

شماره
۸۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ شهریور ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage



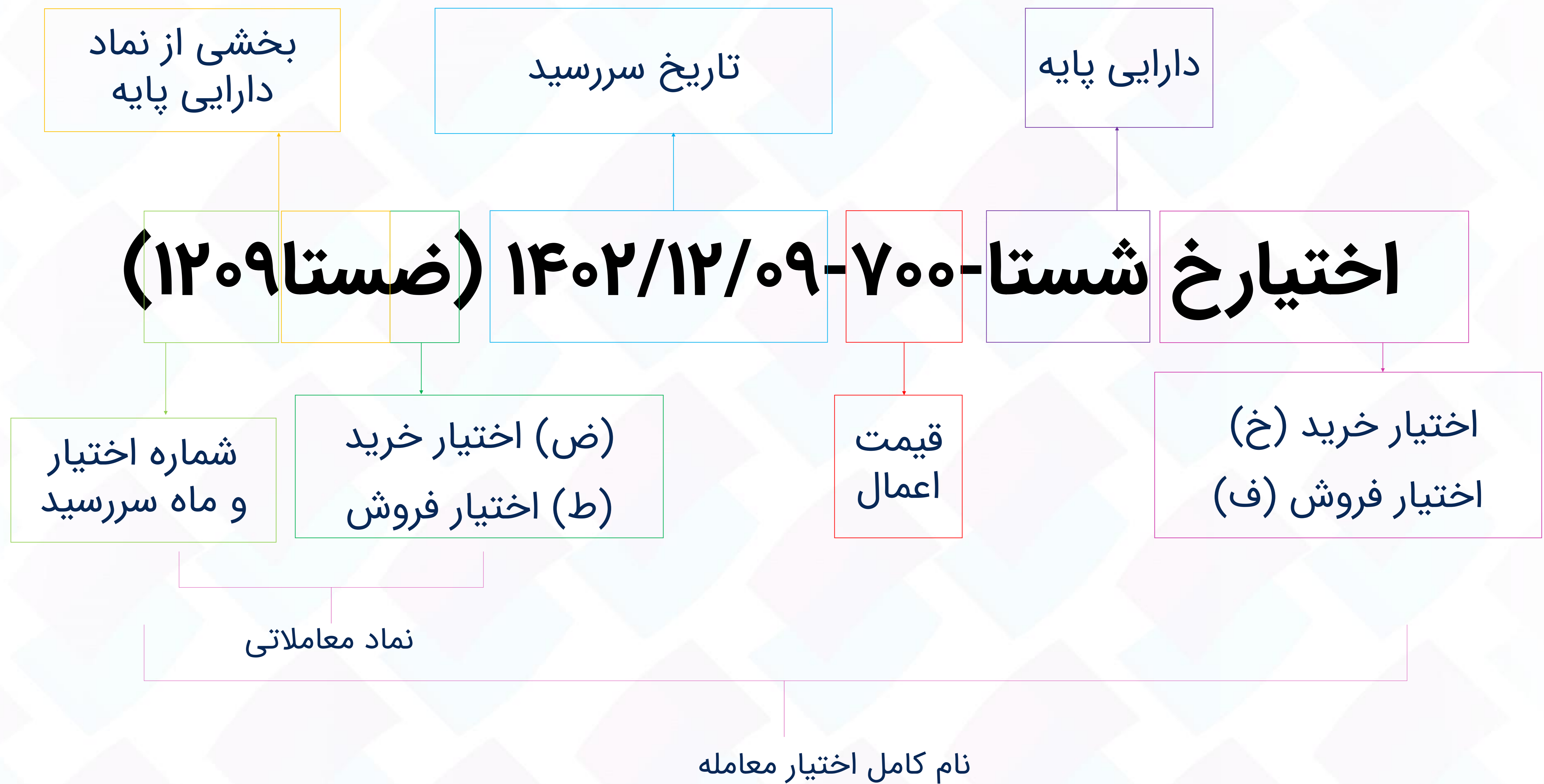


اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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.

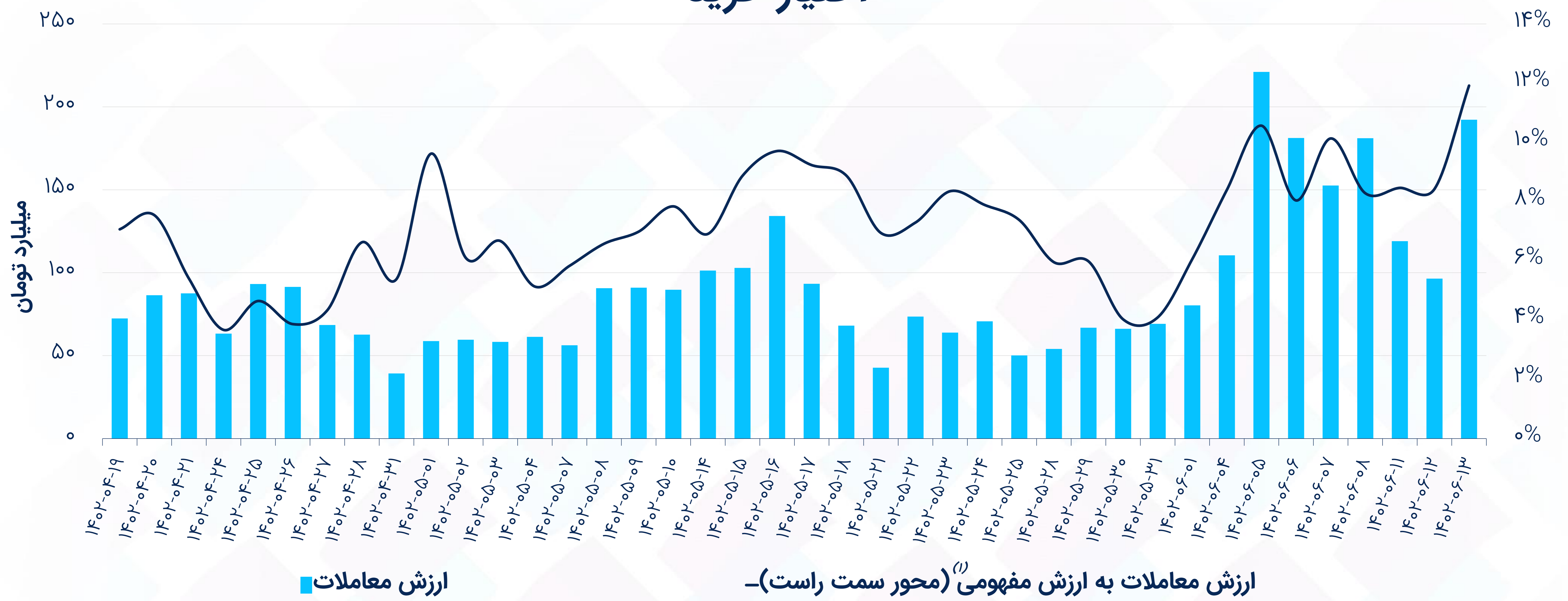


نماد معاملاتی اوراق اختیار تبعی

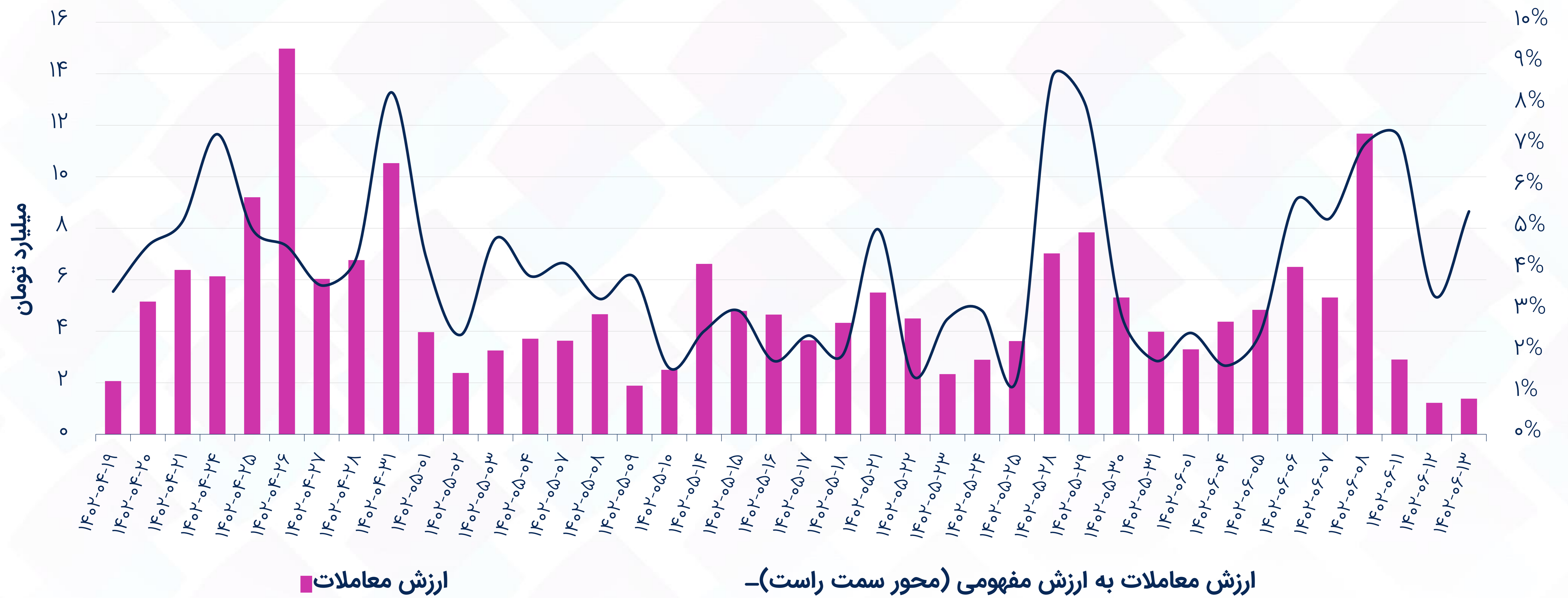


ارزش معاملات

اختیار خرید



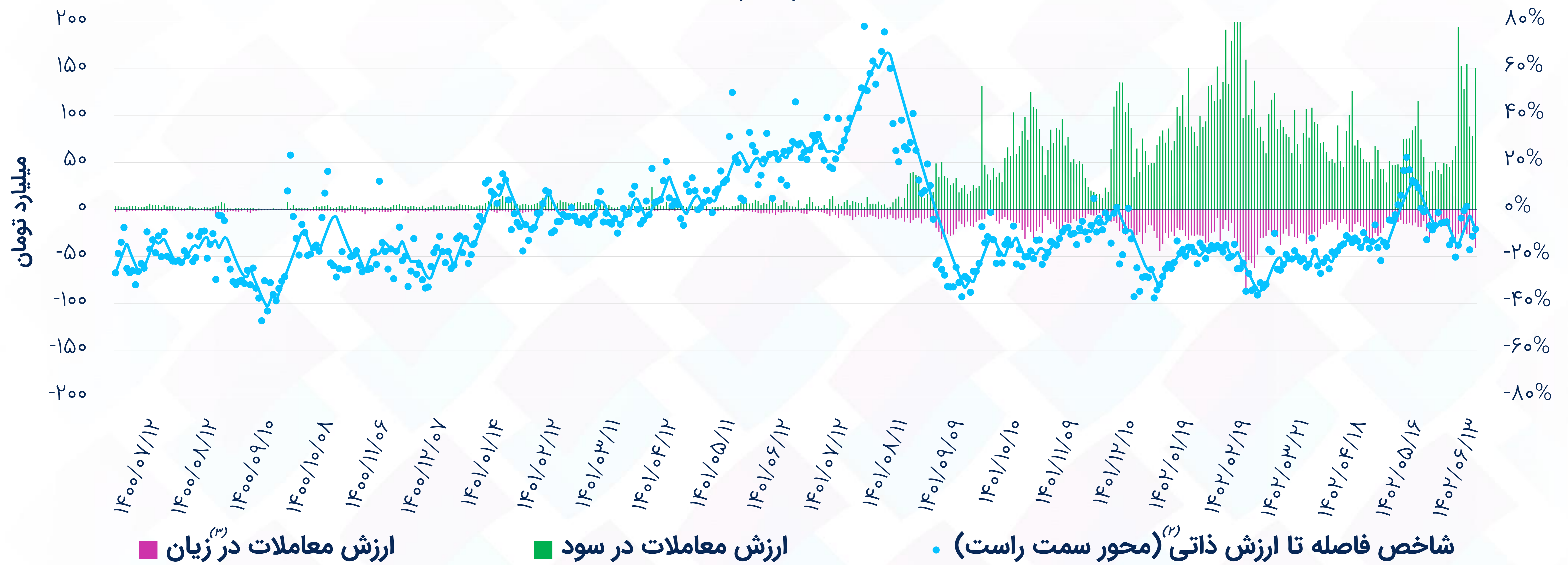
اختیار فروش



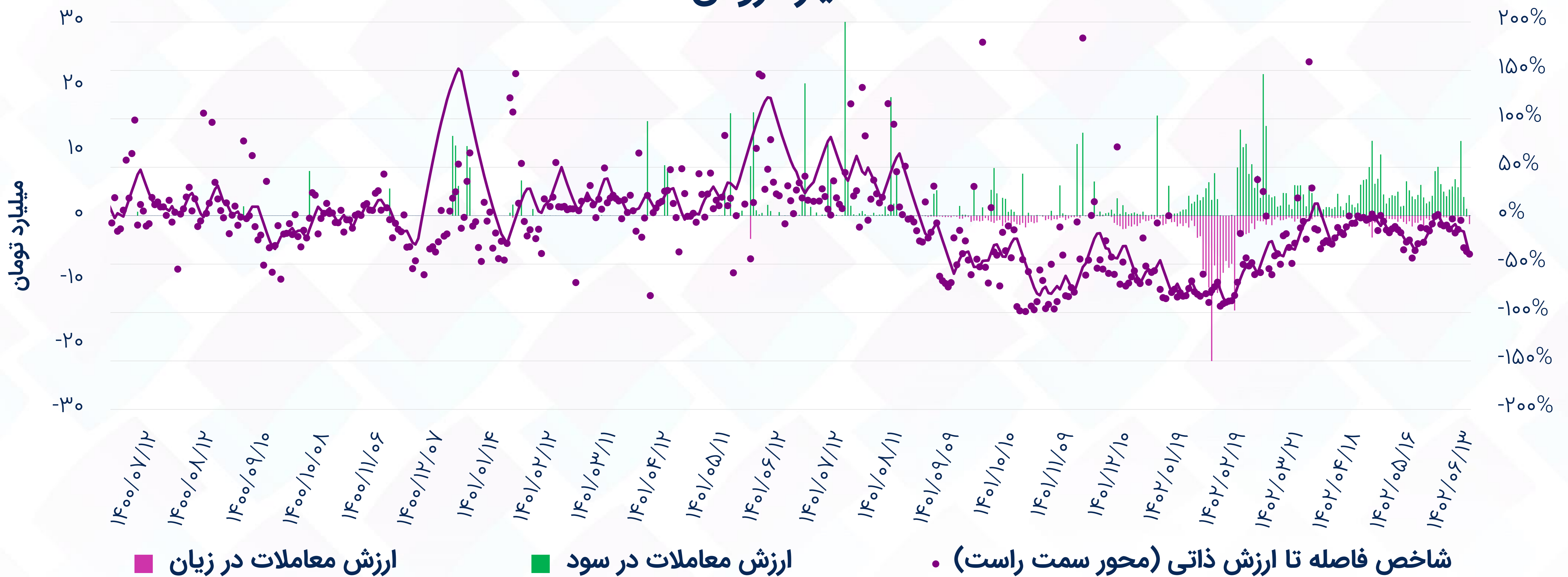
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

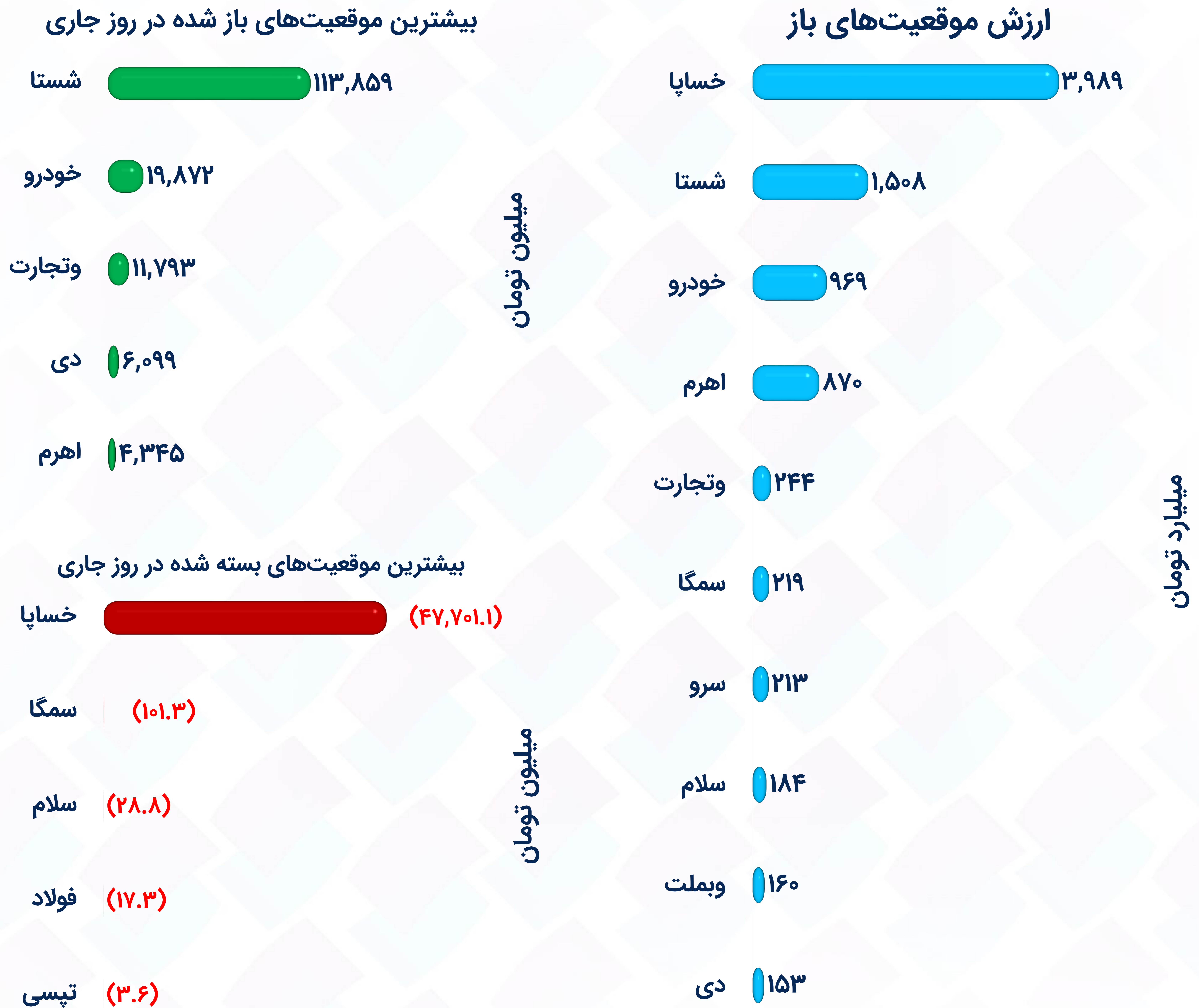
اختیار خرید

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
خودرو	۲۰	۵۲.۳	۳۱۳.۵	۵۱.۶	۰.۷	(۱۱.۶%)
شستا	۲۳	۵۱.۸	۳۸۵.۶	۳۰.۵	۲۱.۳	(۱۴.۳%)
خسپا	۲۴	۴۴.۹	۷۰۷.۲	۲۹.۲	۱۵.۷	(۳.۱%)
اهرم	۳۰	۱۹.۰	۵۵.۸	۱۸.۱	۰.۹	(۴.۰%)
دی	۱۶	۸.۷	۲۶.۵	۷.۴	۱.۳	(۹.۶%)
شتاب	۸	۸.۵	۲۹.۶	۸.۵	۰.۰	(۱.۱%)
وتجارت	۱۷	۳.۴	۶۸.۶	۲.۵	۰.۸	۱۶.۹%

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	۱۰	۱,۳۵۵.۵	۲۵,۰۵۲.۵	۷۰.۳	۱,۲۸۵.۲	(۴۰.۲%)
اهرم	۳	۱۱.۵	۲۷۸.۳	۰.۰	۱۱.۵	(۴۷.۷%)
شبندر	۲	۵.۶	۶۶.۰	۵.۶	۰.۰	(۱۵.۸%)
های وب	۱	۴.۴	۹۸.۷	۴.۴	۰.۰	۵.۰%
حافرین	۱	۴.۰	۱۵.۹	۴.۰	۰.۰	۳۸.۷%
سمگا	۱	۲.۰	۳۳.۶	۲.۰	۰.۰	۲۴.۴%
خودرو	۱	۰.۶	۴۱.۰	۰.۰	۰.۶	(۹۲.۸%)

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

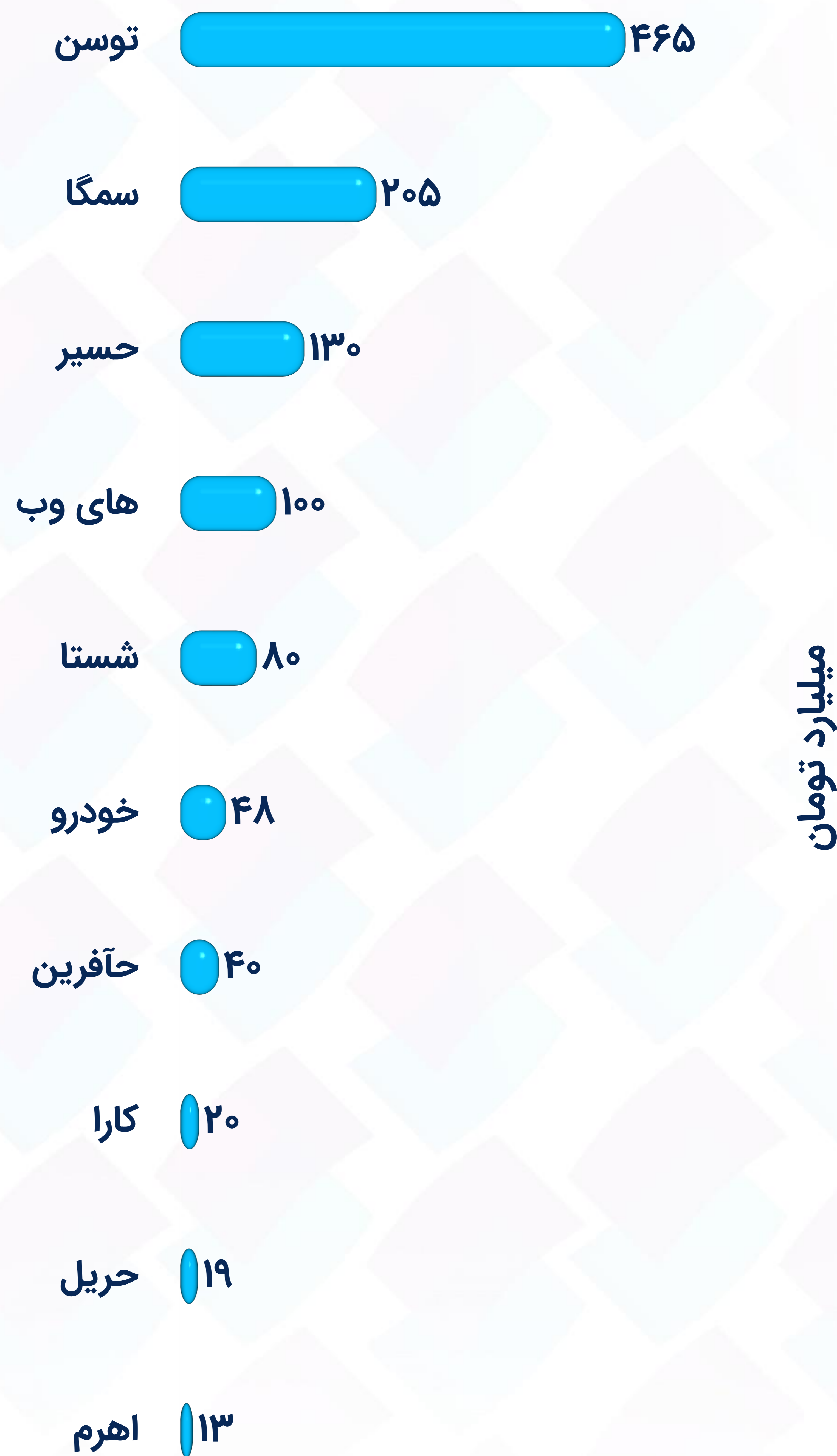
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

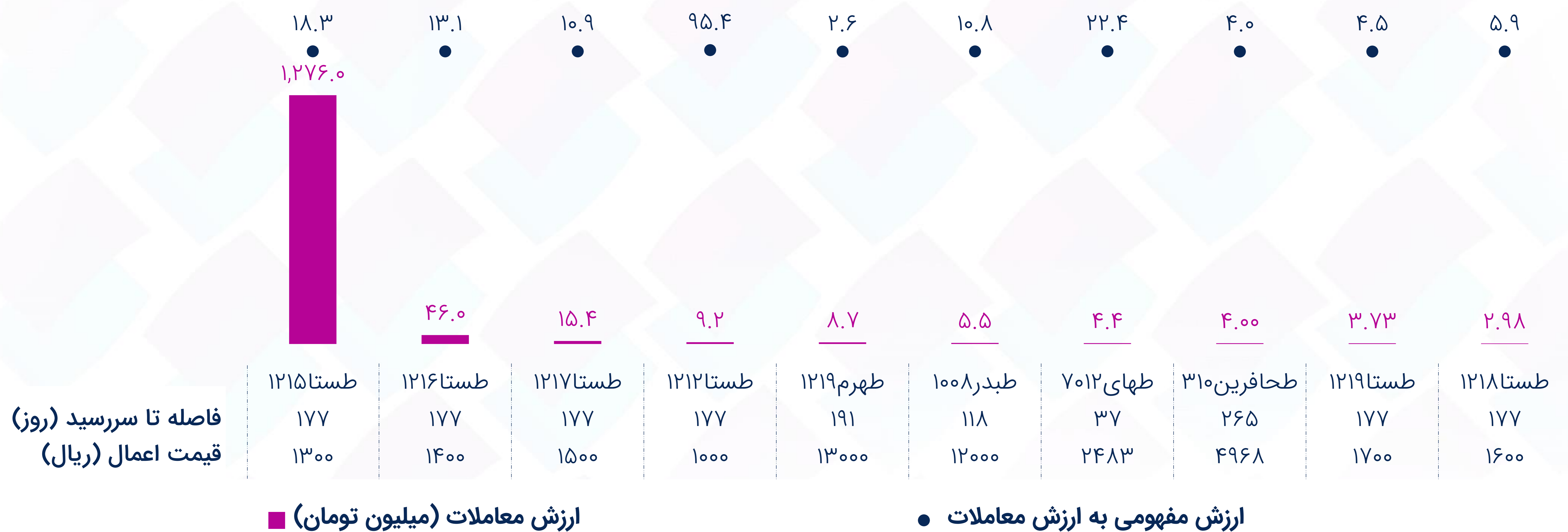


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش 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
۳۵۹%	۶۲۹	۰.۹۲	۲۳.۵	(۱۱.۰%)	۳,۲۱۷	۳,۶۱۳	۱۳۷	۱.۴	۳۵	۳,۰۸۰	ضخاور ۷۰۰
۱۷%	۱,۳۴۶	۰.۹۹	۴.۹	(۰.۹%)	۵,۶۱۹	۵,۶۷۰	۱,۱۵۰	۲.۱	۴۵	۴,۴۶۹	ضفلا ۷۰۳
۱۴%	۵۷۹	۰.۹۸	۵.۷	(۰.۹%)	۲,۹۱۰	۲,۹۳۶	۵۱۰	۲.۵	۲۴	۲,۴۰۰	ضخود ۷۱۰۴
۱۲%	۳۱۱	۰.۱۶	۹۴.۹	۲۸.۶%	۲۶,۲۷۷	۲۰,۴۴۰	۲۷۷	۳۴.۳	۴۲	۲۶,۰۰۰	ضهرم ۷۰۱۶
۱۰%	۱۰۰	۰.۹۲	۱۴.۲	۰.۱%	۱,۲۹۱	۱,۲۹۰	۹۱	۳.۱	۹	۱,۲۰۰	ضخپارس ۶۰۰

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
(۹۷%)	۱	۰.۰۱	۱۲۶.۳	۴۸%	۳,۶۶۲	۲,۴۶۸	۲۹	۱۰.۱	۳۸	۳,۶۳۳	ضهای ۷۰۱۷
(۹۷%)	۰	۰.۰۰	۲۶۷.۷	۳۷%	۴,۰۱۵	۲,۹۳۶	۱۵	۱.۹	۲۴	۴,۰۰۰	ضخود ۷۰۹۸
(۸۸%)	۱۰	۰.۰۵	۴۷.۰	۳۹%	۴,۰۸۷	۲,۹۳۶	۸۷	۲۳۵.۶	۵۲	۴,۰۰۰	ضخود ۸۰۲۴
(۸۳%)	۱۰	۰.۰۴	۷۶.۰	۸۲%	۴,۵۶۰	۲,۵۰۰	۶۰	۶.۰	۱۲۹	۴,۵۰۰	ضسپا ۱۰۰۹
(۷۱%)	۱۲	۰.۰۸	۷۵.۶	۲۹%	۳,۱۷۵	۲,۴۶۸	۴۲	۱.۷	۳۸	۳,۱۳۳	ضهای ۷۰۱۵

(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
۱۰۲.۵%	۴۳۳	-۰.۱۸	۸۳.۱	(۱۳%)	۱۷,۷۸۶	۲۰,۴۴۰	۲۱۴	۲.۶	۴۲	۱۸,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۲
۳۸.۷%	۱,۱۰۸	-۰.۷۱	۵.۲	۳۲%	۴,۱۶۹	۳,۱۷۰	۷۹۹	۴.۰	۲۶۶	۴,۹۶۸	طحافرین ۳۱۰
۲۴.۴%	۳۷۳	-۰.۵۵	۱۶.۴	(۱%)	۴,۹۳۳	۴,۹۸۳	۳۰۰	۲.۰	۲۸	۵,۲۳۳	طسمگا ۷۰۳
۵.۰%	۱۱۶	-۰.۴۱	۲۱.۶	(۴%)	۲,۳۷۳	۲,۴۶۸	۱۱۰	۴.۴	۳۸	۲,۴۸۳	طهای ۷۰۱۲
(۶.۳%)	۱۱۵	-۰.۴۴	۱۱.۲	۳%	۱,۳۷۷	۱,۳۳۶	۱۲۳	۱۵.۴	۱۷۸	۱,۵۰۰	طستا ۱۲۱۷

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
(۹۷%)	۲۱۹	-۰.۰۵	۰.۶	(۷۵%)	۵,۱۰۰	۲۰,۴۴۰	۷,۹۰۰	۸.۷	۱۹۲	۱۳,۰۰۰	طهرم ۱۲۱۹
(۷۵%)	۴	-۰.۰۳	۷۰.۴	(۲۶%)	۹۸۶	۱,۳۳۶	۱۴	۹.۲	۱۷۸	۱,۰۰۰	طستا ۱۲۱۲
(۴۱%)	۴۳	-۰.۲۲	۱۶.۸	(۸%)	۱,۲۲۷	۱,۳۳۶	۷۳	۱,۲۷۶.۰	۱۷۸	۱,۳۰۰	طستا ۱۲۱۵
(۲۷%)	۷۴	-۰.۳۲	۱۲.۷	(۳%)	۱,۲۹۸	۱,۳۳۶	۱۰۲	۴۶.۰	۱۷۸	۱,۴۰۰	طستا ۱۲۱۶
(۲۷%)	۱۴۳	-۰.۸۲	۶.۷	(۲%)	۱,۳۰۴	۱,۳۳۶	۱۹۶	۱.۸	۳۱	۱,۵۰۰	طستا ۷۰۱۶

(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

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



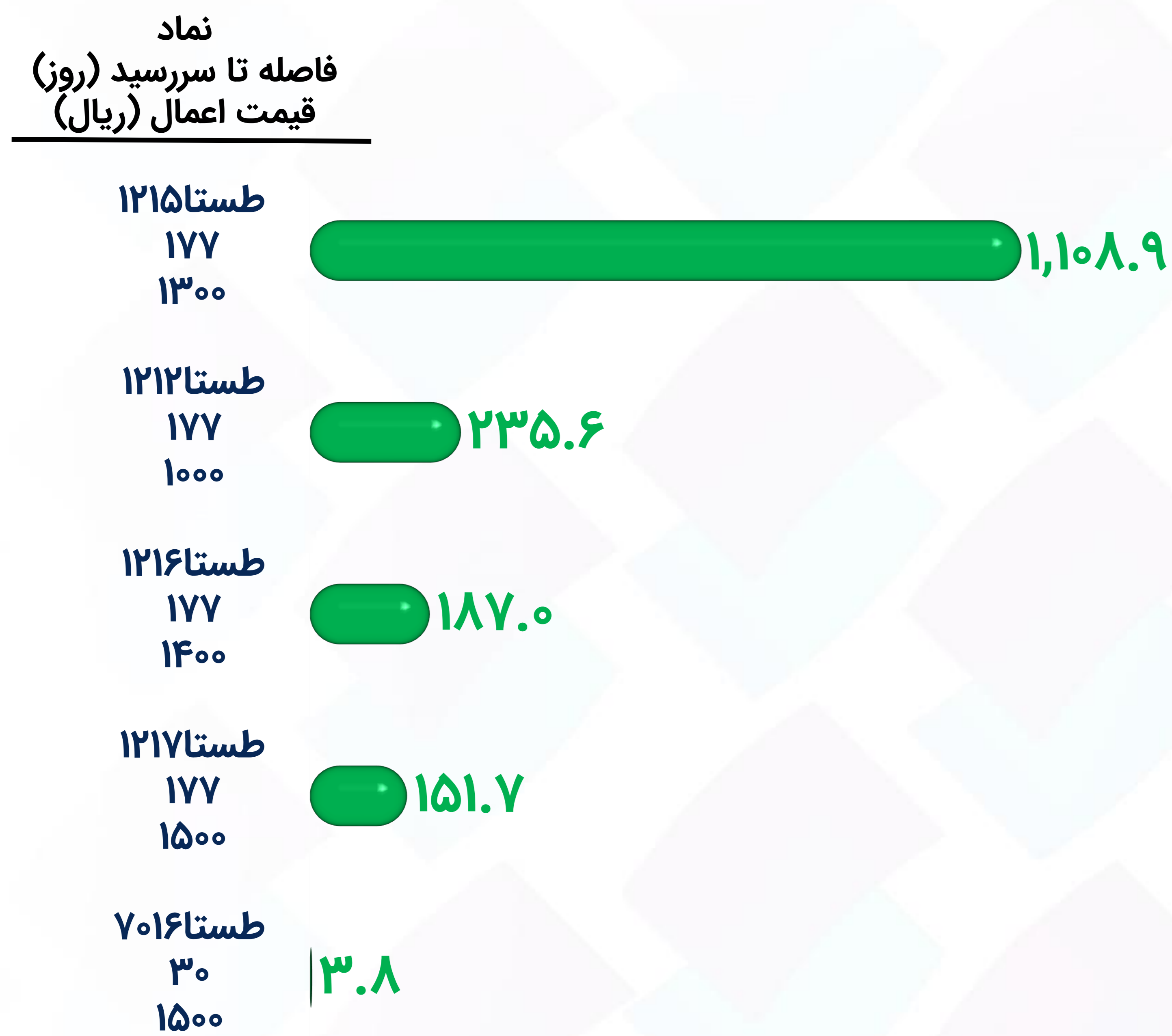
میلیون تومان

میلیون تومان

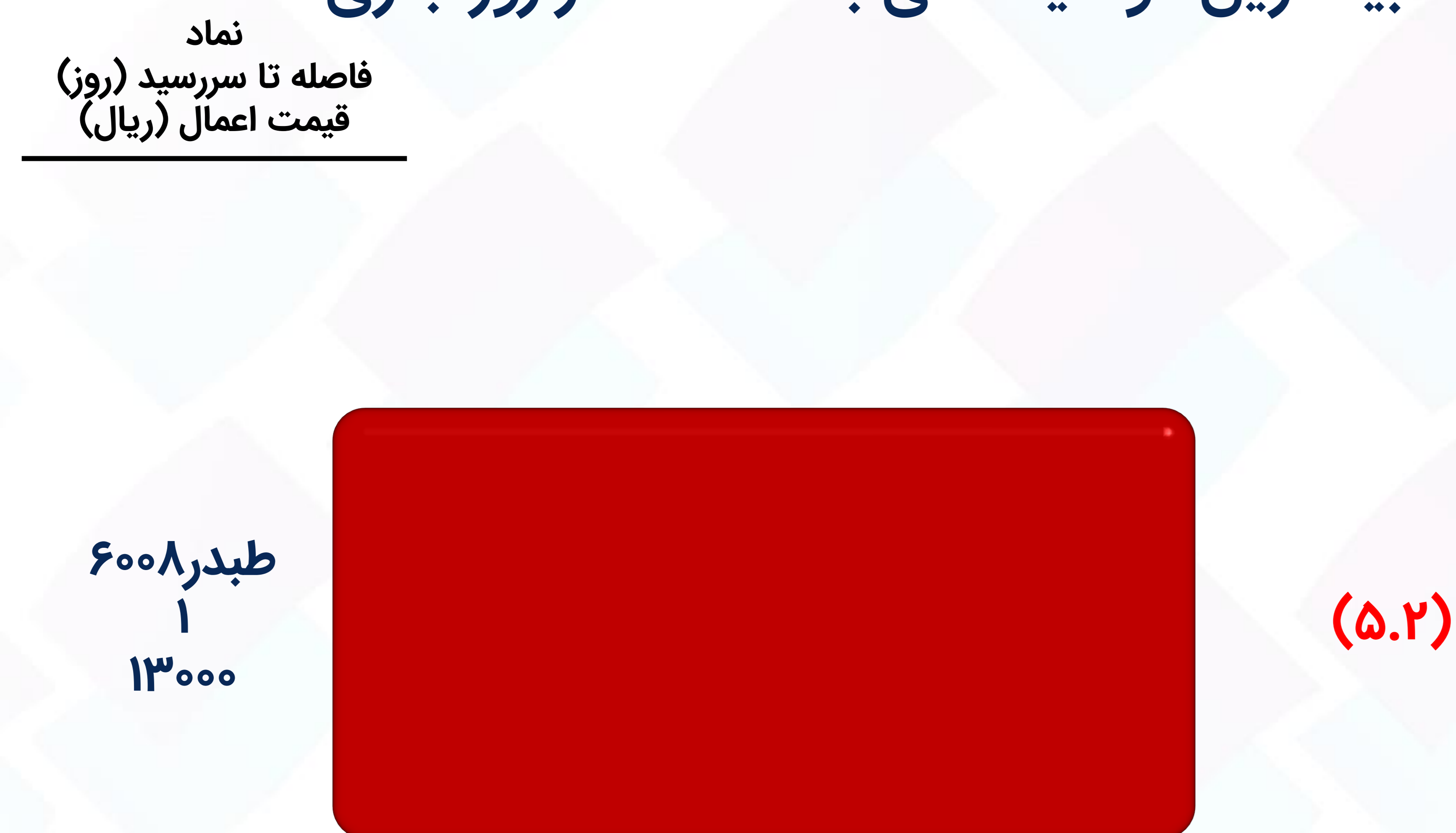
میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

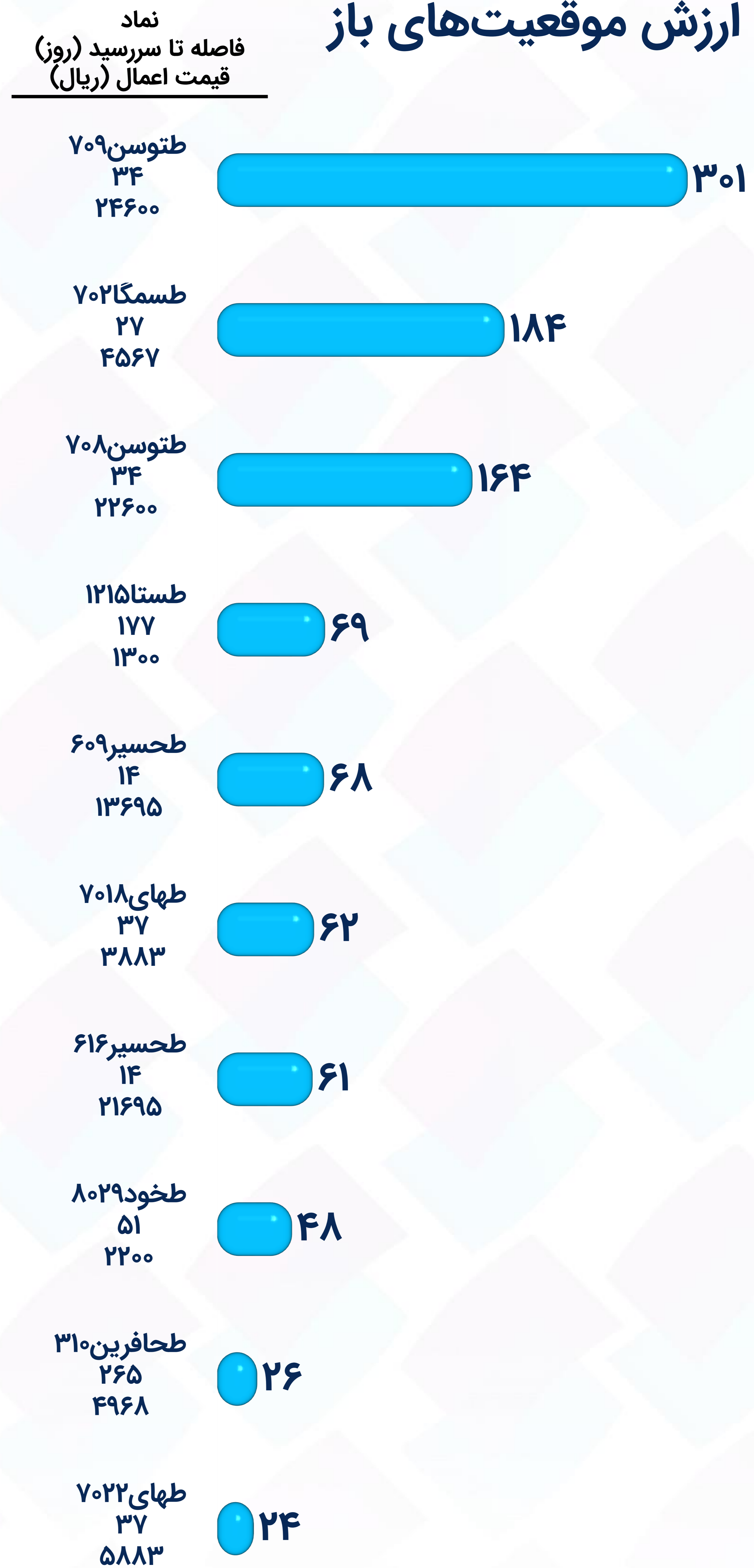
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



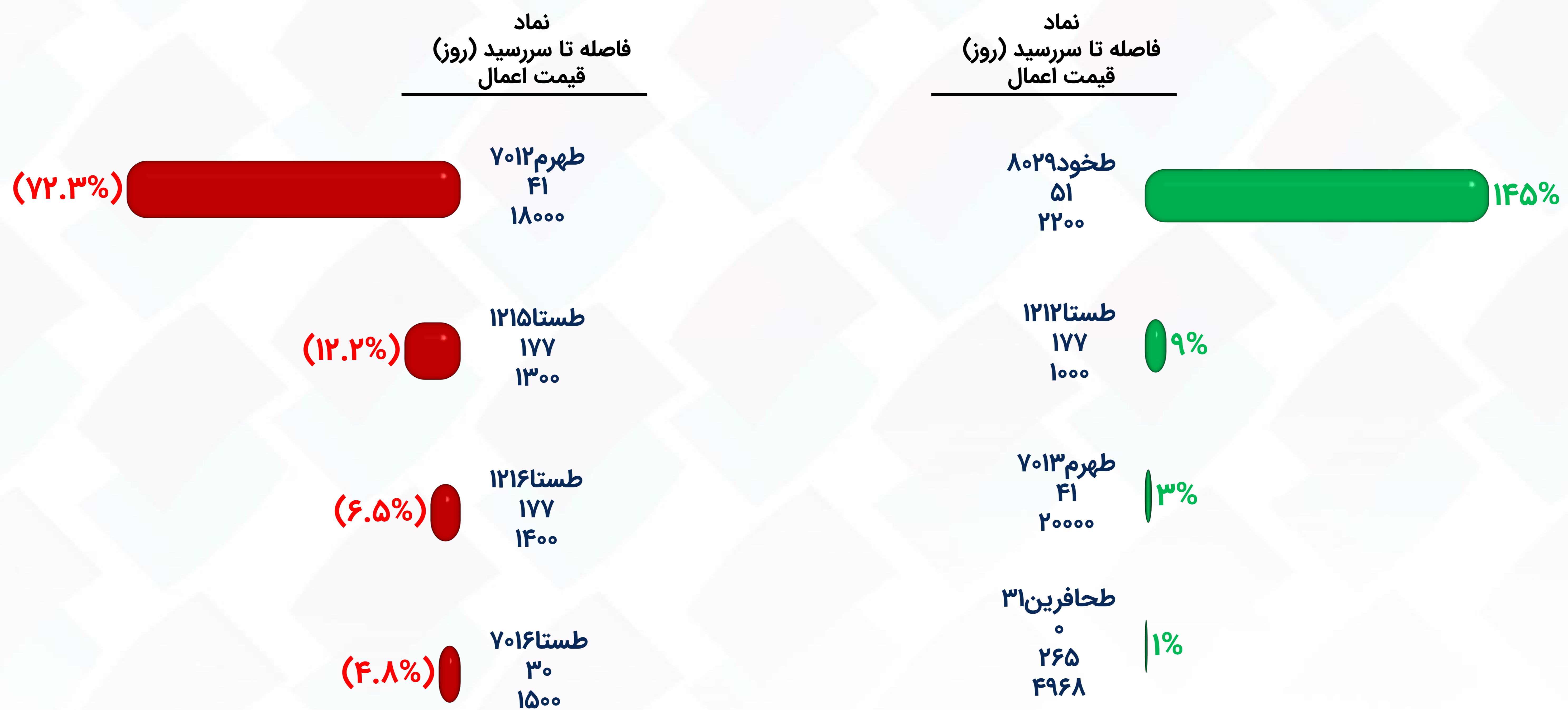
میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

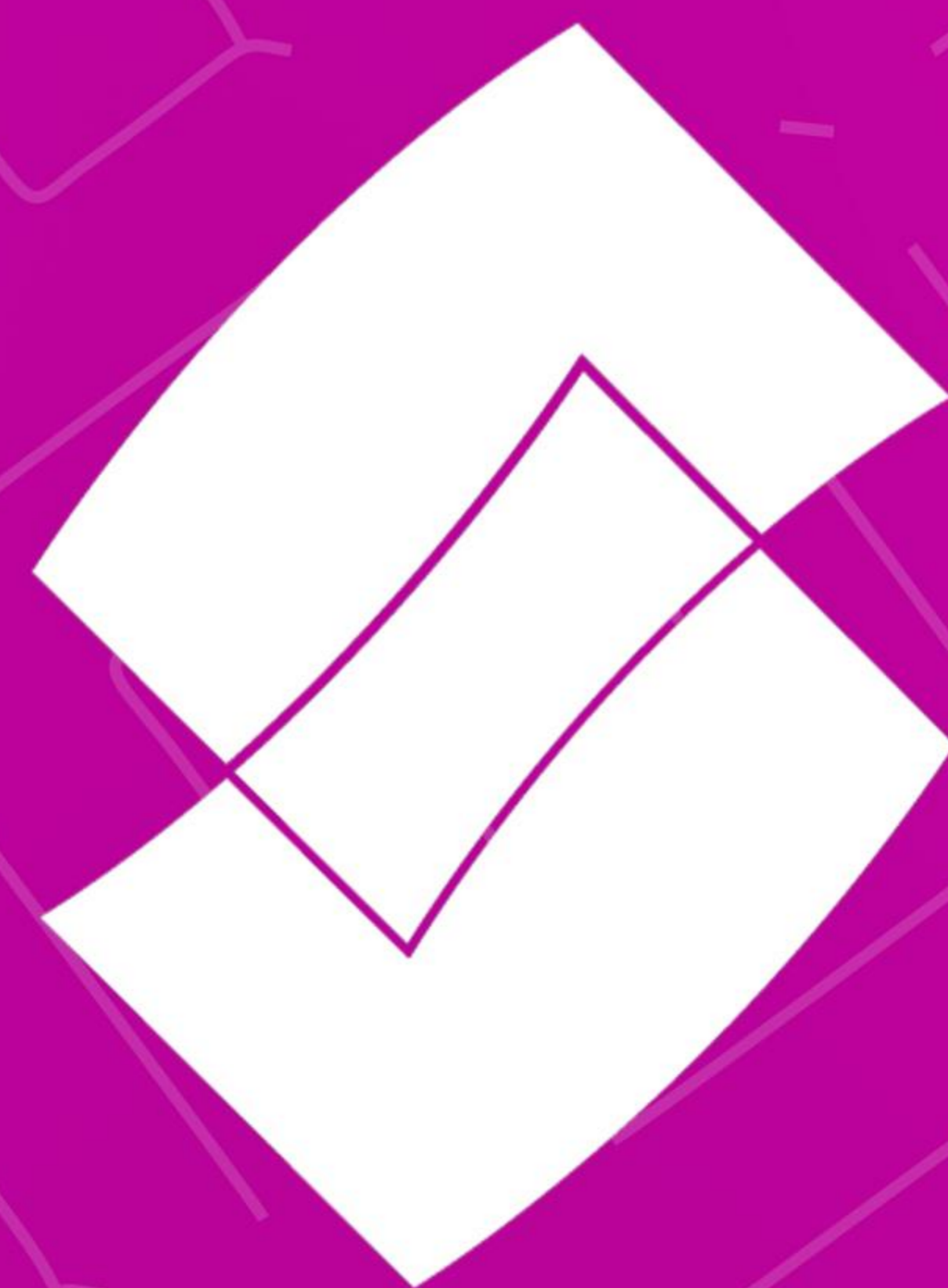
اختیار خرید



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.