

شماره

۲۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

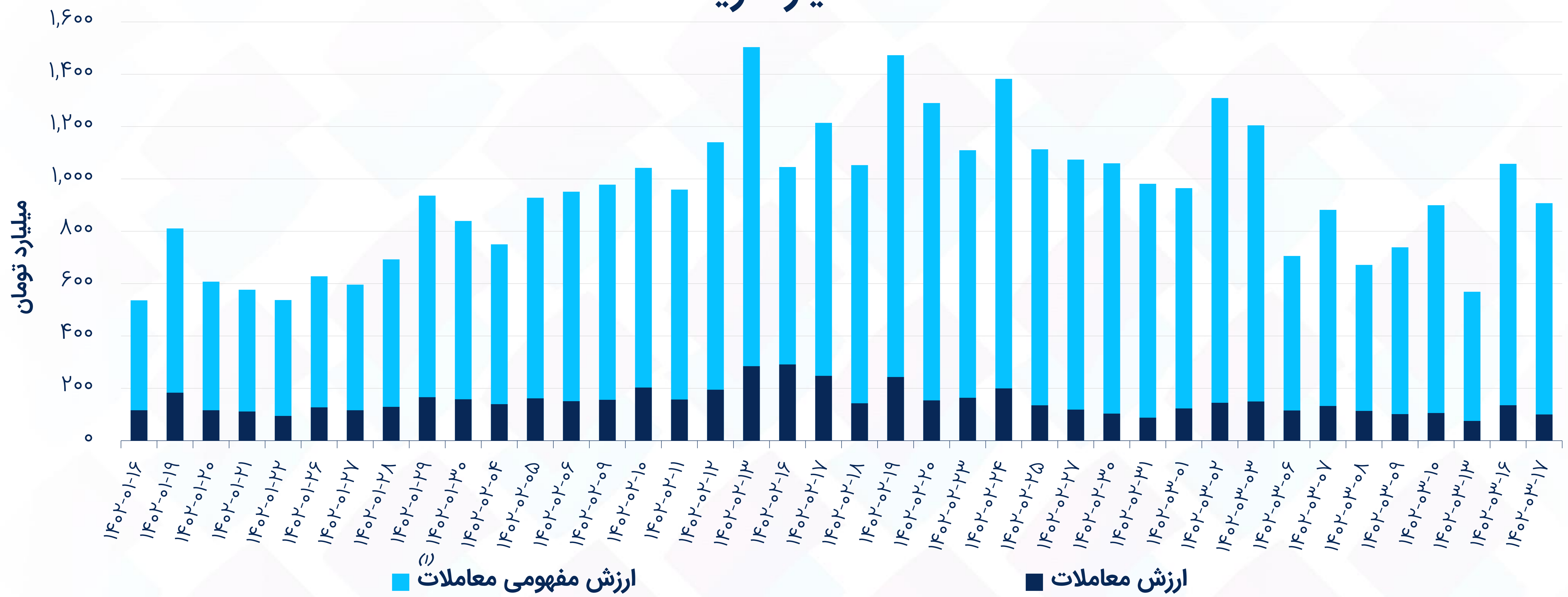




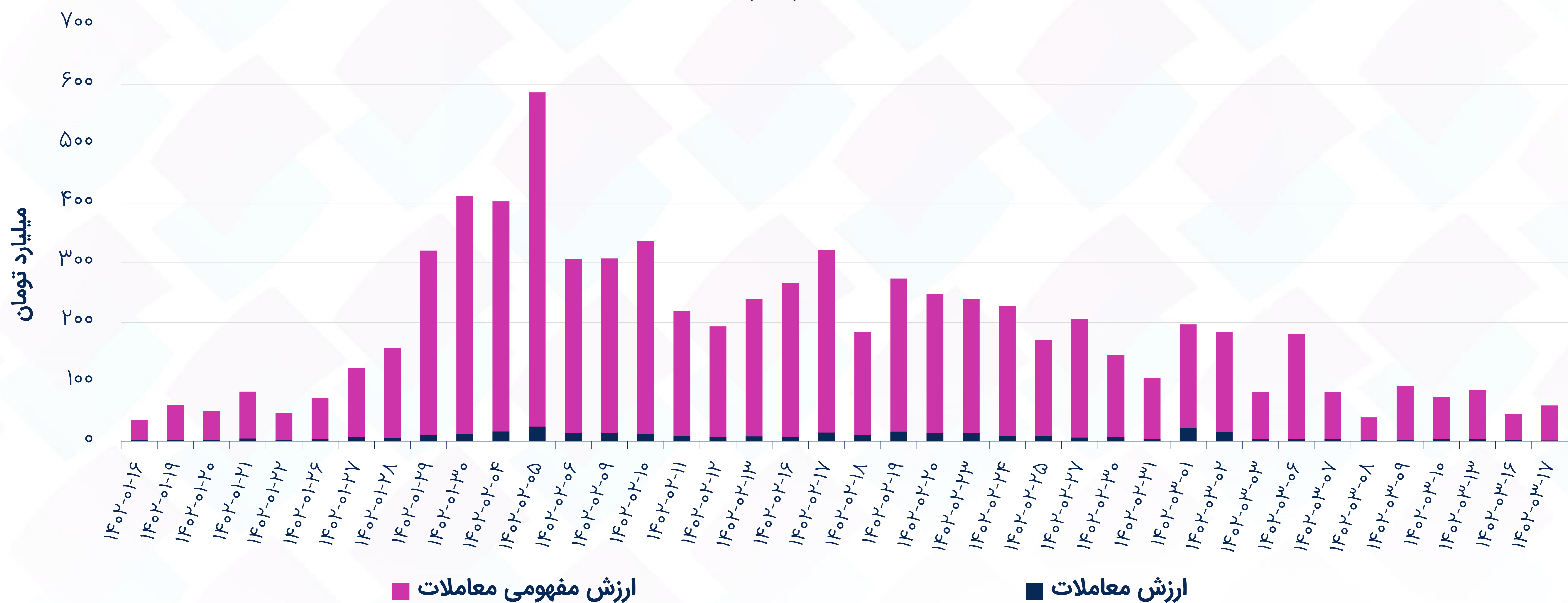
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



اختیار فروش



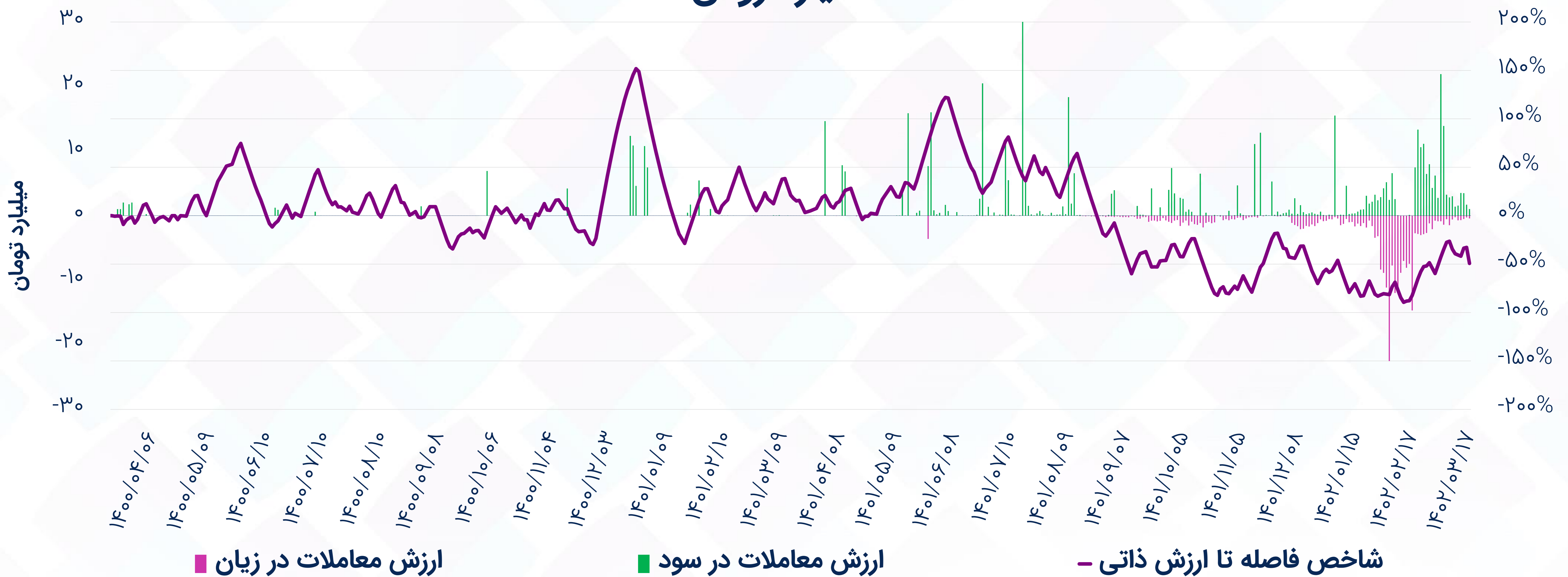
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

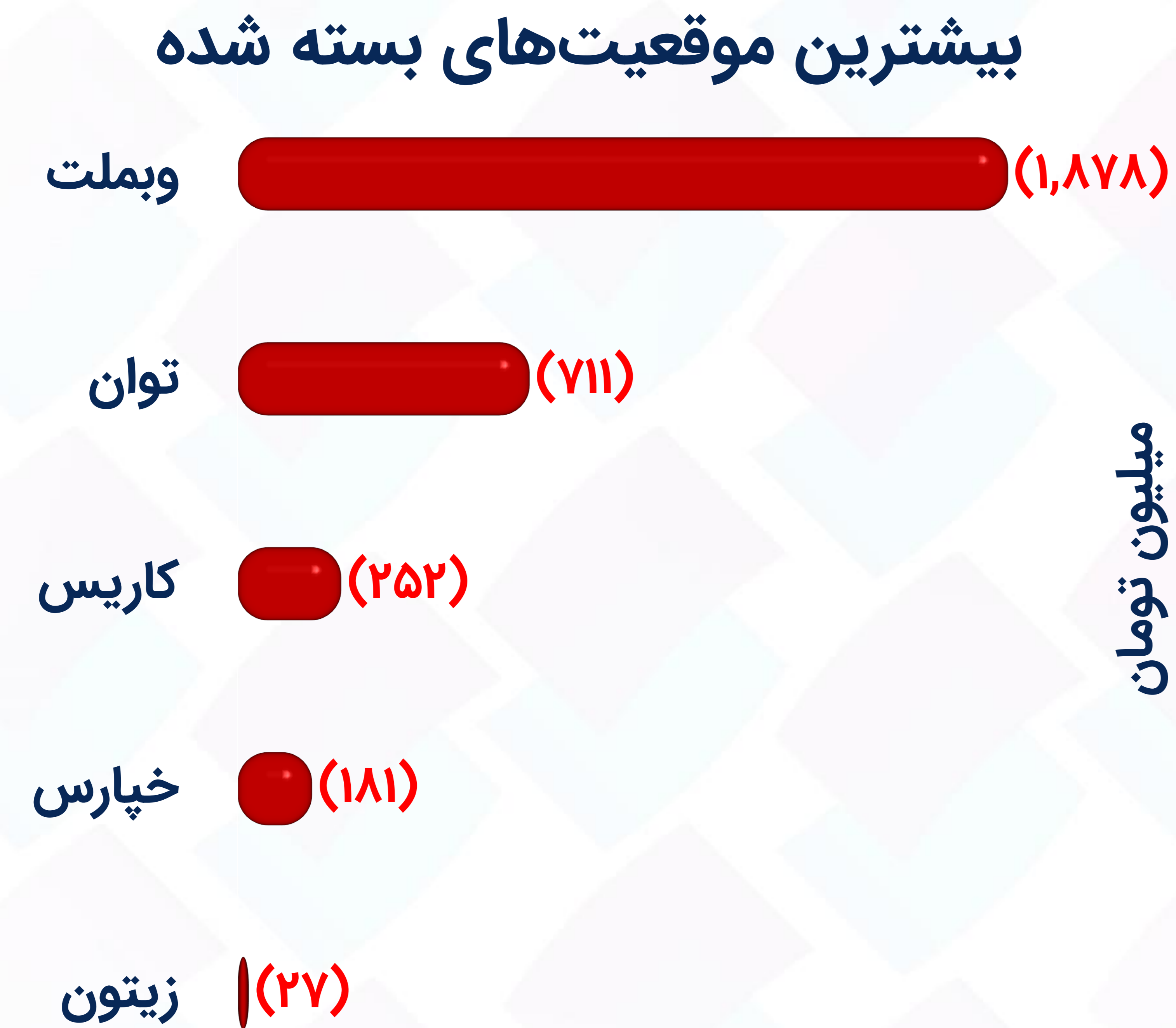
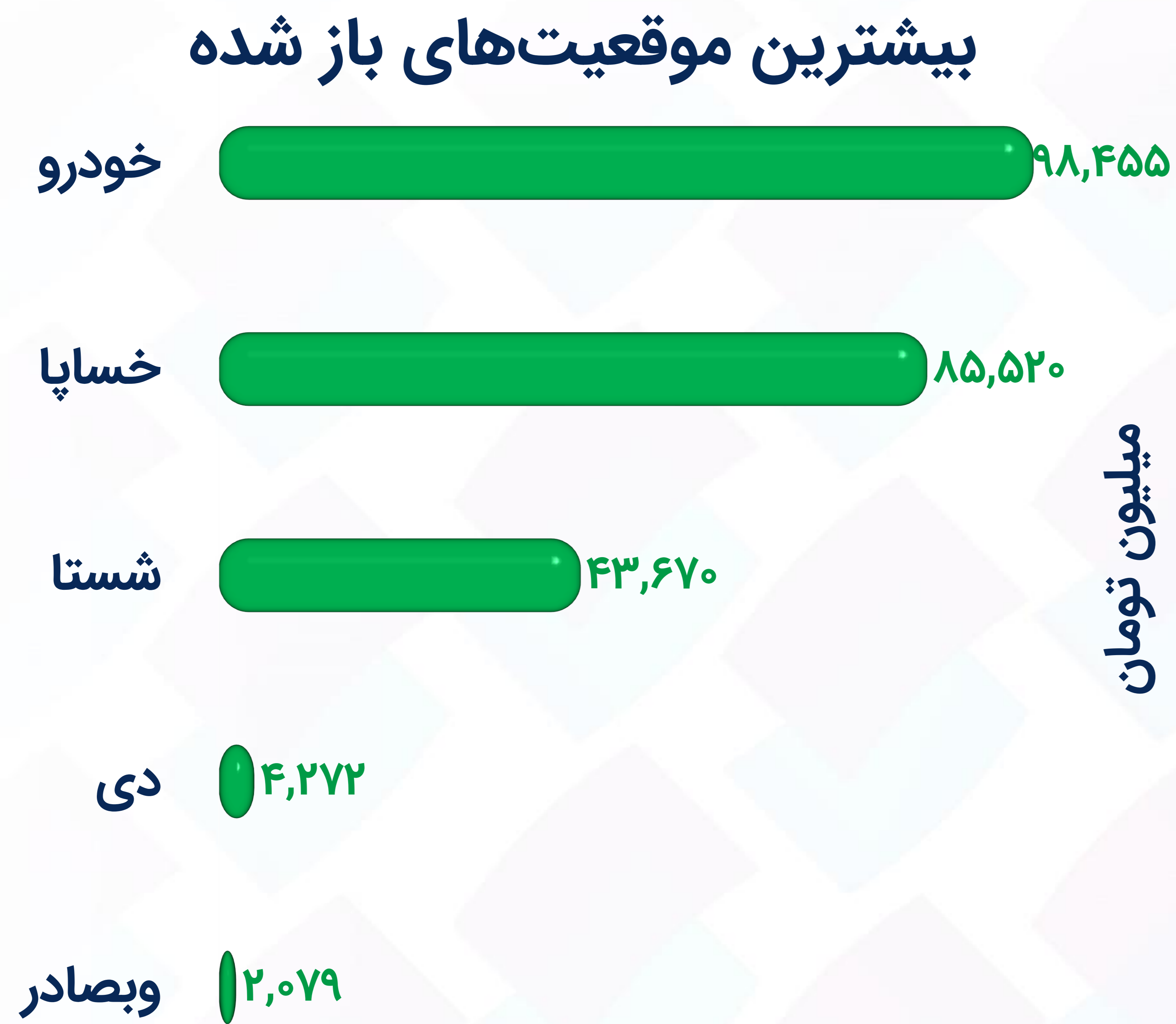
اختیار خرید

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	۲۶	۳۰.۷	۲۱۸.۰	۲۳.۹	۶.۸	(۲۶.۶%)
خسپا	۳۲	۳۰.۱	۳۹۹.۷	۲۲.۰	۸.۱	(۸.۸%)
شستا	۴۰	۱۹.۳	۱۷۷.۹	۵.۳	۱۳.۹	(۴۶.۴%)
وبصادر	۱۶	۴.۶	۲۵.۱	۴.۵	۰.۱	۶.۸%
دی	۱۰	۳.۴	۹.۶	۲.۹	۰.۵	(۱۸.۵%)
وبملت	۱۵	۲.۸	۱۰.۹	۲.۸	۰.۰	۰.۵%
اهرم	۱۲	۲.۵	۴.۶	۲.۳	۰.۲	(۱۶.۵%)

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	۶	۱,۴۳۷.۷	۵۹,۷۴۳.۵	۱,۰۰۹.۵	۴۲۸.۲	(۵۰.۷%)
فولاد	۱	۱۹.۱	۳۵۹.۸	۱۹.۱	۰.۰	۴۳.۵%
سمگا	۱	۲.۱	۸۹.۴	۰.۰	۲.۱	۲۰.۷%
شتران	۱	۱.۲	۵.۷	۱.۲	۰.۰	۶.۰%
خودرو	۱	۰.۲	۱.۱	۰.۲	۰.۰	۹.۸%

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

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده

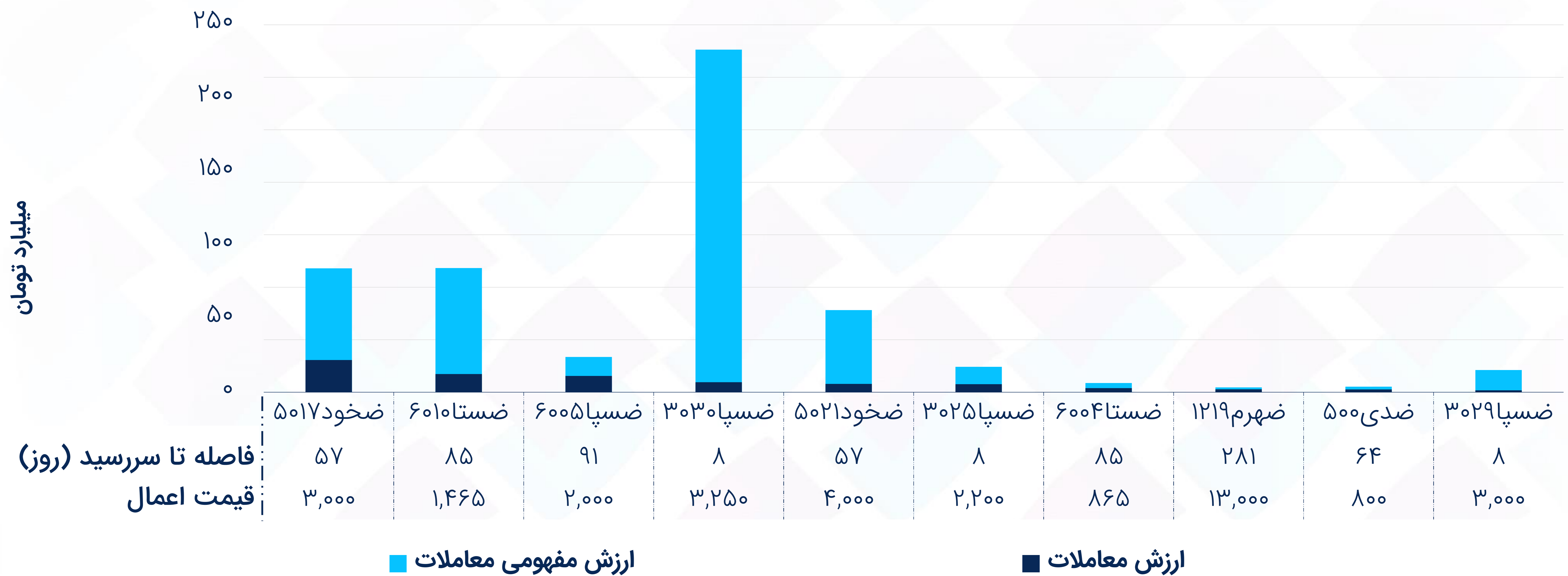


میلیارد تومان

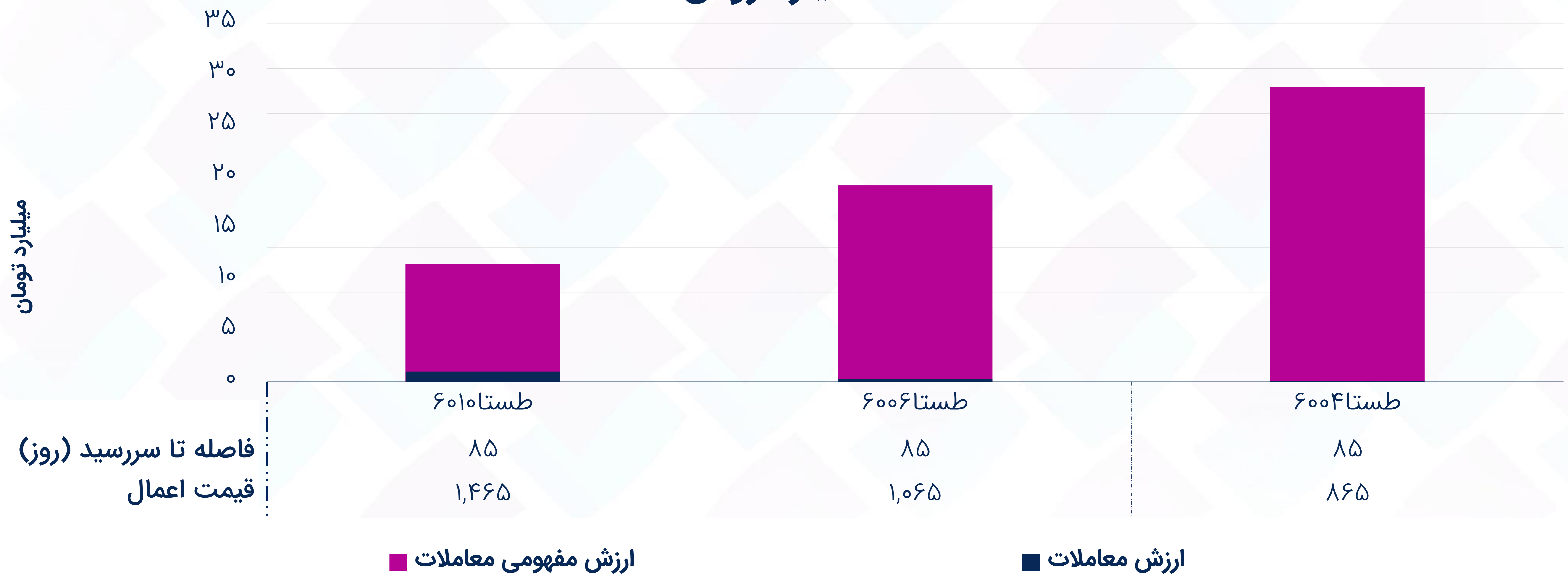
میلیون تومان

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
۶۹%	۵۵۴	۱.۰۰	۵.۰	(۱۲.۰%)	۱,۶۲۸	۱,۸۴۹	۳۲۸	۷.۹	۵	۱,۳۰۰	ضخپارس ۳۰۱
۳۷%	۶۹	۰.۷۵	۳۷.۰	۰.۱%	۱,۸۵۰	۱,۸۴۹	۵۰	۶.۰	۵	۱,۸۰۰	ضخپارس ۳۰۶
۲۷%	۱,۳۷۰	۱.۰۰	۲.۷	(۵.۷%)	۲,۸۸۲	۳,۰۵۷	۱,۰۸۲	۳.۶	۹۱	۱,۸۰۰	ضجارس ۶۰۰۳
۲۴%	۱,۰۶۸	۰.۹۳	۴.۳	۱.۰%	۳,۶۶۰	۳,۶۲۴	۸۶۰	۱۷.۲	۱۱۳	۲,۸۰۰	ضخود ۷۰۹۳
۱۵%	۹,۷۴۳	۱.۰۰	۳.۴	(۲.۹%)	۲۸,۵۰۰	۲۹,۳۴۰	۸,۵۰۰	۹.۴	۲۹	۲۰,۰۰۰	ضروز ۴۰۰۵

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	۵۰۱.۰	۳۳%	۷,۵۱۵	۵,۶۷۰	۱۵	۲.۴	۱۲	۷,۵۰۰	ضترا ۳۰۳۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۸۲.۸	۴۵%	۲,۰۱۱	۱,۳۸۳	۱۱	۲۳۴.۰	۲۹	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۴۷.۲	۳۸%	۱,۹۱۳	۱,۳۸۳	۱۳	۱.۷	۲۹	۱,۹۰۰	ضستا ۴۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۷۸۶.۷	۵۲%	۵,۵۰۷	۳,۶۲۴	۷	۴۷.۵	۲۲	۵,۵۰۰	ضخود ۴۰۳۴
(۹۹%)	۶	۰.۰۱	۳۴.۶	۶۷%	۱۵,۴۴۶	۹,۲۷۰	۴۴۶	۱۷.۴	۷۸	۱۵,۰۰۰	ضشنا ۶۰۱۰

(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
 تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

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
۴۳.۵%	۴۶۸	-۰.۸۲	۱۹.۳	۳%	۶,۲۹۹	۶,۱۳۰	۳۲۶	۱۹.۱	۱۵	۶,۶۲۵	۳۰۲۵ فلاد
۵.۹%	۱,۲۷۱	-۱.۰۰	۴.۸	۲%	۵,۸۰۰	۵,۶۷۰	۱,۲۰۰	۱.۲	۱۲	۷,۰۰۰	۳۰۳۰ شتران

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
(۹۴%)	۱	-۰.۰۱	۵۲.۳	(۲۴%)	۱,۰۴۵	۱,۳۸۳	۲۰	۲۷۸.۳	۸۵	۱,۰۶۵	۶۰۰۶ شستا
(۸۵%)	۵	-۰.۰۶	۳۲.۳	(۱۸%)	۱,۱۳۰	۱,۳۸۳	۳۵	۴.۱	۸۵	۱,۱۶۵	۶۰۰۷ شستا

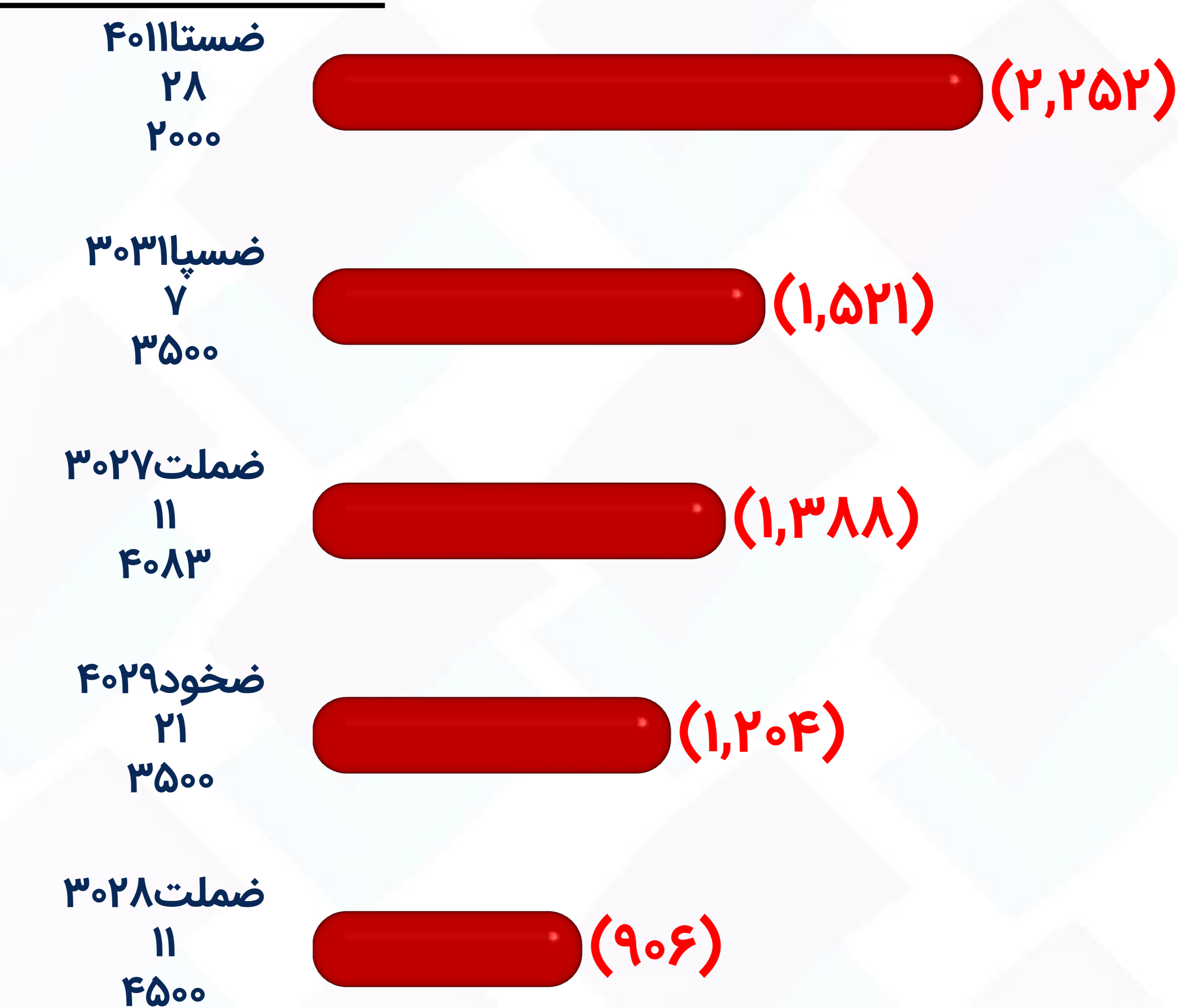
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده

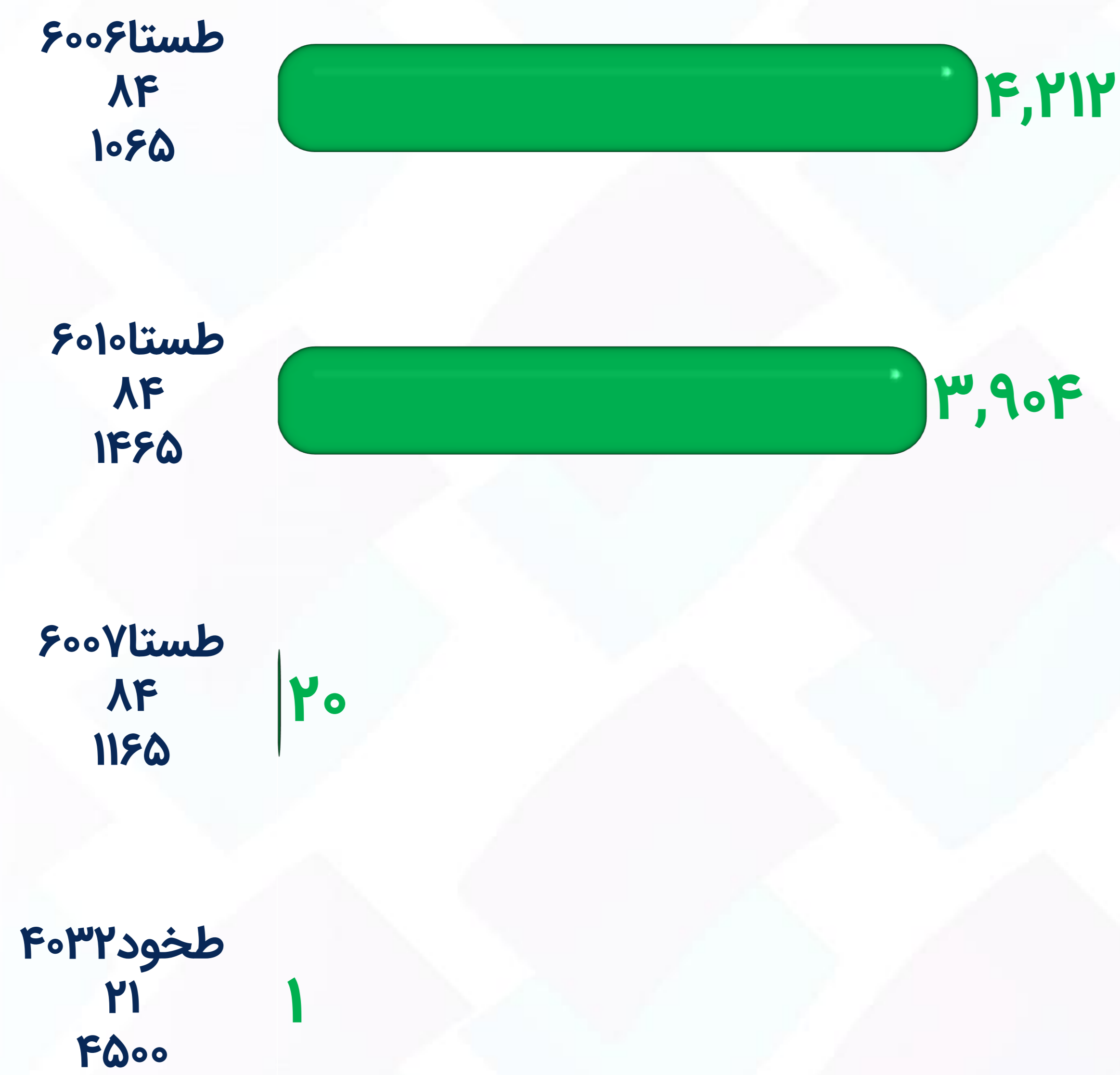


ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده

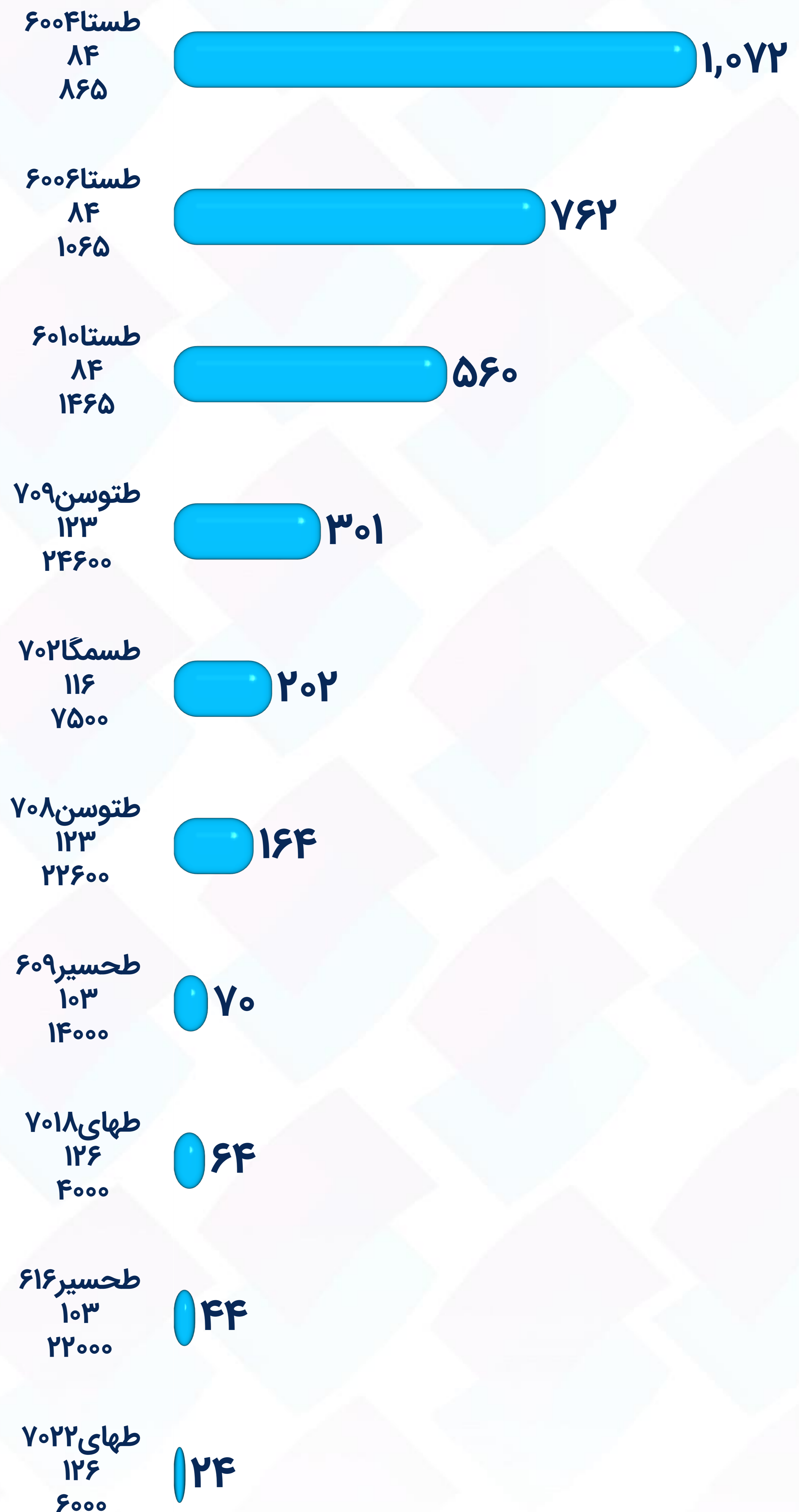


میلیون تومان

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



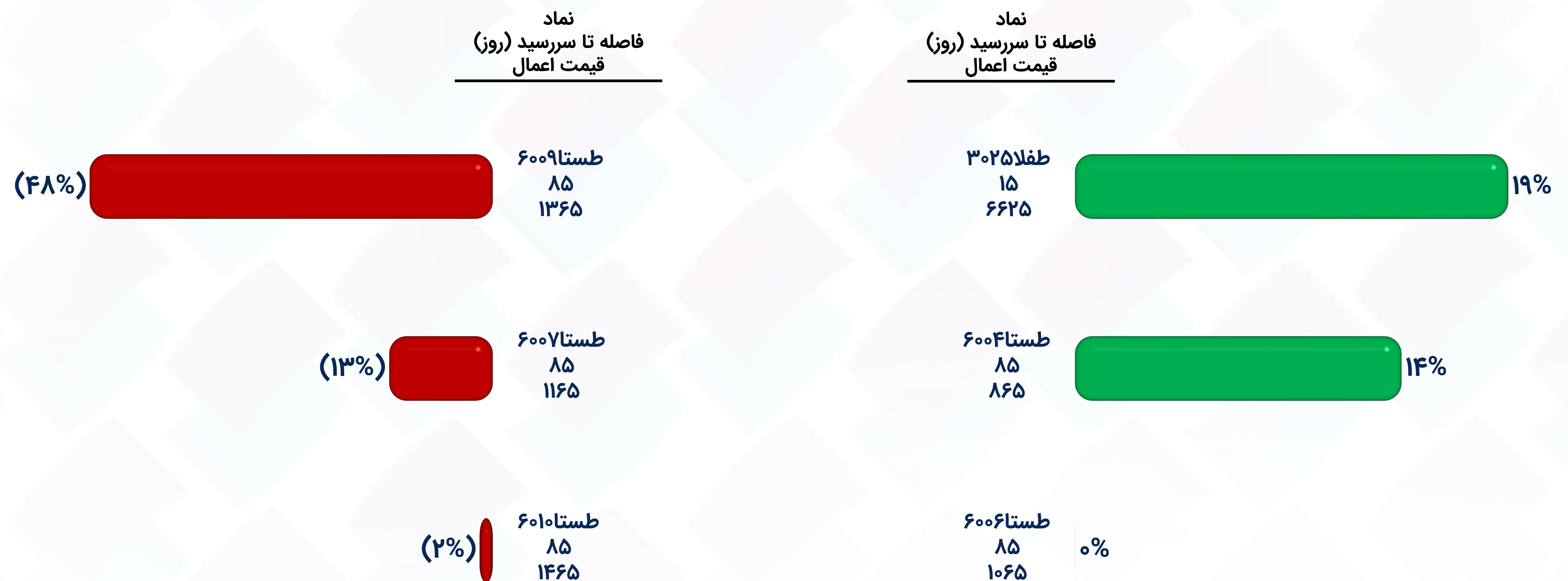
میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

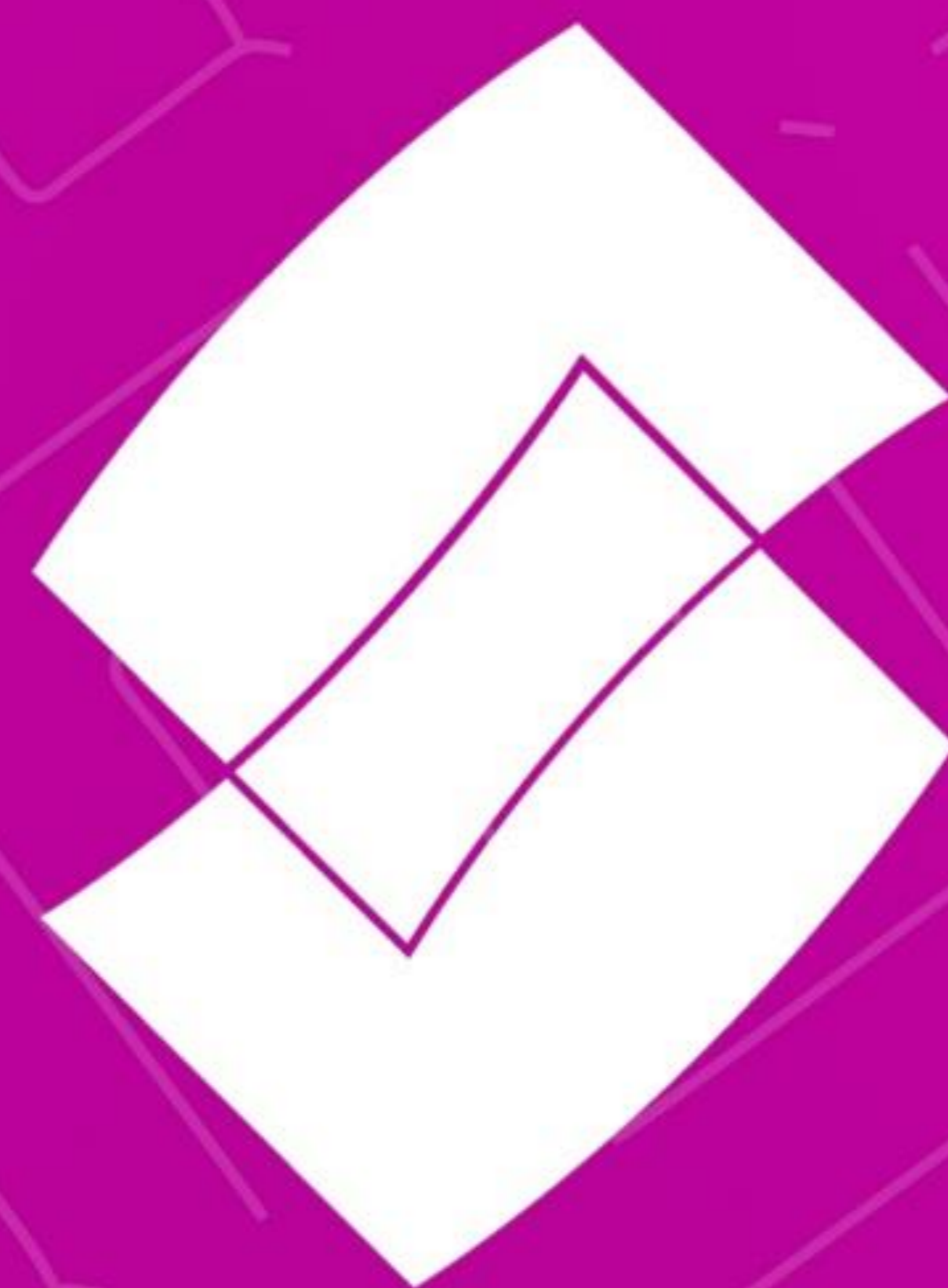
اختیار خرید



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.