

شماره
۳۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۴ تیر ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

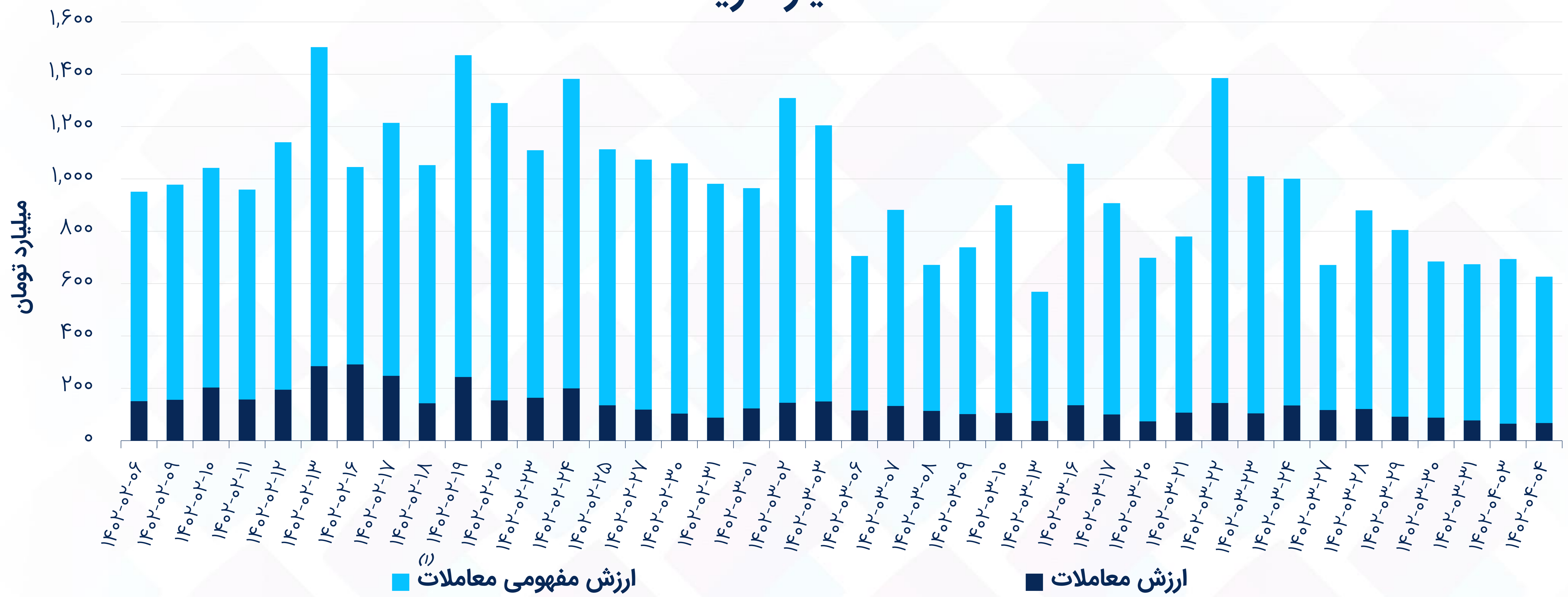




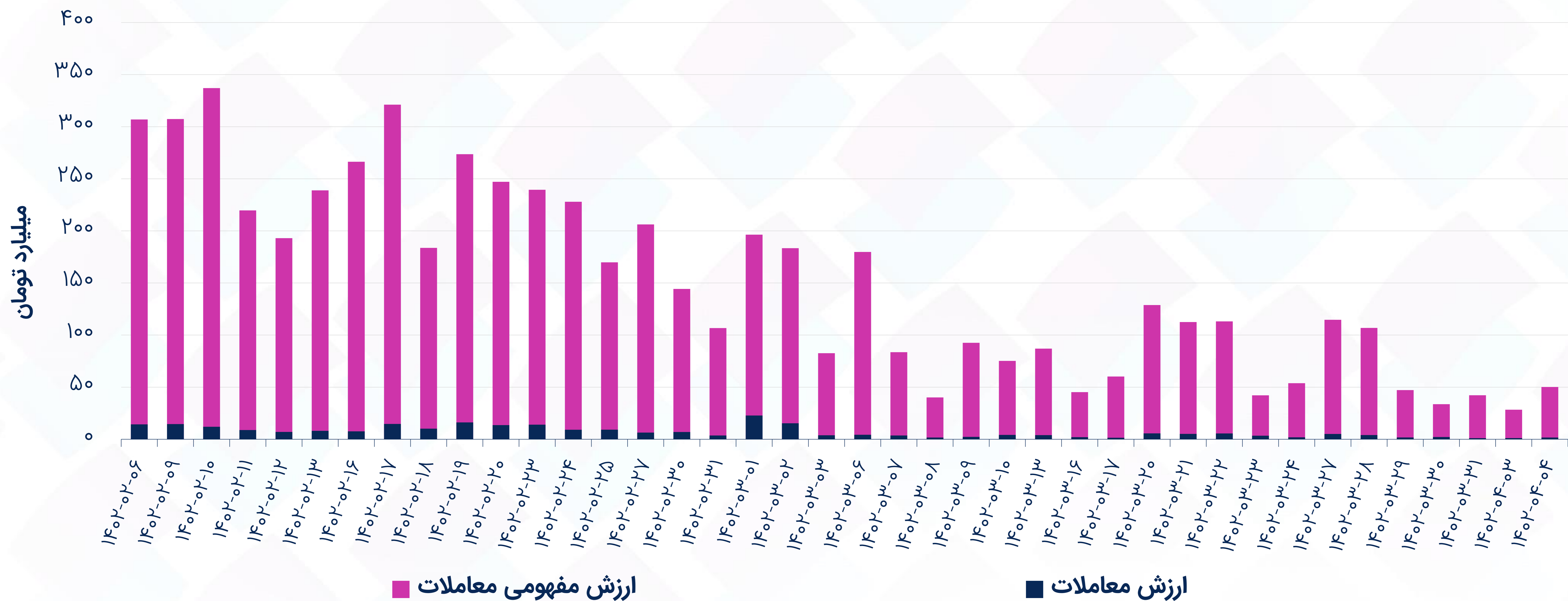
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



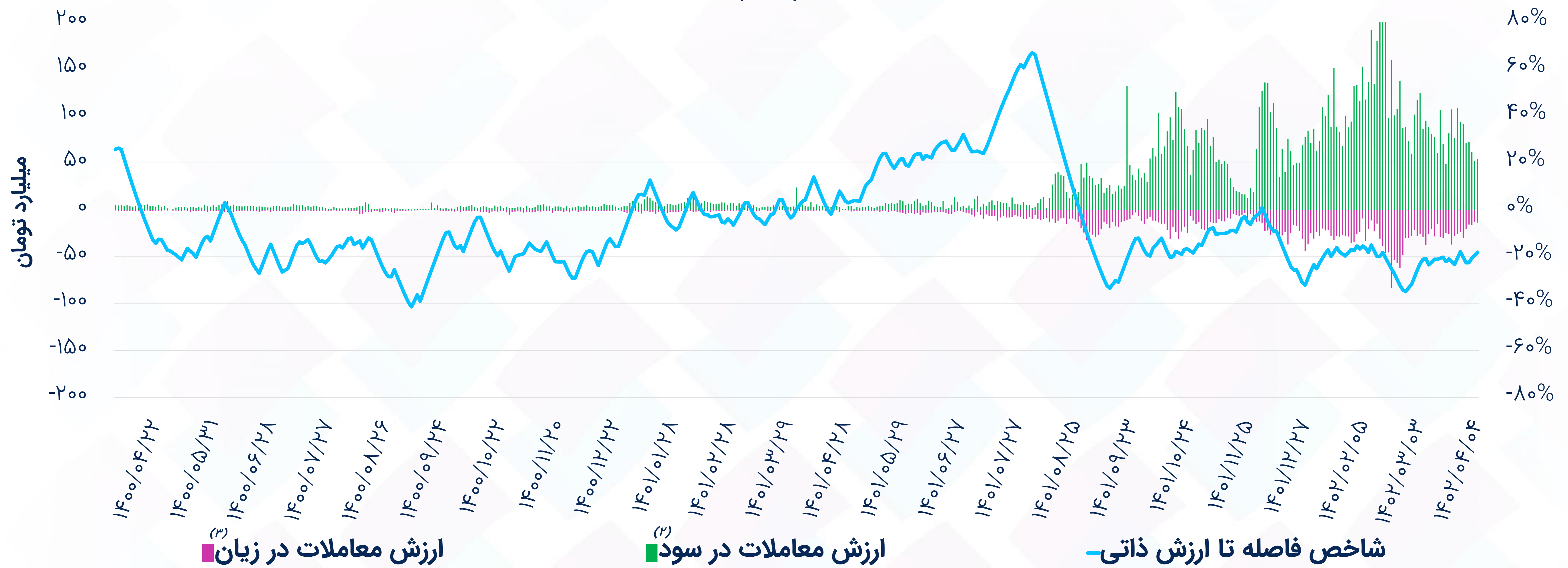
اختیار فروش



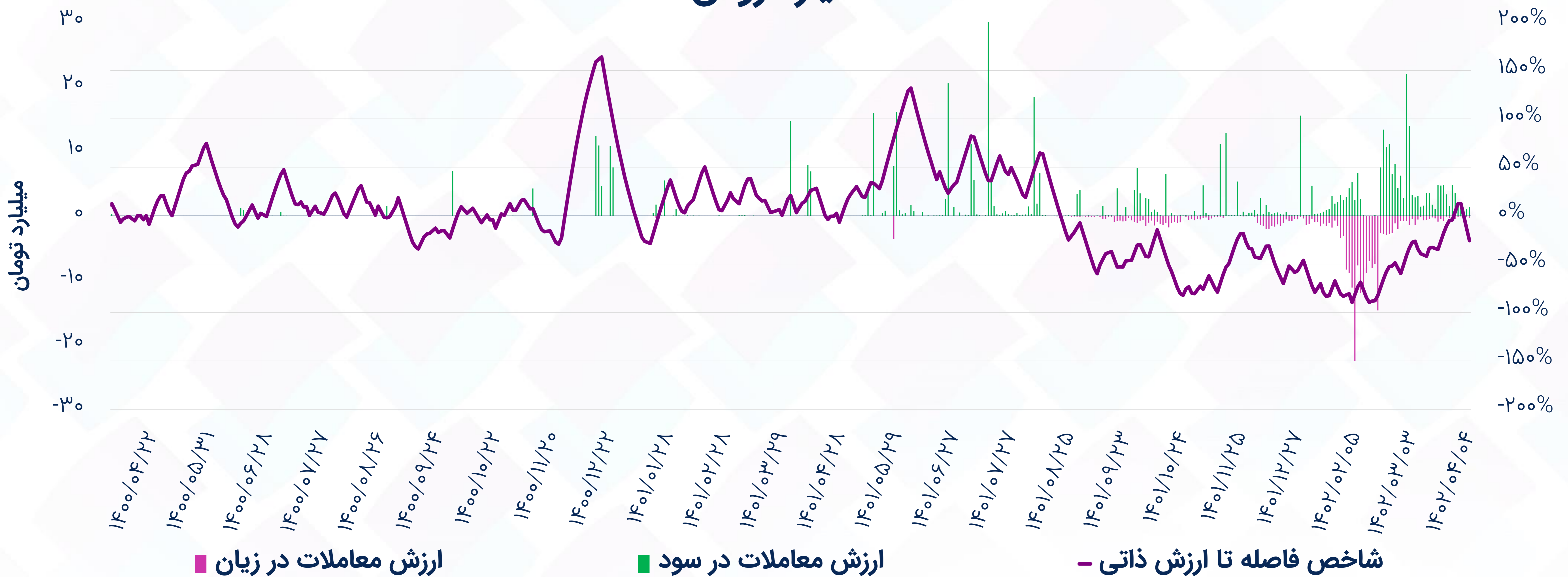
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

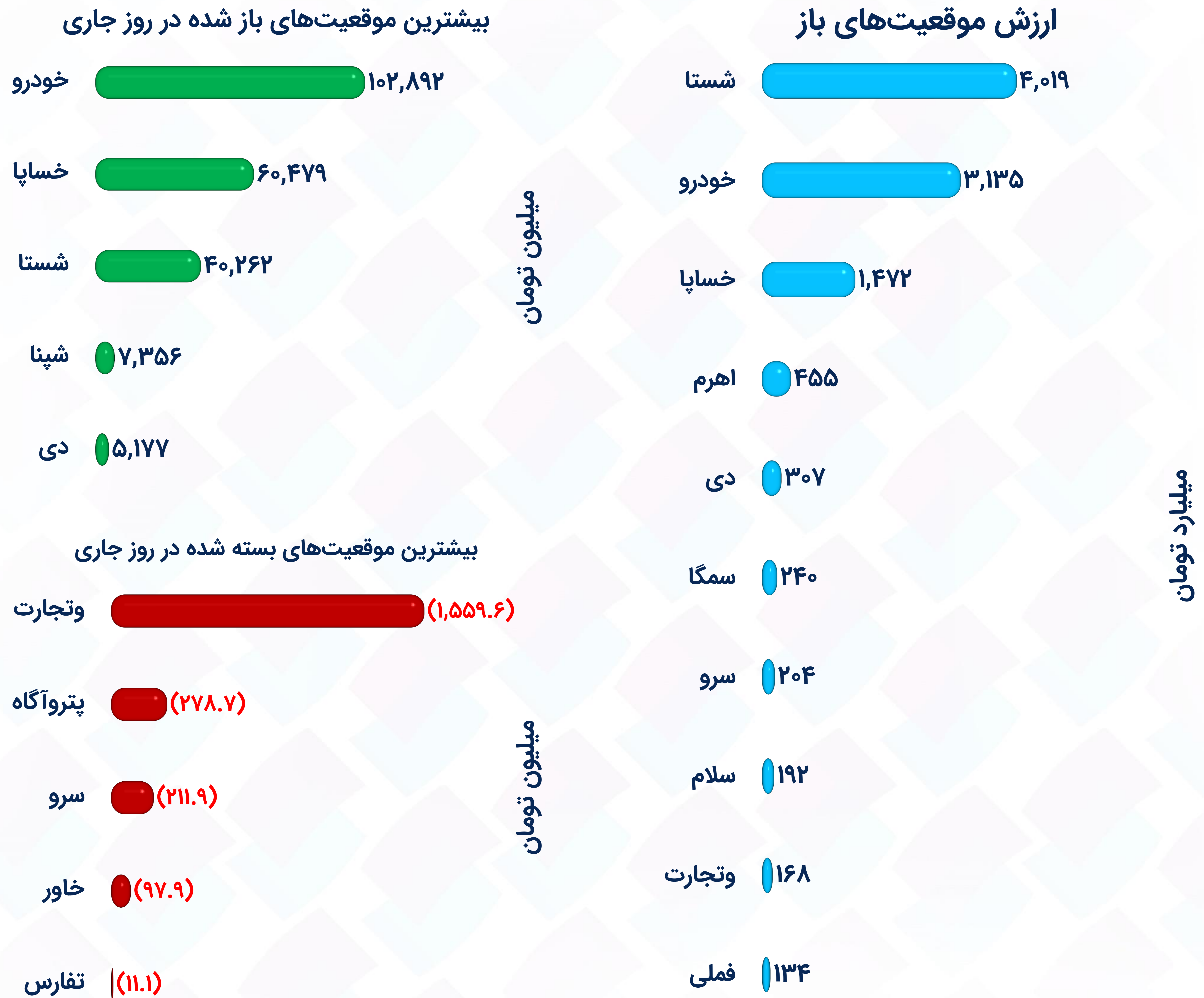
اختیار خرید

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
خودرو	۲۹	۱۸.۷	۳۱۶.۴	۱۶.۸	۲.۰	(۲۴.۹%)
شستا	۳۳	۱۵.۲	۱۴۱.۰	۷.۸	۷.۴	(۲۸.۱%)
کرمان	۸	۹.۸	۲۷.۵	۹.۷	۰.۱	۳.۵%
خسپا	۱۲	۸.۶	۸۱.۳	۶.۱	۲.۴	(۲۳.۳%)
دی	۱۶	۵.۷	۱۸.۷	۵.۲	۰.۶	(۱۱.۷%)
اهرم	۲۱	۵.۱	۱۲.۷	۴.۶	۰.۵	(۹.۲%)
وبملت	۹	۱.۷	۵.۷	۱.۷	۰.۰	(۱۰.۷%)

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	۱,۳۱۸.۰	۴۹,۰۲۱.۳	۱,۰۱۶.۴	۳۰۱.۶	(۳۷.۸%)
حسیر	۱	۲۲۲.۱	۷۴۷.۵	۲۲۲.۱	۰.۰	۳۴.۶%
های وب	۲	۶۹.۹	۱۱۰.۹	۶۹.۹	۰.۰	۸.۵%
فملی	۱	۲۴.۸	۲۷۳.۱	۲۴.۸	۰.۰	(۳۰.۴%)
توسن	۱	۱.۶	۷.۷	۱.۶	۰.۰	(۲.۲%)
حافرین	۱	۰.۶	۳.۶	۰.۶	۰.۰	۵.۱%
اهرم	۱	۰.۵	۴.۳	۰.۵	۰.۰	(۲۲.۸%)

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



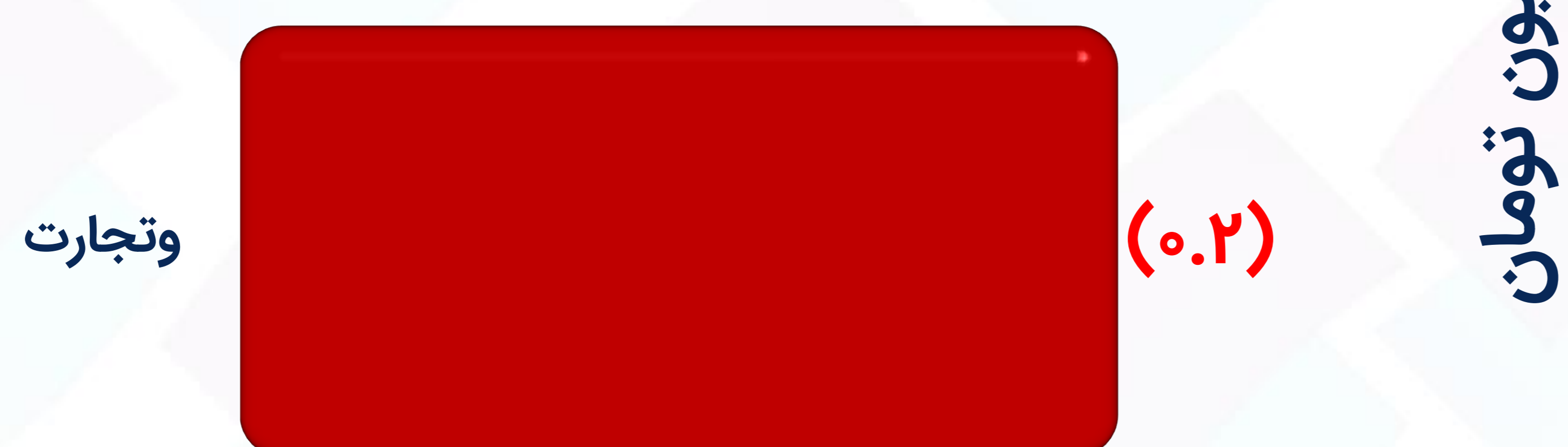
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



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
۷۷%	۱,۶۶۵	۱.۰۰	۳.۳	(۱۶.۰%)	۳,۱۳۴	۳,۷۳۱	۹۳۹	۹.۵	۸۸	۲,۱۹۵	ضتفارس ۶۰۰
۵۴%	۷,۸۶۱	۰.۵۱	۴۰.۱	۴.۱%	۲۰۵,۱۱۱	۱۹۷,۰۳۰	۵,۱۱۱	۷.۴	۱۸	۲۰۰,۰۰۰	ضدار ۴۰۲۱
۴۴%	۶,۳۶۳	۰.۸۳	۴.۶	۸.۶%	۲۰,۴۲۹	۱۸,۸۰۸	۴,۴۲۹	۸۶.۸	۲۵۴	۱۶,۰۰۰	ضتوان ۱۲۰۱
۳۱%	۱۲۴	۰.۷۸	۳۲.۶	(۰.۱%)	۳,۰۹۵	۳,۰۹۸	۹۵	۳۲.۲	۴	۳,۰۰۰	ضخود ۴۰۲۷
۲۱%	۸۵۶	۰.۸۴	۱۶.۵	۰.۱%	۱۱,۷۰۸	۱۱,۷۰۰	۷۰۸	۷۸.۶	۱۱	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	۱,۷۰۱.۰	۲۷%	۱,۷۰۱	۱,۳۳۵	۱	۱.۶	۱۱	۱,۷۰۰	ضستا ۴۰۰۸
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۷۸۶.۷	۷۸%	۵,۵۰۷	۳,۰۹۸	۷	۲۶.۷	۳۹	۵,۵۰۰	ضخود ۵۰۲۴
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۴۰۱.۰	۲۰%	۱,۶۰۴	۱,۳۳۵	۴	۱۸.۹	۱۱	۱,۶۰۰	ضستا ۴۰۰۷
(۹۹%)	۱	۰.۰۰	۷۸.۵	۸۰%	۵,۵۷۱	۳,۰۹۸	۷۱	۱۱.۶	۶۷	۵,۵۰۰	ضخود ۶۰۲۲
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۴۱۷.۷	۶۲%	۵,۰۱۲	۳,۰۹۸	۱۲	۱۴.۳	۳۹	۵,۰۰۰	ضخود ۵۰۲۳

(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
۳۴.۶%	۵,۹۷۷	-۰.۸۸	۴.۰	۱۷%	۱۷,۵۵۸	۱۴,۹۵۰	۴,۴۴۲	۲۲۲.۱	۸۶	۲۲,۰۰۰	طحسیر ۶۱۶
۸.۸%	۲,۴۹۱	-۰.۹۹	۱.۶	۲۰%	۳,۷۱۰	۳,۰۸۰	۲,۲۹۰	۱۳.۷	۱۰۹	۶,۰۰۰	طهای ۷۰۲۲
۸.۴%	۲,۰۳۲	-۰.۹۷	۱.۹	۱۸%	۳,۶۲۶	۳,۰۸۰	۱,۸۷۴	۵۶.۲	۱۰۹	۵,۵۰۰	طهای ۷۰۲۱

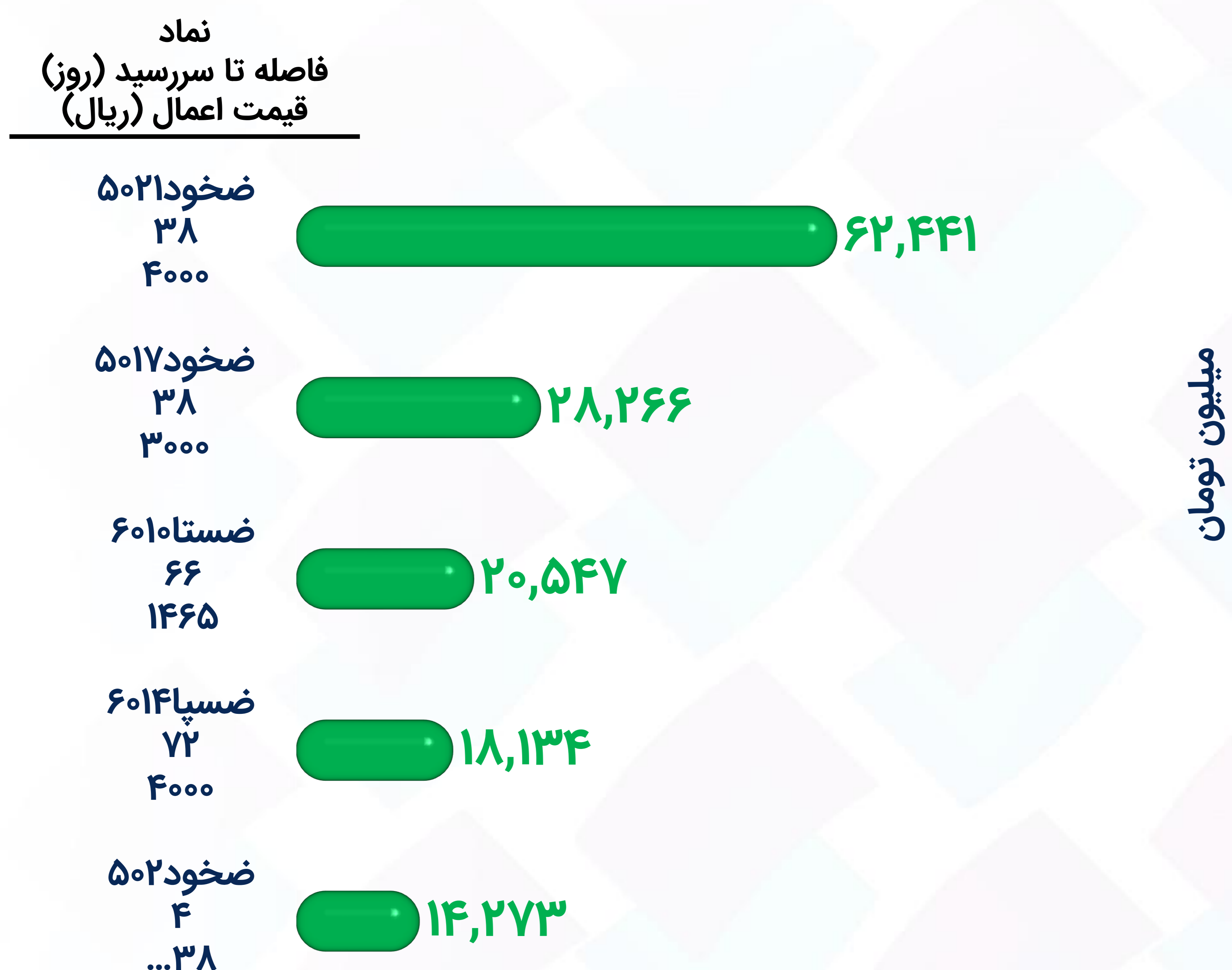
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۱۷۲.۰	(۳۶%)	۸۶۰	۱,۳۳۵	۵	۸۳.۷	۶۷	۸۶۵	طستا ۶۰۰۴
(۹۳%)	۱	-۰.۰۲	۶۱.۶	(۲۱%)	۱,۰۴۸	۱,۳۳۵	۱۷	۲۱۶.۷	۶۷	۱,۰۶۵	طستا ۶۰۰۶
(۶۲%)	۲۴	-۰.۲۱	۱۹.۱	(۱۰%)	۱,۲۰۲	۱,۳۳۵	۶۳	۱.۲	۶۷	۱,۲۶۵	طستا ۶۰۰۸
(۳۰%)	۴۴۱	-۰.۴۳	۱۰.۶	(۴%)	۶,۷۰۰	۶,۹۷۰	۶۳۳	۲۴.۸	۹۵	۷,۳۳۳	طملی ۷۰۳۳
(۲۱%)	۱۱۱	-۰.۶۱	۹.۴	(۱%)	۱,۳۲۴	۱,۳۳۵	۱۴۱	۱,۰۱۶.۴	۶۷	۱,۴۶۵	طستا 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

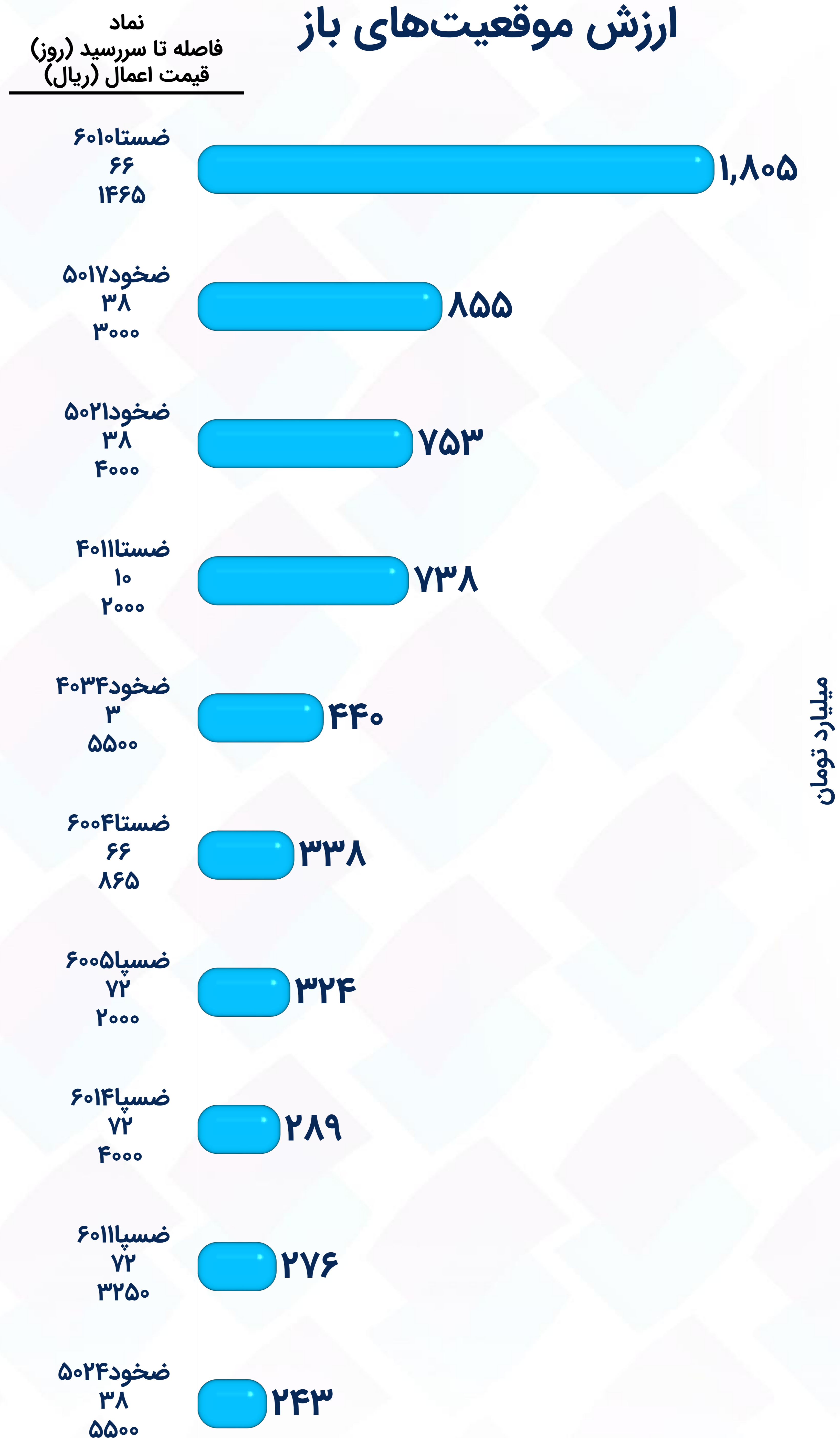
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

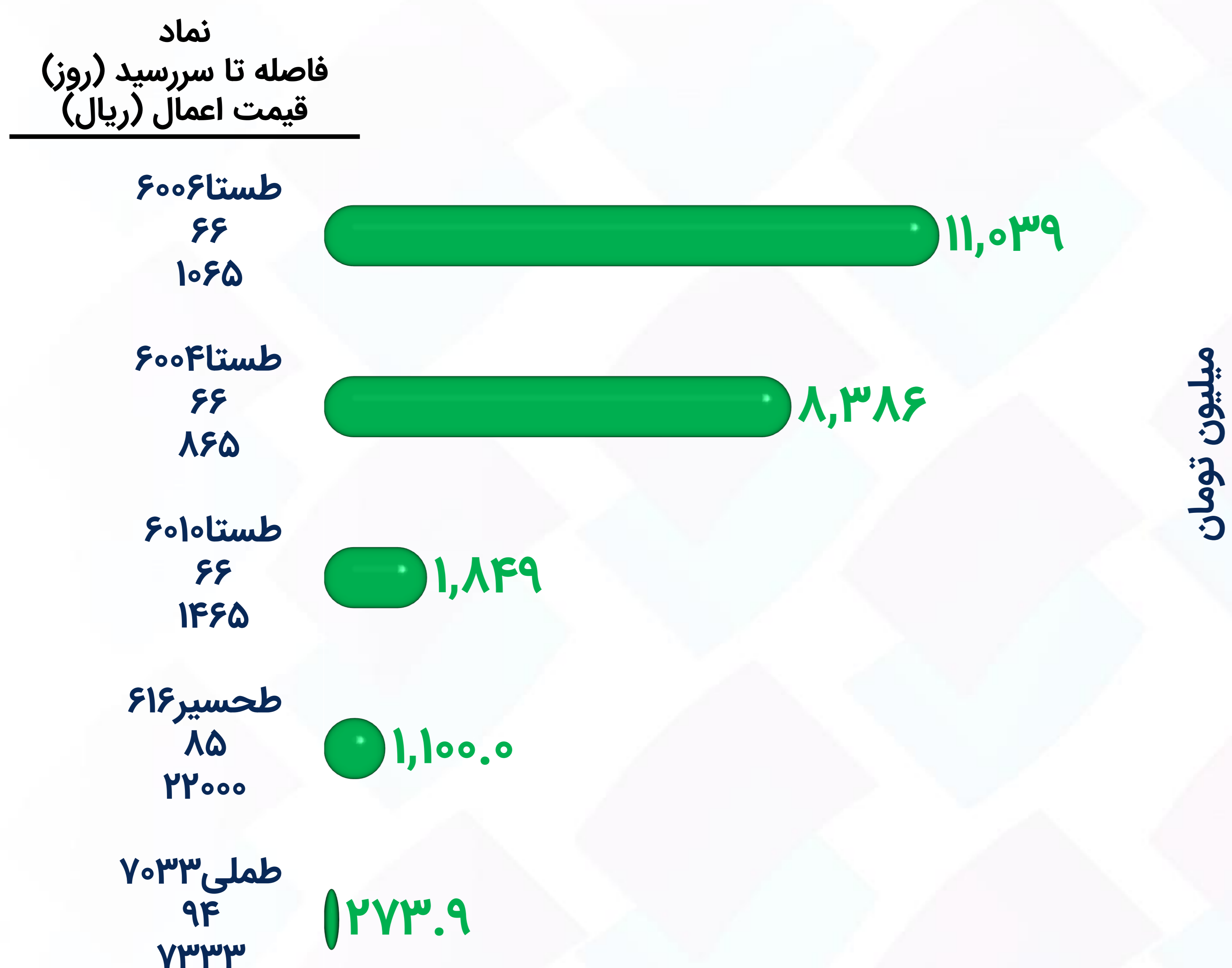


ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

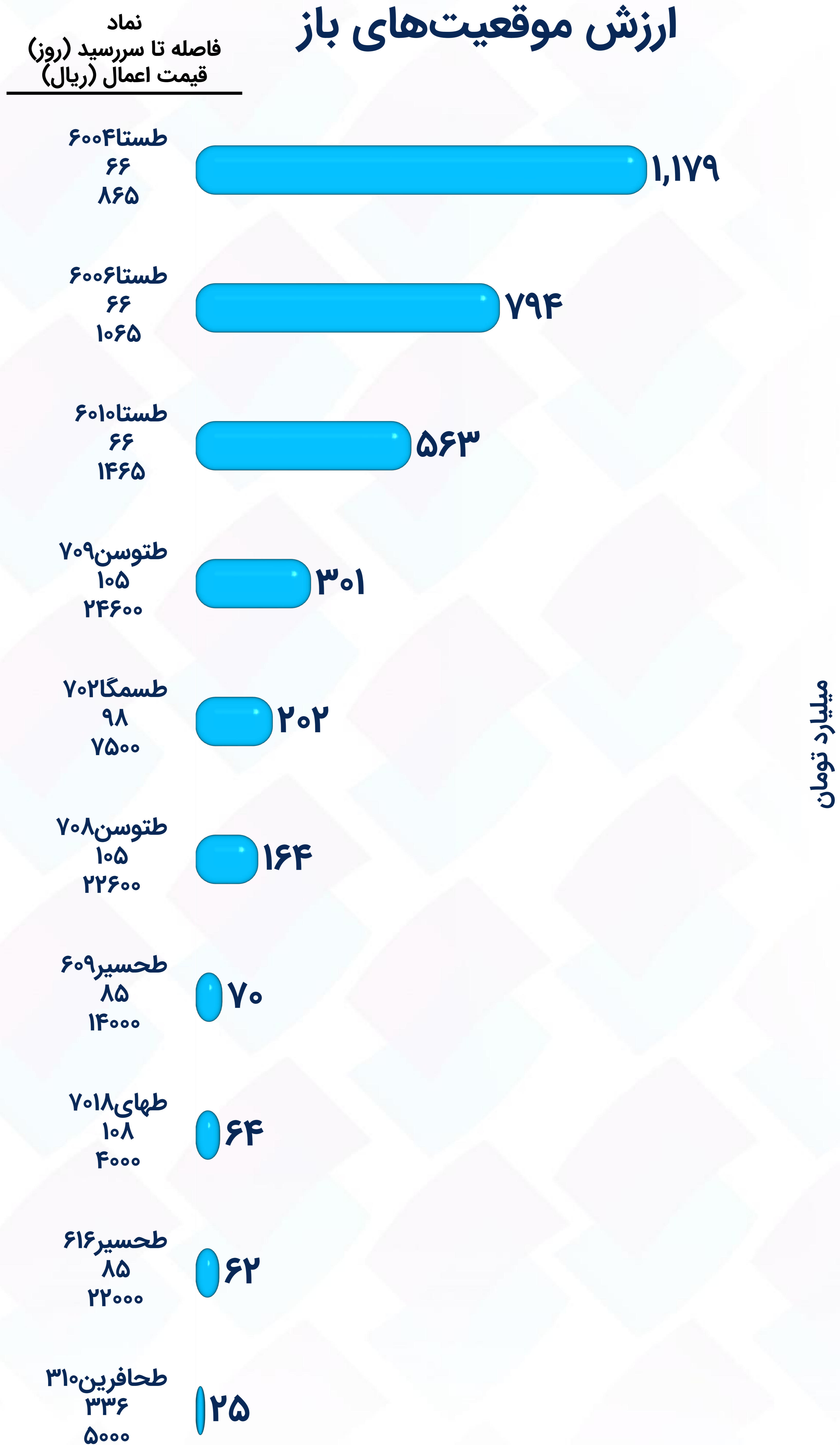
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

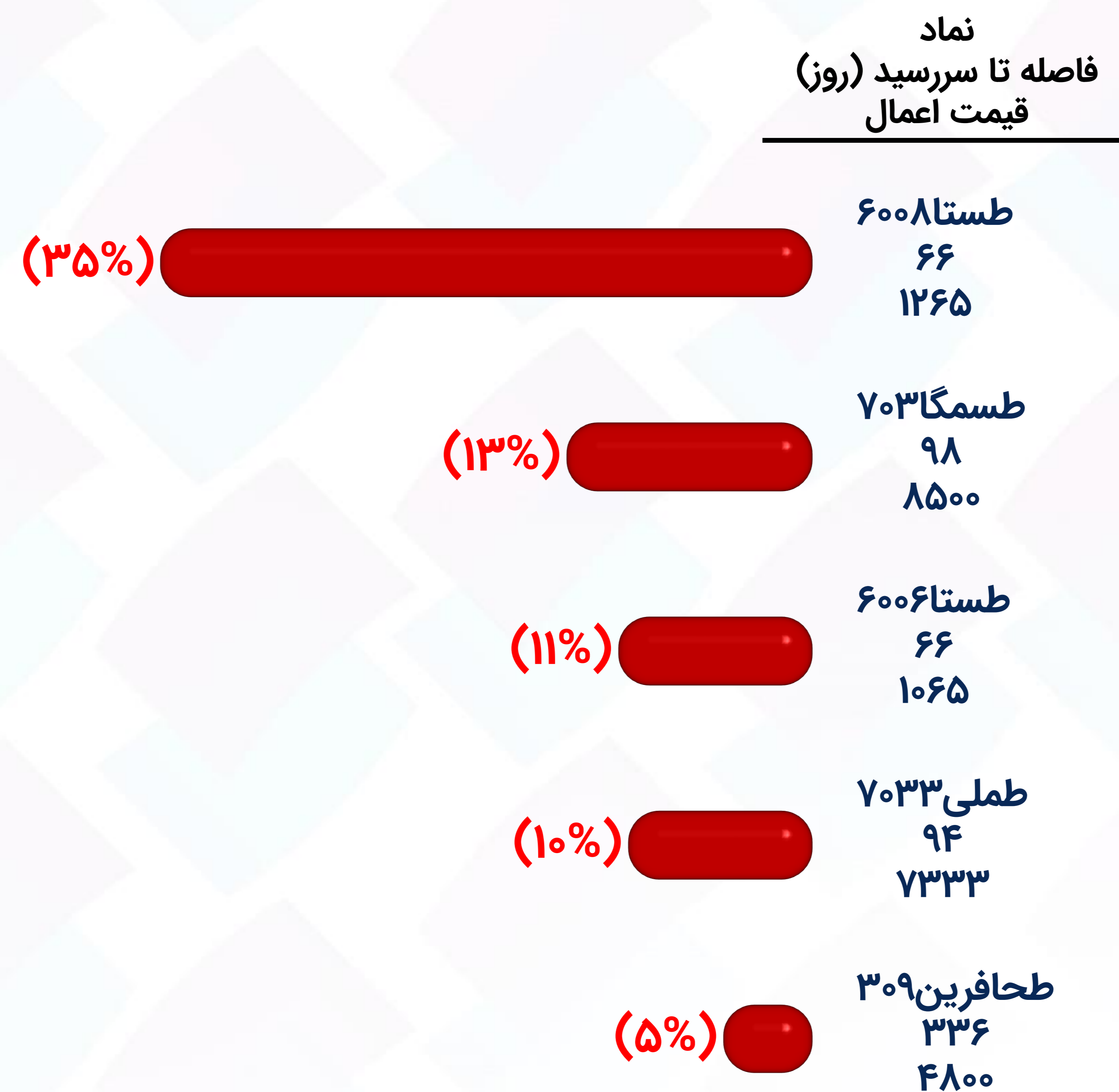


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

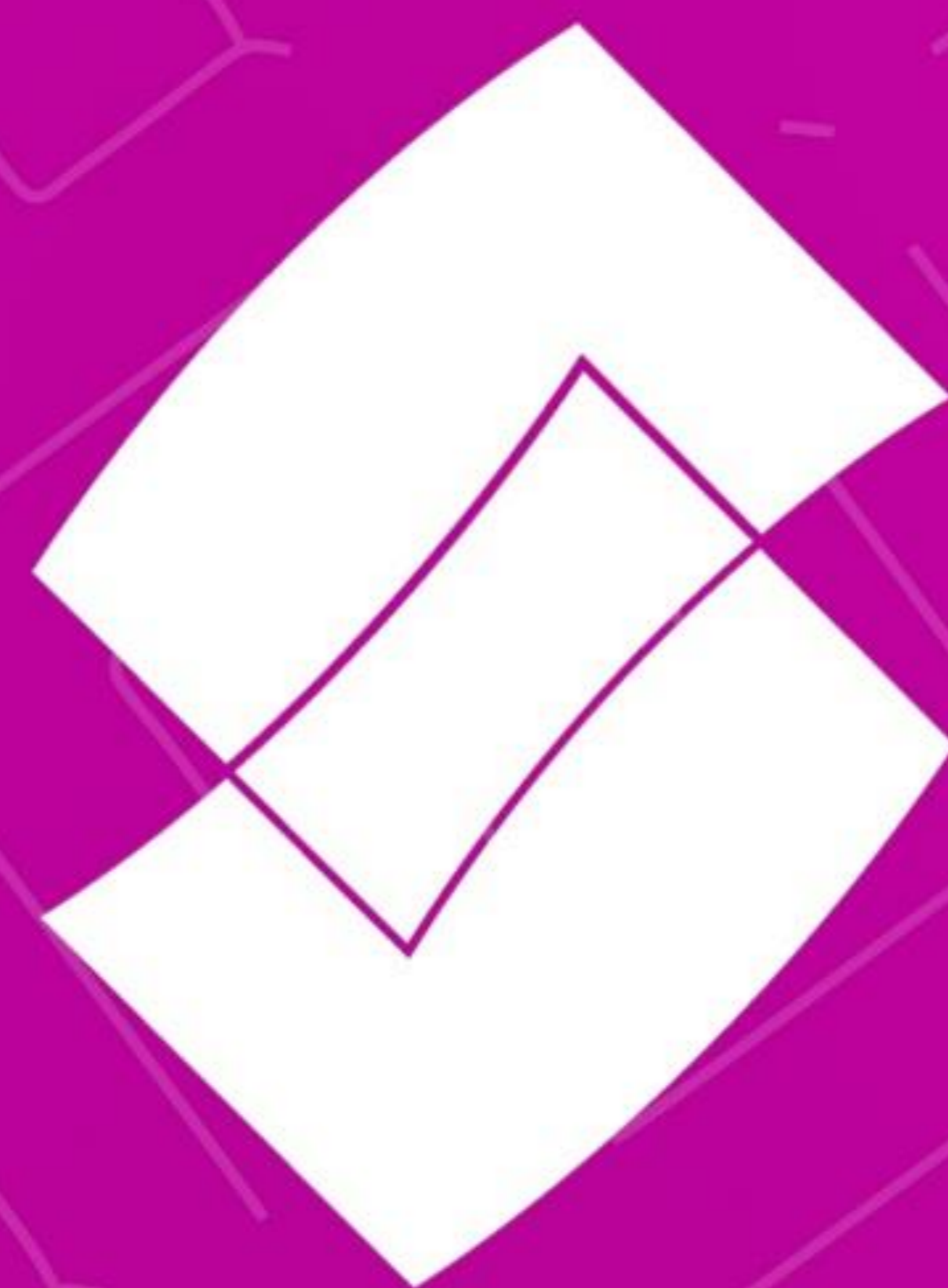
اختیار خرید



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.