

شماره
۴۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۴ تیر ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

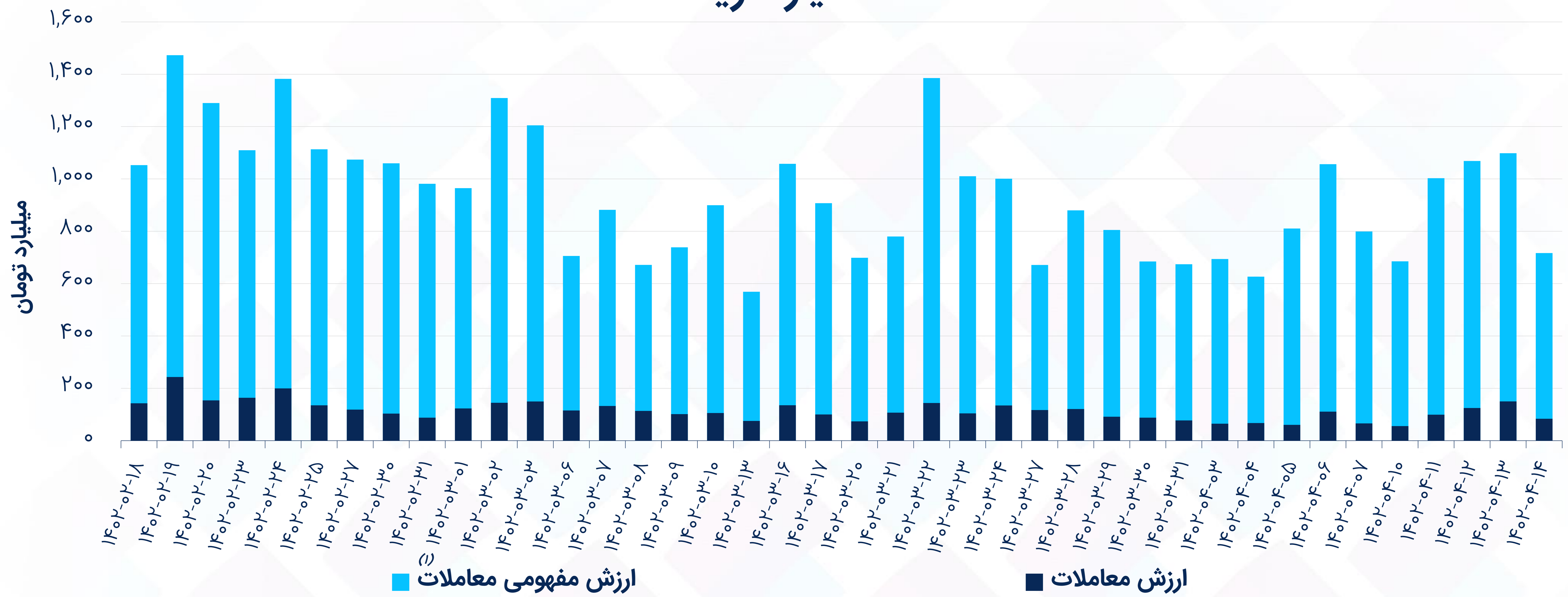




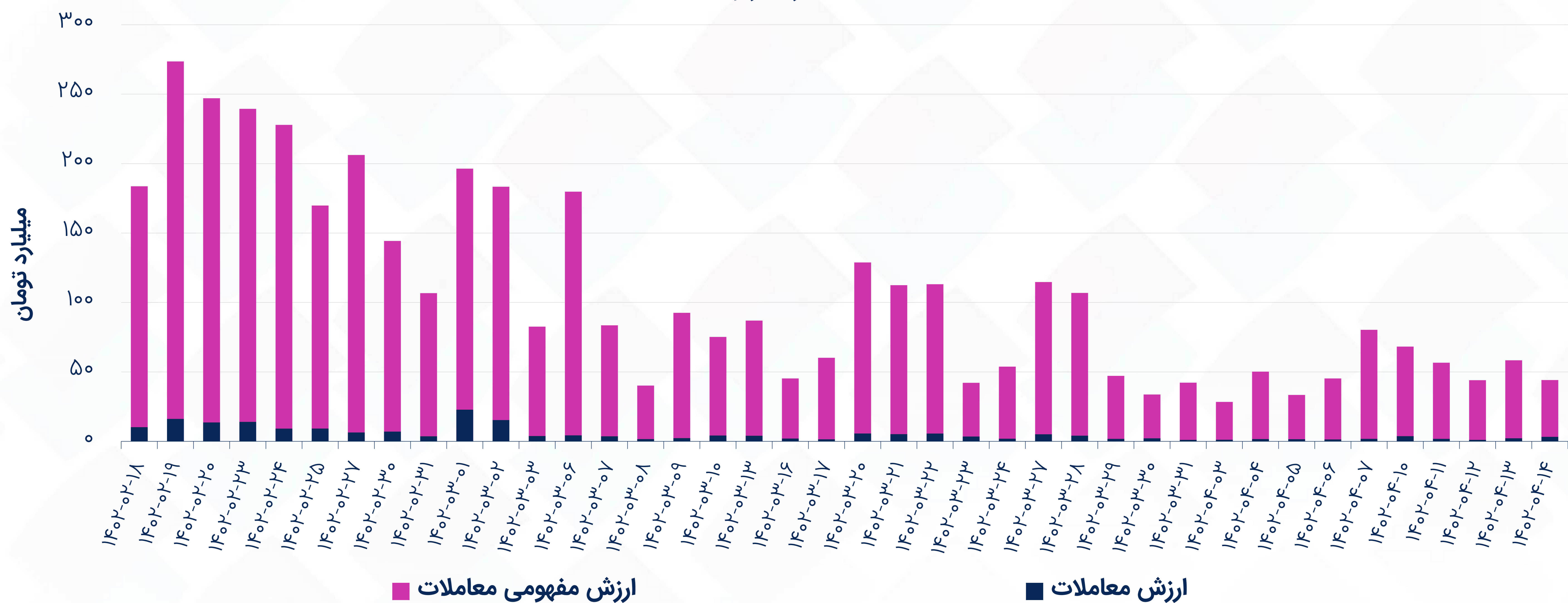
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



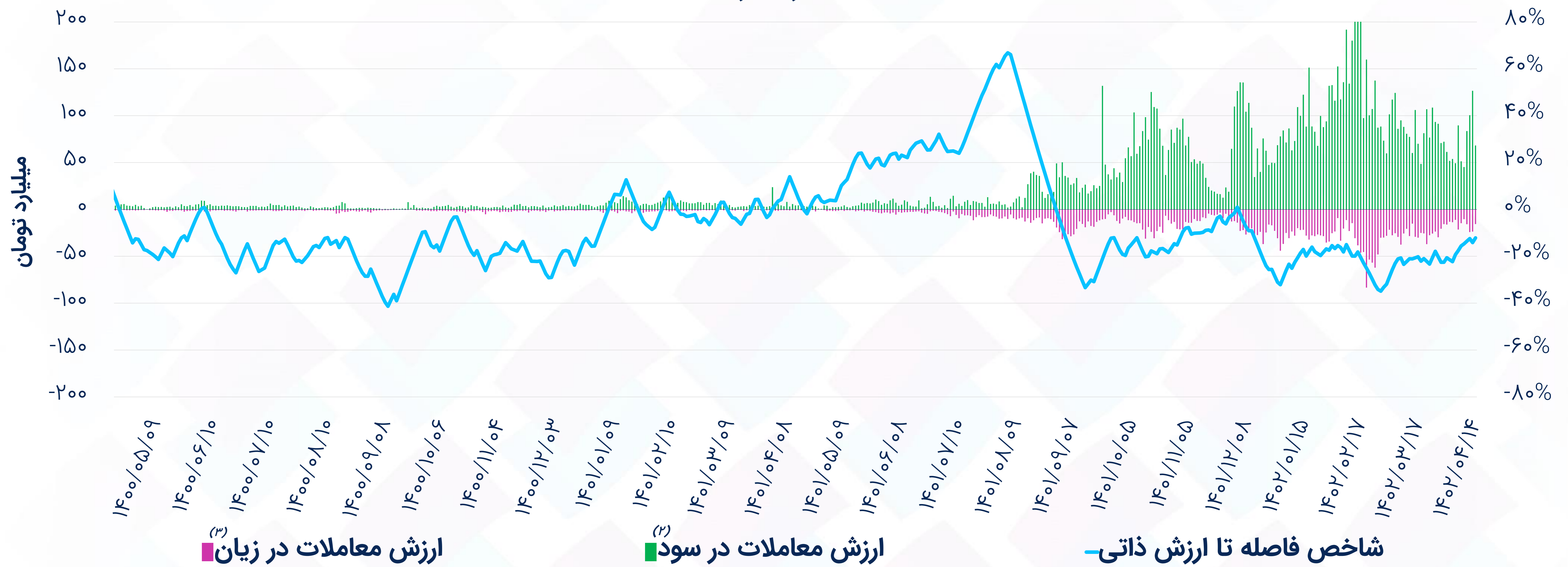
اختیار فروش



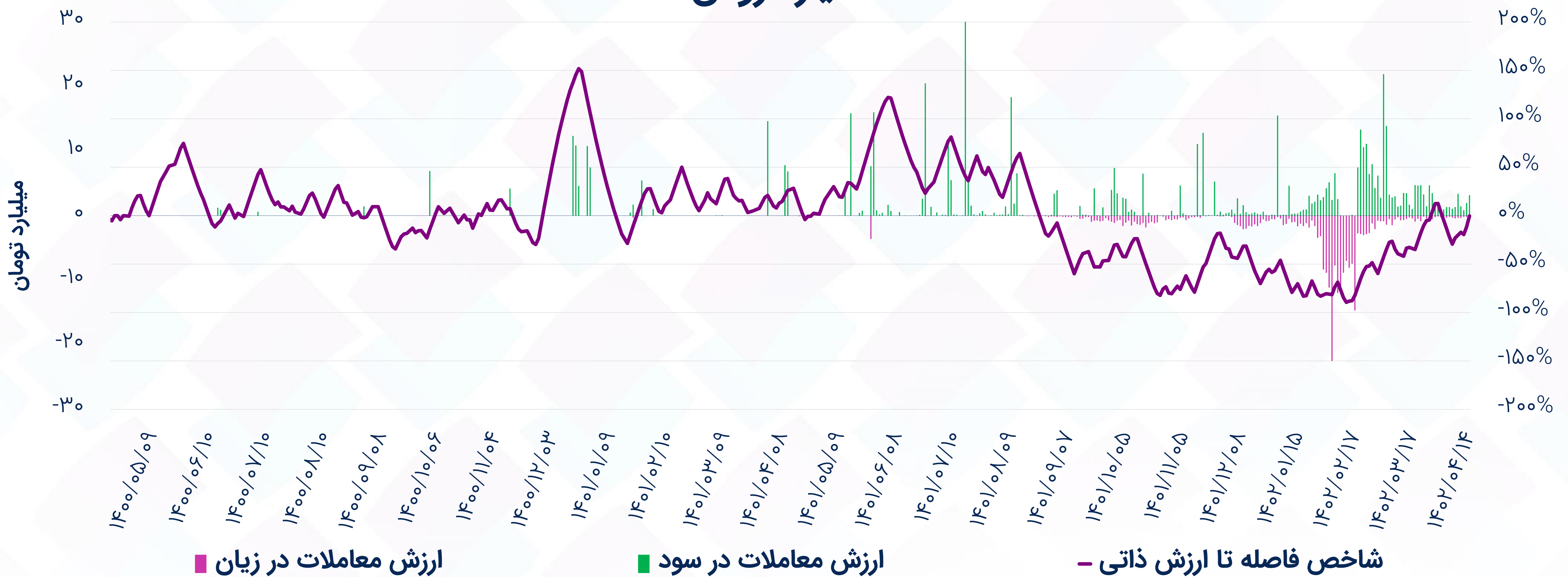
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

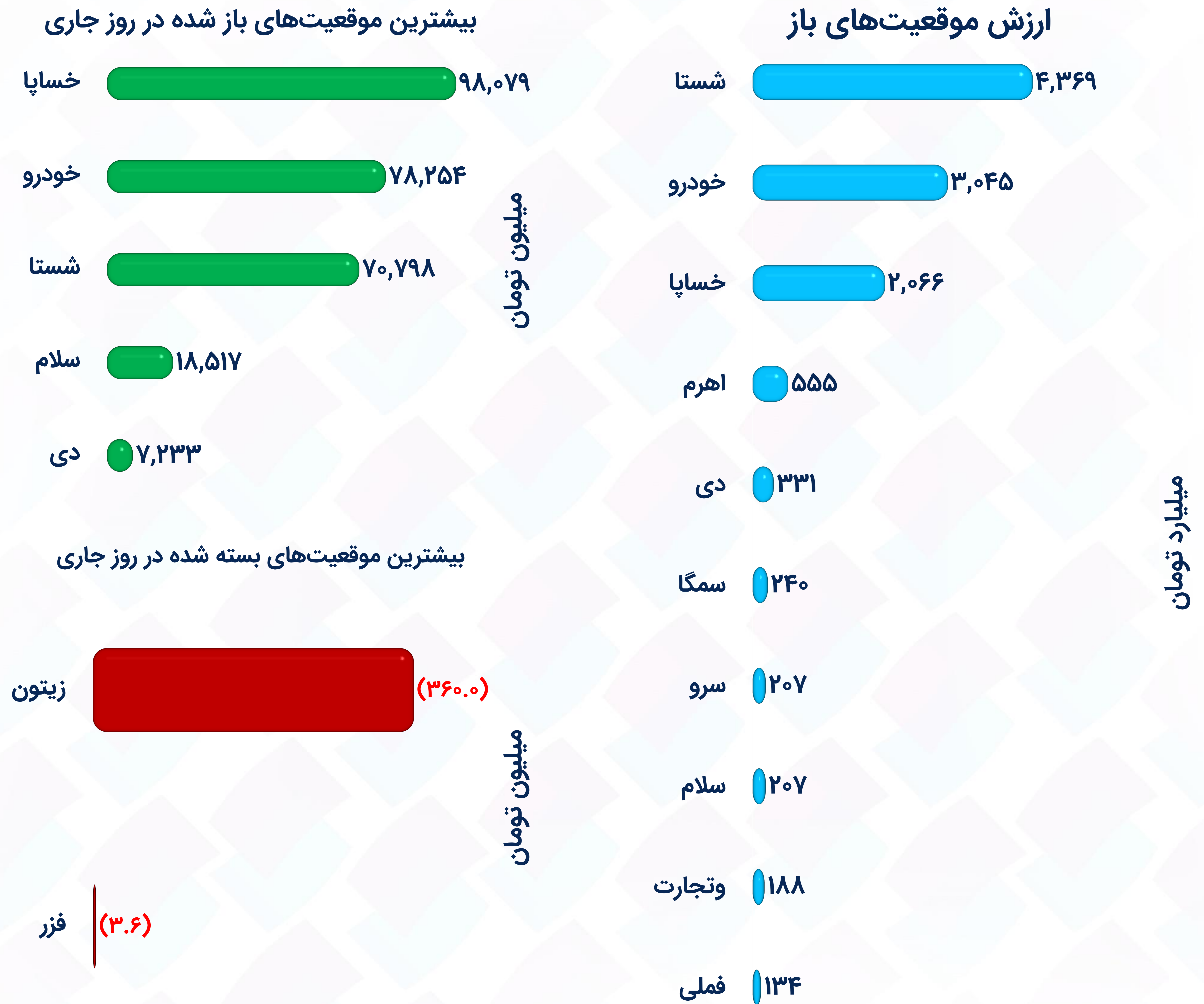
اختیار خرید

| 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 |
|--------|----------------------------|---------------------------------|--|--|---|-------------------------------|
| شستا | ۳۴ | ۲۸.۷ | ۱۶۹.۴ | ۲۳.۹ | ۴.۸ | (۱۱.۶%) |
| خودرو | ۲۹ | ۲۲.۱ | ۳۰۷.۸ | ۲۱.۰ | ۱.۱ | (۱۵.۱%) |
| خسپا | ۱۷ | ۲۰.۱ | ۱۸۰.۱ | ۱۱.۹ | ۸.۳ | (۱۱.۸%) |
| اهرم | ۱۹ | ۴.۲ | ۹.۵ | ۳.۸ | ۰.۴ | (۵.۵%) |
| دی | ۱۶ | ۳.۳ | ۱۸.۸ | ۲.۶ | ۰.۷ | (۲۱.۳%) |
| خپارس | ۷ | ۱.۲ | ۳.۸ | ۱.۲ | ۰.۰ | (۱۳.۵%) |
| فیروزه | ۱۰ | ۰.۸ | ۹.۰ | ۰.۷ | ۰.۱ | ۱۳.۰% |

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 | ۳,۲۰۲.۵ | ۴۴,۱۰۳.۵ | ۳,۱۷۰.۱ | ۳۲.۴ | (۰.۳%) |
| های وب | ۱ | ۱۰.۹ | ۱۷.۰ | ۱۰.۹ | ۰.۰ | ۳.۷% |
| خودرو | ۳ | ۰.۳ | ۱.۶ | ۰.۳ | ۰.۰ | ۰.۸% |

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



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



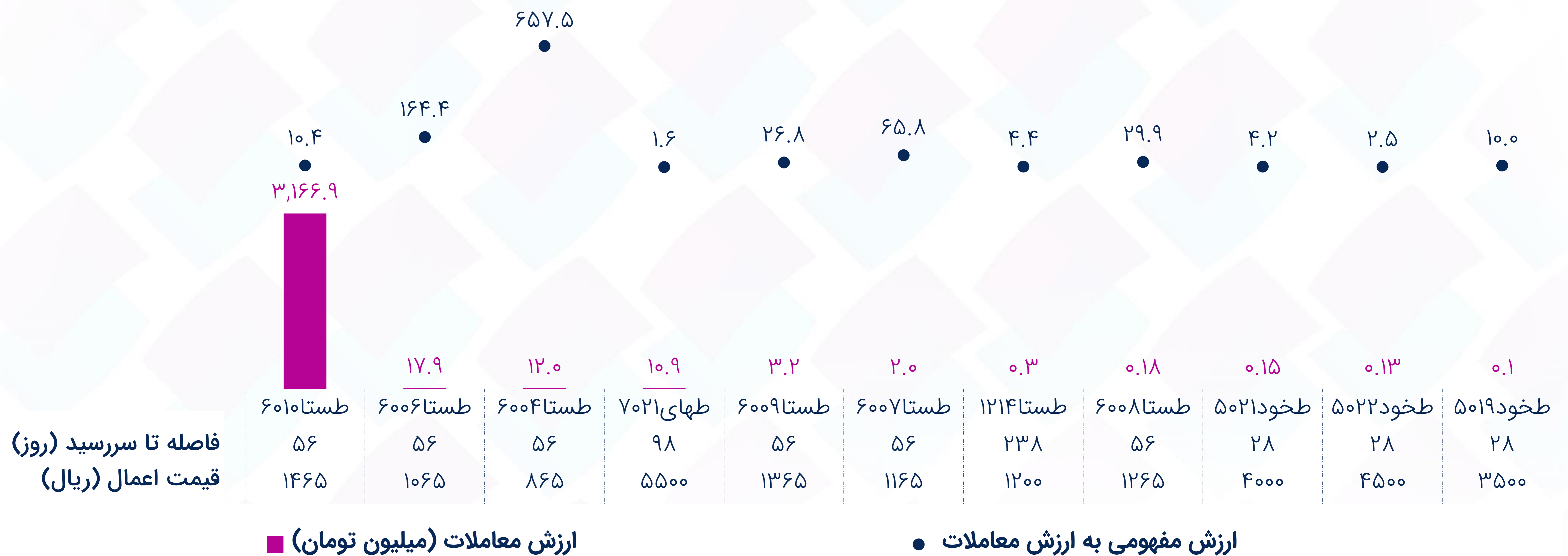
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بک شولز

| فاصله تا ارزش ذاتی | ارزش ذاتی (بک 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 |
|--------------------|---------------------|------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|------------|
| ۱۲۹% | ۵۷۴ | ۰.۸۲ | ۷۲.۷ | (۰.۶%) | ۱۸,۲۵۱ | ۱۸,۳۷۰ | ۲۵۱ | ۵.۱ | ۱۲ | ۱۸,۰۰۰ | زیتون ۴۰۰۶ |
| ۱۲۷% | ۷,۰۷۶ | ۰.۸۰ | ۷.۴ | ۲.۷% | ۲۳,۱۲۰ | ۲۲,۵۱۰ | ۳,۱۲۰ | ۱۵.۹ | ۲۵۳ | ۲۰,۰۰۰ | اهرم ۱۲۲۴ |
| ۷۸% | ۷,۱۱۰ | ۰.۸۶ | ۵.۰ | ۰.۶% | ۲۰,۰۰۰ | ۱۹,۸۷۴ | ۴,۰۰۰ | ۱.۶ | ۲۴۴ | ۱۶,۰۰۰ | توان ۱۲۰۱ |
| ۴۴% | ۳,۸۳۷ | ۱.۰۰ | ۲.۴ | (۱۳.۳%) | ۶,۳۳۱ | ۷,۳۰۰ | ۲,۶۶۴ | ۲۱.۲ | ۸۵ | ۳,۶۶۷ | فملی ۷۰۲۵ |
| ۱۳% | ۶,۴۳۹ | ۱.۰۰ | ۲.۹ | (۰.۱%) | ۱۶,۷۱۴ | ۱۶,۷۳۰ | ۵,۷۱۴ | ۳۲.۶ | ۹۹ | ۱۱,۰۰۰ | سلام ۷۰۰۵ |

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 | ۲,۷۵۱.۰ | ۷۴% | ۵,۵۰۲ | ۳,۱۷۱ | ۲ | ۱۰.۶ | ۲۹ | ۵,۵۰۰ | خودرو ۵۰۲۴ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۳۰۱.۰ | ۷۱% | ۱۵,۰۵۰ | ۸,۸۲۰ | ۵۰ | ۵.۶ | ۵۰ | ۱۵,۰۰۰ | شپنا ۶۰۱۰ |
| (۹۹%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱,۲۵۱.۰ | ۵۸% | ۵,۰۰۴ | ۳,۱۷۱ | ۴ | ۲.۸ | ۲۹ | ۵,۰۰۰ | خودرو ۵۰۲۳ |
| (۹۹%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱۲۰.۶ | ۷۵% | ۵,۵۴۶ | ۳,۱۷۱ | ۴۶ | ۲۴.۱ | ۵۷ | ۵,۵۰۰ | خودرو ۶۰۲۲ |
| (۹۵%) | ۱ | ۰.۰۱ | ۲۰۱.۰ | ۷۱% | ۵,۰۲۵ | ۲,۹۴۵ | ۲۵ | ۶۰.۰ | ۶۳ | ۵,۰۰۰ | خسپا ۶۰۱۶ |

(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 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 |
|--------------------|---------------------|-------|------|-------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|-------------|
| ۳۴.۸% | ۶۶ | -۰.۴۷ | ۲۶.۹ | ۰% | ۱,۳۱۶ | ۱,۳۱۵ | ۴۹ | ۳.۲ | ۵۷ | ۱,۳۶۵ | شستا ۶۰۰۹ |
| ۳.۷% | ۲,۰۶۲ | -۰.۹۸ | ۱.۸ | ۱۴% | ۳,۵۱۱ | ۳,۰۸۹ | ۱,۹۸۹ | ۱۰.۹ | ۹۹ | ۵,۵۰۰ | های وب ۷۰۲۱ |
| ۰.۶% | ۱۲۷ | -۰.۶۹ | ۱۰.۶ | ۲% | ۱,۳۳۹ | ۱,۳۱۵ | ۱۲۶ | ۳,۱۶۶.۹ | ۵۷ | ۱,۴۶۵ | شستا ۶۰۱۰ |

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 | ۴۳۱.۵ | (۳۴%) | ۸۶۳ | ۱,۳۱۵ | ۲ | ۱۲.۰ | ۵۷ | ۸۶۵ | شستا ۶۰۰۴ |
| (۸۲%) | ۱ | -۰.۰۲ | ۱۳۲.۱ | (۲۰%) | ۱,۰۵۷ | ۱,۳۱۵ | ۸ | ۱۷.۹ | ۵۷ | ۱,۰۶۵ | شستا ۶۰۰۶ |
| (۶۱%) | ۸ | -۰.۰۹ | ۵۷.۳ | (۱۳%) | ۱,۱۴۵ | ۱,۳۱۵ | ۲۰ | ۲.۰ | ۵۷ | ۱,۱۶۵ | شستا ۶۰۰۷ |

(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

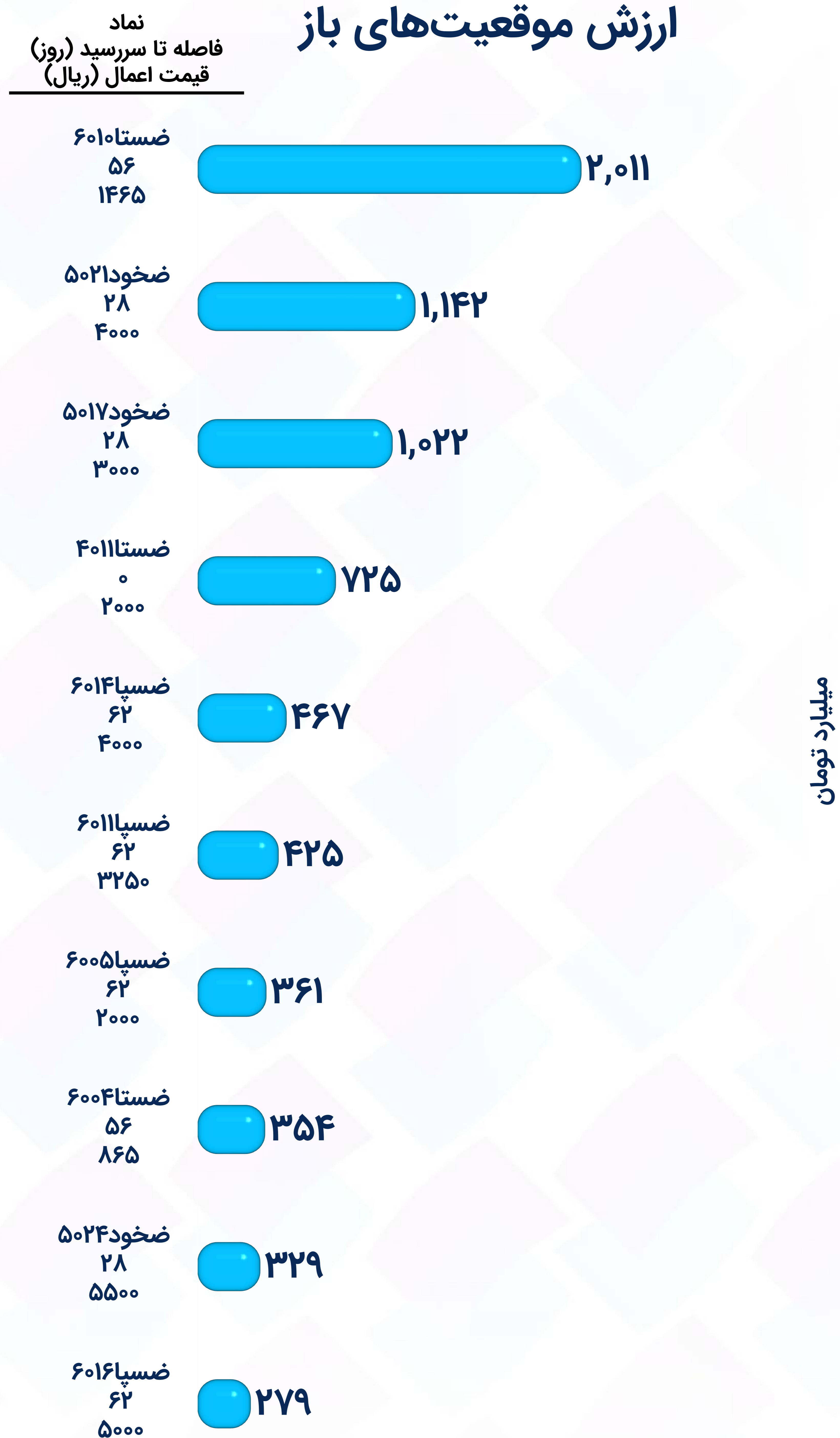
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

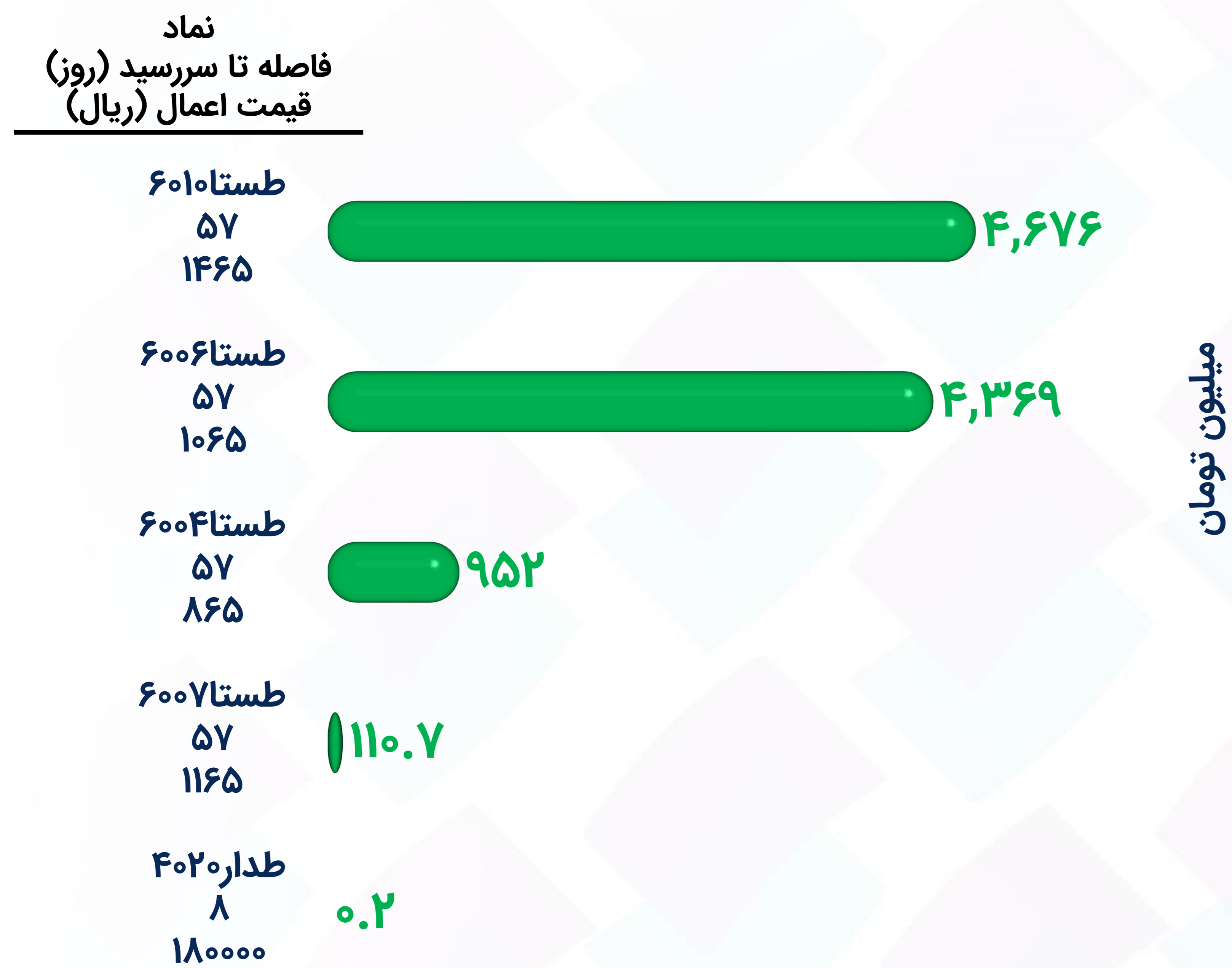


ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

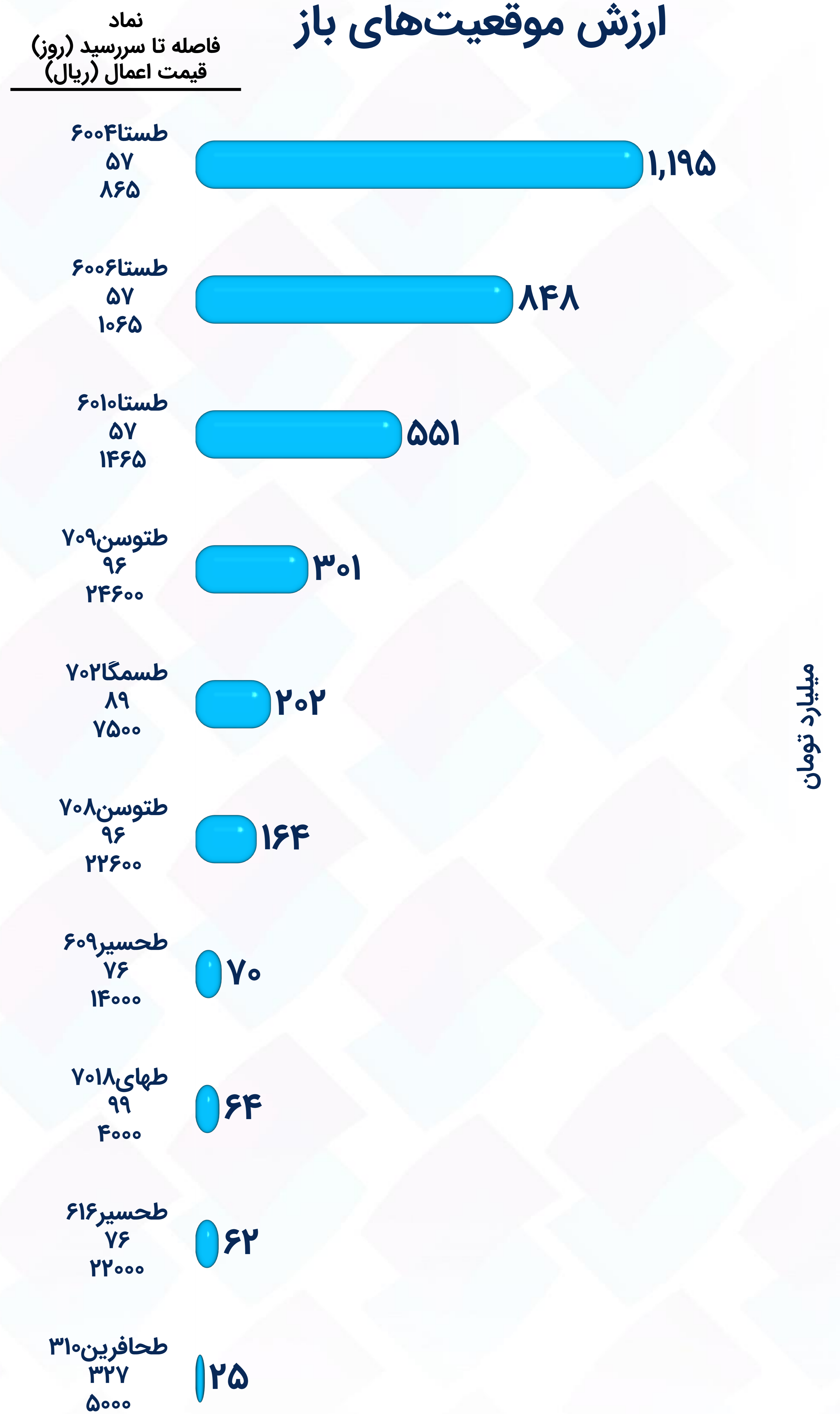
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

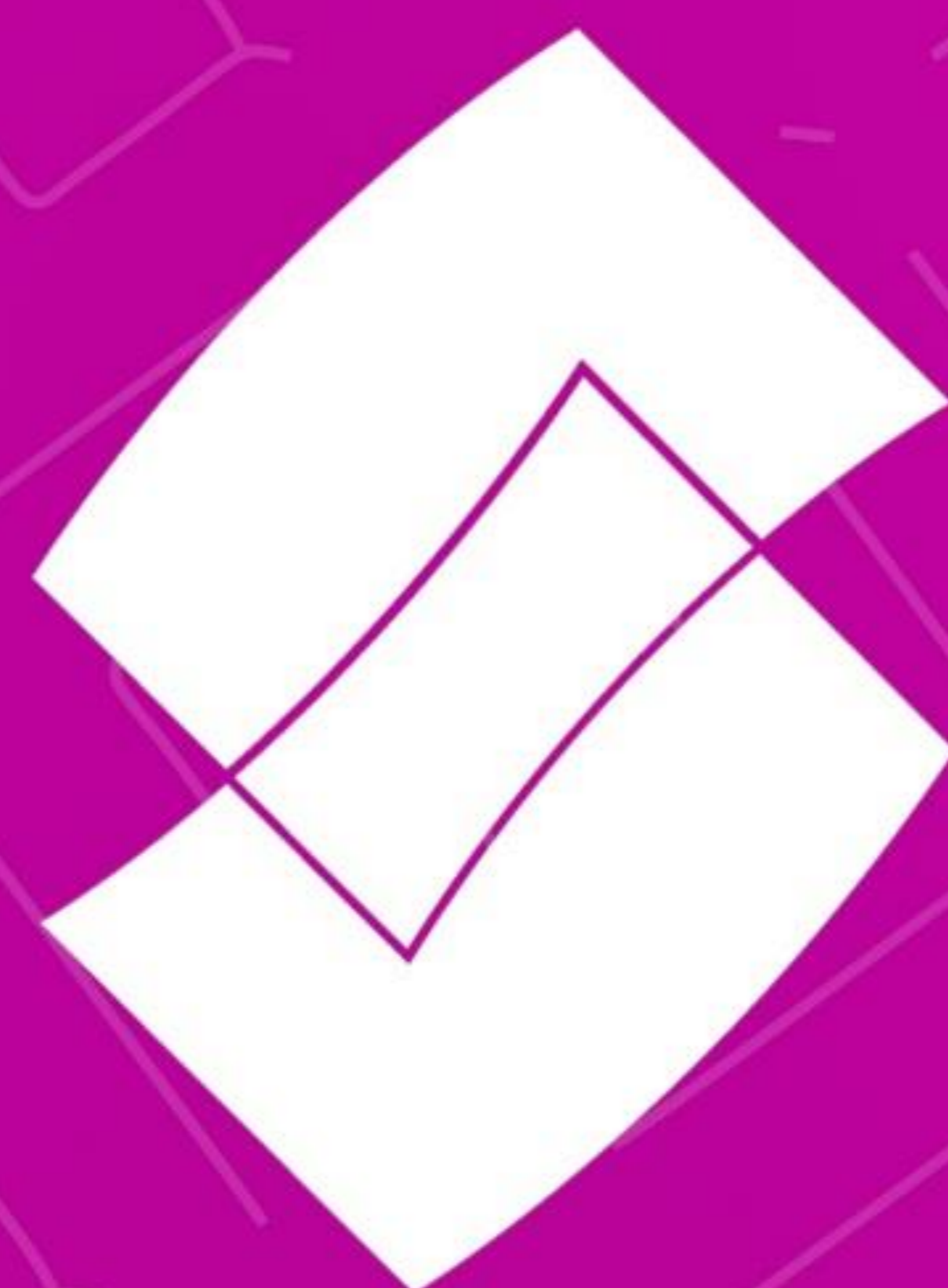
اختیار خرید



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.