

شماره

۳۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۱ خرداد ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

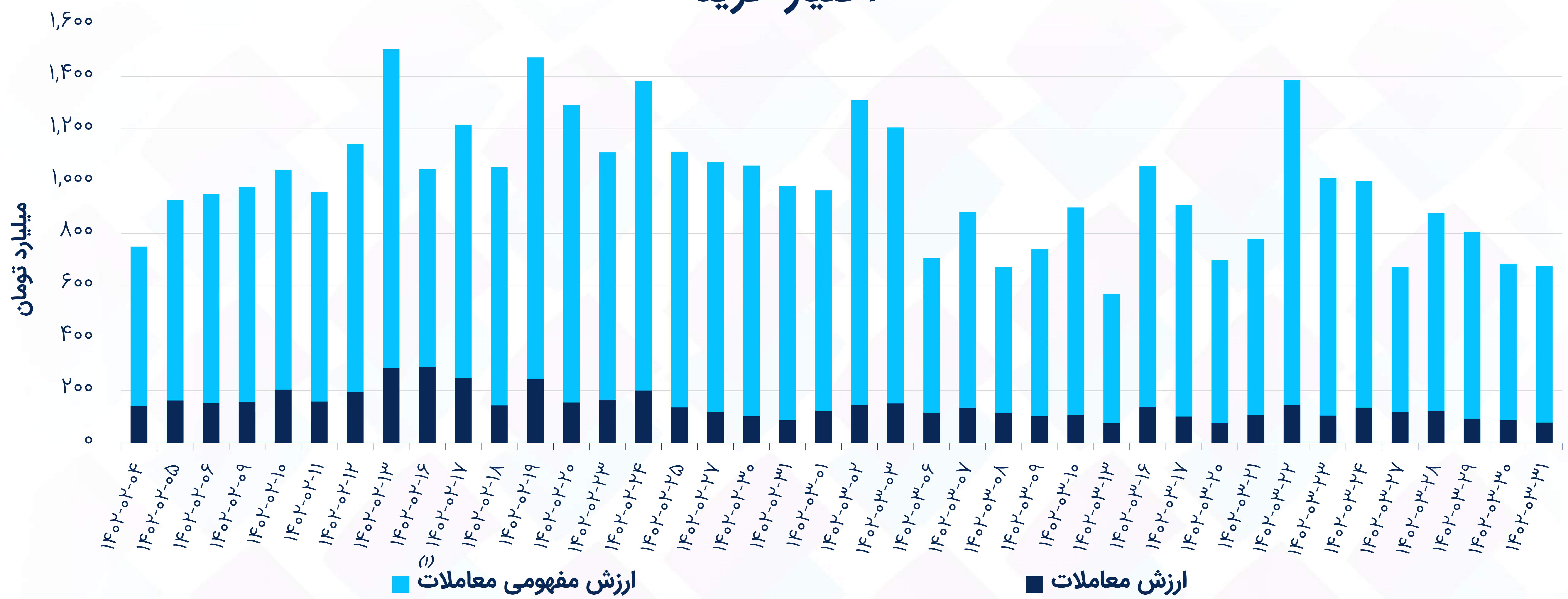




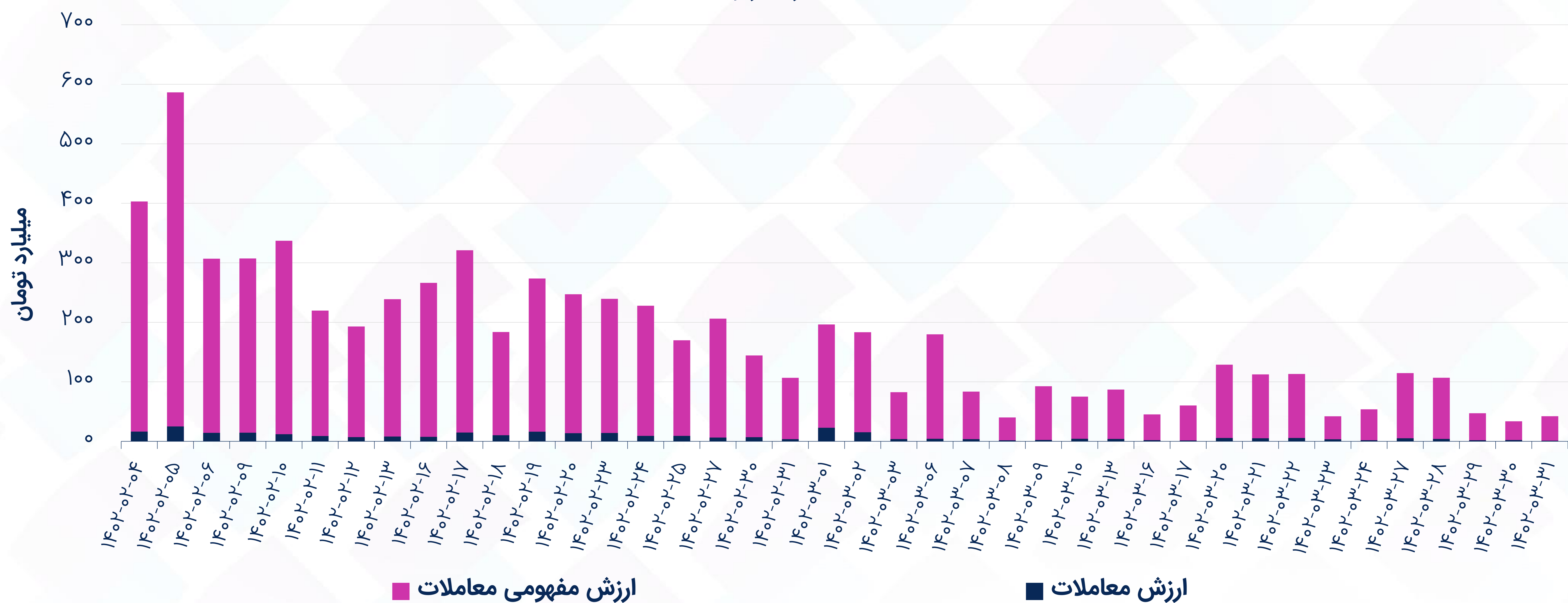
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



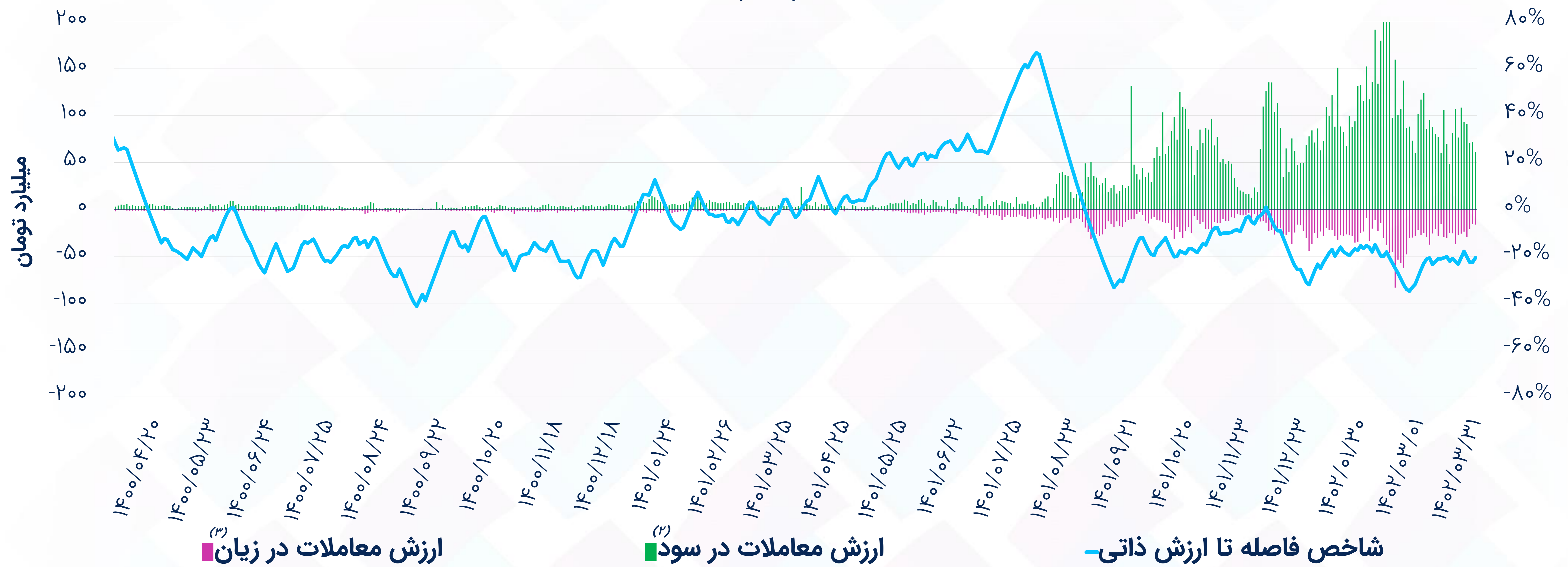
اختیار فروش



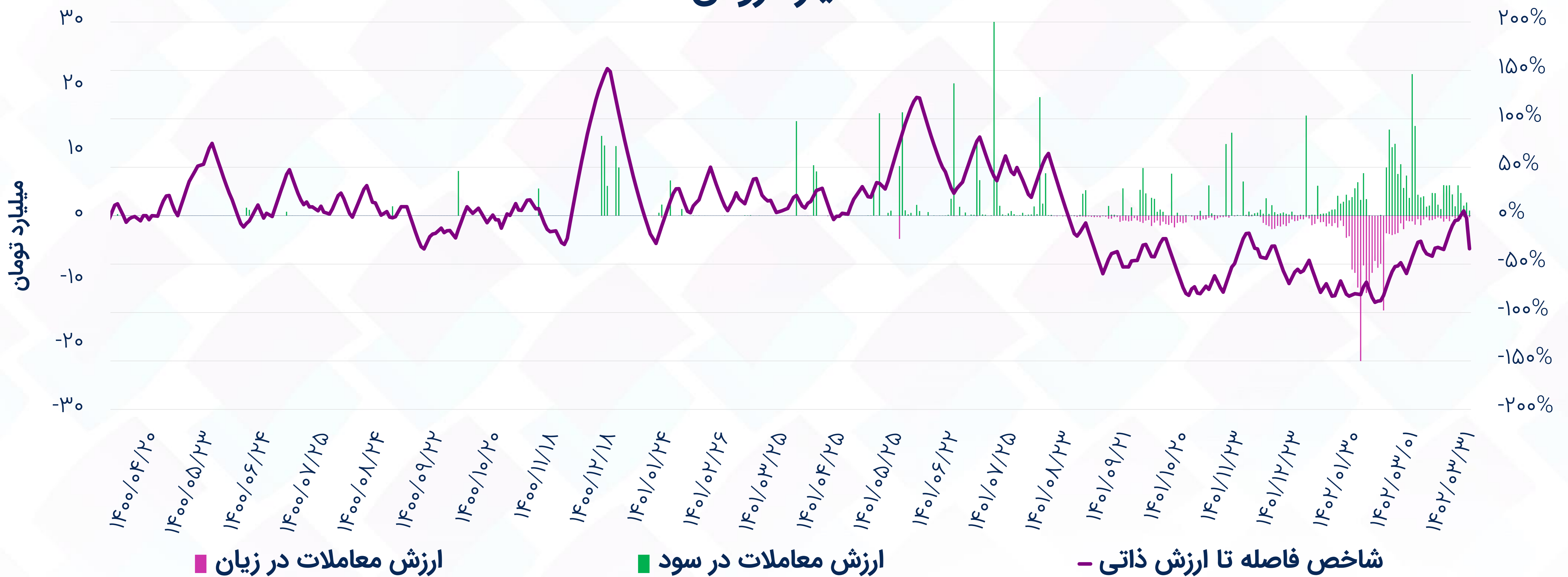
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

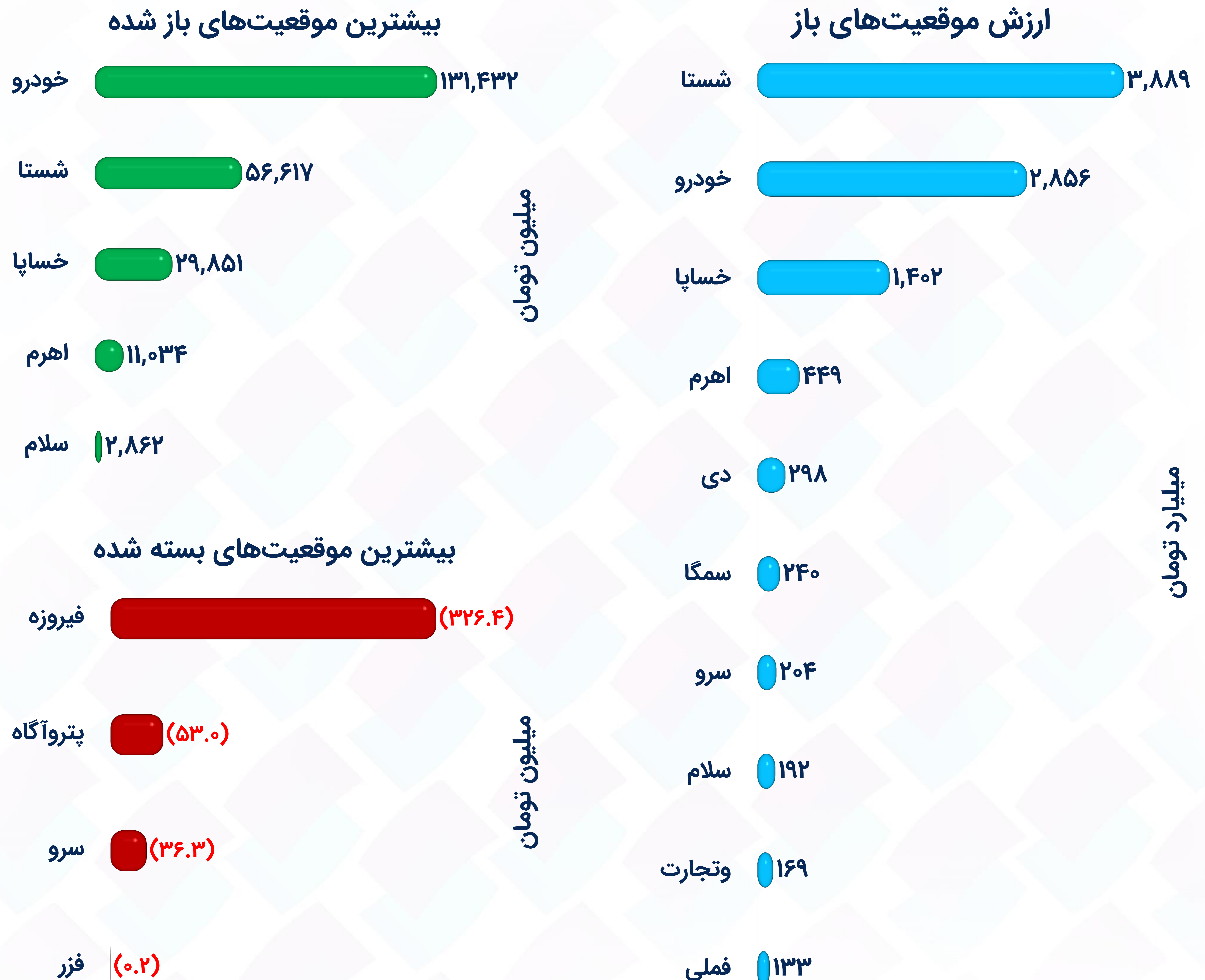
اختیار خرید

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	۳۲	۲۳.۹	۳۶۱.۴	۲۰.۱	۳.۸	(۲۶.۳%)
شستا	۳۱	۱۲.۷	۱۳۵.۶	۶.۳	۶.۵	(۳۵.۳%)
خسپا	۱۶	۱۲.۷	۹۶.۷	۸.۷	۴.۰	(۲۱.۲%)
اهرم	۱۹	۱۱.۰	۲۳.۴	۱۰.۴	۰.۶	(۱۱.۵%)
دی	۱۷	۱۰.۱	۲۷.۷	۹.۳	۰.۸	(۹.۱%)
فولاد	۱۱	۴.۷	۱۶.۵	۴.۷	۰.۰	(۳.۹%)
کرمان	۶	۱.۳	۳.۷	۱.۳	۰.۰	(۶.۹%)

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	۱,۰۱۰.۶	۴۲,۰۴۲.۹	۷۷۰.۰	۲۴۰.۶	(۳۵.۰%)
فولاد	۲	۱۹.۸	۱۴۷.۷	۱۹.۸	۰.۰	۱۱.۸%
فملی	۱	۲.۱	۲۴.۱	۲.۱	۰.۰	(۲۸.۰%)
حسیر	۱	۱.۹	۳.۰	۰.۰	۱.۹	(۹۲.۷%)
حافرین	۱	۰.۶	۳.۷	۰.۶	۰.۰	(۱.۳%)
شپنا	۱	۰.۲	۱.۸	۰.۲	۰.۰	۵.۸%

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 ۲,۵۲۵

توسن ۴۶۵

سمگا ۲۲۴

حسیر ۱۳۱

های وب ۱۰۱

حافرین ۴۰

حریل ۱۹

کارا ۱۷

سلام ۳

اهرم ۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده

شستا ۱۵,۳۳۳.۹

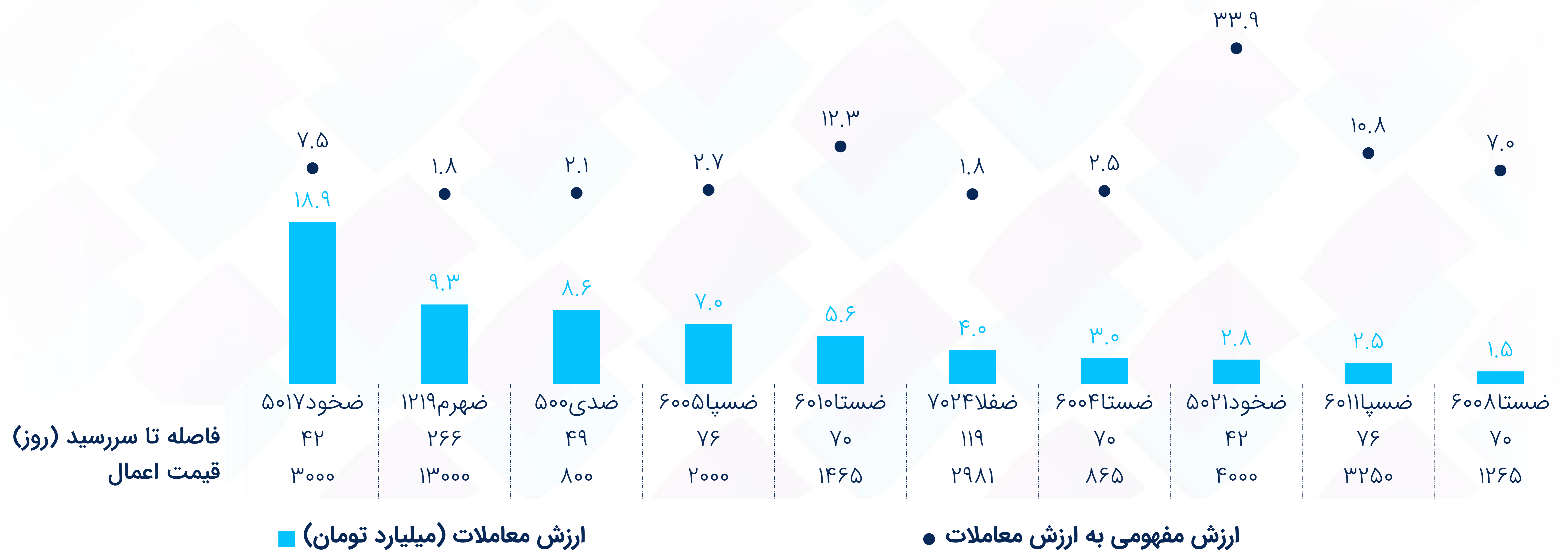
فملی ۲۵.۳

حسیر ۲.۸

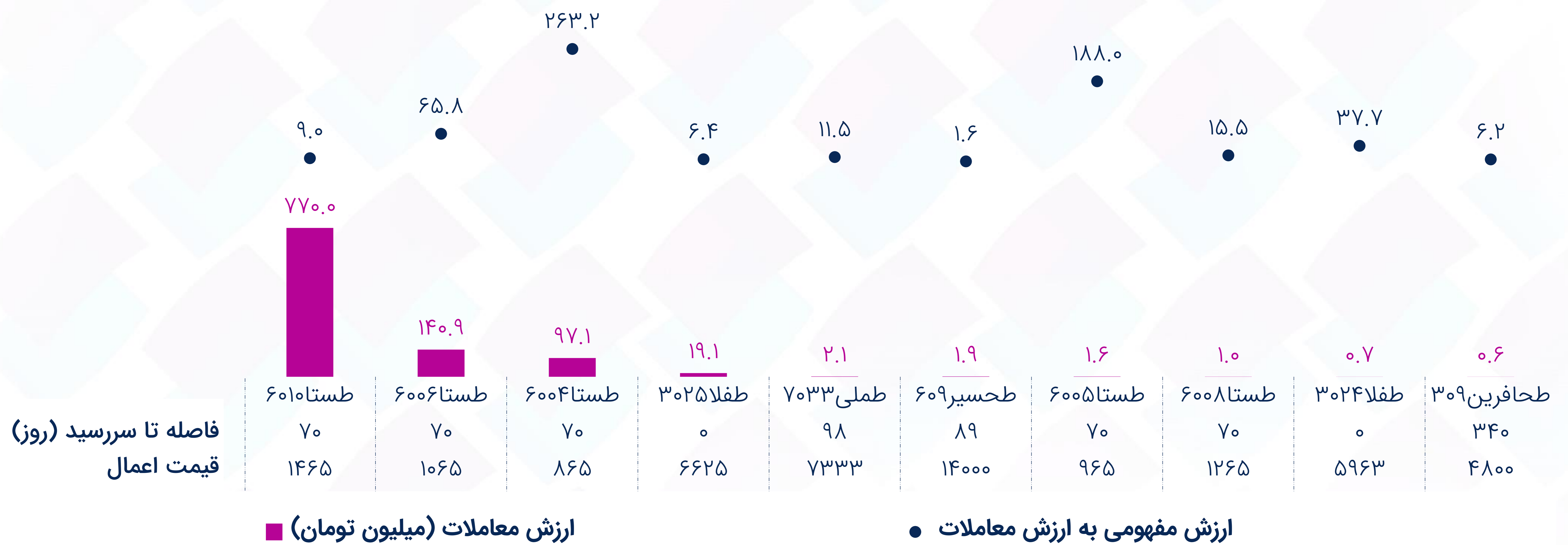
میلیون تومان

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
۱۳۶%	۲۱	۰.۲۲	۴۲۹.۹	۴.۶%	۳,۸۶۹	۳,۷۰۰	۹	۲.۳	۵	۳,۸۶۰	چکاپا ۴۰۰۸
۱۰۰%	۲,۰۱۱	۰.۹۷	۶.۳	(۹.۲%)	۶,۳۴۰	۶,۹۸۰	۱,۰۰۷	۱۵۱.۶	۹۹	۵,۳۳۳	ضملی ۷۰۳۰
۴۸%	۲,۳۰۶	۱.۰۰	۳.۳	(۸.۲%)	۵,۱۹۷	۵,۶۶۰	۱,۵۵۳	۲۳۵.۱	۱۲۰	۳,۶۴۴	ضفلا ۷۰۲۶
۳۴%	۱۳۳	۰.۷۳	۳۷.۵	۰.۲%	۳,۷۰۹	۳,۷۰۰	۹۹	۱۵.۹	۵	۳,۶۱۰	ضچکا ۴۰۰۷
۳۳%	۱۳,۷۷۰	۱.۰۰	۱.۷	(۱۳.۸%)	۱۷,۸۳۰	۲۰,۶۹۰	۱۰,۳۳۰	۱.۰	۱۱۷	۷,۵۰۰	ضهرم ۷۰۰۲

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	۵۲%	۲,۰۰۱	۱,۳۱۶	۱	۱۴.۳	۱۵	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۹۰۱.۰	۴۴%	۱,۹۰۱	۱,۳۱۶	۱	۱.۴	۱۵	۱,۹۰۰	ضستا ۴۰۱۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴,۵۰۱.۰	۴۱%	۴,۵۰۱	۳,۱۸۶	۱	۴.۲	۸	۴,۵۰۰	ضخود ۴۰۳۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۷۰۱.۰	۲۹%	۱,۷۰۱	۱,۳۱۶	۱	۳.۰	۱۵	۱,۷۰۰	ضستا ۴۰۰۸
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴۵۹.۳	۷۳%	۵,۵۱۲	۳,۱۸۶	۱۲	۲۵.۰	۴۳	۵,۵۰۰	ضخود ۵۰۲۴

(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
۸.۶%	۹۶۰	-۱.۰۰	۶.۵	۱%	۵,۷۴۱	۵,۶۶۰	۸۸۴	۱۹.۱	۱	۶,۶۲۵	۳۰۲۵ پفلا
(۱۶.۷%)	۱۲۲	-۰.۶۳	۹.۰	۰%	۱,۳۱۸	۱,۳۱۶	۱۴۷	۷۷۰.۰	۷۱	۱,۴۶۵	۶۰۱۰ طستا
(۲۸.۰%)	۴۳۷	-۰.۴۲	۱۱.۱	(۴%)	۶,۷۲۶	۶,۹۸۰	۶۰۷	۲.۱	۹۹	۷,۳۳۳	۷۰۳۳ طملی

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	۱۷۲.۰	(۳۵%)	۸۶۰	۱,۳۱۶	۵	۹۷.۱	۷۱	۸۶۵	۶۰۰۴ طستا
(۹۶%)	۰	۰.۰۰	۱۳۶.۹	(۲۷%)	۹۵۸	۱,۳۱۶	۷	۱.۶	۷۱	۹۶۵	۶۰۰۵ طستا
(۹۳%)	۷۰۰	-۰.۲۶	۰.۵	(۷۰%)	۴,۴۲۶	۱۴,۹۷۰	۹,۵۷۴	۱.۹	۹۰	۱۴,۰۰۰	۶۰۹۹ طحسیر
(۸۹%)	۲	-۰.۰۳	۵۲.۳	(۲۱%)	۱,۰۴۵	۱,۳۱۶	۲۰	۱۴۰.۹	۷۱	۱,۰۶۵	۶۰۰۶ طستا
(۶۶%)	۲۹	-۰.۲۴	۱۳.۹	(۱۰%)	۱,۱۸۰	۱,۳۱۶	۸۵	۱.۰	۷۱	۱,۲۶۵	۶۰۰۸ طستا

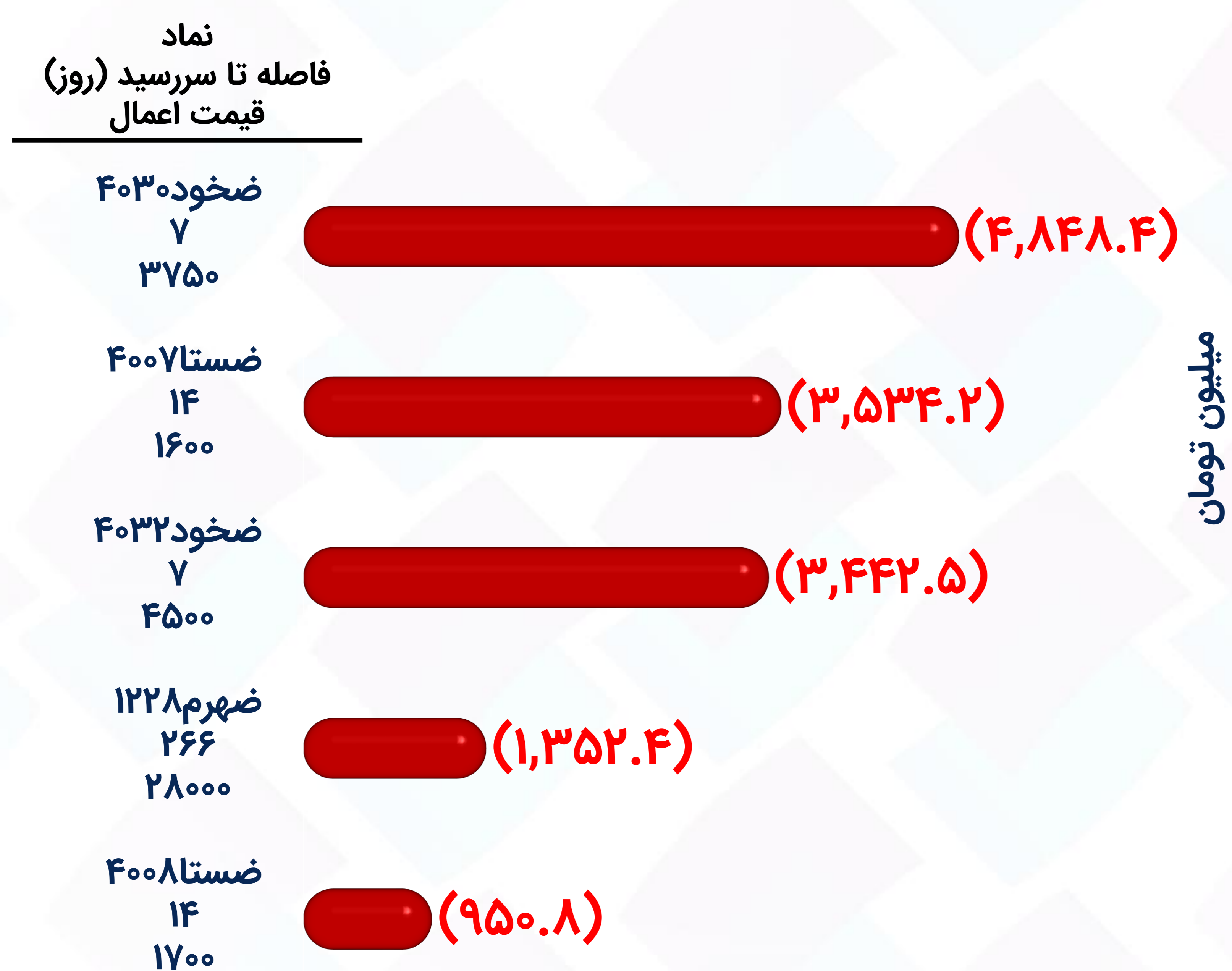
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

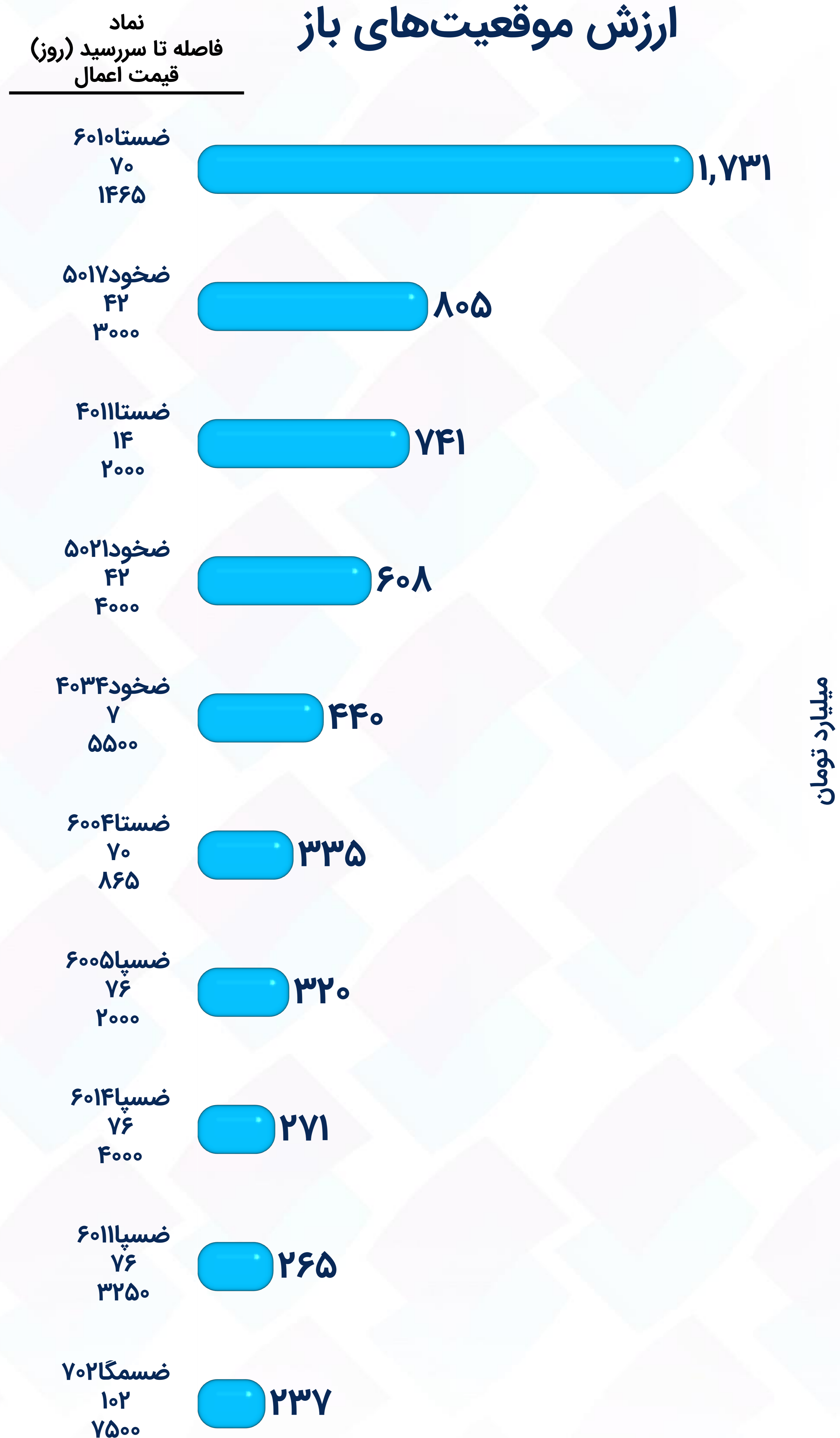
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



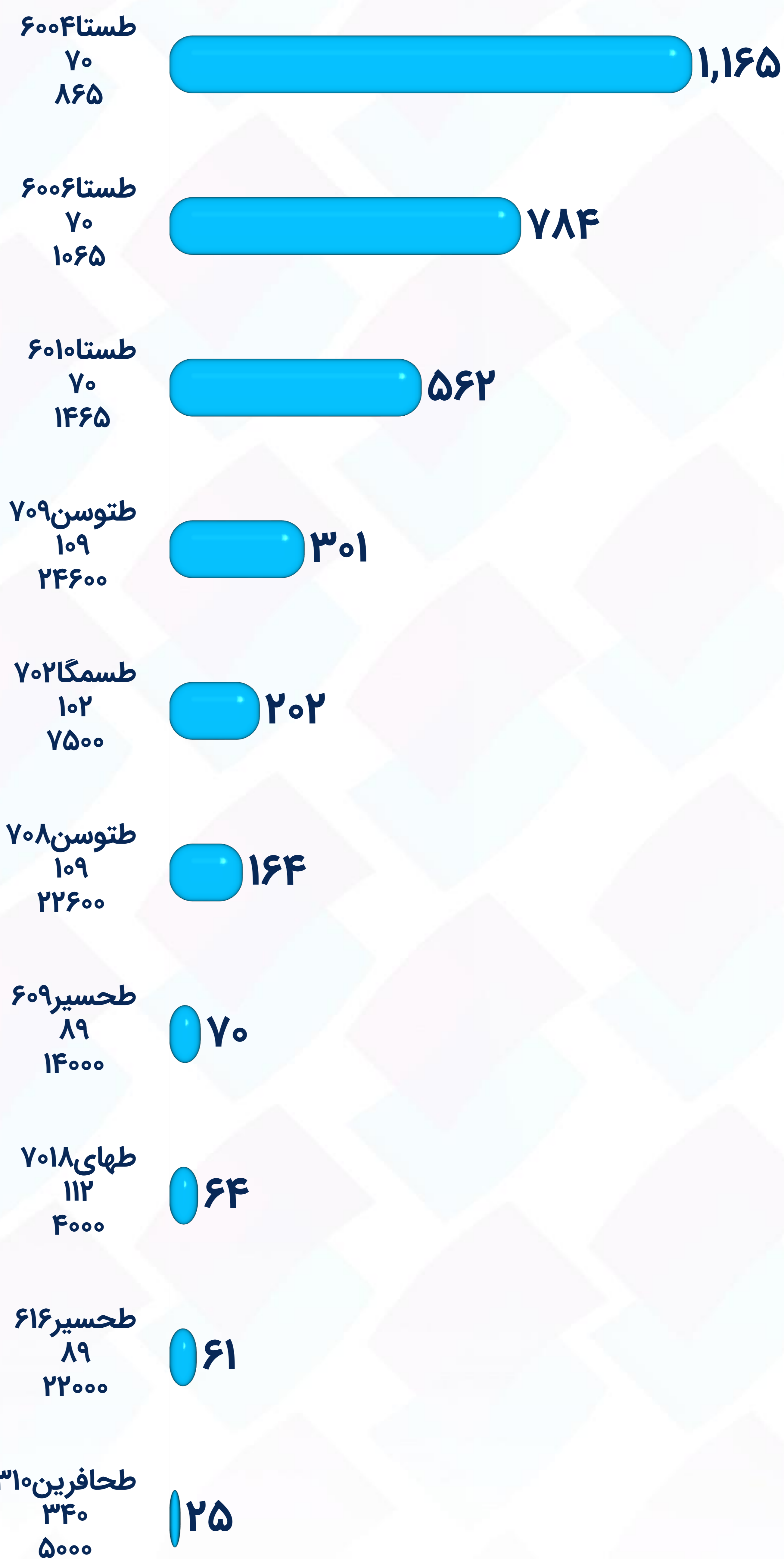
ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال



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