

شماره

۸۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۹ 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

قیمت آخرین معامله

پایین‌ترین قیمت فروش
(بهترین قیمت خرید)

میانگین وزنی قیمت‌های معامله
شده در طی روز معاملاتی

اختیارخ شستا-1402/12/09-700 (ضشتا1209) -

خرید	معامله	فروش
643	62 644 [10.65%]	653
اولین	پایانی	دیروز
615	35 617 [6.01%]	582
تعداد معاملات		
75		
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

بالاترین قیمت خرید
(بهترین قیمت فروش)

اولین قیمت معاملاتی

تعداد قراردادهای معامله شده

حجم معاملات * اندازه قرار داد * قیمت پایانی دارایی پایه

بیشترین و کمترین قیمت معامله
شده در روز معاملاتی

بیشترین و کمترین قیمت معامله
شده در هفته

بیشترین و کمترین قیمت معامله
شده در سال

میانگین حجم معامله شده در
ماه

تعداد قراردادهای خرید و فروش به
تفکیک حقیقی و حقوقی

تعداد خریدار و فروشنده به تفکیک
حقیقی و حقوقی

بازه روز

600

بازه مجاز

1

بازه هفته

553

بازه سال

500

تعداد سهام

1,000

حجم مبنا

1

سهام شناور

%

میانگین حجم ماه

6,991

تعداد سهام هر قرارداد

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

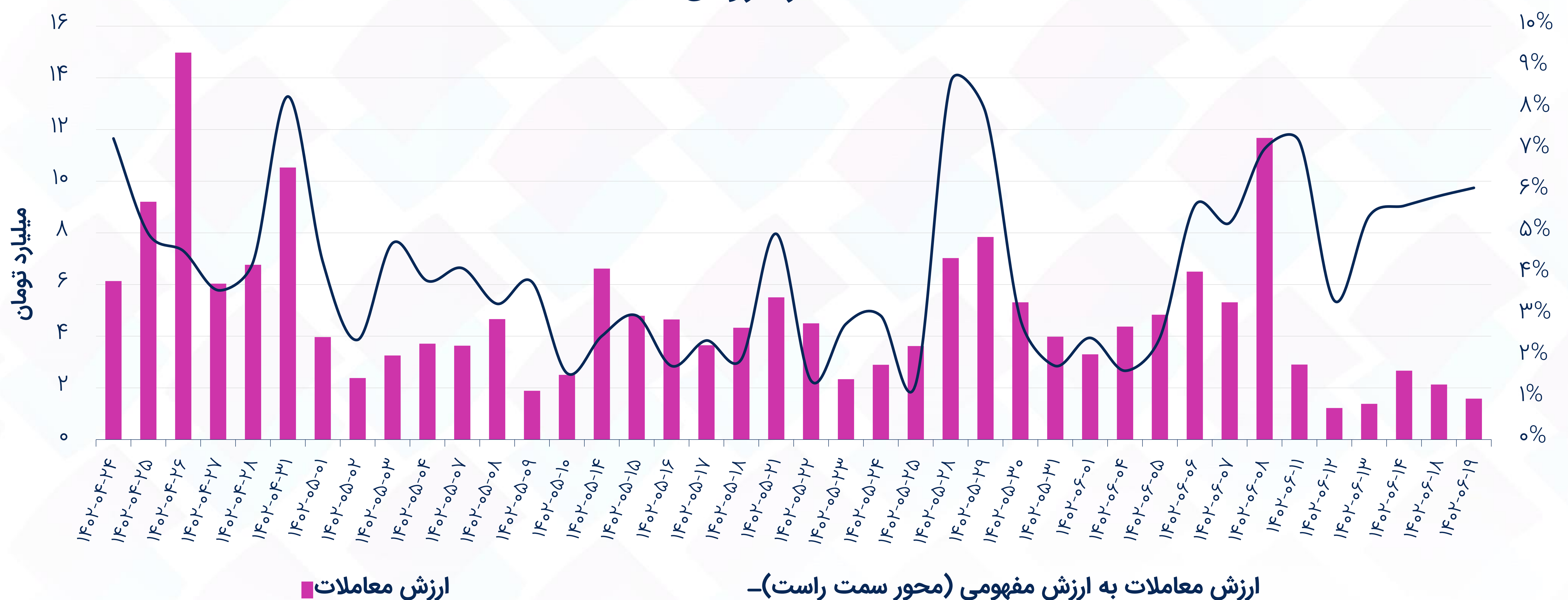
تعداد	حجم	خرید	فروش	حجم	تعداد
1	1	643	653	18	1
1	2	630	654	30	1

ارزش معاملات

اختیار خرید

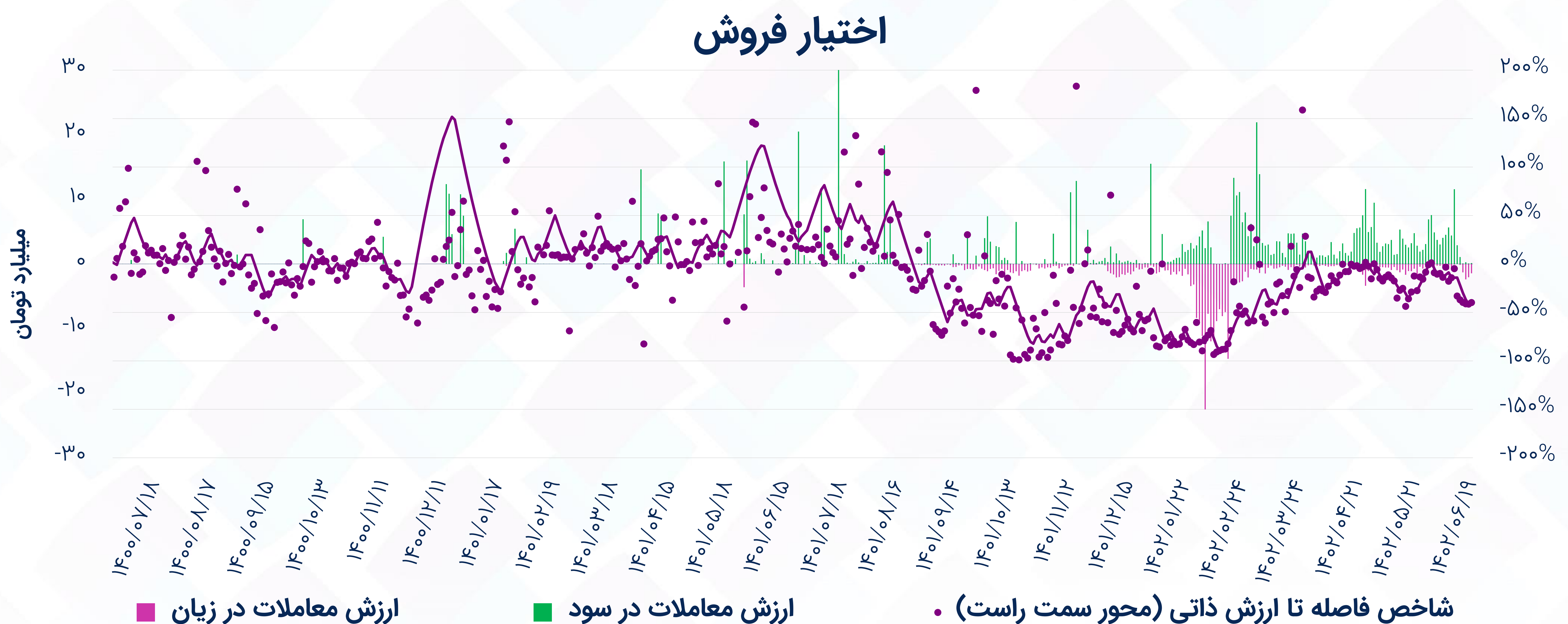
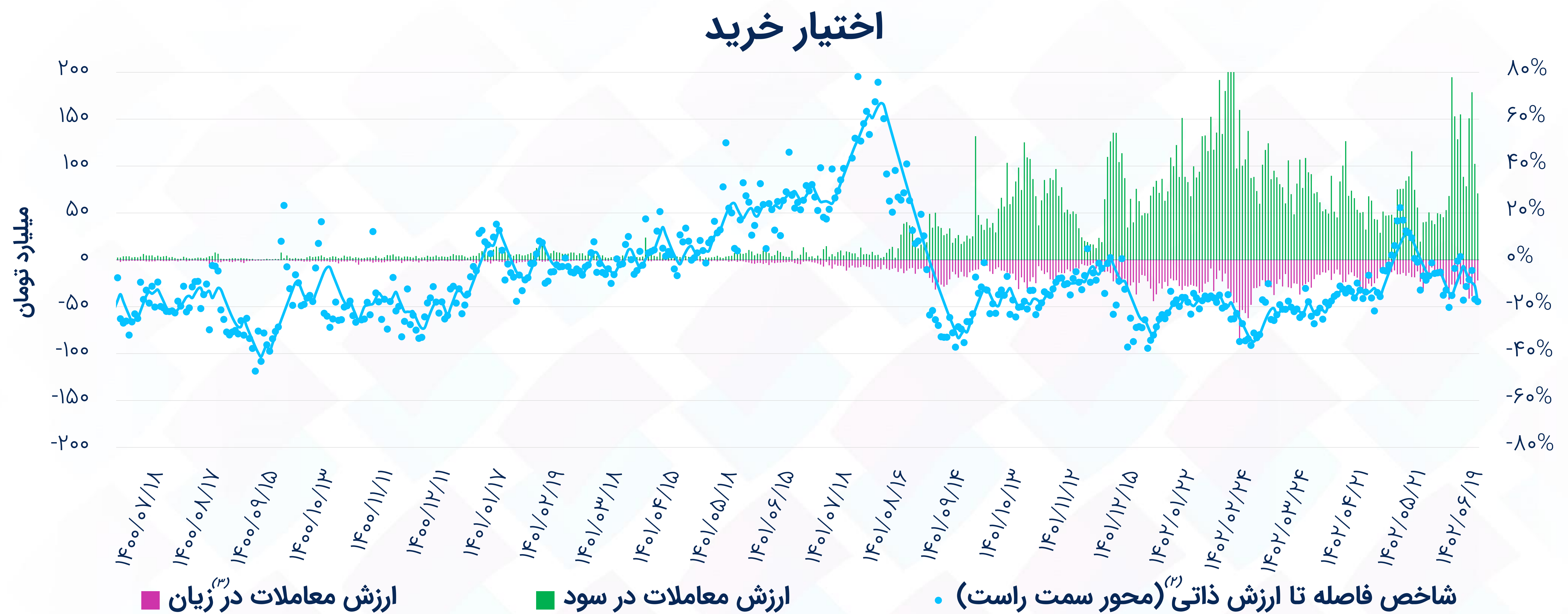


اختیار فروش



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

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی^(۱)



(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

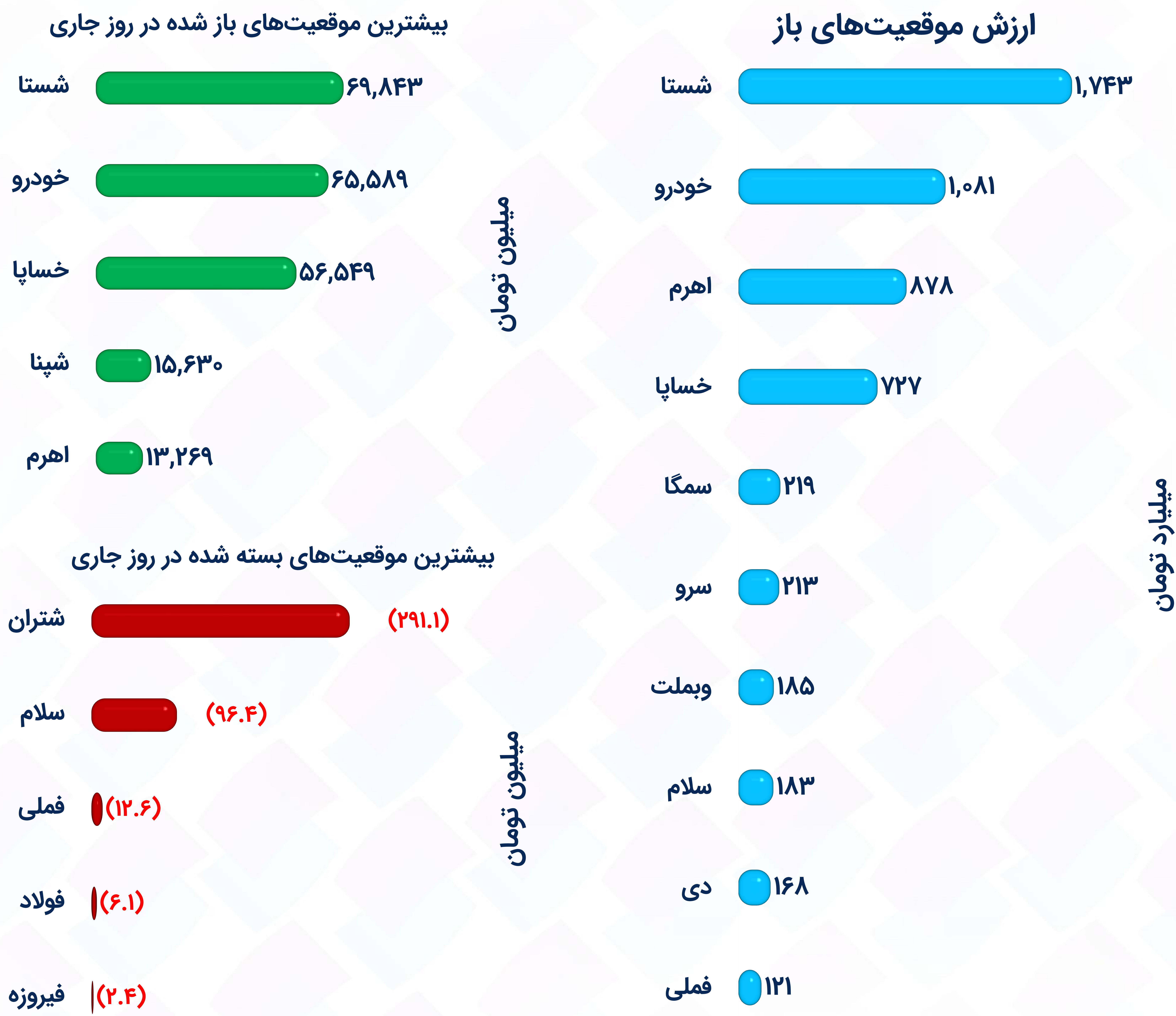
اختیار خرید

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	۲۶	۴۴.۸	۳۰۳.۲	۴۳.۹	۰.۹	(۱۶.۳%)
خسایا	۱۸	۱۷.۴	۹۹.۸	۵.۵	۱۲.۰	(۳۰.۶%)
شستا	۲۵	۱۲.۱	۱۵۱.۹	۴.۹	۷.۱	(۲۲.۶%)
اهرم	۲۱	۸.۵	۳۲.۲	۸.۰	۰.۵	(۱.۴%)
شتاب	۷	۳.۵	۱۳.۴	۳.۵	۰.۰	(۵.۰%)
دی	۱۴	۲.۵	۸.۵	۲.۲	۰.۴	(۱۲.۶%)
های وب	۵	۱.۱	۸.۵	۰.۸	۰.۳	(۱۸.۰%)

اختیار فروش

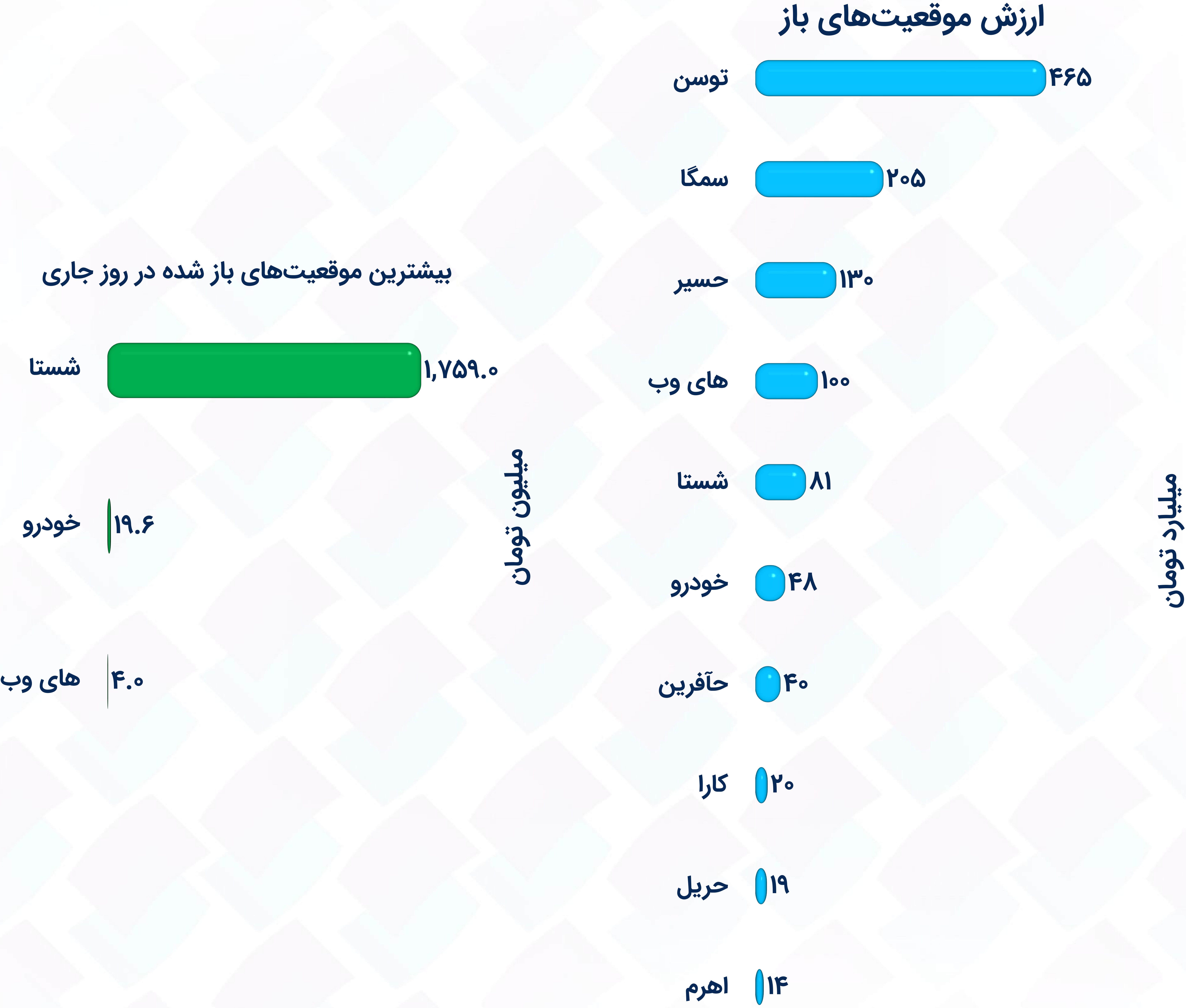
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
شستا	۸	۱,۵۶۷.۳	۲۵,۶۷۴.۹	۱۲۵.۴	۱,۴۴۱.۹	(۳۹.۶%)
حسیر	۲	۷.۰	۵.۵	۷.۰	۰.۰	(۷۶.۴%)
خودرو	۱	۵.۵	۳۱۳.۸	۰.۰	۵.۵	(۹۵.۴%)
توسن	۱	۴.۰	۲۶.۸	۴.۰	۰.۰	۱۲.۹%
های وب	۱	۰.۶	۰.۵	۰.۶	۰.۰	۴.۰%

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

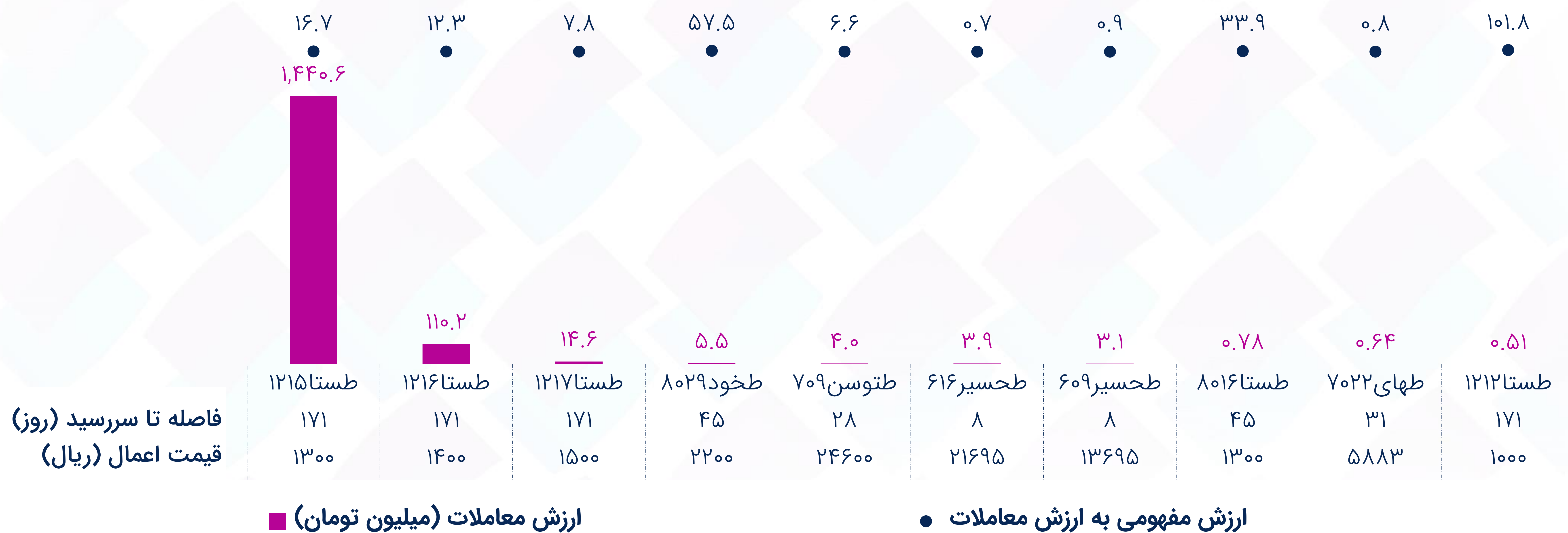


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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 سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضراگرس ۱۲۱۱	زاگرس	۱۳۹,۰۰۰	۱۷۷	۳۸.۰	۲۰,۰۰۰	۱۴۱,۲۵۰	۱۵۹,۰۰۰	۱۲.۶%	۸.۰	۰.۷۴	۲۵,۷۰۳	۲۹%
ضهرم ۷۰۱۳	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۶	۱۳۴.۲	۱,۴۵۵	۲۰,۰۱۰	۲۱,۴۵۵	۷.۲%	۱۴.۷	۰.۵۹	۱,۶۹۹	۱۷%
ضهرم ۱۲۲۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۸۶	۹۲.۶	۳,۱۰۷	۲۰,۰۱۰	۲۵,۱۰۷	۲۵.۵%	۸.۱	۰.۶۲	۳,۵۸۴	۱۵%
ضهرم ۷۰۱۴	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳۶	۱۶۹.۴	۷۷۳	۲۰,۰۱۰	۲۲,۷۷۳	۱۳.۸%	۲۹.۵	۰.۳۹	۸۸۸	۱۵%
ضستا ۷۰۱۲	شستا	۱,۱۰۰	۲۵	۱۱.۰	۲۱۴	۱,۳۲۳	۱,۳۱۴	(۰.۷%)	۶.۱	۰.۹۹	۲۴۳	۱۳%

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 سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضخود ۷۰۹۸	خودرو	۴,۰۰۰	۱۸	۲.۷	۴	۲,۹۳۲	۴,۰۰۴	۳۷%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸%)
ضخود ۹۰۲۳	خودرو	۵,۰۰۰	۸۱	۲.۷	۲۷	۲,۹۳۲	۵,۰۲۷	۷۱%	۱۸۶.۲	۰.۰۱	۲	(۹۲%)
ضشنا ۸۰۲۹	شپنا	۱۳,۰۰۰	۵۰	۵.۹	۲۳	۸,۴۵۰	۱۳,۰۲۳	۵۴%	۵۶۶.۲	۰.۰۱	۲	(۹۰%)
ضخود ۸۰۲۴	خودرو	۴,۰۰۰	۴۶	۴۴۸.۰	۵۳	۲,۹۳۲	۴,۰۵۳	۳۸%	۷۶.۵	۰.۰۴	۷	(۸۸%)
ضصاد ۱۱۴۵	وبصادر	۳,۹۹۷	۱۴۴	۶.۷	۴۸	۲,۲۴۷	۴,۰۴۵	۸۰%	۸۴.۳	۰.۰۳	۷	(۸۵%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
(۲) فاصله تا سربه‌سر: 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 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 سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طوسن ۷۰۹	توسن	۲۴,۶۰۰	۲۹	۴۰	۳,۱۱۴	۲۰,۶۰۰	۲۱,۴۸۶	۴%	۶.۹	-۰.۹۸	۳,۵۱۵	۱۲.۹%
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱,۴۰۰	۱۷۲	۱۱۰.۲	۱۰۸	۱,۳۲۳	۱,۲۹۲	(۲%)	۱۲.۰	-۰.۳۴	۸۰	(۲۶.۳%)

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 سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طحسیر ۶۰۹	حسیر	۱۳,۶۹۵	۹	۳.۱	۱۵,۵۴۰	۱۳,۶۷۰	-۱,۸۴۵	(۱۱۳%)	-۰.۱	-۰.۴۶	۴۱۷	(۹۷%)
طخود ۸۰۲۹	خودرو	۲,۲۰۰	۴۶	۵.۵	۵۱	۲,۹۳۲	۲,۱۴۹	(۲۷%)	۴۲.۱	-۰.۰۱	۲	(۹۵%)
طحسیر ۶۱۶	حسیر	۲۱,۶۹۵	۹	۳.۹	۱۹,۷۰۰	۱۳,۶۷۰	۱,۹۹۵	(۸۵%)	۰.۱	-۱.۰۰	۷,۸۸۷	(۶۰%)
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱,۳۰۰	۱۷۲	۱,۴۴۰.۶	۷۹	۱,۳۲۳	۱,۲۲۱	(۸%)	۱۵.۵	-۰.۲۳	۴۷	(۴۱%)
طستا ۱۲۱۷	شستا	۱,۵۰۰	۱۷۲	۱۴.۶	۱۷۰	۱,۳۲۳	۱,۳۳۰	۱%	۷.۸	-۰.۴۶	۱۲۳	(۲۷%)

(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

ارزش موقعیت‌های باز

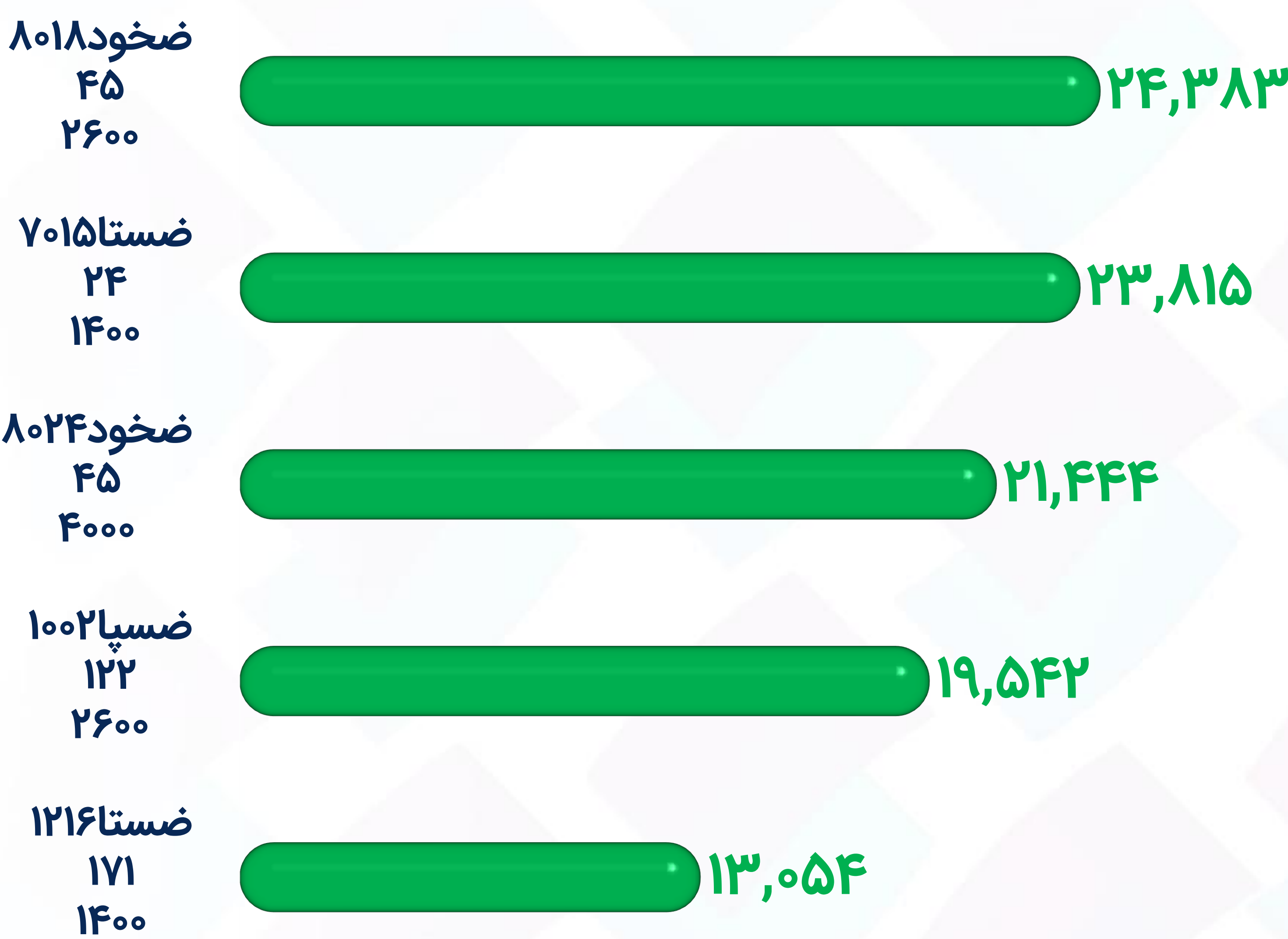
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

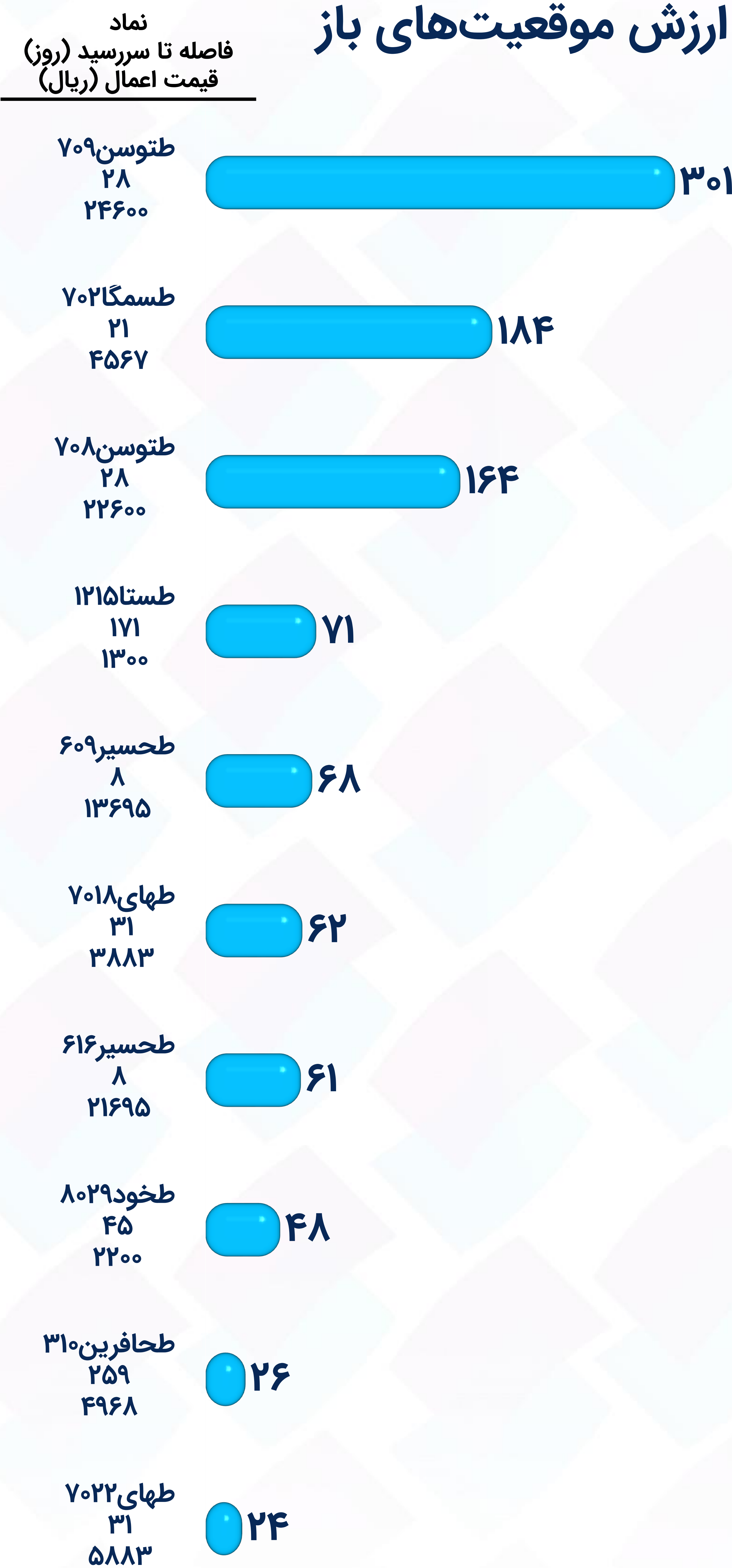
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

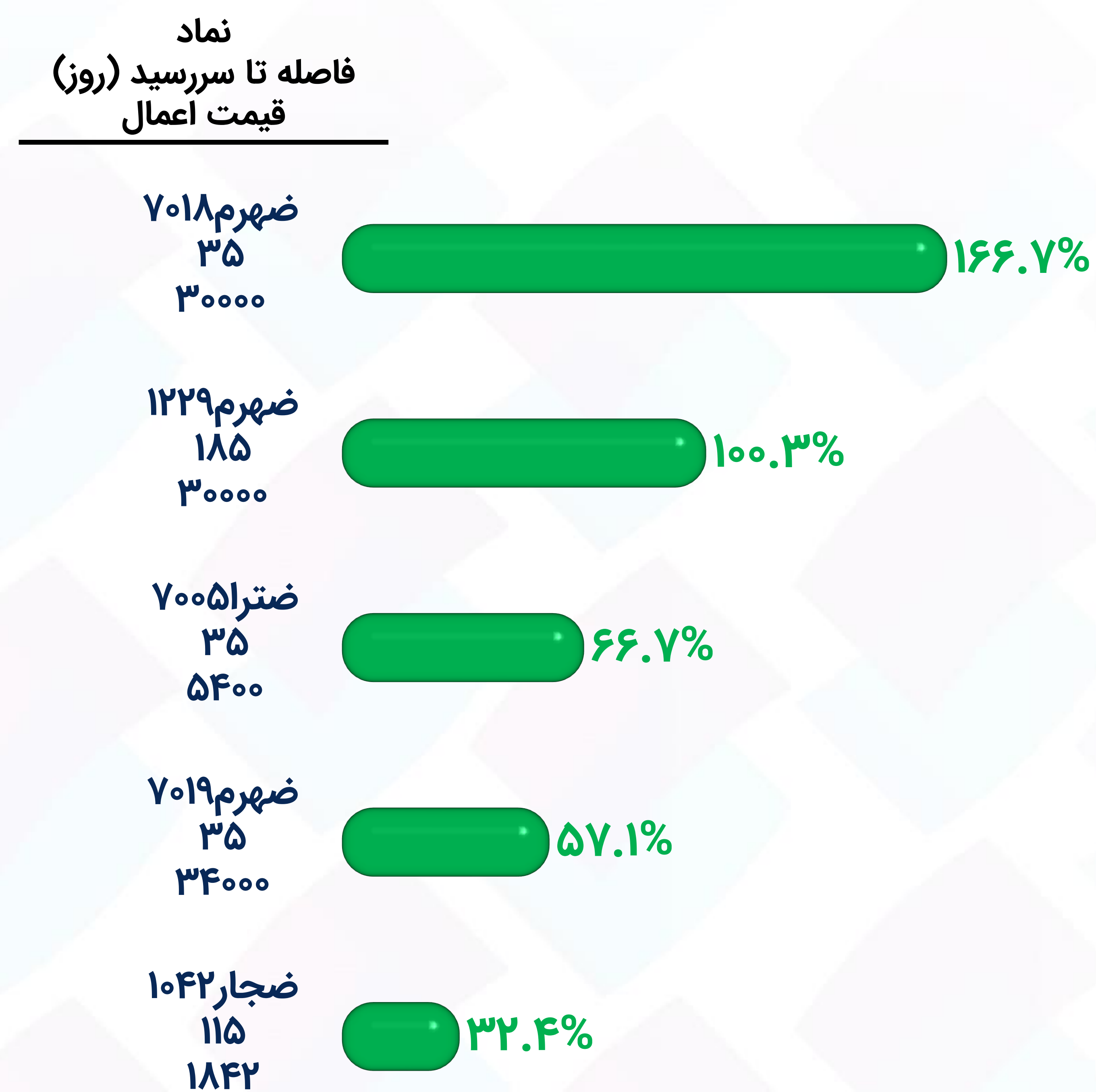
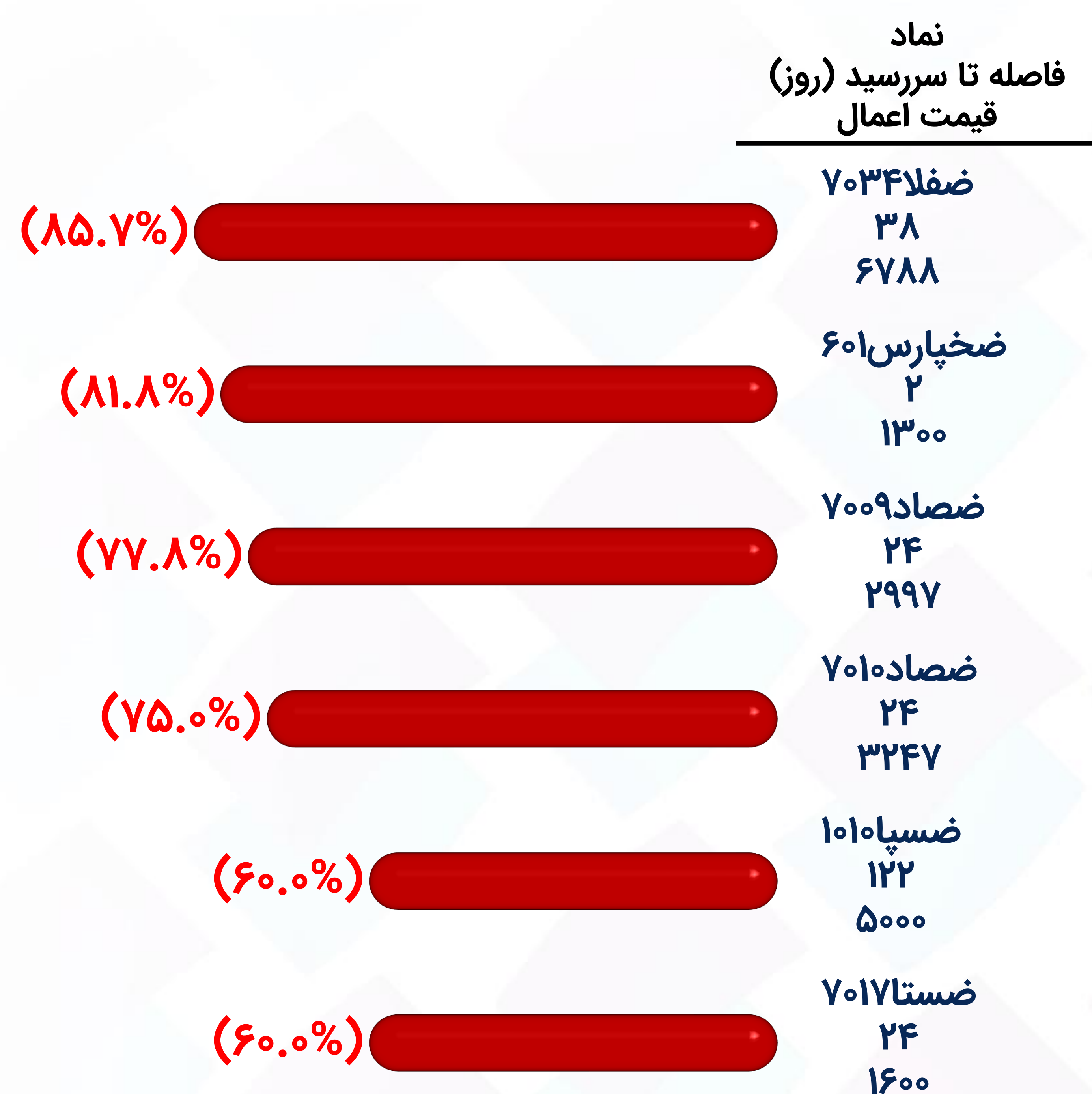


ارزش موقعیت‌های باز

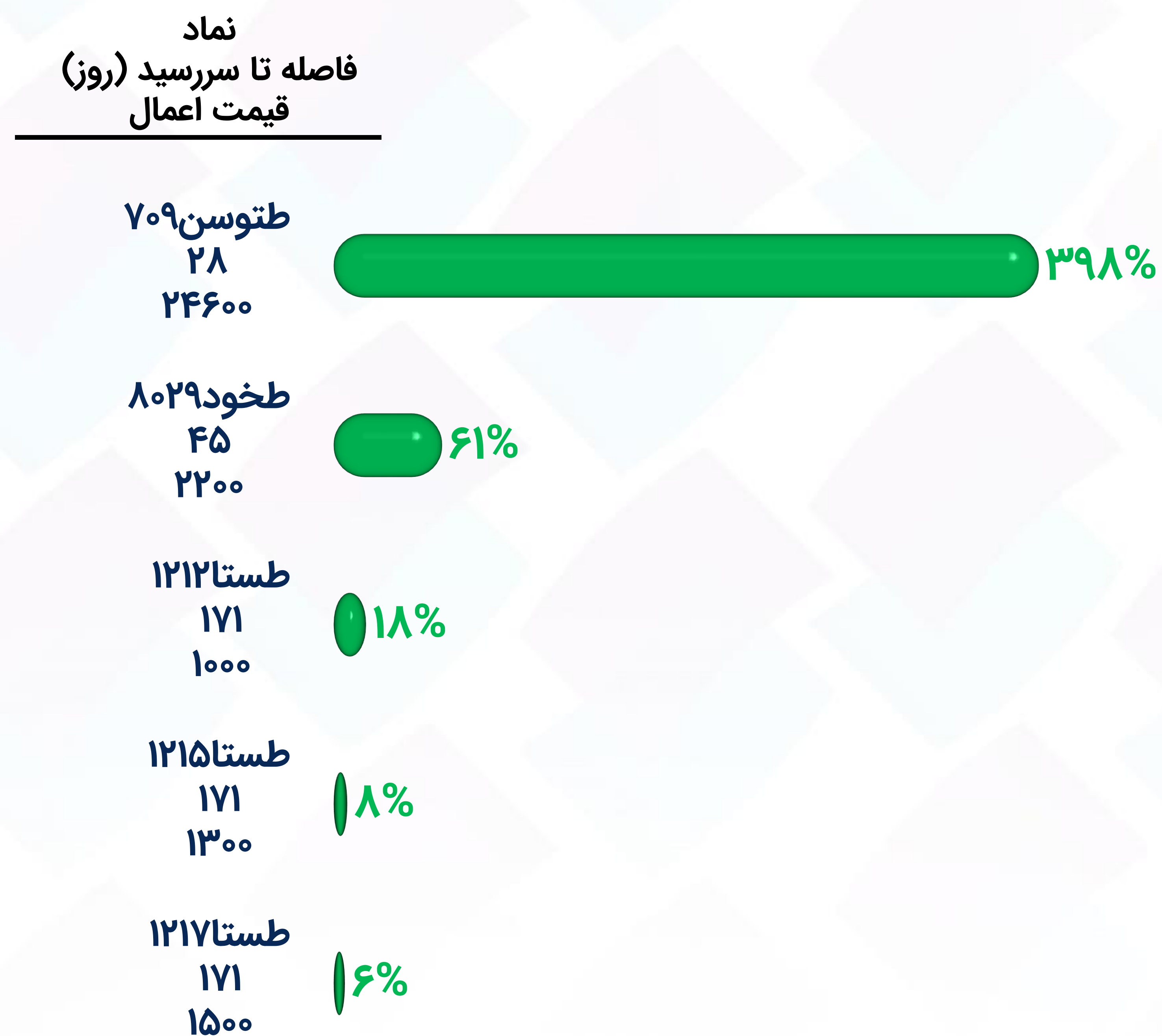
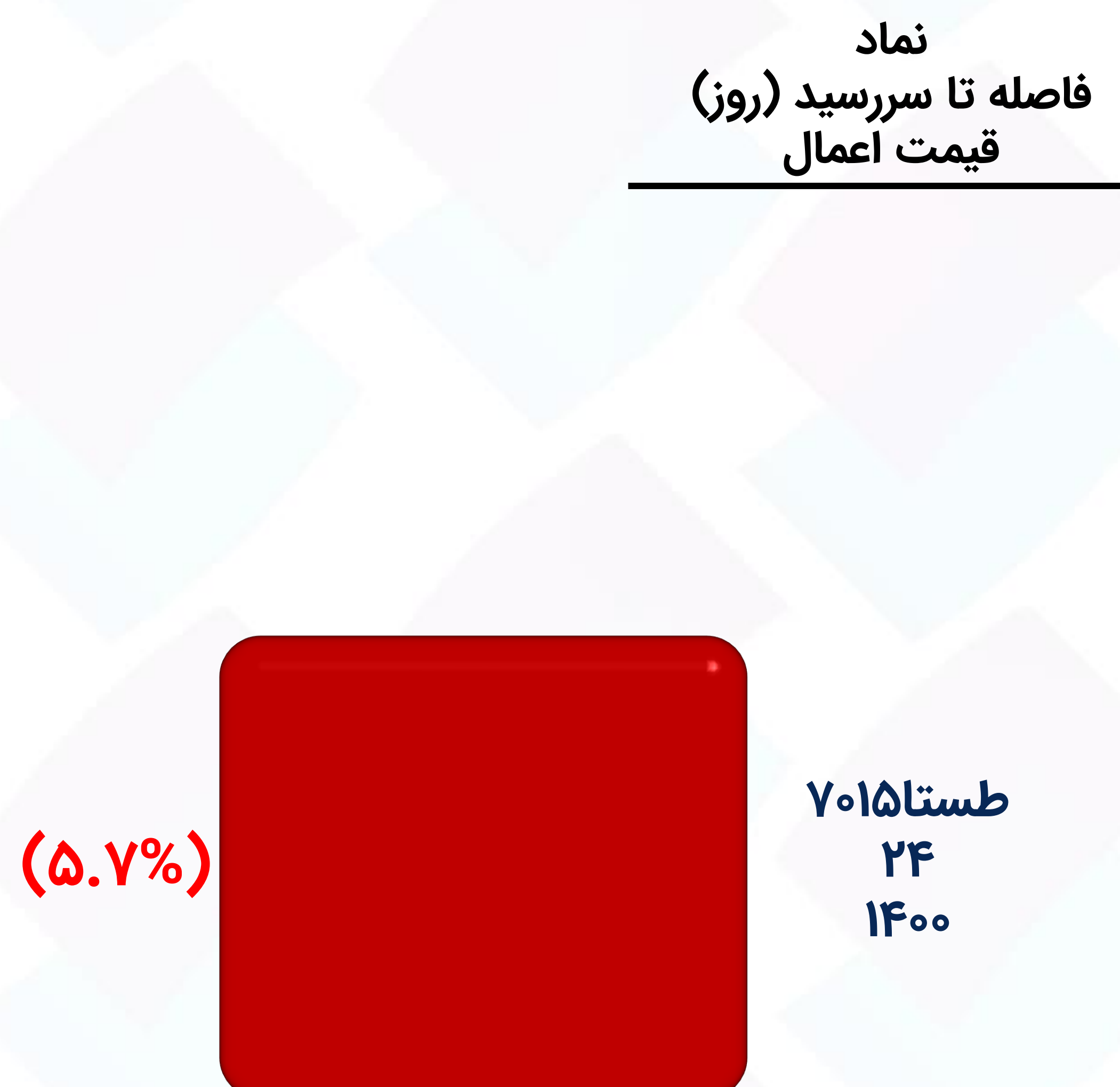


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

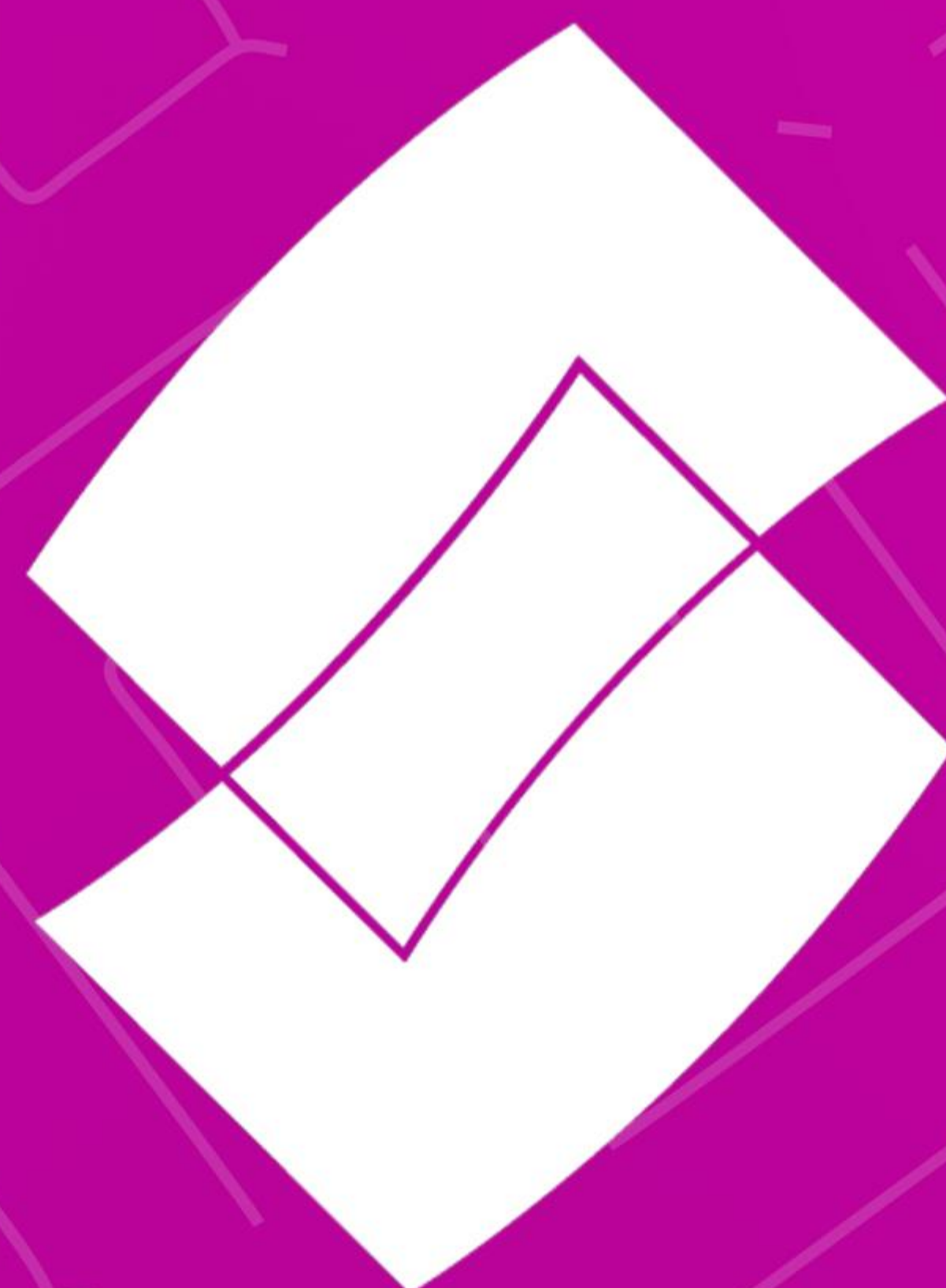
اختیار خرید



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، محمدحسین 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.