

شماره

۸۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۱ شهریور ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage



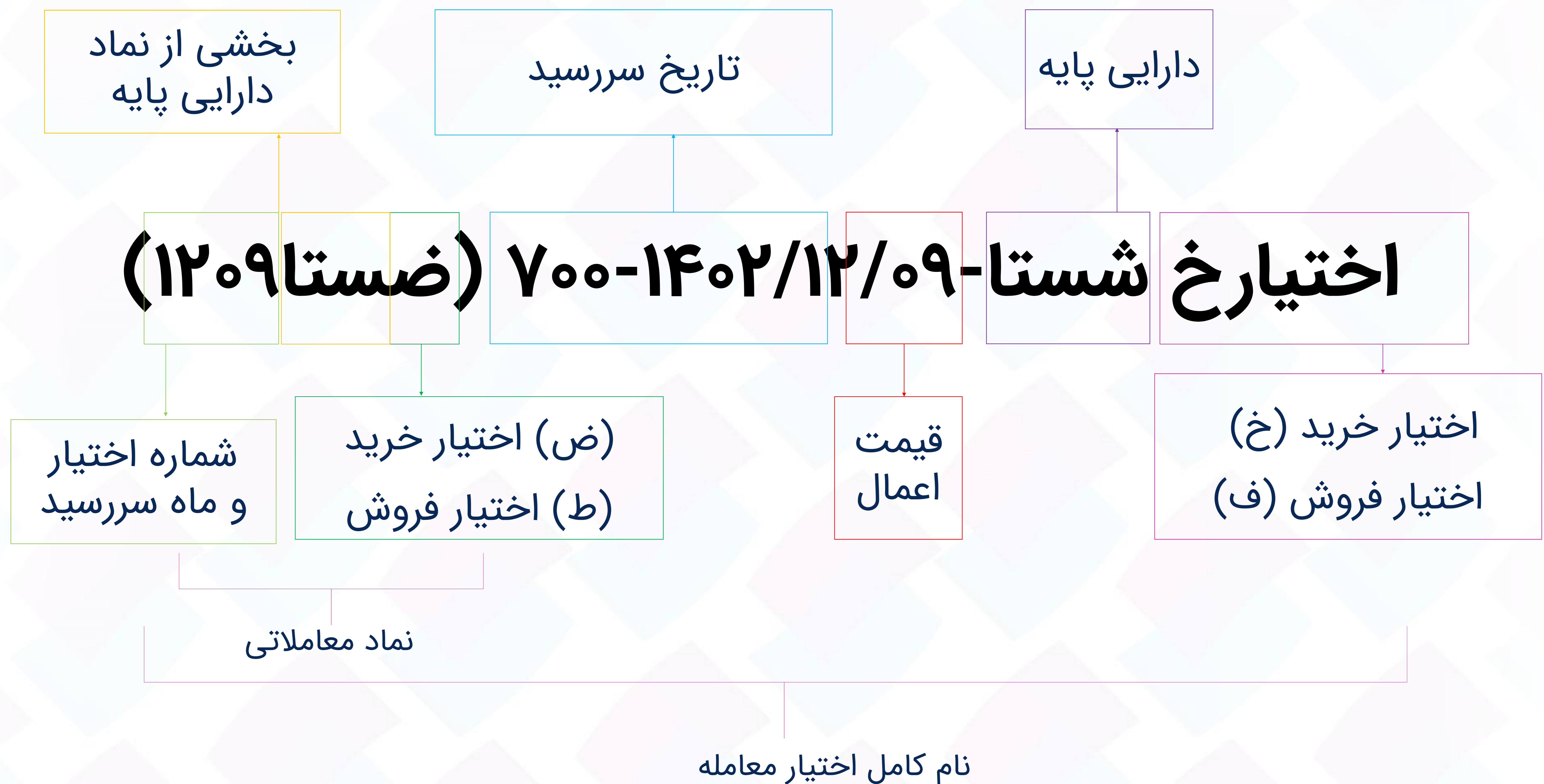


اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

آشنایی با نماد معاملاتی اوراق اختیار معامله

آموزش
قسمت نهم

اوراق اختیار معامله در دو دسته اختیار خرید و فروش قرار میگیرند. نماد معاملاتی این اوراق نشان دهنده نوع اختیار(خرید، فروش)، دارایی پایه و ماه سررسید است.

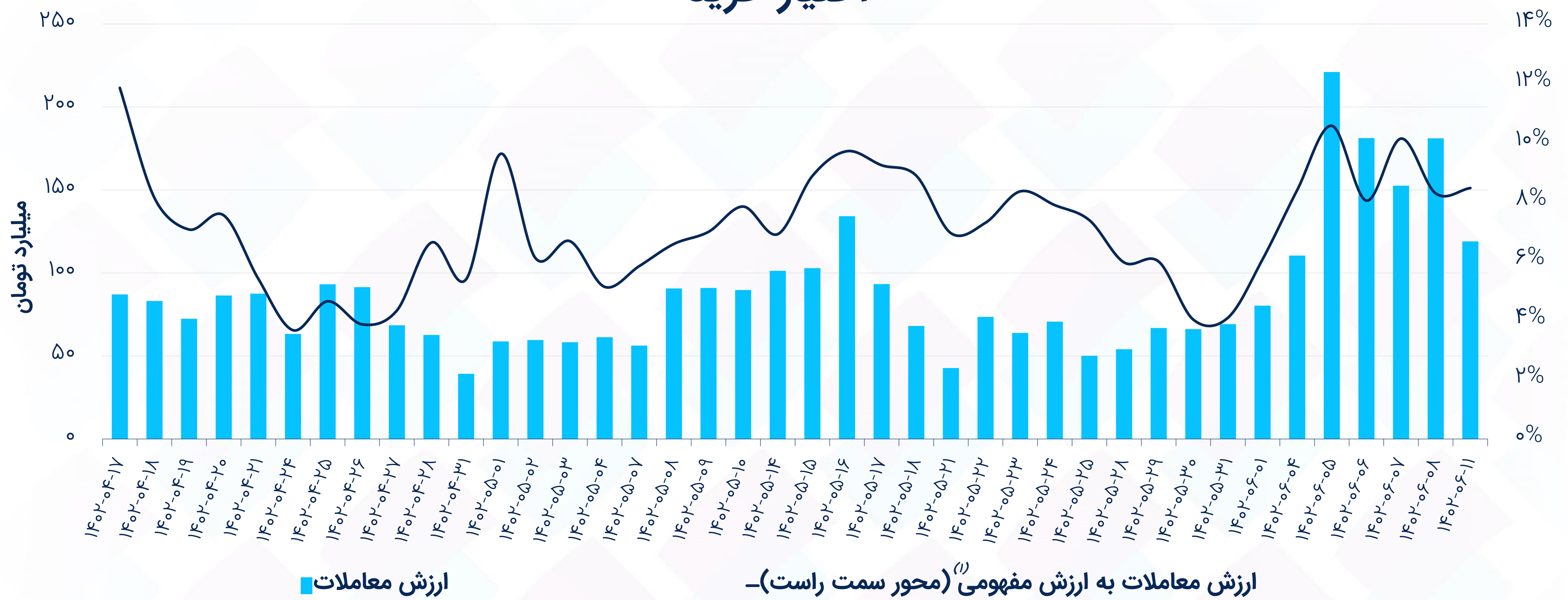


نماد معاملاتی اوراق اختیار تبعی

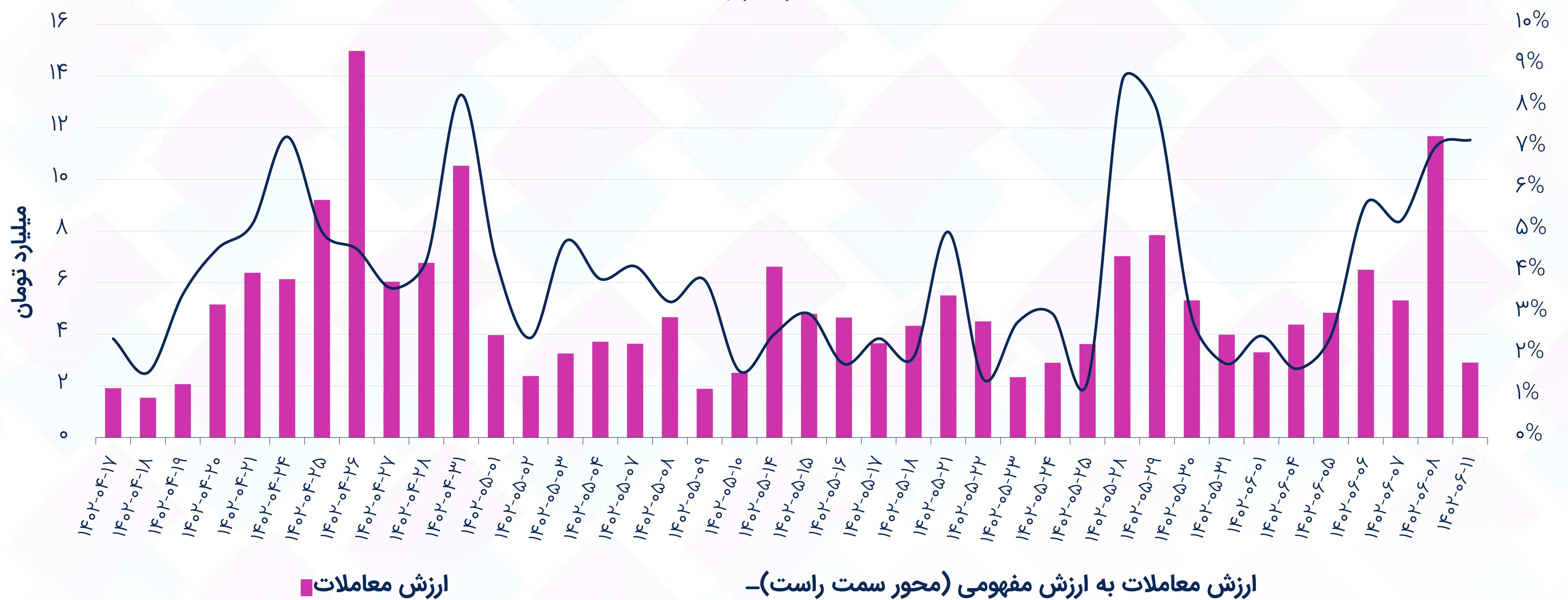


ارزش معاملات

اختیار خرید



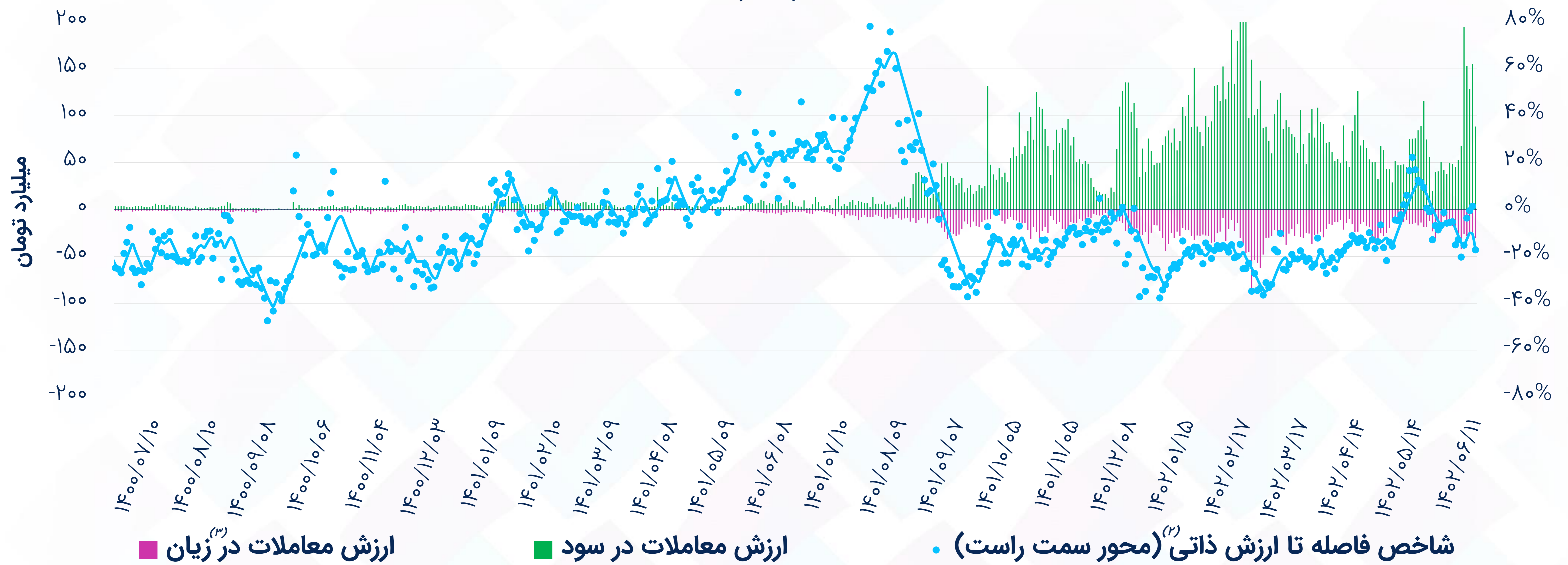
اختیار فروش



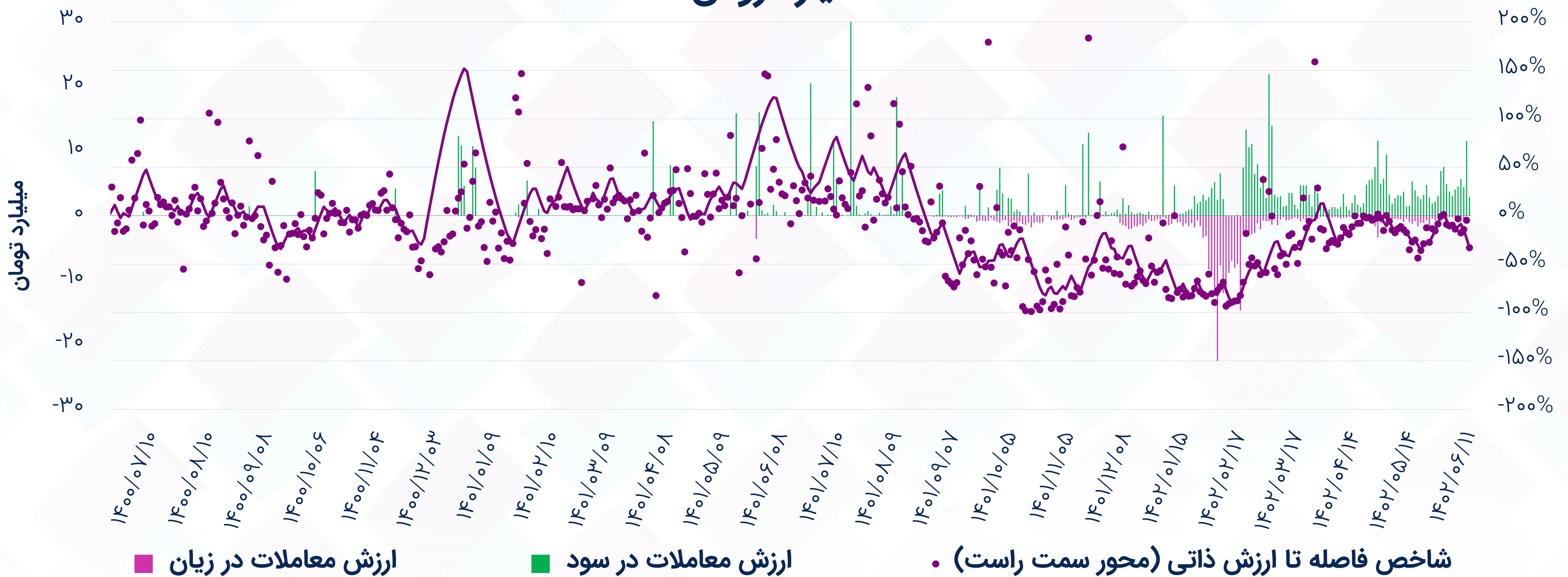
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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 خطی مربوط به داده‌های Smooth 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

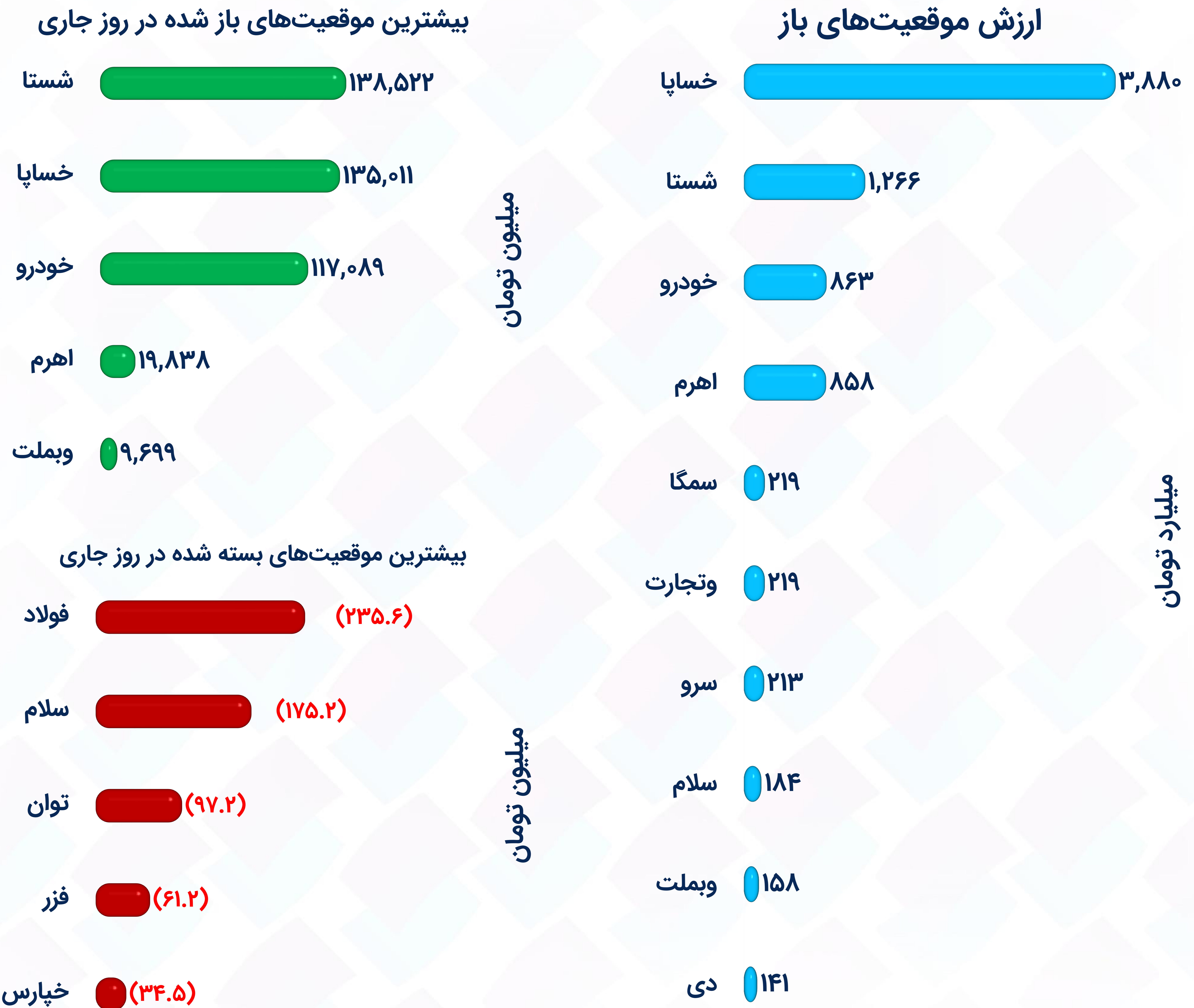
اختیار خرید

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	۲۴	۴۳.۰	۸۸۷.۷	۲۶.۴	۱۶.۶	(۲۲.۵%)
خودرو	۲۷	۴۰.۷	۲۷۱.۹	۴۰.۰	۰.۸	(۱۴.۲%)
شستا	۲۷	۱۲.۷	۱۳۳.۸	۳.۱	۹.۵	(۲۸.۱%)
اهرم	۲۱	۱۰.۰	۳۱.۹	۸.۷	۱.۲	(۳.۵%)
دی	۱۴	۴.۵	۱۴.۳	۳.۷	۰.۷	(۱۲.۹%)
وتجارت	۱۴	۲.۴	۲۶.۲	۱.۹	۰.۵	۲.۸%
وبملت	۶	۱.۱	۱۱.۸	۰.۷	۰.۴	(۶.۱%)

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	۸	۲,۸۵۱.۲	۳۹,۳۷۴.۷	۲,۸۵۰.۷	۰.۵	(۳۳.۹%)
های وب	۱	۳۰.۱	۵۸۱.۷	۳۰.۱	۰.۰	(۲.۸%)
حافرین	۱	۱۸.۳	۷۶.۶	۱۸.۳	۰.۰	۴۳.۱%
خودرو	۲	۱.۳	۲۲۷.۹	۰.۰	۱.۳	(۶۵.۲%)
شبندر	۱	۱.۱	۵.۴	۱.۱	۰.۰	۱.۱%

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

توسن ۴۶۵

سمگا ۲۰۵

حسیر ۱۳۰

های وب ۱۰۰

شستا ۴۱

خآفرین ۴۰

خودرو ۳۵

کارا ۲۰

حریل ۱۹

اهرم ۱۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۷,۶۵۶.۶

های وب ۷۱۶.۸

خودرو ۵.۲

توان ۳.۶

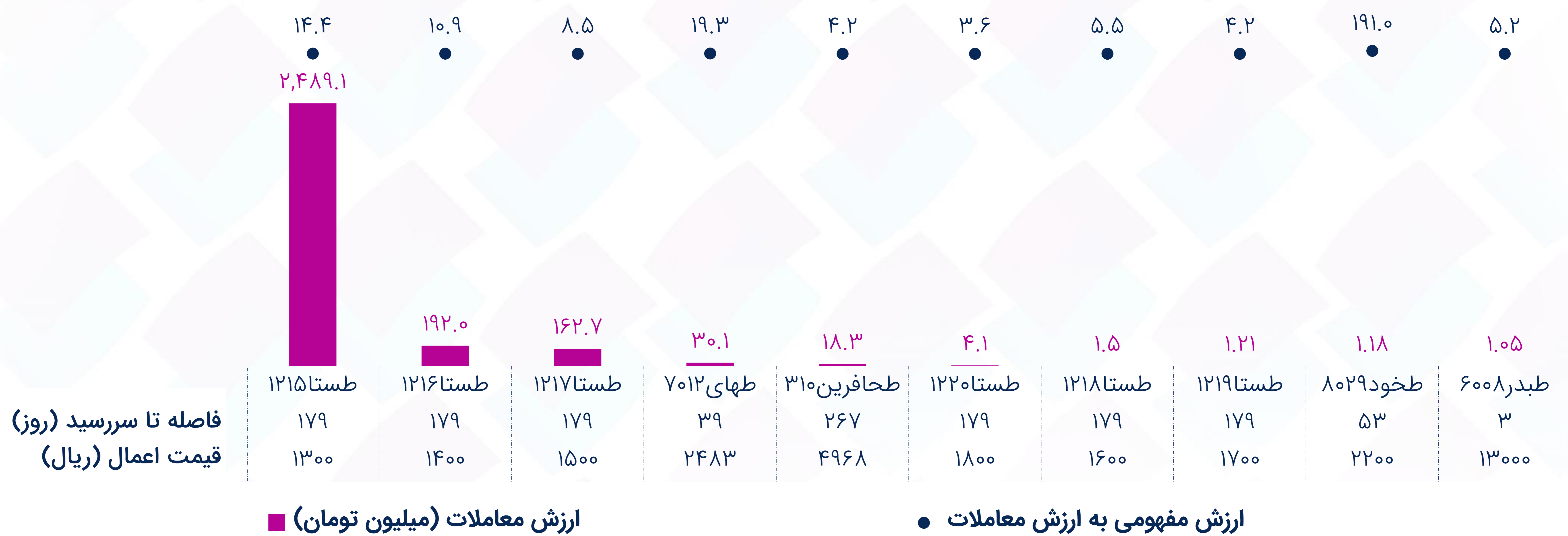
میلیون تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
ضتوسن ۷۰۵	توسن	۳۷	۳.۴	۲,۸۳۵	۲۰,۰۵۰	۱۹,۴۳۵	(۳.۱%)	۶.۹	۰.۹۹	۳,۸۸۴	۳۷%
ضجار ۶۰۰۷	وتجارت	۴	۴۰.۰	۱۱۳	۲,۴۷۸	۲,۴۵۵	(۰.۹%)	۲۱.۷	۰.۸۹	۱۴۹	۳۲%
ضفرز ۷۰۲	فزر	۵۱	۹.۲	۵,۳۸۵	۴۱,۲۰۰	۴۱,۳۸۵	۰.۴%	۷.۷	۰.۸۵	۷,۰۷۴	۳۱%
ضبدر ۱۰۰۲	شبندر	۱۲۱	۲.۵	۳,۵۲۳	۱۰,۸۴۰	۱۰,۵۲۳	(۲.۹%)	۳.۰	۰.۹۹	۴,۴۲۳	۲۶%
ضجار ۶۰۰۶	وتجارت	۴	۴۳۳.۲	۲۷۷	۲,۴۷۸	۲,۴۱۹	(۲.۴%)	۸.۷	۱.۰۰	۳۴۲	۲۴%

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
ضسپا ۶۰۱۳	خسپا	۴	۱.۸	۱	۲,۴۹۴	۳,۷۵۱	۵۰%	۳,۷۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضسپا ۶۰۱۱	خسپا	۴	۲۸.۸	۱	۲,۴۹۴	۳,۲۵۱	۳۰%	۳,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضسپا ۶۰۱۰	خسپا	۴	۲۰.۰	۱	۲,۴۹۴	۳,۰۰۱	۲۰%	۳,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۶۰۱	وتجارت	۴	۲.۱	۲	۲,۴۷۸	۲,۹۴۴	۱۹%	۱,۴۷۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۷۰۱	وبصادر	۳۳	۱.۷	۱۸	۲,۲۱۸	۳,۲۶۵	۴۷%	۱۸۱.۴	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

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طحافرین ۳۱۰	حافرین	۲۶۸	۱۸.۳	۷۶۲	۳,۱۹۱	۴,۲۰۶	۳۲%	۵.۵	-۰.۷۱	۱,۰۹۱	۴۳.۱%
طبدرا ۶۰۰۸	شبندر	۴	۱.۱	۲,۱۰۰	۱۰,۸۴۰	۱۰,۹۰۰	۱%	۵.۲	-۱.۰۰	۲,۱۲۳	۱.۱%
طهای ۷۰۱۲	های وب	۴۰	۳۰.۱	۱۲۷	۲,۴۵۶	۲,۳۵۶	(۴%)	۱۸.۶	-۰.۴۲	۱۲۳	(۲.۸%)
طستا ۱۲۲۰	شستا	۱۸۰	۴.۱	۳۵۶	۱,۲۸۲	۱,۴۴۴	۱۳%	۴.۱	-۰.۷۹	۳۳۵	(۶.۰%)
طستا ۱۲۱۷	شستا	۱۸۰	۱۶۲.۷	۱۵۰	۱,۲۸۲	۱,۳۵۰	۵%	۹.۰	-۰.۵۰	۱۴۰	(۶.۴%)

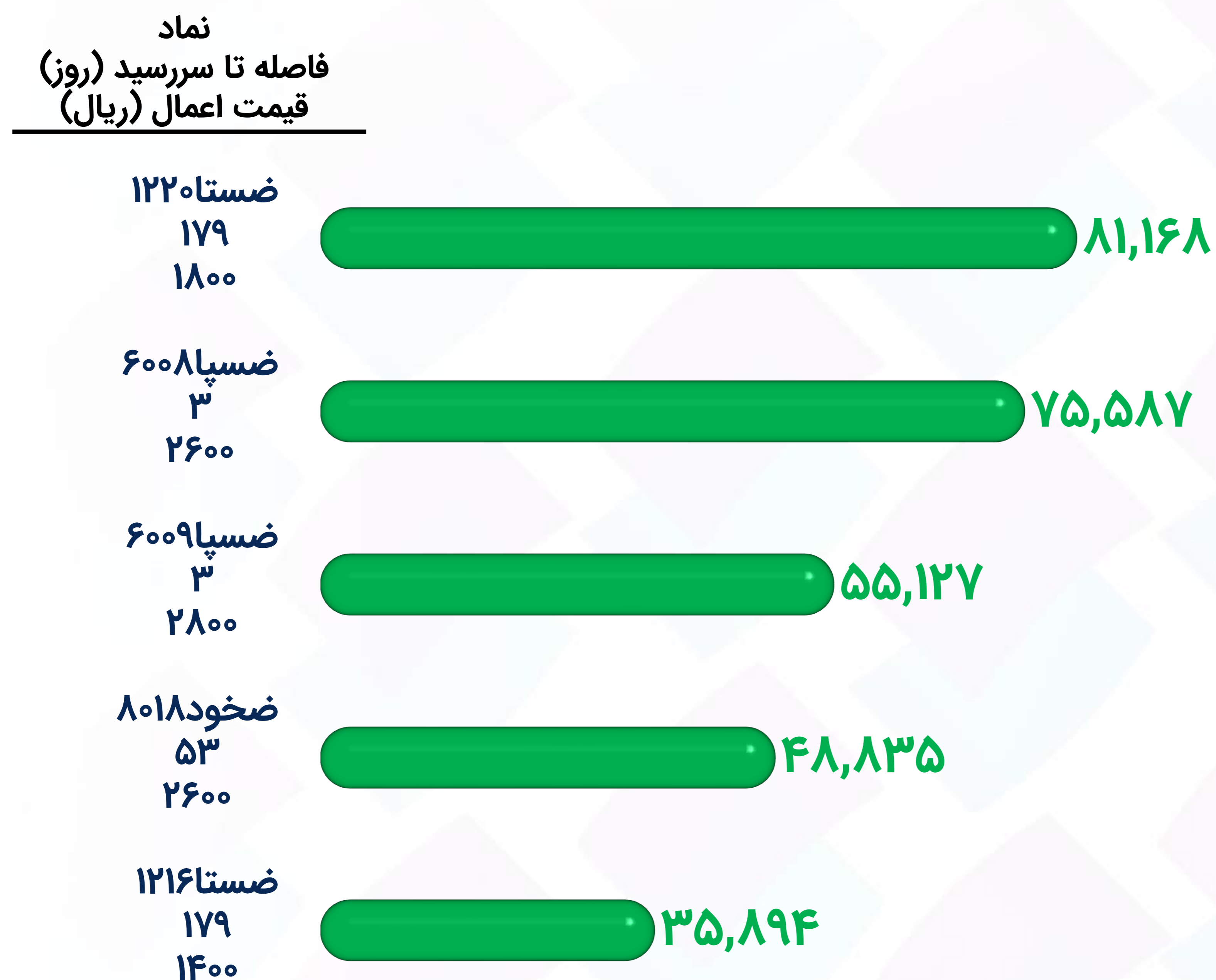
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

نماد	دارایی پایه قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طخود ۸۰۲۹	خودرو	۵۴	۱.۲	۱۵	۲,۸۶۵	۲,۱۸۵	(۲۴%)	۱۴۵.۷	-۰.۰۳	۵	(۶۴%)
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱۸۰	۲,۴۸۹.۱	۸۹	۱,۲۸۲	۱,۲۱۱	(۶%)	۱۳.۶	-۰.۲۷	۵۶	(۳۷%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱۸۰	۱۹۲.۰	۱۱۸	۱,۲۸۲	۱,۲۸۲	۰%	۱۰.۹	-۰.۳۹	۹۳	(۲۱%)
طستا ۱۲۱۸	شستا	۱۸۰	۱.۵	۲۳۳	۱,۲۸۲	۱,۳۶۷	۷%	۵.۹	-۰.۶۱	۱۹۷	(۱۵%)
طستا ۱۲۱۹	شستا	۱۸۰	۱.۲	۳۰۲	۱,۲۸۲	۱,۳۹۸	۹%	۴.۶	-۰.۷۱	۲۶۳	(۱۳%)

(۱) سربه‌سر: 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

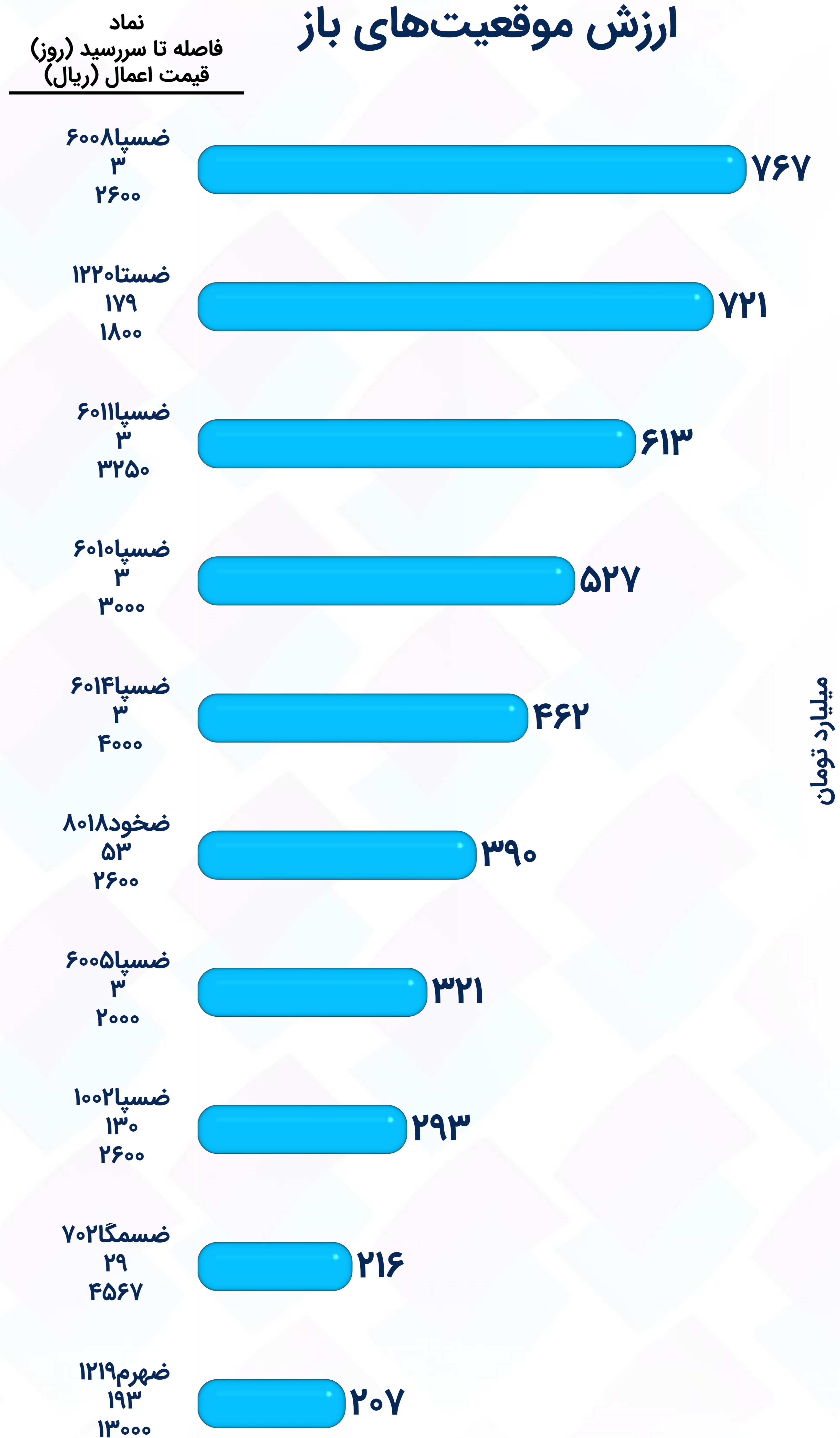
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

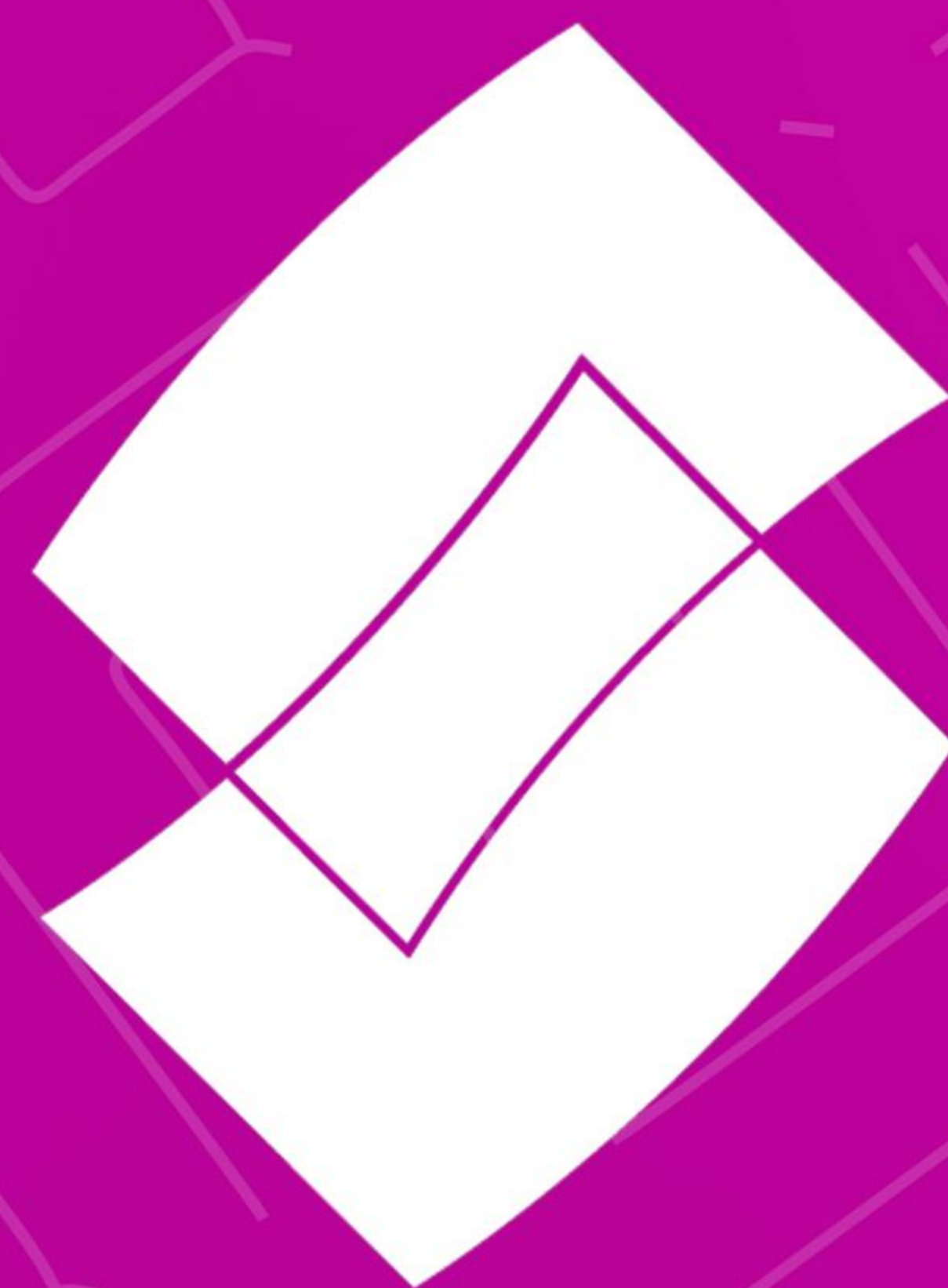
اختیار خرید



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
خیابان ولیعصر، خیابان همایون
شهنواز (گلستان)، پلاک ۱۱۰

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،
محتوای آن نباید به تنهایی جهت اتخاذ تصمیمات مالی و
سرمایه گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.