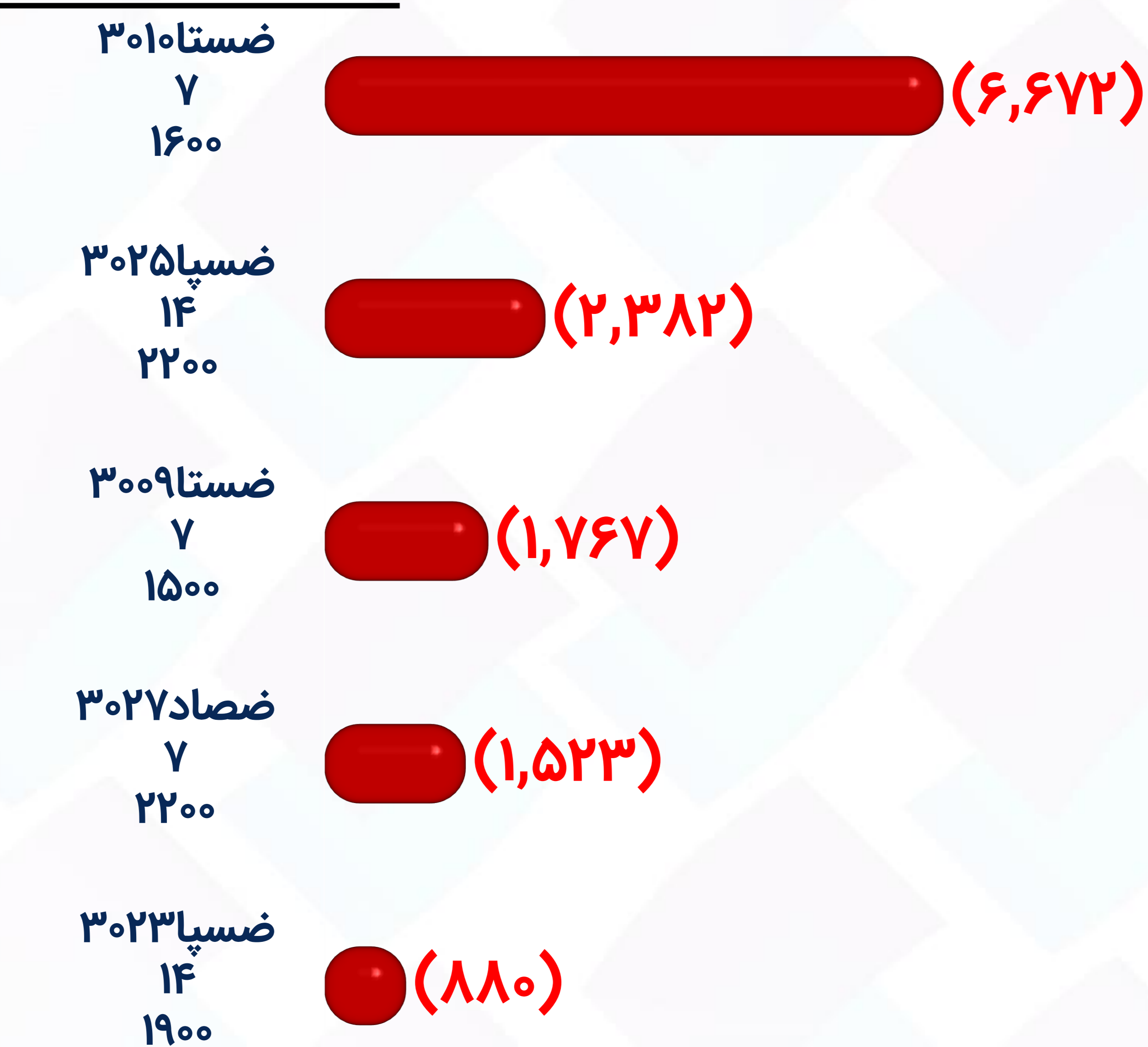
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

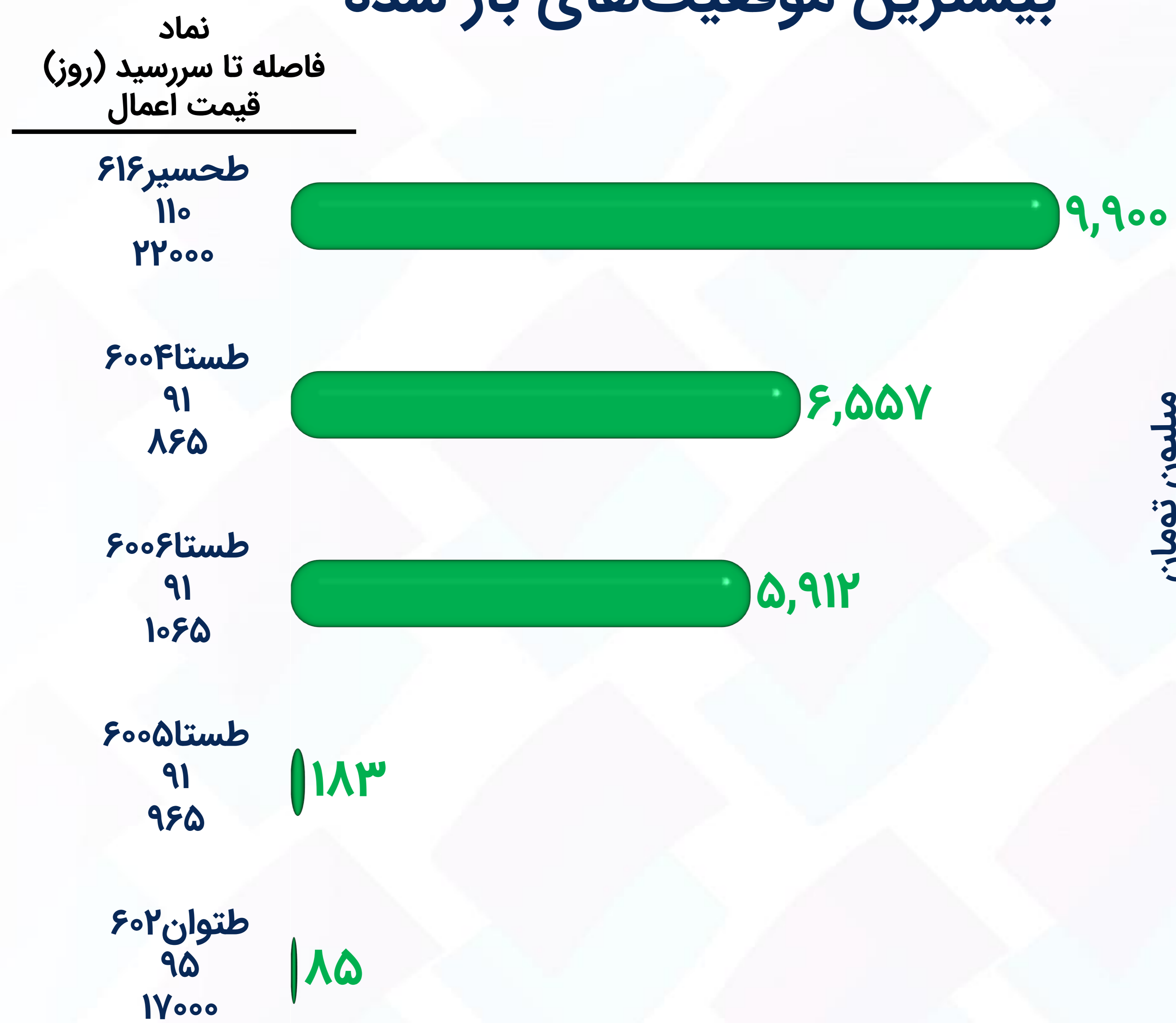
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

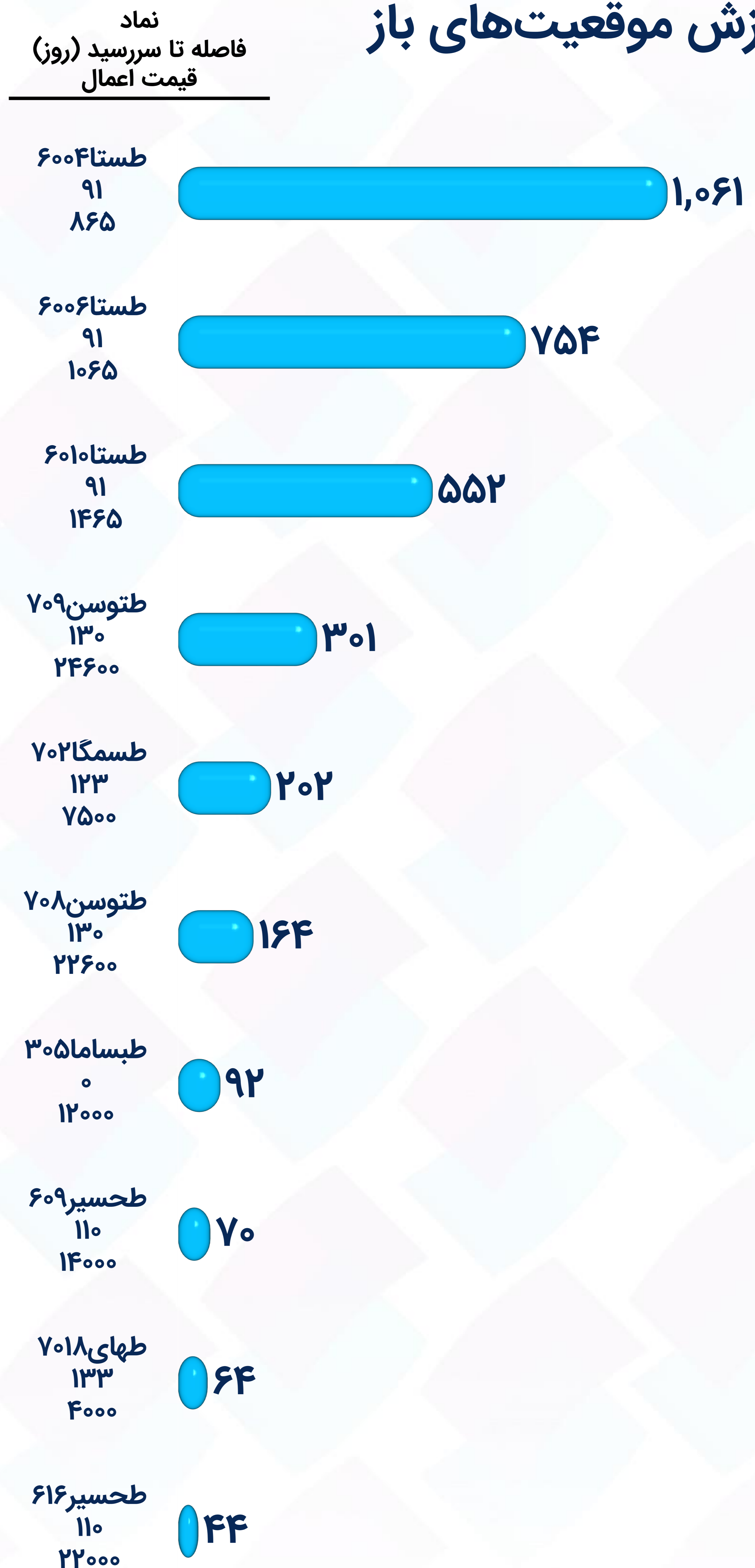
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

میلیون تومان

میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

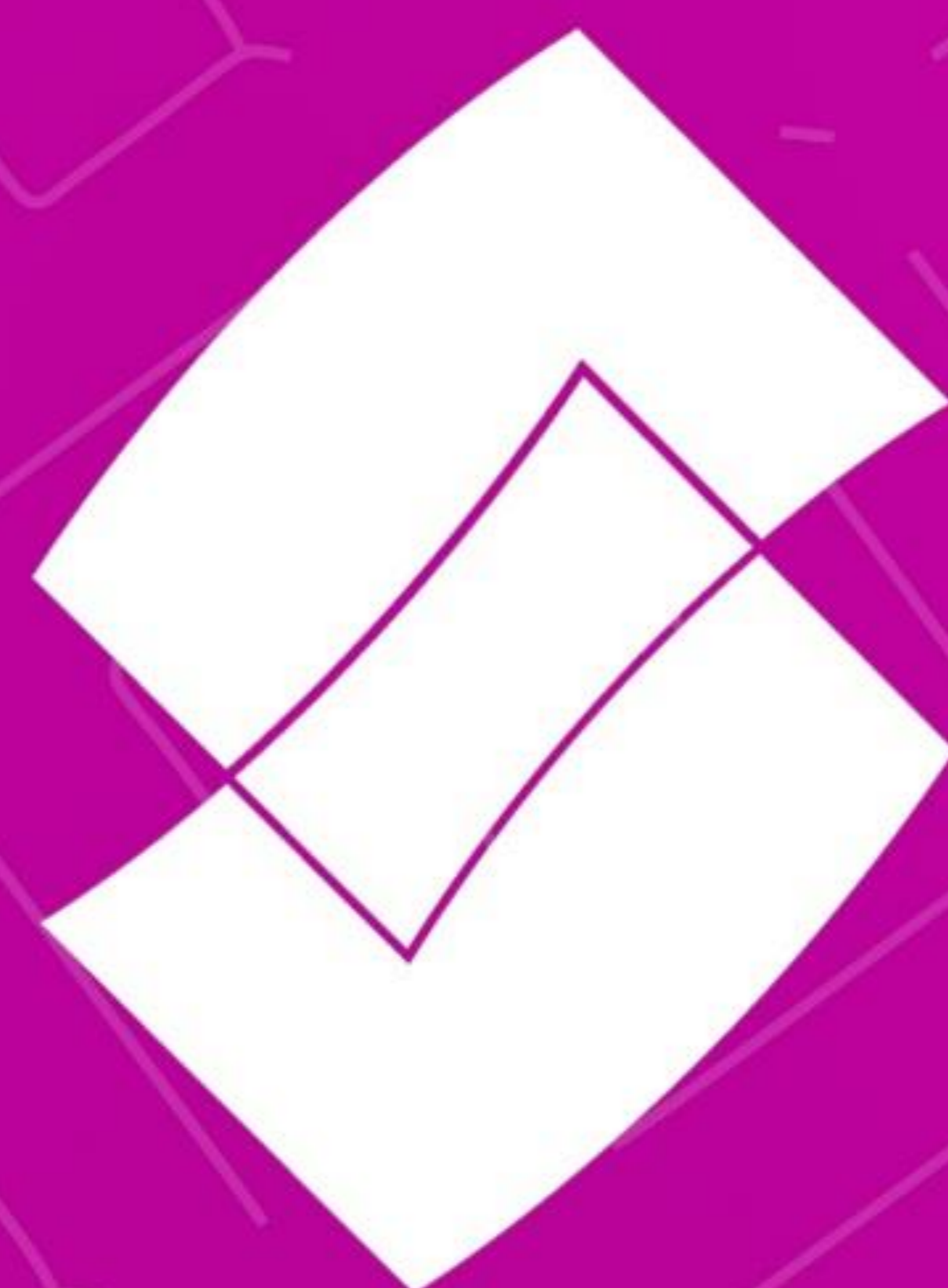
اختیار خرید



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.