

شماره
۳۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ تیر ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

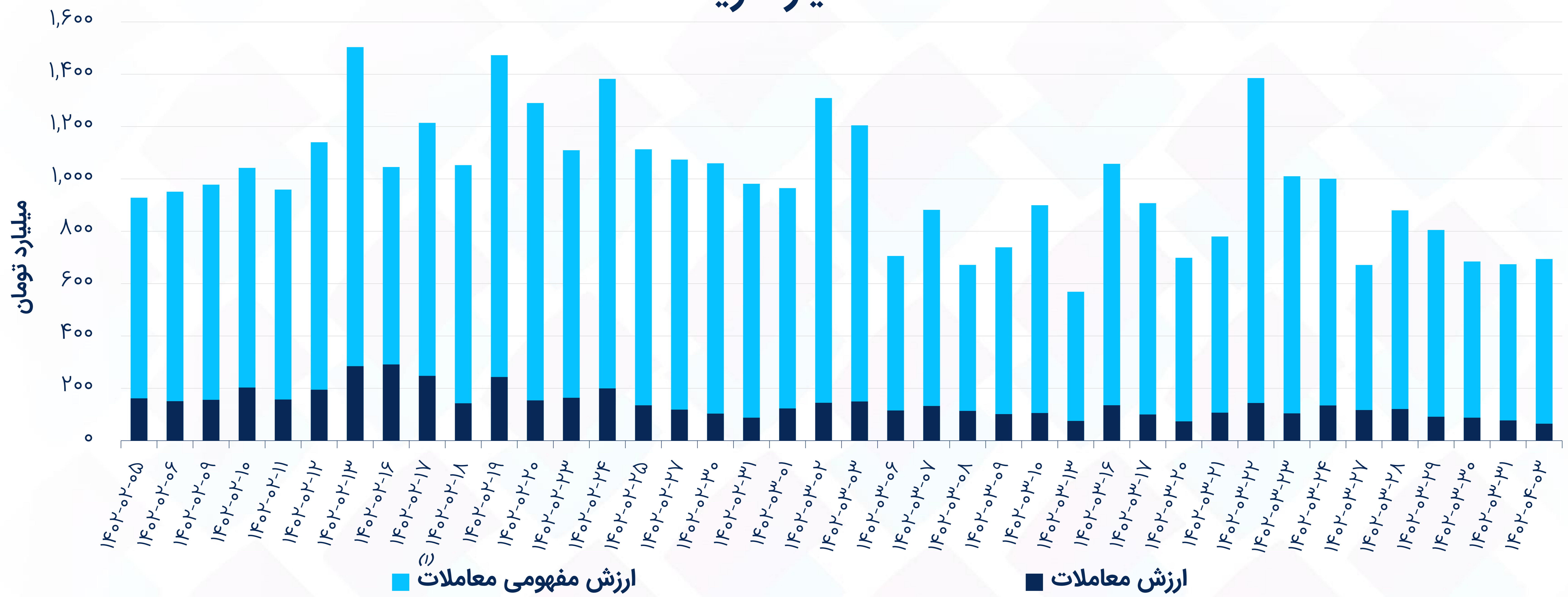




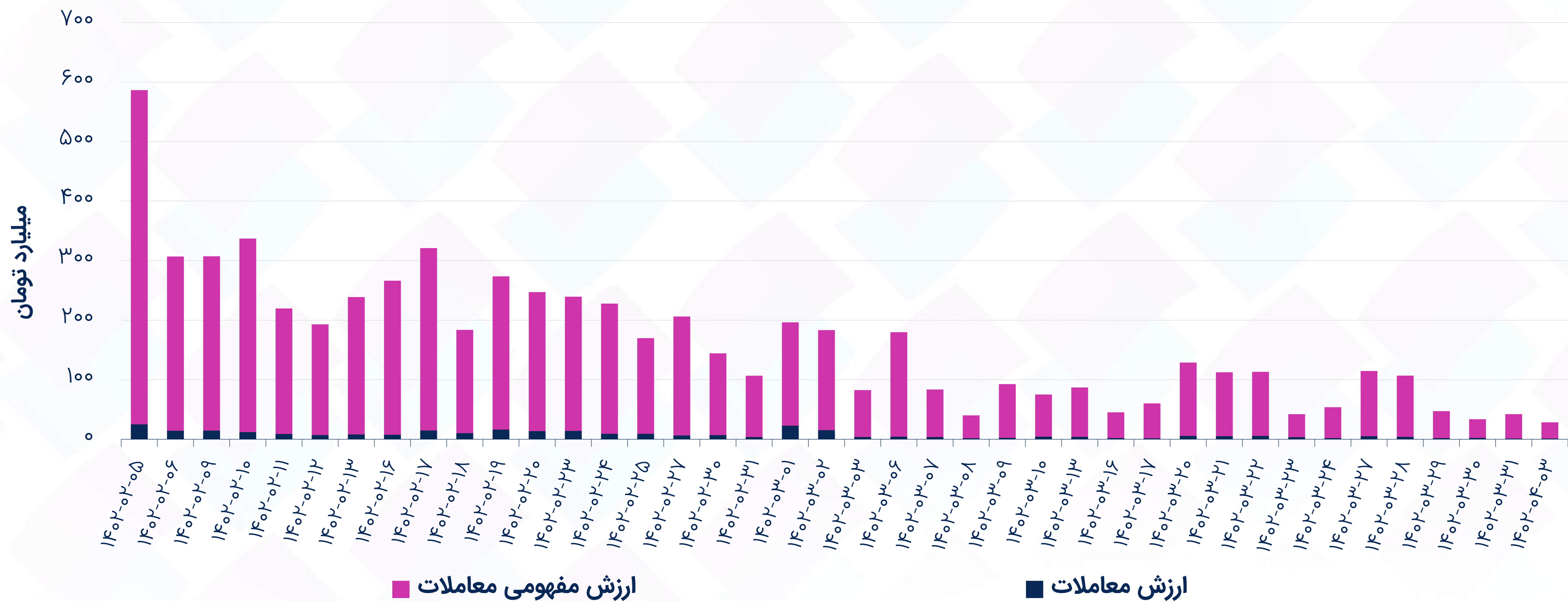
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



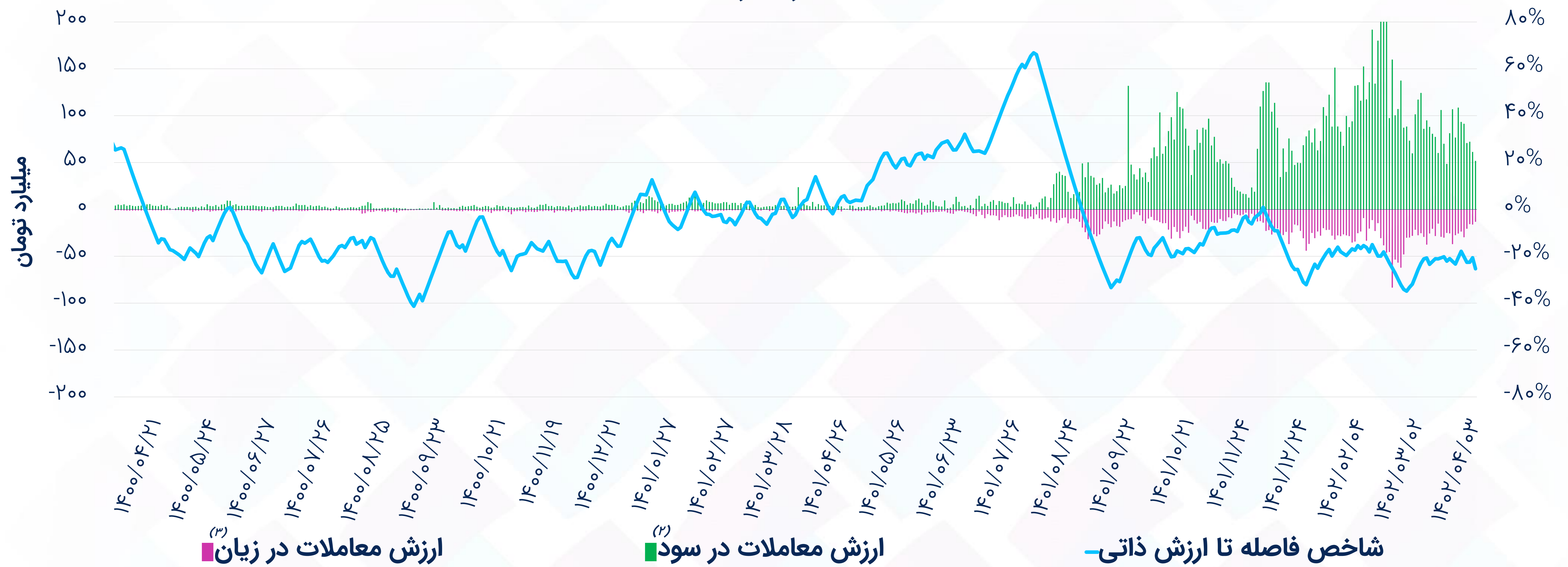
اختیار فروش



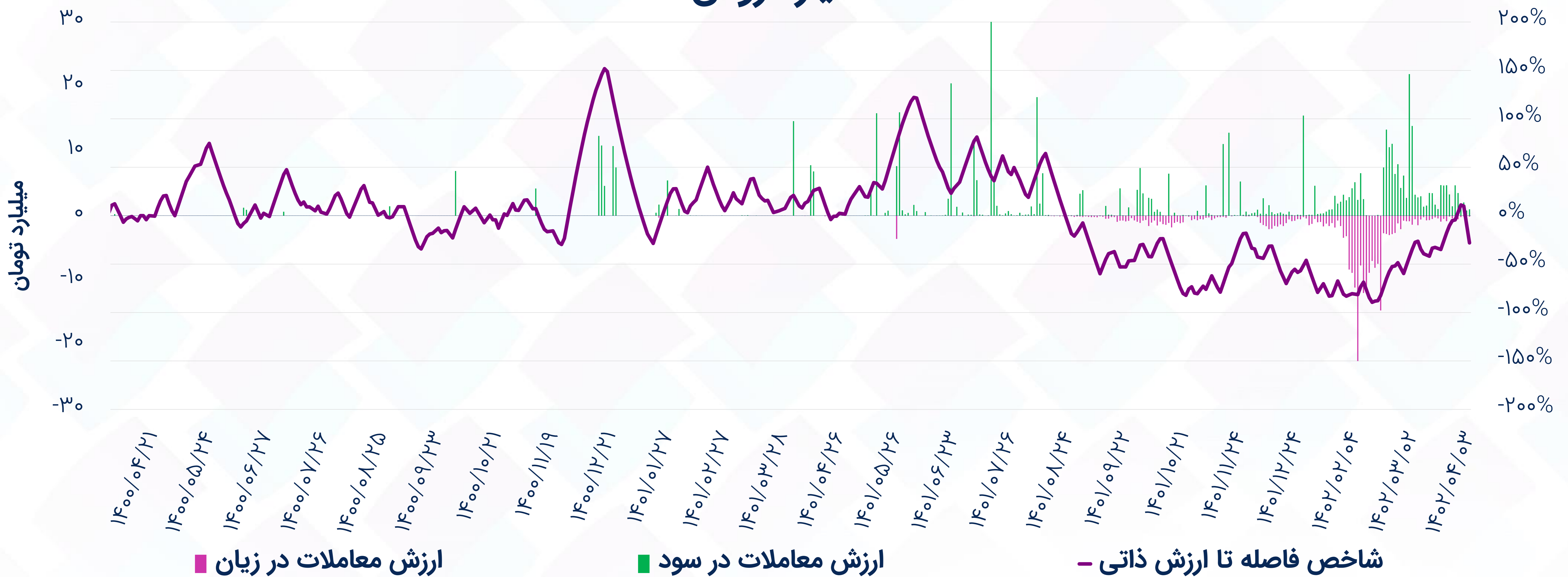
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

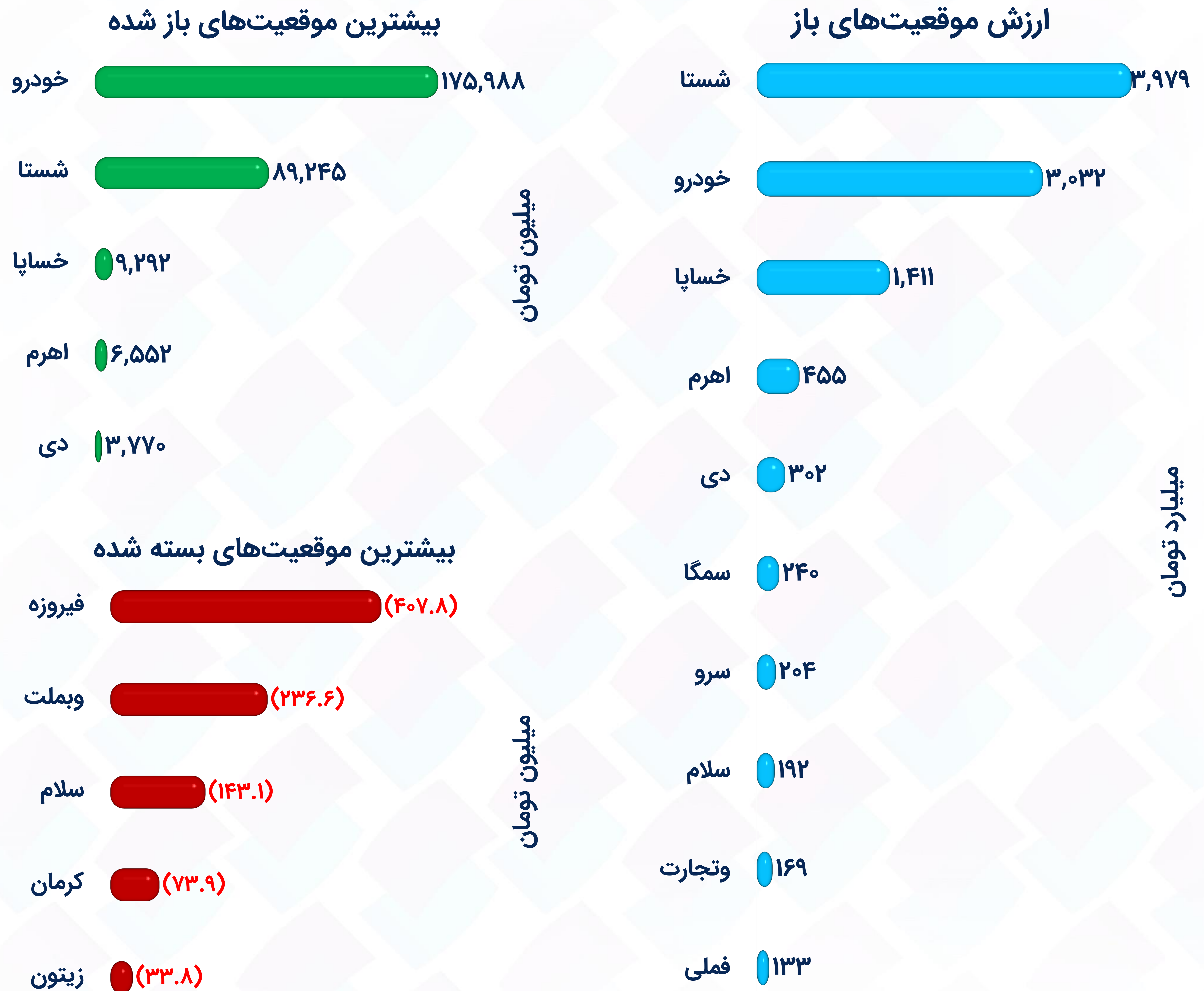
اختیار خرید

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
شستا	۳۰	۲۴.۰	۱۸۳.۰	۱۶.۴	۷.۶	(۲۷.۶%)
خودرو	۳۳	۲۲.۷	۴۴۲.۷	۱۹.۱	۳.۶	(۳۴.۴%)
اهرم	۲۷	۸.۱	۱۷.۴	۷.۹	۰.۳	(۹.۴%)
دی	۱۵	۵.۶	۱۷.۶	۵.۲	۰.۴	(۱۰.۸%)
خسپا	۸	۱.۴	۱۲.۸	۰.۹	۰.۵	(۲۵.۳%)
کرمان	۷	۱.۰	۲.۸	۱.۰	۰.۰	(۸.۱%)
فیروزه	۹	۰.۸	۴.۶	۰.۳	۰.۵	(۲۳.۹%)

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	۷	۱,۰۲۶.۳	۲۷,۲۹۶.۵	۸۷۱.۰	۱۵۵.۳	(۲۷.۸%)
فملی	۱	۱۰۹.۶	۱,۰۷۸.۶	۱۰۹.۶	۰.۰	(۳۱.۳%)
حافرین	۱	۰.۶	۳.۶	۰.۶	۰.۰	۴.۲%

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 ۲,۵۳۰

توسن ۴۶۵

سمگا ۲۲۴

حسیر ۱۳۱

های وب ۱۰۱

حافرین ۴۰

حریل ۱۹

کارا ۱۷

سلام ۳

اهرم ۳

بیشترین موقعیت‌های باز شده

شستا ۱۵,۳۳۳.۹

فملی ۲۵.۳

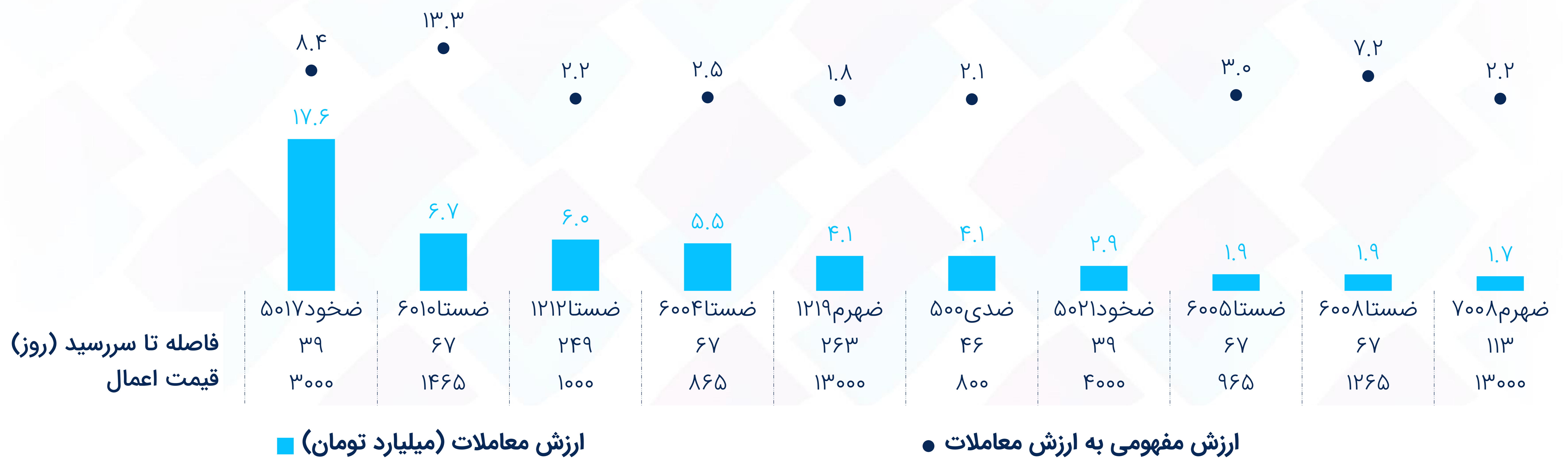
حسیر ۲.۸

میلیون تومان

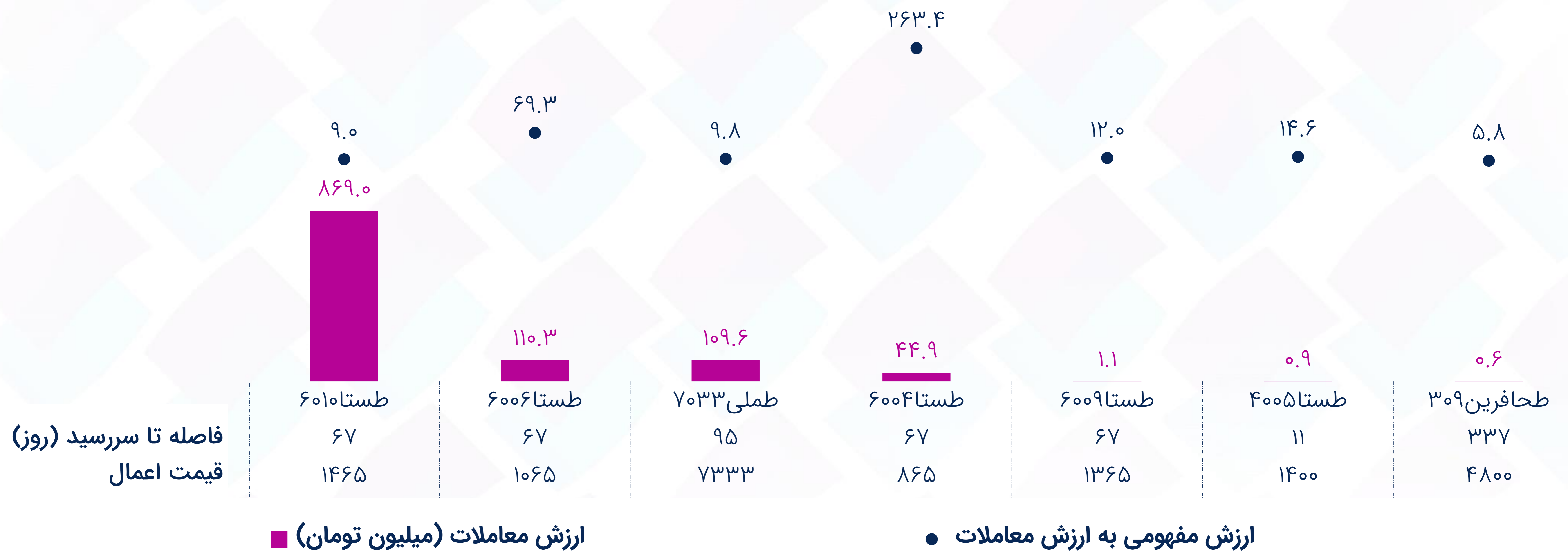
میلیارد تومان

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
۱۱۰%	۵,۱۷۹	۰.۹۹	۵.۹	(۱۱.۳%)	۱۴,۴۶۵	۱۶,۳۱۰	۲,۴۶۵	۱۷.۷	۱۱۰	۱۲,۰۰۰	ضسلا ۷۰۰۶
۸۵%	۸۷۷	۰.۹۵	۷.۵	(۵.۷%)	۳,۵۲۷	۳,۷۴۰	۴۷۳	۵.۵	۸۹	۳,۰۵۴	ضتفارس ۶۰۳
۵۴%	۱,۳۳۹	۰.۹۲	۶.۳	(۱.۳%)	۵,۵۰۸	۵,۵۸۰	۸۷۰	۲.۴	۱۱۷	۴,۶۳۸	ضفلا ۷۰۲۹
۴۸%	۶,۰۹۸	۱.۰۰	۳.۷	(۷.۳%)	۱۵,۱۱۴	۱۶,۳۱۰	۴,۱۱۴	۱۷.۷	۱۱۰	۱۱,۰۰۰	ضسلا ۷۰۰۵
۳۱%	۴,۵۴۷	۱.۰۰	۱.۷	(۱۳.۳%)	۵,۹۷۱	۶,۸۹۰	۳,۴۷۱	۱۰.۹	۹۶	۲,۵۰۰	ضملی ۷۰۲۱

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	۱,۳۱۷	۱	۲.۴	۱۲	۲,۰۰۰	ضستا ۴۰۱۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۸۰۱.۰	۳۷%	۱,۸۰۱	۱,۳۱۷	۱	۱.۵	۱۲	۱,۸۰۰	ضستا ۴۰۰۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۷۰۱.۰	۲۹%	۱,۷۰۱	۱,۳۱۷	۱	۱۳.۷	۱۲	۱,۷۰۰	ضستا ۴۰۰۸
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۵۰۱.۰	۷۸%	۵,۵۱۱	۳,۰۸۸	۱۱	۵۱.۵	۴۰	۵,۵۰۰	ضخود ۵۰۲۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۷۵۱.۰	۲۱%	۳,۷۵۱	۳,۰۸۸	۱	۱۱.۱	۵	۳,۷۵۰	ضخود ۴۰۳۰

(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

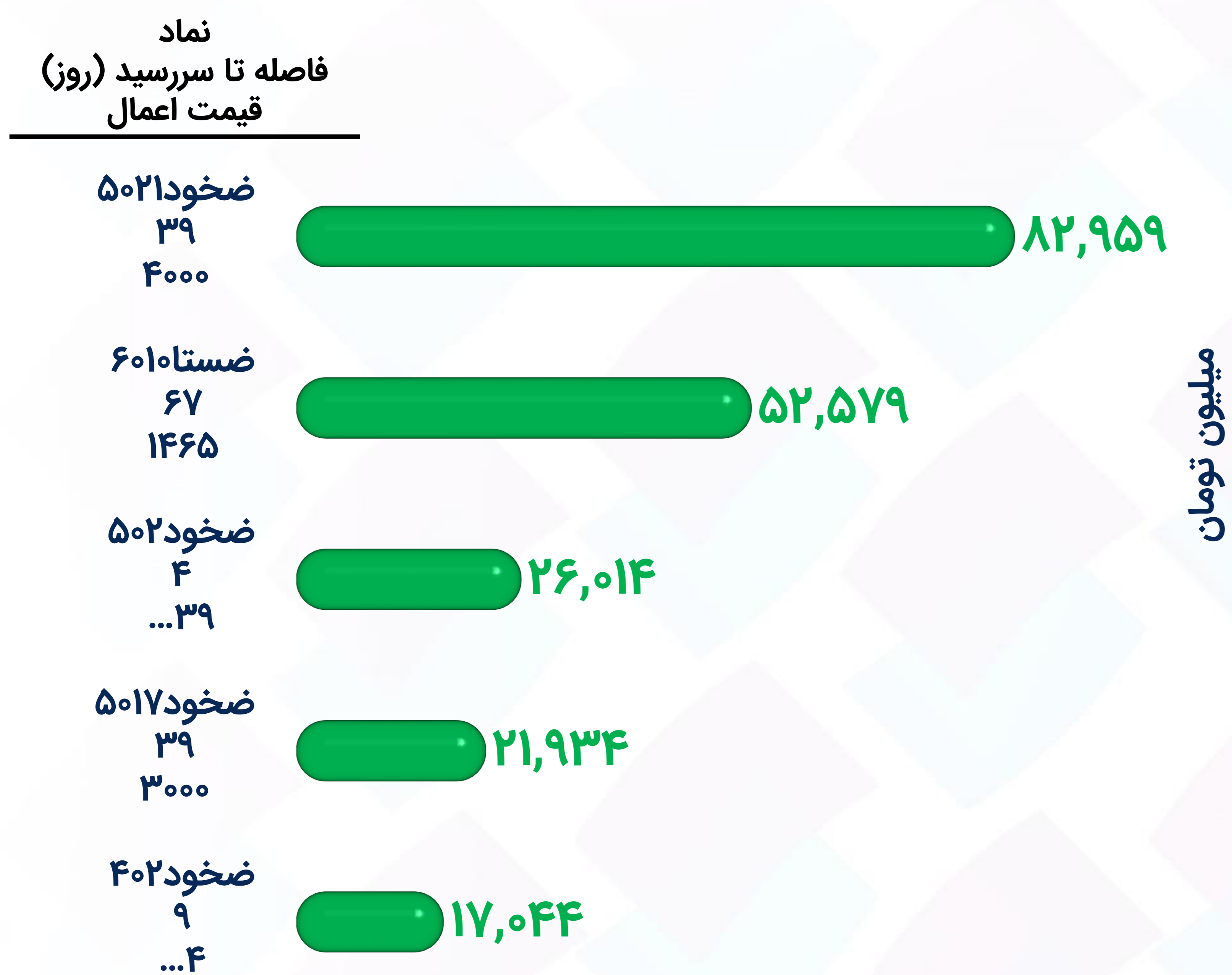
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۱,۳۱۷	۵	۴۴.۹	۶۸	۸۶۵	شستا ۶۰۰۴
(۹۰%)	۲	-۰.۰۳	۵۵.۱	(۲۱%)	۱,۰۴۶	۱,۳۱۷	۱۹	۱۱۰.۳	۶۸	۱,۰۶۵	شستا ۶۰۰۶
(۴۰%)	۶۶	-۰.۴۴	۱۱.۴	(۵%)	۱,۲۵۵	۱,۳۱۷	۱۱۰	۱.۱	۶۸	۱,۳۶۵	شستا ۶۰۰۹
(۳۱%)	۴۸۱	-۰.۴۶	۹.۵	(۴%)	۶,۶۳۳	۶,۸۹۰	۷۰۰	۱۰۹.۶	۹۶	۷,۳۳۳	فملی ۷۰۳۳
(۱۶%)	۱۲۳	-۰.۶۴	۹.۰	۰%	۱,۳۱۸	۱,۳۱۷	۱۴۷	۸۶۹.۰	۶۸	۱,۴۶۵	شستا ۶۰۱۰

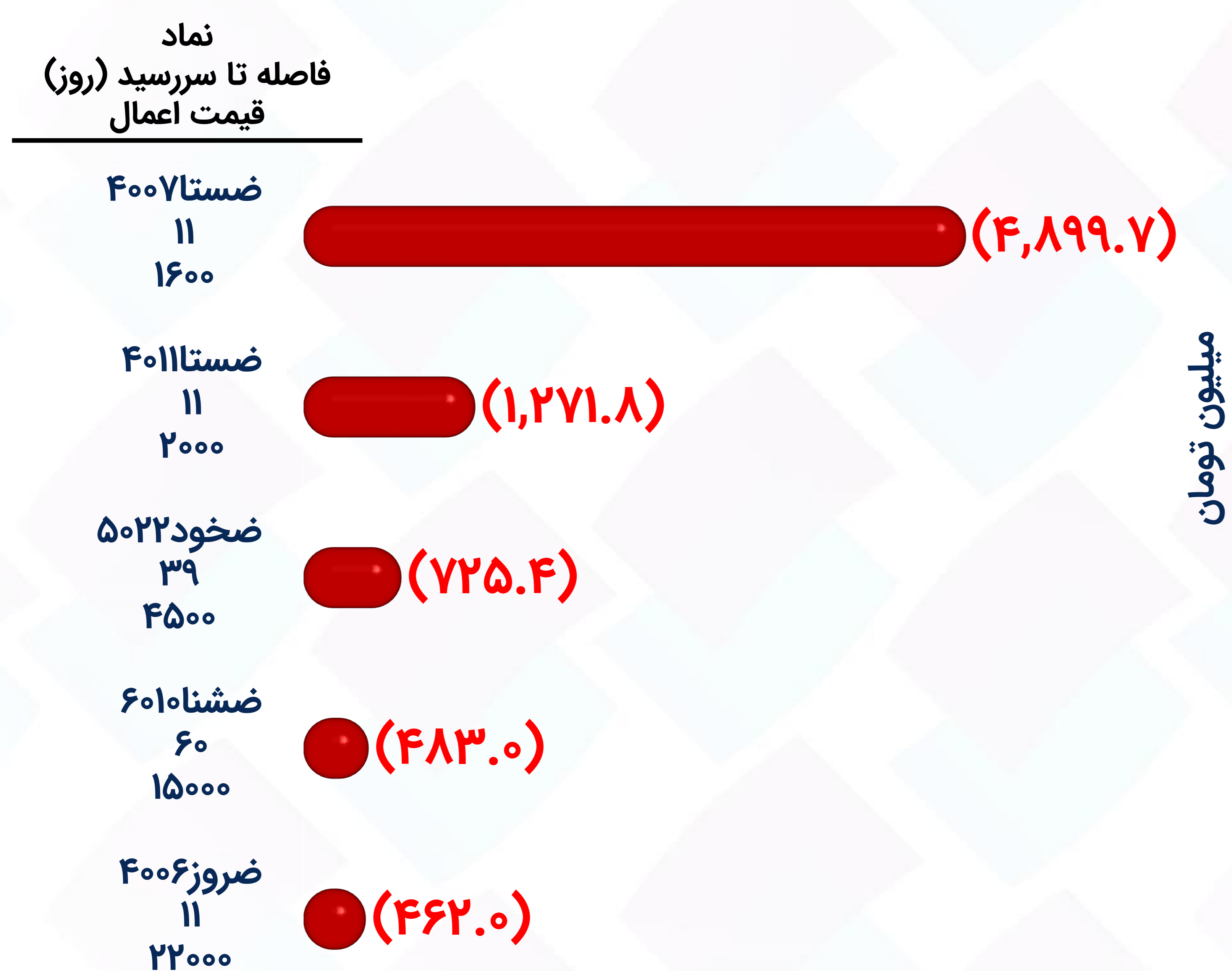
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

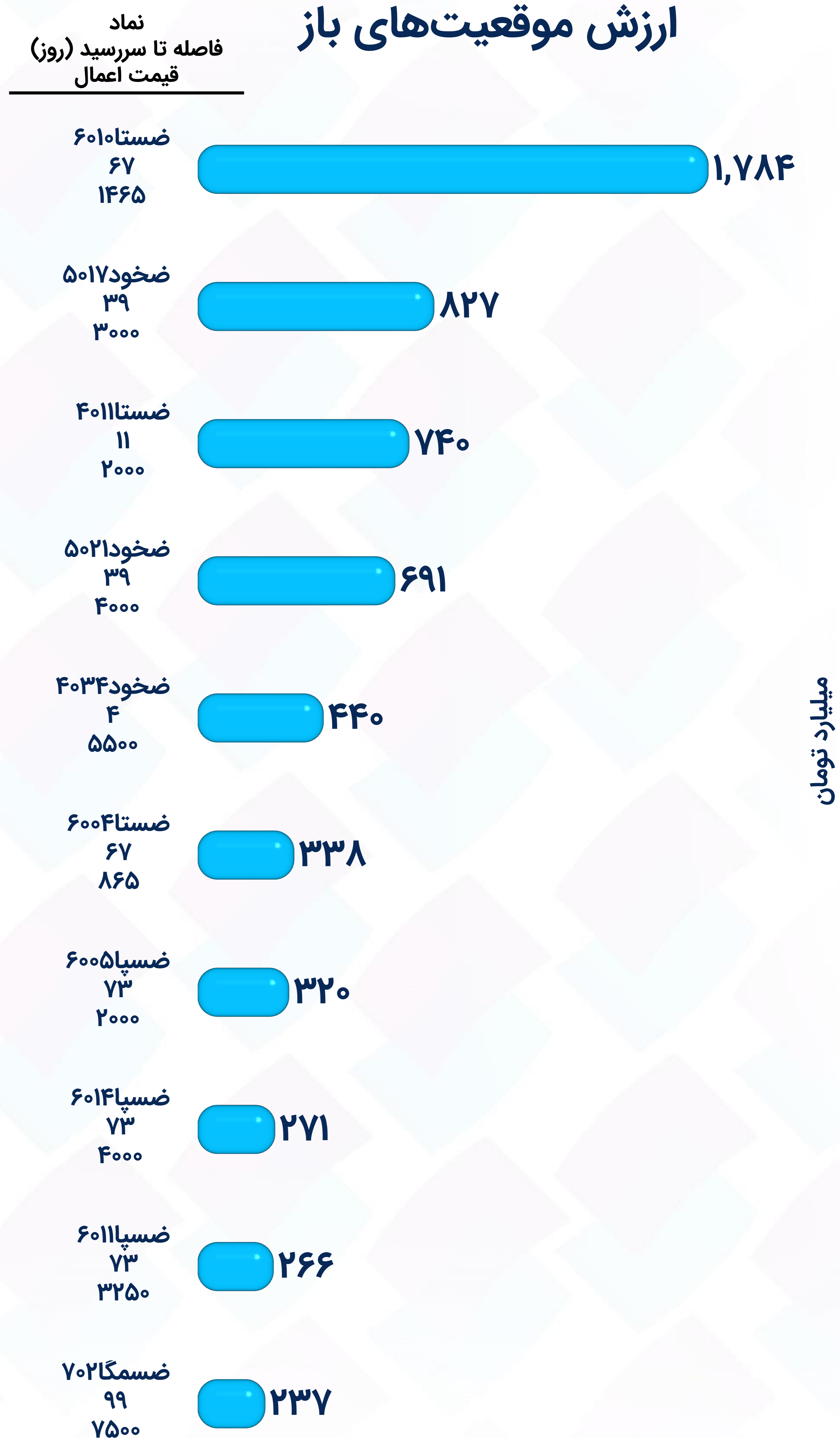
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز

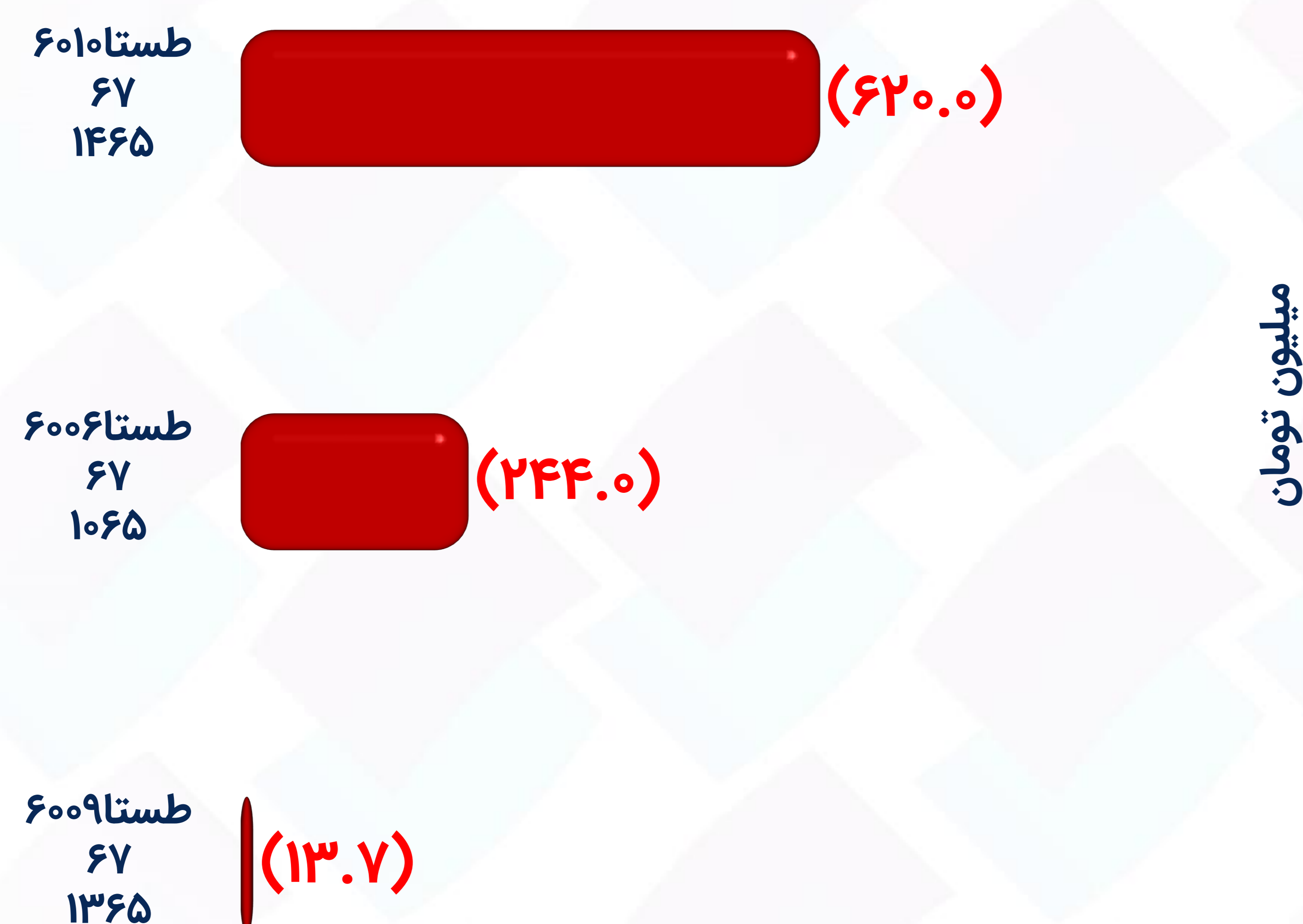


موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

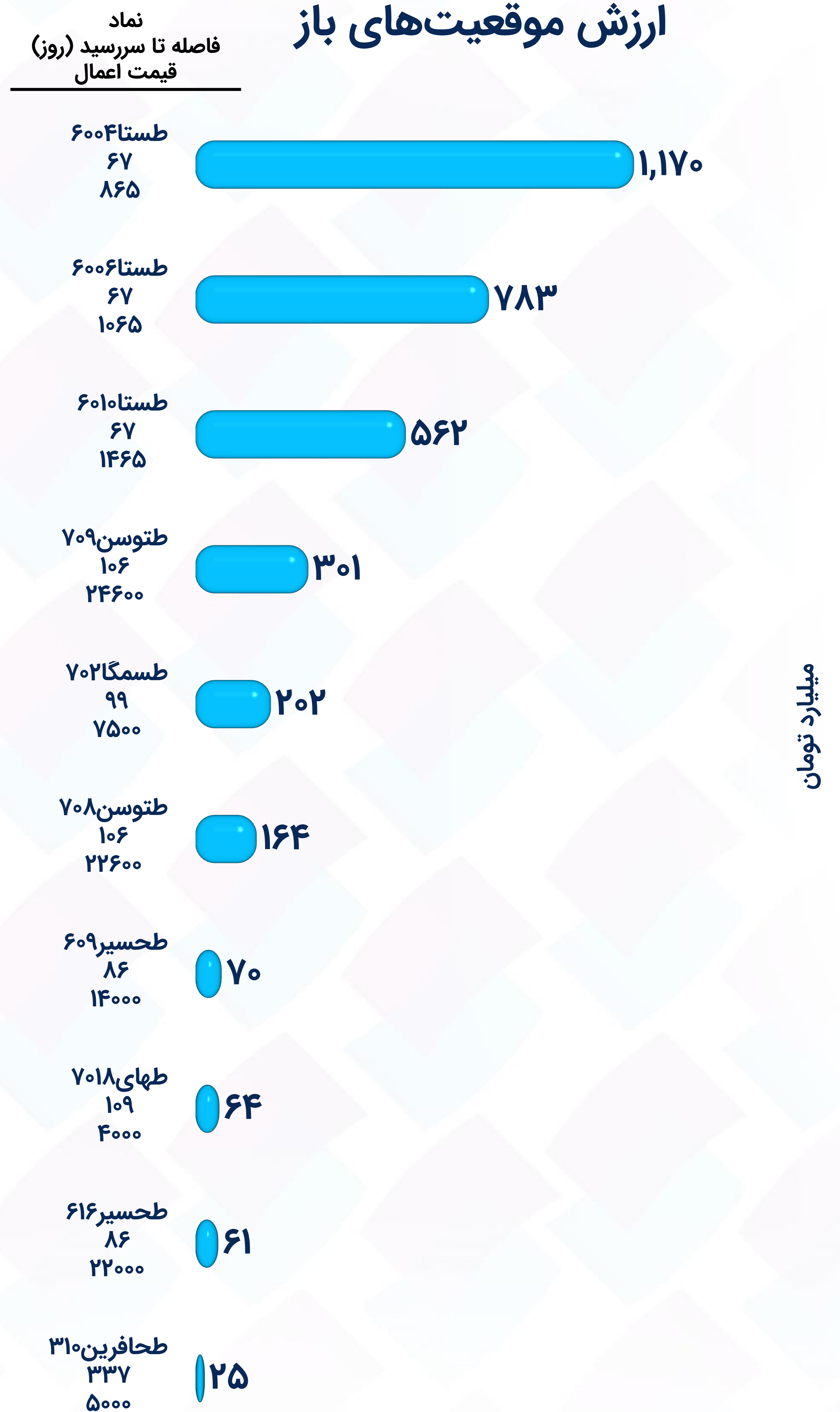
بیشترین موقعیت‌های باز شده



بیشترین موقعیت‌های بسته شده



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

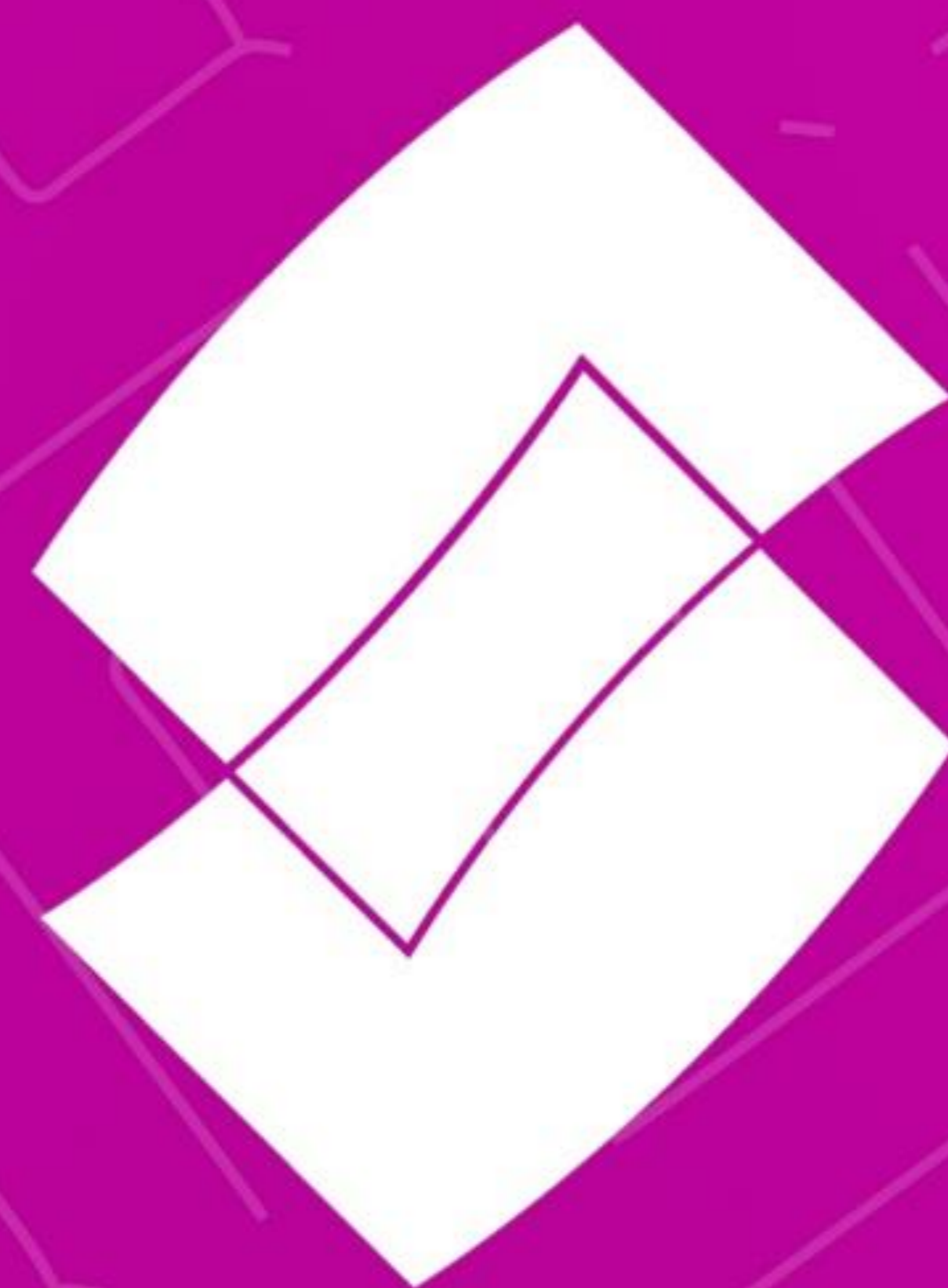
اختیار خرید



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