

شماره

۲۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۴ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

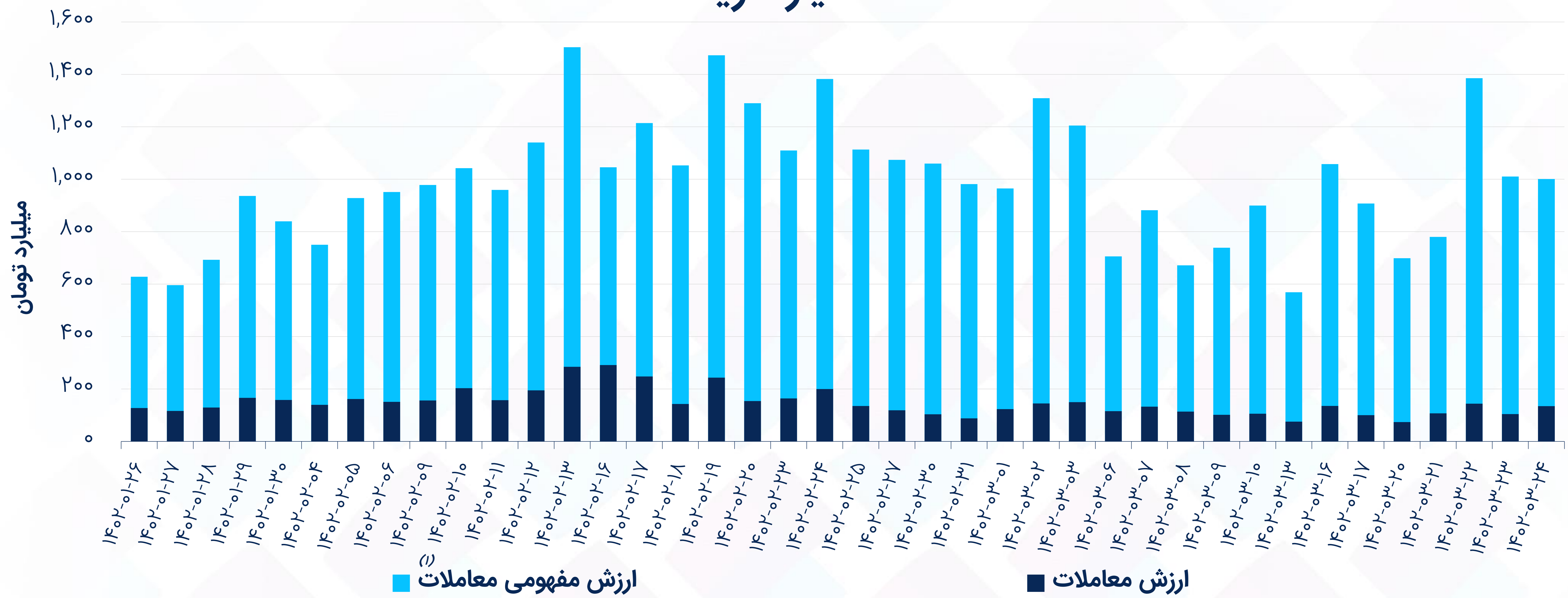




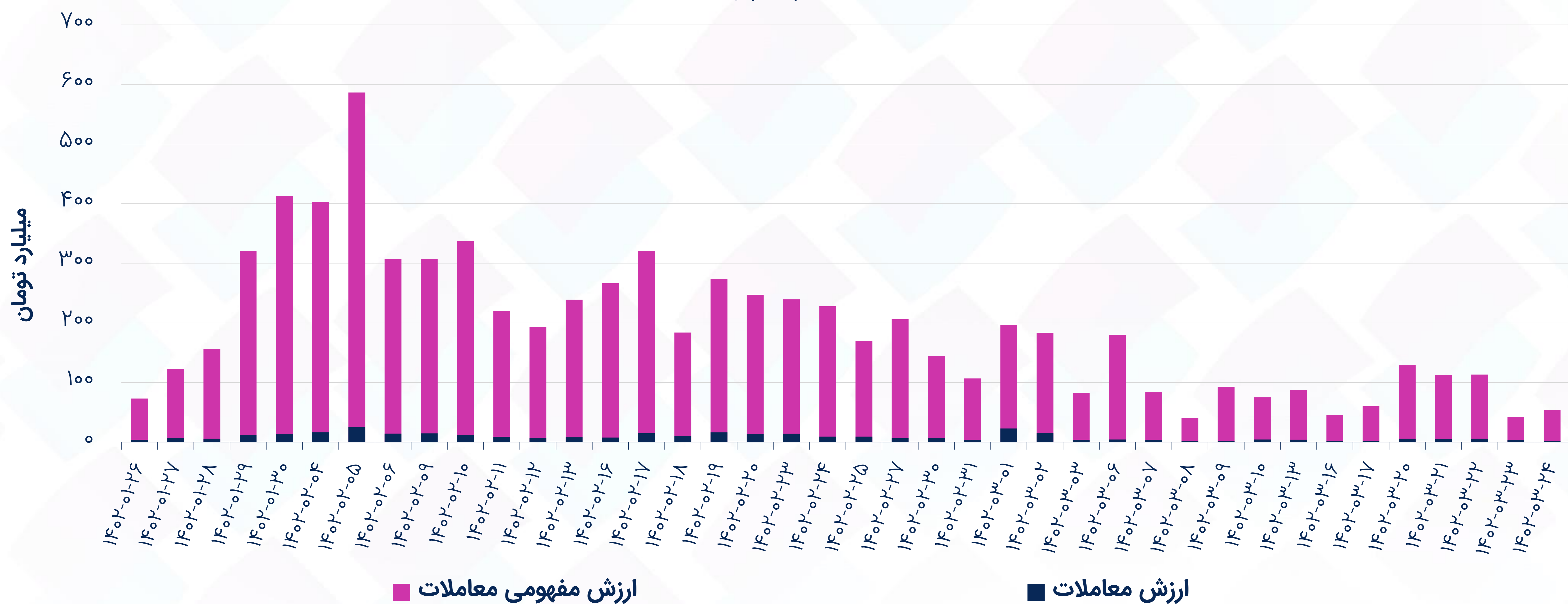
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



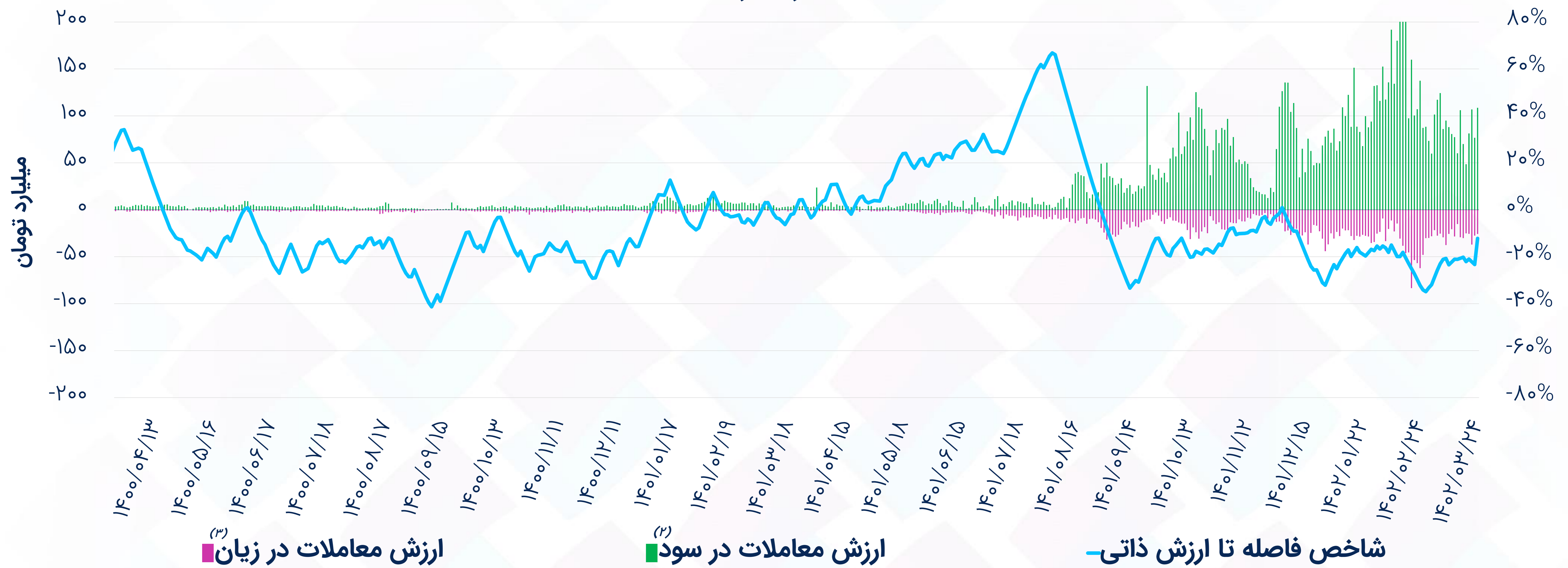
اختیار فروش



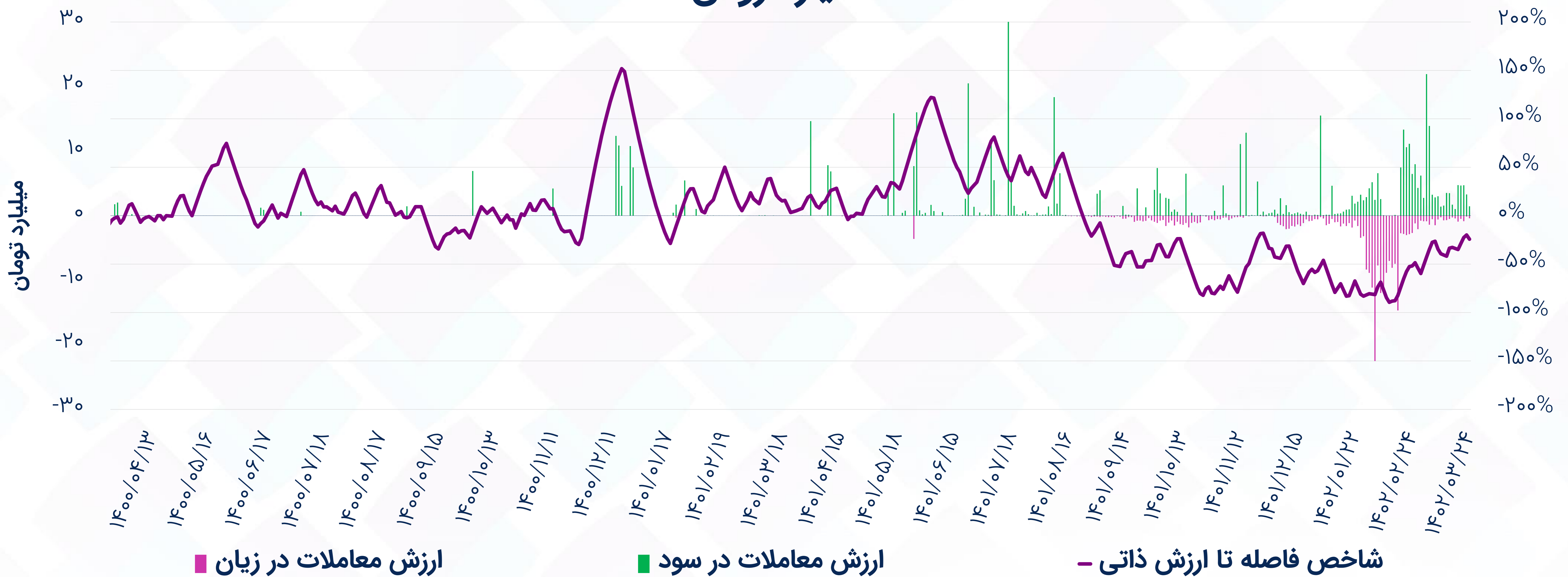
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

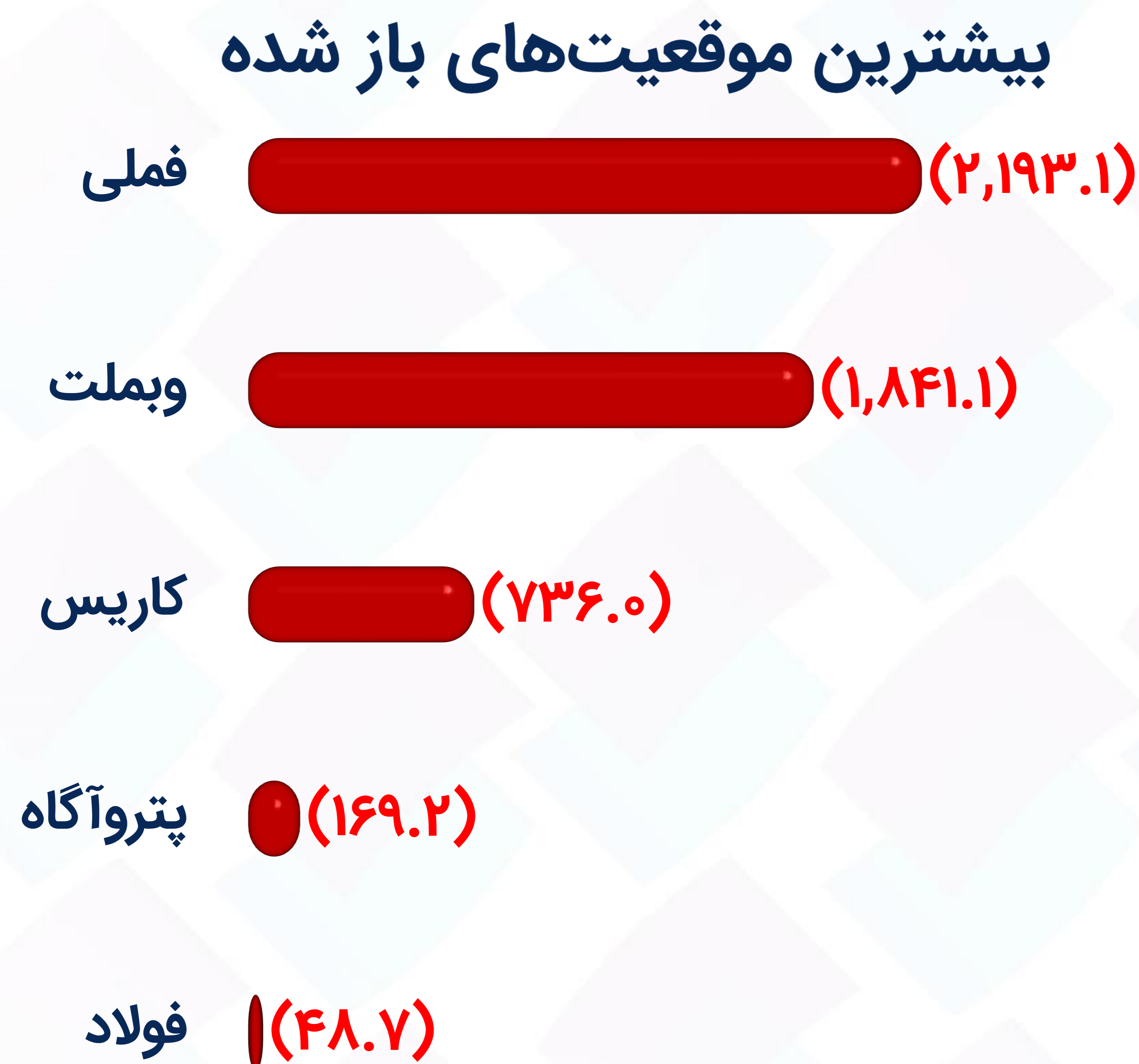
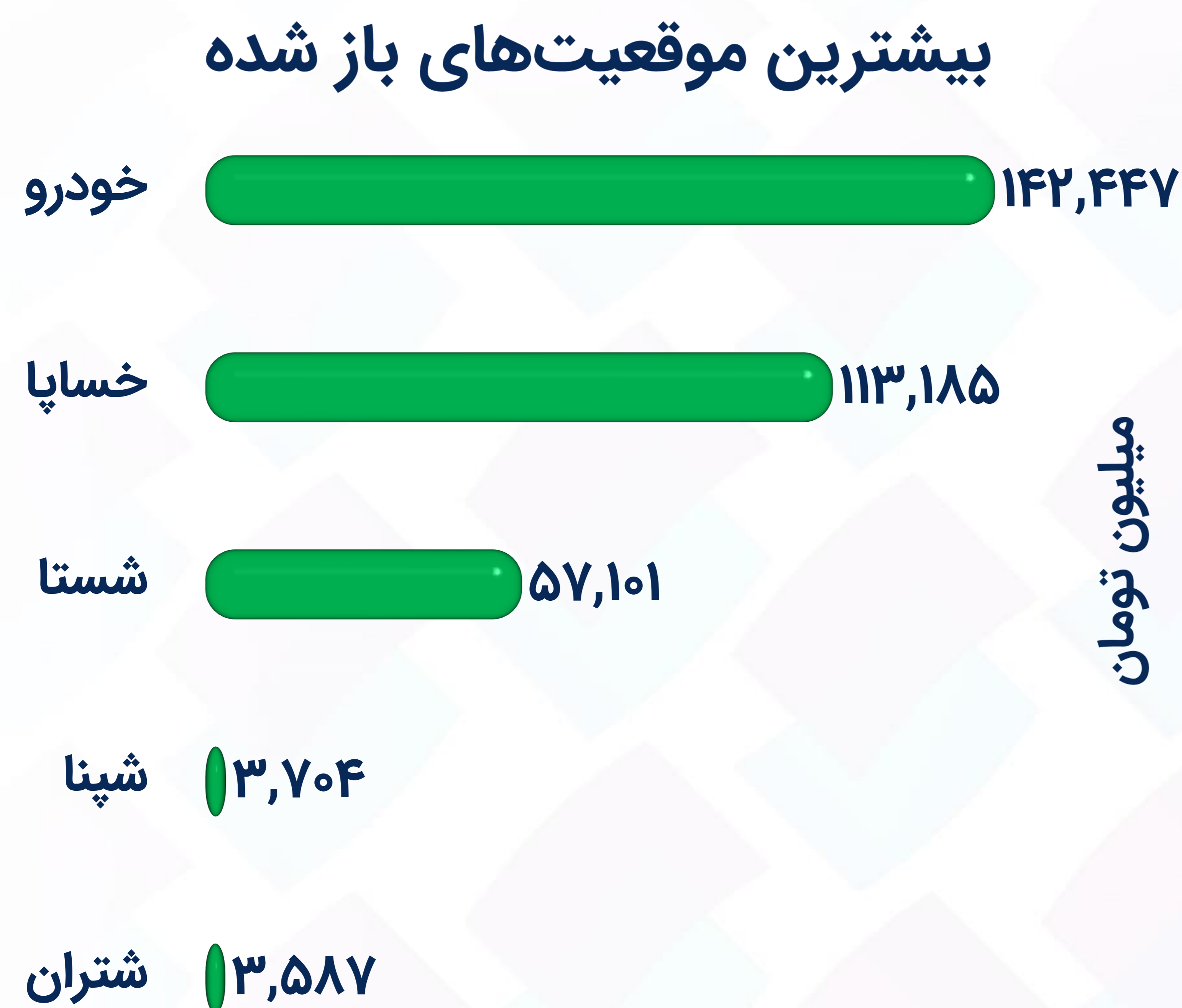
اختیار خرید

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
خسپا	۳۱	۷۰.۴	۴۶۷.۵	۶۰.۱	۱۰.۳	(۵.۲%)
خودرو	۲۷	۲۱.۶	۲۳۴.۸	۱۷.۵	۴.۱	(۲۸.۴%)
دی	۱۵	۱۲.۱	۳۷.۹	۹.۷	۲.۴	(۱۲.۴%)
شستا	۳۳	۹.۶	۱۸۳.۱	۲.۱	۷.۵	(۵۶.۹%)
سلام	۵	۴.۹	۱۸.۲	۴.۹	۰.۰	(۷.۸%)
وبملت	۱۶	۴.۳	۱۶.۱	۴.۳	۰.۰	۱۳.۲%
فملی	۴	۴.۲	۹.۷	۴.۲	۰.۰	۳۵.۱%

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	۵	۱,۸۳۲.۹	۵۳,۶۹۰.۱	۱,۴۳۱.۱	۴۰۱.۷	(۲۴.۶%)
شتران	۵	۱۲.۹	۶۹.۴	۱۲.۹	۰.۰	(۲.۱%)
توسن	۱	۷.۶	۳۵.۷	۷.۶	۰.۰	۳.۱%
های وب	۲	۲.۵	۴.۰	۲.۵	۰.۰	۲.۵%
خسپا	۱	۰.۵	۱.۷	۰.۵	۰.۰	۳۶.۲%
فولاد	۱	۰.۴	۳.۵	۰.۴	۰.۰	۱۲.۳%
سمگا	۱	۰.۱	۱.۶	۰.۱	۰.۰	۴۲.۴%

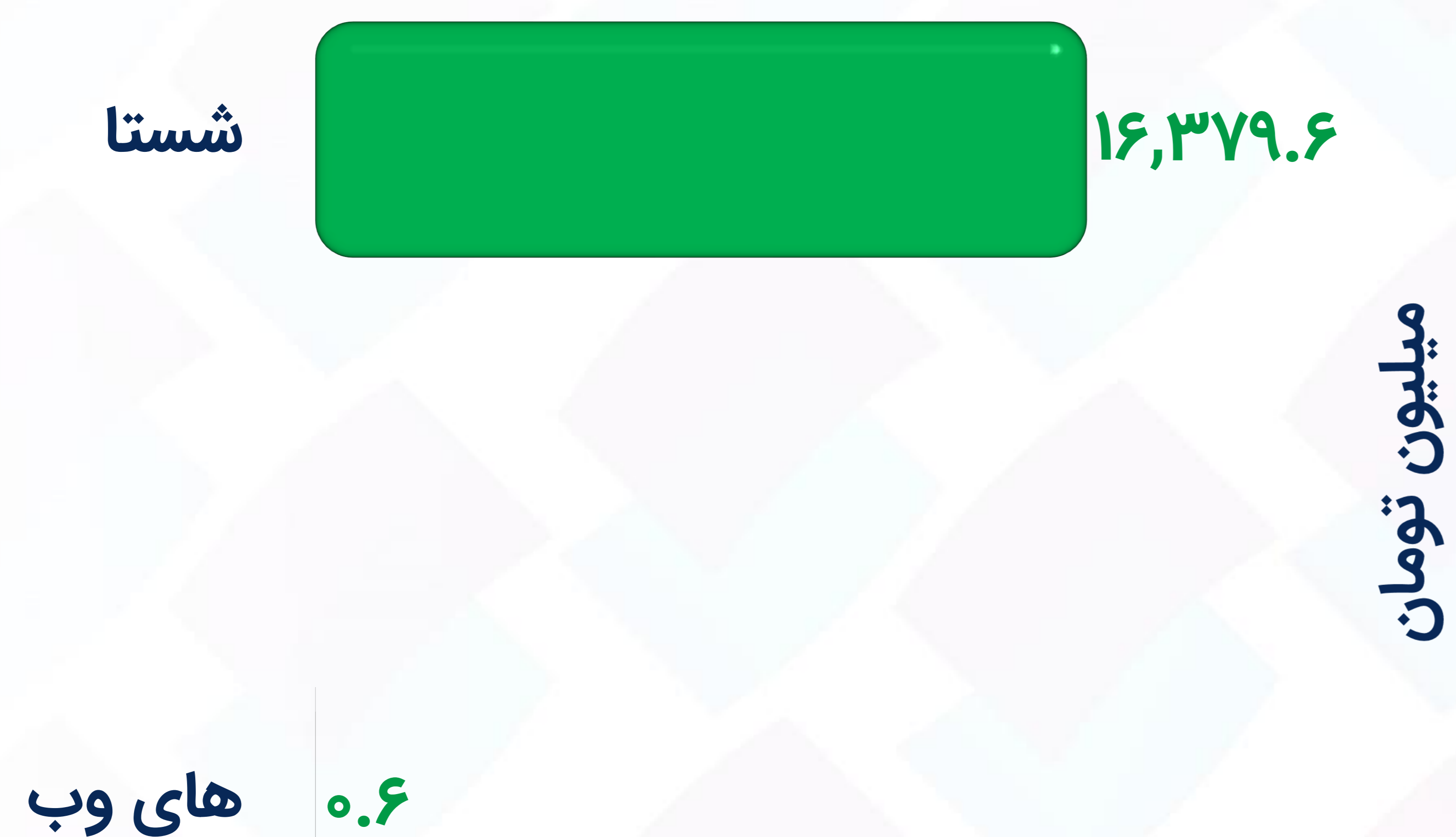
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده

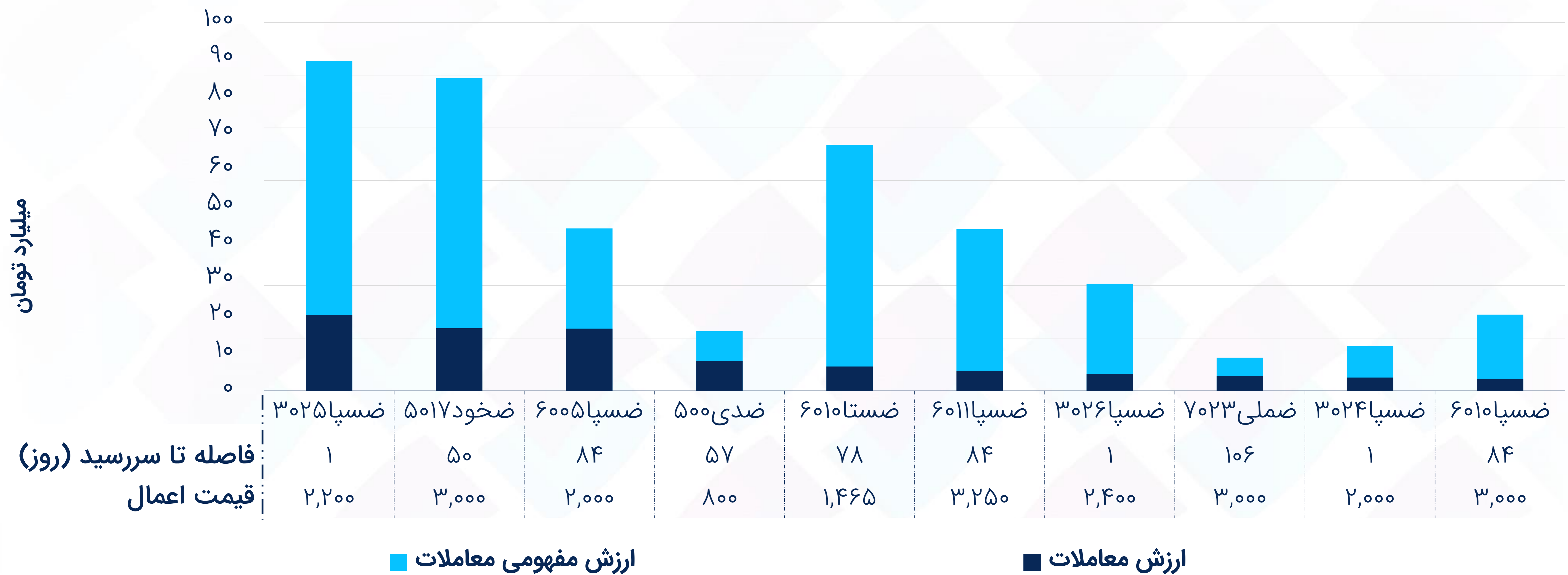


ارزش موقعیت‌های باز

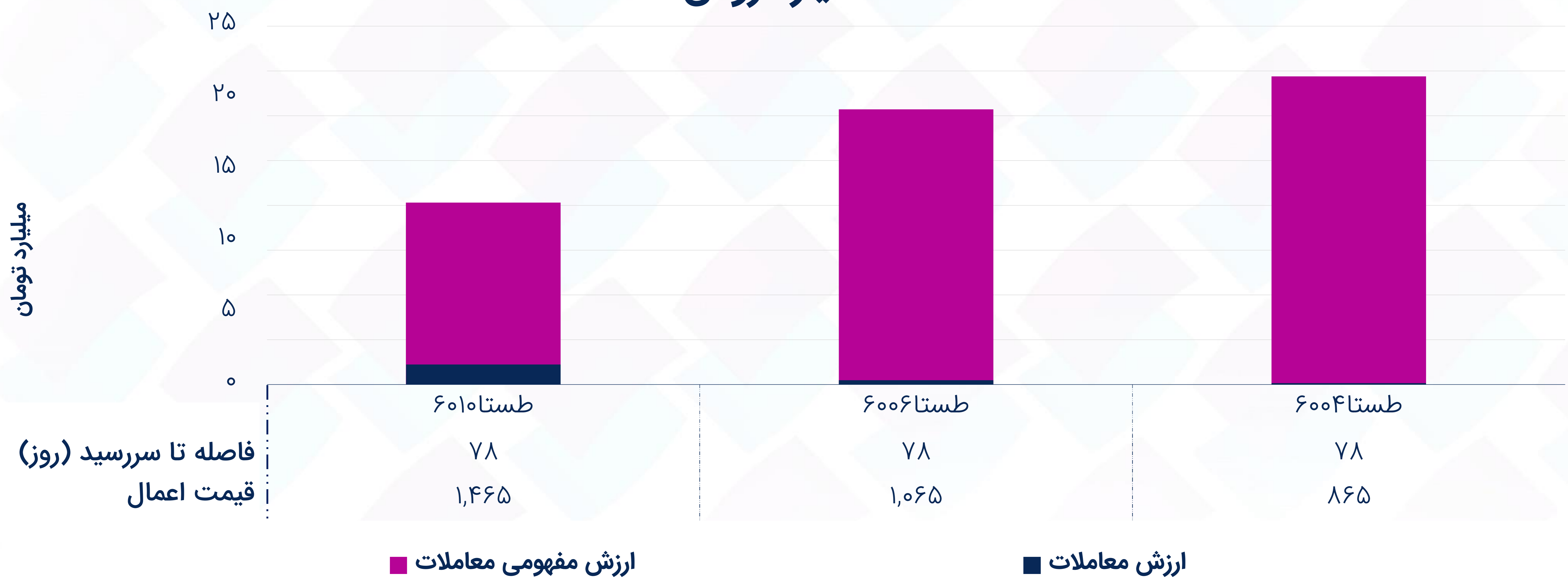


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۲۰۲%	۳۱۱	۰.۸۹	۴۹.۵	(۳.۴%)	۵,۱۰۳	۵,۲۸۰	۱۰۳	۵۶.۳	۵	۵,۰۰۰	وبملت ۳۰۲۹
۵۳%	۲,۴۷۲	۰.۴۷	۱۷.۱	۴۹.۰%	۲۷,۶۱۴	۱۸,۵۲۸	۱,۶۱۴	۱.۱	۲۶۵	۲۶,۰۰۰	توان ۱۲۰۸
۴۷%	۱,۵۳۱	۰.۹۹	۲.۵	(۹.۴%)	۲,۶۴۱	۲,۹۱۵	۱,۰۴۱	۱.۱	۲۰۴	۱,۶۰۰	وتجارت ۱۰۳۹
۳۷%	۴,۳۱۲	۱.۰۰	۲.۰	(۱۳.۵%)	۶,۱۳۹	۷,۱۰۰	۳,۱۳۹	۳,۹۸۳.۴	۱۰۶	۳,۰۰۰	فملی ۷۰۲۳
۳۵%	۷۹۶	۱.۰۰	۸.۶	(۳.۶%)	۵,۰۸۹	۵,۲۸۰	۵۸۹	۳۰۶.۸	۵	۴,۵۰۰	وبملت ۳۰۲۸

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	۵۵%	۲,۰۰۲	۱,۲۹۵	۲	۹۱.۰	۲۲	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۰۱.۰	۸۶%	۲,۴۰۸	۱,۲۹۵	۸	۱.۶	۵۰	۲,۴۰۰	شستا ۵۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۵,۵۰۱.۰	۶۲%	۵,۵۰۱	۳,۳۹۸	۱	۴.۵	۱۵	۵,۵۰۰	خودرو ۴۰۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۶۶.۶	۲۶%	۷,۳۳۲	۵,۸۲۰	۴۴	۷.۰	۸	۷,۲۸۸	فولاد ۳۰۲۶
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۸۳۴.۳	۴۷%	۵,۰۰۶	۳,۳۹۸	۶	۱.۱	۱۵	۵,۰۰۰	خودرو ۴۰۳۳

(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

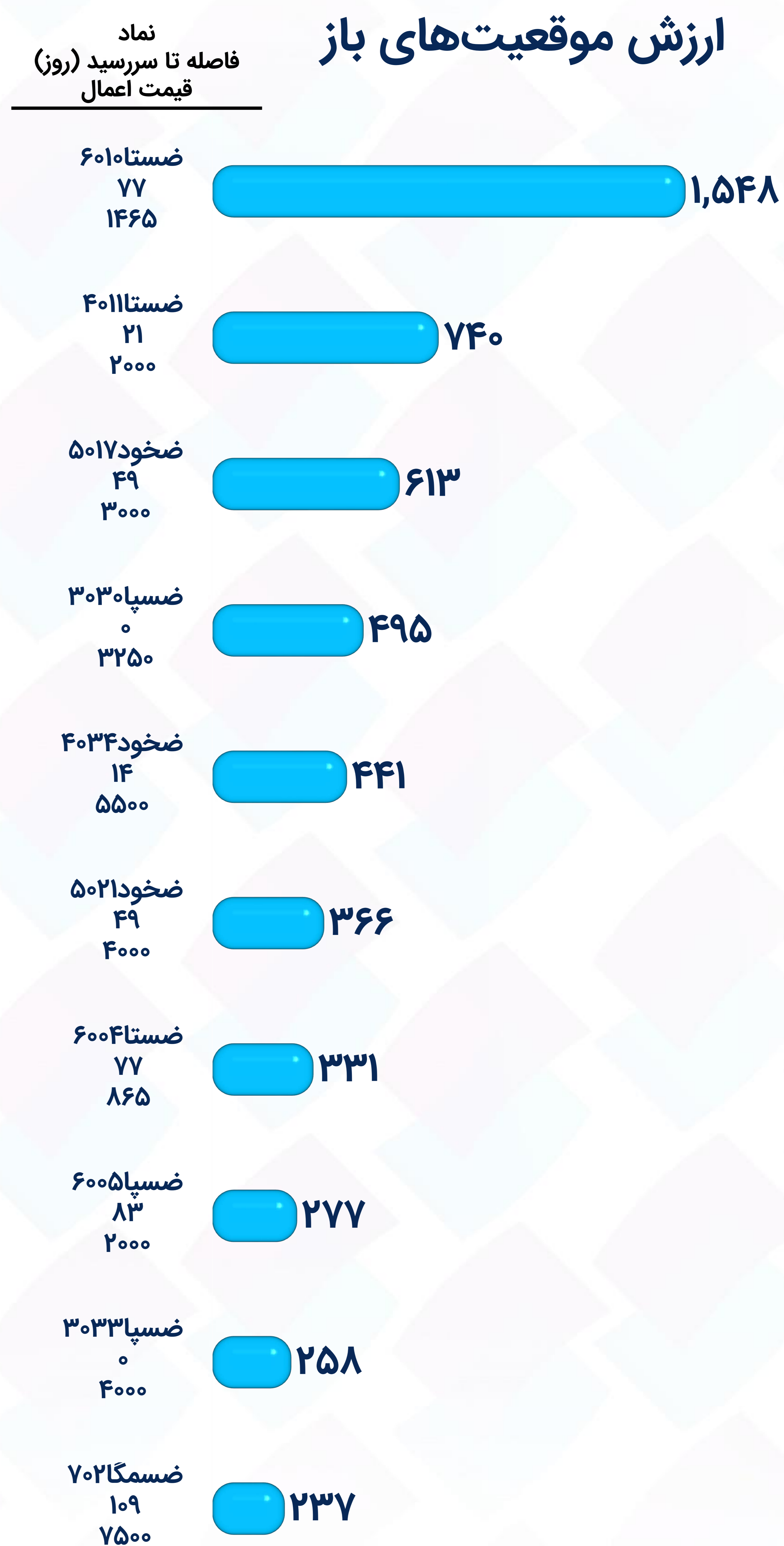
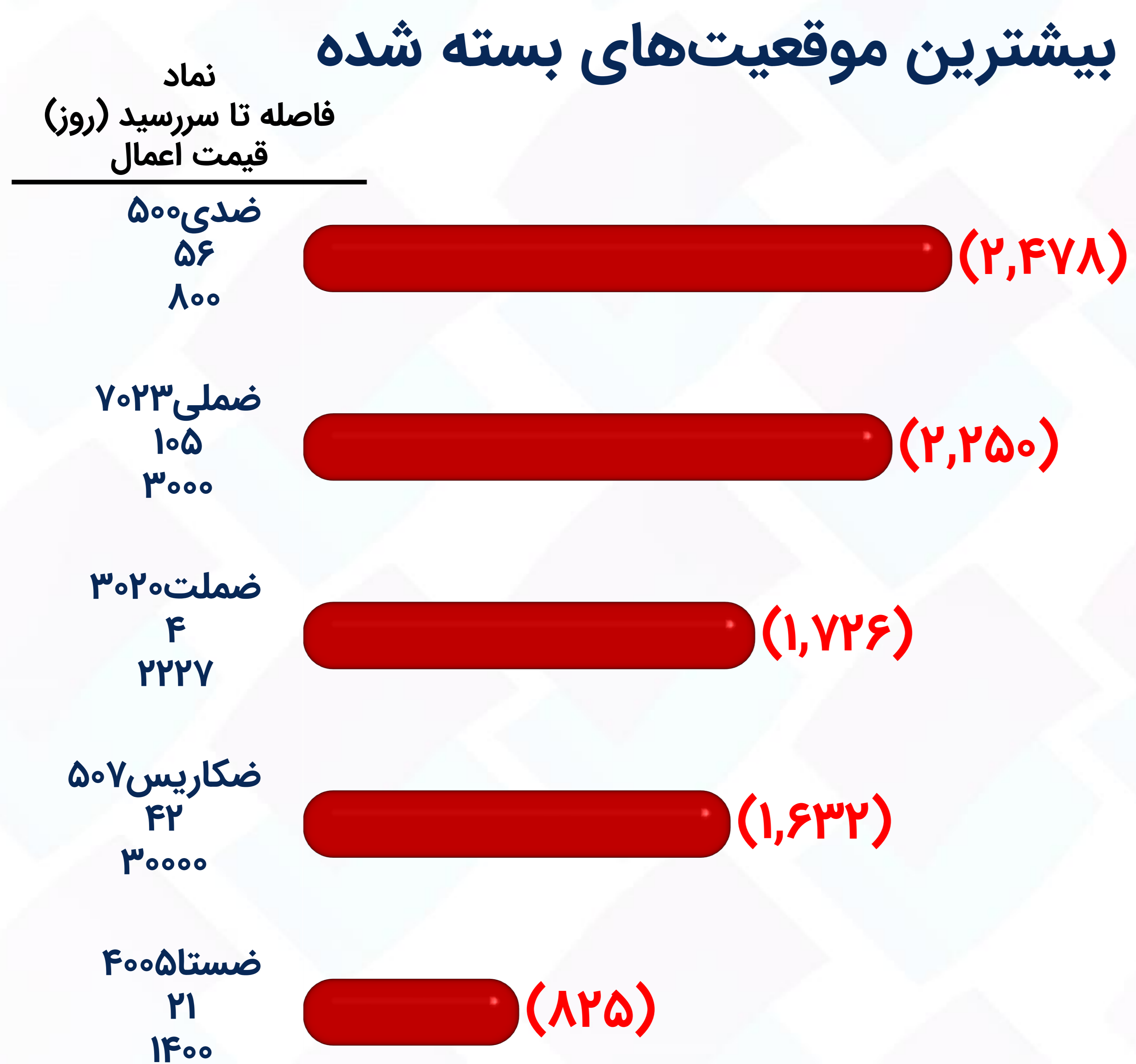
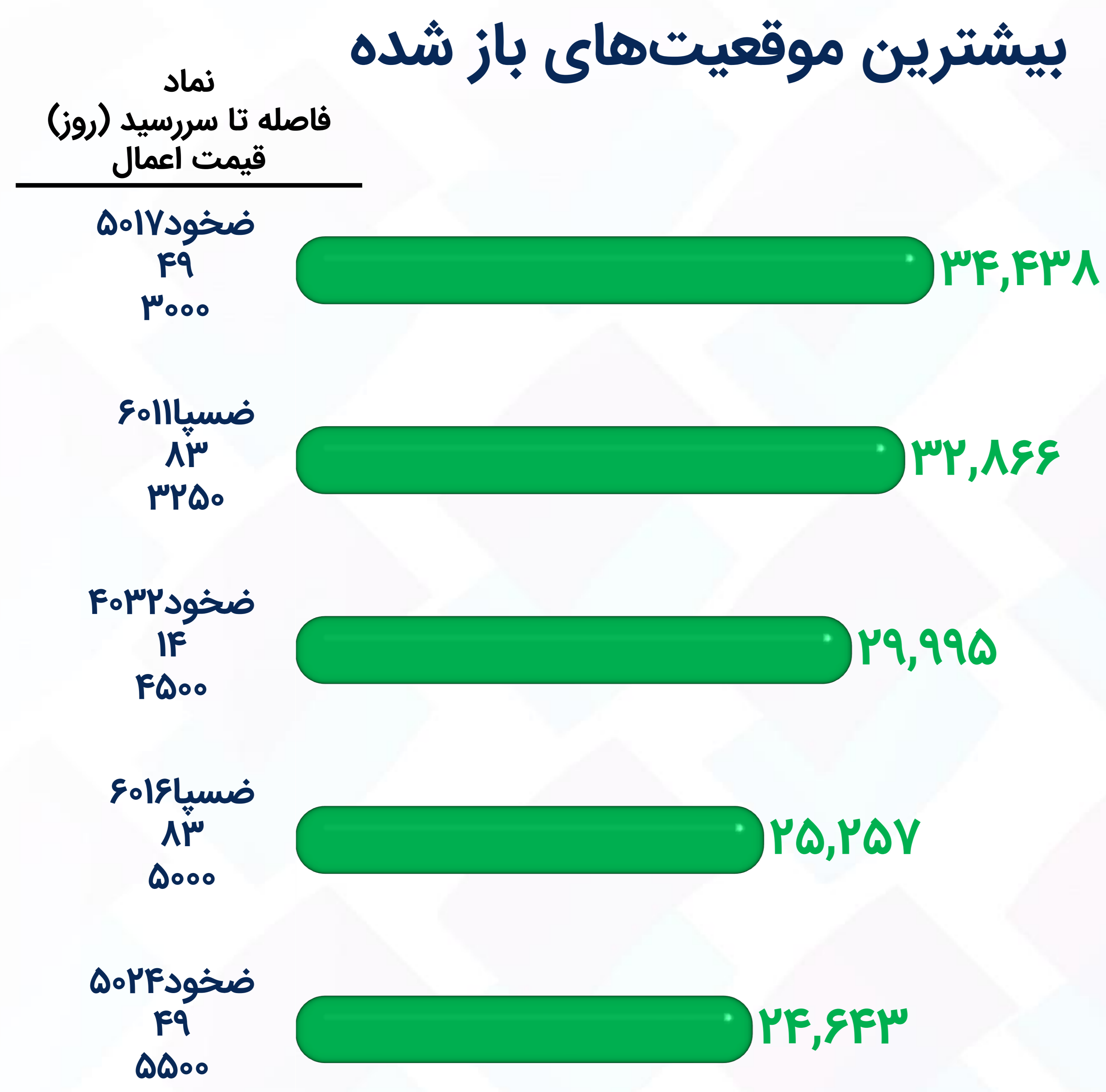
نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طوسن ۷۰۹	توسن	۱۱۷	۷.۶	۴,۰۰۰	۱۸,۷۷۰	۲۰,۶۰۰	۱۰%	۵.۲	-۰.۸۶	۴,۱۲۵	۳.۱%
طترا ۳۰۳۱	شتران	۵	۲.۲	۲,۲۰۰	۵,۳۰۰	۵,۳۰۰	۰%	۲.۴	-۱.۰۰	۲,۱۷۴	(۱.۲%)
طترا ۳۰۲۹	شتران	۵	۳.۶	۱,۲۰۰	۵,۳۰۰	۵,۳۰۰	۰%	۴.۴	-۱.۰۰	۱,۱۷۸	(۱.۹%)
طترا ۳۰۲۸	شتران	۵	۵.۷	۶۹۹	۵,۳۰۰	۵,۳۰۱	۰%	۷.۶	-۱.۰۰	۶۷۹	(۲.۸%)
طترا ۳۰۳۰	شتران	۵	۱.۴	۱,۷۳۱	۵,۳۰۰	۵,۲۶۹	(۱%)	۳.۰	-۱.۰۰	۱,۶۷۶	(۳.۲%)

گرانترین نسبت به ارزش بک 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 (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۶۰۰۶	شستا	۷۸	۲۸۲.۰	۱۹	۱,۲۹۵	۱,۰۴۶	(۱۹%)	۵۵.۱	-۰.۰۴	۳	(۸۲%)
طستا ۶۰۰۸	شستا	۷۸	۲۰.۱	۹۶	۱,۲۹۵	۱,۱۶۹	(۱۰%)	۱۲.۲	-۰.۲۸	۳۶	(۶۳%)
طستا ۶۰۱۰	شستا	۷۸	۱,۴۳۱.۱	۱۴۶	۱,۲۹۵	۱,۳۱۹	۲%	۹.۰	-۰.۶۵	۱۳۵	(۸%)
طترا ۳۰۳۰	شتران	۵	۱.۴	۱,۷۳۱	۵,۳۰۰	۵,۲۶۹	(۱%)	۳.۰	-۱.۰۰	۱,۶۷۶	(۳%)
طترا ۳۰۲۸	شتران	۵	۵.۷	۶۹۹	۵,۳۰۰	۵,۳۰۱	۰%	۷.۶	-۱.۰۰	۶۷۹	(۳%)

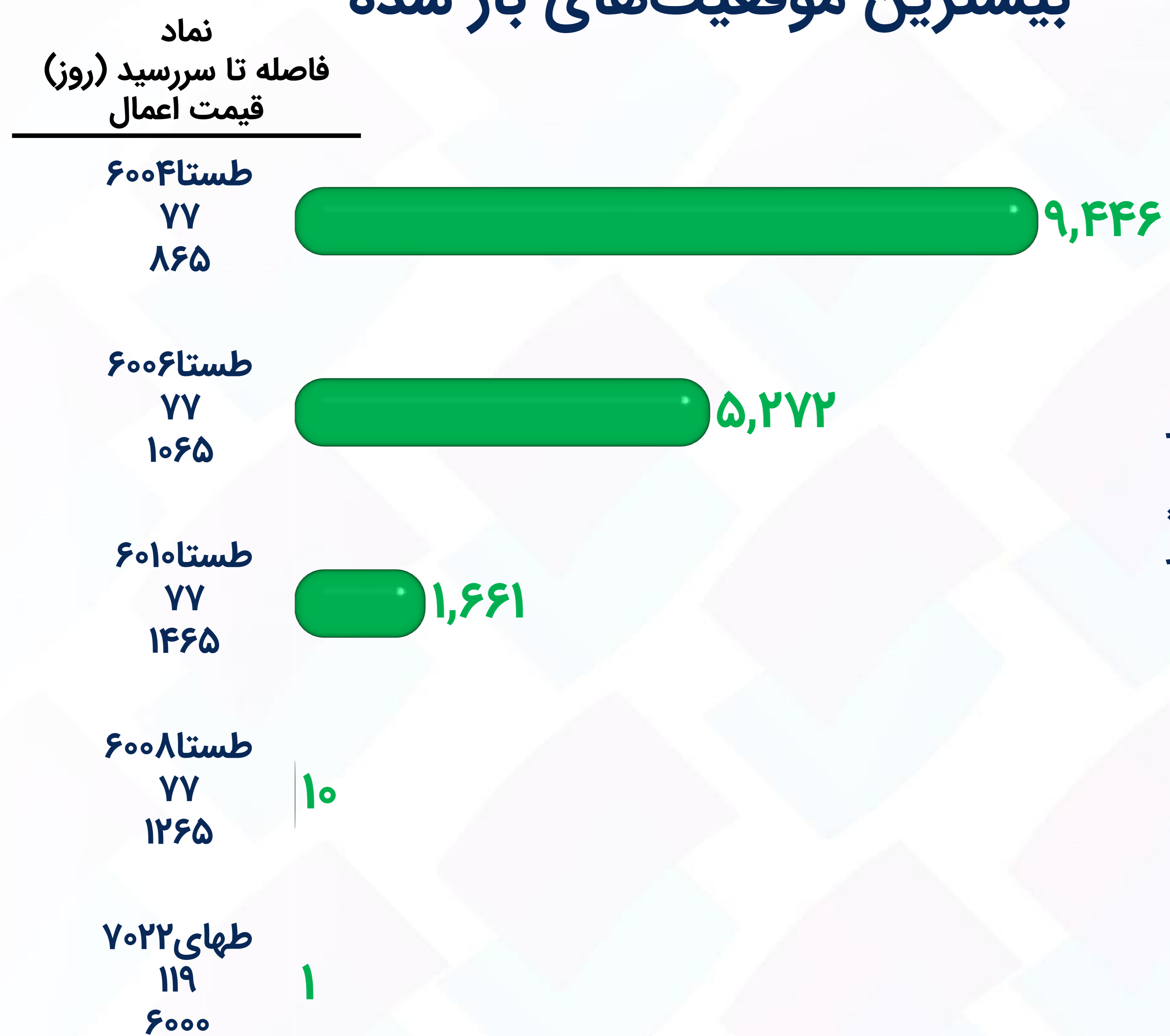
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

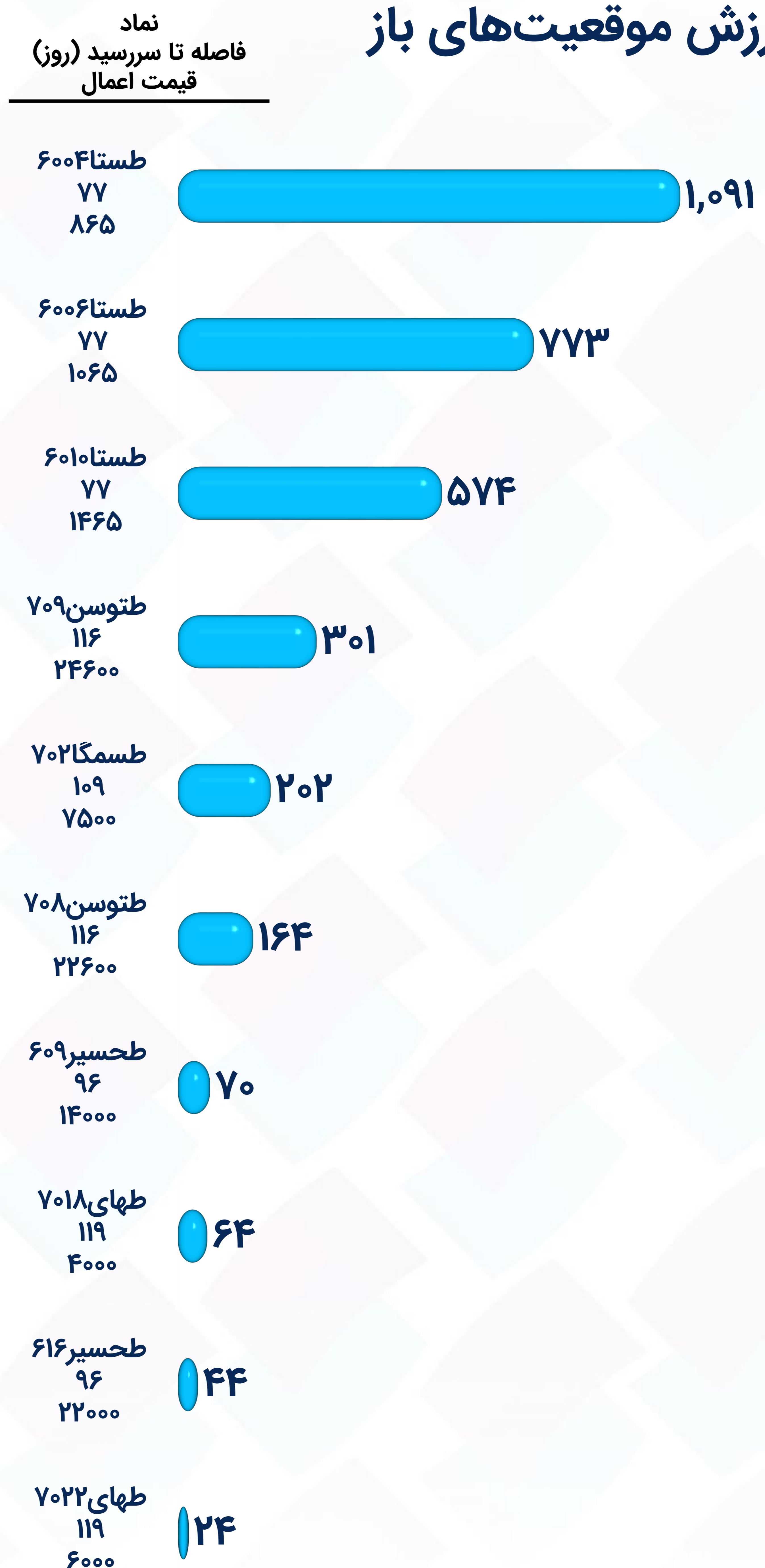
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



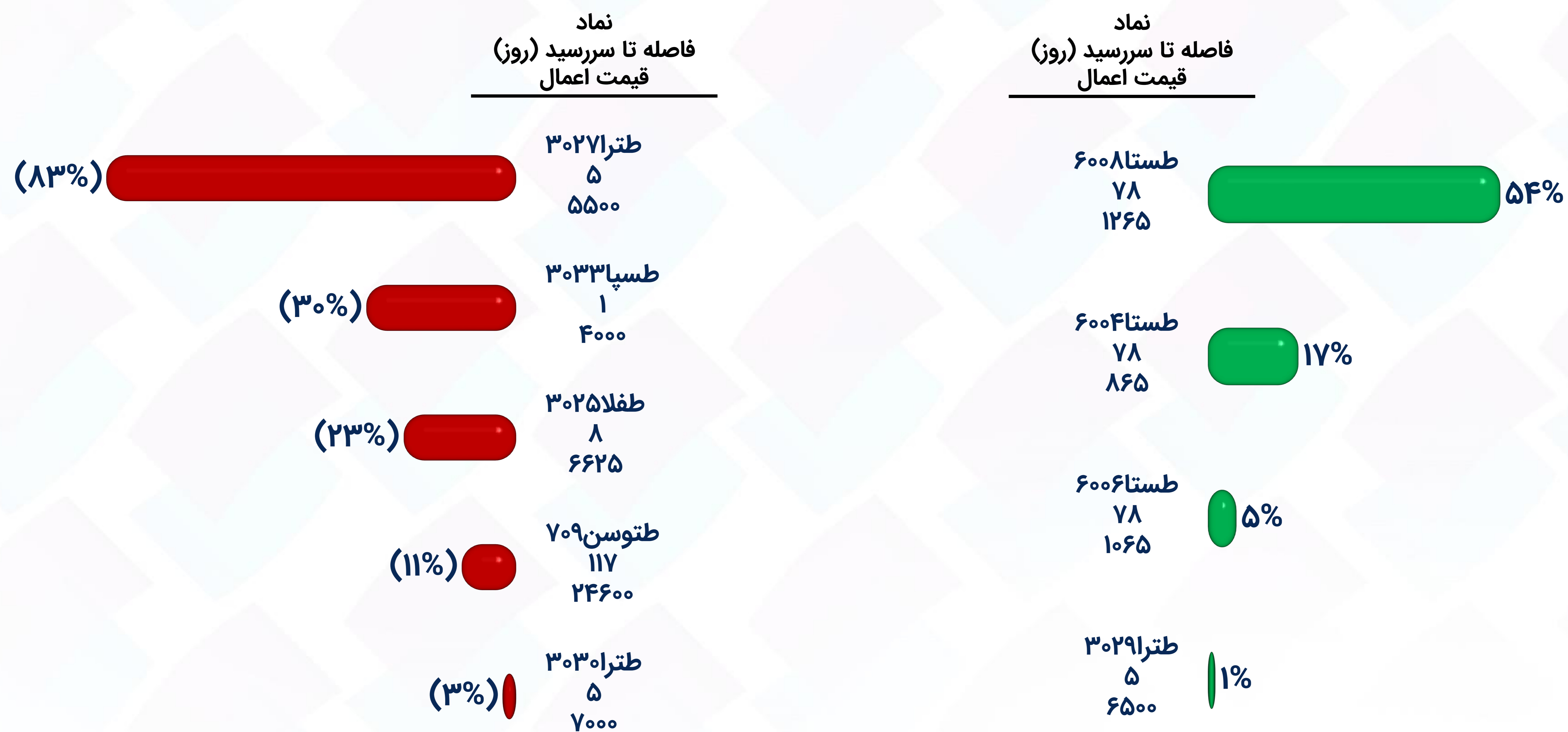
میلیارد تومان

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.