

شماره

۲۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۷ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

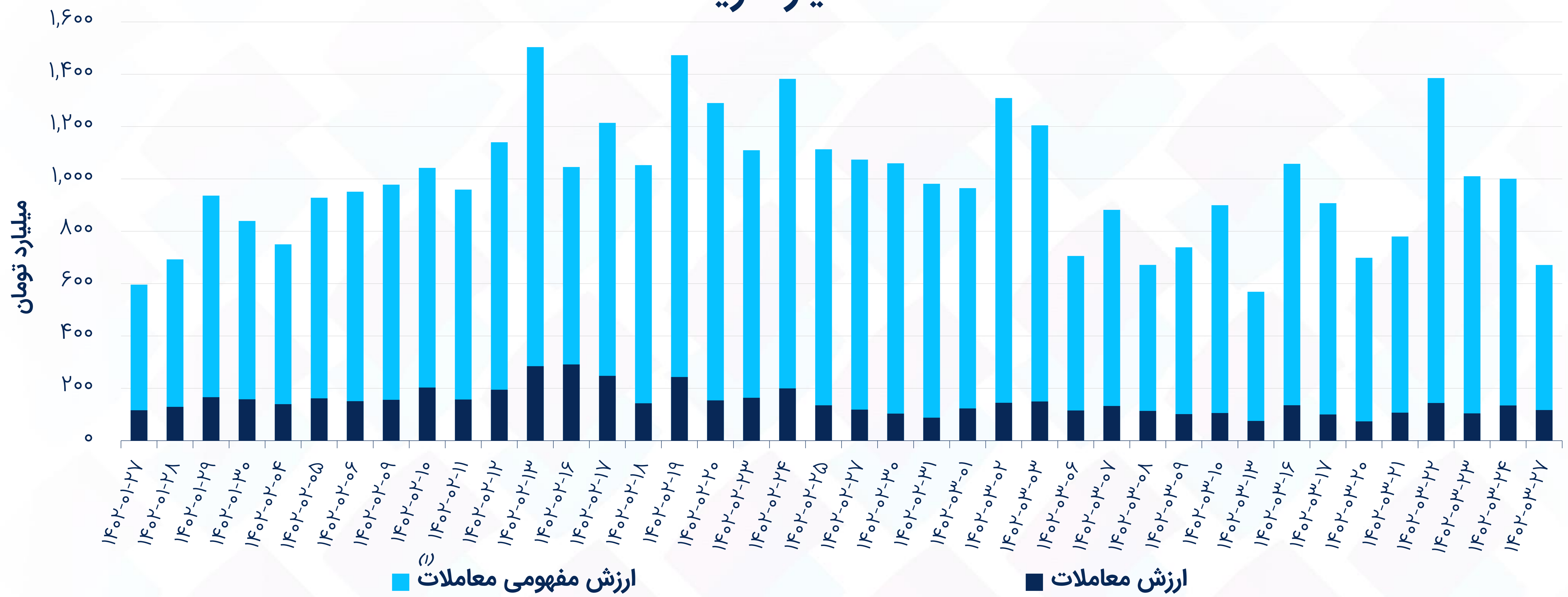




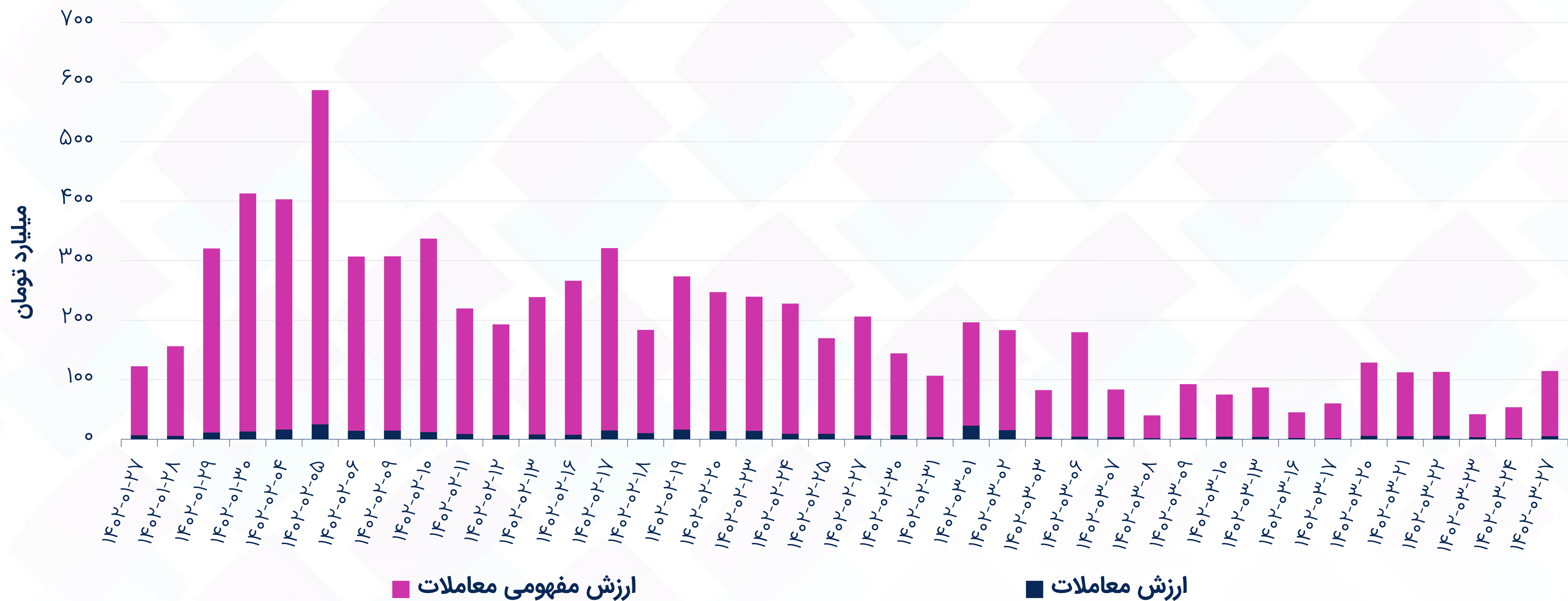
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



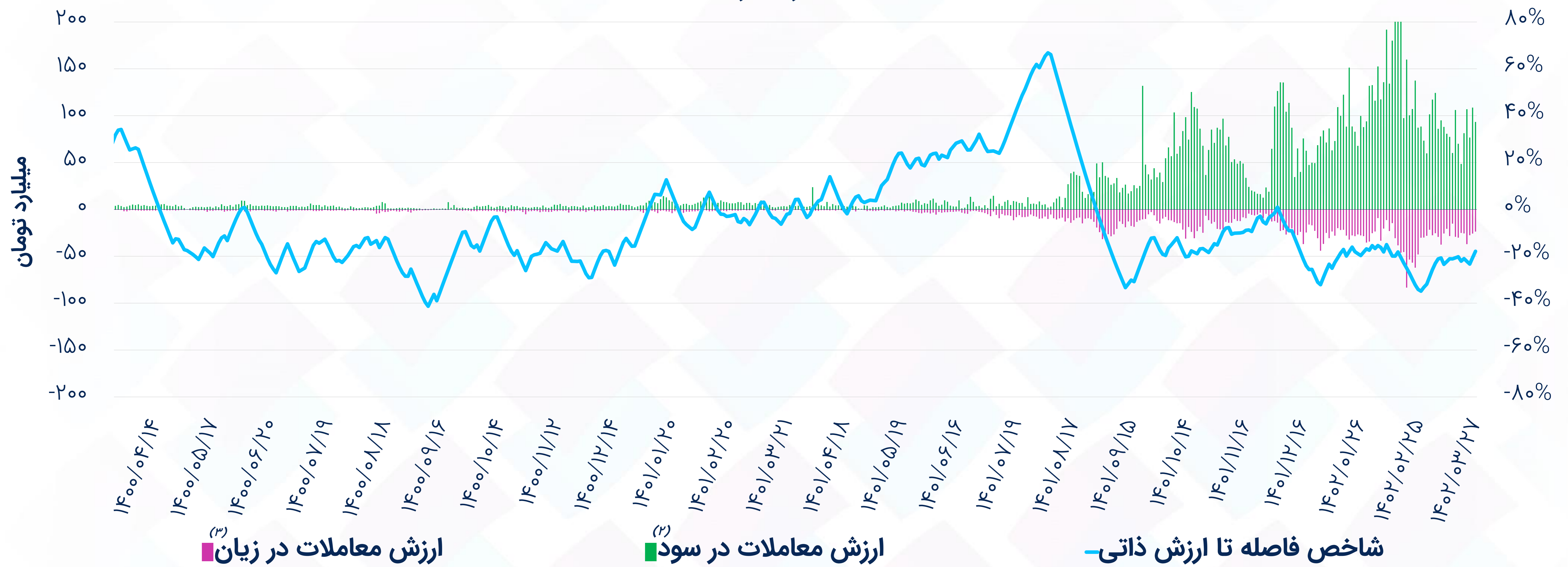
اختیار فروش



(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

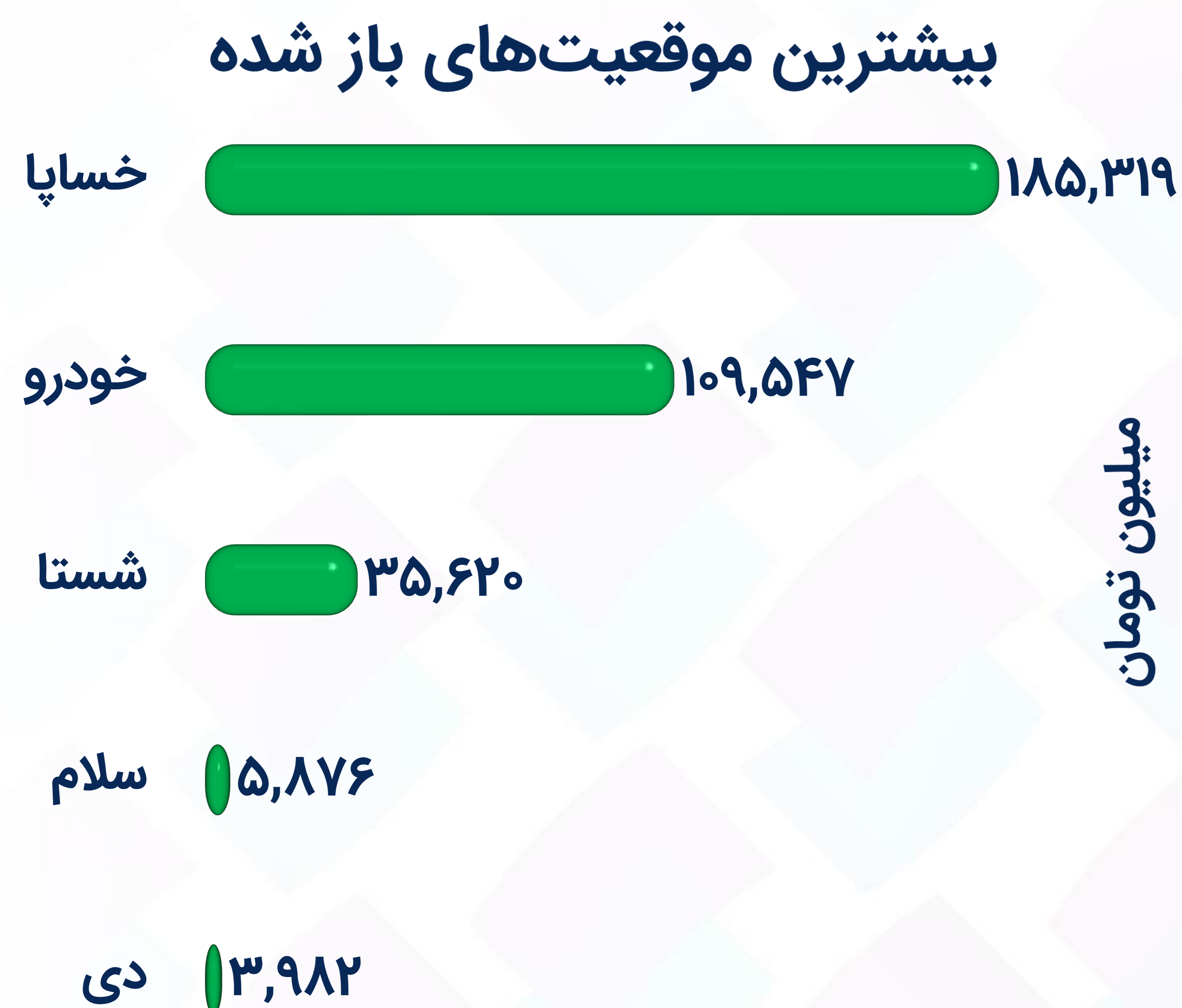
اختیار خرید

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	۲۰	۴۳.۲	۱۹۵.۱	۳۵.۳	۷.۹	(۱۷.۹%)
وبملت	۱۷	۱۹.۷	۶۰.۴	۱۹.۷	۰.۰	۱۰.۳%
خودرو	۲۲	۱۹.۶	۱۷۸.۴	۱۶.۳	۳.۳	(۳۰.۳%)
شستا	۳۱	۱۳.۳	۱۵۷.۴	۴.۳	۹.۰	(۵۰.۶%)
دی	۱۷	۸.۵	۲۷.۵	۷.۰	۱.۵	(۱۳.۴%)
اهرم	۲۴	۴.۰	۱۱.۳	۳.۵	۰.۵	(۱۳.۶%)
شتران	۹	۱.۶	۷.۳	۱.۶	۰.۰	۱۱.۲%

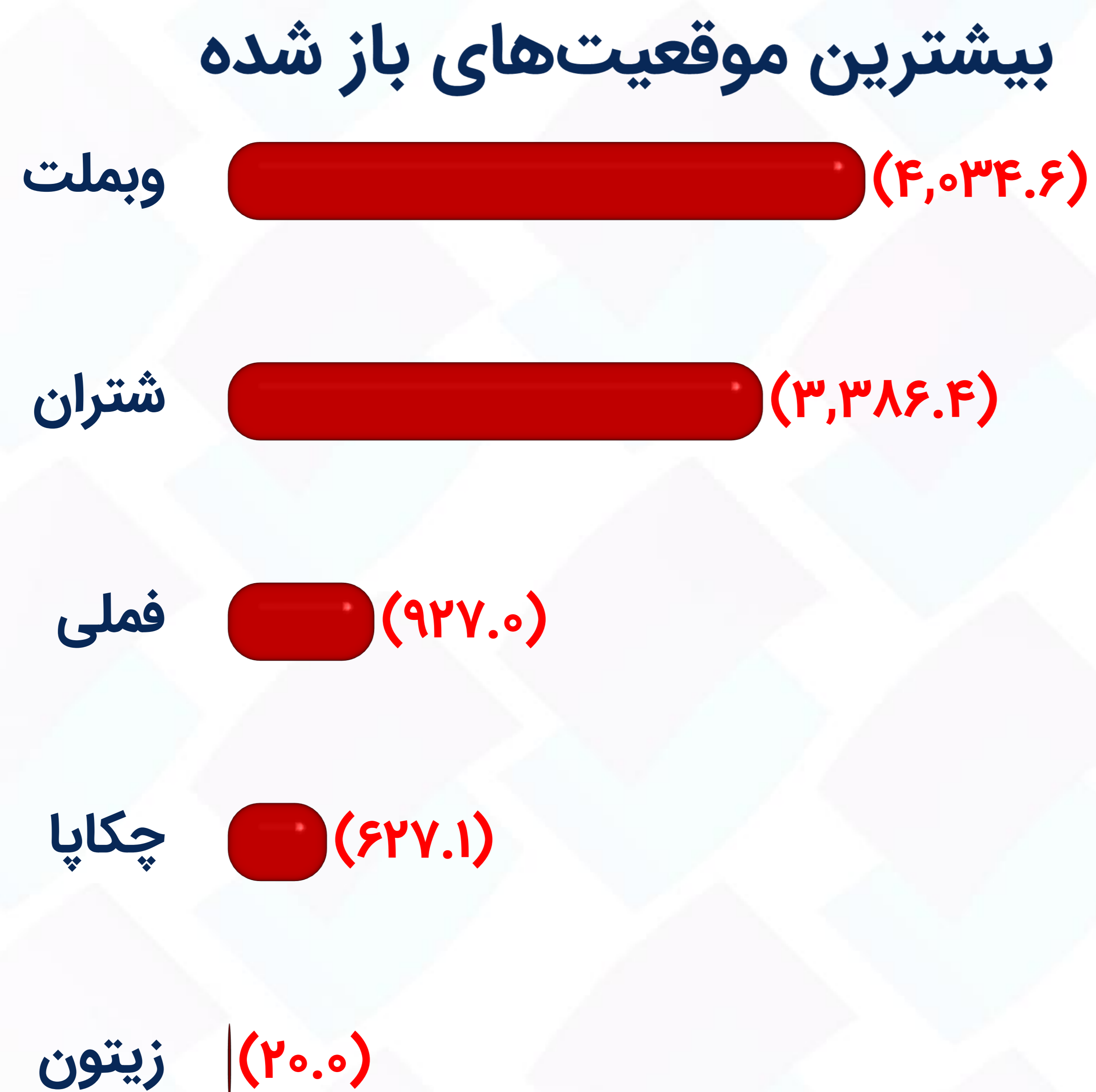
اختیار فروش

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	۲,۳۵۱.۲	۵۵,۲۸۹.۸	۱,۹۸۱.۳	۳۶۹.۹	(۲۱.۸%)
حریل	۱	۱,۰۲۹.۳	۱۴,۴۱۰.۲	۱,۰۲۹.۳	۰.۰	۱۸۸.۵%
حافرین	۱	۸۹۱.۴	۱۸,۳۴۹.۲	۸۹۱.۴	۰.۰	۲۹۰.۱%
حسیر	۱	۵۱۶.۵	۱۱,۵۳۸.۵	۵۱۶.۵	۰.۰	۷۷۴.۹%
های وب	۲	۲۷۶.۶	۵۵۶.۸	۲۷۶.۶	۰.۰	۱۳.۶%
اهرم	۲	۳.۴	۵۰.۰	۱.۰	۲.۴	۱۱.۷%
فولاد	۱	۱.۳	۱۰.۵	۱.۳	۰.۰	۱۳.۶%

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



میلیون تومان



میلیون تومان

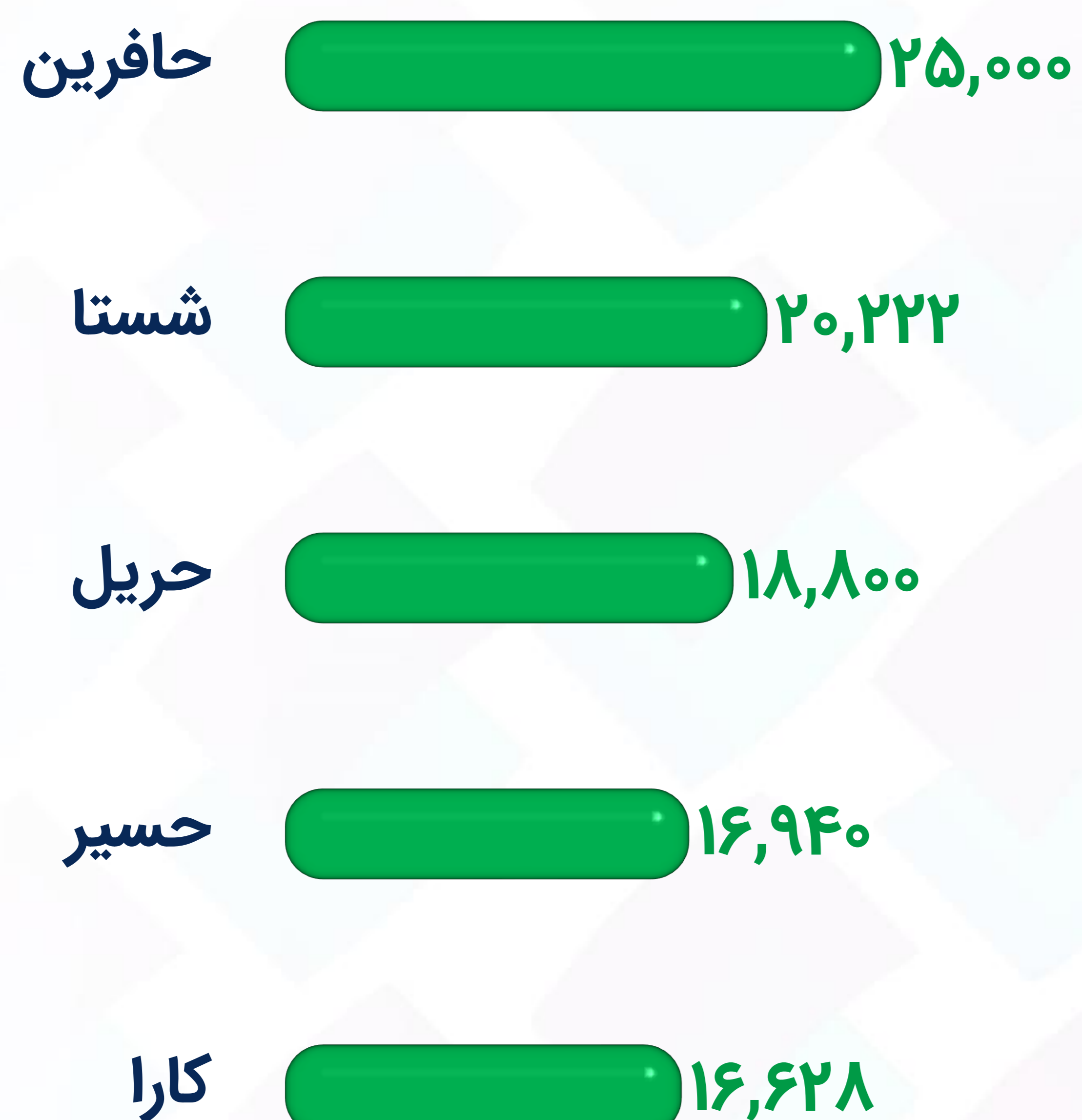


میلیارد تومان

(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

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

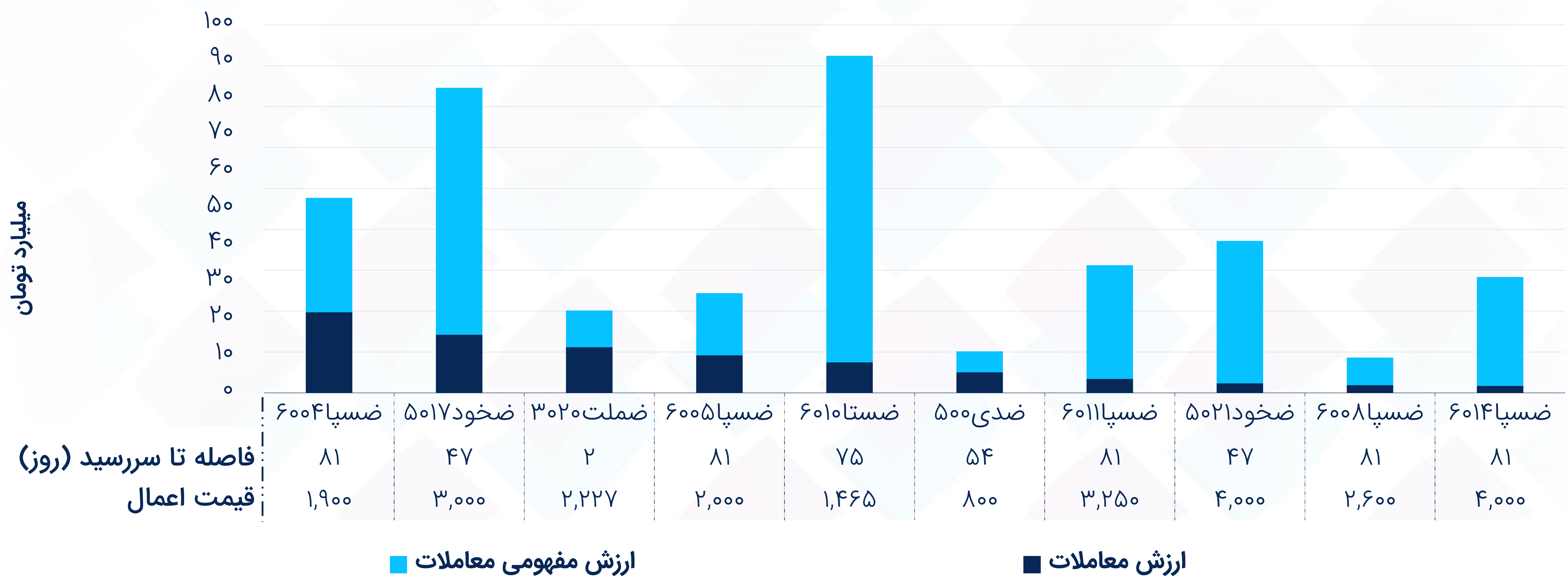
بیشترین موقعیت‌های بسته شده



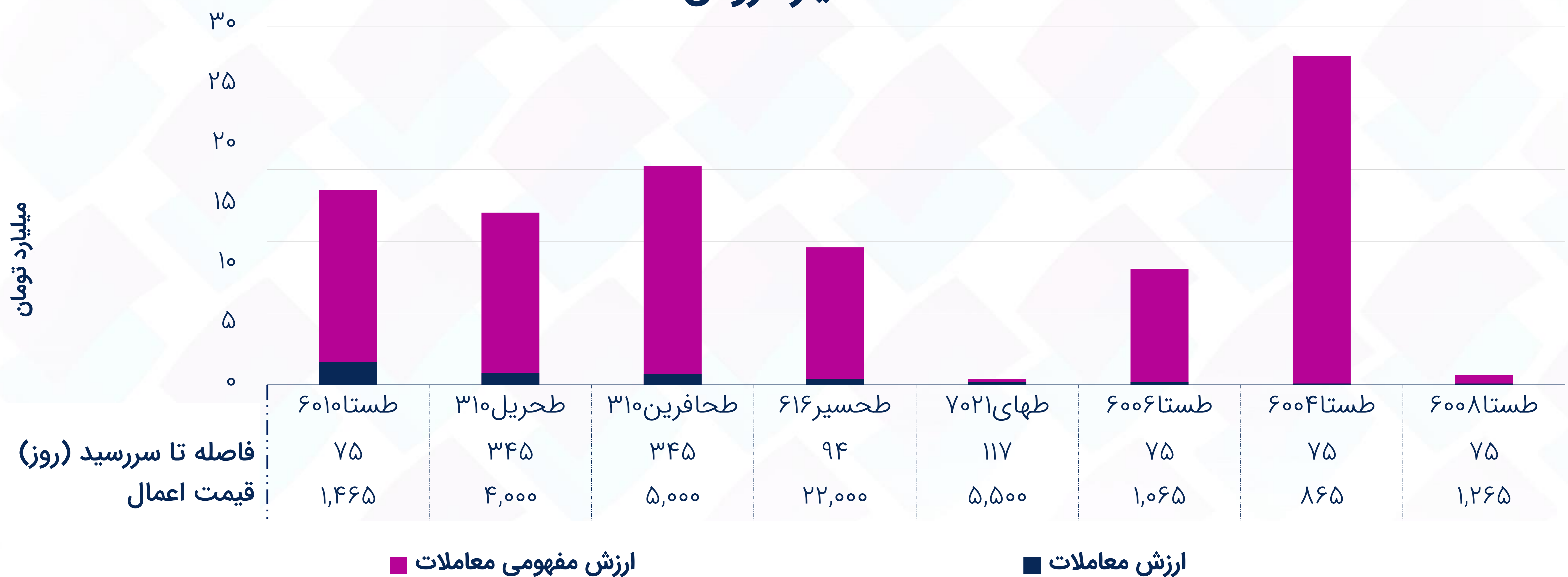
میلیون تومان

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
۳۱%	۲,۳۱۲	۰.۴۵	۱۵.۷	۵۲.۱%	۲۷,۷۷۰	۱۸,۲۵۷	۱,۷۷۰	۱۴۴.۴	۲۶۲	۲۶,۰۰۰	توان ۱۲۰۸
۲۲%	۸۲۷	۰.۷۳	۱۷.۳	۱.۶%	۱۱,۶۷۶	۱۱,۴۹۰	۶۷۶	۳.۰	۱۹	۱۱,۰۰۰	پتروآگاه ۴۰۰۵
۲۱%	۱۳۹,۰۳۰	۱.۰۰	۱.۷	(۱۰.۶%)	۱۹۴,۵۰۱	۲۱۷,۵۹۰	۱۱۴,۵۰۱	۱.۱	۲۶	۸۰,۰۰۰	دارا یکم ۴۰۱۱
۲۱%	۲۸,۱۹۵	۱.۰۰	۵.۳	(۳.۲%)	۱۲۳,۳۰۰	۱۲۷,۳۶۰	۲۳,۳۰۰	۴۶.۸	۱۲	۱۰۰,۰۰۰	سرو ۴۰۰۵
۱۴%	۷۳۷	۰.۹۶	۲.۴	۴.۷%	۱,۵۴۴	۱,۴۷۴	۶۴۴	۷۵.۰	۲۶۲	۹۰۰	کرمان ۱۲۰

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	۲,۰۰۱.۰	۵۵%	۲,۰۰۱	۱,۲۹۰	۱	۱۵.۹	۱۹	۲,۰۰۰	شستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۴۳.۹	۸۷%	۲,۴۰۷	۱,۲۹۰	۷	۱.۴	۴۷	۲,۴۰۰	شستا ۵۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۴۳.۹	۳۲%	۱,۷۰۷	۱,۲۹۰	۷	۹.۸	۱۹	۱,۷۰۰	شستا ۴۰۰۸
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۹۷.۳	۹۹%	۸,۰۲۷	۴,۰۲۴	۲۷	۱.۱	۶۸	۸,۰۰۰	فخوز ۶۰۱۰
(۱۰۰%)	۱	۰.۰۰	۷۶.۰	۷۹%	۱۵,۲۰۰	۸,۵۱۰	۲۰۰	۲.۸	۶۸	۱۵,۰۰۰	شپنا 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 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
۱۳.۹%	۱,۸۰۸	-۰.۹۴	۲.۵	۱۹%	۳,۹۱۳	۳,۲۸۱	۱,۵۸۷	۲۴۲.۷	۱۱۷	۵,۵۰۰	طهای ۷۰۲۱ های وب
۱۱.۷%	۲,۲۵۷	-۰.۹۷	۲.۰	۲۱%	۳,۹۷۹	۳,۲۸۱	۲,۰۲۱	۳۳.۹	۱۱۷	۶,۰۰۰	طهای ۷۰۲۲ های وب

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
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۱۲۲.۶	(۳۳%)	۸۵۸	۱,۲۹۰	۷	۱۴۹.۲	۷۵	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴ شستا
(۸۵%)	۳	-۰.۰۴	۴۹.۷	(۱۹%)	۱,۰۴۴	۱,۲۹۰	۲۱	۱۵۸.۳	۷۵	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶ شستا
(۵۹%)	۳۶	-۰.۲۹	۱۳.۲	(۹%)	۱,۱۷۶	۱,۲۹۰	۸۹	۵۳.۳	۷۵	۱,۲۶۵	طستا ۶۰۰۸ شستا
(۵%)	۷۸	-۰.۴۸	۱۵.۶	(۱%)	۱,۲۸۳	۱,۲۹۰	۸۲	۴۴.۲	۷۵	۱,۳۶۵	طستا ۶۰۰۹ شستا

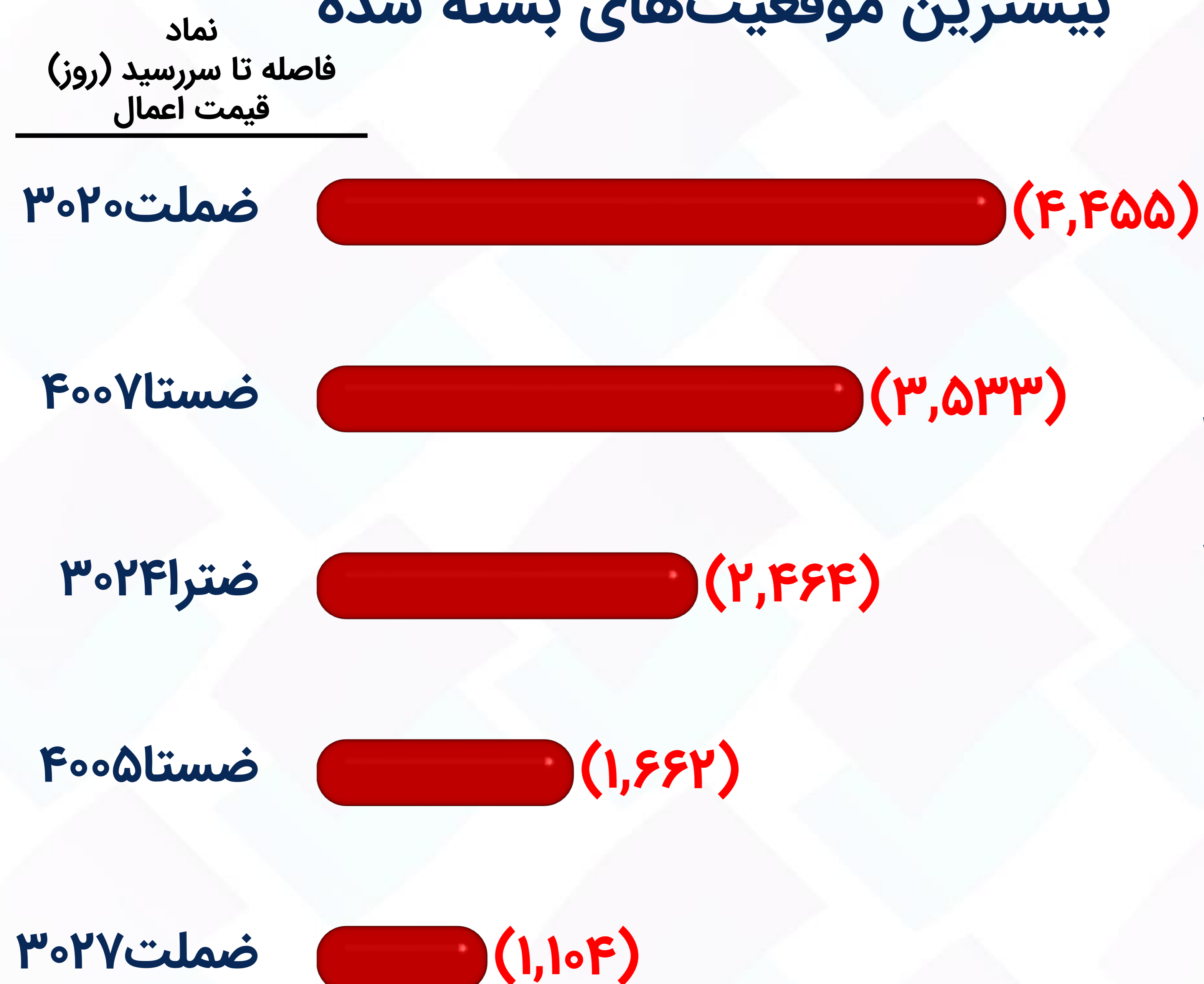
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده



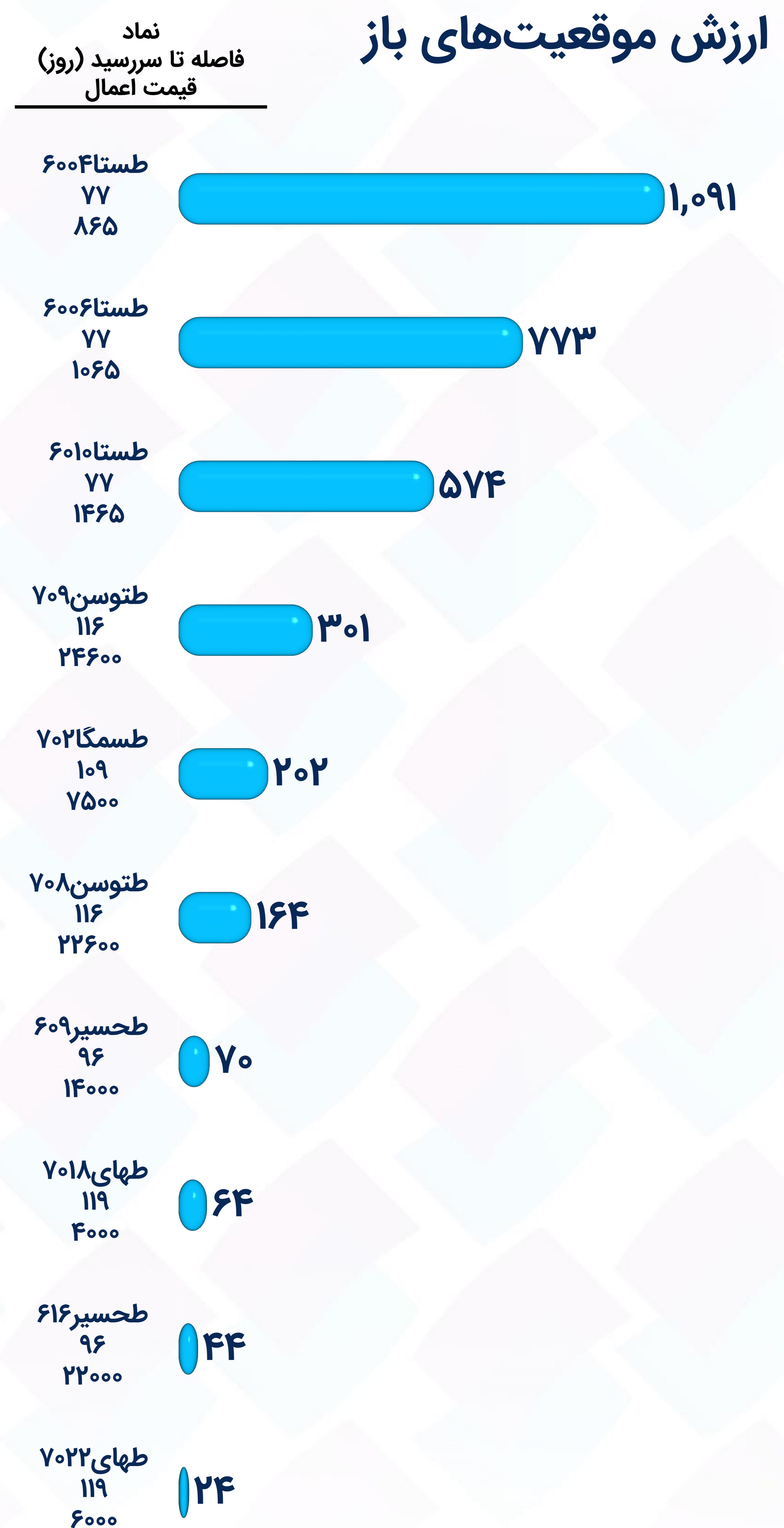
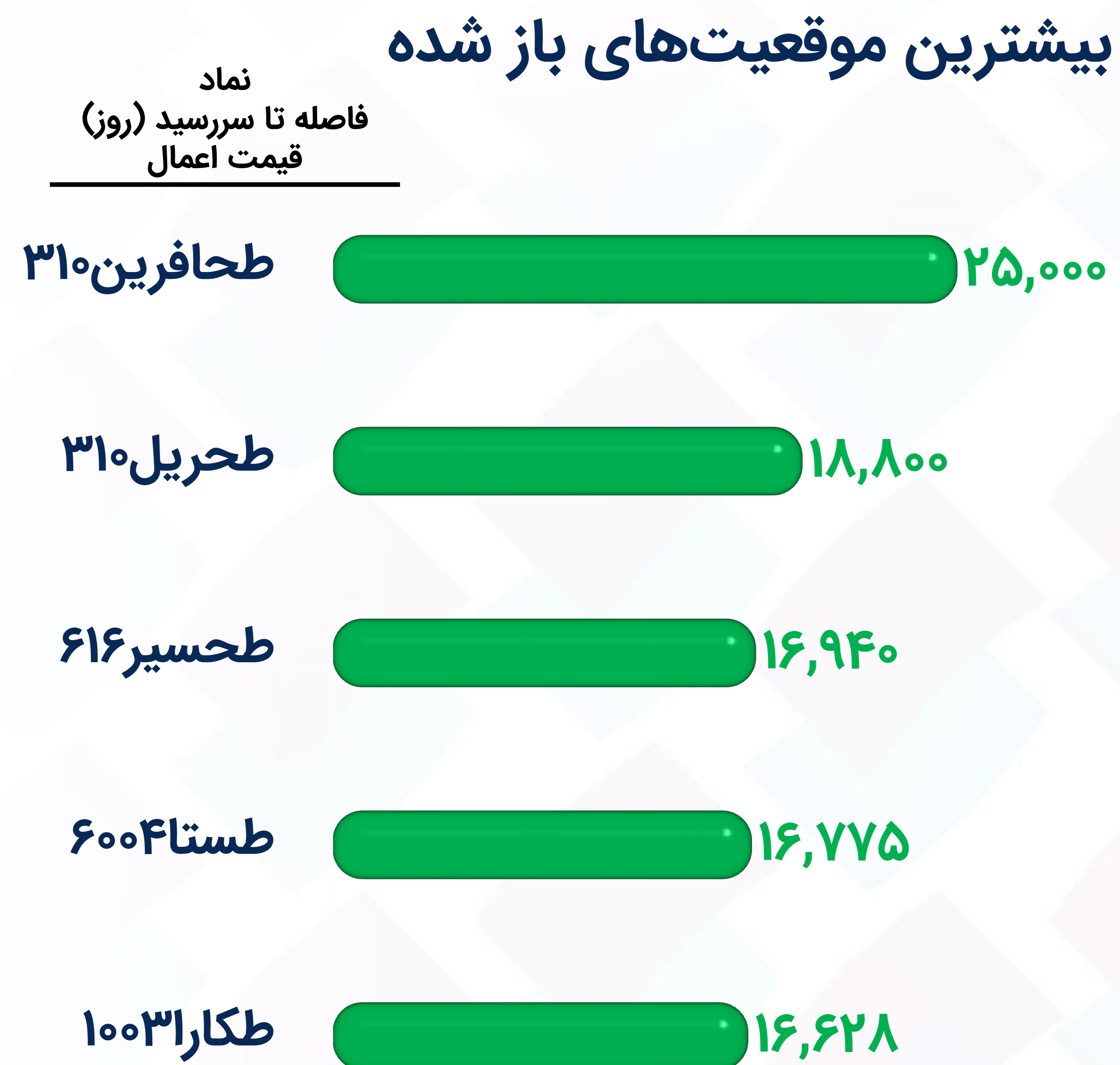
بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش



میلیارد تومان

میلیون تومان

میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

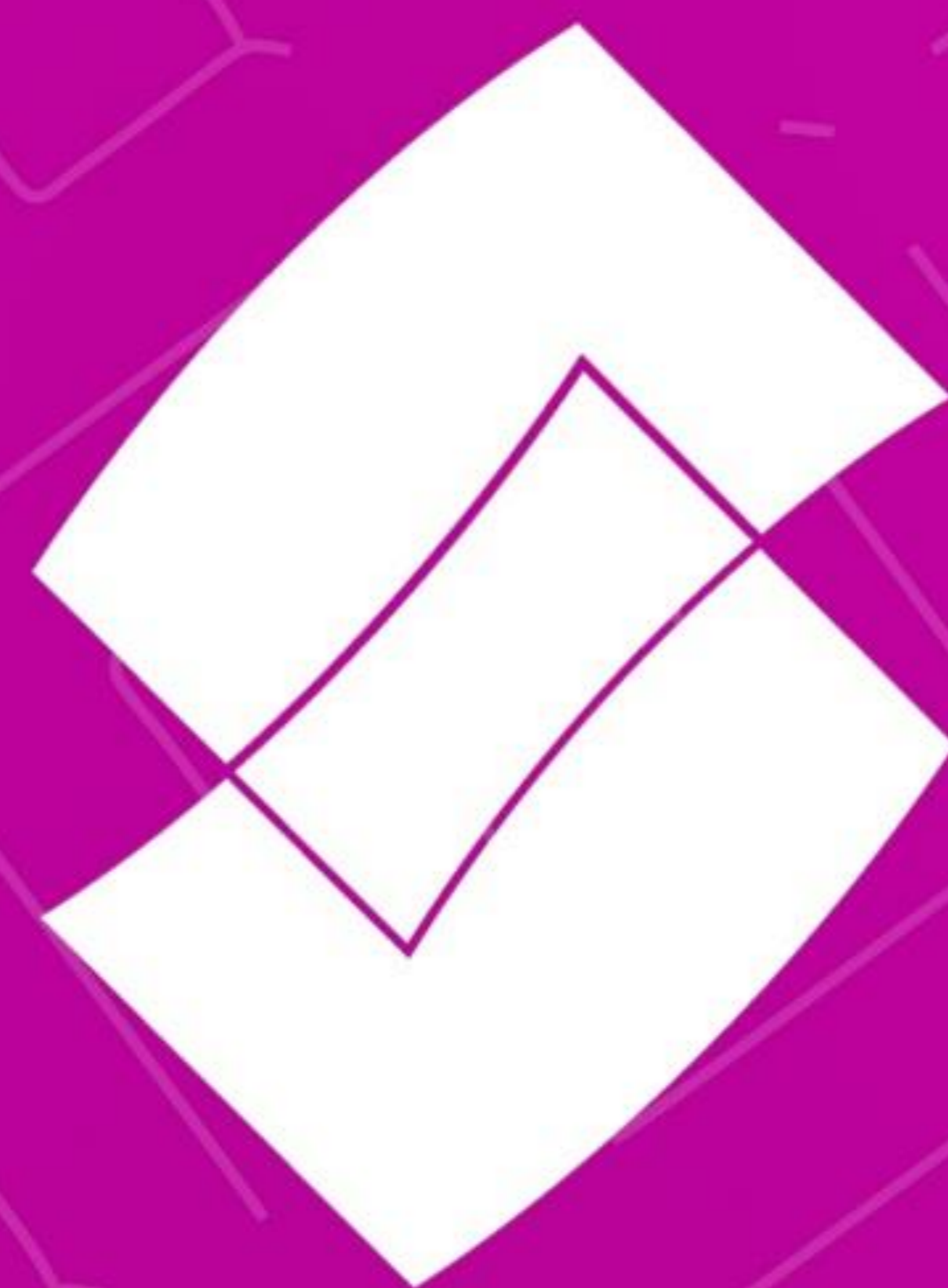
اختیار خرید



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.