

شماره

۸۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ 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 تابلو اختیار معاملات

آموزش
قسمت دهم

اختیار شستا-700-1402/12/09 (صستا1209) -			
خرید	معامله	فروش	قیمت آخرین معامله
643	62 644 [10.65%]	653	
اولین	پایانی	دیروز	پایین‌ترین قیمت فروش (بهترین قیمت خرید)
615	35 617 [6.01%]	582	
تعداد معاملات		75	میانگین وزنی قیمت‌های معامله شده در طی روز معاملاتی
حجم معاملات		3,601	
ارزش معاملات		2,221 B	
ارزش مفهومی معاملات		3,164 B	
آخرین اطلاعات قیمت		10:40:35	
وضعیت		مجاز	

حجم معاملات * قیمت پایانی

بیشترین و کمترین قیمت معامله شده در روز معاملاتی	بازه روز	600	647
بیشترین و کمترین قیمت معامله شده در هفته	قیمت مجاز	1	100,000
بیشترین و کمترین قیمت معامله شده در سال	بازه هفته	553	699
بیشترین و کمترین قیمت معامله شده در سال	بازه سال	500	1,200
میانگین حجم معامله شده در ماه	تعداد سهام	1,000	
تعداد قراردادهای خرید و فروش به تفکیک حقیقی و حقوقی	حجم مینا	1	
تعداد خریدار و فروشنده به تفکیک حقیقی و حقوقی	سهام شناور	%	
	میانگین حجم ماه	6,991	

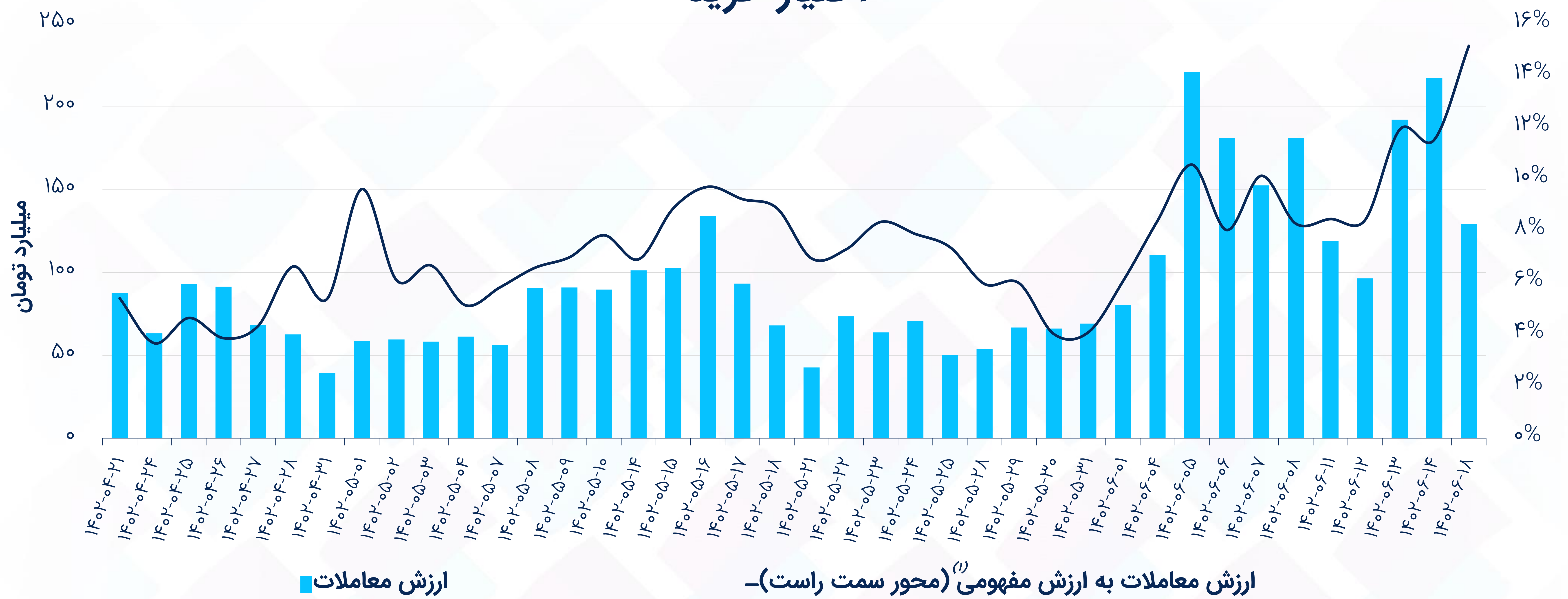
تعداد	حجم	فروش	خرید	حجم	تعداد
1	18	653	643	1	1
1	30	654	630	2	1

تعداد خریدار تعداد قرارداد خرید قیمت خرید قرار داد به ازای هر سهم دارایی پایه قیمت سفارش فروش قرارداد به ازای هر سهم دارایی پایه تعداد قرارداد فروش تعداد فروشنده

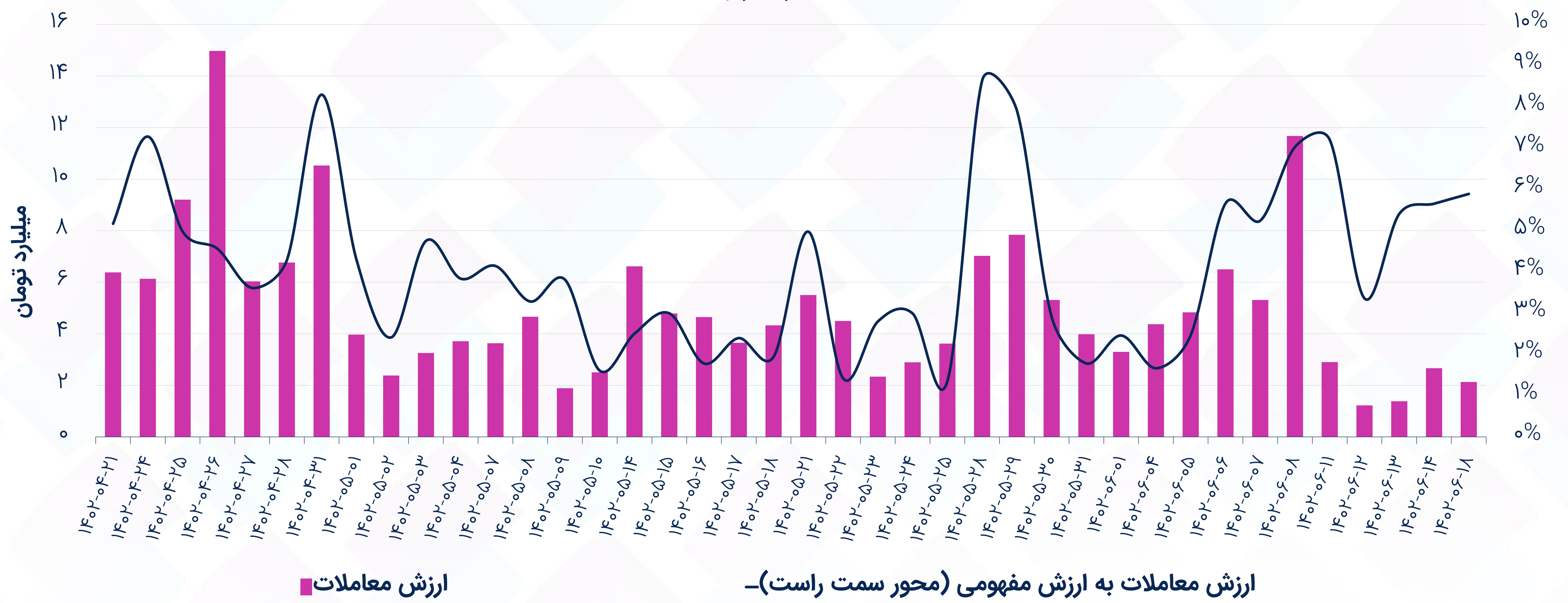
تعداد	حجم	فروش	خرید	حجم	تعداد
1	18	653	643	1	1
1	30	654	630	2	1

ارزش معاملات

اختیار خرید



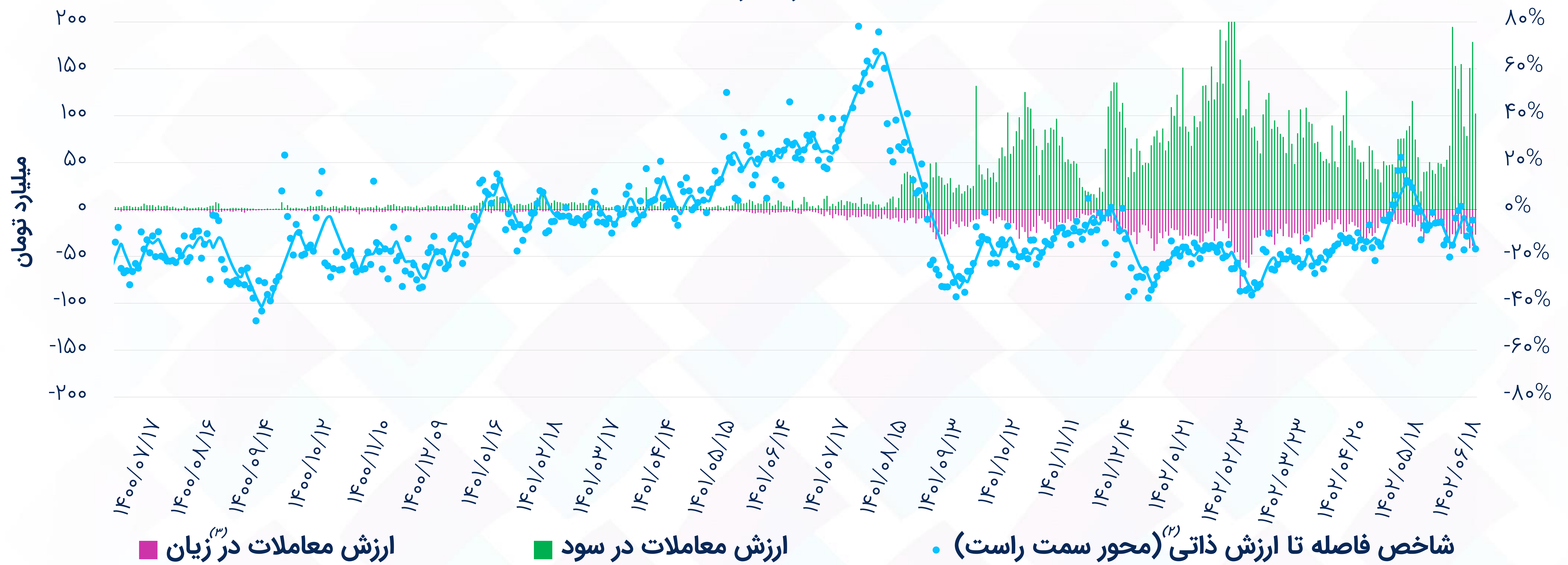
اختیار فروش



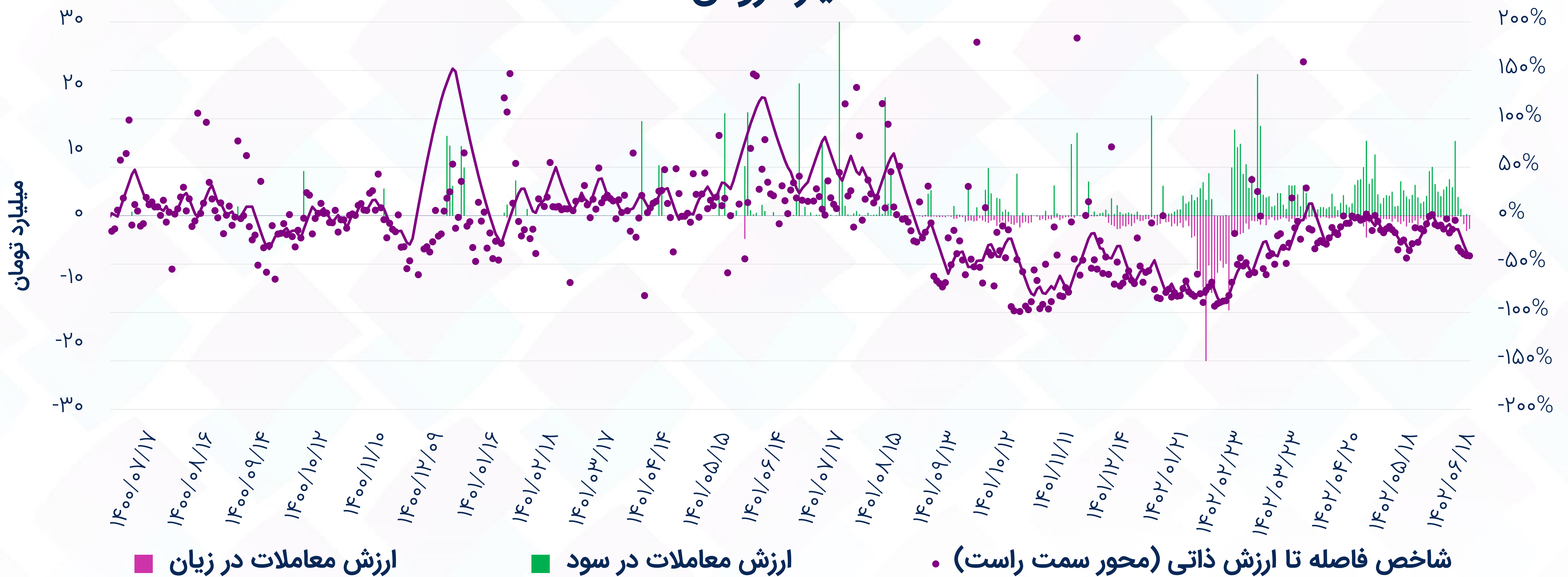
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۲۳	۷۳.۲	۴۴۴.۳	۷۱.۴	۱.۸	(۱۵.۸%)
خسپا	۱۱	۲۰.۷	۱۱۱.۸	۶.۱	۱۴.۶	(۳۰.۵%)
شستا	۲۵	۱۹.۳	۲۰۵.۳	۱۱.۳	۷.۹	(۱۶.۹%)
اهرم	۲۸	۸.۶	۳۷.۴	۷.۷	۰.۸	۳.۹%
دی	۱۲	۳.۳	۱۱.۱	۲.۶	۰.۶	(۱۲.۹%)
وبملت	۶	۲.۰	۲۲.۳	۱.۲	۰.۸	(۱۱.۳%)
کرمان	۳	۰.۹	۲.۲	۰.۸	۰.۱	(۸.۹%)

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	۸	۲,۱۲۶.۱	۳۵,۳۳۶.۵	۶۸.۶	۲,۰۵۷.۵	(۴۱.۶%)
حافرین	۱	۱.۴	۵.۲	۱.۴	۰.۰	۴۷.۱%
اهرم	۲	۱.۲	۷۳۶.۱	۰.۰	۱.۲	(۶۱.۲%)
توسن	۱	۰.۹	۲۴.۴	۰.۹	۰.۰	۳۷۷.۸%
شبندر	۱	۰.۴	۴.۶	۰.۴	۰.۰	(۲۵.۴%)
شتران	۱	۰.۴	۴.۶	۰.۴	۰.۰	(۲۷.۷%)
خودرو	۱	۰.۳	۴۶.۱	۰.۰	۰.۳	(۸۶.۵%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

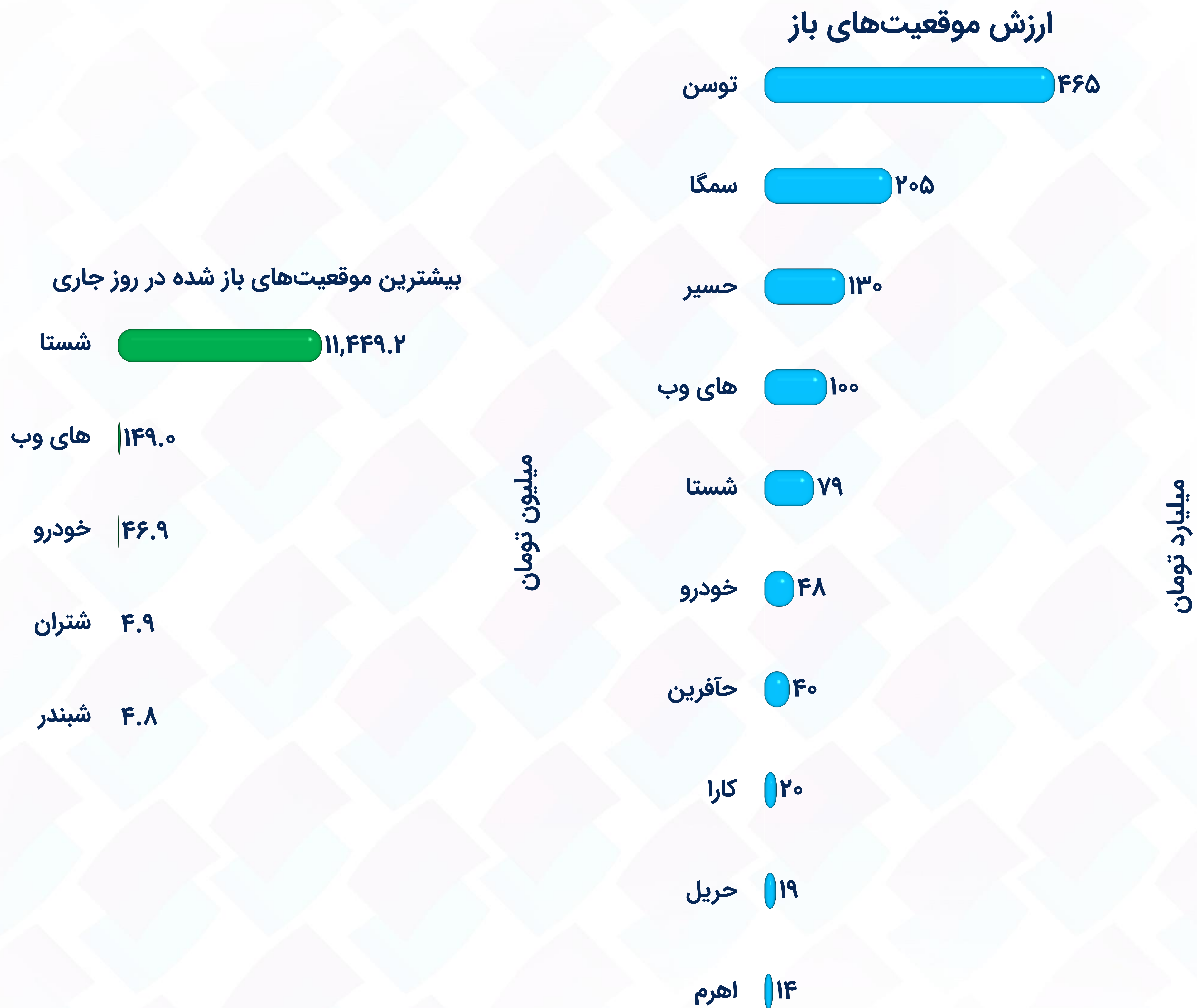
ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

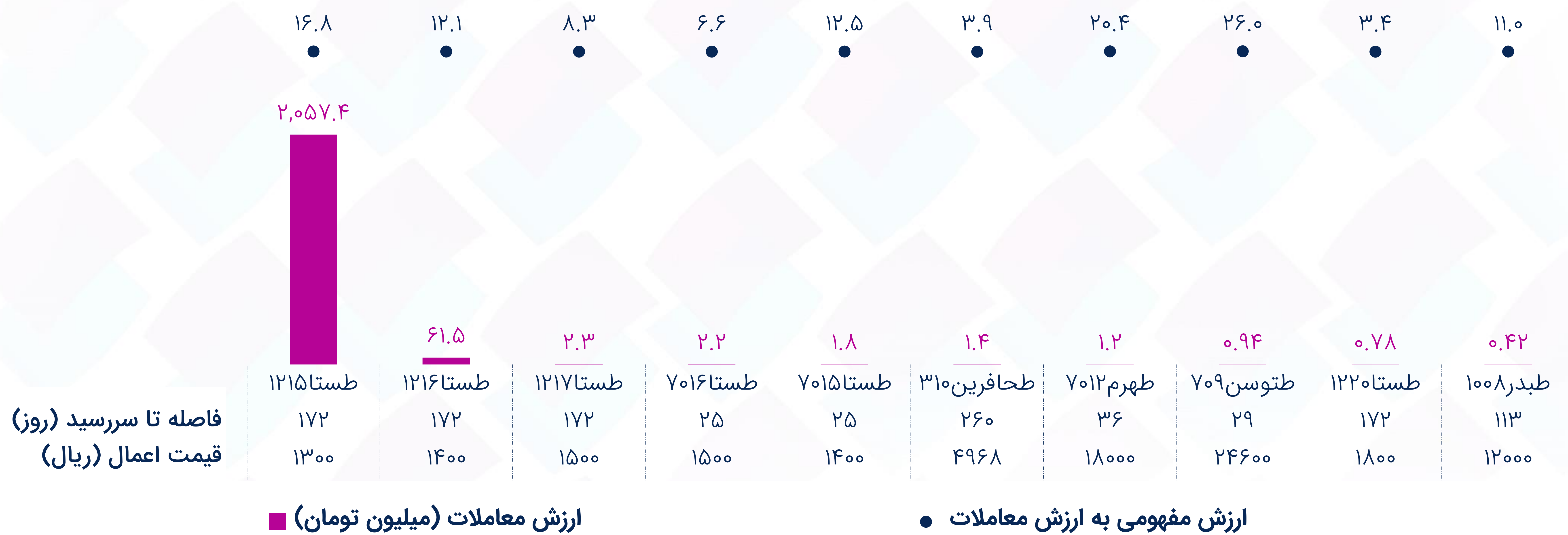


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۱۰۸%	۱,۵۵۸	۰.۳۴	۴۱.۱	۵۰.۸%	۳۰,۷۴۹	۲۰,۳۹۰	۷۴۹	۳۴۶.۴	۱۸۷	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۲۲۹
۹۵%	۶۸۰	۱.۰۰	۵.۶	(۱۳.۴%)	۱,۹۴۶	۲,۲۴۸	۳۴۹	۶.۶	۲۶	۱,۵۹۷	وبصادر ۷۰۰۰
۵۴%	۱۵۵	۰.۷۵	۳۱.۲	۰.۱%	۳,۱۵۵	۳,۱۵۲	۱۰۱	۱.۶	۱۲	۳,۰۵۴	تفارس ۶۰۳
۳۳%	۱,۲۰۷	۰.۶۶	۱۲.۰	۱۲.۷%	۱۰,۹۰۹	۹,۶۸۰	۹۰۹	۱۰.۰	۱۳۸	۱۰,۰۰۰	بساما ۱۱۰۳
۳۱%	۹۷۶	۱.۰۰	۳.۹	(۶.۷%)	۲,۹۴۰	۳,۱۵۲	۷۴۵	۶.۲	۱۲	۲,۱۹۵	تفارس 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
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۸۱۲.۸	۴۵%	۳,۲۵۱	۲,۲۴۸	۴	۱.۹	۲۶	۳,۲۴۷	وبصادر ۷۰۱
(۹۶%)	۰	۰.۰۰	۱,۳۳۴.۳	۳۶%	۴,۰۰۳	۲,۹۴۳	۳	۵.۷	۱۹	۴,۰۰۰	خودرو ۷۰۹۸
(۹۲%)	۲	۰.۰۱	۱۶۷.۷	۱۰۵%	۵,۰۳۰	۲,۴۵۴	۳۰	۹.۹	۱۲۴	۵,۰۰۰	خسپا ۱۰۱
(۹۰%)	۱	۰.۰۱	۴۹۱.۷	۴۵%	۶,۸۸۴	۴,۷۳۵	۱۴	۱.۴	۴۰	۶,۸۷۰	وبملت ۷۰۰۸
(۹۰%)	۸	۰.۰۴	۵۴.۳	۳۸%	۴,۰۷۵	۲,۹۴۳	۷۵	۲۵۷.۱	۴۷	۴,۰۰۰	خودرو ۸۰۲۴

(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
۴۷.۱%	۱,۱۷۷	-۰.۷۵	۵.۲	۳۵%	۴,۱۶۸	۳,۰۸۶	۸۰۰	۱.۴	۲۶۱	۴,۹۶۸	طحافرین ۳۱۰
(۲۳.۱%)	۱۵۴	-۰.۸۷	۶.۵	(۲%)	۱,۳۰۰	۱,۳۲۶	۲۰۰	۲.۲	۲۶	۱,۵۰۰	طستا ۷۰۱۶

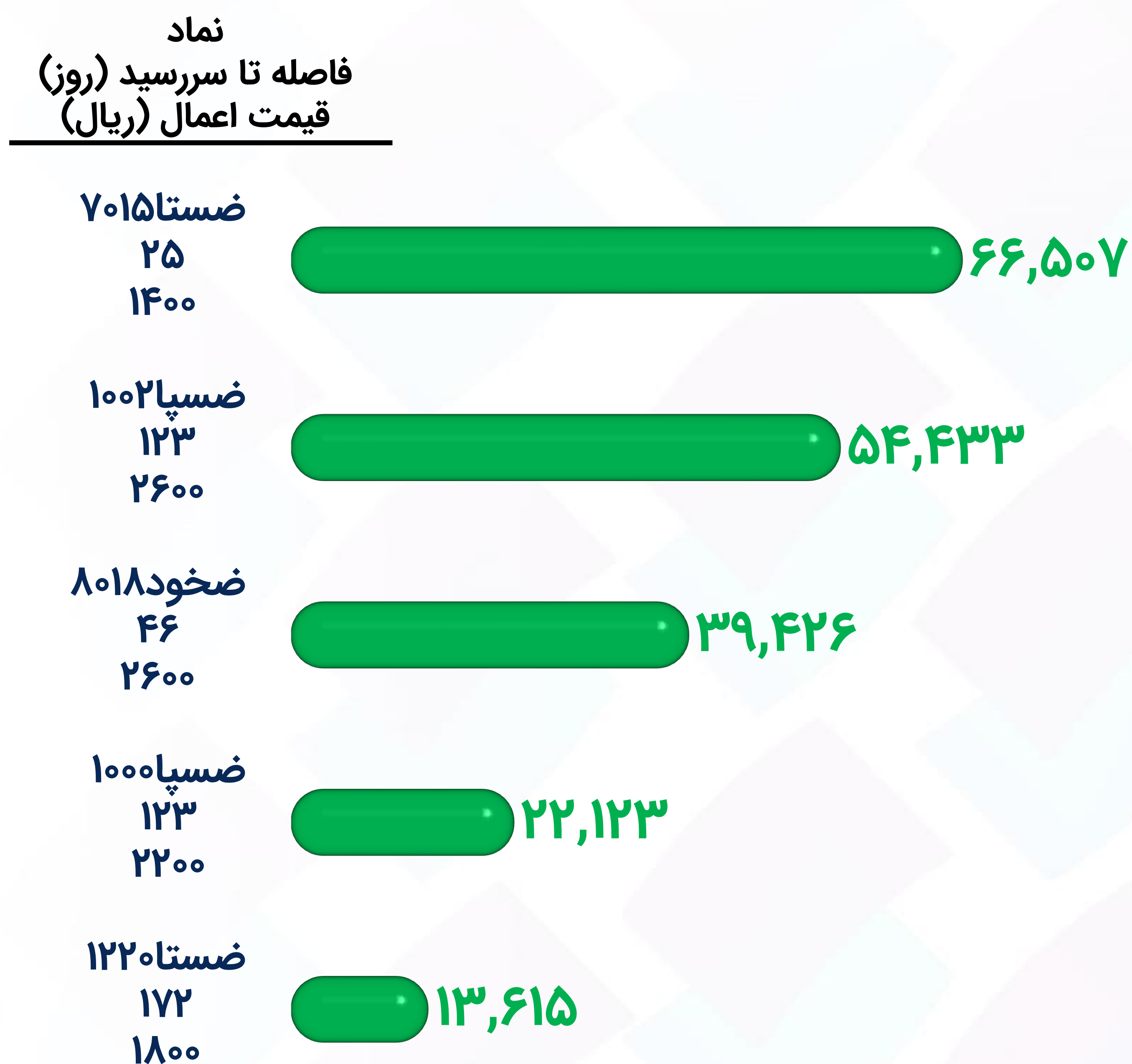
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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
(۶۰%)	۳۹۹	-۰.۱۸	۱۷.۰	(۱۷%)	۱۷,۰۰۰	۲۰,۳۹۰	۱,۰۰۰	۱.۲	۳۷	۱۸,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۲
(۴۲%)	۴۶	-۰.۲۳	۱۵.۵	(۸%)	۱,۲۲۱	۱,۳۲۶	۷۹	۲,۰۵۷.۴	۱۷۳	۱,۳۰۰	طستا ۱۲۱۵
(۲۹%)	۷۸	-۰.۳۴	۱۱.۷	(۳%)	۱,۲۹۰	۱,۳۲۶	۱۱۰	۶۱.۵	۱۷۳	۱,۴۰۰	طستا ۱۲۱۶
(۲۸%)	۷۶	-۰.۶۴	۱۲.۲	(۲%)	۱,۲۹۴	۱,۳۲۶	۱۰۶	۱.۸	۲۶	۱,۴۰۰	طستا ۷۰۱۵
(۲۴%)	۱۲۱	-۰.۴۵	۸.۴	۱%	۱,۳۴۰	۱,۳۲۶	۱۶۰	۲.۳	۱۷۳	۱,۵۰۰	طستا ۱۲۱۷

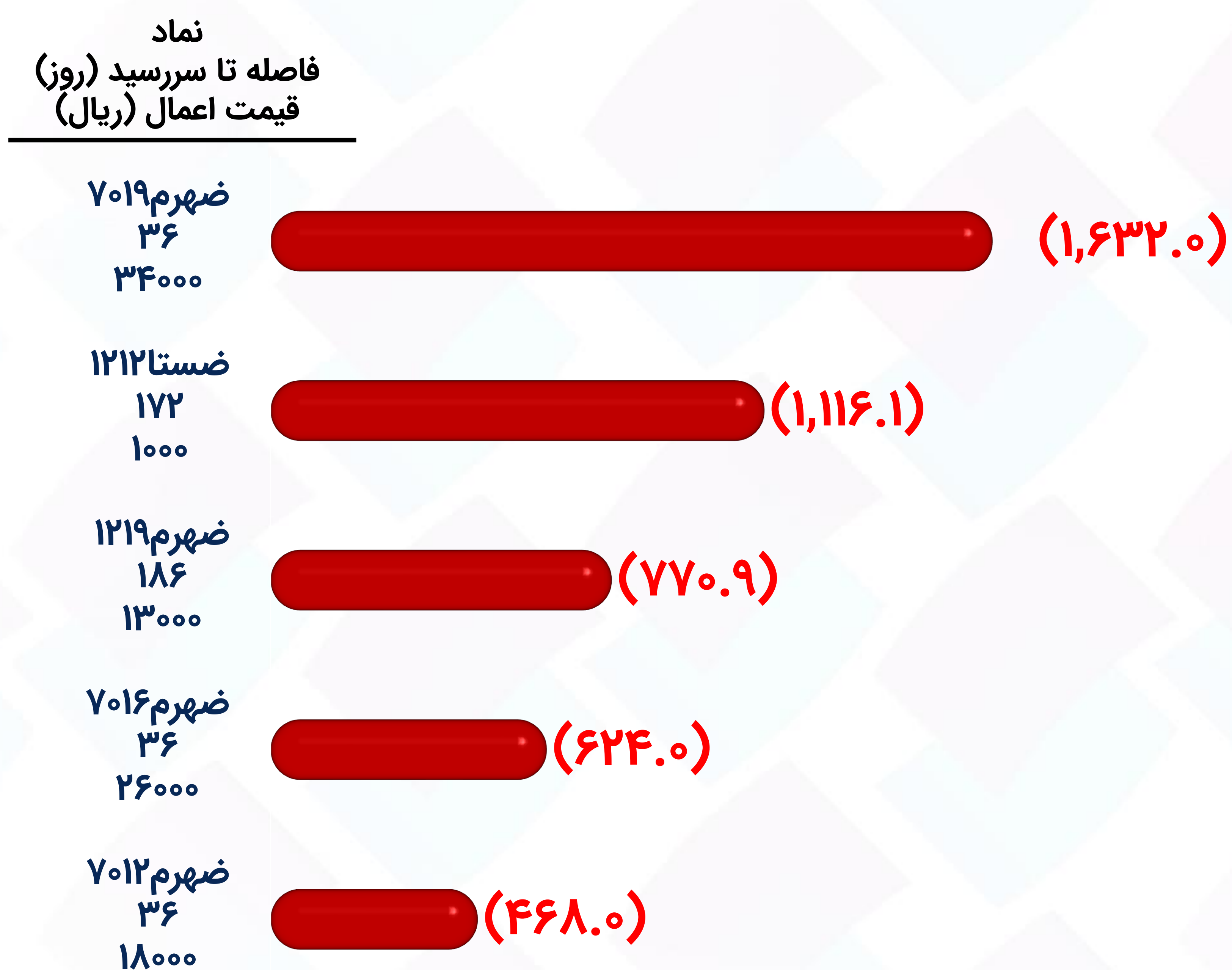
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است). تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

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

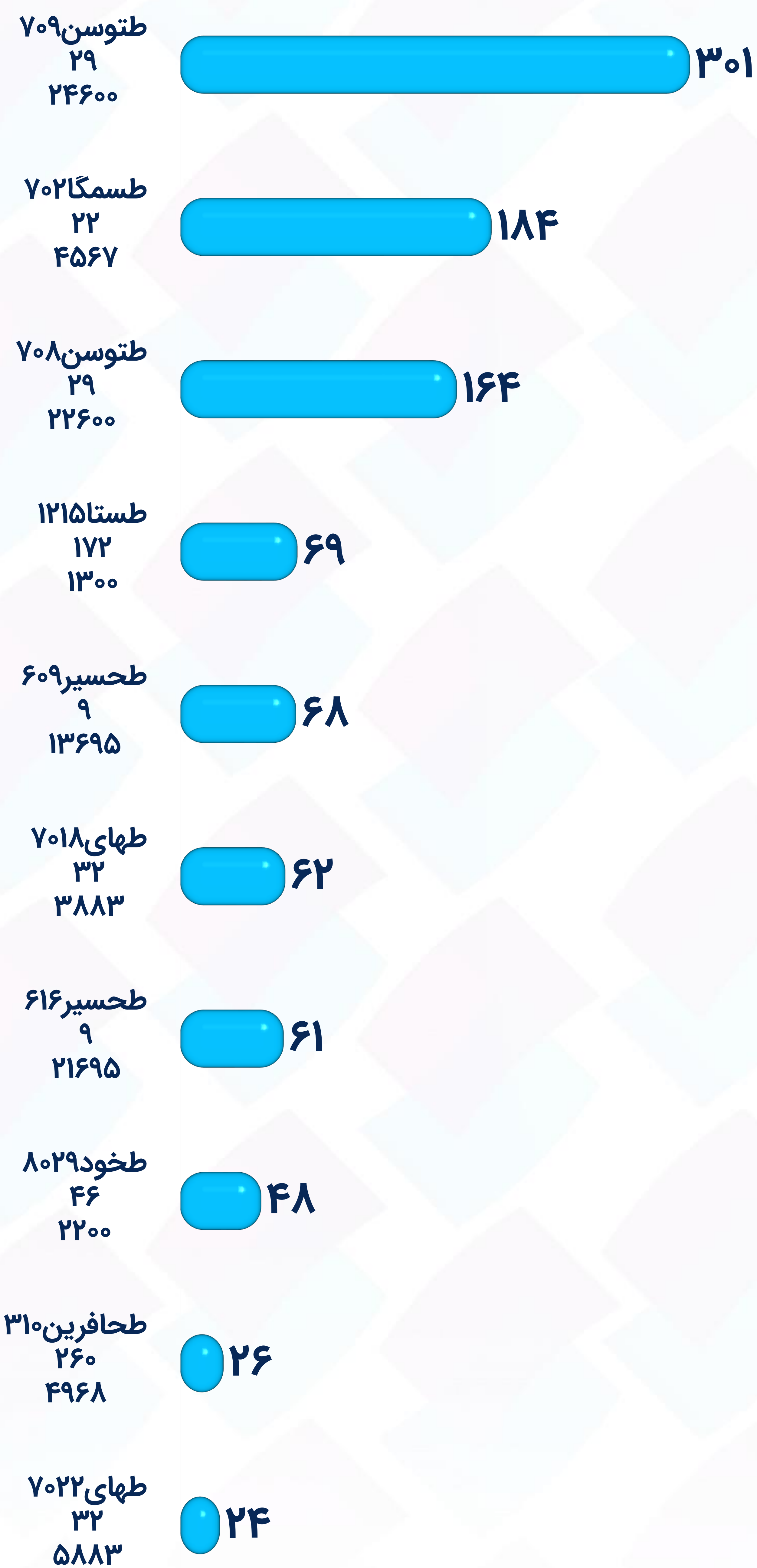
میلیون تومان

میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

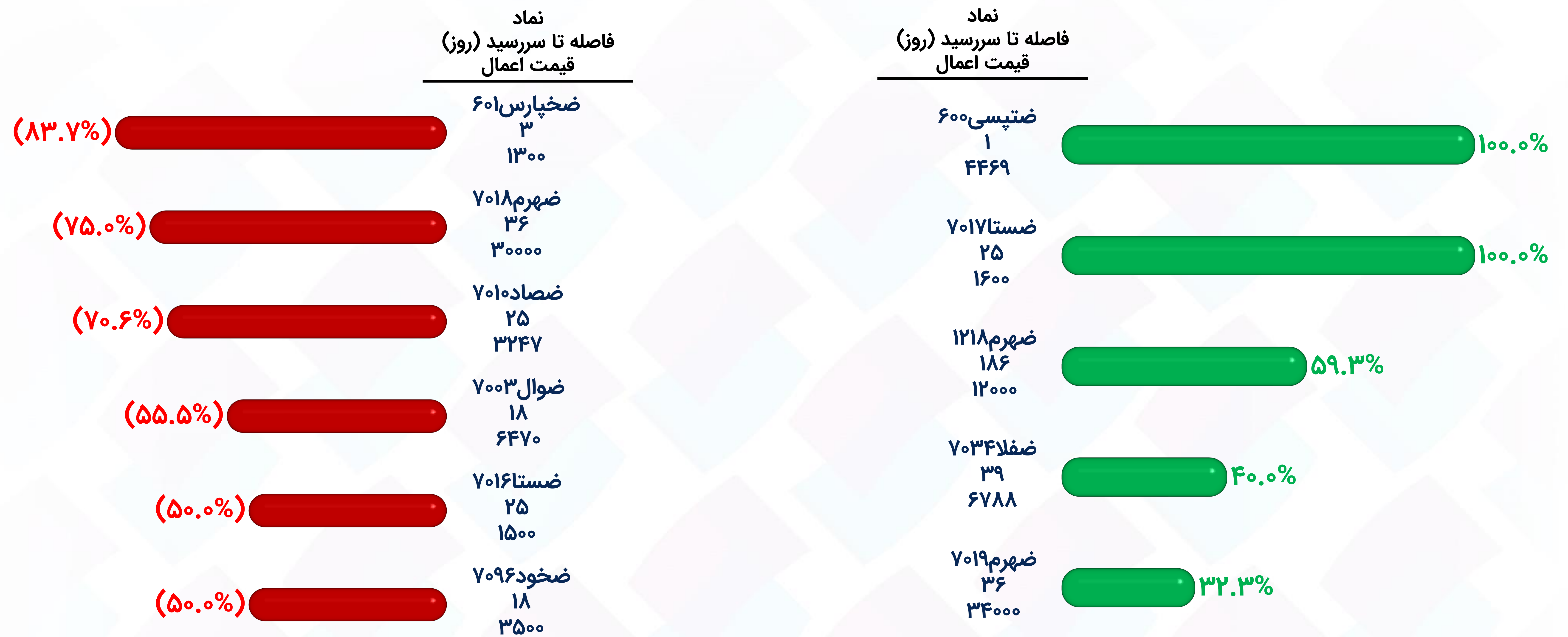
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

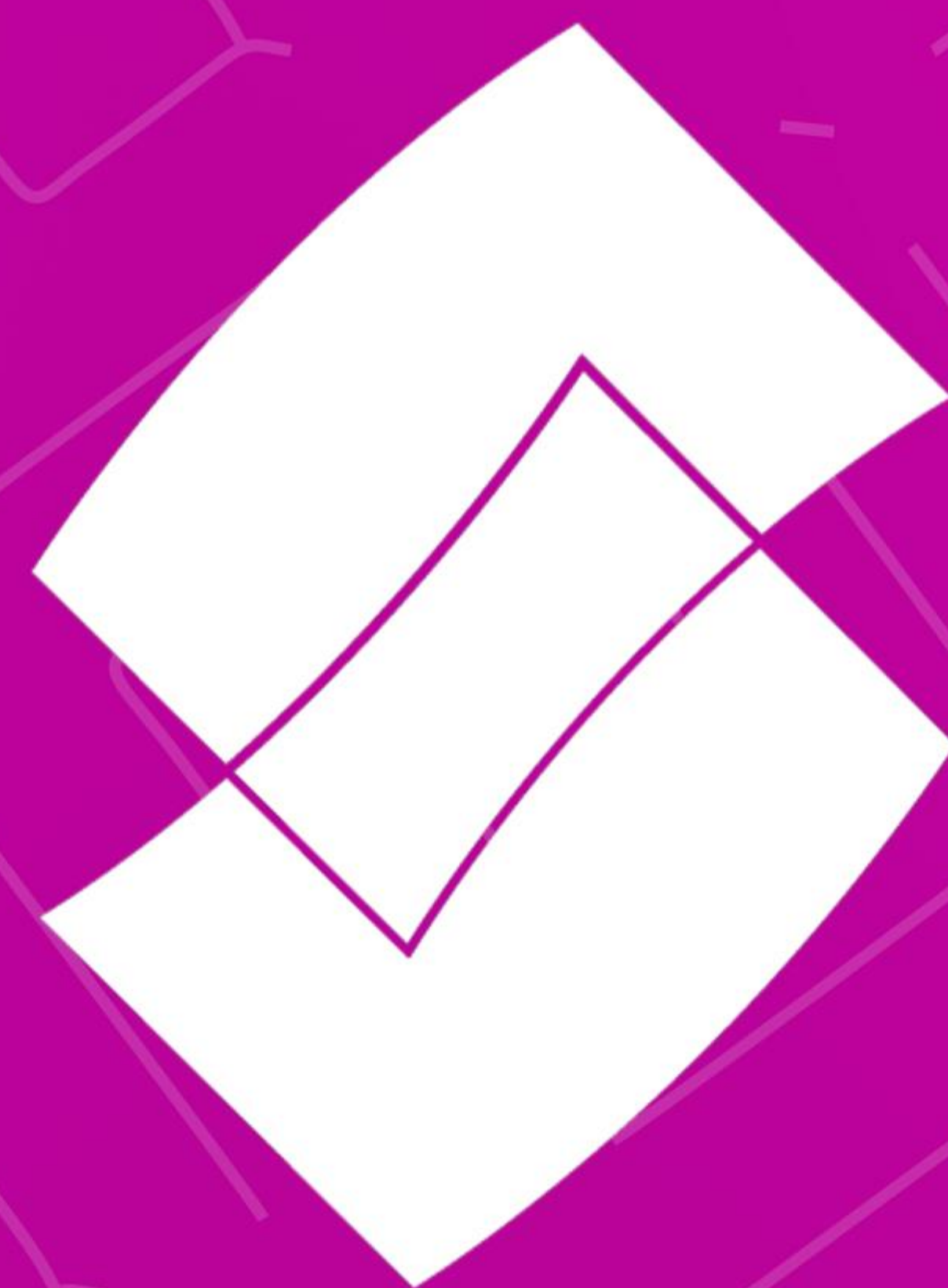
اختیار خرید



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.