

شماره

۲۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

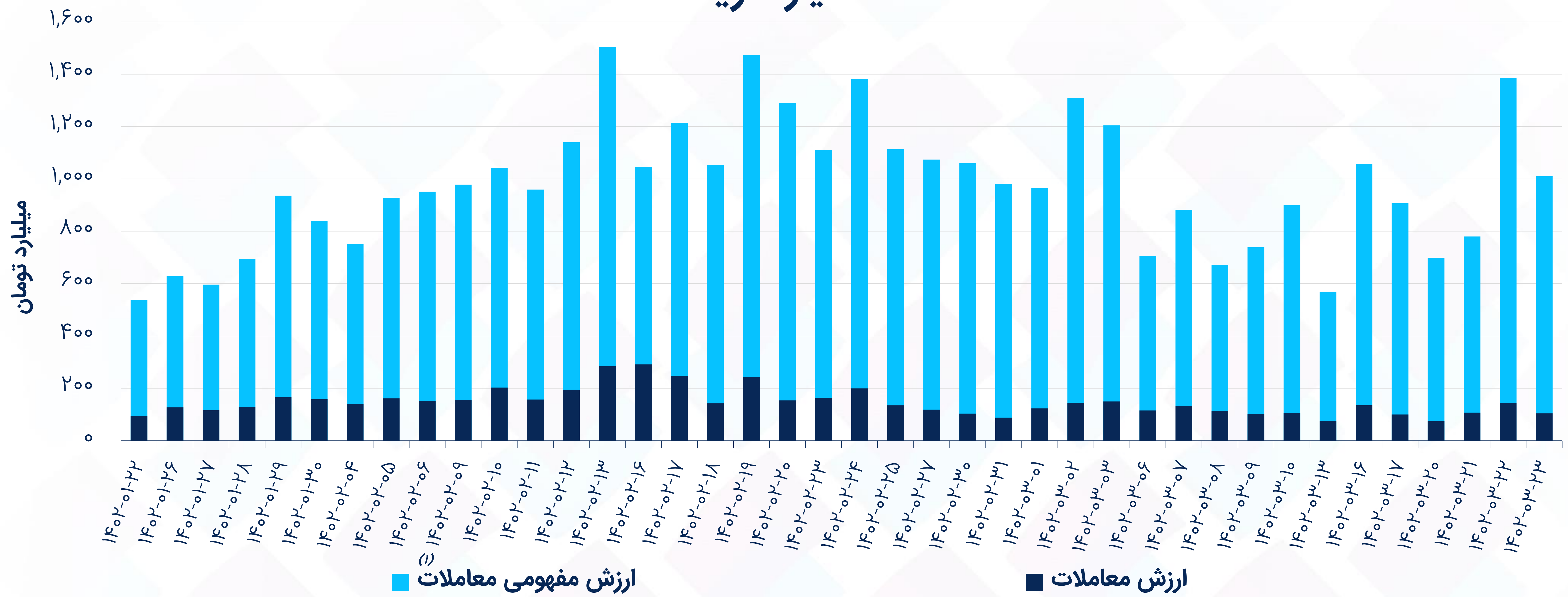




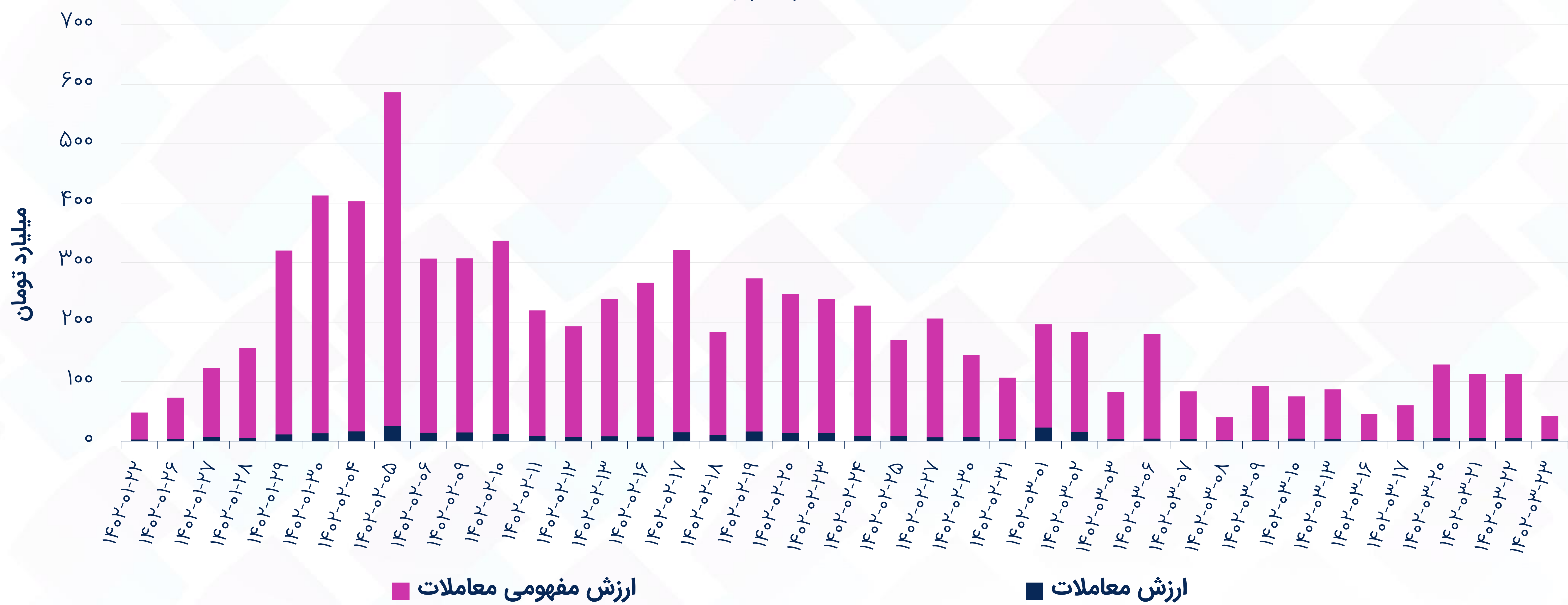
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



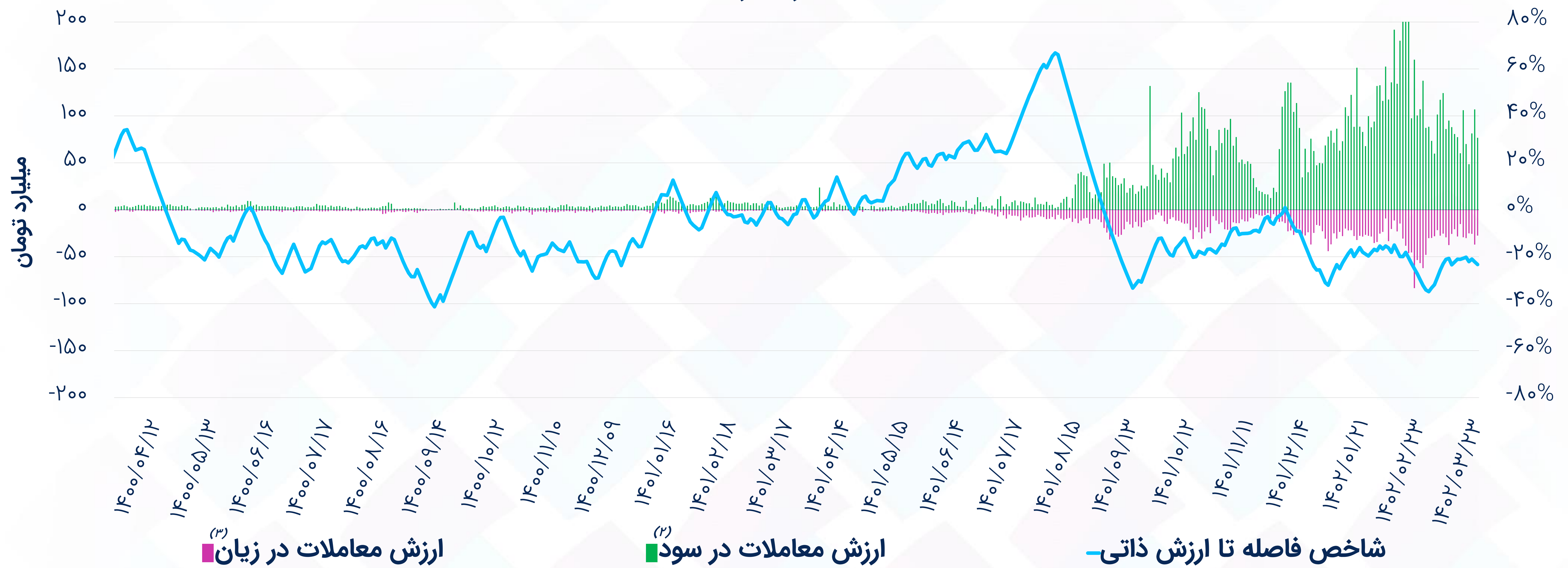
اختیار فروش



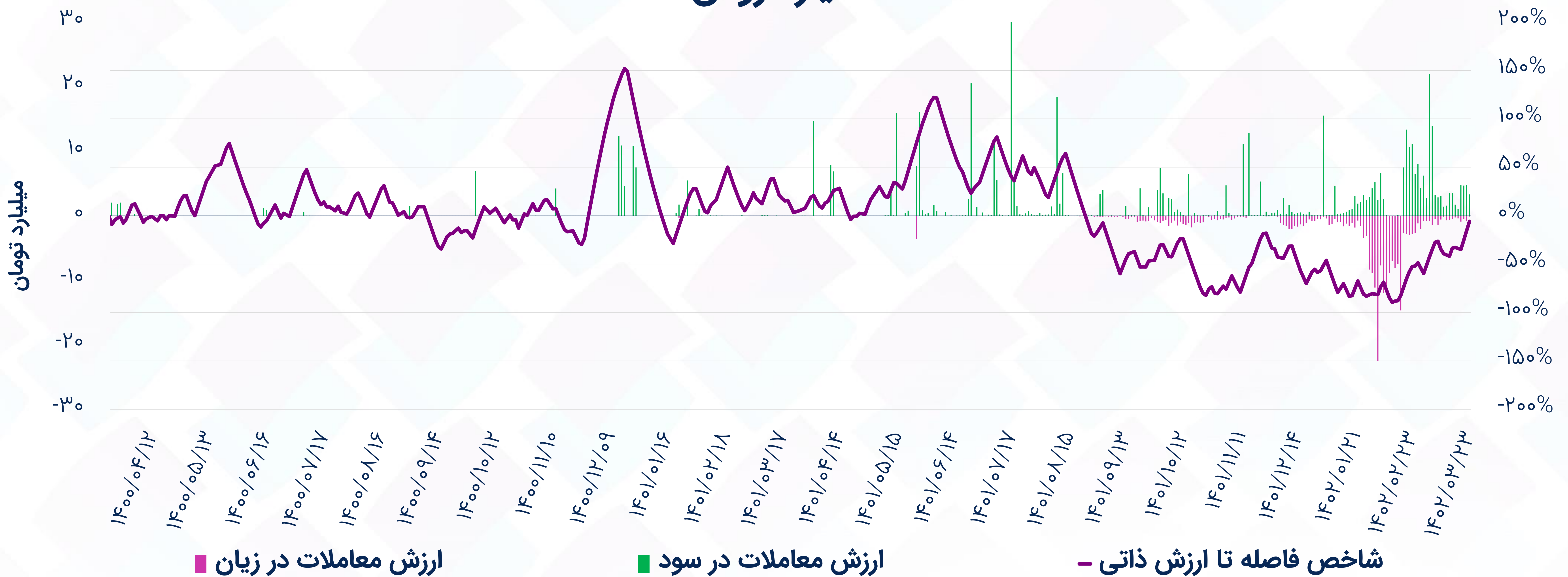
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۱	۳۲.۷	۳۴۵.۶	۲۷.۱	۵.۶	(۸.۴%)
خودرو	۲۹	۲۱.۱	۳۱۹.۵	۱۵.۴	۵.۷	(۳۷.۲%)
شستا	۳۷	۱۶.۴	۲۰۲.۳	۴.۷	۱۱.۷	(۵۴.۹%)
دی	۱۷	۱۳.۶	۴۷.۵	۱۰.۰	۳.۶	(۲۲.۱%)
اهرم	۱۹	۱۰.۴	۲۰.۴	۱۰.۱	۰.۳	(۱۲.۵%)
وبملت	۱۴	۳.۸	۸.۲	۳.۸	۰.۰	۵.۹%
خاور	۶	۱.۷	۳.۶	۱.۷	۰.۰	(۲۴.۸%)

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	۴	۳,۴۱۴.۲	۴۱,۸۳۳.۱	۳,۲۶۹.۹	۱۴۴.۳	(۵.۹%)
فولاد	۱	۹.۸	۶۲.۴	۹.۸	۰.۰	۱۳.۶%
شتران	۵	۵.۳	۳۸.۰	۵.۳	۰.۰	۲.۸%
توسن	۱	۴.۹	۲۰.۴	۴.۹	۰.۰	(۵.۳%)
اهرم	۲	۱.۶	۶۷.۱	۰.۰	۱.۶	۱۶.۸%
فملی	۱	۱.۵	۱۰۴.۷	۰.۰	۱.۵	(۳۴.۱%)
شپنا	۳	۱.۳	۳.۳	۱.۳	۰.۰	۵.۶%

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

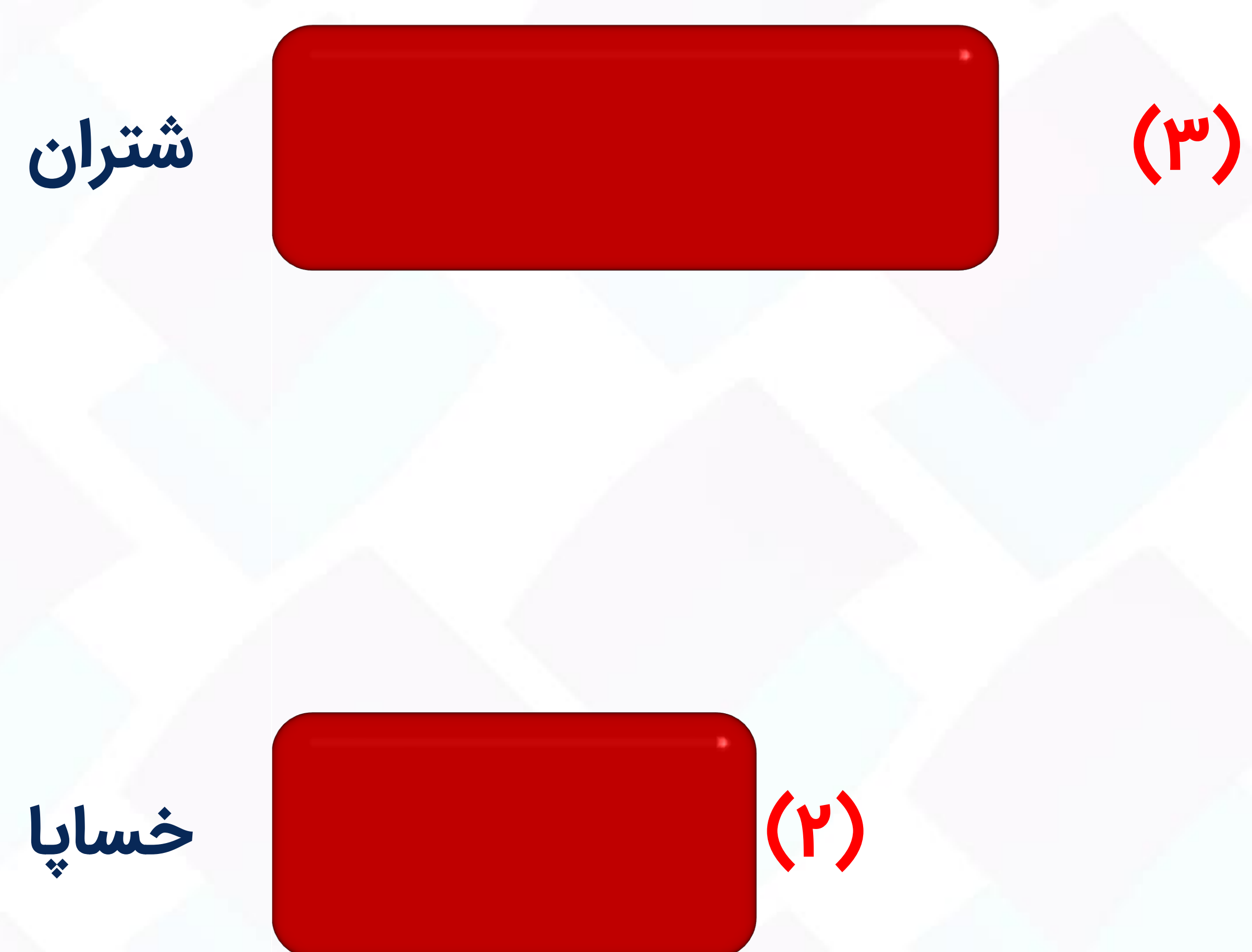
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



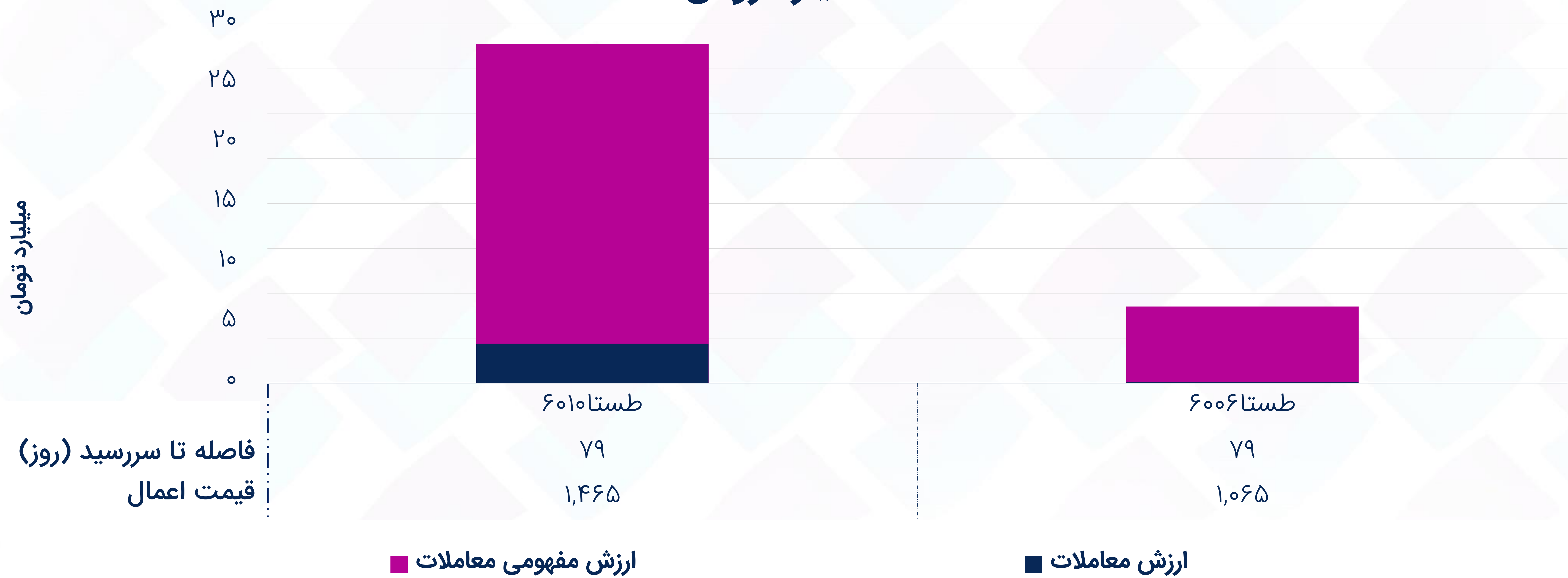
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
۲۲۴%	۸۳۸	۰.۹۴	۹.۵	(۱۵.۰%)	۲,۴۵۹	۲,۸۹۴	۲۵۹	۵.۳	۸۵	۲,۲۰۰	خسپا ۶۰۰۶
۱۴۹%	۱,۰۹۹	۰.۹۸	۶.۴	(۱۵.۵%)	۲,۸۴۱	۳,۳۶۴	۴۴۱	۴.۷	۷۹	۲,۴۰۰	خودرو ۶۰۱۲
۵۸%	۲,۲۹۲	۰.۴۵	۱۸.۹	۵۱.۸%	۲۷,۴۵۵	۱۸,۰۸۲	۱,۴۵۵	۱۳۵.۶	۲۶۶	۲۶,۰۰۰	توان ۱۲۰۸
۵۵%	۲,۰۴۶	۰.۹۷	۵.۰	(۴.۶%)	۶,۶۵۷	۶,۹۸۰	۱,۳۲۴	۶۳۷.۱	۱۰۷	۵,۳۳۳	ضملی ۷۰۳۰
۴۴%	۷۱۹	۱.۰۰	۱۰.۰	(۳.۸%)	۵,۰۰۰	۵,۲۰۰	۵۰۰	۲.۰	۶	۴,۵۰۰	شتران 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	۱,۰۰۱.۰	۵۶%	۲,۰۰۲	۱,۲۸۰	۲	۴۰.۵	۲۳	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۵,۵۰۱.۰	۶۴%	۵,۵۰۱	۳,۳۶۴	۱	۲۴.۲	۱۶	۵,۵۰۰	خودرو ۴۰۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۰۱.۰	۴۱%	۱,۸۰۶	۱,۲۸۰	۶	۳.۱	۲۳	۱,۸۰۰	شستا ۴۰۰۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۴۸.۸	۱۰۶%	۸,۰۲۳	۳,۸۸۸	۲۳	۱.۶	۷۲	۸,۰۰۰	فخوز ۶۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۱۳.۵	۳۳%	۱,۷۰۸	۱,۲۸۰	۸	۵۴.۴	۲۳	۱,۷۰۰	شستا ۴۰۰۸

(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 بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

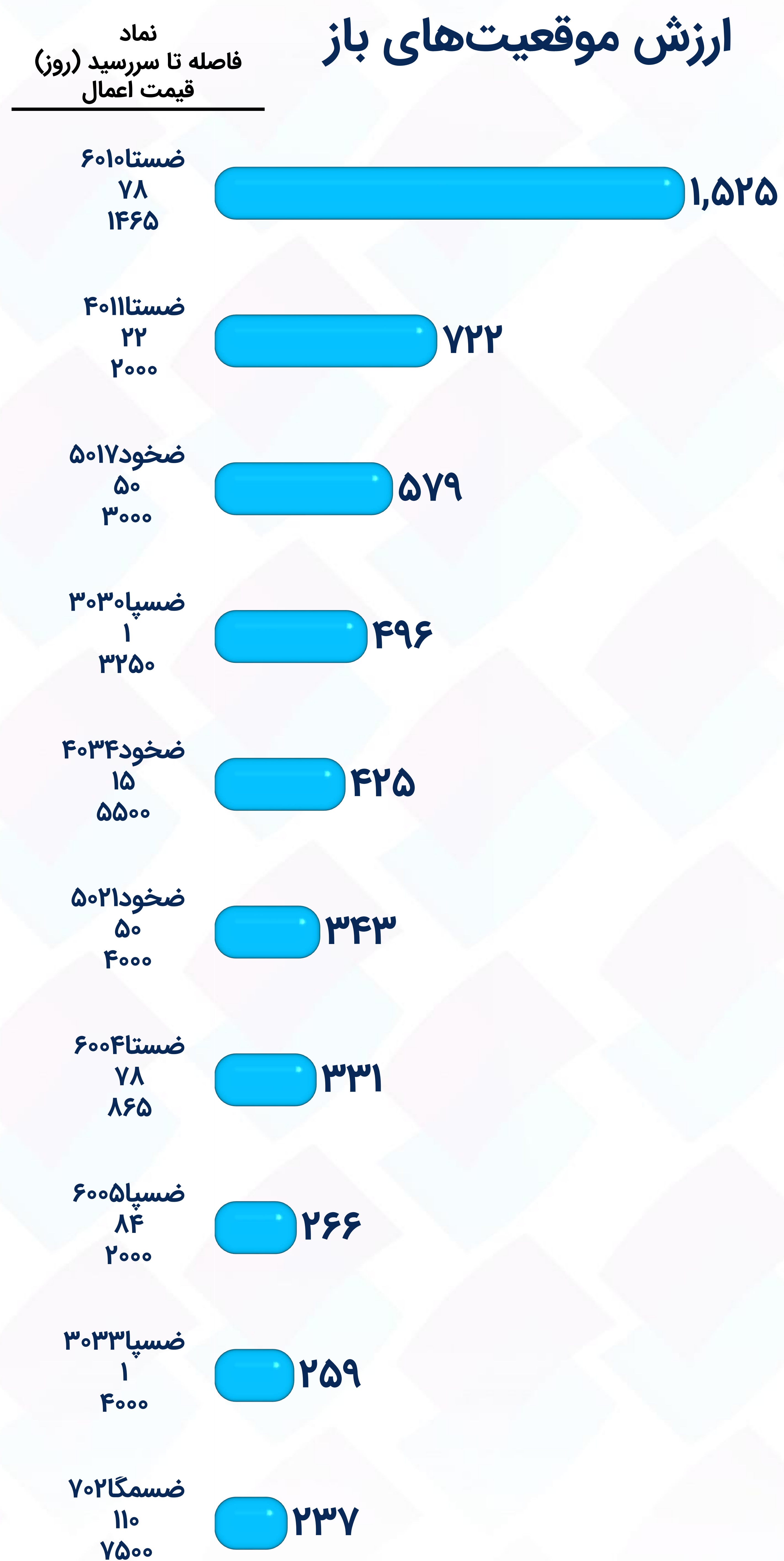
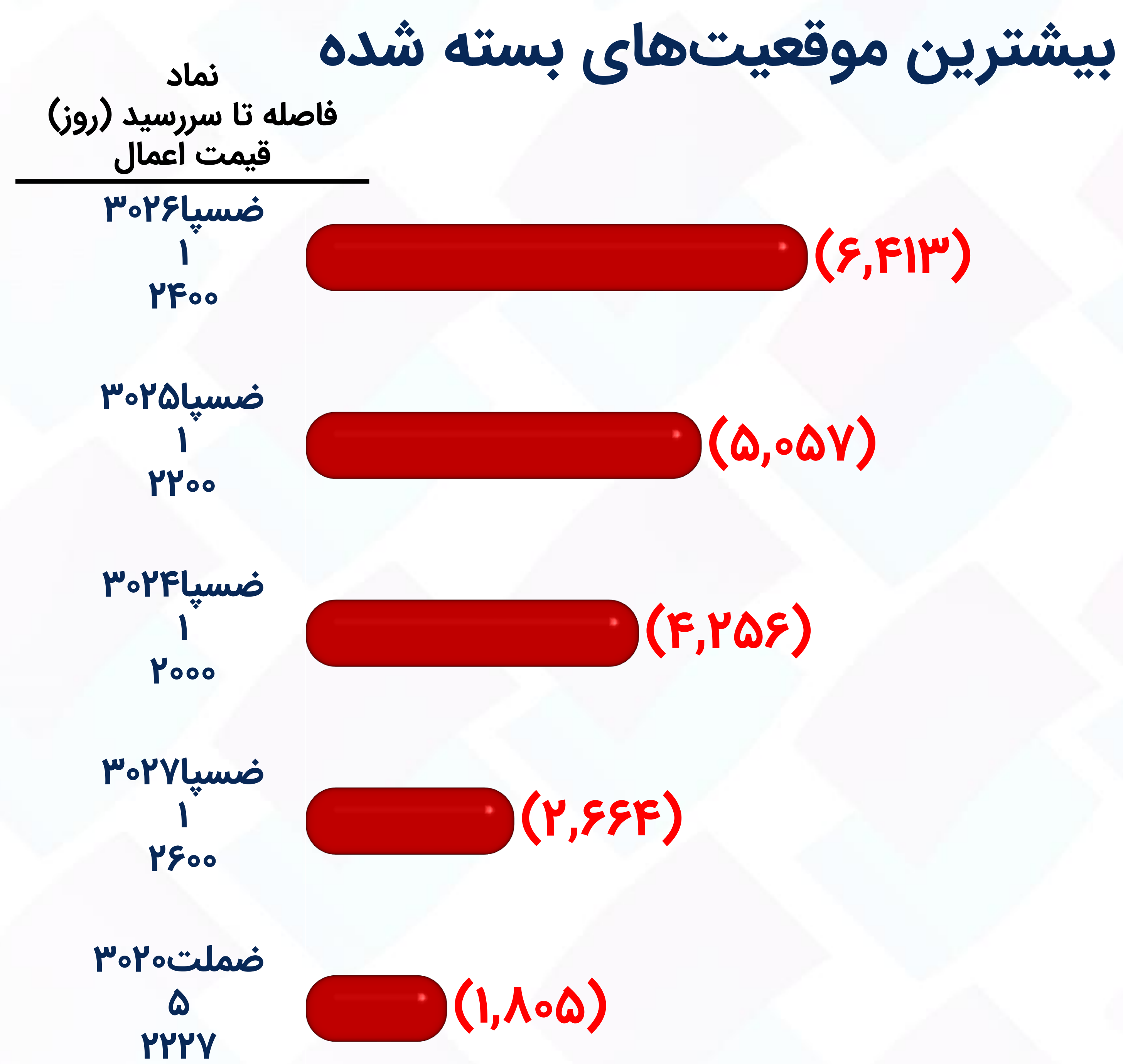
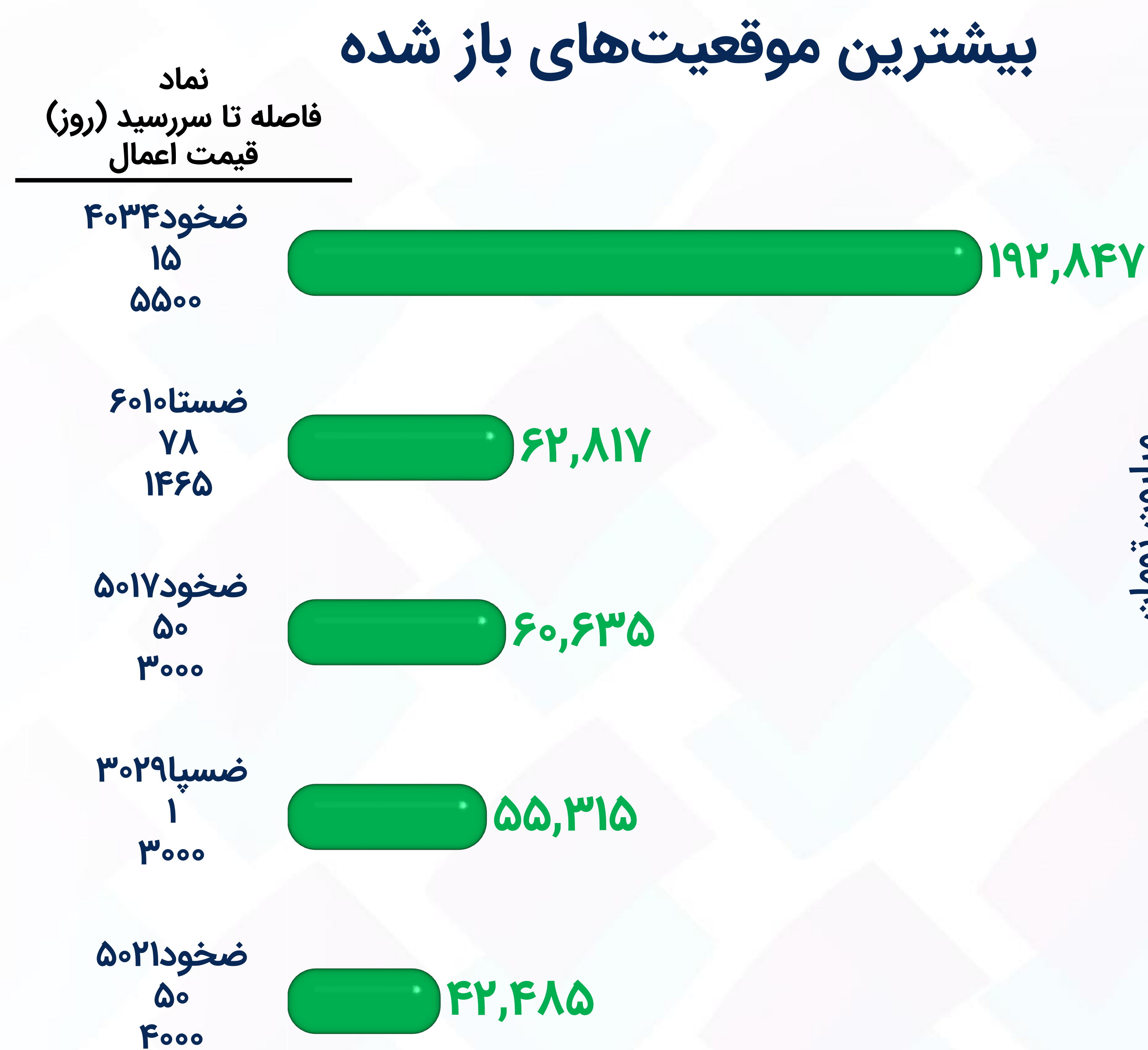
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
۳۰۲۵	طلا	۶,۶۲۵	۹	۹.۸	۸۷۵	۵,۵۹۰	۵,۷۵۰	۳%	۶.۶	-۱.۰۰	۹۹۴	۱۳.۶%
۳۰۲۸	شتران	۶,۰۰۰	۶	۳.۴	۷۴۸	۵,۲۰۰	۵,۲۵۲	۱%	۷.۰	-۱.۰۰	۷۷۵	۳.۶%
۳۰۲۹	شتران	۶,۵۰۰	۶	۱.۱	۱,۲۳۳	۵,۲۰۰	۵,۲۶۷	۱%	۴.۳	-۱.۰۰	۱,۲۷۳	۳.۲%
۶۰۱۰	شستا	۱,۴۶۵	۷۹	۳,۲۶۹.۹	۱۴۸	۱,۲۸۰	۱,۳۱۷	۳%	۸.۹	-۰.۶۸	۱۴۴	(۲.۷%)
۷۰۹	توسن	۲۴,۶۰۰	۱۱۸	۴.۹	۴,۴۹۸	۱۸,۵۸۰	۲۰,۱۰۲	۸%	۴.۵	-۰.۸۷	۴,۲۶۱	(۵.۳%)

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 سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
۶۰۰۴	شستا	۸۶۵	۷۹	۳۲.۰	۶	۱,۲۸۰	۸۵۹	(۳۳%)	۱۴۳.۲	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
۶۰۰۶	شستا	۱,۰۶۵	۷۹	۹۵.۶	۱۹	۱,۲۸۰	۱,۰۴۶	(۱۸%)	۵۵.۱	-۰.۰۵	۴	(۷۹%)
۷۰۳۱	فملی	۶,۰۰۰	۱۰۷	۱.۵	۱۰۰	۶,۹۸۰	۵,۹۰۰	(۱۵%)	۵۹.۰	-۰.۱۰	۶۶	(۳۴%)
۷۰۹	توسن	۲۴,۶۰۰	۱۱۸	۴.۹	۴,۴۹۸	۱۸,۵۸۰	۲۰,۱۰۲	۸%	۴.۵	-۰.۸۷	۴,۲۶۱	(۵%)
۶۰۱۰	شستا	۱,۴۶۵	۷۹	۳,۲۶۹.۹	۱۴۸	۱,۲۸۰	۱,۳۱۷	۳%	۸.۹	-۰.۶۸	۱۴۴	(۳%)

(۱) سربه‌سر: 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



میلین تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



میلیون تومان

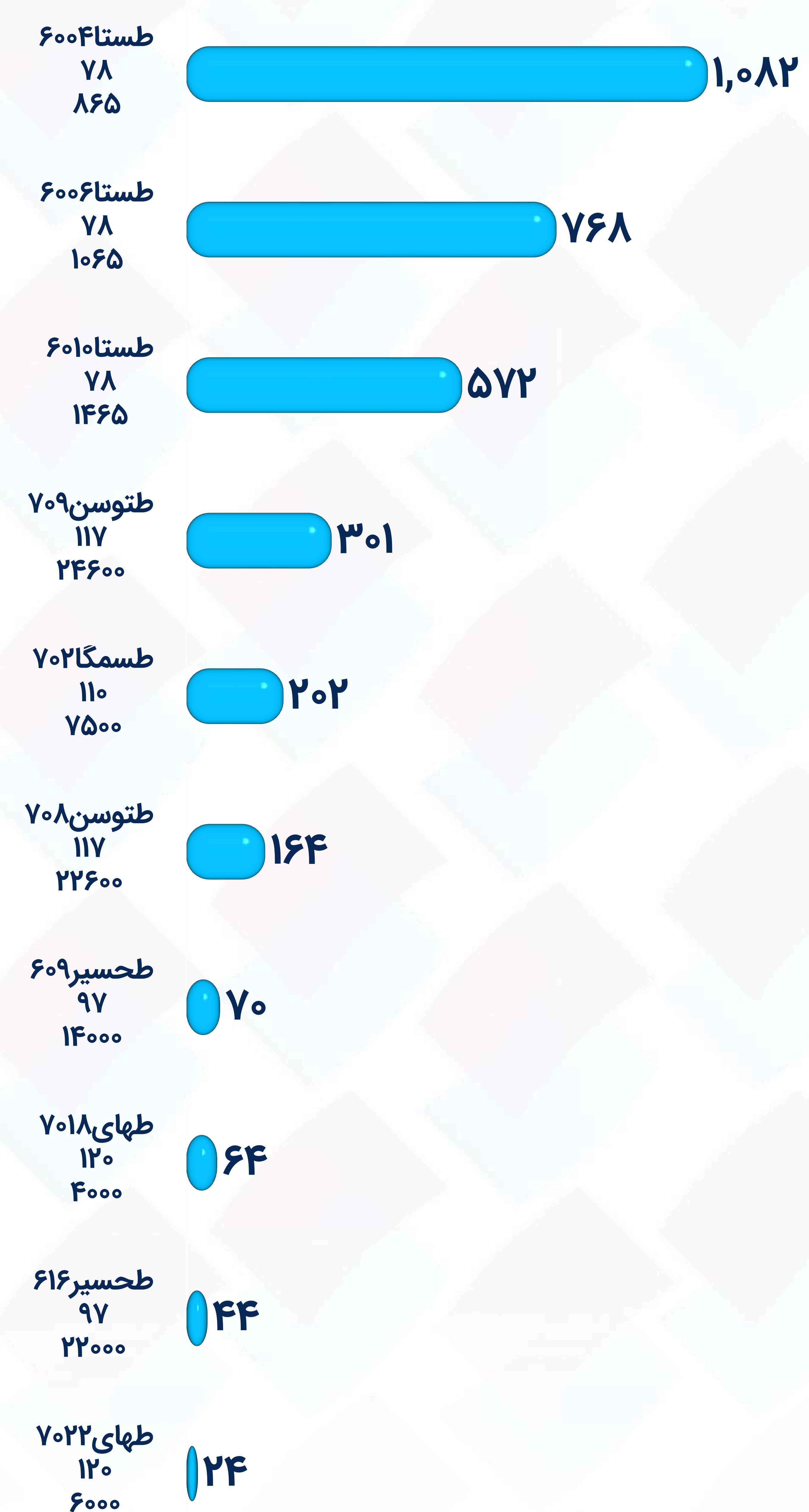
بیشترین موقعیت‌های بسته شده



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



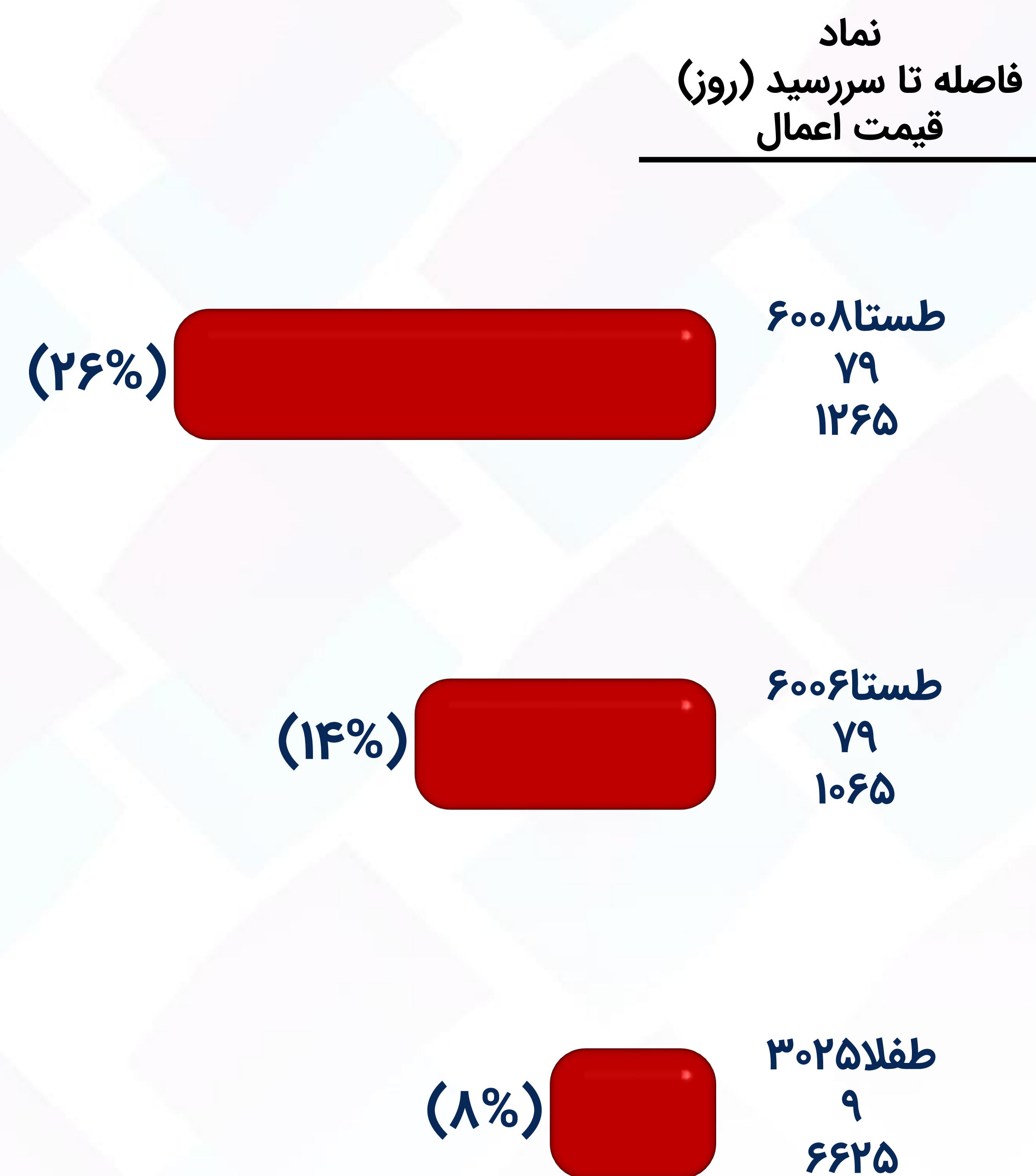
میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

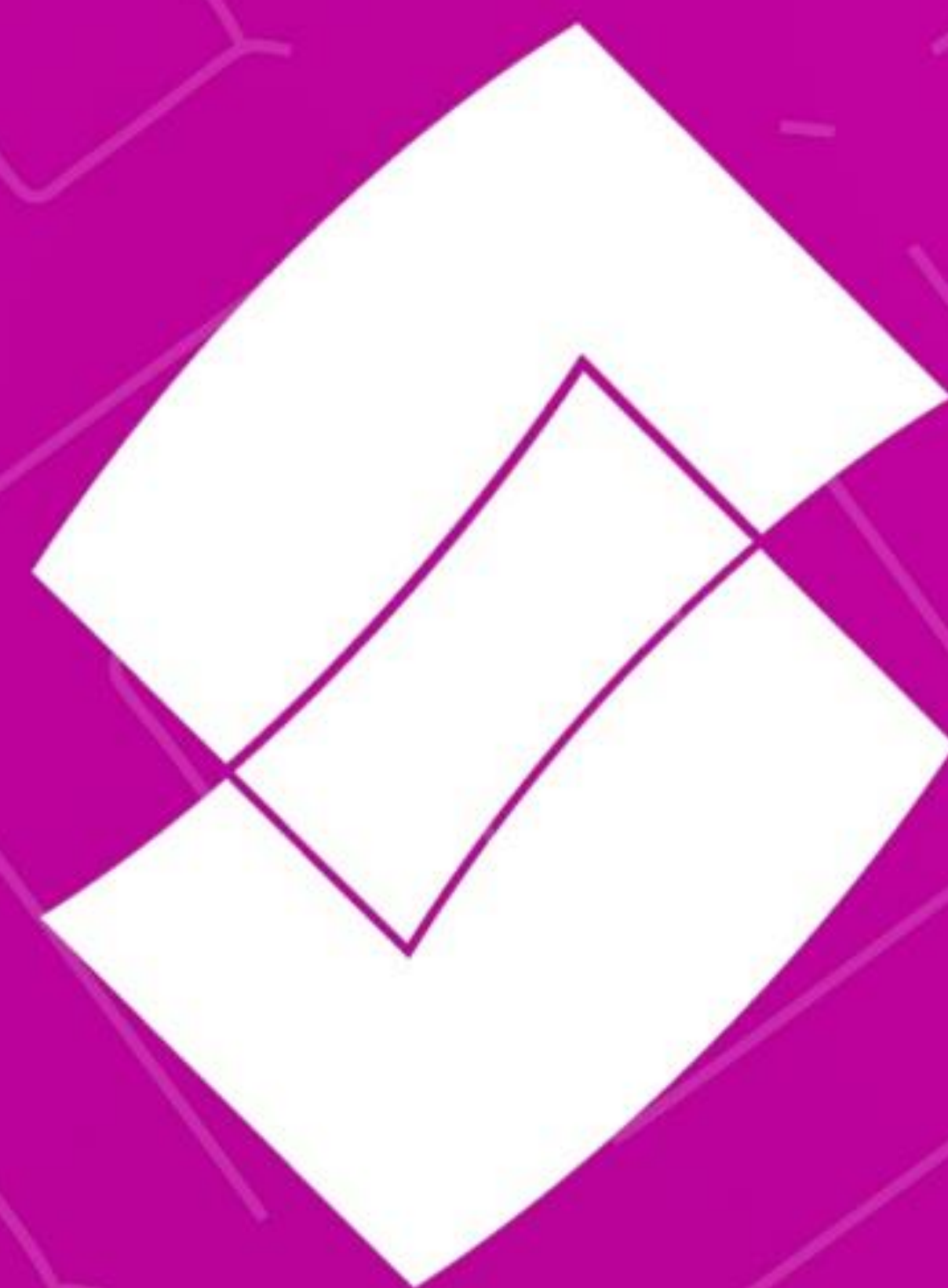
اختیار خرید



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