

شماره

۸۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۴ شهریور ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage



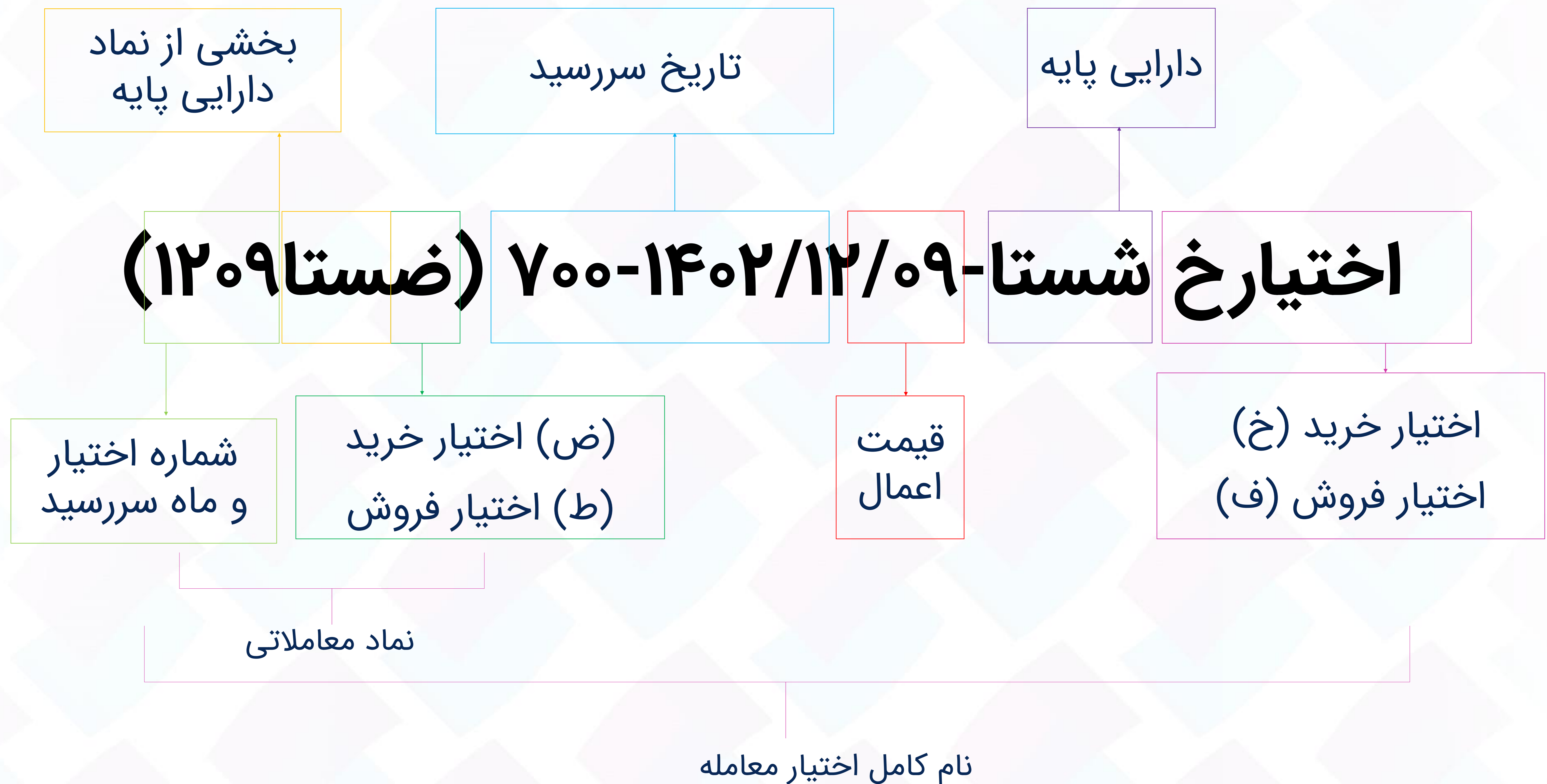


اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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.

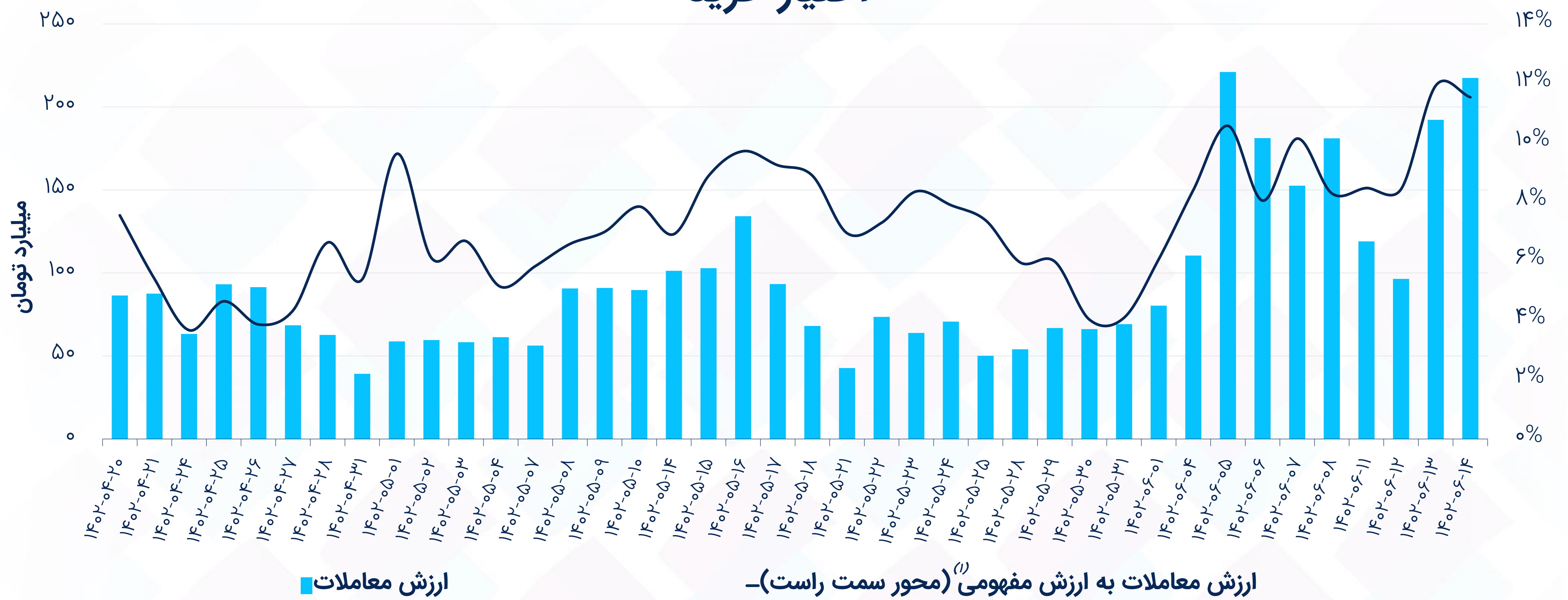


نماد معاملاتی اوراق اختیار تبعی

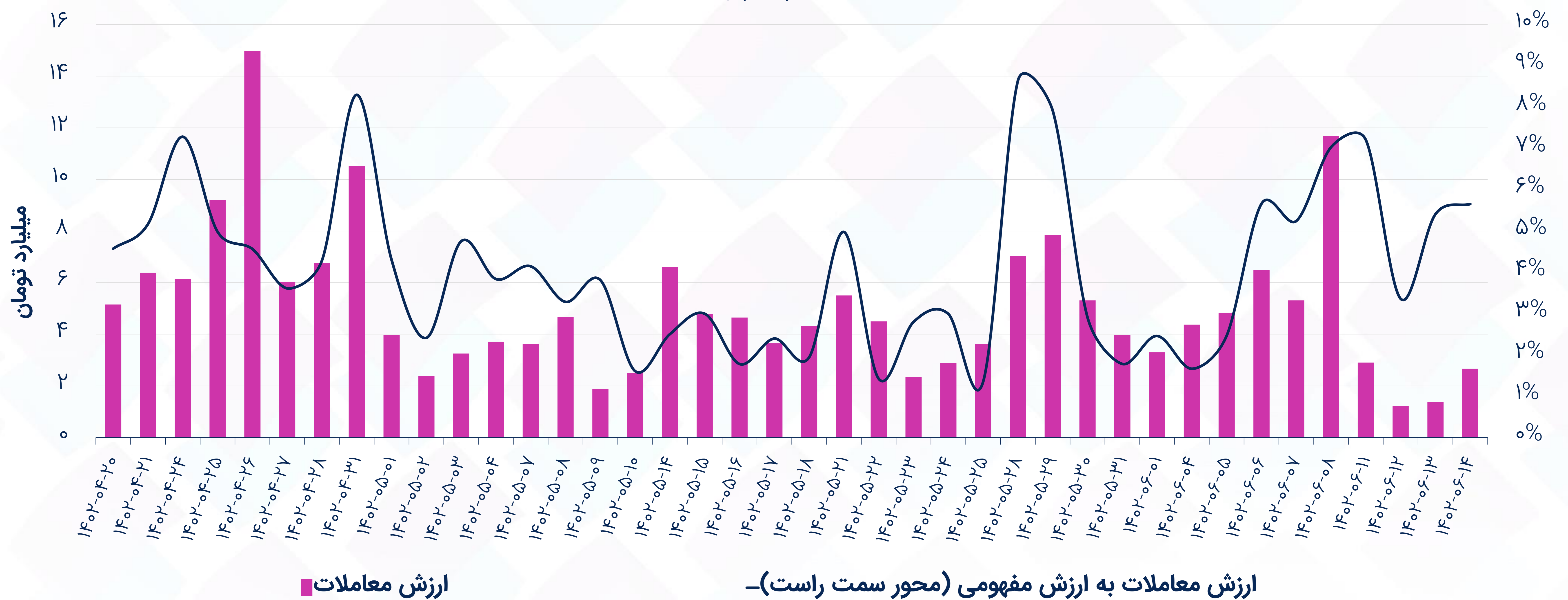


ارزش معاملات

اختیار خرید



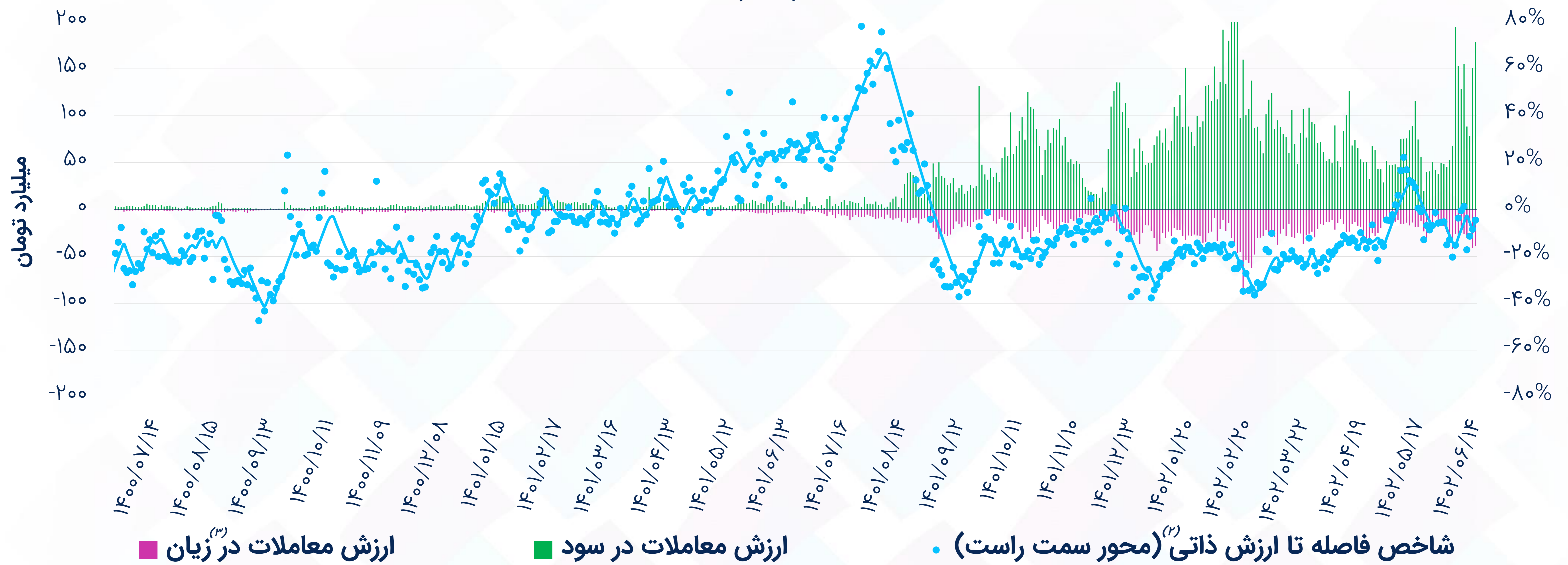
اختیار فروش



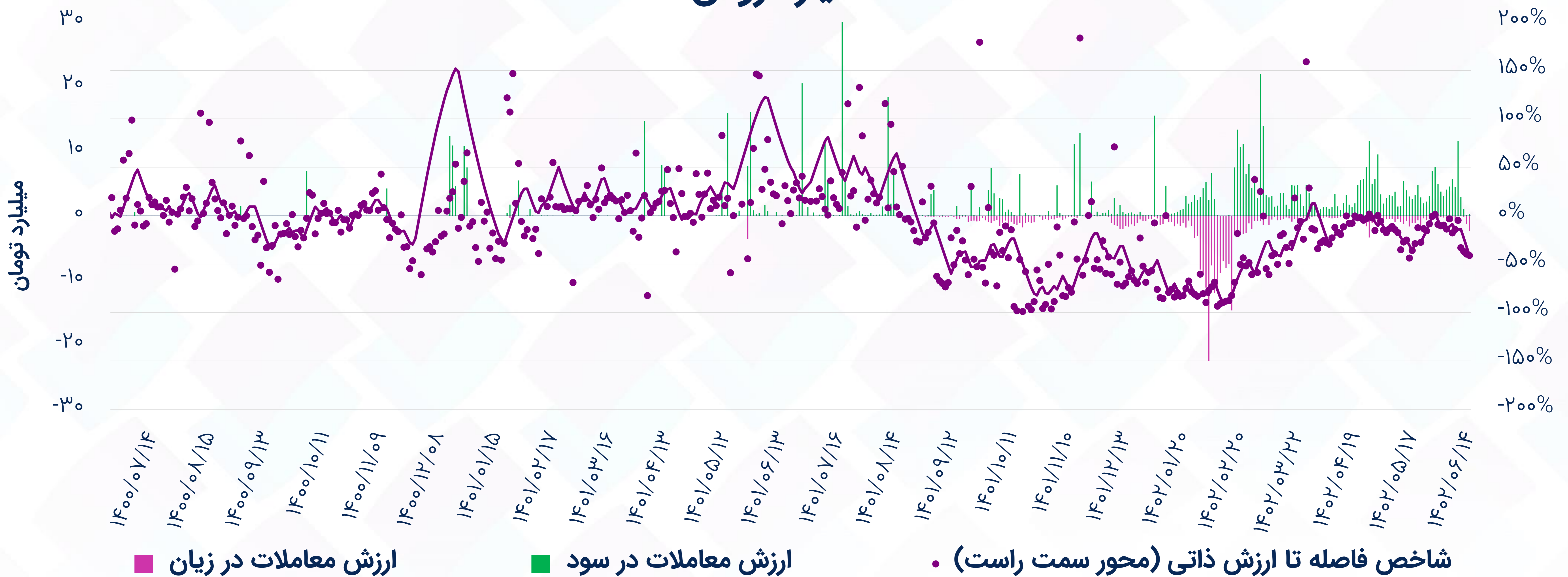
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

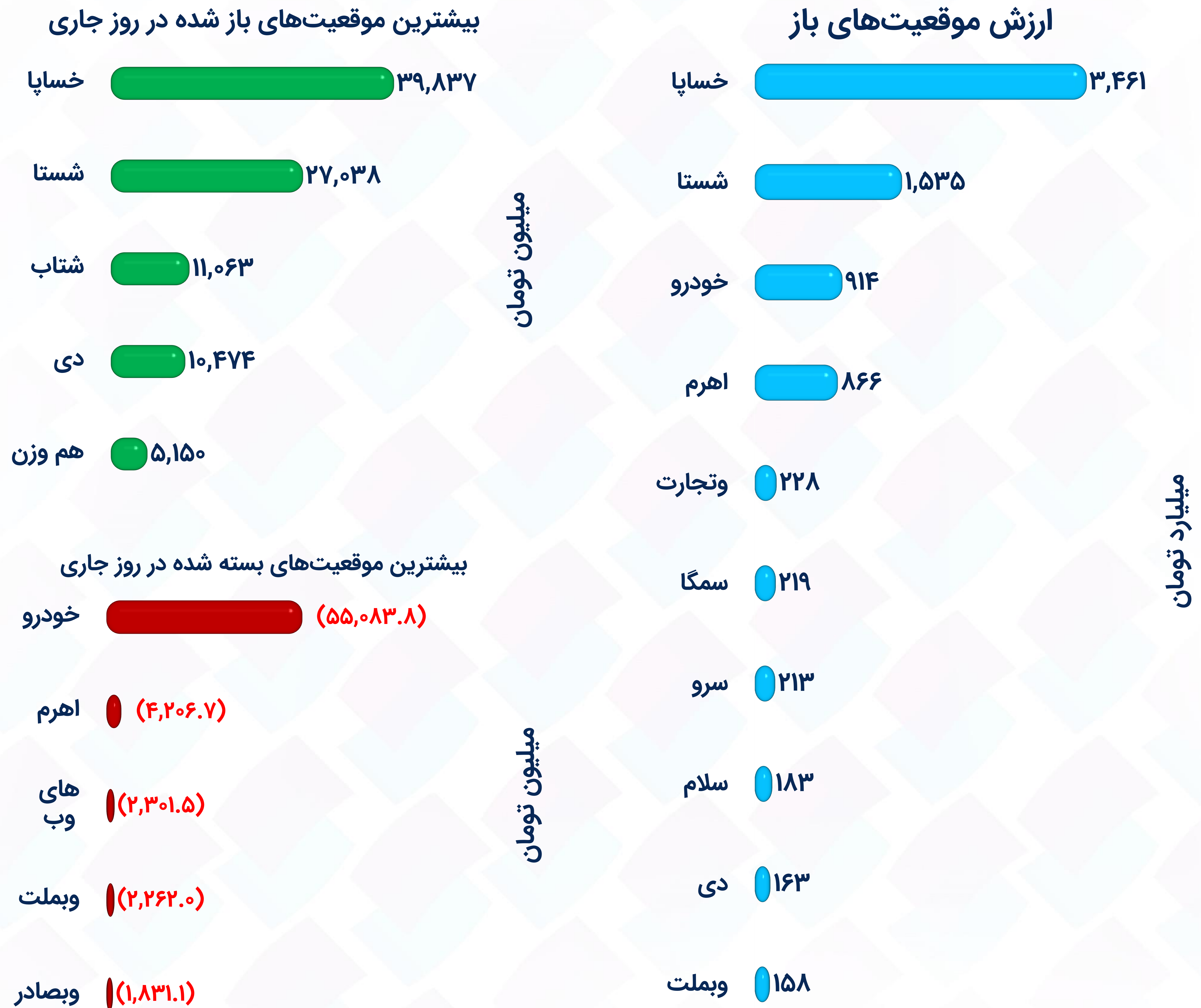
اختیار خرید

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	۲۸	۹۴.۵	۱,۰۷۱.۷	۷۲.۹	۲۱.۶	(۰.۷%)
خودرو	۲۲	۵۴.۷	۳۲۳.۰	۵۴.۲	۰.۵	(۵.۴%)
شستا	۲۶	۲۸.۲	۲۶۳.۱	۱۴.۴	۱۳.۷	(۲۲.۵%)
اهرم	۲۸	۱۷.۶	۵۲.۹	۱۶.۱	۱.۵	(۲.۶%)
دی	۱۷	۱۰.۲	۲۹.۷	۹.۴	۰.۹	(۷.۴%)
وتجارت	۱۸	۴.۸	۹۴.۱	۴.۸	۰.۰	۳۱.۷%
هم وزن	۴	۱.۳	۵.۳	۱.۳	۰.۰	۷.۲%

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	۹	۲,۶۳۵.۶	۴۶,۸۱۱.۹	۲۵۴.۵	۲,۳۸۱.۱	(۴۱.۸%)
حافرین	۲	۱۴.۹	۵۷.۱	۱۴.۹	۰.۰	۳۳.۶%
های وب	۲	۱۲.۱	۱۵۴.۹	۵.۵	۶.۶	(۰.۳%)
سمگا	۱	۱.۴	۲۴.۳	۱.۴	۰.۰	۱۷.۸%
فملی	۲	۰.۴	۲.۳	۰.۴	۰.۰	۶.۳%
خودرو	۱	۰.۳	۶۶.۰	۰.۰	۰.۳	(۸۶.۹%)
اهرم	۱	۰.۱	۸.۴	۰.۰	۰.۱	۲۰.۷%

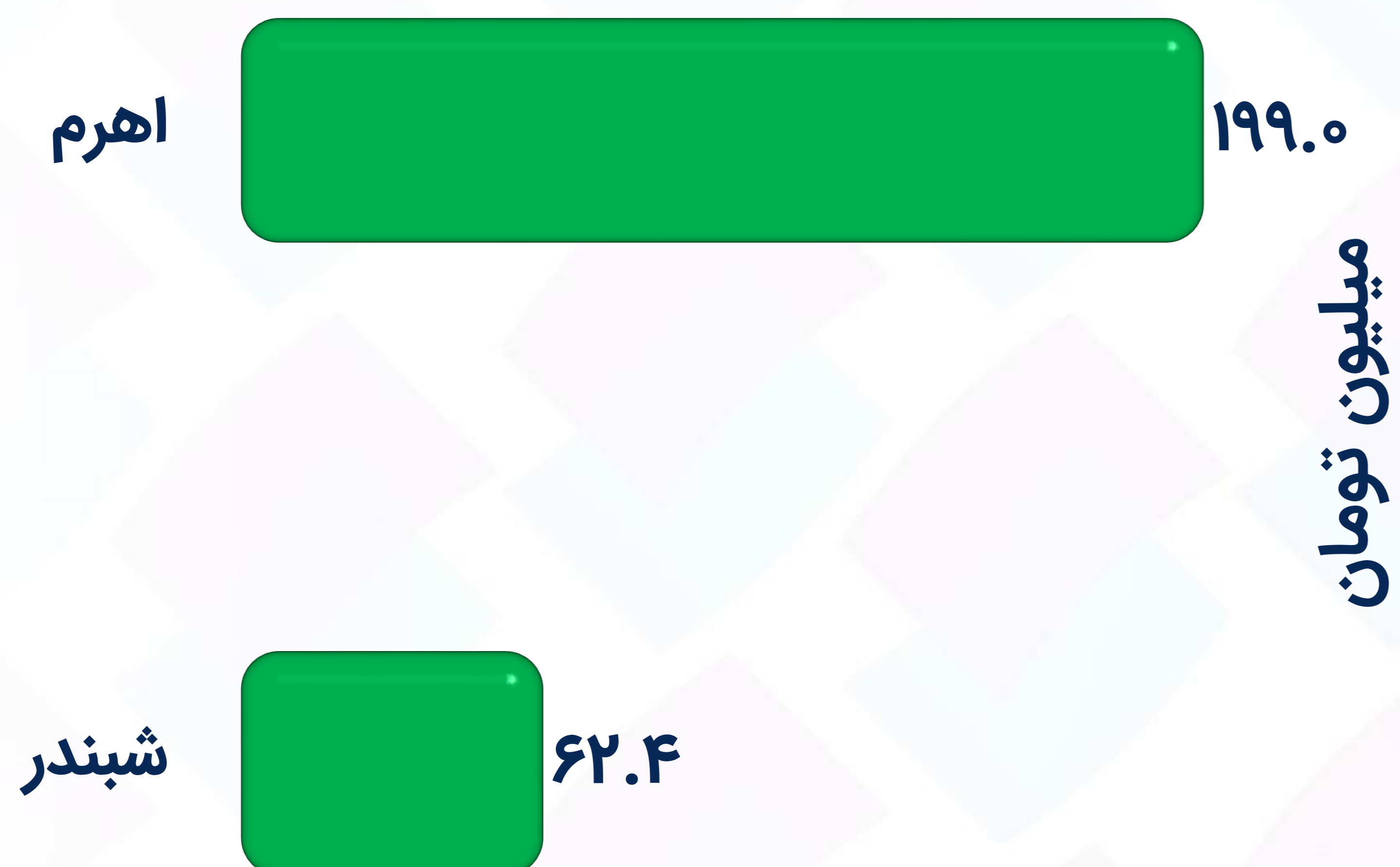
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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 موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



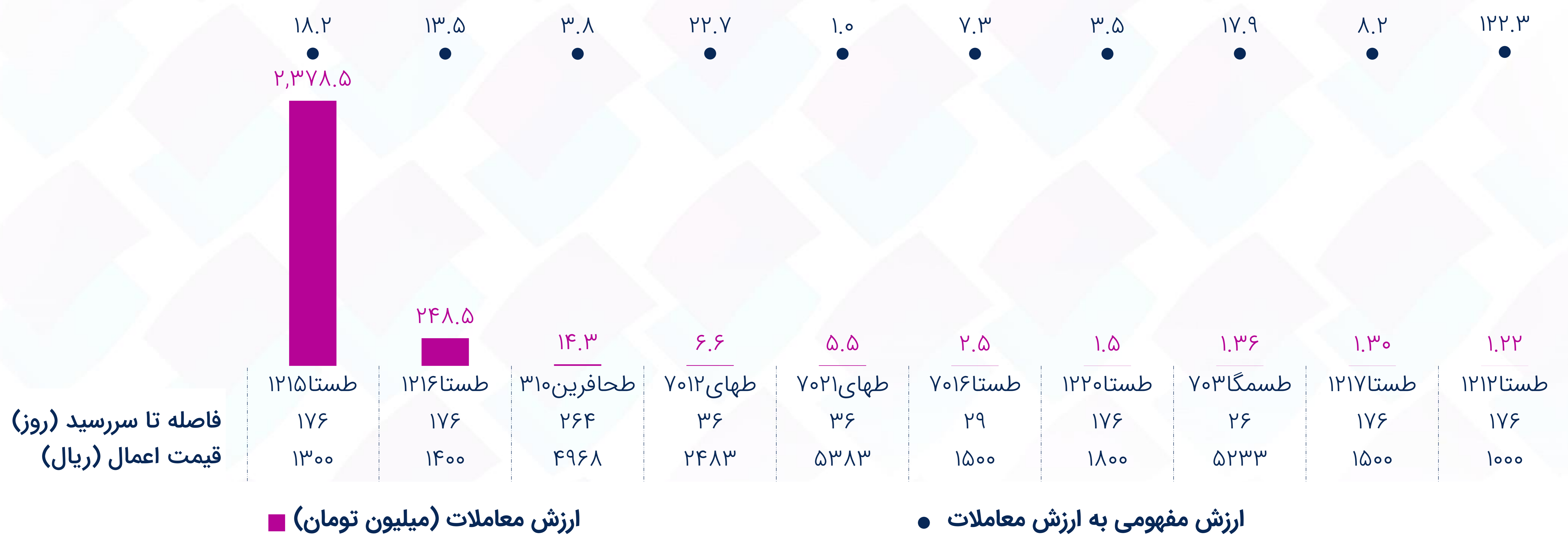
میلیون تومان

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
۱۴۶%	۸۱	۰.۲۲	۲۴۹.۱	۹.۵%	۸,۲۲۰	۷,۵۱۰	۳۳	۱۰.۴	۲۳	۸,۱۸۷	ضملی ۷۰۳۵
۲۸%	۱,۴۹۱	۰.۵۱	۱۹.۹	۹.۹%	۲۳,۱۶۵	۲۱,۰۸۰	۱,۱۶۵	۱۲۳.۹	۴۱	۲۲,۰۰۰	ضهرم ۷۰۱۴
۲۶%	۱۰۵	۰.۹۴	۱۵.۵	(۱.۰%)	۱,۲۸۳	۱,۲۹۶	۸۳	۲۲.۱	۸	۱,۲۰۰	ضخپارس ۶۰۰
۲۴%	۲,۶۸۰	۰.۷۴	۸.۴	۱۲.۴%	۱۸,۱۶۰	۱۶,۱۵۳	۲,۱۶۰	۱۴۰.۴	۱۶۷	۱۶,۰۰۰	ضهم وزن ۱۱۰۵
۲۲%	۲,۵۲۰	۰.۷۰	۱۰.۶	۴.۷%	۲۲,۰۷۳	۲۱,۰۸۰	۲,۰۷۳	۳۴۷.۰	۴۱	۲۰,۰۰۰	ضهرم ۷۰۱۳

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	۱۲۱.۰	۹۹%	۶,۰۵۰	۳,۰۴۷	۵۰	۵.۱	۵۱	۶,۰۰۰	ضخود ۸۰۲۸
(۹۷%)	۳	۰.۰۲	۵۱.۰	۵۱%	۴,۵۹۰	۳,۰۴۷	۹۰	۱.۸	۵۱	۴,۵۰۰	ضخود ۸۰۲۵
(۹۲%)	۴	۰.۰۲	۹۱.۹	۹۸%	۵,۰۵۵	۲,۵۵۲	۵۵	۲.۵	۱۲۸	۵,۰۰۰	ضسپا ۱۰۱
(۸۶%)	۱	۰.۰۱	۵۰۱.۰	۳۲%	۴,۰۰۸	۳,۰۴۷	۸	۳.۳	۲۳	۴,۰۰۰	ضخود ۷۰۹۸
(۸۳%)	۱۰	۰.۰۵	۶۸.۷	۷۸%	۴,۰۵۶	۲,۲۸۳	۵۹	۱۰.۴	۱۴۹	۳,۹۹۷	ضصاد ۱۱۴۵

(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

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	۲۶۵	۱۴.۳	۸۳۸	۳,۱۷۱	۴,۱۳۰	۳۰%	۴.۹	-۰.۷۲	۱,۱۱۳	۳۲.۸%
طسمگا ۷۰۳	سمگا	۲۷	۱.۴	۲۸۳	۵,۰۵۴	۴,۹۵۰	(۲%)	۱۷.۵	-۰.۵۱	۳۳۳	۱۷.۸%
طهای ۷۰۲۱	های وب	۳۷	۵.۵	۲,۶۰۰	۲,۴۹۴	۲,۷۸۳	۱۲%	۱.۱	-۱.۰۰	۲,۷۵۰	۵.۸%
طهای ۷۰۱۲	های وب	۳۷	۶.۶	۱۱۰	۲,۴۹۴	۲,۳۷۳	(۵%)	۲۱.۶	-۰.۳۹	۱۰۴	(۵.۳%)
طستا ۱۲۲۰	شستا	۱۷۷	۱.۵	۳۸۶	۱,۳۴۵	۱,۴۱۴	۵%	۳.۷	-۰.۷۳	۲۹۰	(۲۴.۸%)

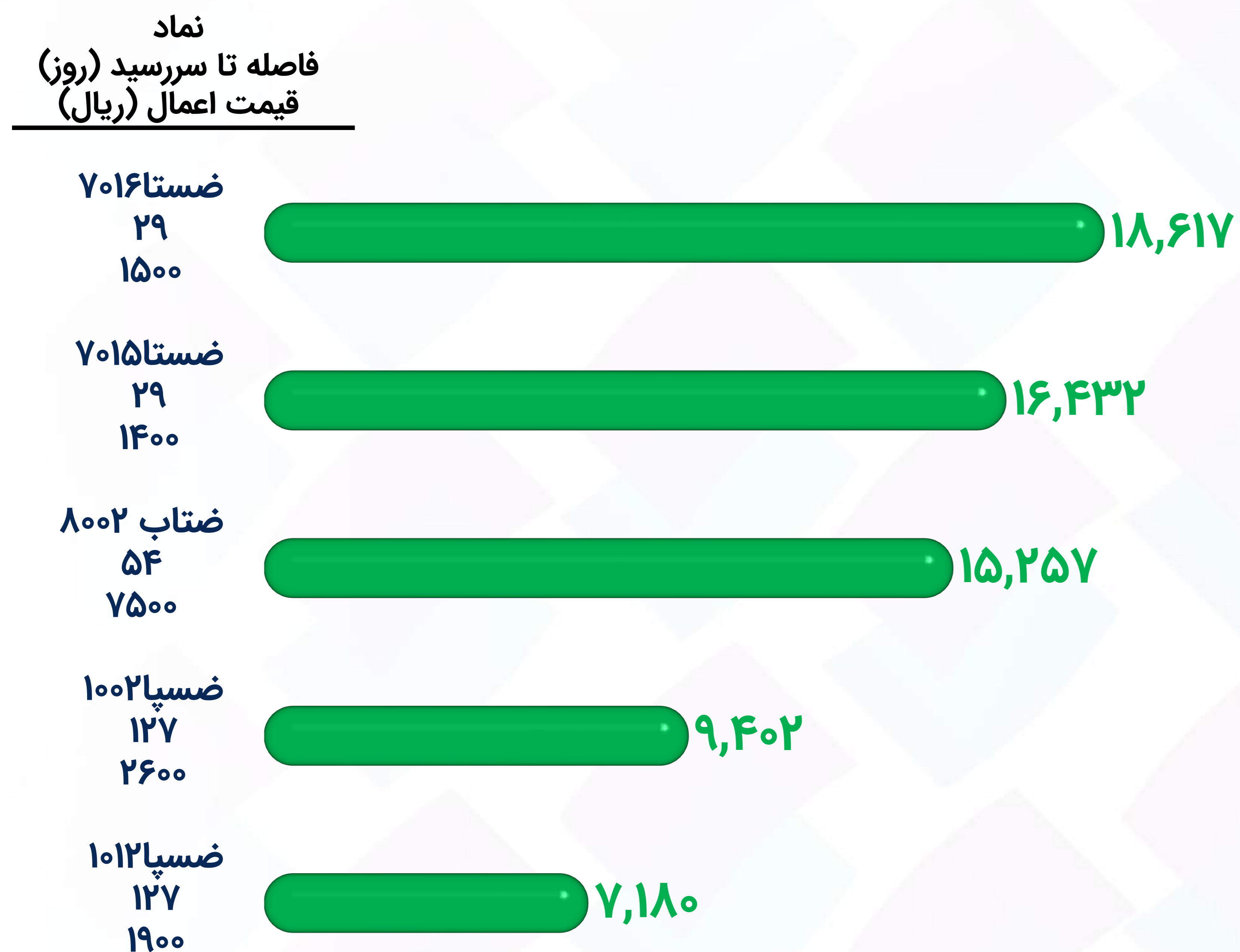
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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
طستا ۱۲۱۲	شستا	۱۷۷	۱.۲	۱۱	۱,۳۴۵	۹۸۹	(۲۶%)	۸۹.۹	-۰.۰۳	۳	(۶۹%)
طستا ۷۰۱۴	شستا	۳۰	۱.۲	۴۰	۱,۳۴۵	۱,۲۶۰	(۶%)	۳۱.۵	-۰.۲۷	۲۲	(۴۵%)
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱۷۷	۲,۳۷۸.۵	۷۴	۱,۳۴۵	۱,۲۲۶	(۹%)	۱۶.۶	-۰.۲۱	۴۲	(۴۳%)
طستا ۱۲۱۷	شستا	۱۷۷	۱.۳	۱۶۴	۱,۳۴۵	۱,۳۳۶	(۱%)	۸.۱	-۰.۴۳	۱۱۳	(۳۱%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱۷۷	۲۴۸.۵	۱۰۰	۱,۳۴۵	۱,۳۰۰	(۳%)	۱۳.۰	-۰.۳۱	۷۲	(۲۸%)

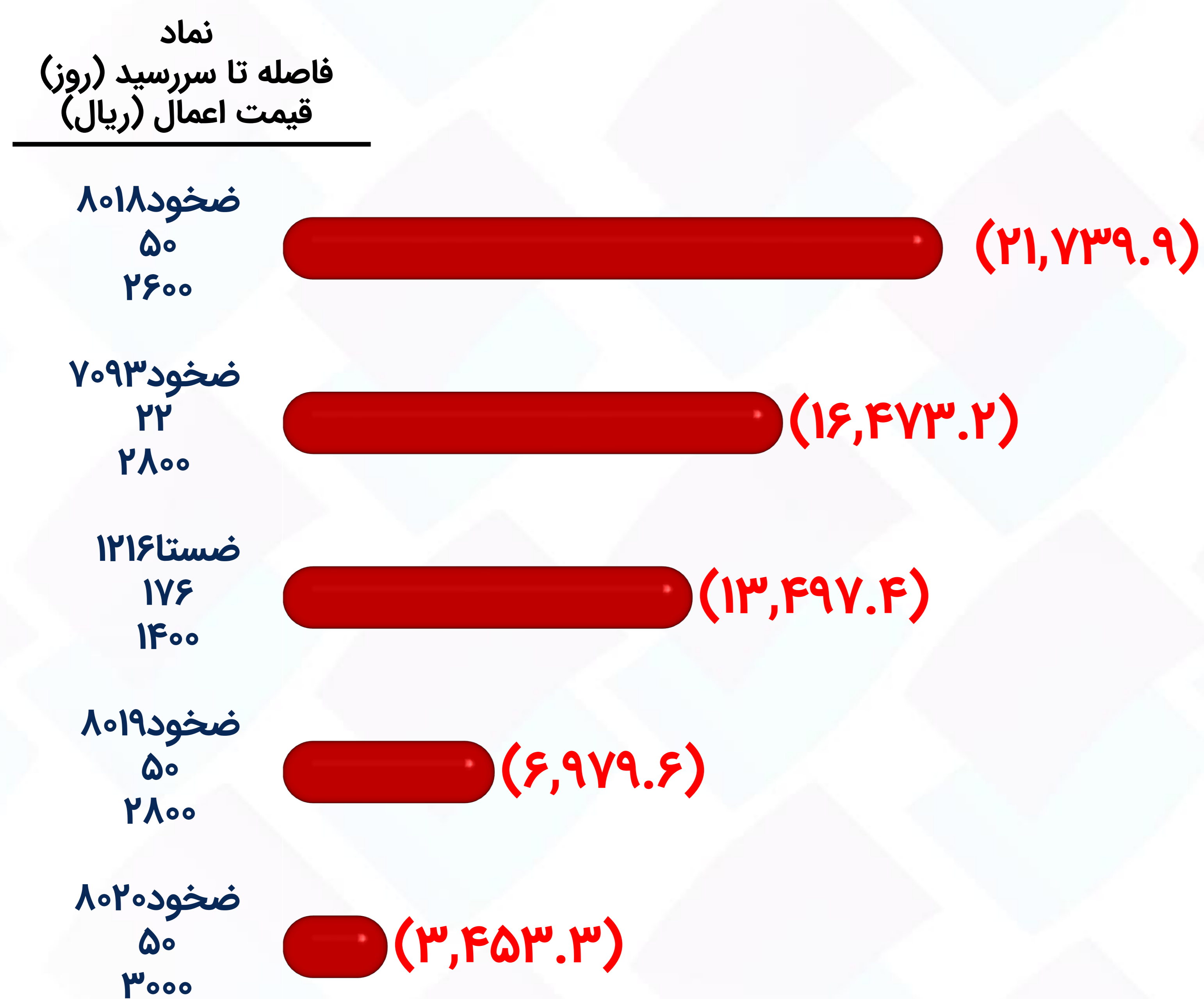
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است). تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

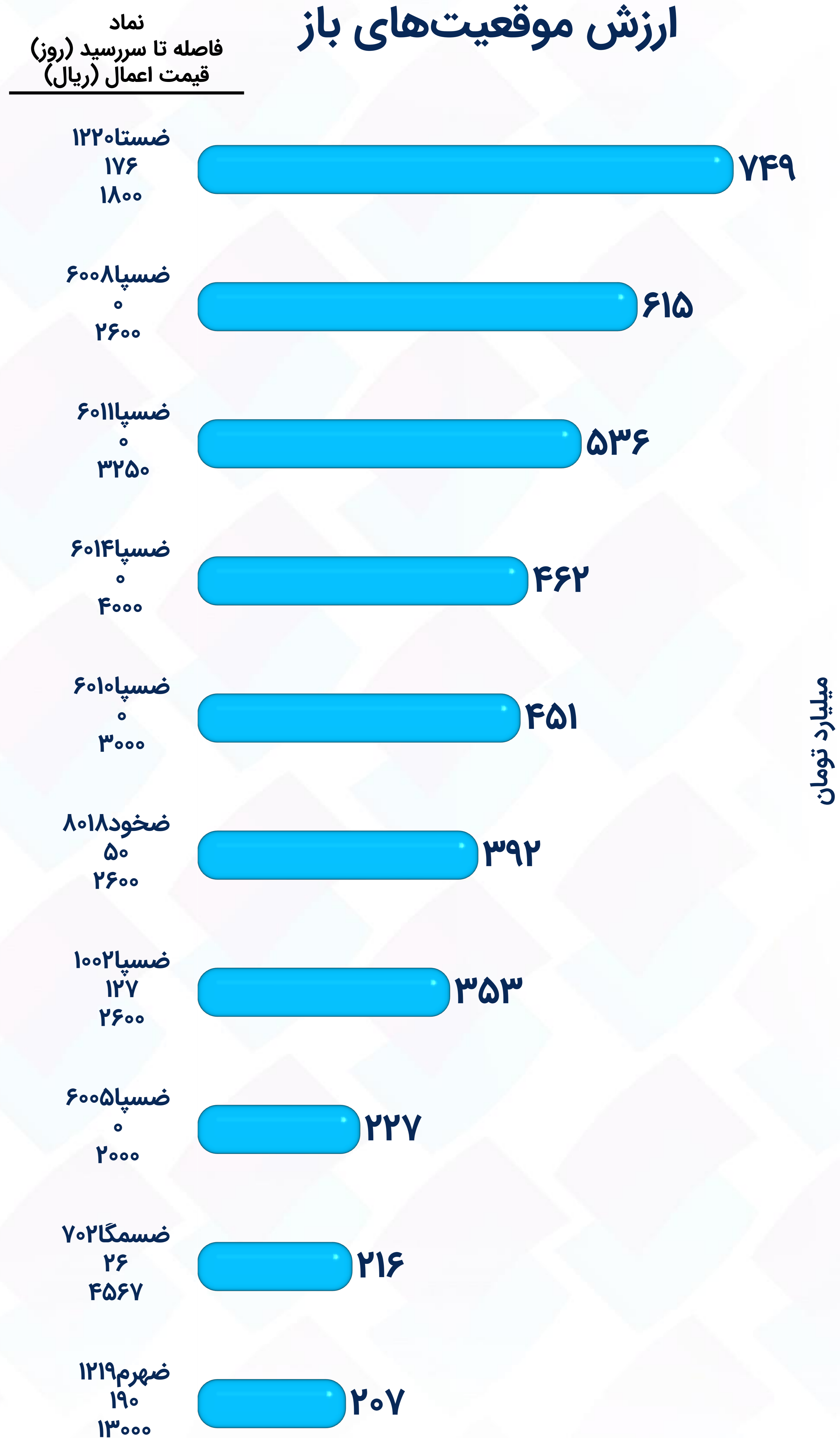
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

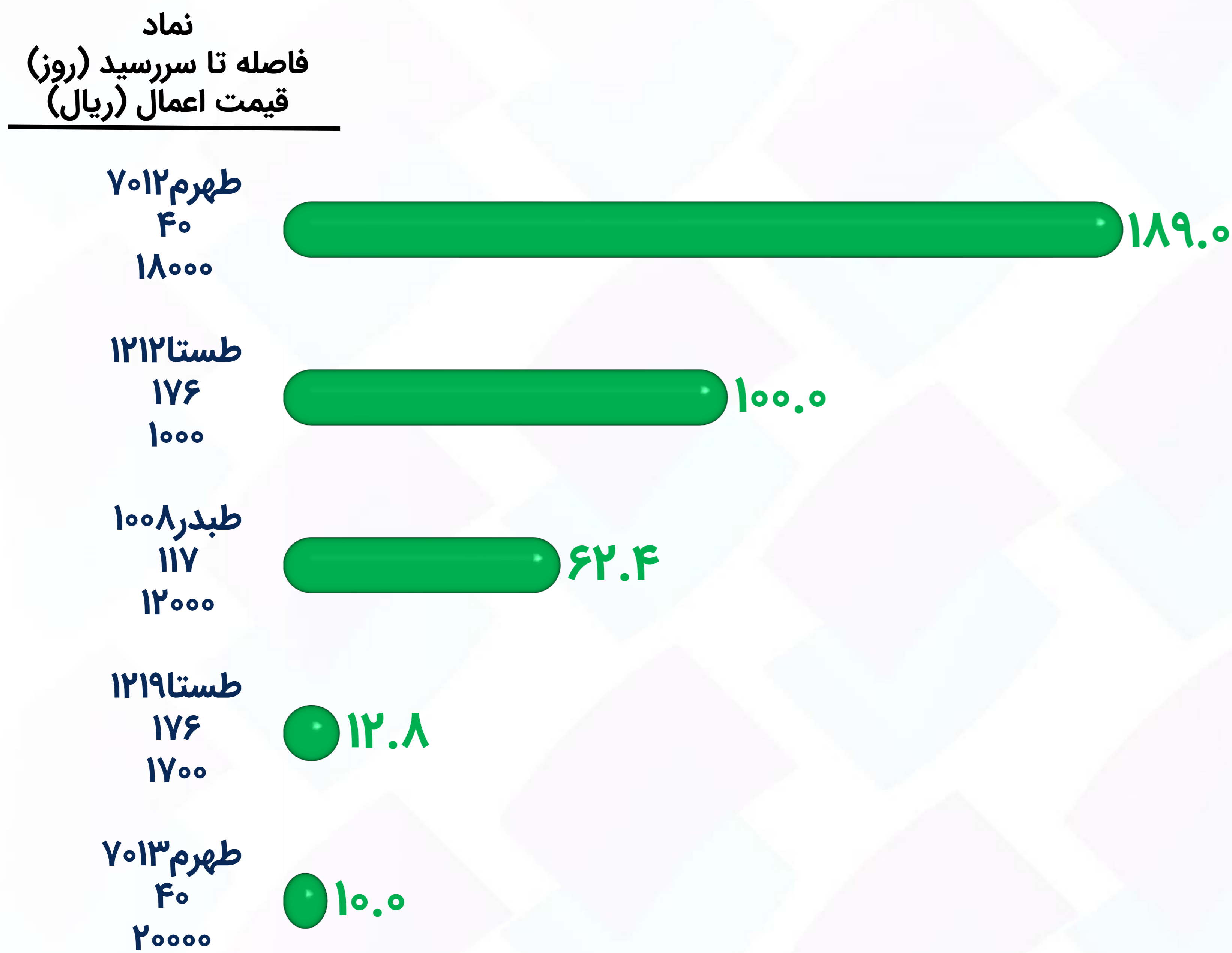


ارزش موقعیت‌های باز

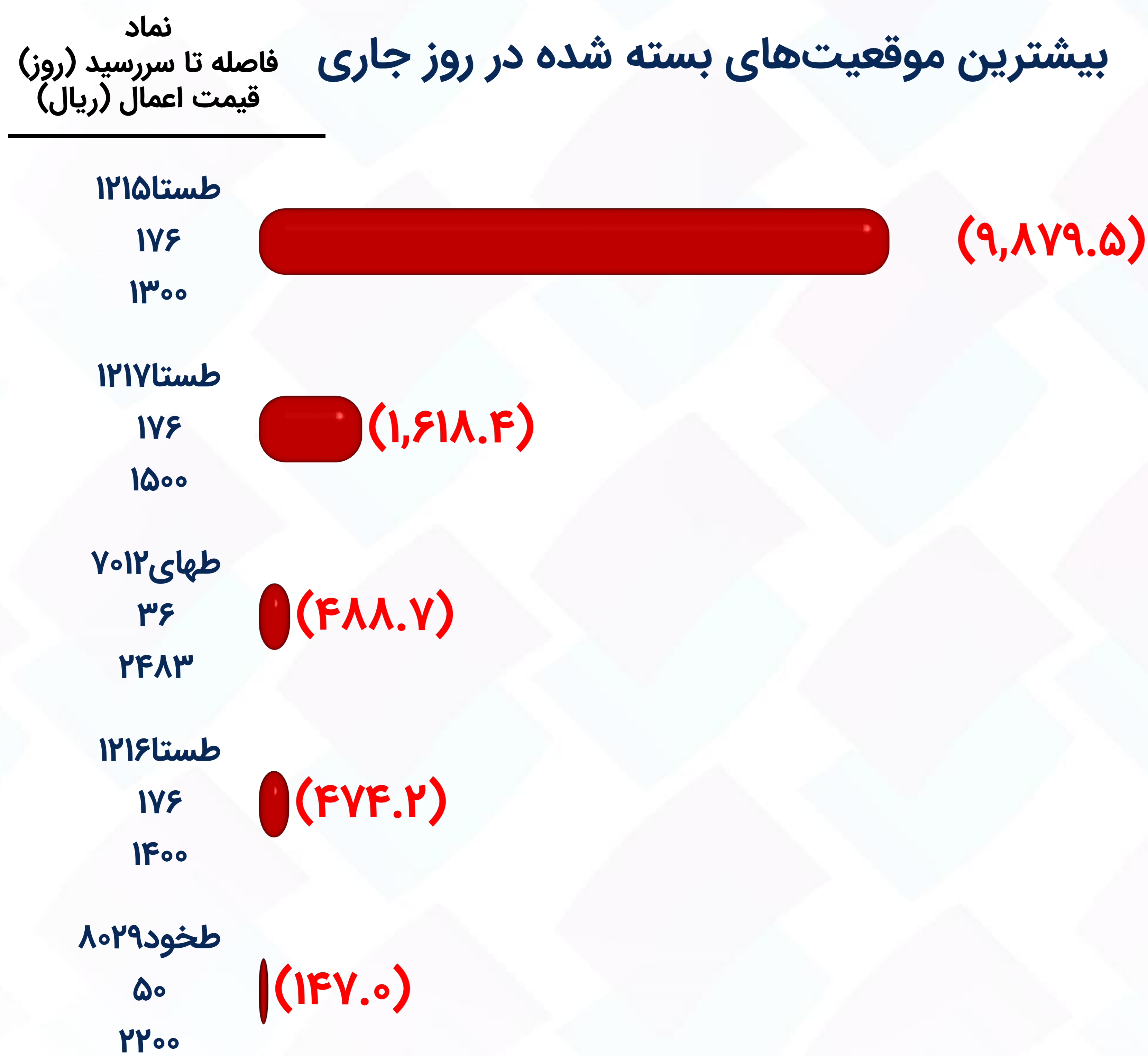


موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

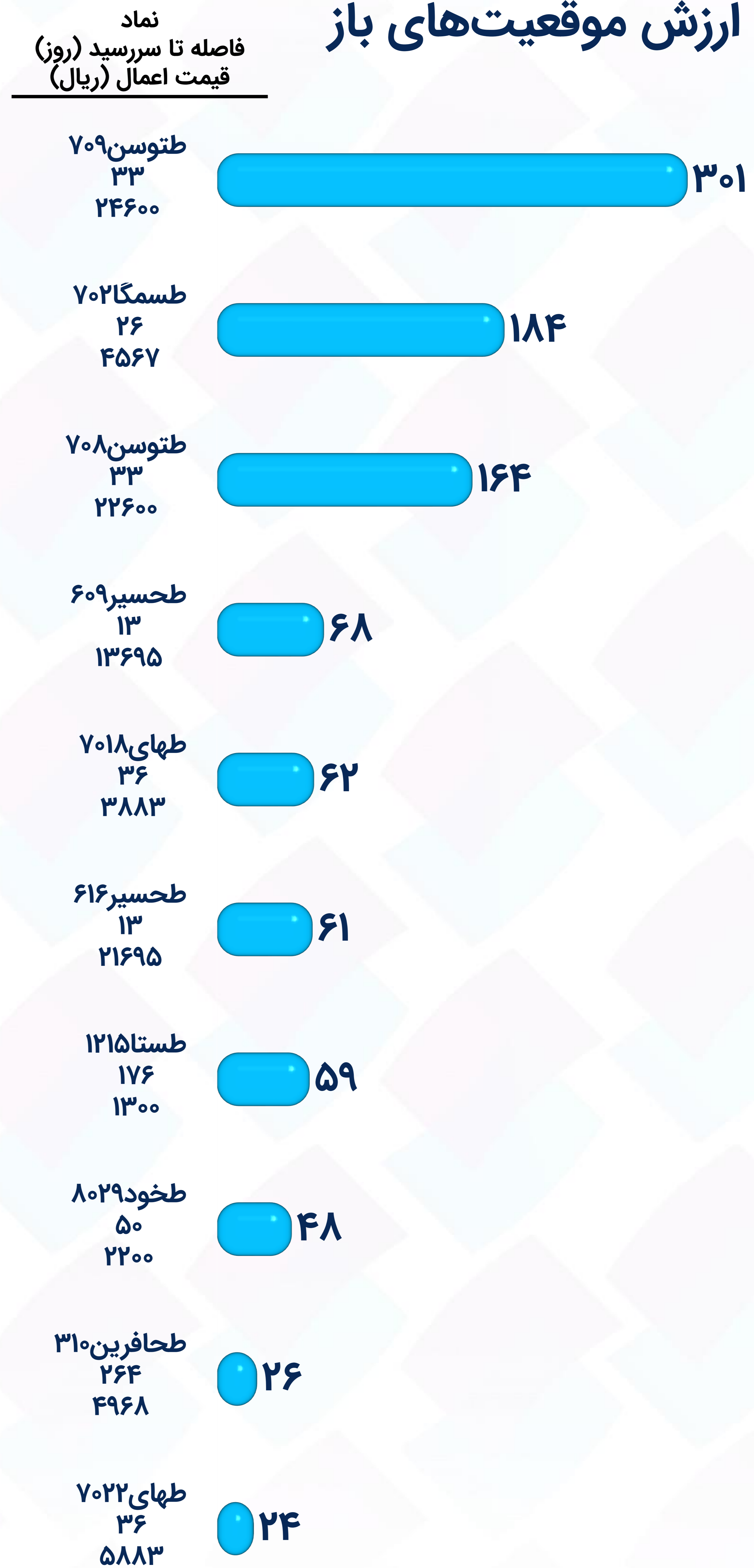
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



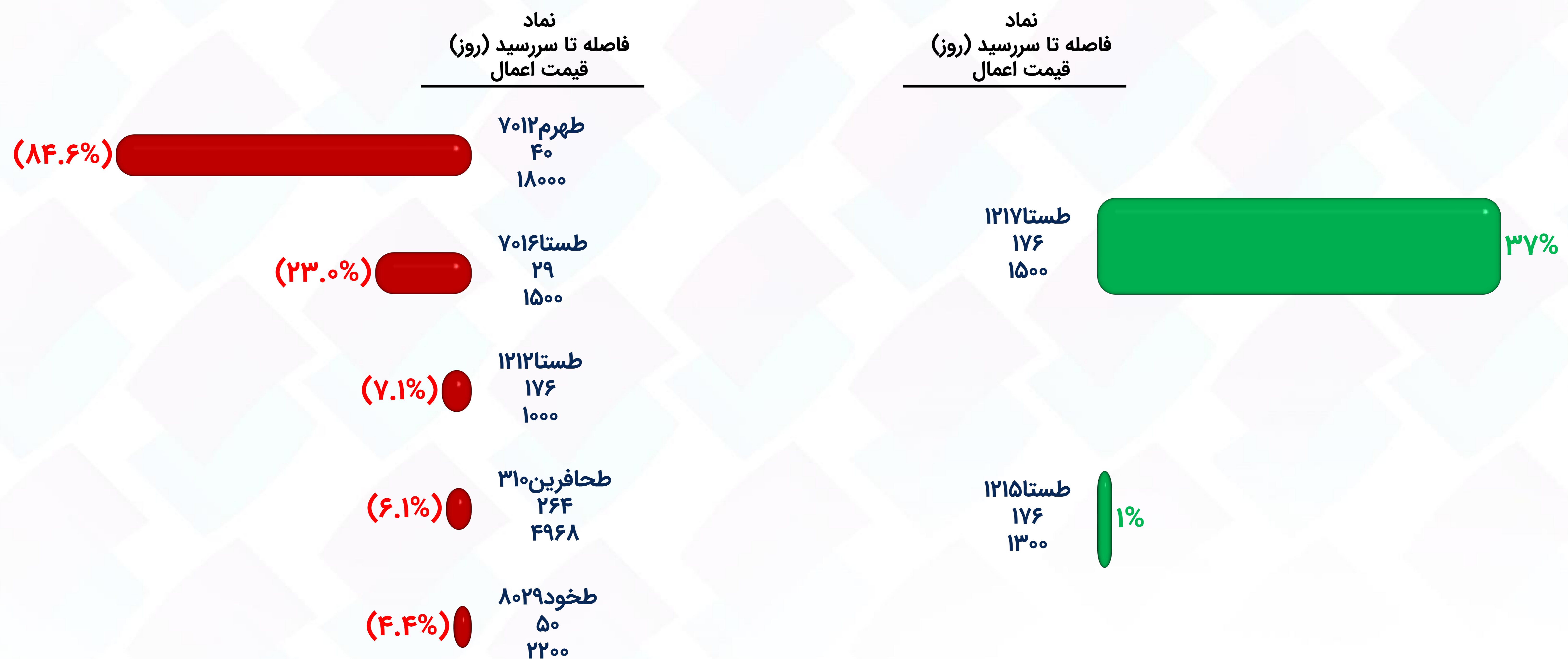
میلیارد تومان

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.