

شماره

۳۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

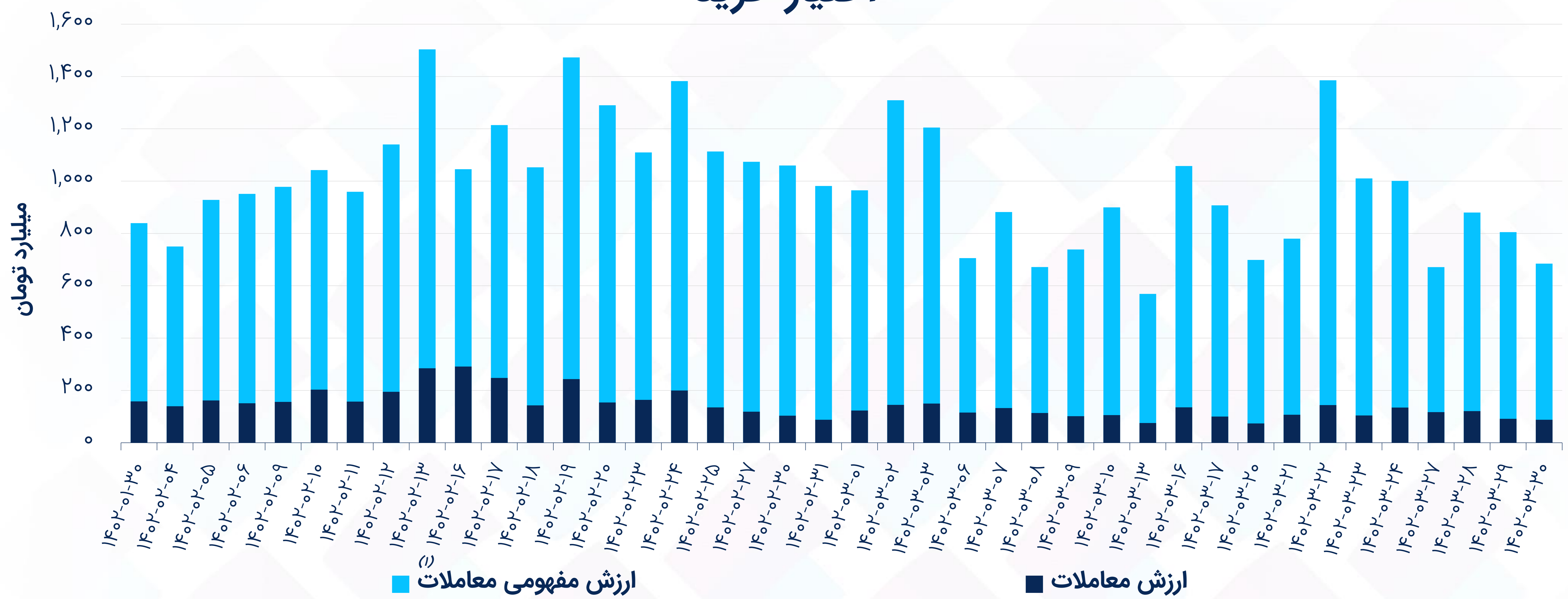




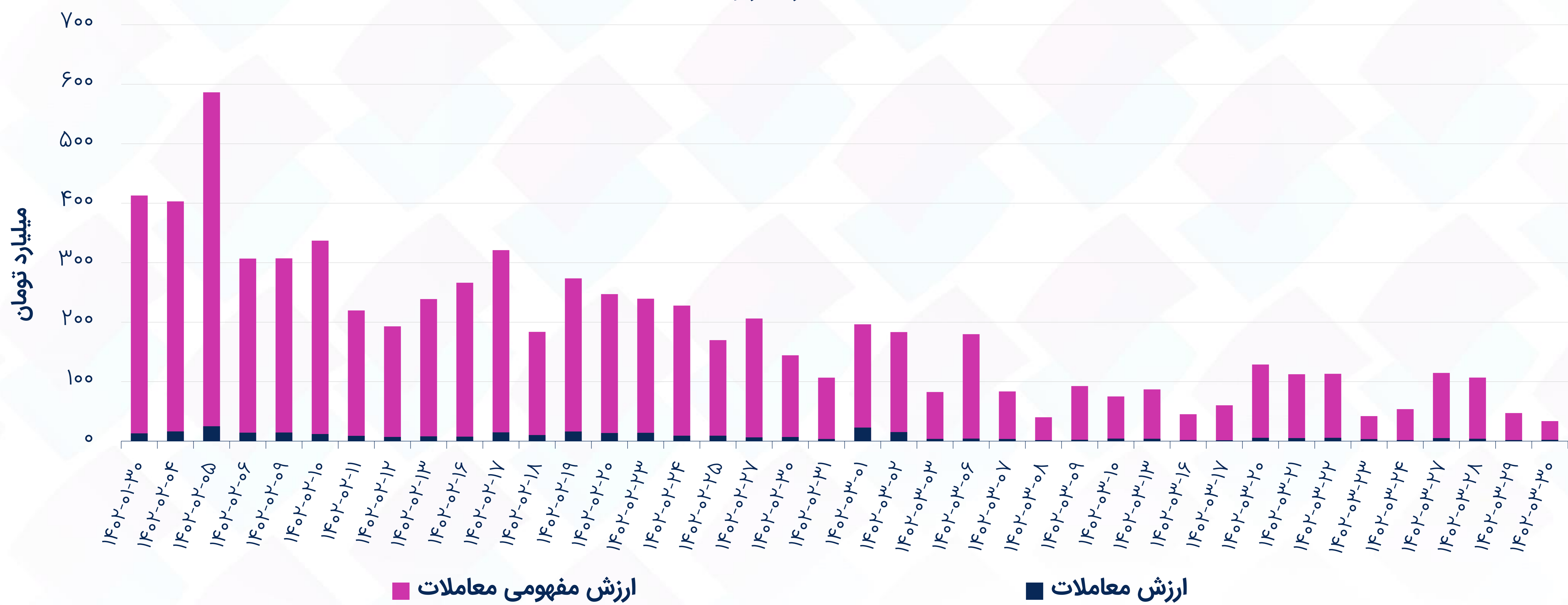
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



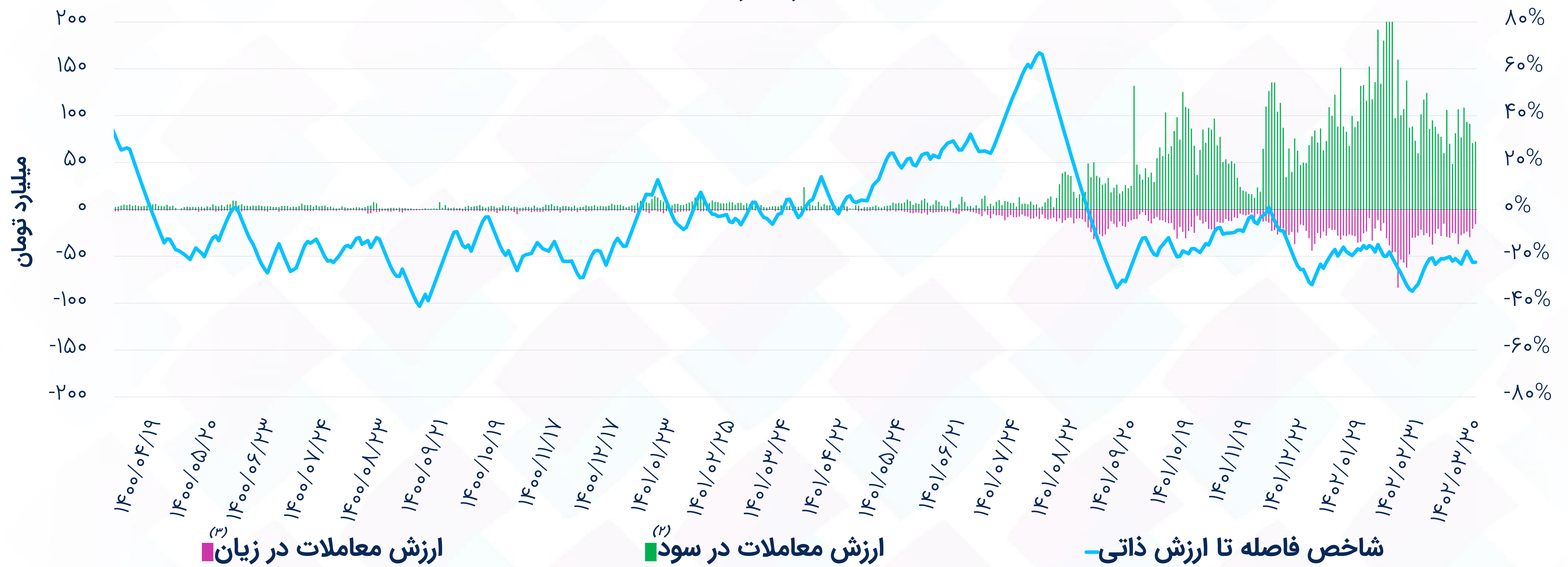
اختیار فروش



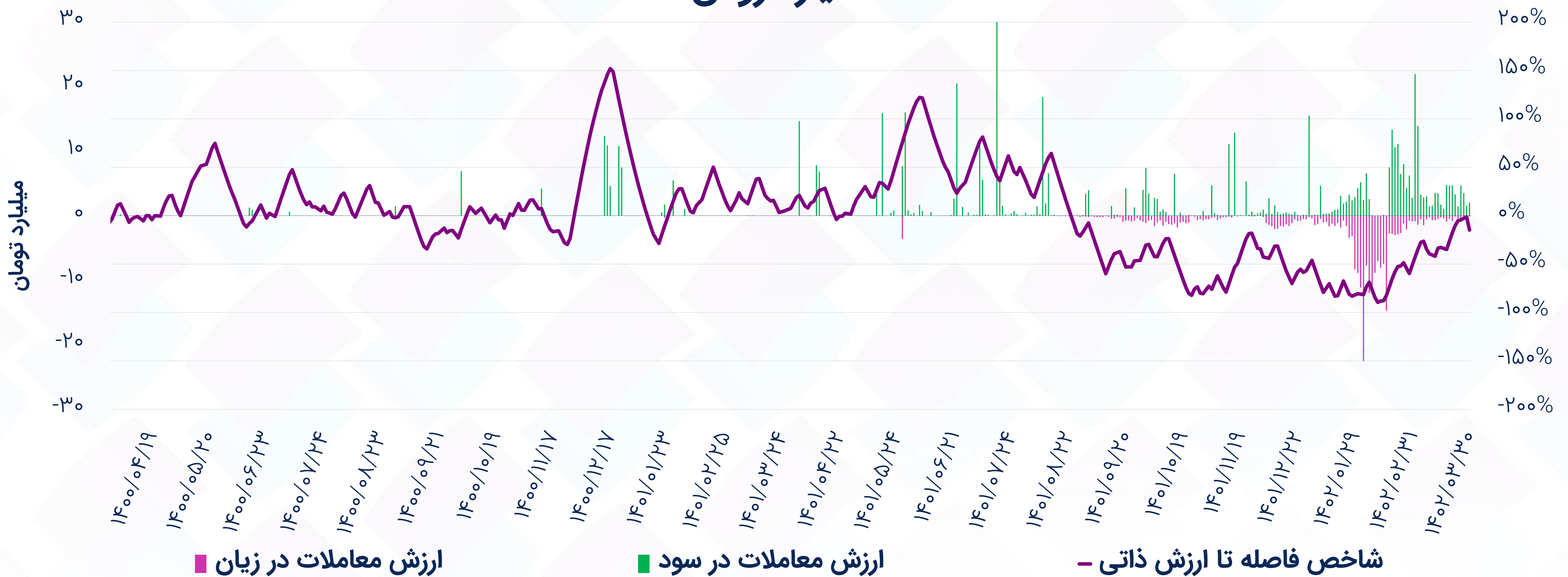
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

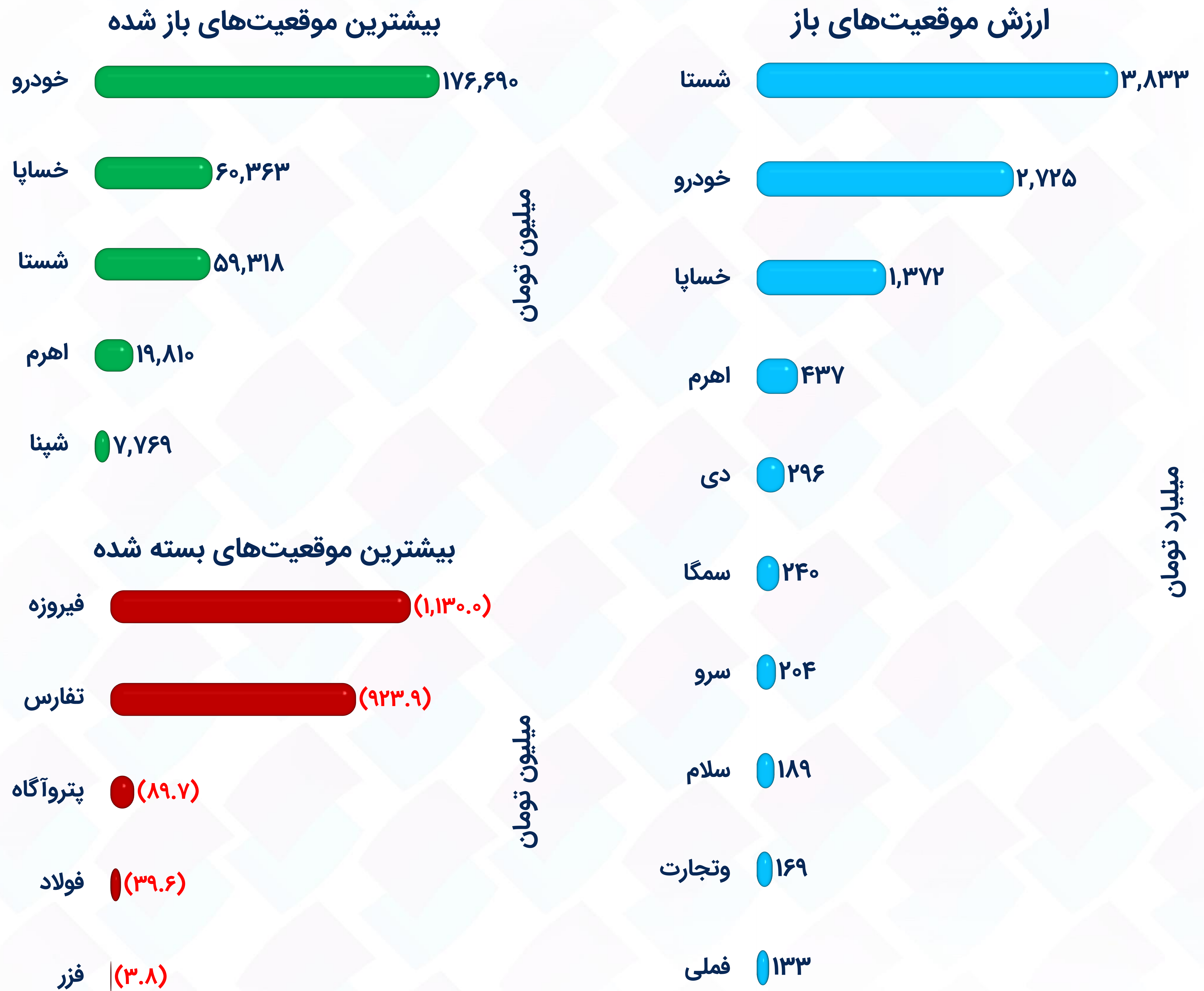
اختیار خرید

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
خودرو	۳۹	۲۵.۰	۳۵۰.۶	۲۱.۲	۳.۸	(۲۹.۰%)
اهرم	۲۰	۲۱.۷	۴۱.۹	۲۰.۶	۱.۱	(۱۳.۴%)
حسابا	۱۸	۱۸.۵	۱۰۰.۱	۱۵.۶	۲.۹	(۱۷.۷%)
شستا	۳۶	۱۱.۲	۱۳۷.۶	۴.۹	۶.۳	(۴۰.۸%)
دی	۱۴	۴.۵	۱۵.۲	۳.۹	۰.۶	(۱۲.۲%)
خپارس	۵	۱.۱	۲.۹	۱.۱	۰.۰	(۱۸.۵%)
شبندر	۵	۱.۰	۶.۹	۰.۹	۰.۱	(۷.۷%)

اختیار فروش

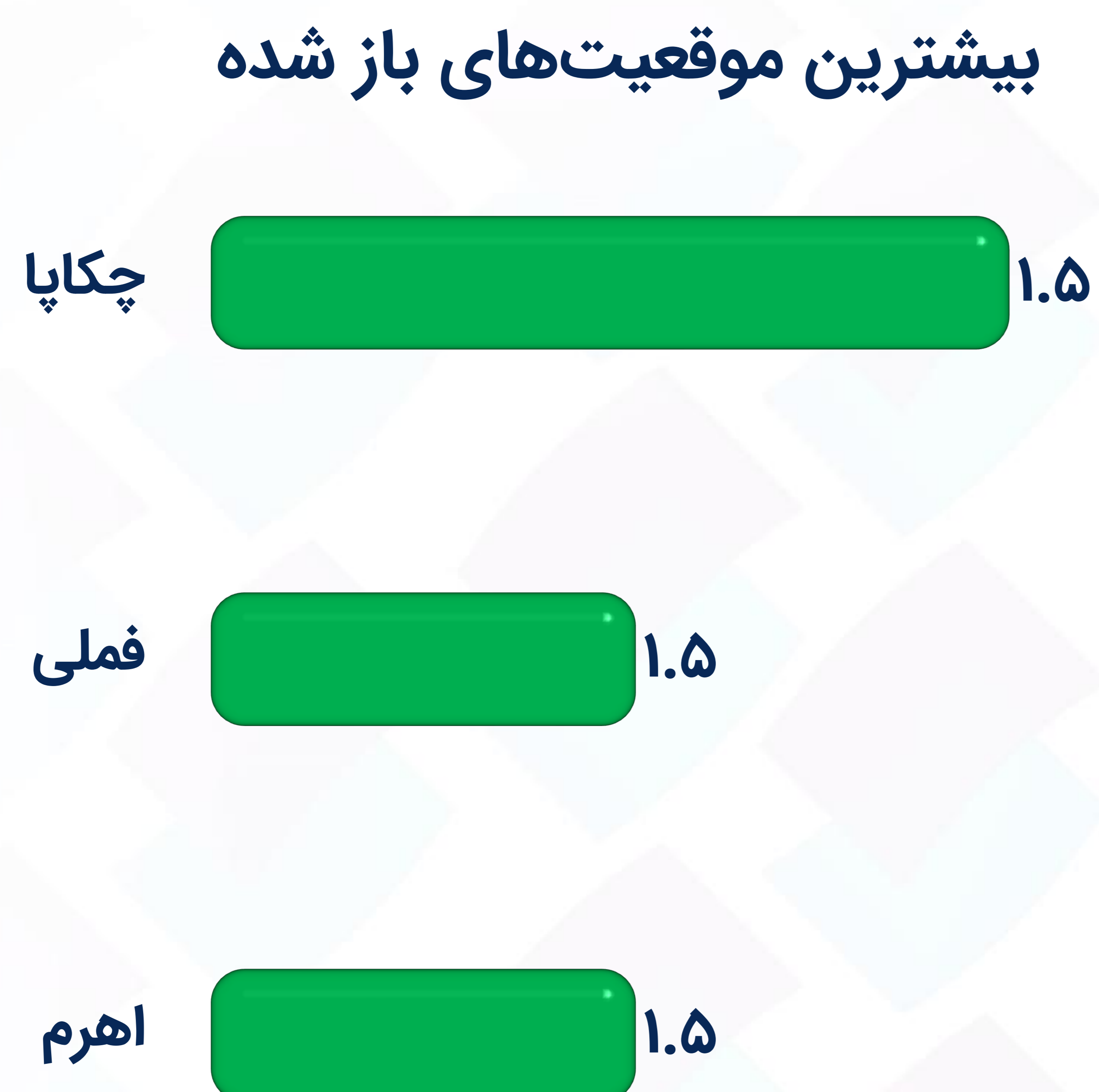
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
شستا	۶	۲,۱۲۸.۹	۳۳,۴۳۳.۷	۲,۰۰۷.۷	۱۲۱.۲	(۱۵.۴%)
فولاد	۲	۲۴.۱	۱۶۶.۲	۲۴.۱	۰.۰	۹.۹%
حافرین	۲	۵.۶	۵۶.۲	۵.۶	۰.۰	۶۳.۲%
اهرم	۲	۲.۱	۳۴.۶	۰.۰	۲.۱	۲۳.۲%
شپنا	۳	۱.۸	۷.۹	۱.۸	۰.۰	(۳.۱%)
خودرو	۱	۰.۷	۱.۶	۰.۷	۰.۰	۲.۵%

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



میلیون تومان



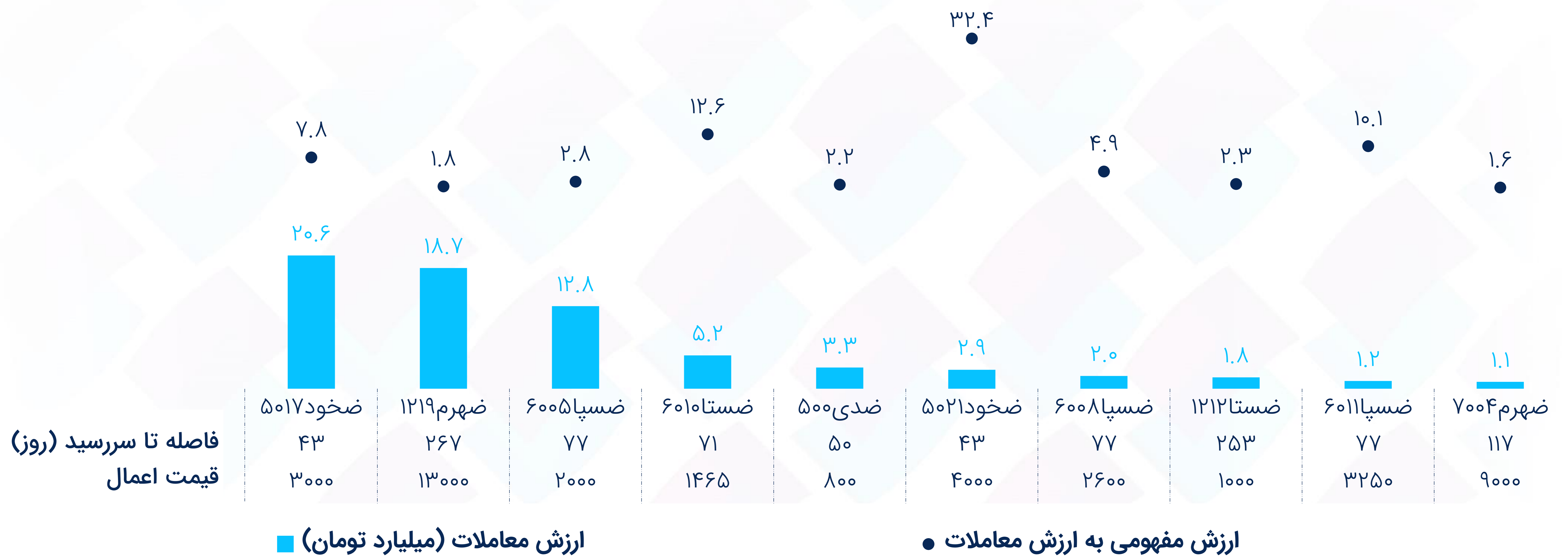
میلیون تومان



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
۱۳۱%	۲,۰۱۰	۰.۷۴	۱۹.۴	۳.۵%	۱۶,۸۷۱	۱۶,۳۰۰	۸۷۱	۱.۳	۱۱۴	۱۶,۰۰۰	ضسلا ۷۰۱
۶۰%	۸۸	۰.۵۶	۶۶.۶	۱.۳%	۳,۶۶۵	۳,۶۱۹	۵۵	۲.۵	۶	۳,۶۱۰	ضچکا ۴۰۰۷
۴۹%	۵۶۶	۱.۰۰	۳.۲	(۱۱.۳%)	۱,۲۳۰	۱,۳۸۷	۳۸۰	۴.۸	۵۱	۸۵۰	ضدی ۵۰۱
۳۷%	۳,۹۱۱	۰.۹۹	۹.۴	(۲.۸%)	۲۶,۸۶۲	۲۷,۶۴۰	۲,۸۶۲	۳۳.۲	۱۶	۲۴,۰۰۰	ضروز ۴۰۰۷
۱۷%	۶۸۵	۰.۷۱	۱۹.۹	۱.۹%	۱۱,۵۸۳	۱۱,۳۷۰	۵۸۳	۲۵.۹	۱۶	۱۱,۰۰۰	ضترو ۴۰۰۵

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	۵۴%	۲,۰۰۱	۱,۲۹۷	۱	۱۴.۹	۱۶	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴,۵۰۱.۰	۴۳%	۴,۵۰۱	۳,۱۴۰	۱	۱.۶	۹	۴,۵۰۰	ضخود ۴۰۳۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۲۴.۵	۷۶%	۵,۵۱۷	۳,۱۴۰	۱۷	۸۴.۷	۴۴	۵,۵۰۰	ضخود ۵۰۲۴
(۹۹%)	۱	۰.۰۰	۱۰۵.۲	۷۳%	۱۵,۱۴۴	۸,۷۴۰	۱۴۴	۸۳.۰	۶۵	۱۵,۰۰۰	ضشنا ۶۰۱۰
(۹۹%)	۱	۰.۰۱	۵۴.۹	۷۸%	۵,۶۰۲	۳,۱۴۰	۱۰۲	۴.۹	۷۲	۵,۵۰۰	ضخود ۶۰۲۲

(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
۶۲.۳%	۵۹۲	-۰.۴۶	۱۲.۲	۲۰%	۴,۴۳۵	۳,۶۹۵	۳۶۵	۵.۲	۳۴۲	۴,۸۰۰	طحافرین ۳۰۹ حافرین
۲۶.۵%	۱,۵۸۱	-۰.۳۲	۱۵.۰	(۸%)	۱۸,۷۵۰	۲۰,۳۳۰	۱,۲۵۰	۲.۰	۱۱۸	۲۰,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۳ اهرم
۱۰.۴%	۹۳۶	-۱.۰۰	۶.۸	۲%	۵,۷۷۷	۵,۶۸۰	۸۴۸	۲۳.۵	۲	۶,۶۲۵	طفلا ۳۰۲۵ فولاد

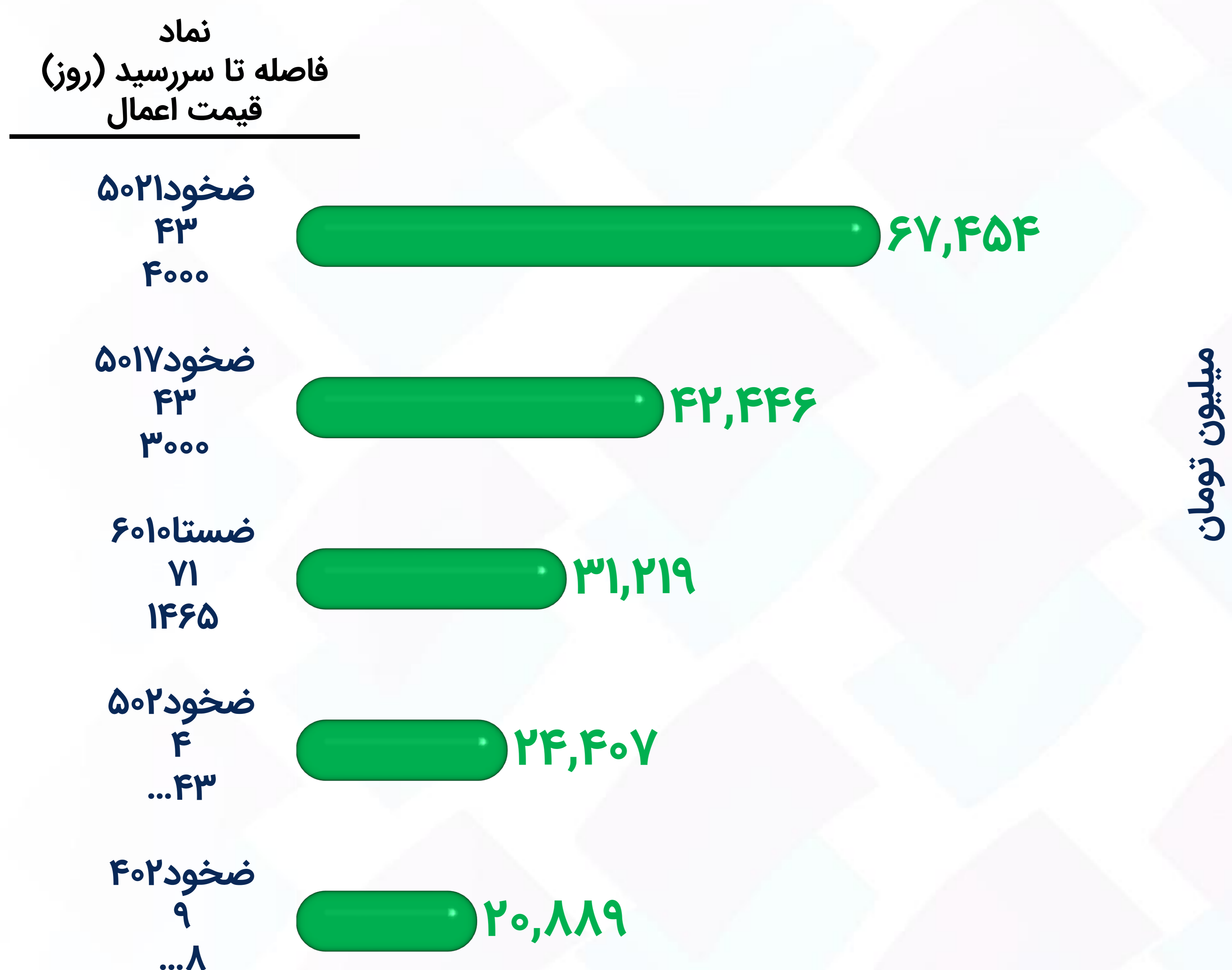
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۱۷۲.۰	(۳۴%)	۸۶۰	۱,۲۹۷	۵	۴۴.۲	۷۲	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴ شستا
(۸۷%)	۳	-۰.۰۴	۴۹.۷	(۲۰%)	۱,۰۴۴	۱,۲۹۷	۲۱	۷۶.۳	۷۲	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶ شستا
(۱۱%)	۱۳۵	-۰.۶۷	۸.۷	۱%	۱,۳۱۴	۱,۲۹۷	۱۵۱	۲,۰۰۷.۵	۷۲	۱,۴۶۵	طستا ۶۰۱۰ 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

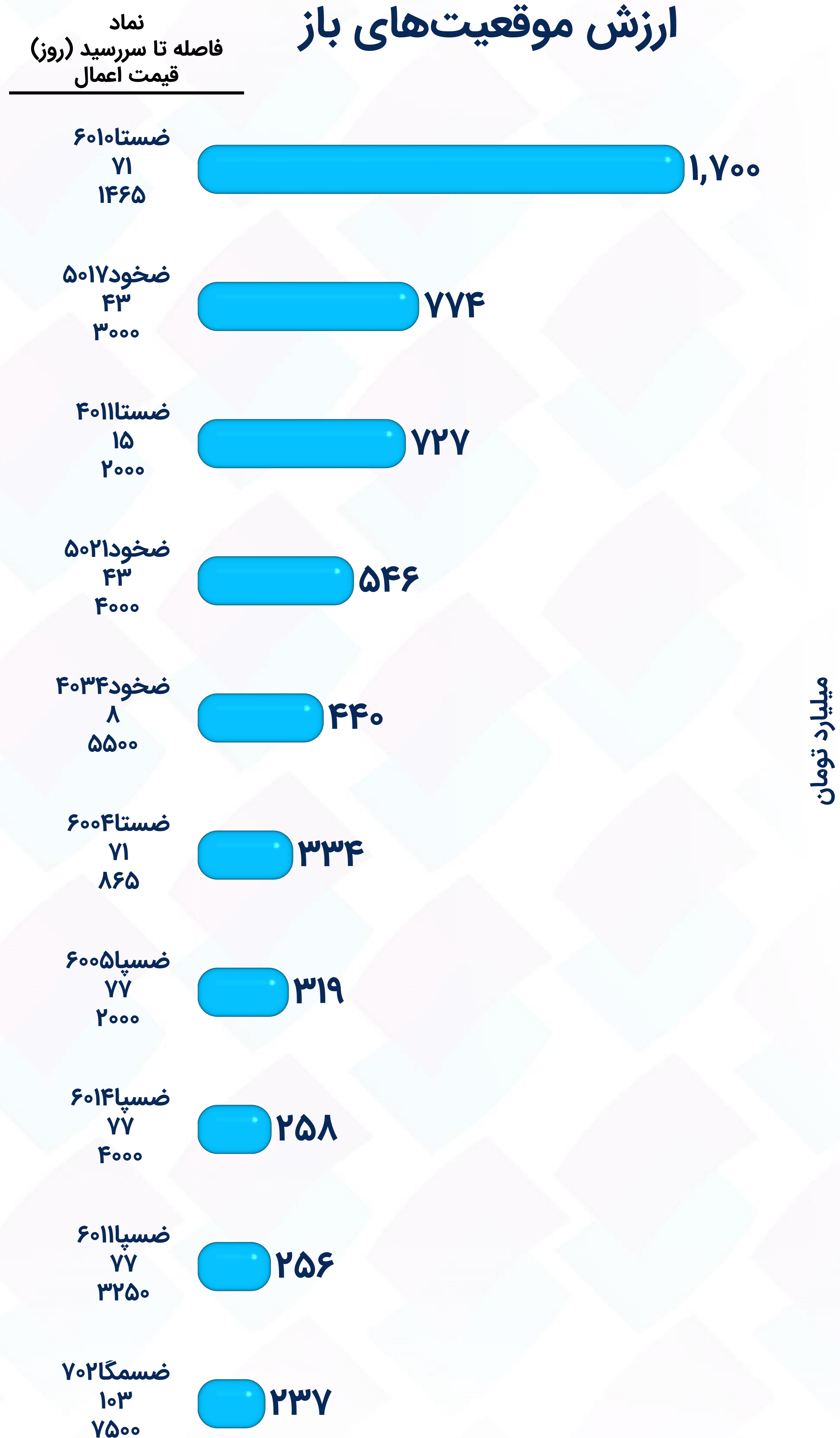
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده

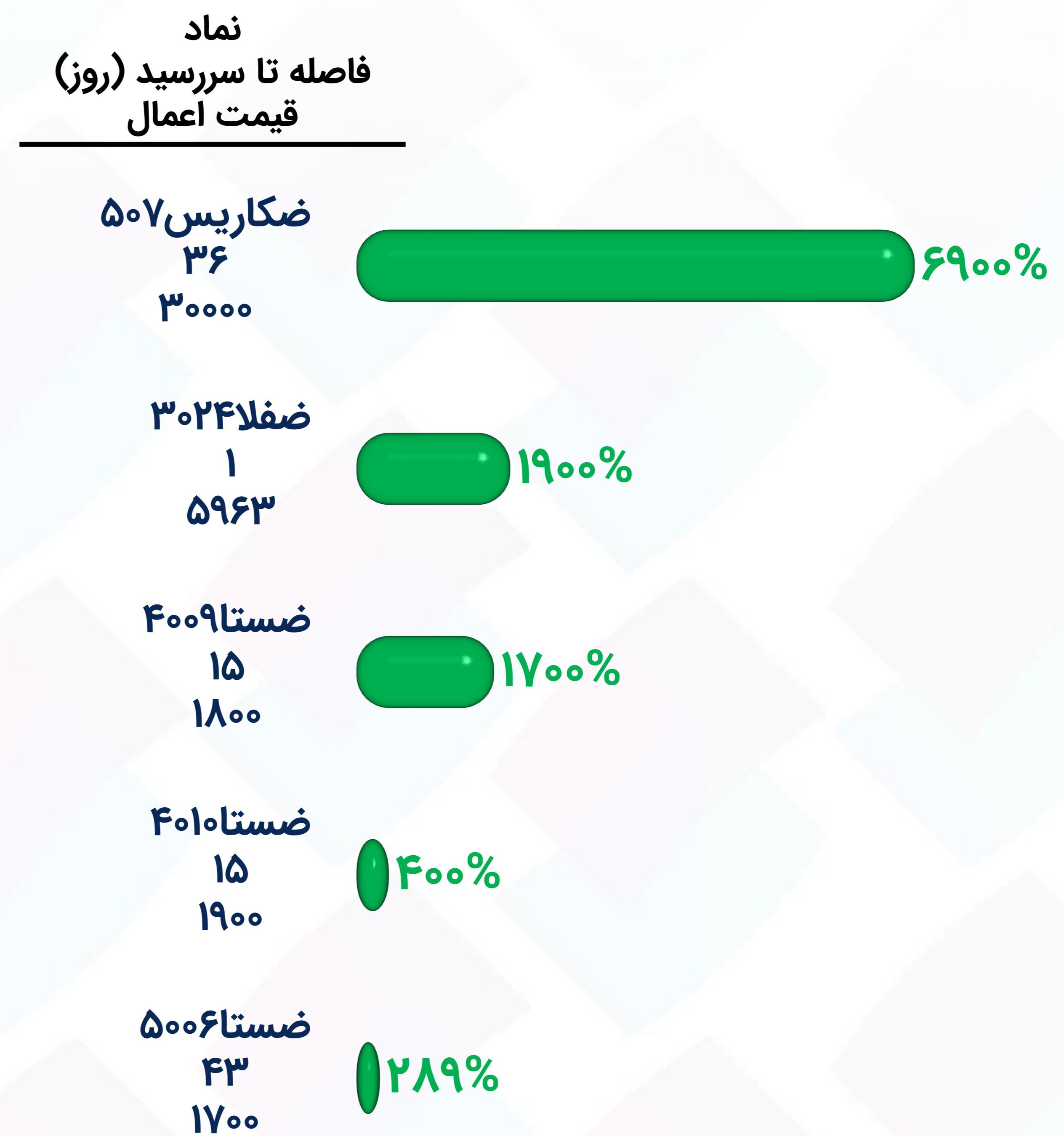
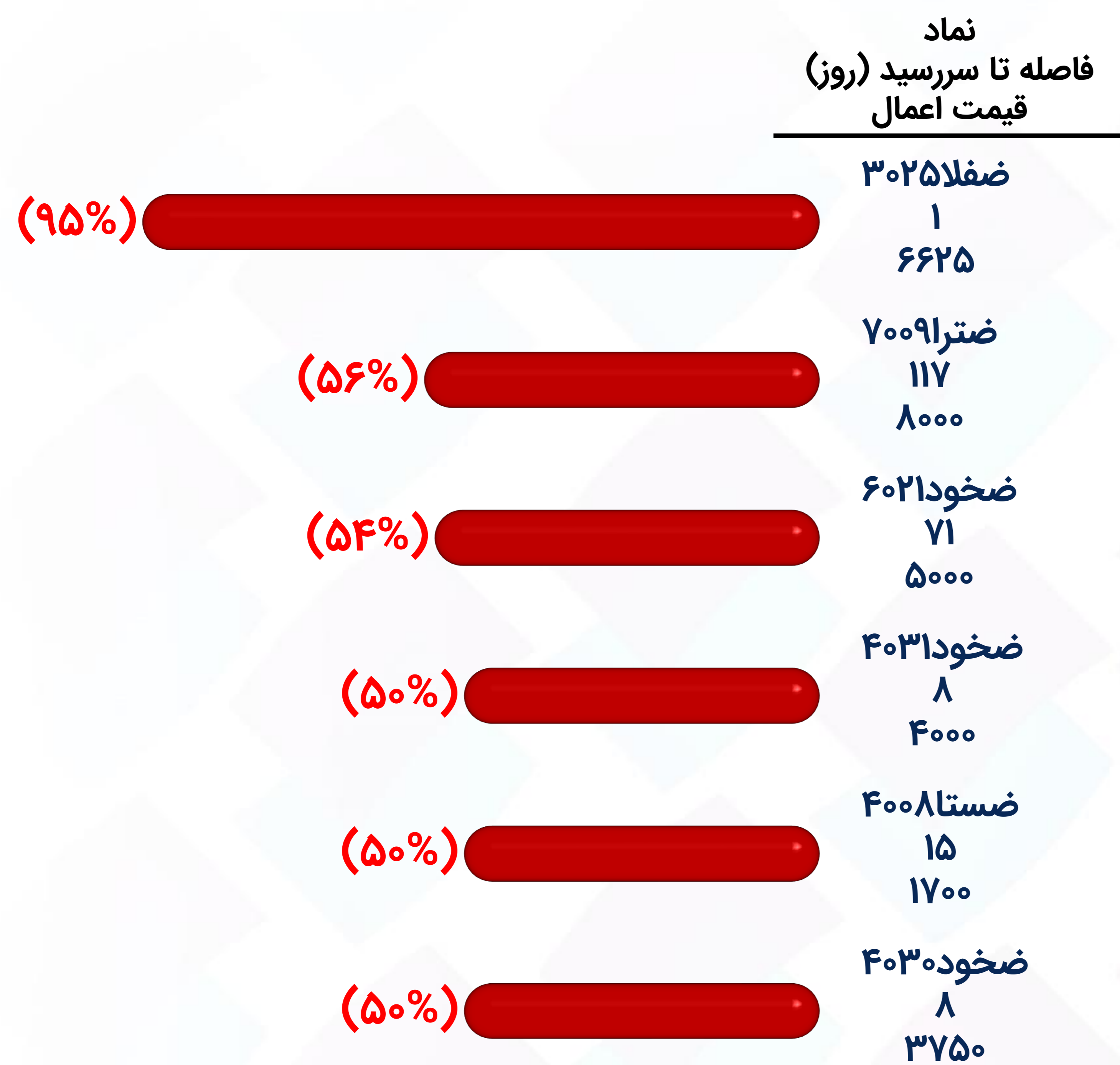


ارزش موقعیت‌های باز

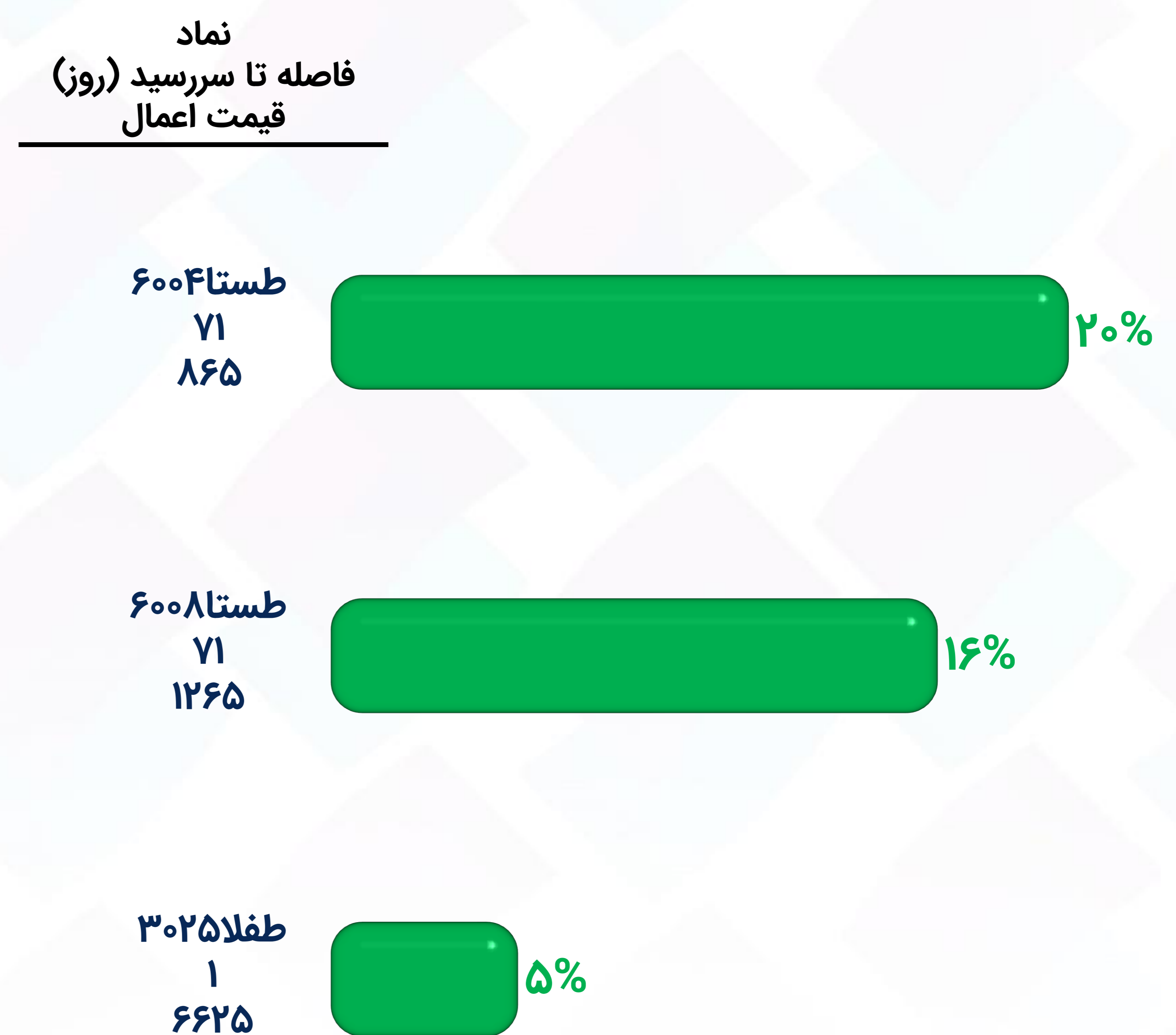
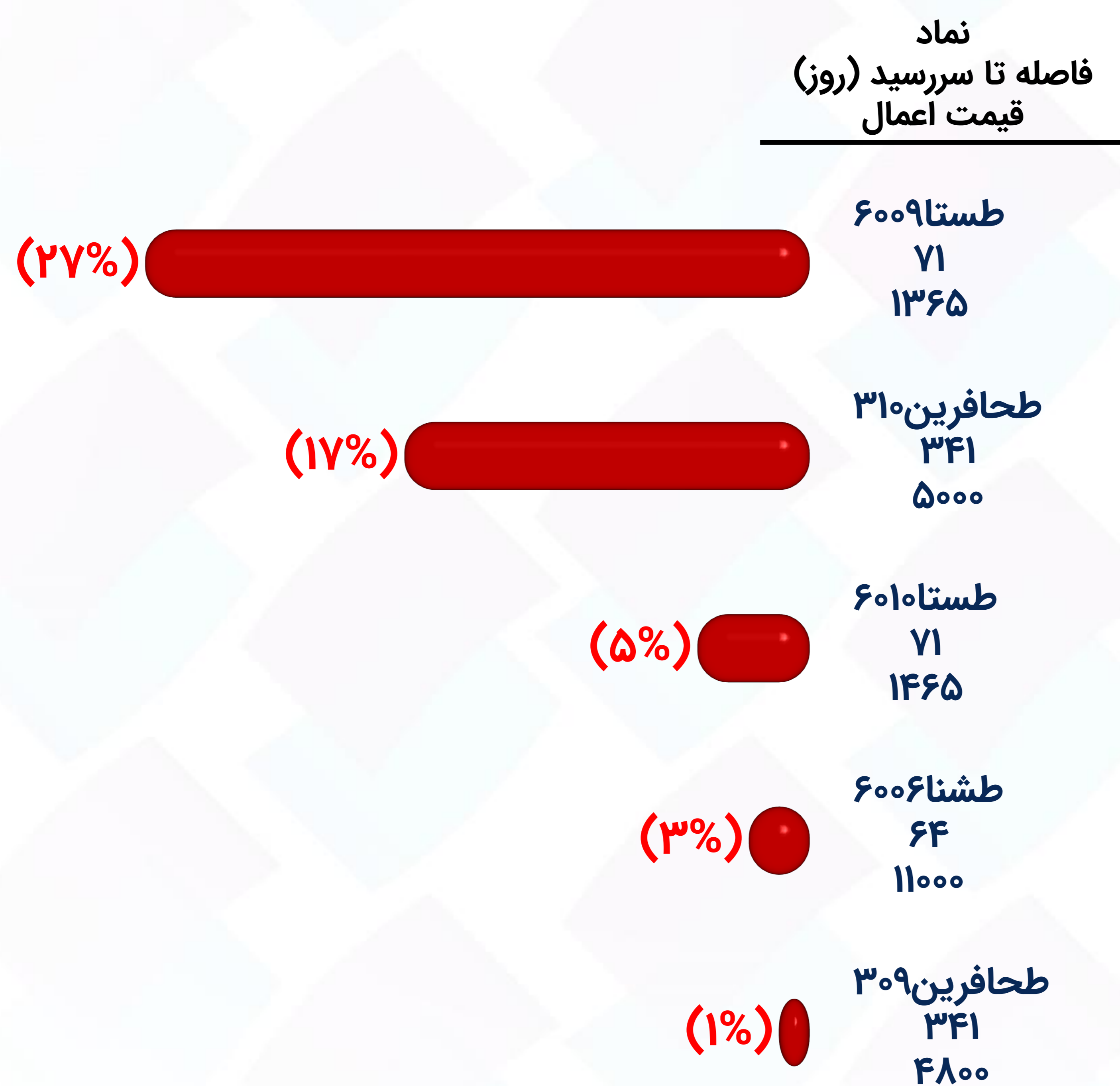


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

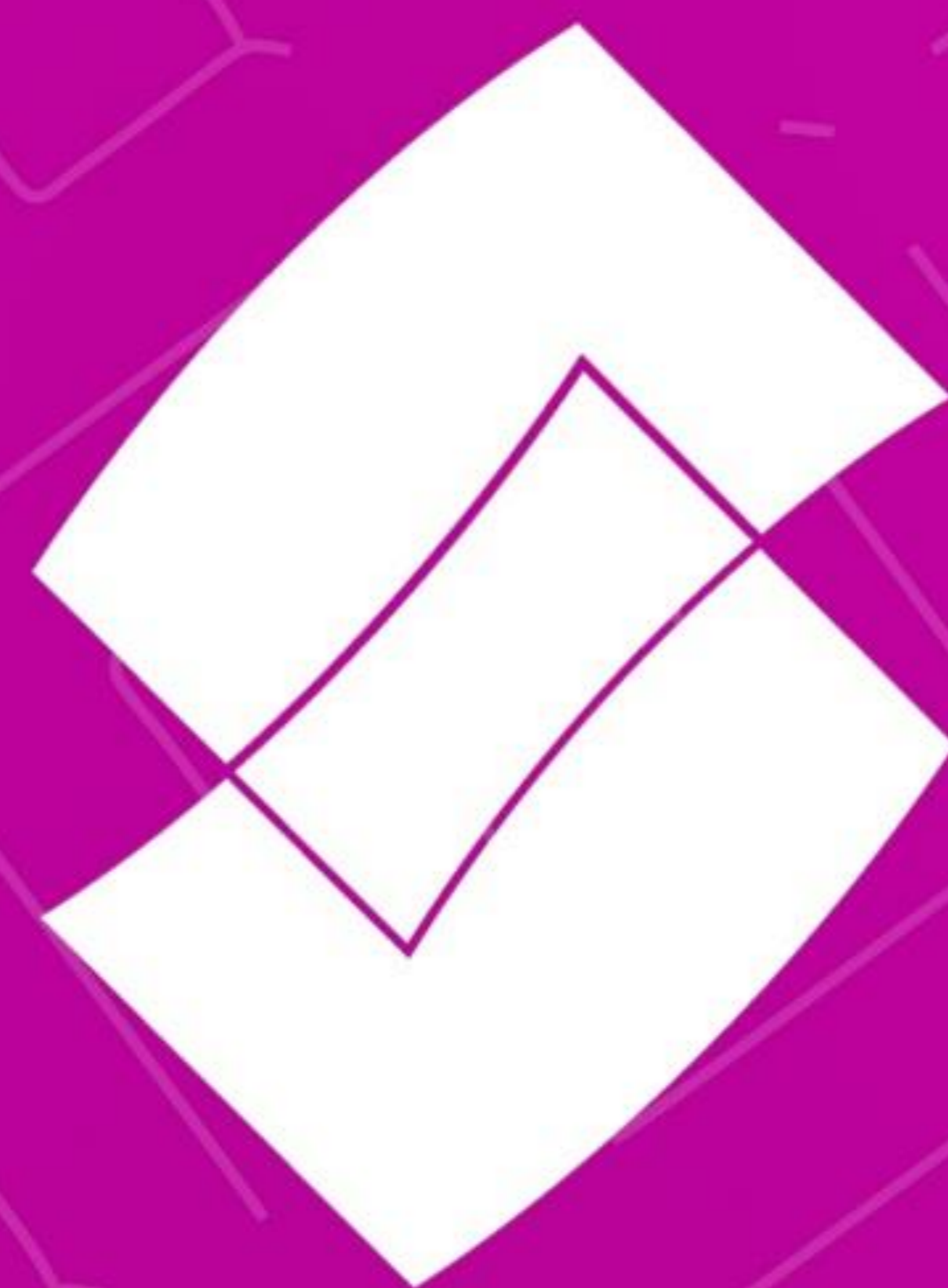
اختیار خرید



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.