

شماره
۴۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۲ تیر ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

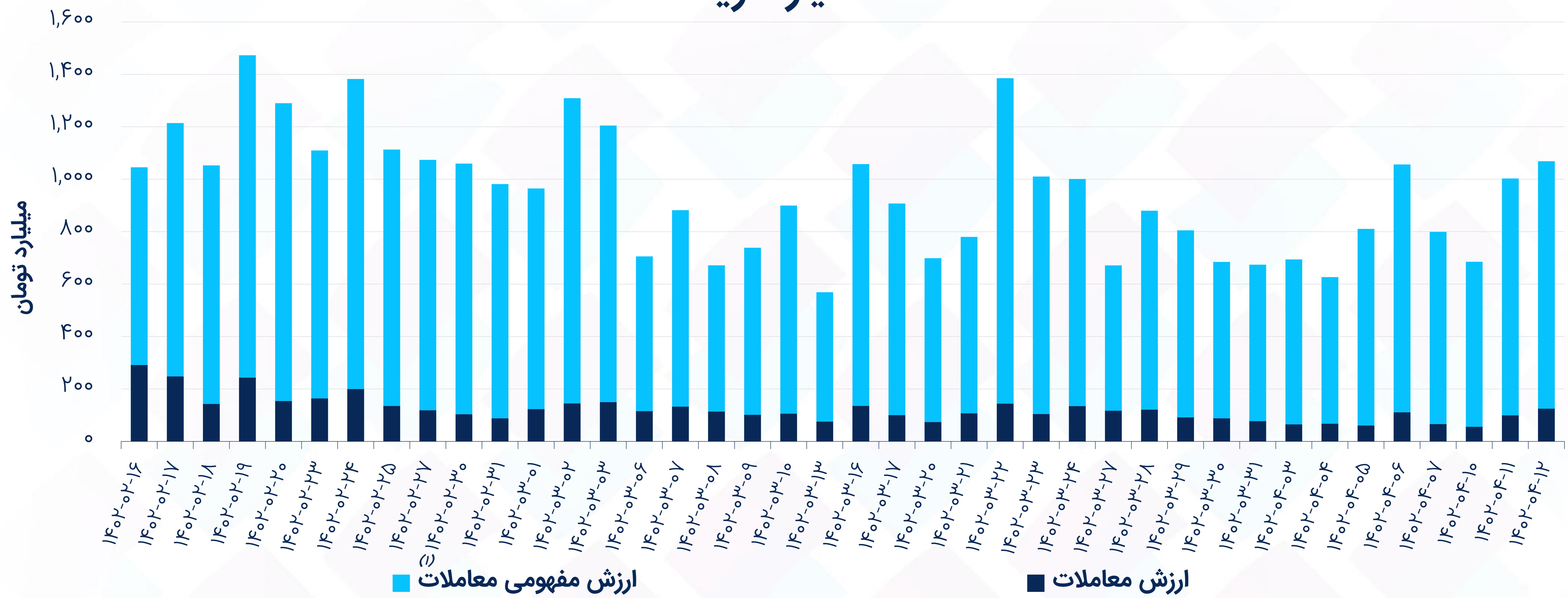




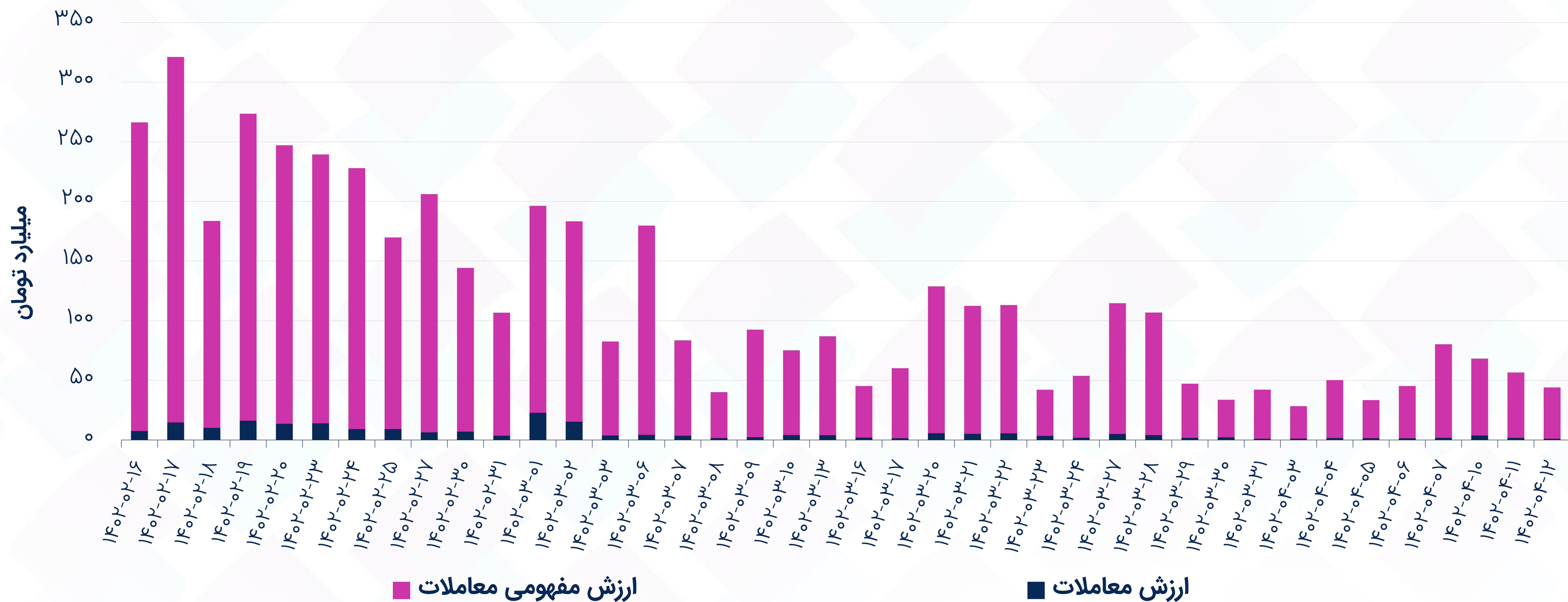
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



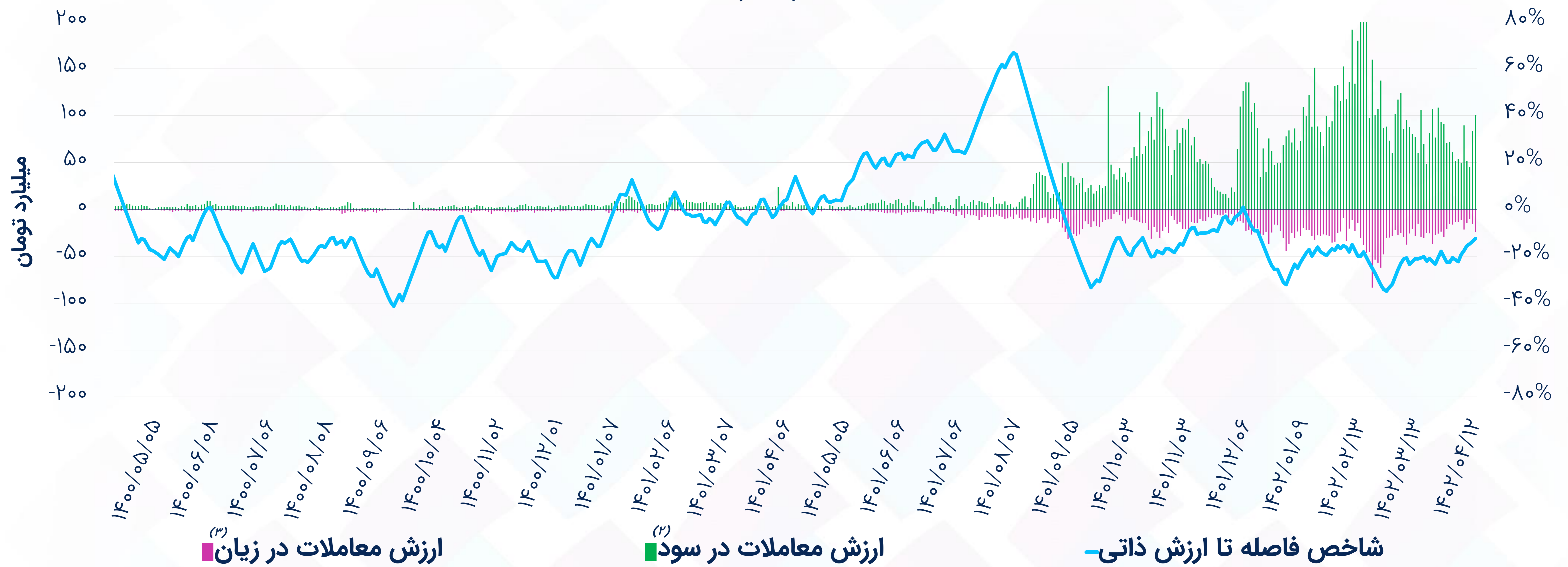
اختیار فروش



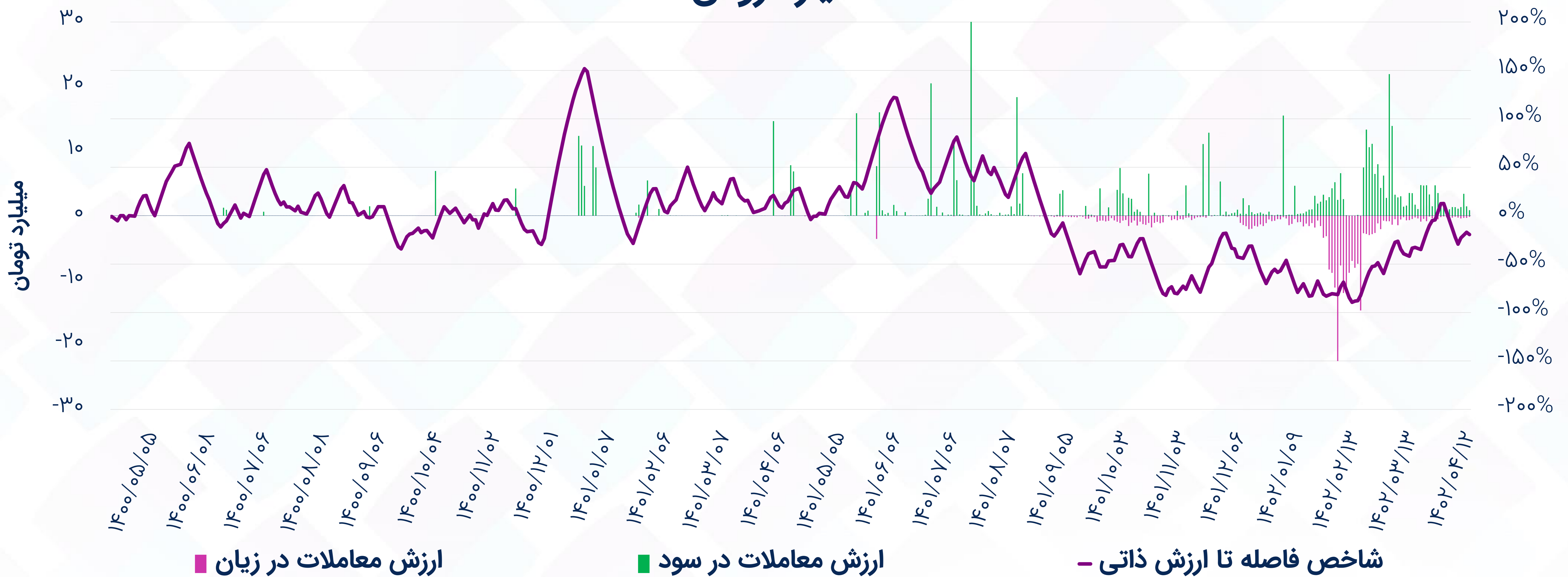
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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
خسپا	۲۱	۳۹.۷	۳۱۷.۷	۲۹.۸	۹.۹	(۱۰.۴%)
خودرو	۳۰	۲۷.۸	۴۲۰.۶	۲۵.۴	۲.۴	(۸.۲%)
شستا	۳۲	۱۷.۵	۱۹۵.۹	۱۰.۲	۷.۳	(۲۷.۶%)
اهرم	۲۸	۱۳.۸	۳۵.۶	۱۲.۵	۱.۳	(۵.۱%)
خاور	۷	۱۳.۱	۲۸.۶	۱۳.۱	۰.۰	(۱۳.۷%)
دی	۱۹	۶.۷	۳۰.۱	۵.۳	۱.۴	(۱۷.۹%)
وتجارت	۱۳	۱.۳	۱۳.۳	۰.۱	۱.۲	(۵.۱%)

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	۱۳	۱,۰۱۵.۱	۴۳,۷۸۴.۳	۸۳۱.۲	۱۸۴.۰	(۲۲.۰%)
حافرین	۱	۱۸.۰	۱۸۰.۶	۱۸.۰	۰.۰	۱۱۰.۰%
های وب	۱	۷.۱	۱۱.۹	۷.۱	۰.۰	۱۴.۶%
فملی	۳	۰.۸	۳.۲	۰.۸	۰.۰	(۱۱.۳%)
شپنا	۱	۰.۸	۲.۶	۰.۸	۰.۰	۱۱.۱%
اهرم	۲	۰.۶	۴۶.۵	۰.۰	۰.۶	۱۴.۱%

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان



(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

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضروز ۴۰۰۹	فیروزه	۳	۶.۷	۱۱۵	۲۸,۱۵۰	۲۸,۱۱۵	(۰.۱%)	۲۴۴.۵	۰.۶۰	۴۴۴	۲۸۶%
ضترو ۴۰۰۵	پتروآگاه	۳	۹.۲	۴۳۵	۱۱,۵۲۰	۱۱,۴۳۵	(۰.۷%)	۲۶.۳	۰.۹۱	۵۶۱	۲۹%
ضروز ۴۰۰۸	فیروزه	۳	۸۰.۹	۱,۷۷۵	۲۸,۱۵۰	۲۷,۷۷۵	(۱.۳%)	۱۵.۶	۱.۰۰	۲,۲۰۳	۲۴%
ضهرم ۷۰۱۰	اهرم	۱۰۵	۲۱۴.۸	۶,۷۱۱	۲۲,۱۶۰	۲۱,۷۱۱	(۲.۰%)	۳.۲	۰.۹۶	۸,۳۲۲	۲۴%
ضترو ۴۰۰۴	پتروآگاه	۳	۷۹.۷	۱,۳۰۳	۱۱,۵۲۰	۱۱,۳۰۳	(۱.۹%)	۸.۷	۱.۰۰	۱,۵۴۰	۱۸%

گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سرربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضستا ۴۰۰۷	شستا	۳	۱.۲	۱	۱,۳۰۶	۱,۶۰۱	۲۳%	۱,۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۰۶	شستا	۳	۱.۱	۱	۱,۳۰۶	۱,۵۰۱	۱۵%	۱,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۵۰۲۴	خودرو	۳۱	۶.۱	۳	۳,۱۹۸	۵,۵۰۳	۷۲%	۱,۸۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۶۰۱۰	شپنا	۵۲	۱.۳	۷۷	۸,۸۳۰	۱۵,۰۷۷	۷۱%	۱۹۵.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۵۰۲۳	خودرو	۳۱	۵.۱	۵	۳,۱۹۸	۵,۰۰۵	۵۷%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
 (۲) فاصله تا سرربه‌سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سربه‌سر)
 (۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سربه‌سر
 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	فاصله تا سر به سر	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۱۱۰.۰%	۷۵۶	-۰.۵۴	۱۲.۹	۲۸%	۴,۶۴۰	۳,۶۱۱	۳۶۰	۱۸.۰	۳۲۹	۵,۰۰۰	طحافرین ۳۱۰
۱۴.۶%	۲,۰۸۷	-۰.۹۸	۲.۰	۲۰%	۳,۶۷۹	۳,۰۵۵	۱,۸۲۱	۷.۱	۱۰۱	۵,۵۰۰	طهای ۷۰۲۱

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
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۸۷.۳	(۳۴%)	۸۶۲	۱,۳۰۶	۳	۴۶.۱	۵۹	۸۶۵	طستا۴ ۶۰۰۴
(۸۴%)	۲	-۰.۰۳	۹۵.۸	(۱۹%)	۱,۰۵۴	۱,۳۰۶	۱۱	۱۳۳.۰	۵۹	۱,۰۶۵	طستا۶ ۶۰۰۶
(۵۳%)	۹	-۰.۱۰	۶۰.۳	(۱۲%)	۱,۱۴۶	۱,۳۰۶	۱۹	۴.۹	۵۹	۱,۱۶۵	طستا۷ ۶۰۰۷
(۸%)	۱۳۲	-۰.۷۰	۹.۲	۱%	۱,۳۲۲	۱,۳۰۶	۱۴۳	۸۲۷.۷	۵۹	۱,۴۶۵	طستا۱۰ 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

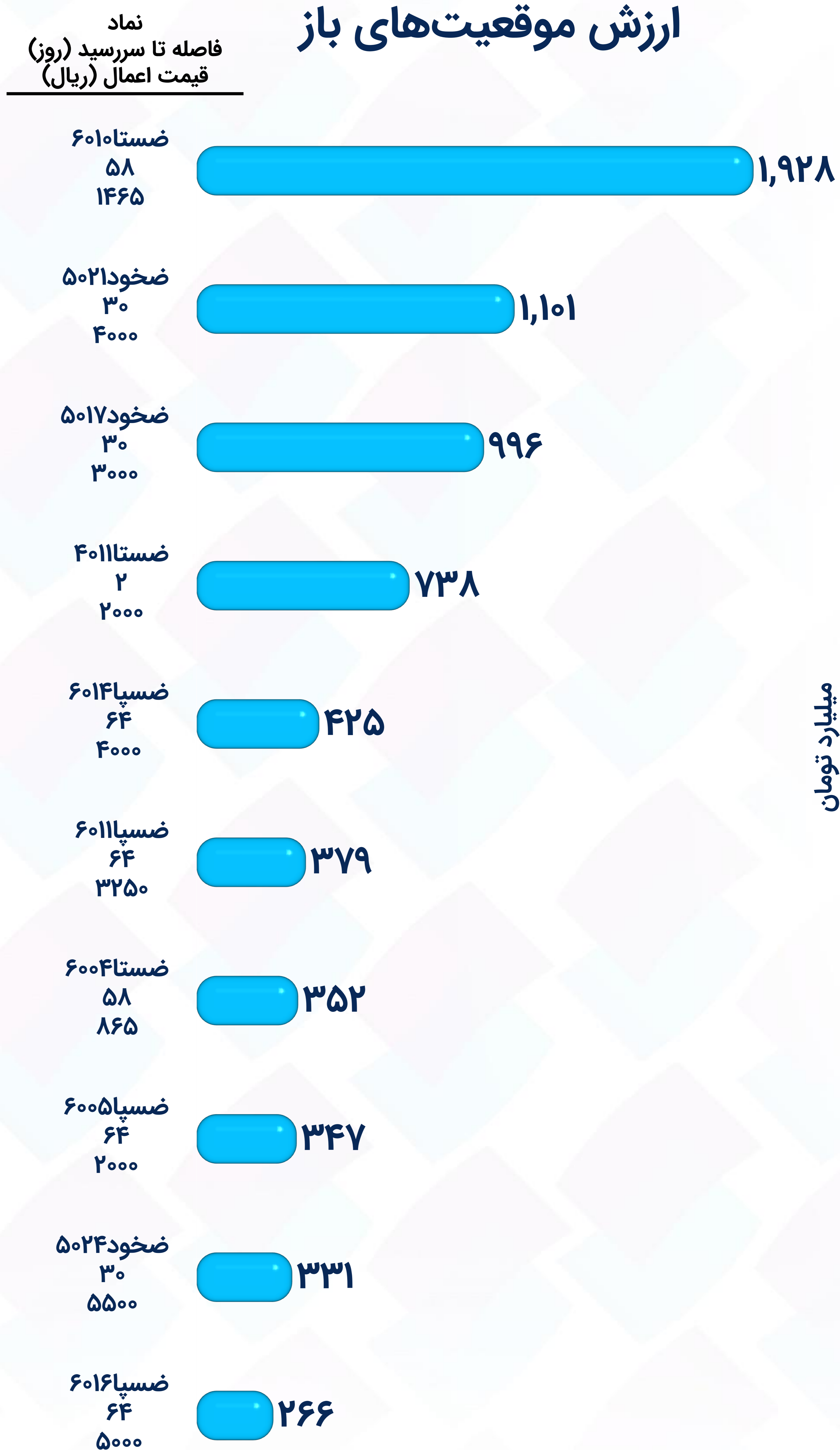
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

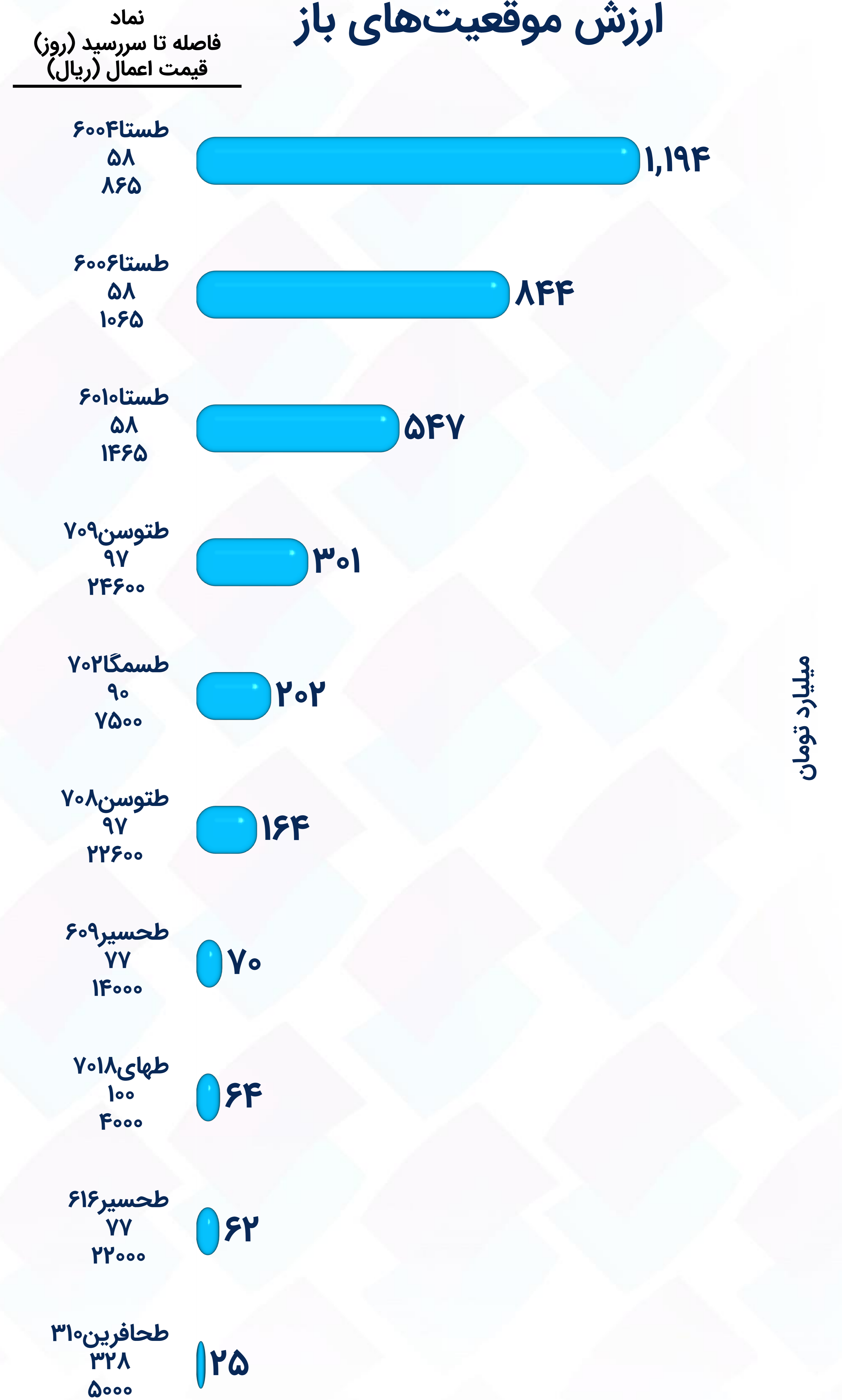
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

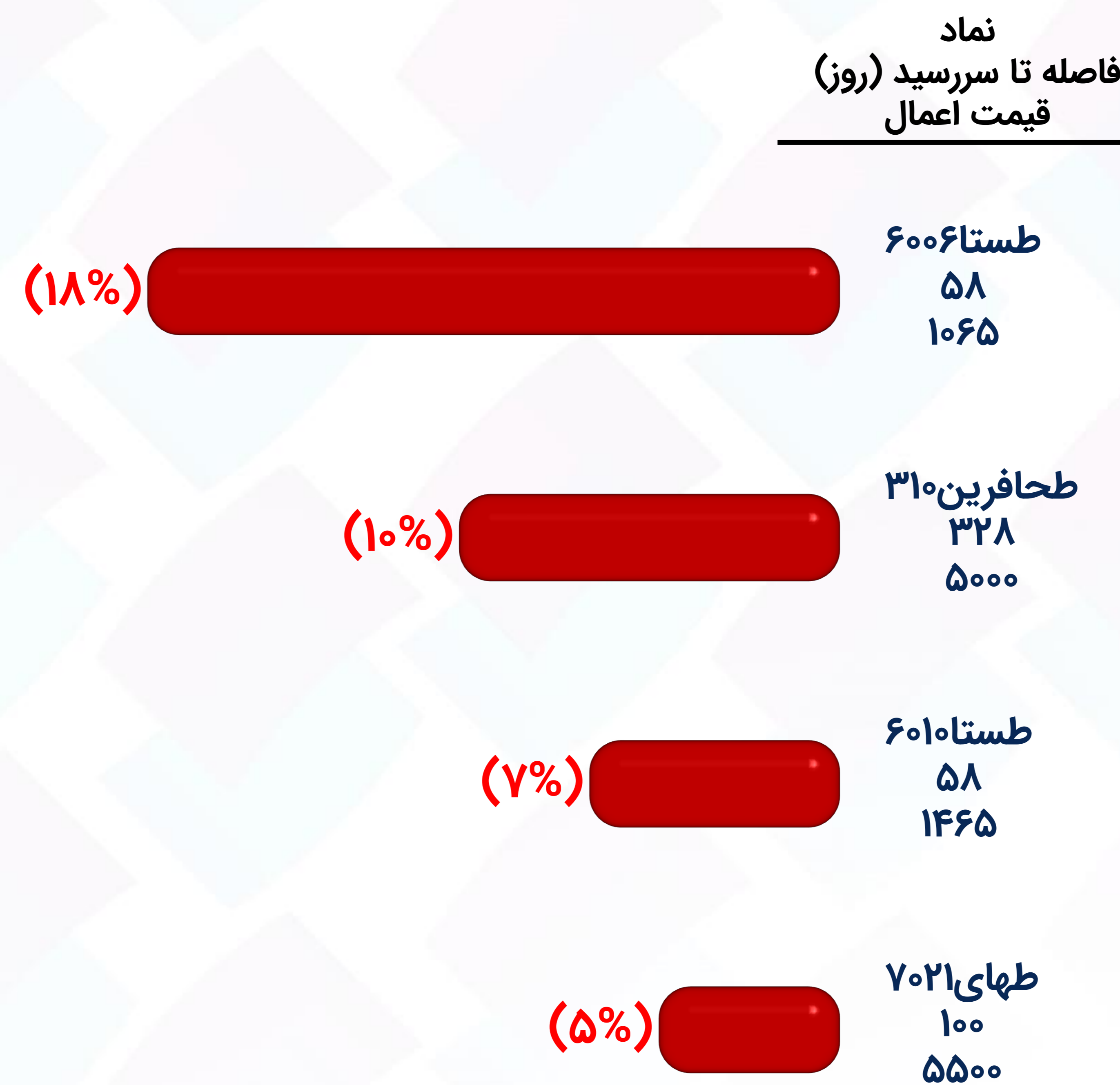


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

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.