

شماره

۲۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۰ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

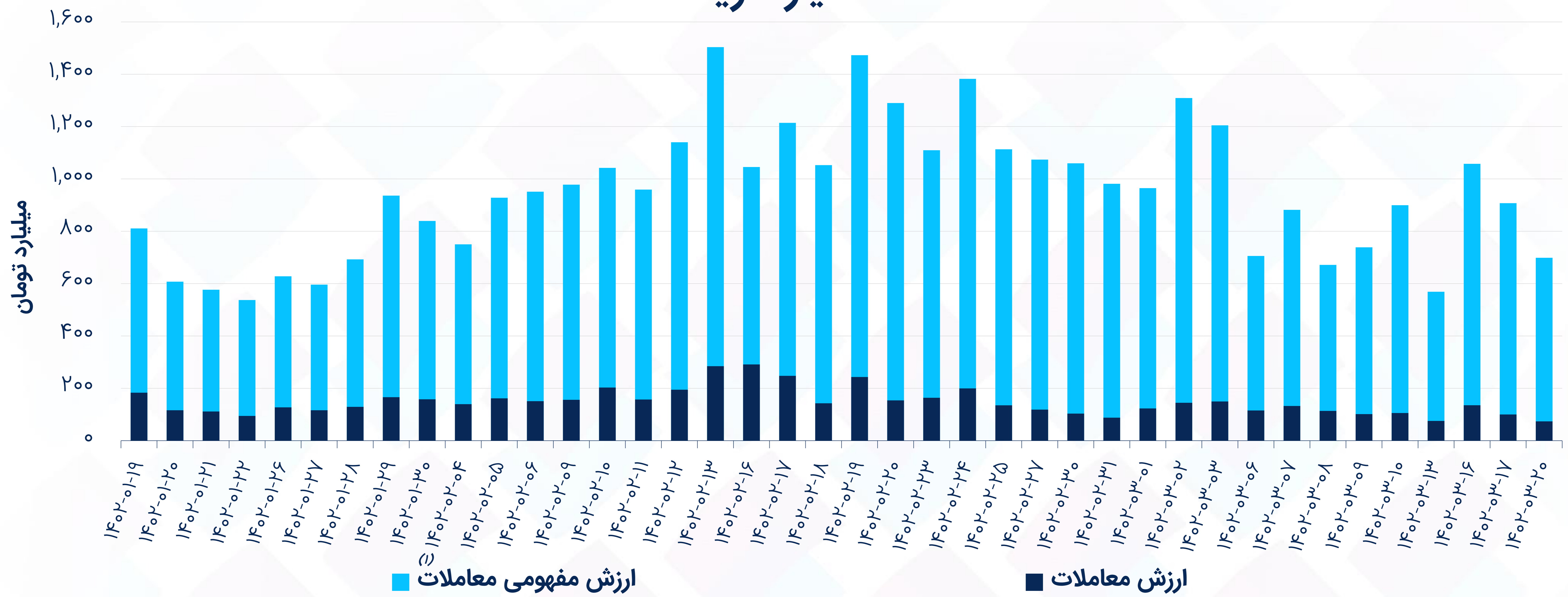




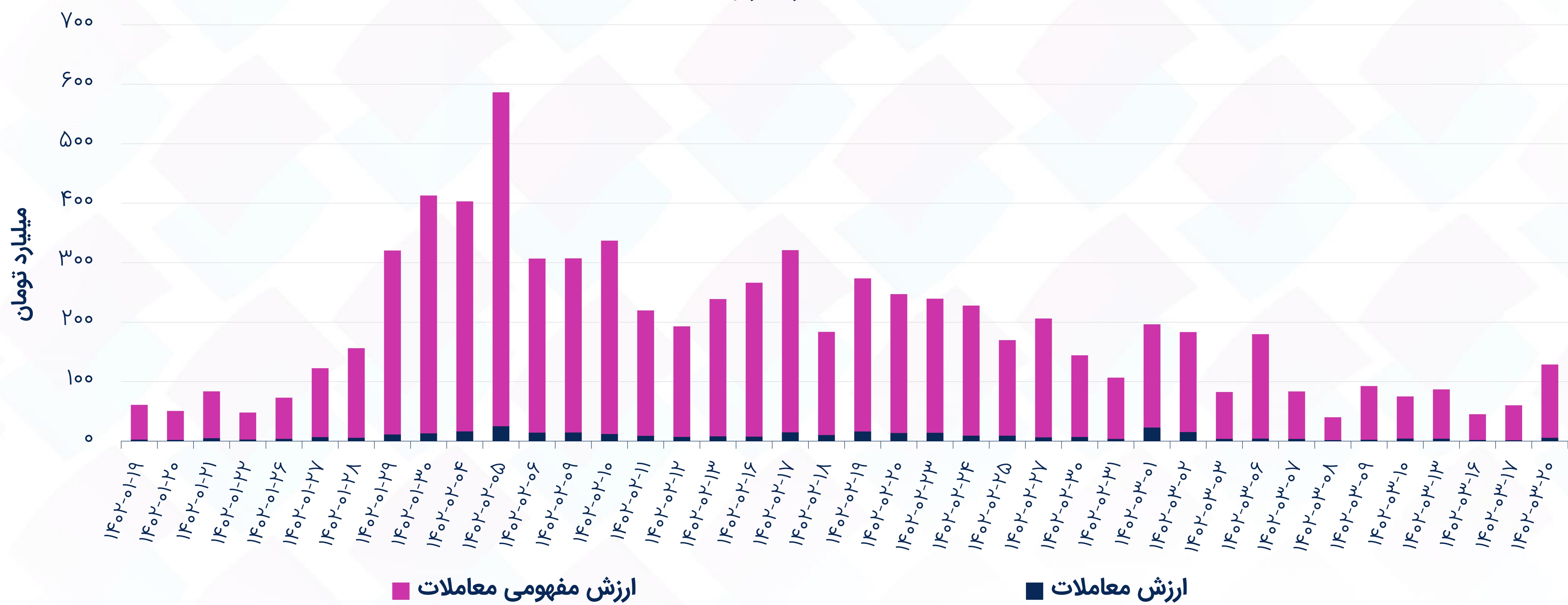
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



اختیار فروش



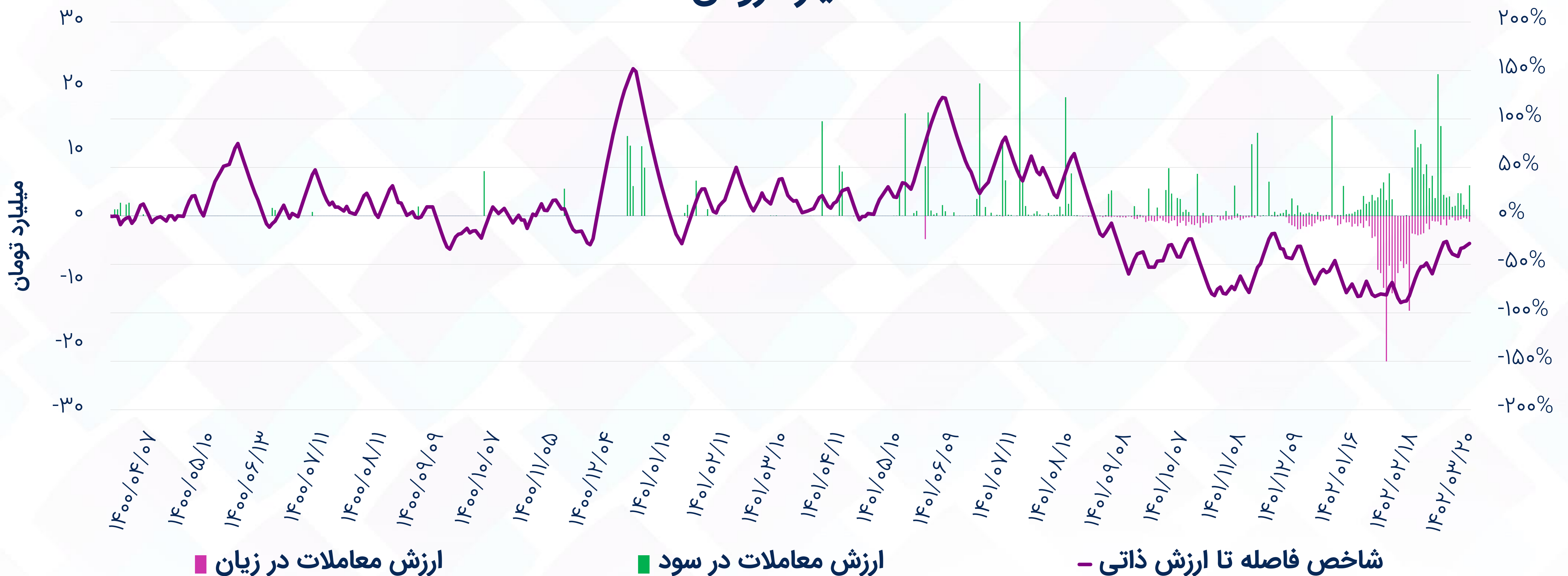
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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
شستا	۳۱	۲۷.۰	۲۵۸.۶	۹.۱	۱۷.۹	(۴۹.۳%)
خسپا	۳۳	۲۰.۳	۳۳۴.۷	۱۶.۶	۳.۷	۲.۴%
اهرم	۱۹	۱۰.۱	۱۹.۲	۹.۶	۰.۵	(۱۸.۳%)
دی	۱۴	۴.۰	۱۵.۴	۳.۱	۰.۹	(۱۳.۴%)
سرو	۱۳	۲.۵	۱۶.۵	۱.۶	۰.۸	(۴.۲%)
وبملت	۱۶	۱.۹	۸.۴	۱.۸	۰.۱	۸.۸%
وتجارت	۷	۱.۸	۷.۳	۱.۴	۰.۳	(۱۰.۱%)

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	۱۰	۵,۶۴۴.۴	۱۲۸,۳۵۸.۷	۴,۷۲۷.۸	۹۱۶.۶	(۲۸.۵%)
فولاد	۲	۶.۶	۷۵.۵	۶.۶	۰.۰	۸.۴%
اهرم	۲	۴.۲	۳۴۶.۶	۰.۰	۴.۲	۴۹.۵%
شبندر	۳	۱.۱	۷.۸	۱.۱	۰.۰	۰.۸%
فملی	۱	۰.۳	۴.۴	۰.۳	۰.۰	(۲۹.۸%)
توان	۱	۰.۳	۳.۷	۰.۰	۰.۳	(۲۹.۳%)
سمگا	۱	۰.۱	۱.۷	۰.۱	۰.۰	۳۲.۳%

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده



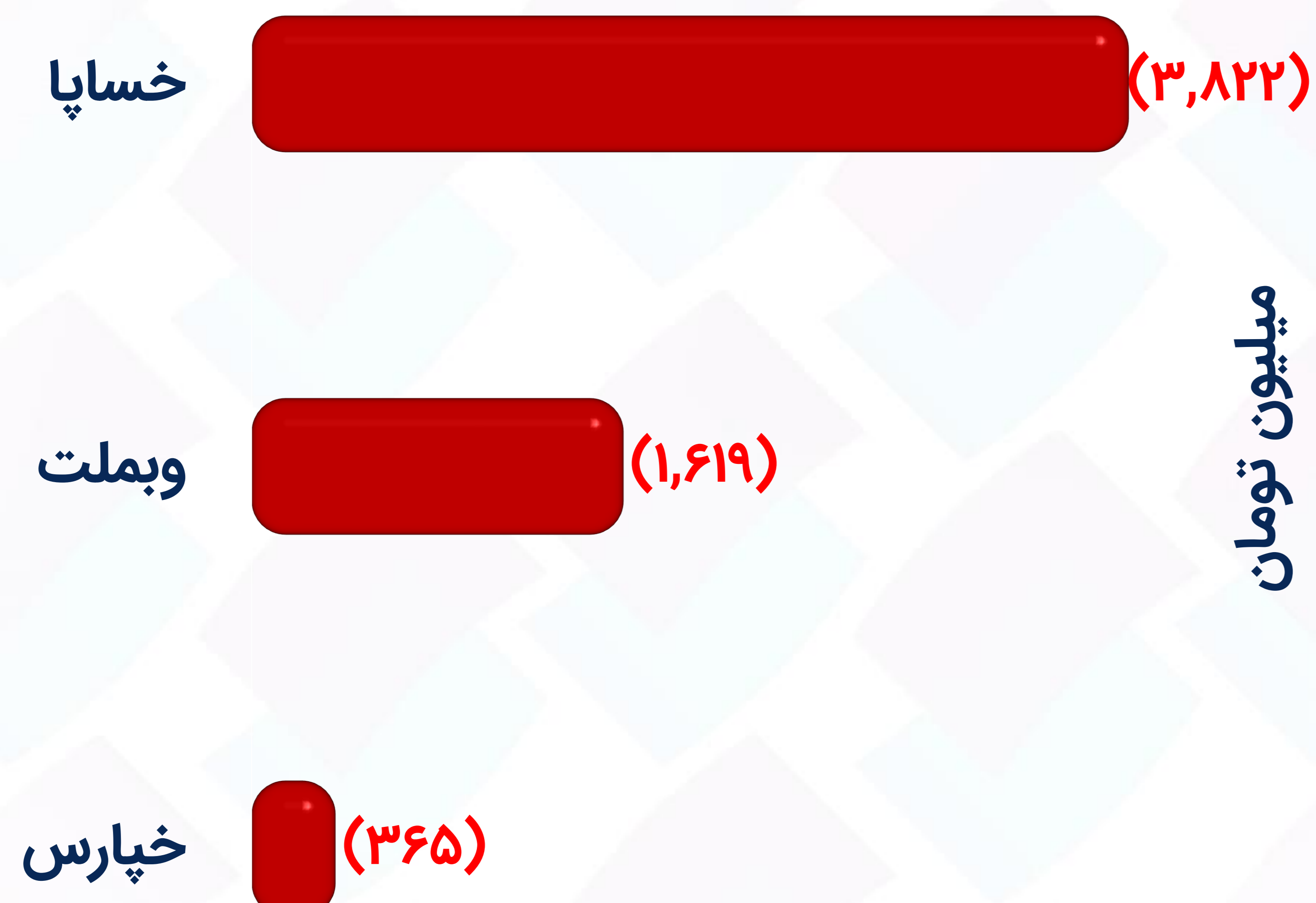
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



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

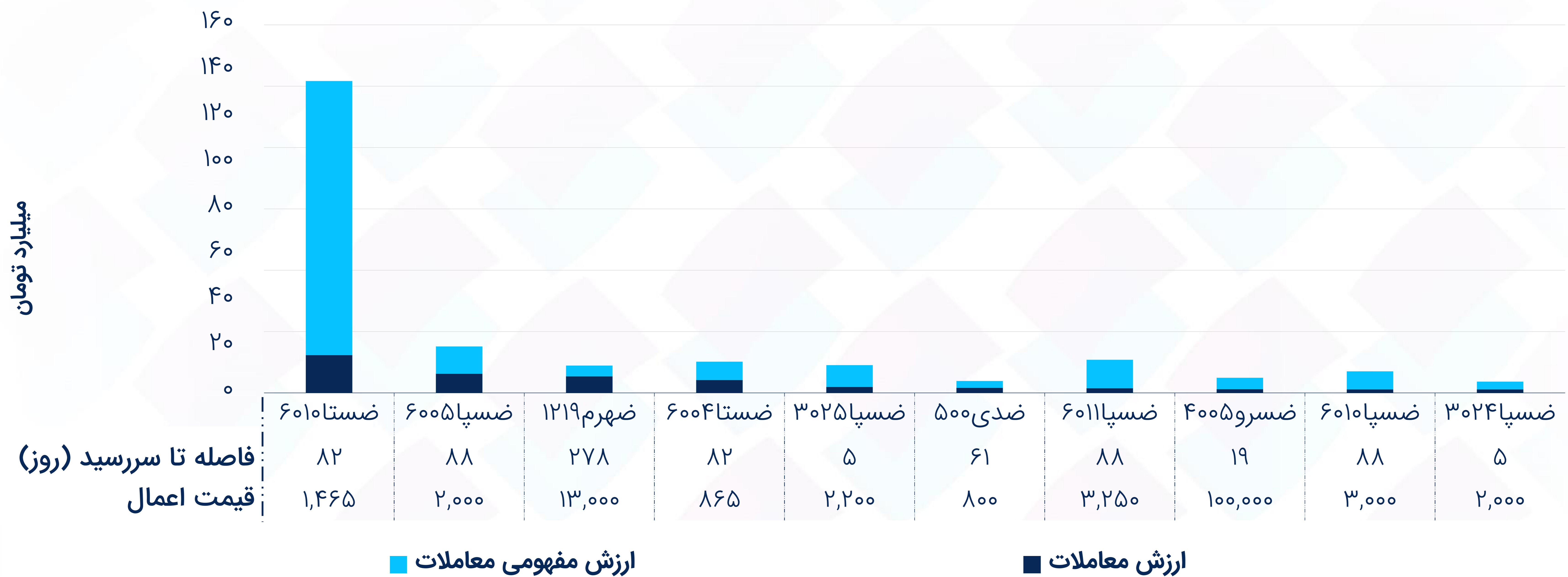
ارزش موقعیت‌های باز



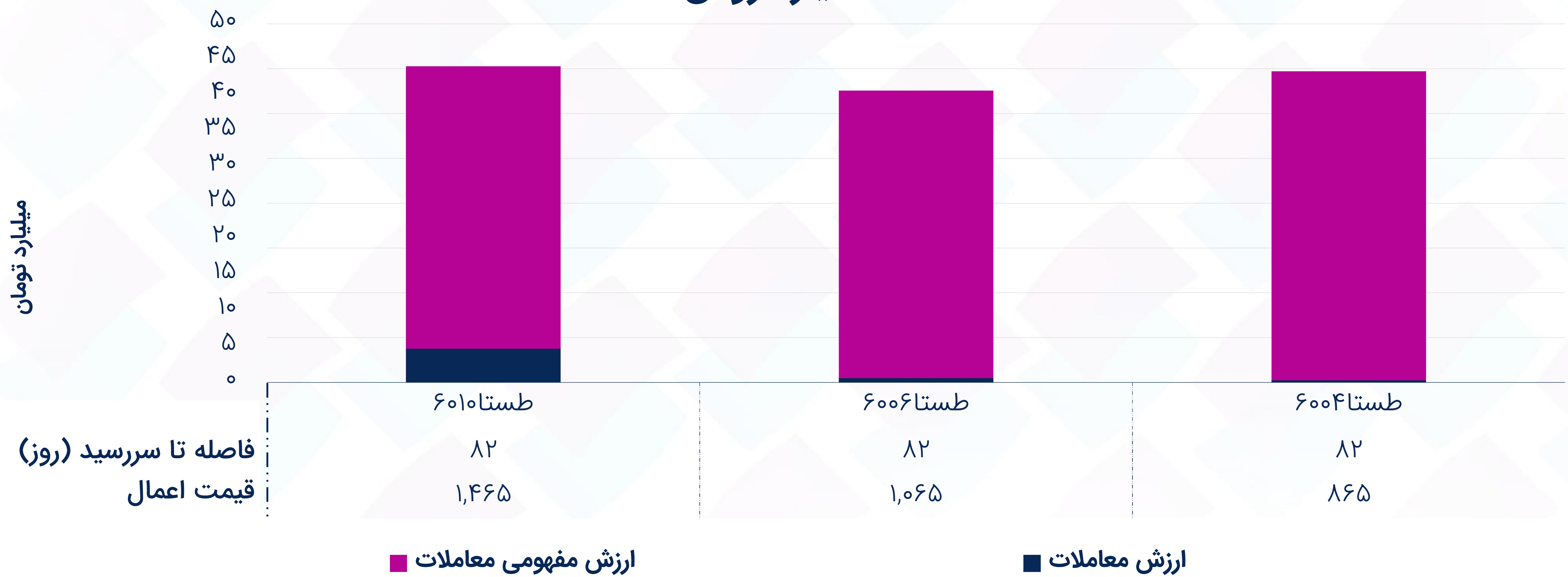
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضیتو ۴۰۰۲	زیتون	۳۷	۲.۶	۱,۳۱۹	۱۸,۰۷۰	۱۴,۳۱۹	(۲۰.۸%)	۱۰.۹	۱.۰۰	۵,۴۰۴	۳۱۰%
ضسپا ۳۰۲۸	خسپا	۵	۱۴۳.۲	۱۰۳	۳,۰۶۴	۲,۹۰۳	(۵.۳%)	۲۸.۲	۰.۹۶	۲۷۷	۱۶۹%
ضسپا ۳۰۲۹	خسپا	۵	۳۸۵.۱	۴۸	۳,۰۶۴	۳,۰۴۸	(۰.۵%)	۶۳.۵	۰.۶۸	۱۱۰	۱۲۹%
ضترا ۳۰۱۹	شتران	۹	۶.۲	۱,۳۱۹	۵,۴۰۰	۴,۱۱۹	(۲۳.۷%)	۳.۱	۱.۰۰	۲,۶۱۸	۹۸%
ضسپا ۳۰۲۷	خسپا	۵	۵۸۷.۱	۲۸۳	۳,۰۶۴	۲,۸۸۳	(۵.۹%)	۱۰.۲	۱.۰۰	۴۷۳	۶۷%

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 سرربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضستا ۴۰۱۱	شستا	۲۶	۲۶۰.۱	۷	۱,۳۱۷	۲,۰۰۷	۵۲%	۲۸۶.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۵۰۱۱	شستا	۵۴	۲.۶	۱۶	۱,۳۱۷	۲,۴۱۶	۸۳%	۱۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضسپا ۳۰۳۳	خسپا	۵	۱۸.۱	۱	۳,۰۶۴	۴,۰۰۱	۳۱%	۴,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضچکا ۴۰۱۲	چکپا	۱۶	۱.۹	۸	۳,۸۰۹	۵,۵۰۸	۴۵%	۶۸۸.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۰۹	شستا	۲۶	۳۷.۶	۱۵	۱,۳۱۷	۱,۸۱۵	۳۸%	۱۲۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
 (۲) فاصله تا سرربه‌سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سربه‌سر)
 (۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سربه‌سر
 تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

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
۴۹.۶%	۴۰۸	-۰.۱۱	۵۷.۶	(۲۴%)	۱۵,۷۲۷	۲۰,۶۵۰	۲۷۳	۴.۲	۱۲۸	۱۶,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۱

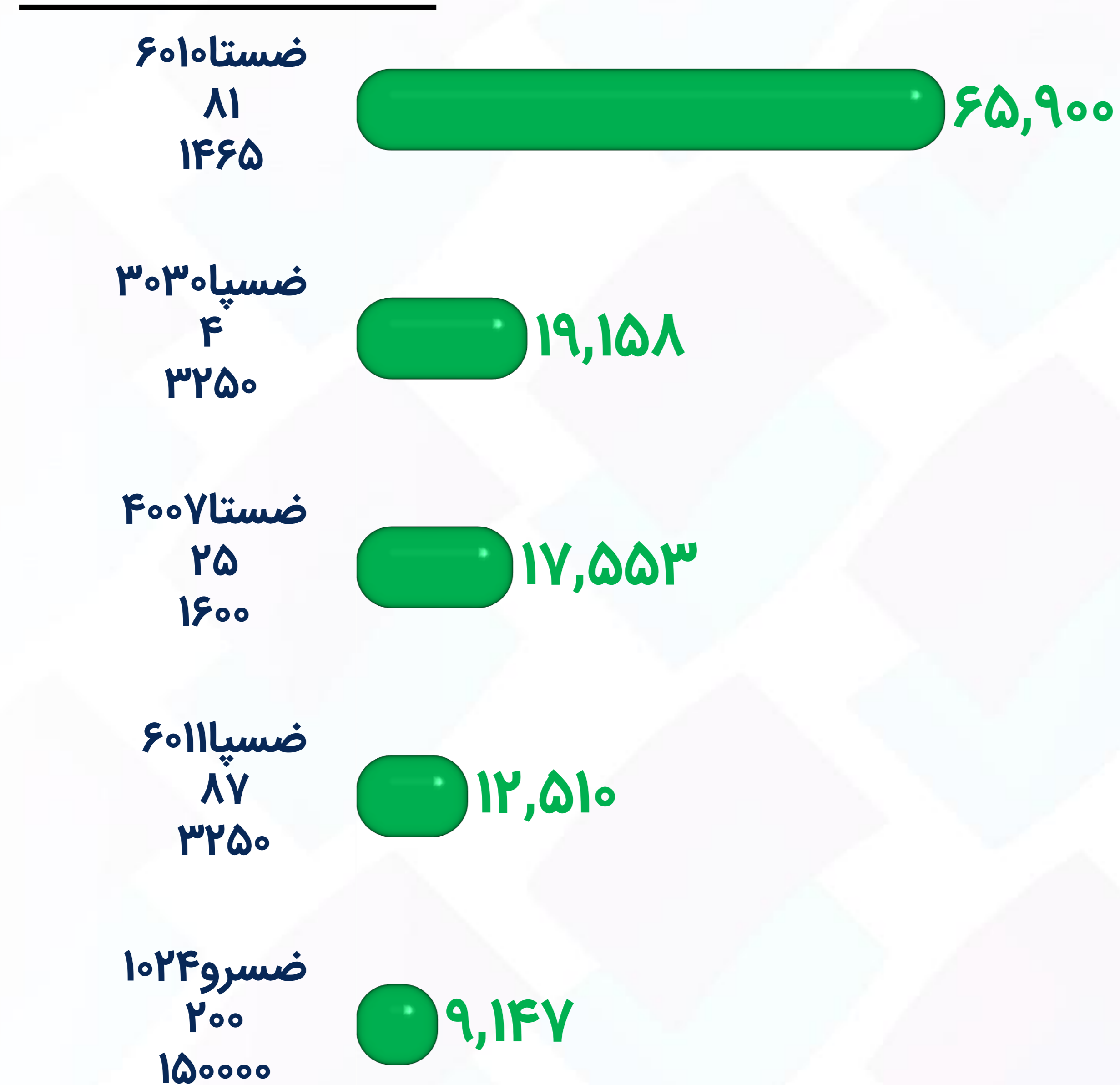
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۱۰۷.۱	(۳۵%)	۸۵۷	۱,۳۱۷	۸	۲۶۳.۸	۸۲	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۸۸%)	۲	-۰.۰۳	۴۹.۷	(۲۱%)	۱,۰۴۴	۱,۳۱۷	۲۱	۶۴۸.۵	۸۲	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶
(۸۲%)	۱۰	-۰.۱۰	۲۰.۲	(۱۶%)	۱,۱۱۰	۱,۳۱۷	۵۵	۳.۹	۸۲	۱,۱۶۵	طستا ۶۰۰۷
(۱۶%)	۱۱۸	-۰.۶۰	۹.۴	۱%	۱,۳۲۴	۱,۳۱۷	۱۴۱	۴,۷۲۶.۶	۸۲	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰

(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



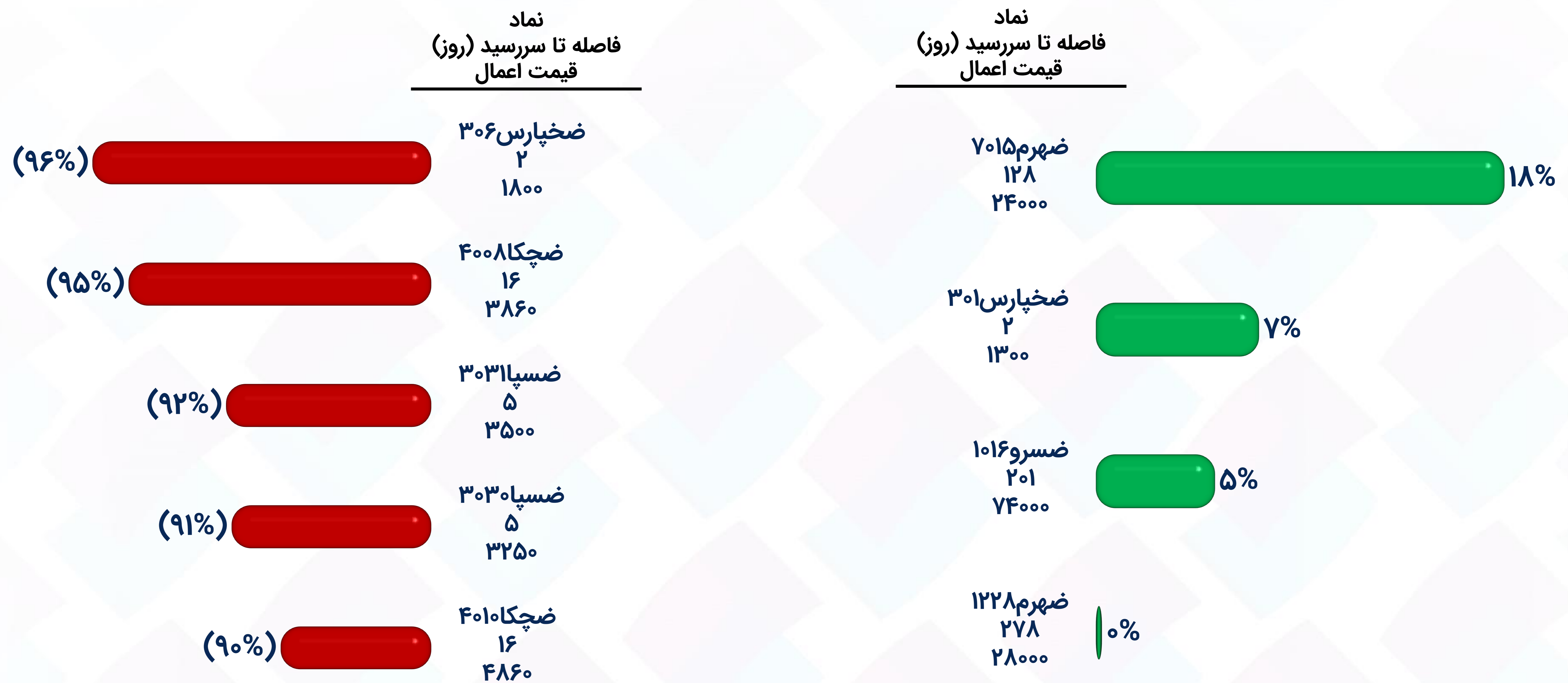
ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال

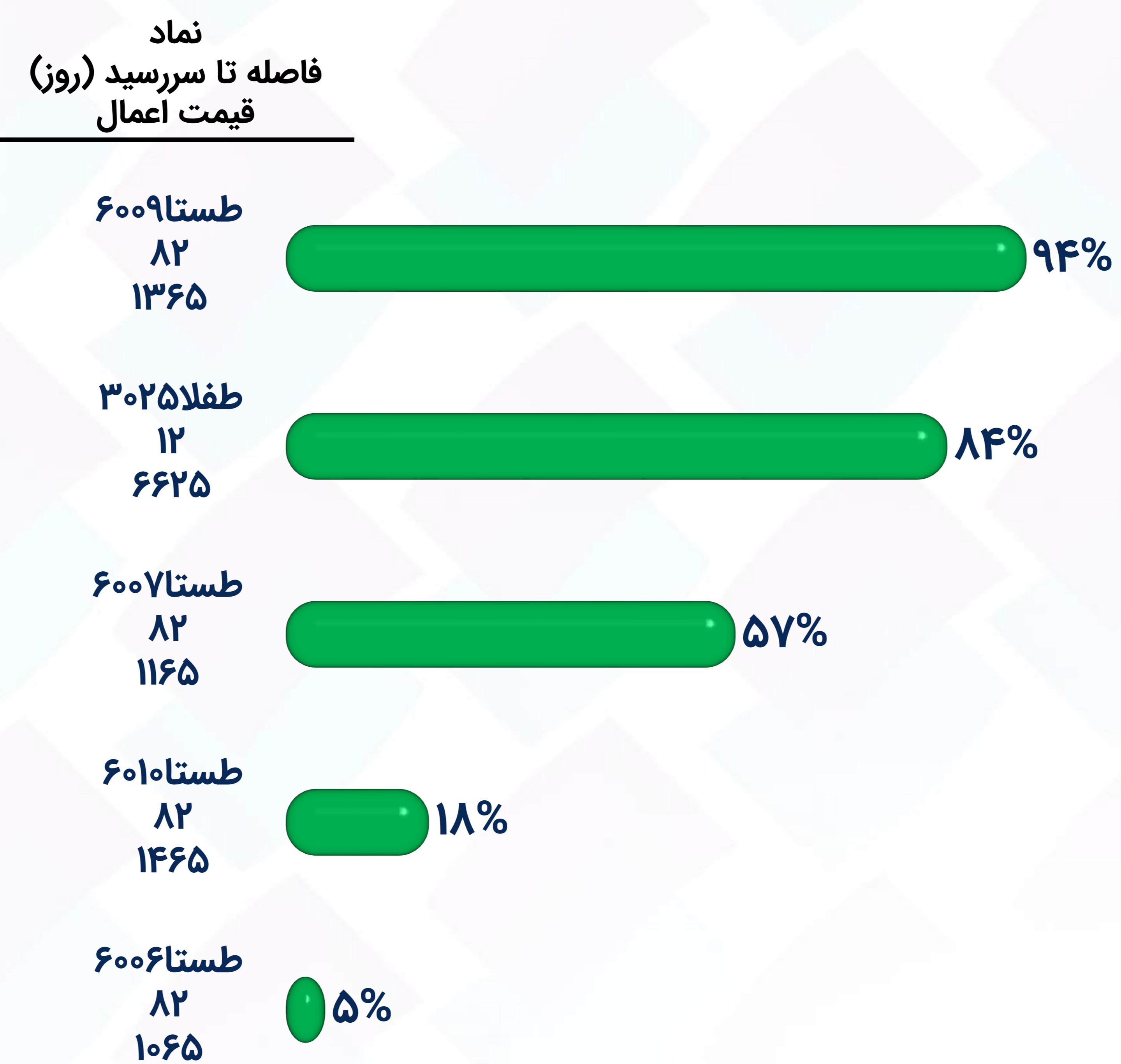


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

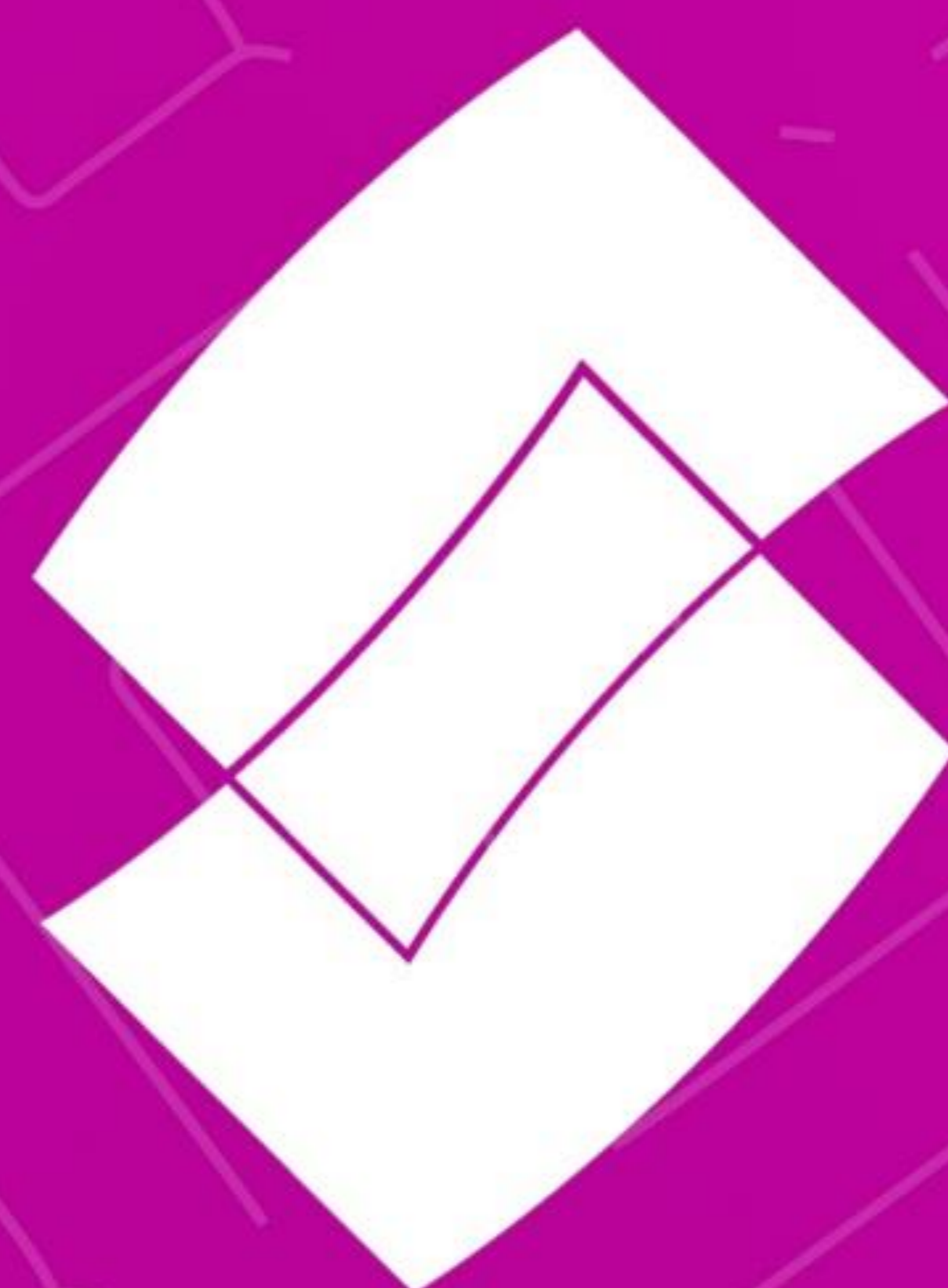
اختیار خرید



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.