

شماره

۲۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۲ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

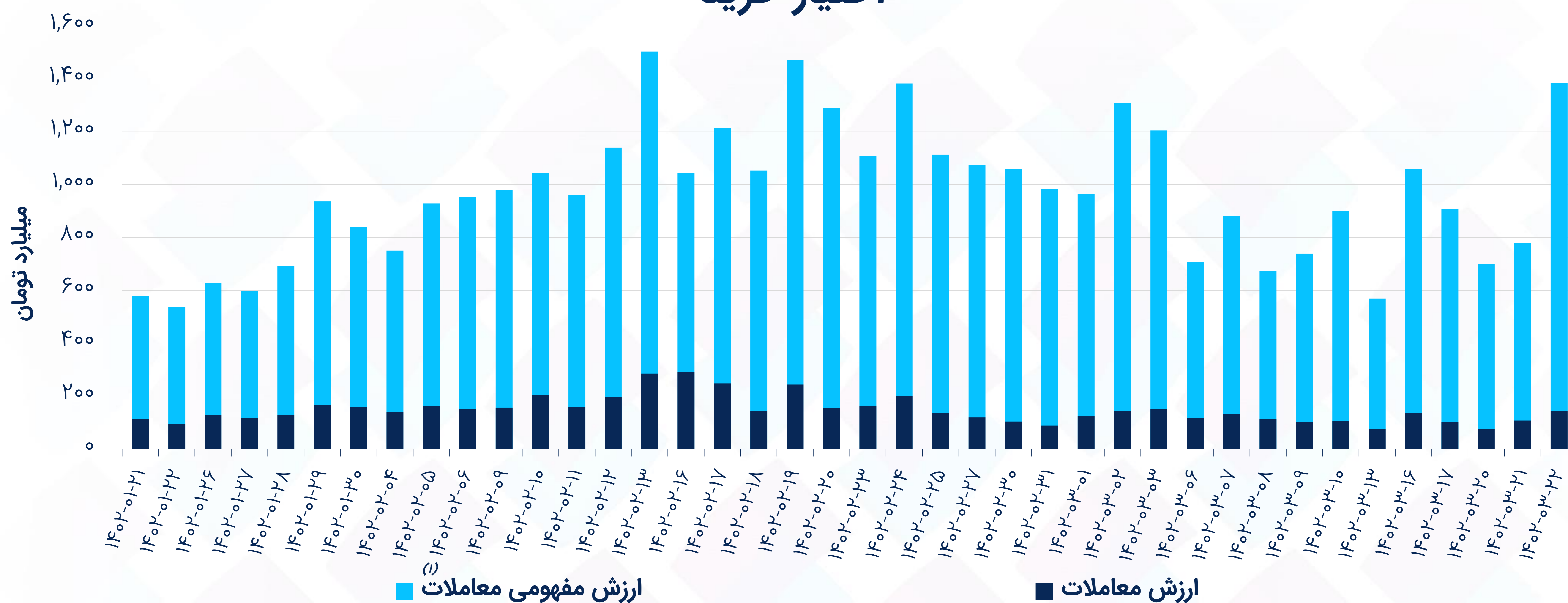




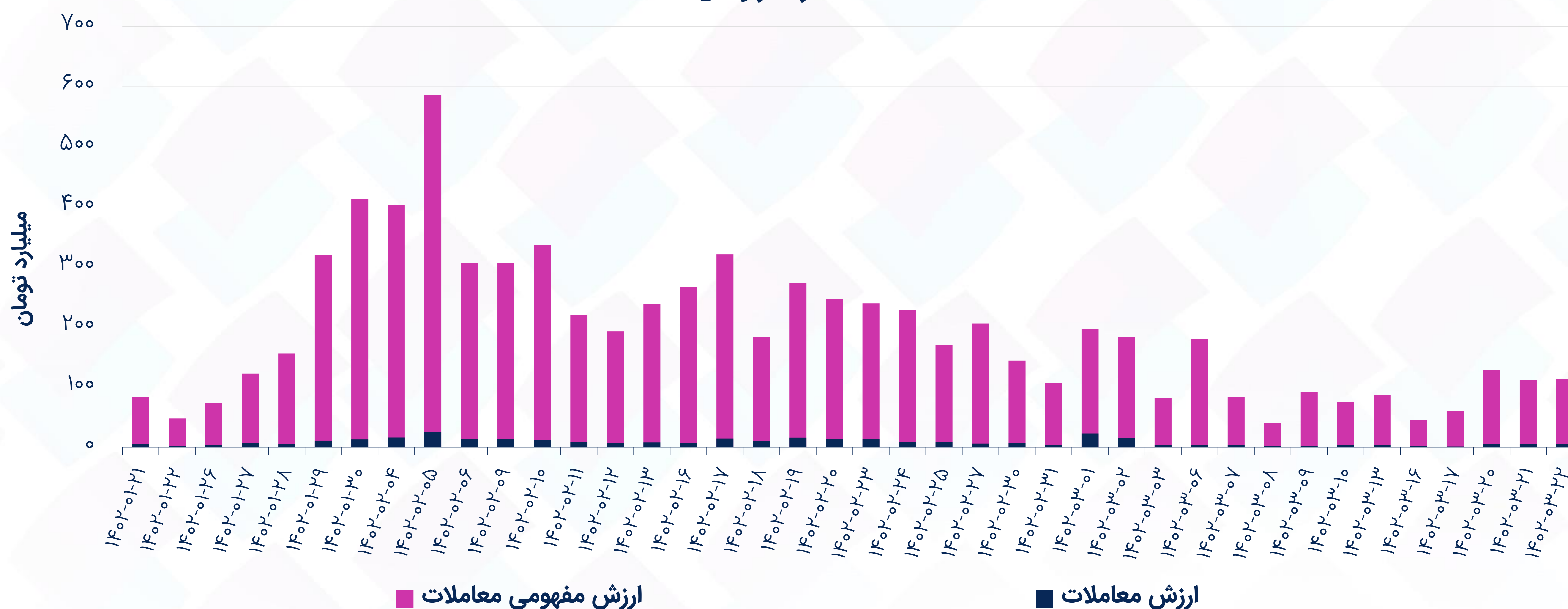
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



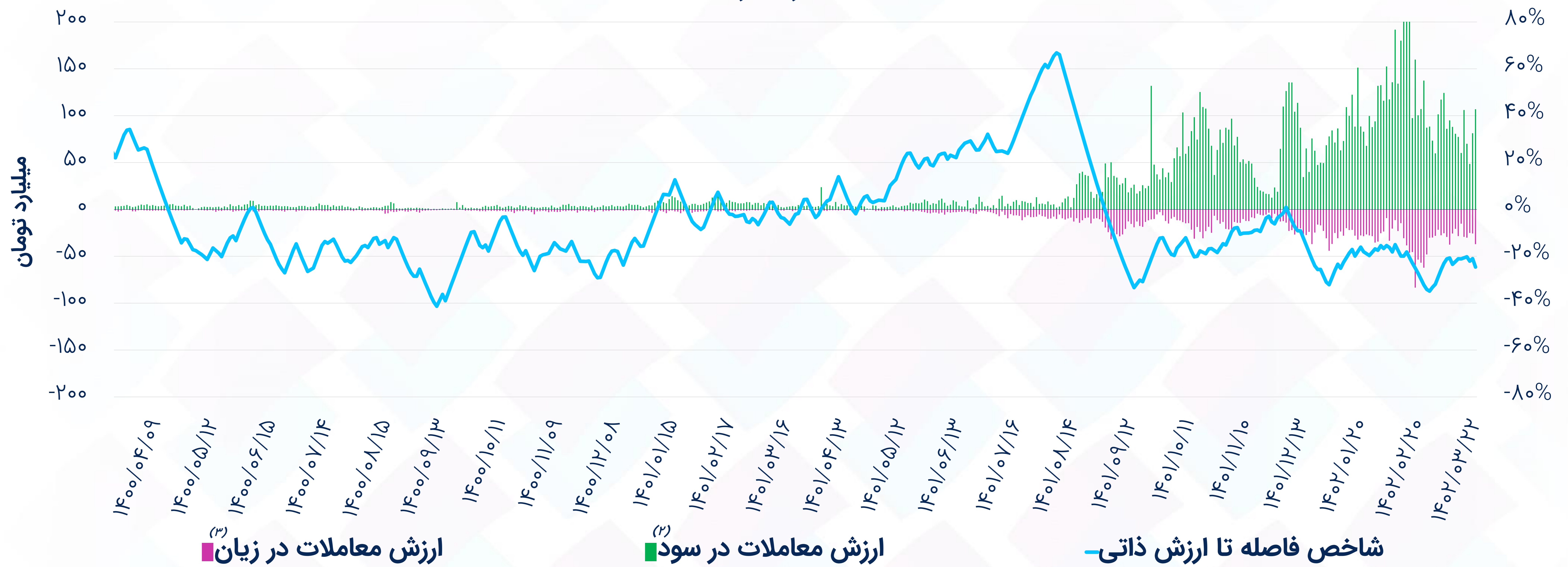
اختیار فروش



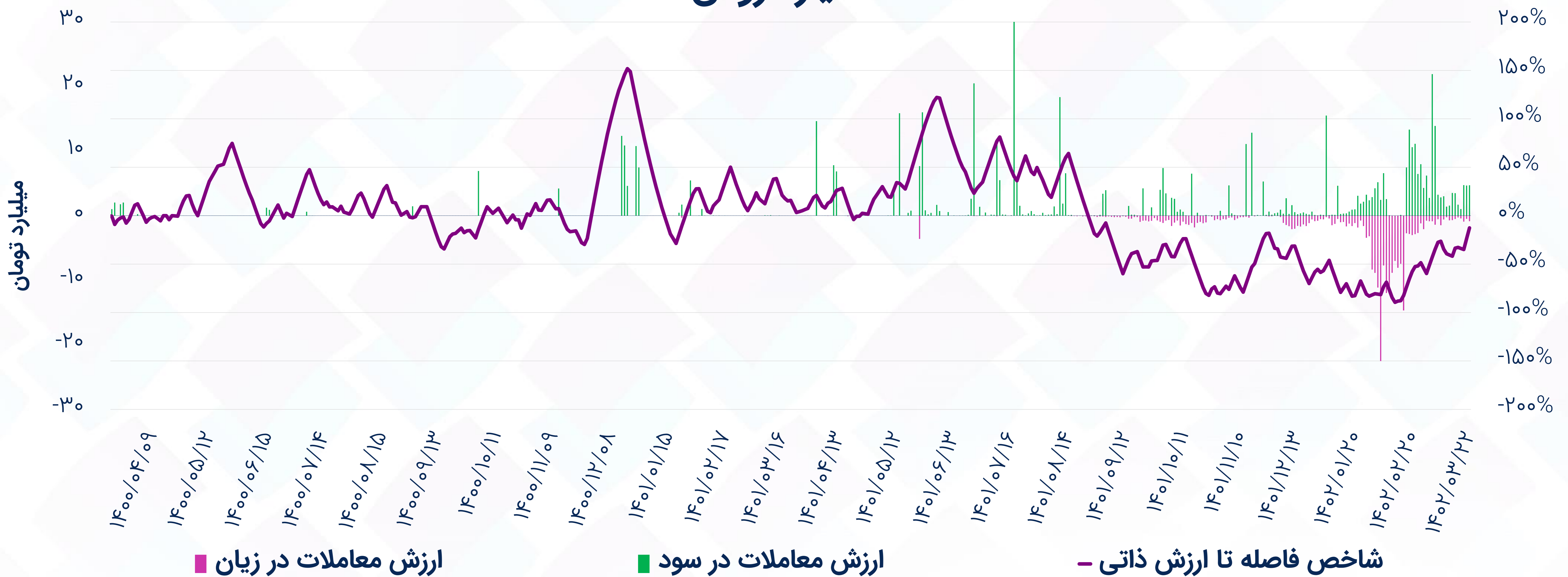
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

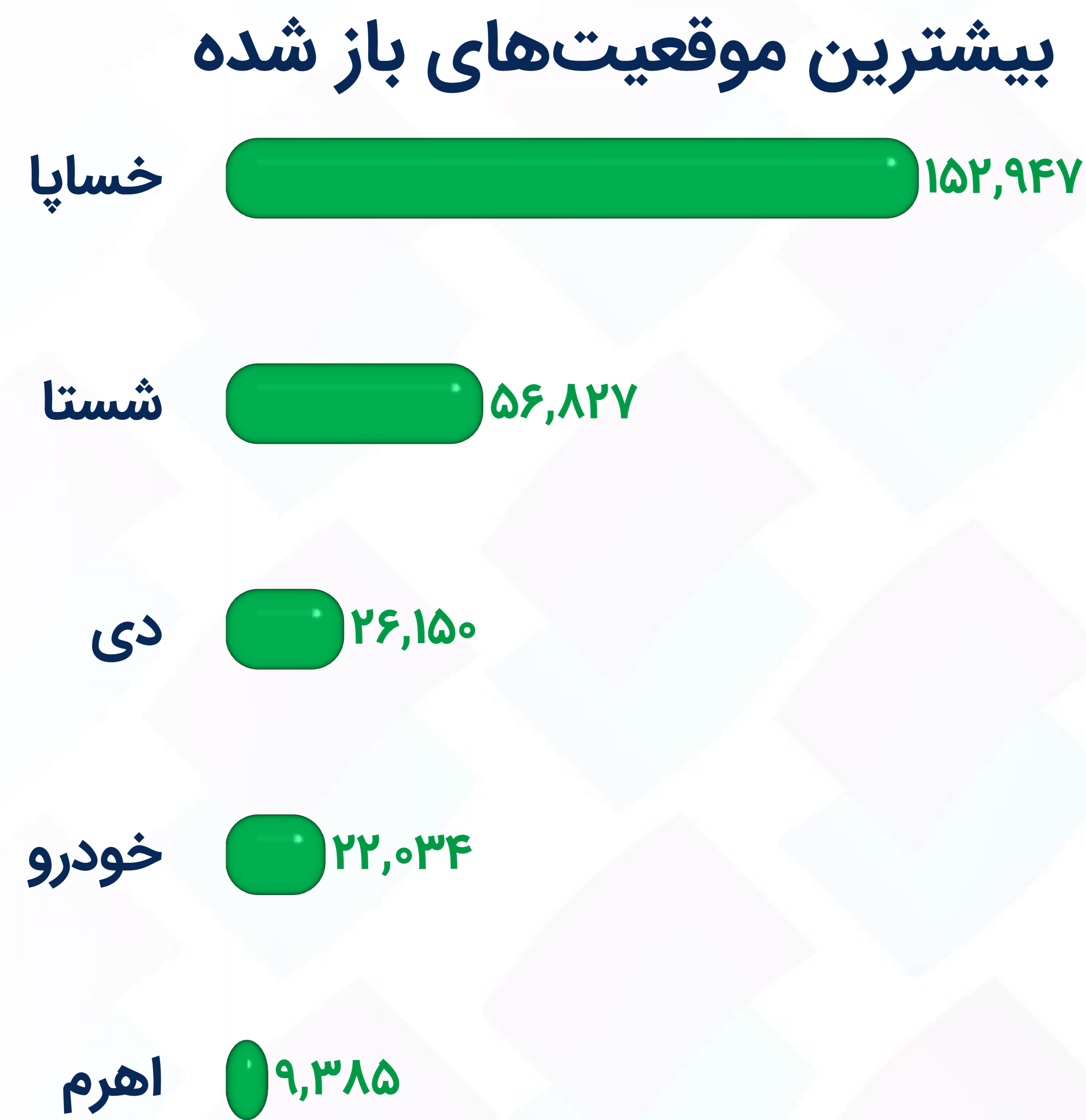
اختیار خرید

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
خسپا	۳۲	۵۱.۰	۶۸۸.۳	۴۰.۳	۱۰.۷	(۱۳.۱%)
خودرو	۲۱	۲۴.۴	۲۵۱.۶	۲۰.۲	۴.۲	(۳۰.۷%)
شستا	۳۴	۲۳.۱	۲۷۸.۳	۶.۶	۱۶.۵	(۵۵.۵%)
دی	۱۷	۱۶.۰	۵۵.۳	۱۲.۰	۴.۰	(۲۲.۹%)
اهرم	۲۲	۱۵.۰	۲۸.۳	۱۴.۶	۰.۴	(۲۱.۶%)
وبملت	۱۷	۴.۵	۱۳.۰	۴.۵	۰.۰	۰.۷%
خاور	۵	۳.۵	۶.۷	۳.۵	۰.۰	(۲۴.۱%)

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	۷	۵,۵۰۰.۱	۱۱۲,۷۰۹.۶	۴,۶۴۶.۵	۸۵۳.۶	(۱۳.۰%)
فولاد	۲	۶۸.۸	۴۱۹.۶	۶۸.۸	۰.۱	۱۶.۱%
سمگا	۱	۱.۲	۱۵.۷	۱.۲	۰.۰	۵۵.۵%
اهرم	۱	۰.۸	۷.۸	۰.۸	۰.۰	(۴.۷%)
توسن	۱	۰.۵	۱.۹	۰.۵	۰.۰	(۷.۸%)
توان	۱	۰.۳	۳.۵	۰.۰	۰.۳	(۶.۳%)

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



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



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

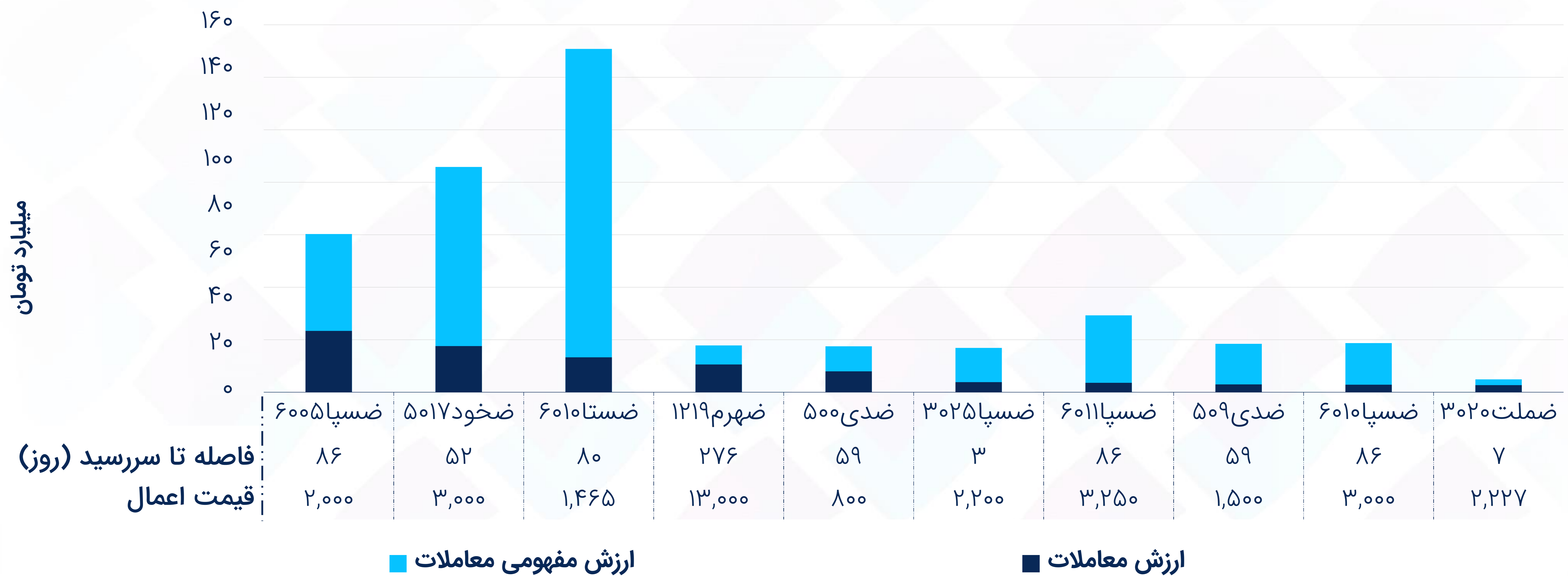


بیشترین موقعیت‌های بسته شده

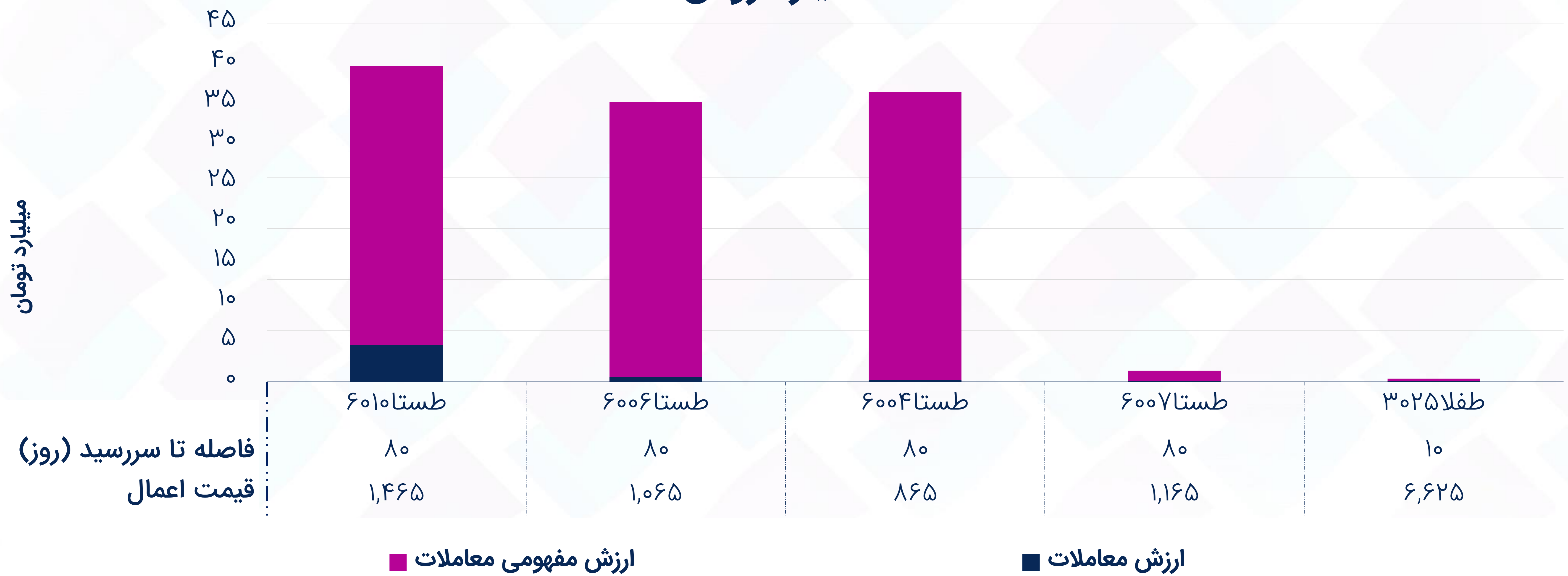


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۷۹%	۳,۵۷۴	۰.۹۰	۹.۳	(۰.۶%)	۱۸,۶۰۱	۱۸,۷۱۰	۲,۰۰۱	۳.۴	۱۱۹	۱۶,۶۰۰	ضتوسن ۷۰۵
۵۷%	۳,۴۵۲	۱.۰۰	۴.۶	(۹.۹%)	۱۰,۲۰۰	۱۱,۳۲۰	۲,۲۰۰	۱۱.۰	۲۴	۸,۰۰۰	ضترو ۴۰۰۲
۵۳%	۸۸۳	۰.۴۵	۳۲.۱	۱۷.۰%	۱۸,۵۷۸	۱۵,۸۸۰	۵۷۸	۴۳.۶	۱۲۲	۱۸,۰۰۰	ضسلا ۷۰۱۱
۳۱%	۷۸۴	۰.۶۸	۱۹.۳	۲.۵%	۱۱,۶۰۰	۱۱,۳۲۰	۶۰۰	۱۹.۸	۲۴	۱۱,۰۰۰	ضترو ۴۰۰۵
۳۰%	۷۱	۰.۳۸	۶۶.۶	۵.۳%	۳,۶۶۵	۳,۴۸۰	۵۵	۷.۳	۱۴	۳,۶۱۰	ضچکا ۴۰۰۷

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	۶۶۷.۷	۵۷%	۲,۰۰۳	۱,۲۷۲	۳	۱۴۲.۵	۲۴	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۰۱.۰	۸۹%	۲,۴۰۸	۱,۲۷۲	۸	۱.۶	۵۲	۲,۴۰۰	ضستا ۵۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۱۷.۷	۵۰%	۱,۹۰۶	۱,۲۷۲	۶	۲.۴	۲۴	۱,۹۰۰	ضستا ۴۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲,۷۵۱.۰	۶۳%	۵,۵۰۲	۳,۳۷۶	۲	۴۴.۹	۱۷	۵,۵۰۰	ضخود ۴۰۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۲۵۱.۰	۲۷%	۶,۵۰۲	۵,۱۲۰	۲	۳.۹	۷	۶,۵۰۰	ضترا ۳۰۲۹

(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
۵۵.۵%	۹۳۳	-۰.۴۵	۱۳.۲	۱%	۷,۹۰۰	۷,۸۴۰	۶۰۰	۱.۲	۱۱۲	۸,۵۰۰	طسمگا ۷۰۳
۱۶.۲%	۱,۰۵۹	-۱.۰۰	۶.۳	۳%	۵,۷۱۳	۵,۵۲۰	۹۱۲	۶۸.۸	۱۰	۶,۶۲۵	طفلا ۳۰۲

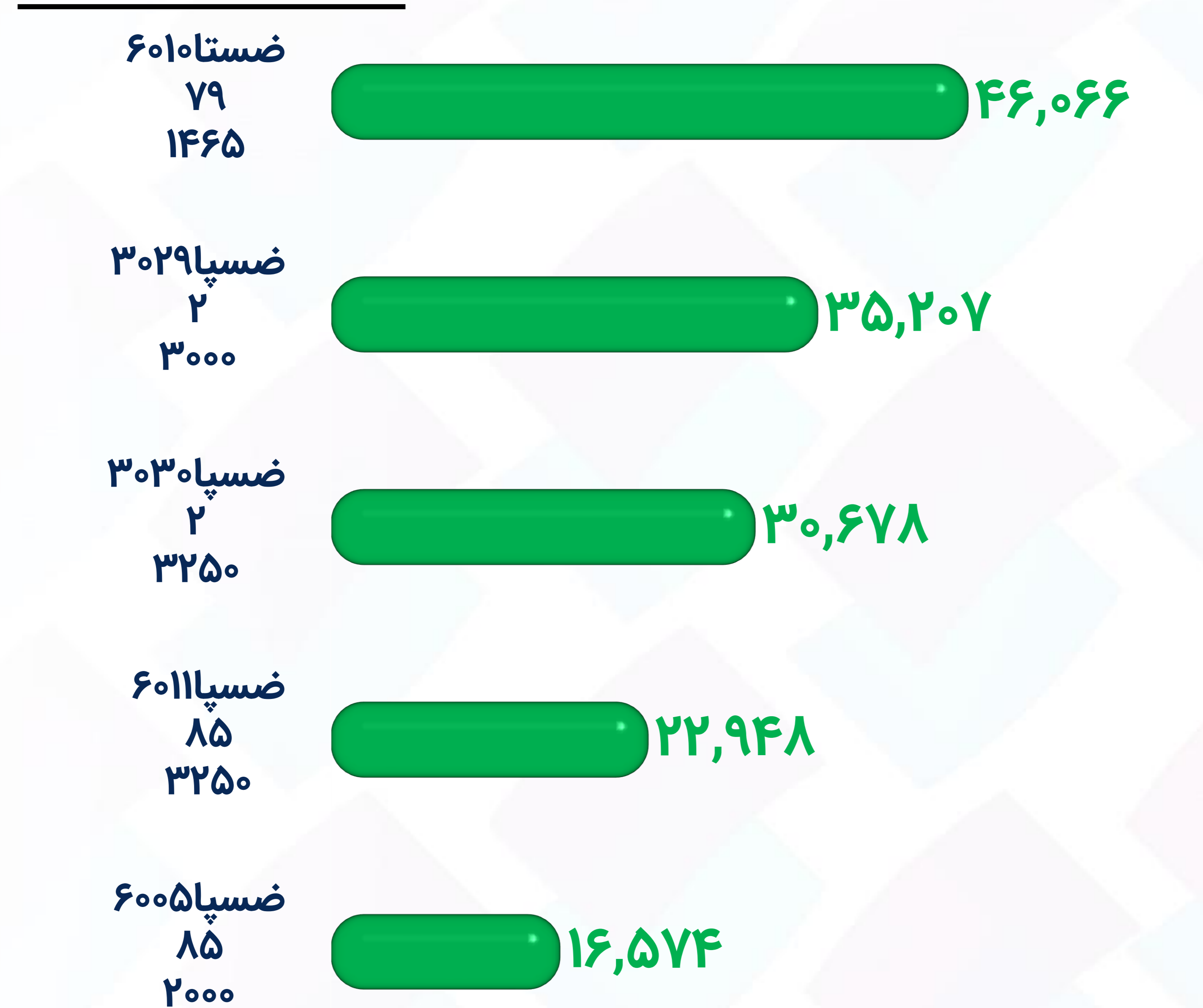
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۱۲۲.۶	(۳۳%)	۸۵۸	۱,۲۷۲	۷	۲۰۰.۵	۸۰	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۷۹%)	۴	-۰.۰۵	۴۹.۷	(۱۸%)	۱,۰۴۴	۱,۲۷۲	۲۱	۵۸۰.۶	۸۰	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶
(۷۵%)	۱۶	-۰.۱۵	۱۶.۹	(۱۴%)	۱,۱۰۰	۱,۲۷۲	۶۵	۷۱.۹	۸۰	۱,۱۶۵	طستا ۶۰۰۷
(۱۸%)	۸۷	-۰.۵۱	۱۲.۰	(۱%)	۱,۲۶۰	۱,۲۷۲	۱۰۵	۱.۳	۸۰	۱,۳۶۵	طستا ۶۰۰۹
(۰%)	۱۴۹	-۰.۶۹	۸.۸	۳%	۱,۳۱۶	۱,۲۷۲	۱۴۹	۴,۶۴۵.۳	۸۰	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.

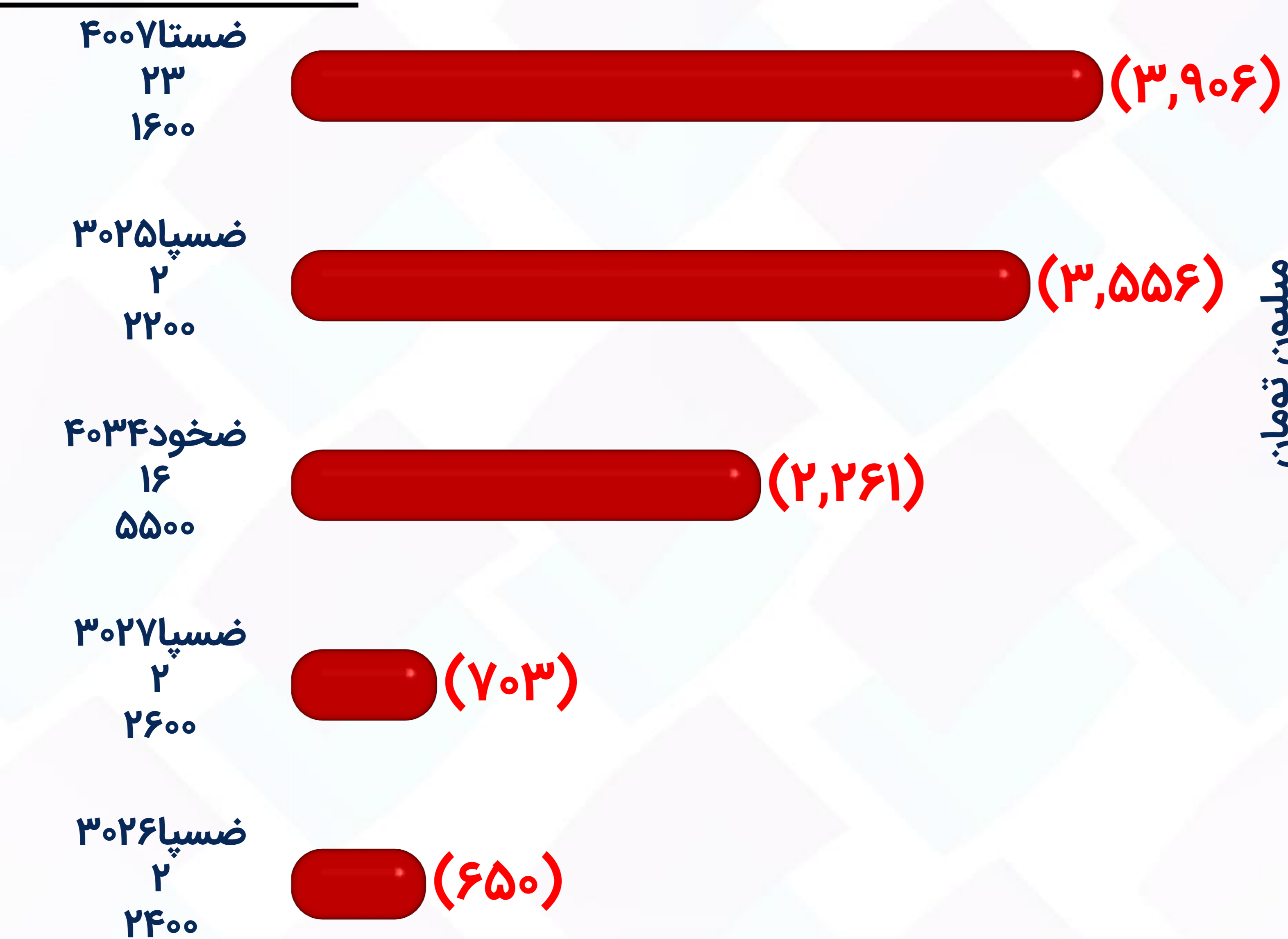
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

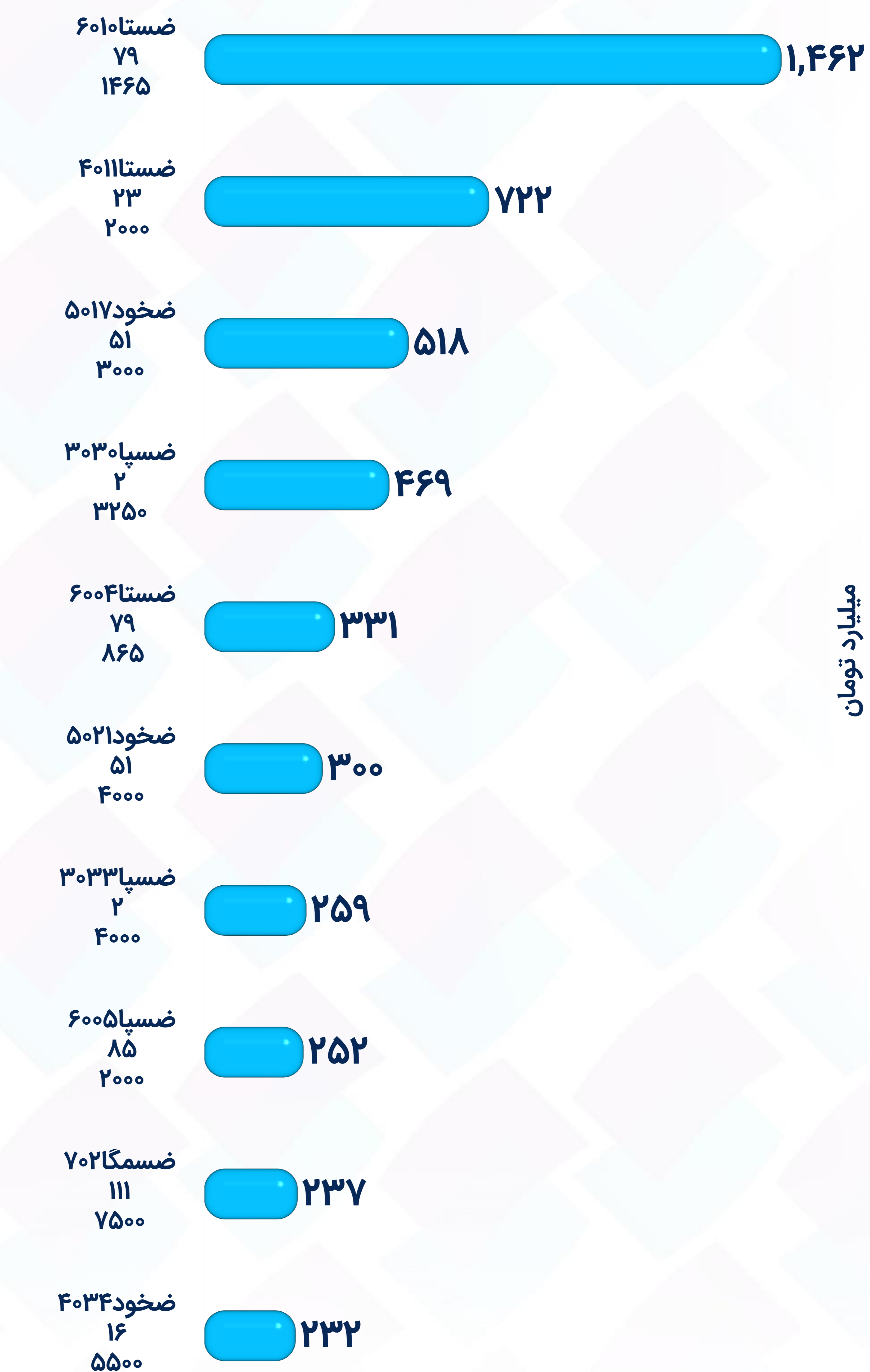
بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

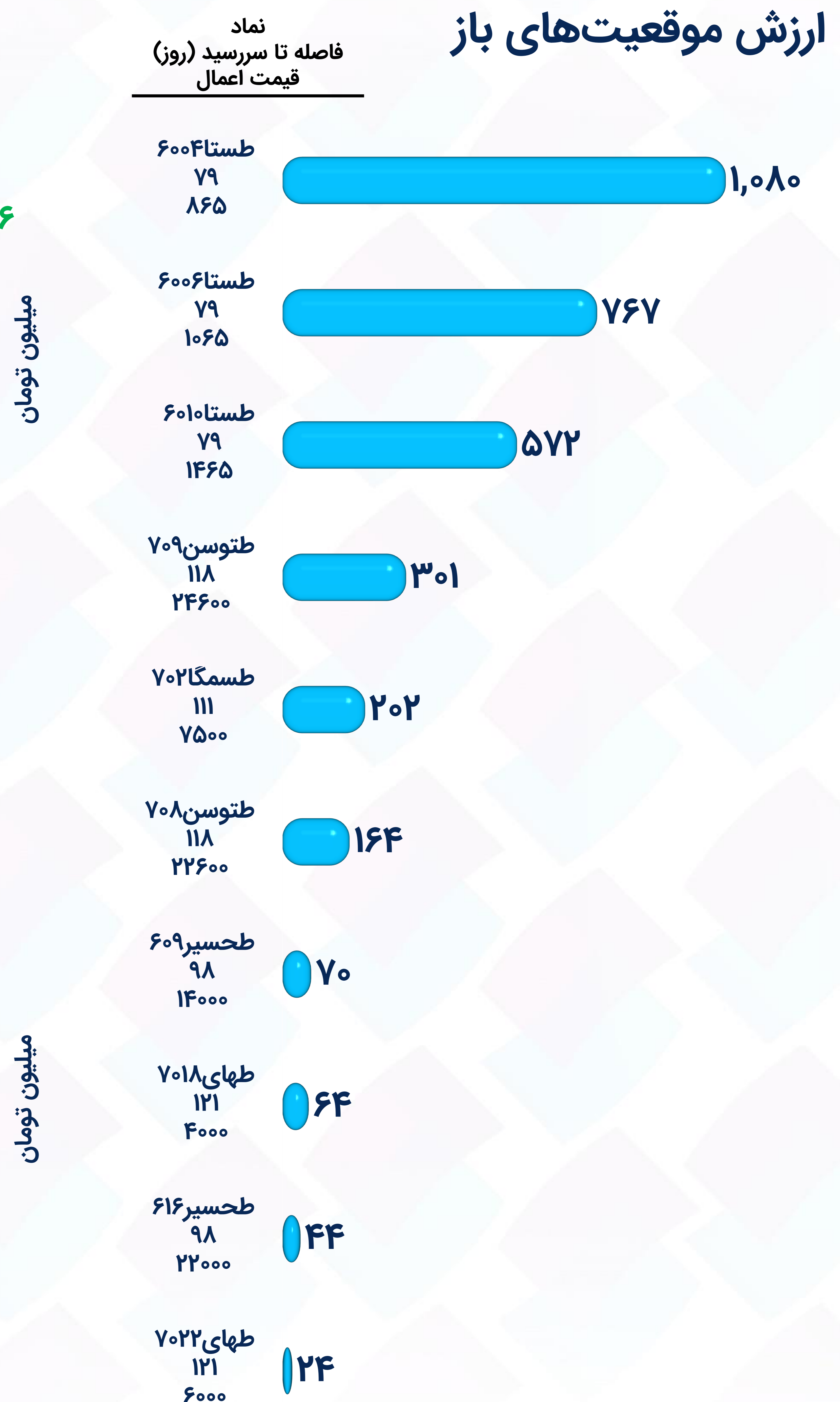
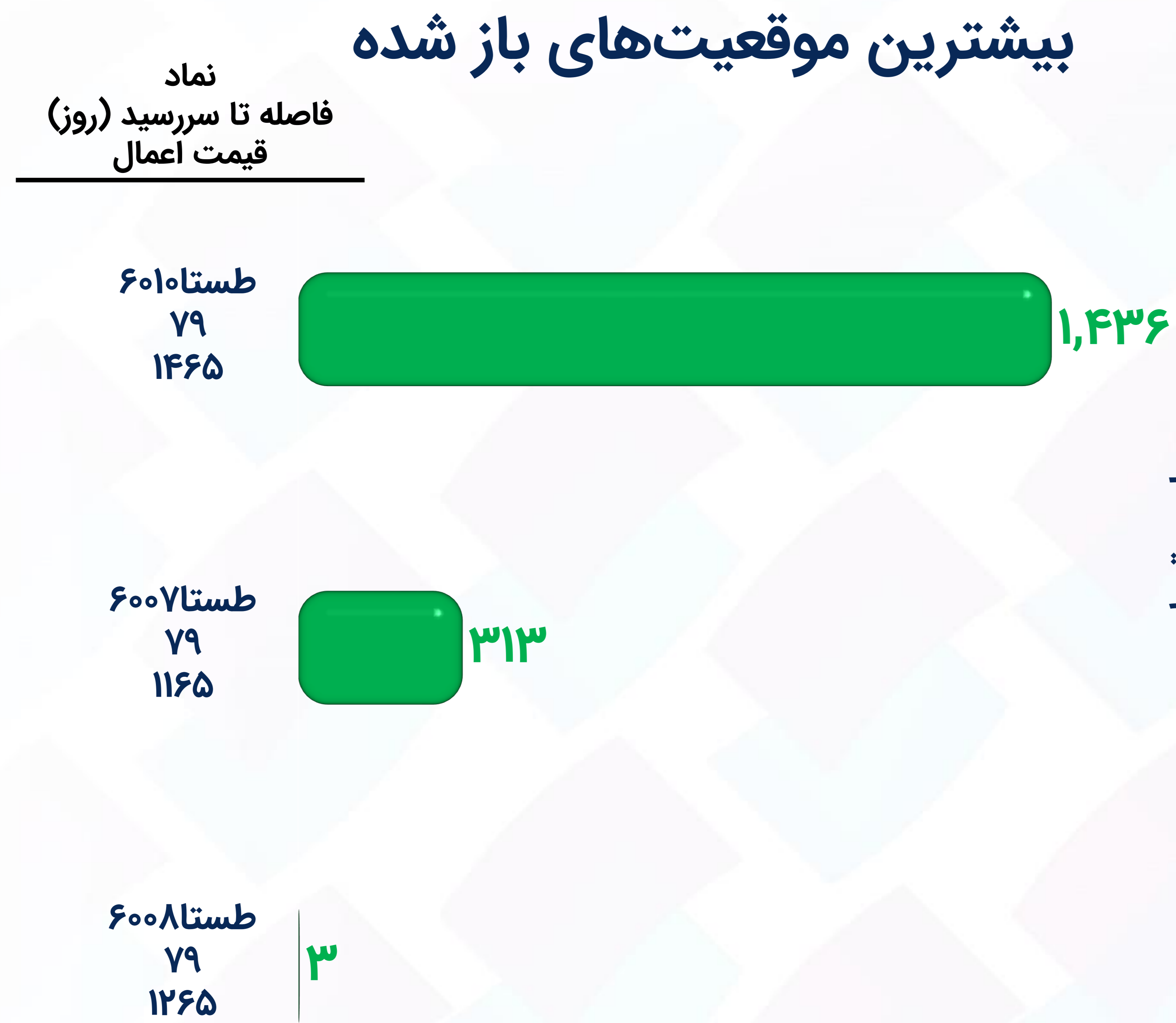
ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش



میلیارد تومان

میلیون تومان

میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

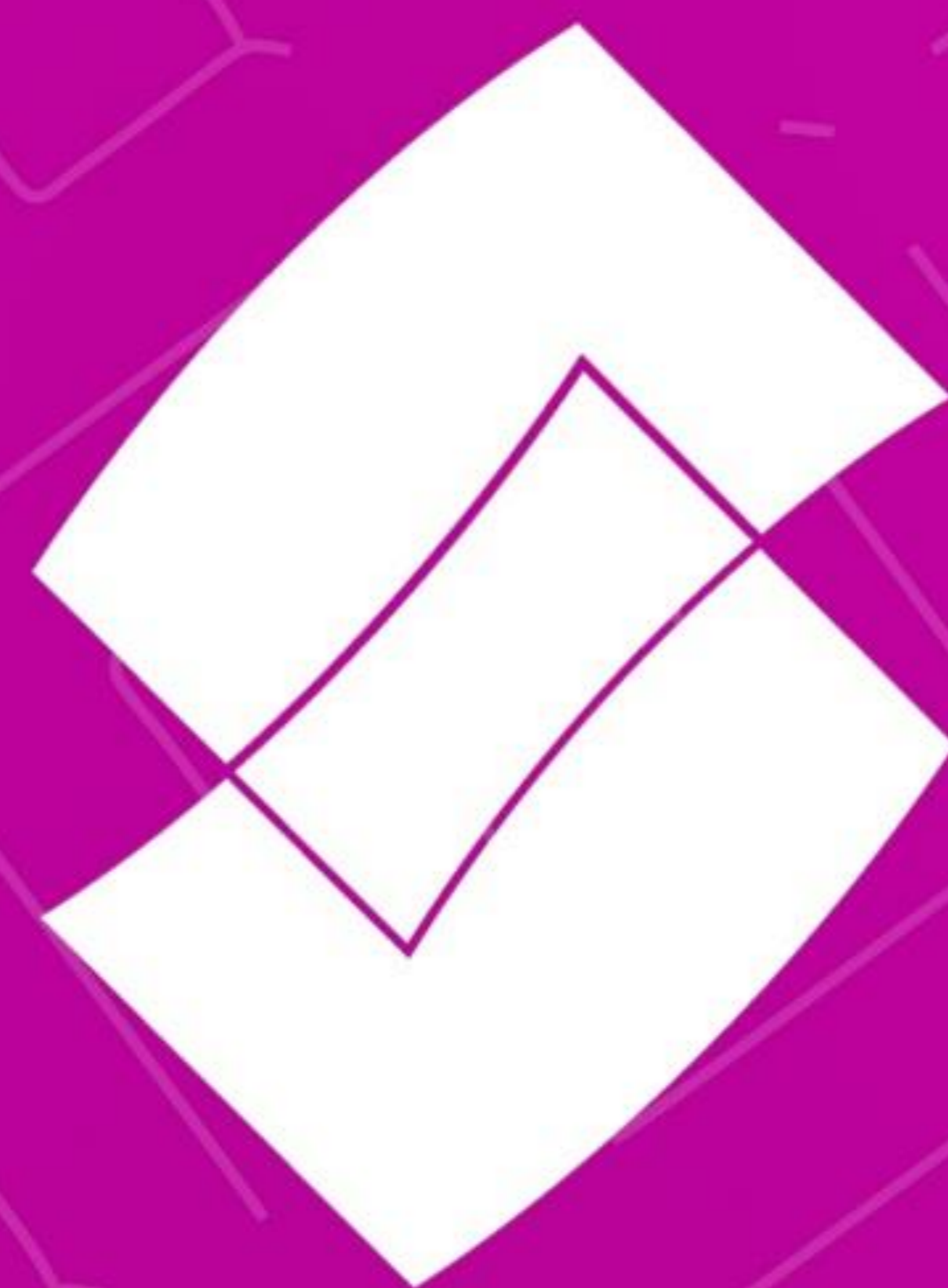
اختیار خرید



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.