

شماره

۳۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۹ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

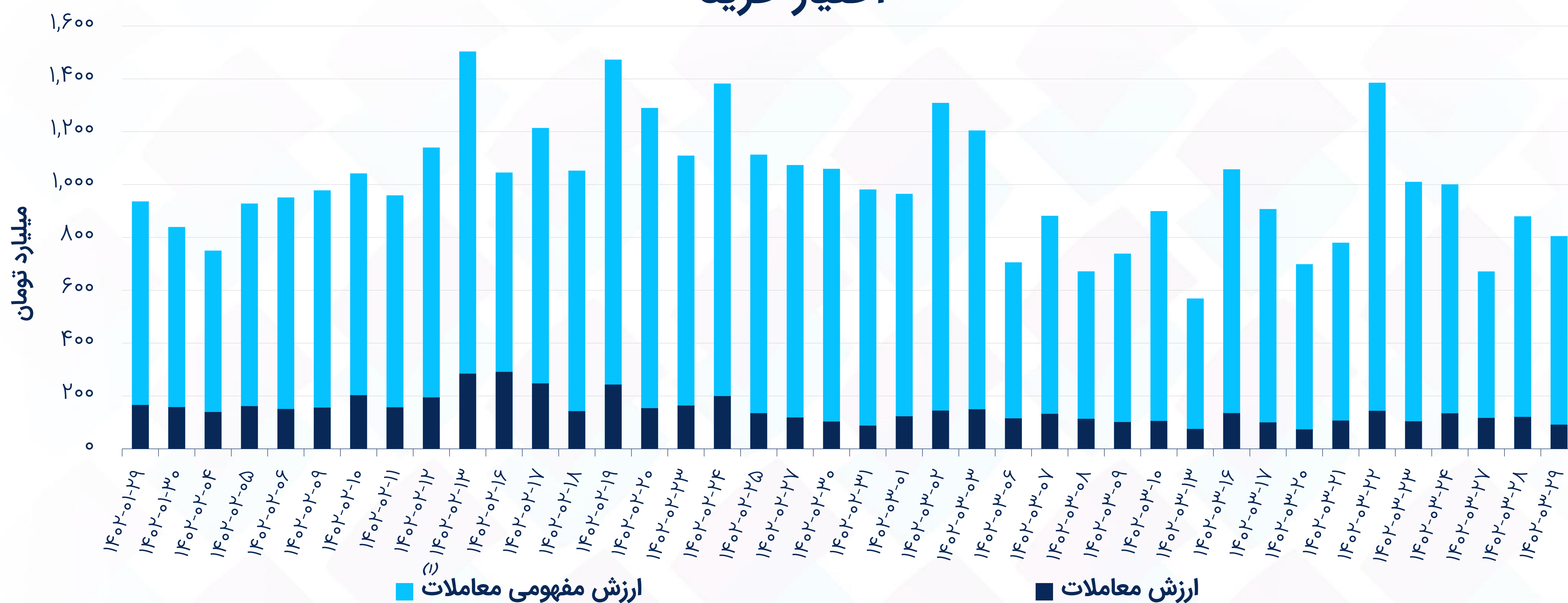




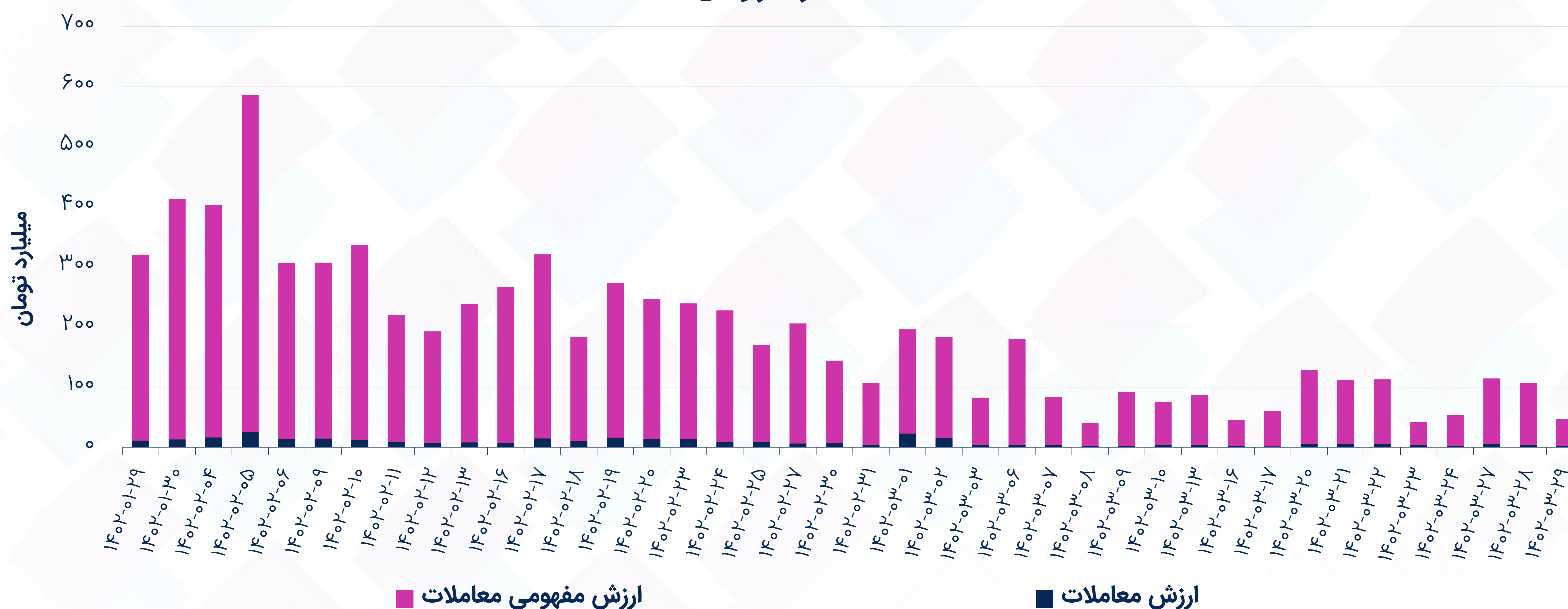
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



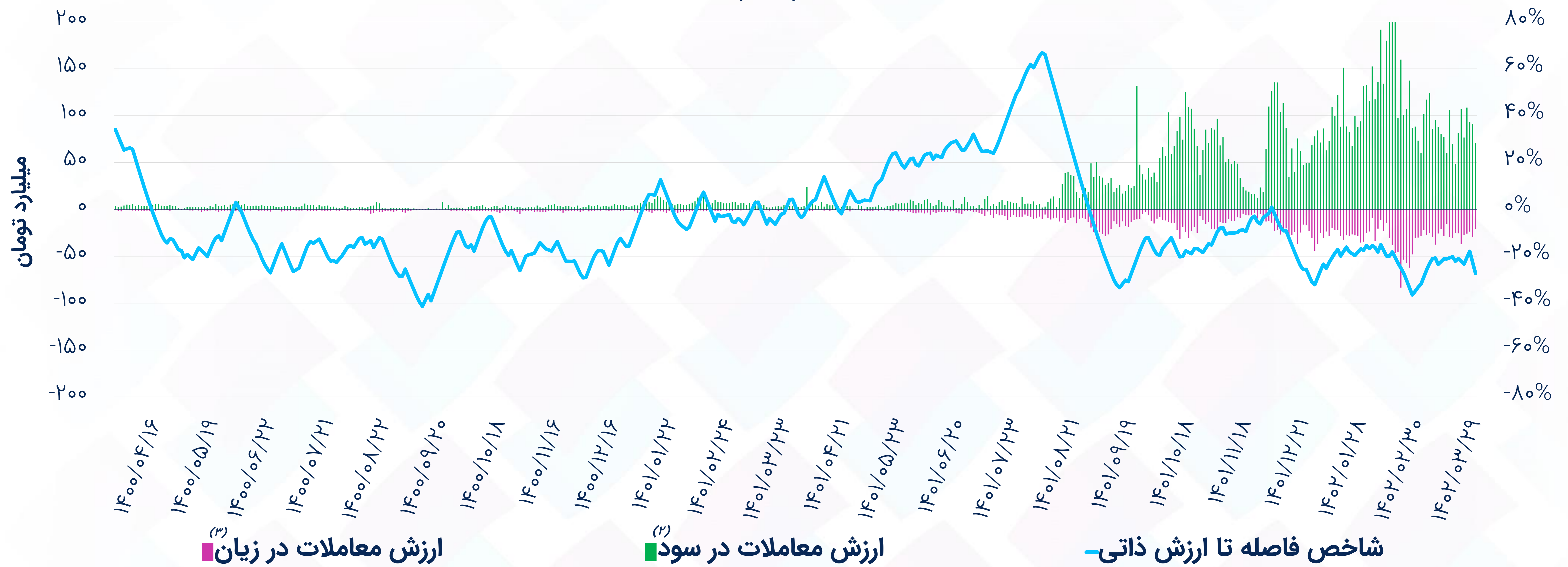
اختیار فروش



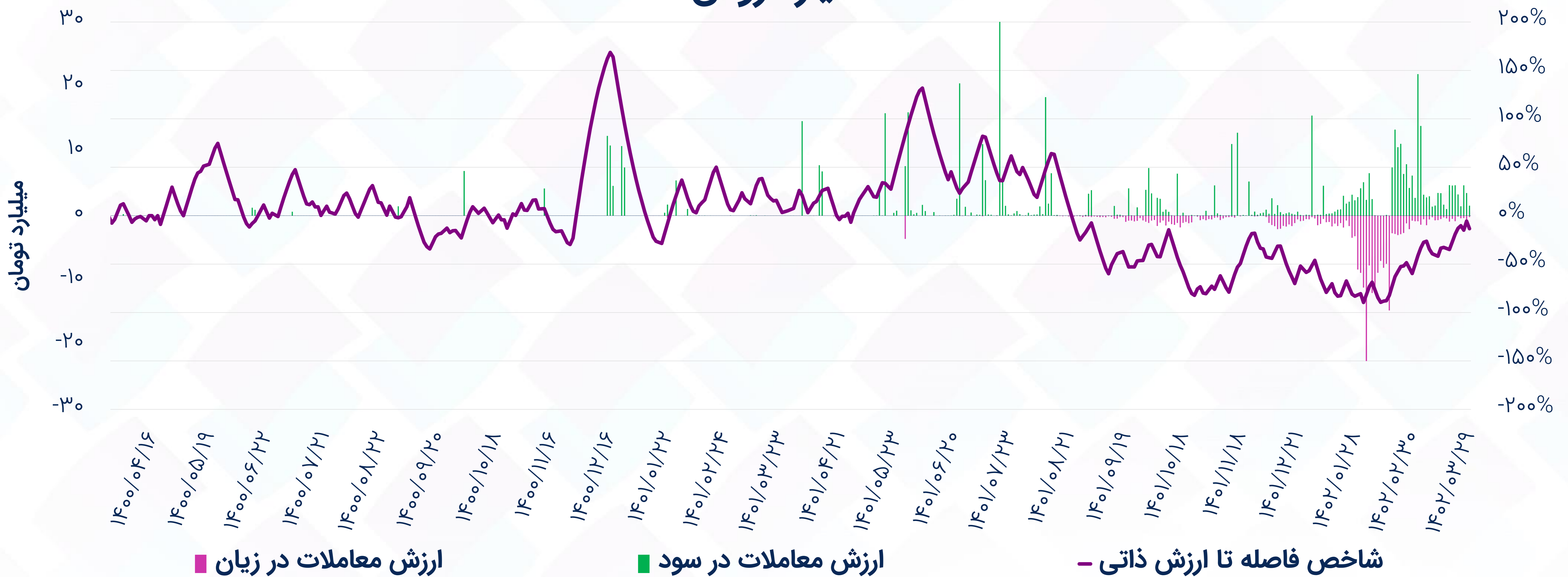
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

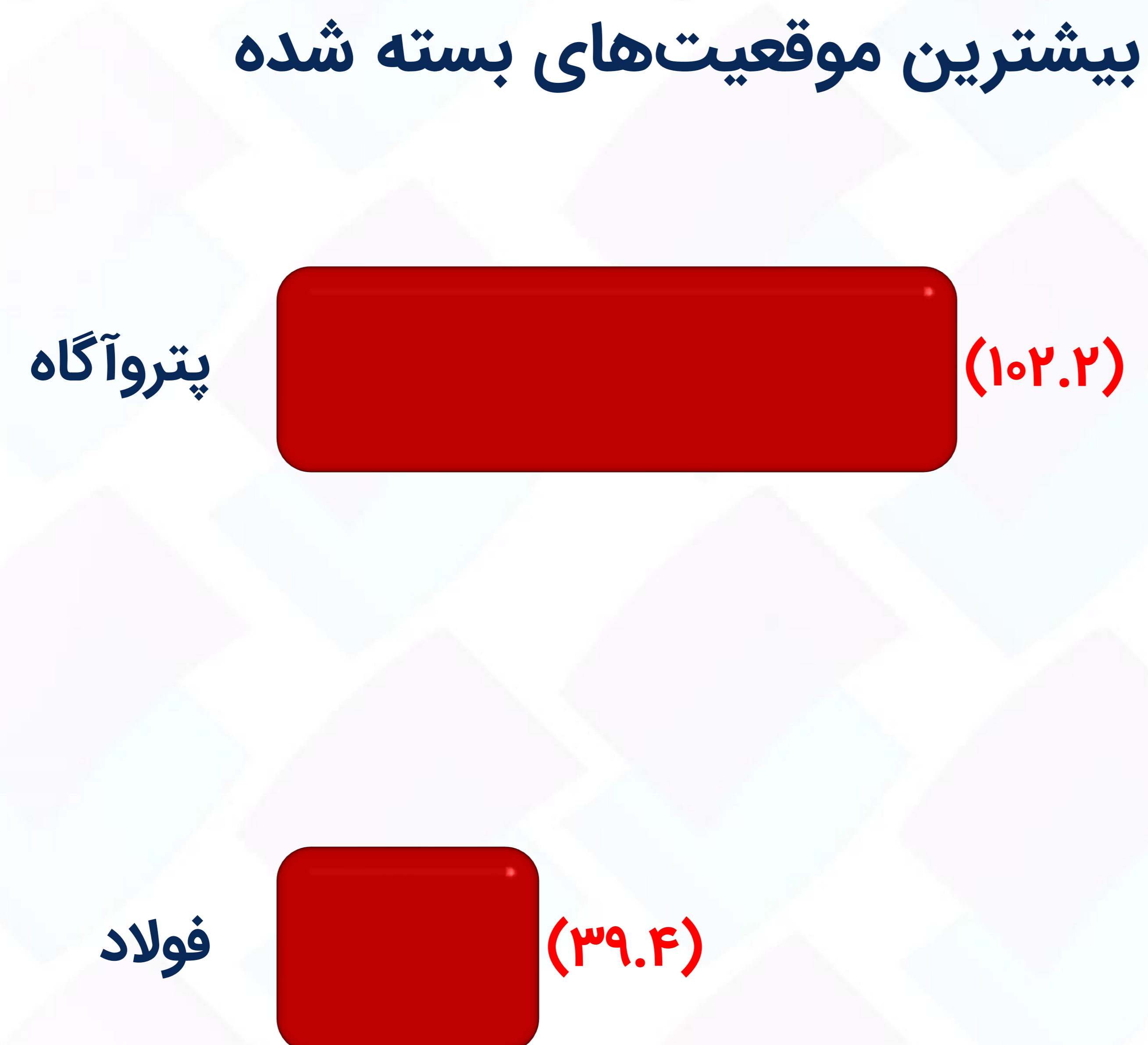
اختیار خرید

| 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 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|--|--|---|-------------------------------|
| خودرو | ۳۳ | ۲۹.۷ | ۳۷۹.۵ | ۲۵.۹ | ۳.۸ | (۳۰.۰%) |
| خسایا | ۲۰ | ۲۷.۴ | ۱۶۲.۵ | ۲۲.۰ | ۵.۴ | (۲۲.۲%) |
| شستا | ۳۵ | ۱۶.۰ | ۲۰۱.۴ | ۷.۲ | ۸.۸ | (۴۳.۱%) |
| اهرم | ۱۷ | ۴.۵ | ۹.۸ | ۴.۰ | ۰.۵ | (۱۴.۸%) |
| دی | ۱۶ | ۴.۳ | ۱۵.۳ | ۳.۵ | ۰.۸ | (۱۶.۷%) |
| شتران | ۳ | ۳.۵ | ۸.۹ | ۳.۵ | ۰.۰ | (۱۴.۷%) |
| خپارس | ۵ | ۱.۱ | ۳.۱ | ۱.۱ | ۰.۰ | (۲۰.۵%) |

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 | ۶ | ۱,۷۰۳.۹ | ۴۵,۵۹۷.۳ | ۱,۵۱۰.۴ | ۱۹۳.۵ | (۱۳.۸%) |
| سلام | ۱ | ۲۰.۵ | ۱,۳۳۰.۰ | ۰.۰ | ۲۰.۵ | (۵۰.۸%) |
| فولاد | ۲ | ۲۰.۱ | ۱۳۱.۸ | ۲۰.۱ | ۰.۰ | ۱۰.۳% |
| حافرین | ۲ | ۱۱.۱ | ۹۸.۱ | ۱۱.۱ | ۰.۰ | ۵۷.۸% |
| های وب | ۱ | ۲.۸ | ۴.۷ | ۲.۸ | ۰.۰ | ۷.۱% |
| اهرم | ۱ | ۱.۲ | ۸.۱ | ۱.۲ | ۰.۰ | (۱۵.۴%) |
| شپنا | ۱ | ۱.۰ | ۴.۳ | ۱.۰ | ۰.۰ | (۲.۹%) |

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

ارزش موقعیت‌های باز

شستا ۲,۵۱۱

توسن ۴۶۵

سمگا ۲۲۴

حسیر ۱۳۱

های وب ۱۰۱

حافرین ۴۰

حریل ۱۹

کارا ۱۷

سلام ۳

اهرم ۳

بیشترین موقعیت‌های باز شده

شستا ۲۱,۴۷۶.۱

اهرم ۸.۸

حافرین ۰.۵

میلیون تومان

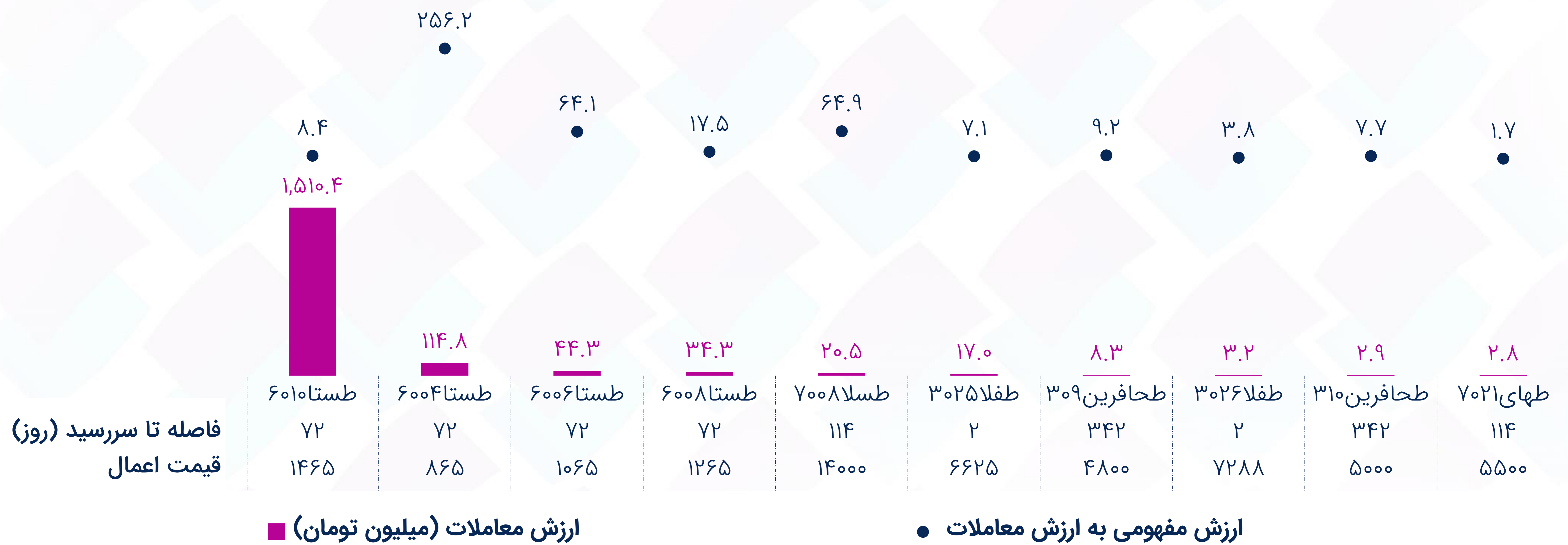
میلیارد تومان

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 |
|--------------------|----------------------|------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|----------|
| ۱۱۲% | ۵,۲۸۹ | ۱.۰۰ | ۶.۲ | (۱۴.۱%) | ۱۵,۵۰۰ | ۱۸,۰۴۰ | ۲,۵۰۰ | ۵.۰ | ۲۸ | ۱۳,۰۰۰ | ضیتو۲۴۰۰ |
| ۷۵% | ۱۹۴ | ۰.۹۹ | ۱۰.۹ | (۵.۵%) | ۱,۲۱۱ | ۱,۲۸۱ | ۱۱۱ | ۱۲.۷ | ۱۷ | ۱,۱۰۰ | ضستا۲۴۰۰ |
| ۲۲% | ۲۷,۷۳۹ | ۱.۰۰ | ۵.۴ | (۳.۳%) | ۱۲۲,۸۱۹ | ۱۲۷,۰۵۰ | ۲۲,۸۱۹ | ۵.۷ | ۱۰ | ۱۰۰,۰۰۰ | ضسرو۵۴۰۰ |
| ۱۸% | ۴۷,۶۰۱ | ۱.۰۰ | ۳.۰ | (۵.۲%) | ۱۲۰,۴۰۰ | ۱۲۷,۰۵۰ | ۴۰,۴۰۰ | ۱۳.۶ | ۱۰ | ۸۰,۰۰۰ | ضسرو۳۴۰۰ |
| ۱۷% | ۳۷,۶۷۰ | ۱.۰۰ | ۳.۸ | (۳.۸%) | ۱۲۲,۲۵۱ | ۱۲۷,۰۵۰ | ۳۲,۲۵۱ | ۸.۷ | ۱۰ | ۹۰,۰۰۰ | ضسرو۴۴۰۰ |

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 | ۵۶% | ۲,۰۰۱ | ۱,۲۸۱ | ۱ | ۲۸.۹ | ۱۷ | ۲,۰۰۰ | ضستا۱۱۴۰۰ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱,۹۰۱.۰ | ۴۸% | ۱,۹۰۱ | ۱,۲۸۱ | ۱ | ۱.۷ | ۱۷ | ۱,۹۰۰ | ضستا۱۰۴۰۰ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱,۸۰۱.۰ | ۴۱% | ۱,۸۰۱ | ۱,۲۸۱ | ۱ | ۴.۸ | ۱۷ | ۱,۸۰۰ | ضستا۰۹۴۰۰ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۴,۵۰۱.۰ | ۴۳% | ۴,۵۰۱ | ۳,۱۵۱ | ۱ | ۹.۵ | ۱۰ | ۴,۵۰۰ | ضخود۳۲۴۰۰ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۸۵۱.۰ | ۳۳% | ۱,۷۰۲ | ۱,۲۸۱ | ۲ | ۳.۶ | ۱۷ | ۱,۷۰۰ | ضستا۰۸۴۰۰ |

(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 |
|--------------------|---------------------|-------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|--------------------|
| ۵۸.۸% | ۶۲۶ | -۰.۴۸ | ۱۱.۲ | ۲۲% | ۴,۴۰۶ | ۳,۶۱۸ | ۳۹۴ | ۸.۳ | ۳۴۳ | ۴,۸۰۰ | طحافرین ۳۰۹ حافرین |
| ۵۴.۷% | ۷۲۷ | -۰.۵۲ | ۹.۶ | ۲۵% | ۴,۵۳۰ | ۳,۶۱۸ | ۴۷۰ | ۲.۹ | ۳۴۳ | ۵,۰۰۰ | طحافرین ۳۱۰ حافرین |
| ۱۱.۴% | ۹۰۱ | -۱.۰۰ | ۷.۲ | ۲% | ۵,۸۱۶ | ۵,۷۱۰ | ۸۰۹ | ۱۷.۰ | ۳ | ۶,۶۲۵ | طفلا ۳۰۲ فولاد |
| ۷.۱% | ۱,۹۸۶ | -۰.۹۶ | ۲.۰ | ۱۷% | ۳,۶۴۶ | ۳,۱۰۵ | ۱,۸۵۴ | ۲.۸ | ۱۱۵ | ۵,۵۰۰ | طهای ۷۰۲۱ های وب |
| ۴.۳% | ۱,۵۶۳ | -۱.۰۰ | ۳.۹ | ۱% | ۵,۷۸۹ | ۵,۷۱۰ | ۱,۴۹۹ | ۳.۲ | ۳ | ۷,۲۸۸ | طفلا ۳۰۲ فولاد |

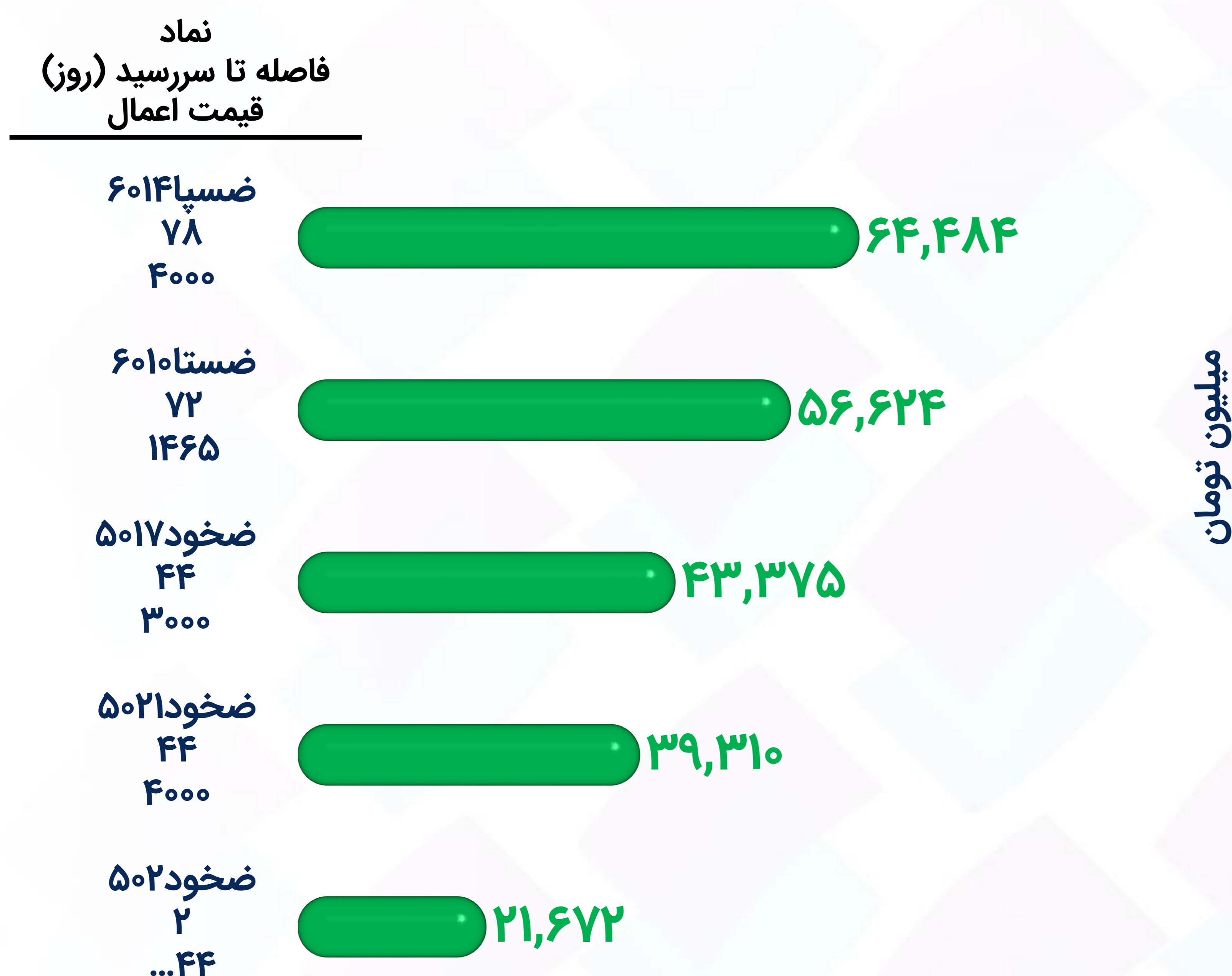
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

| 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 | ۱۷۲.۰ | (۳۳%) | ۸۶۰ | ۱,۲۸۱ | ۵ | ۱۱۴.۸ | ۷۳ | ۸۶۵ | طستا ۶۰۰۴ شستا |
| (۸۳%) | ۳ | -۰.۰۴ | ۵۲.۳ | (۱۸%) | ۱,۰۴۵ | ۱,۲۸۱ | ۲۰ | ۴۴.۳ | ۷۳ | ۱,۰۶۵ | طستا ۶۰۰۶ شستا |
| (۵۱%) | ۱۲۳ | -۰.۰۹ | ۵۵.۰ | (۱۵%) | ۱۳,۷۵۰ | ۱۶,۲۲۰ | ۲۵۰ | ۲۰.۵ | ۱۱۵ | ۱۴,۰۰۰ | طسلا ۷۰۰۸ سلام |
| (۴۷%) | ۳۹ | -۰.۳۰ | ۱۶.۳ | (۷%) | ۱,۱۹۲ | ۱,۲۸۱ | ۷۳ | ۳۴.۳ | ۷۳ | ۱,۲۶۵ | طستا ۶۰۰۸ شستا |
| (۱۵%) | ۲,۵۳۸ | -۰.۴۴ | ۶.۳ | (۶%) | ۱۹,۰۰۰ | ۲۰,۲۶۰ | ۳,۰۰۰ | ۱.۲ | ۱۱۹ | ۲۲,۰۰۰ | طهرم ۷۰۱۴ اهرم |

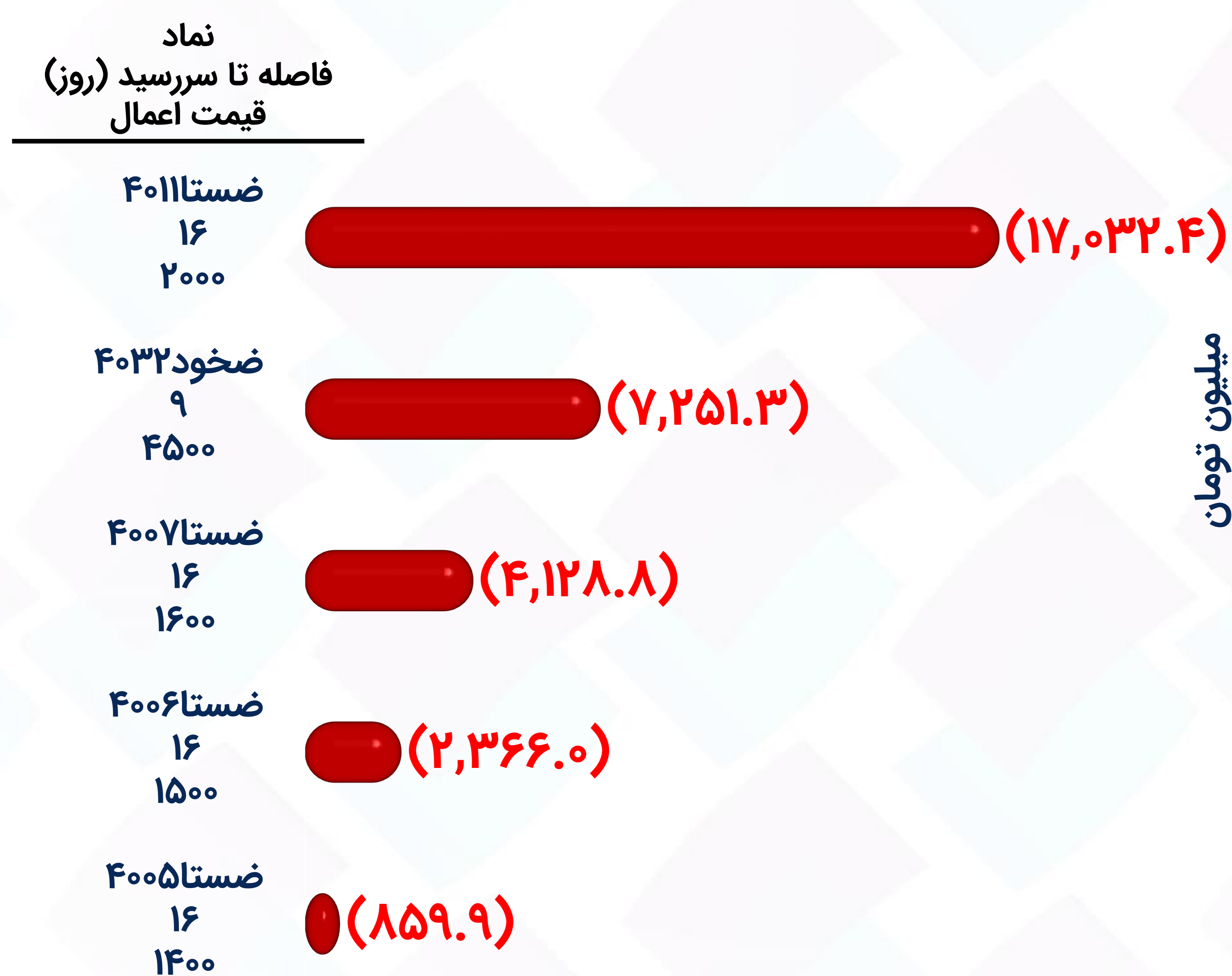
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

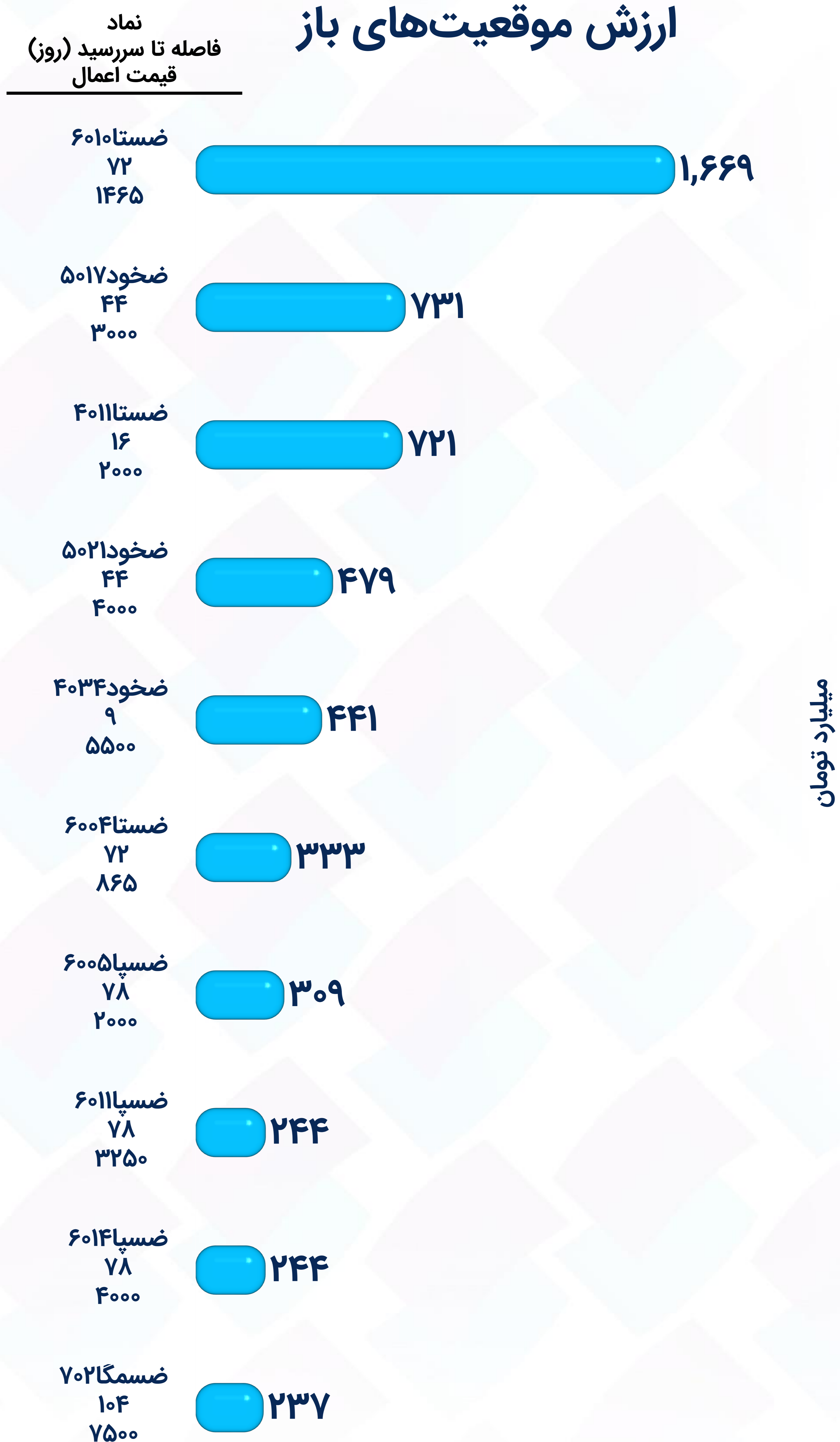
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

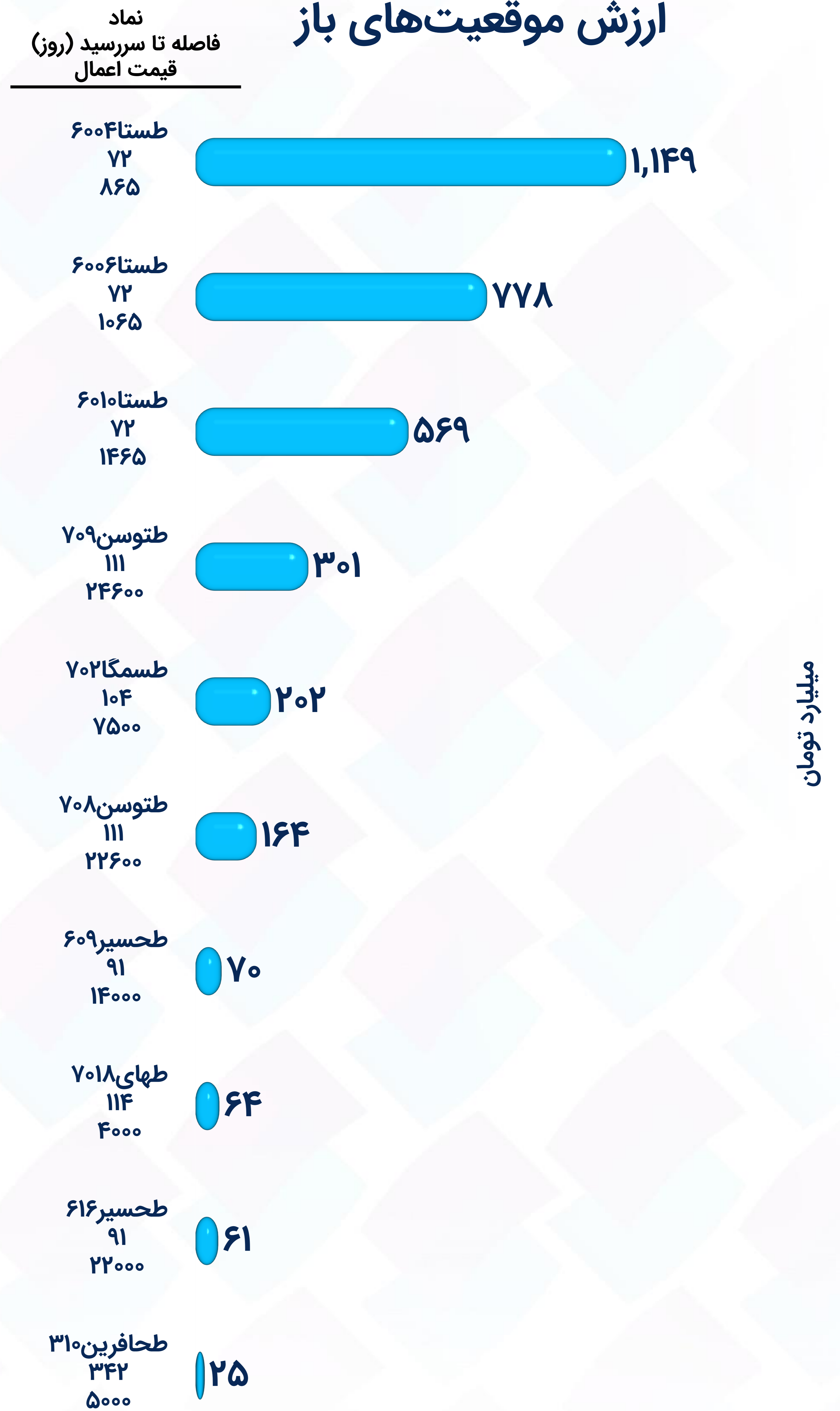
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

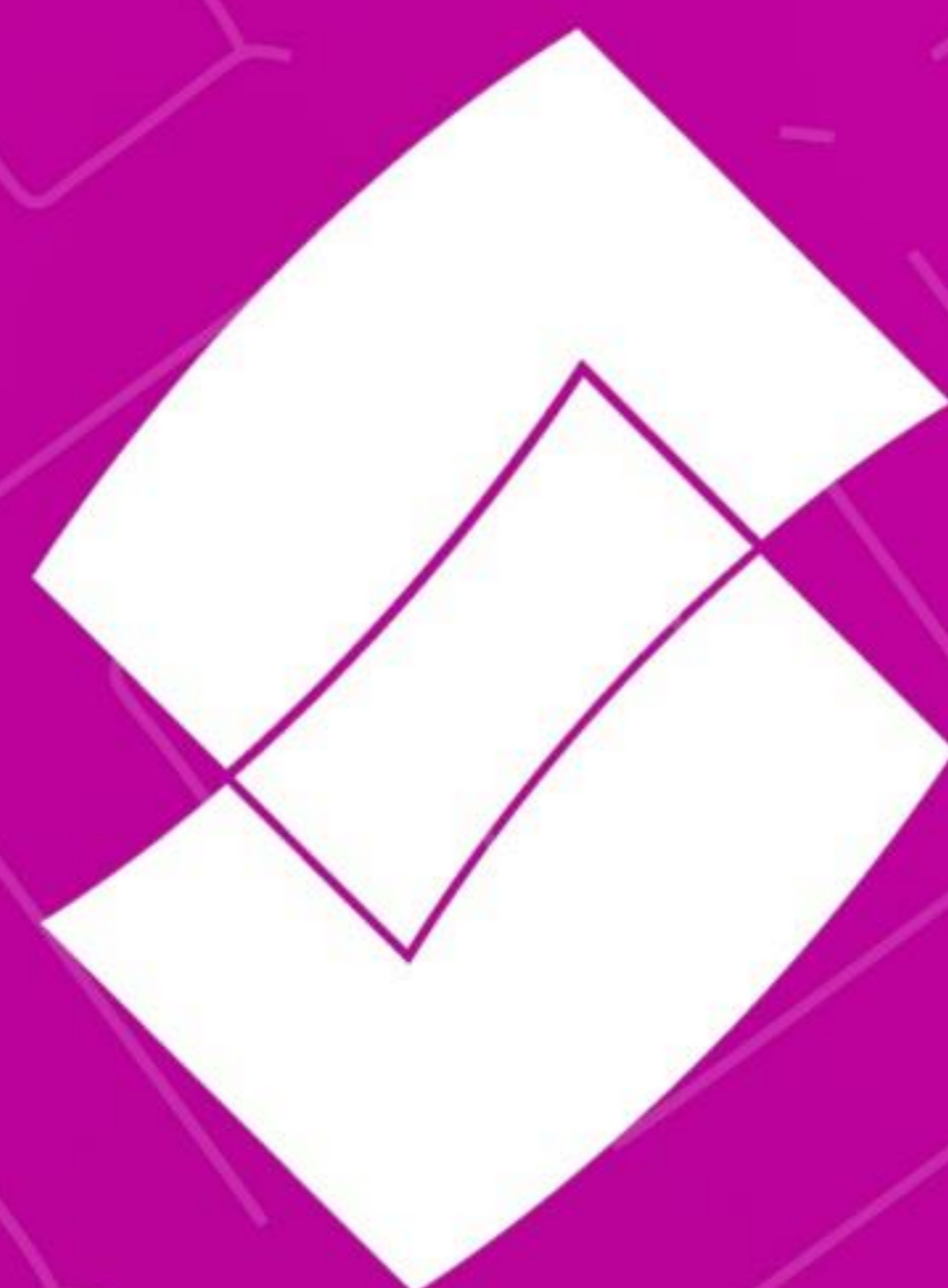
اختیار خرید



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.