

شماره

۸۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۰ 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

اختیارخ 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	

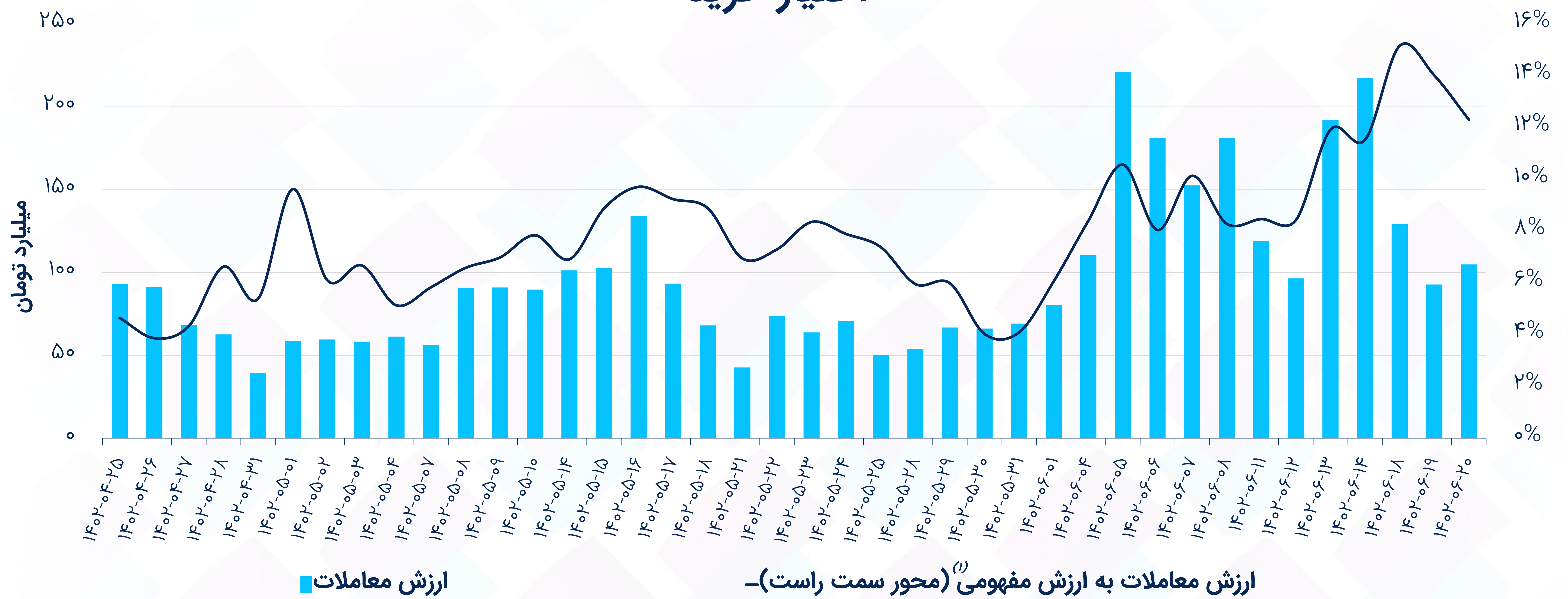
تعداد	حجم	فروش	خرید	حجم	تعداد
1	18	653	643	1	1
1	30	654	630	2	1

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

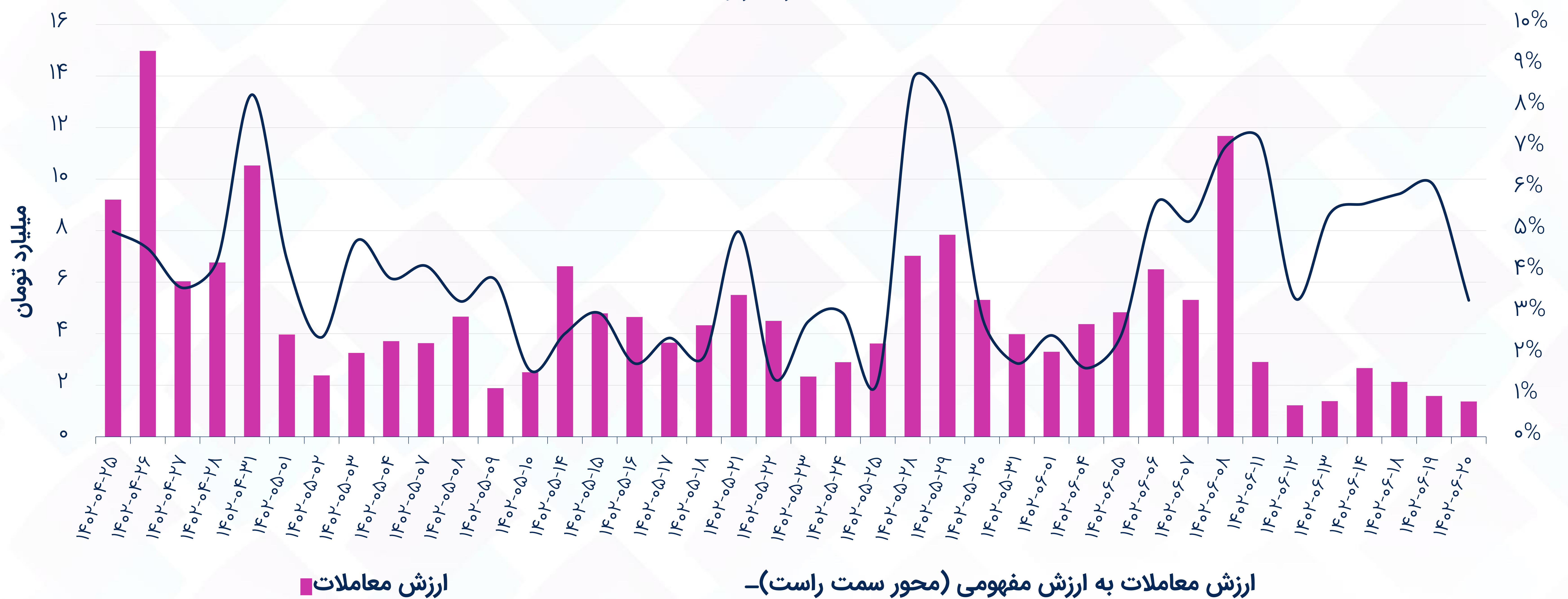
تعداد	حجم	فروش	خرید	حجم	تعداد
1	18	653	643	1	1
1	30	654	630	2	1

ارزش معاملات

اختیار خرید

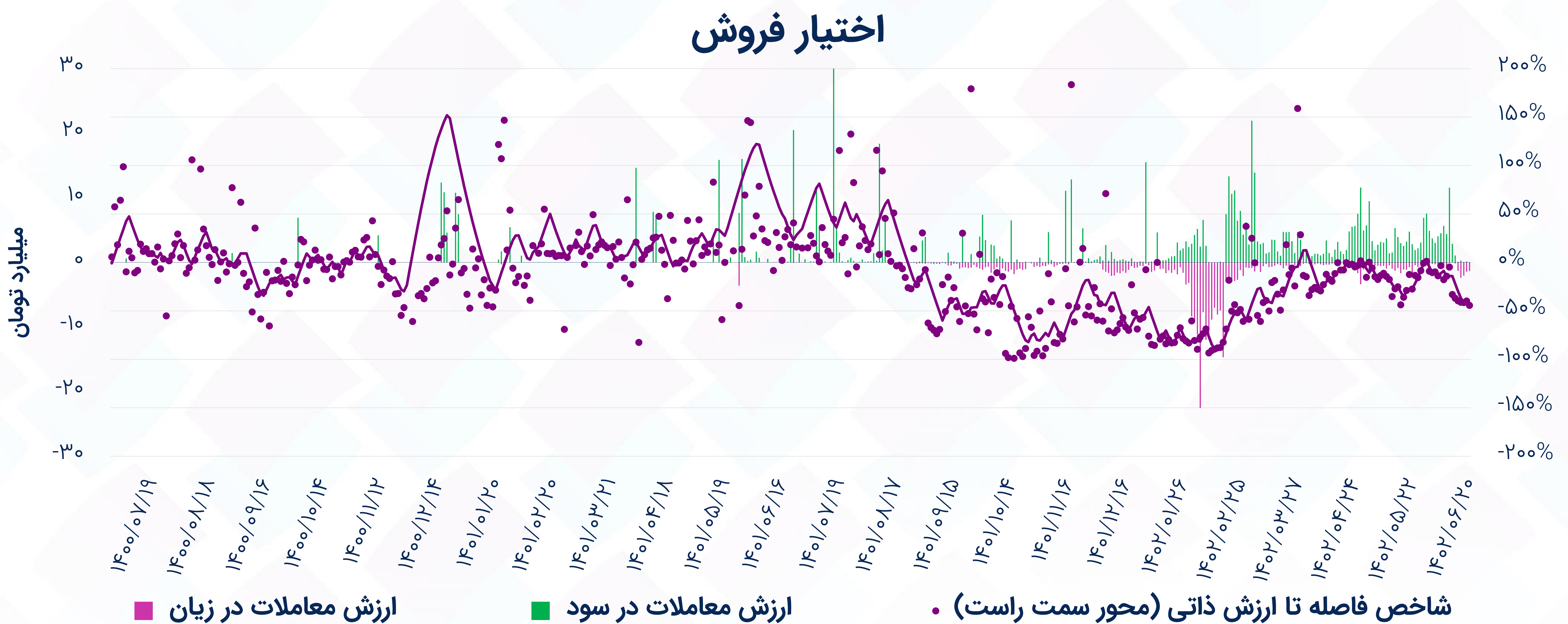
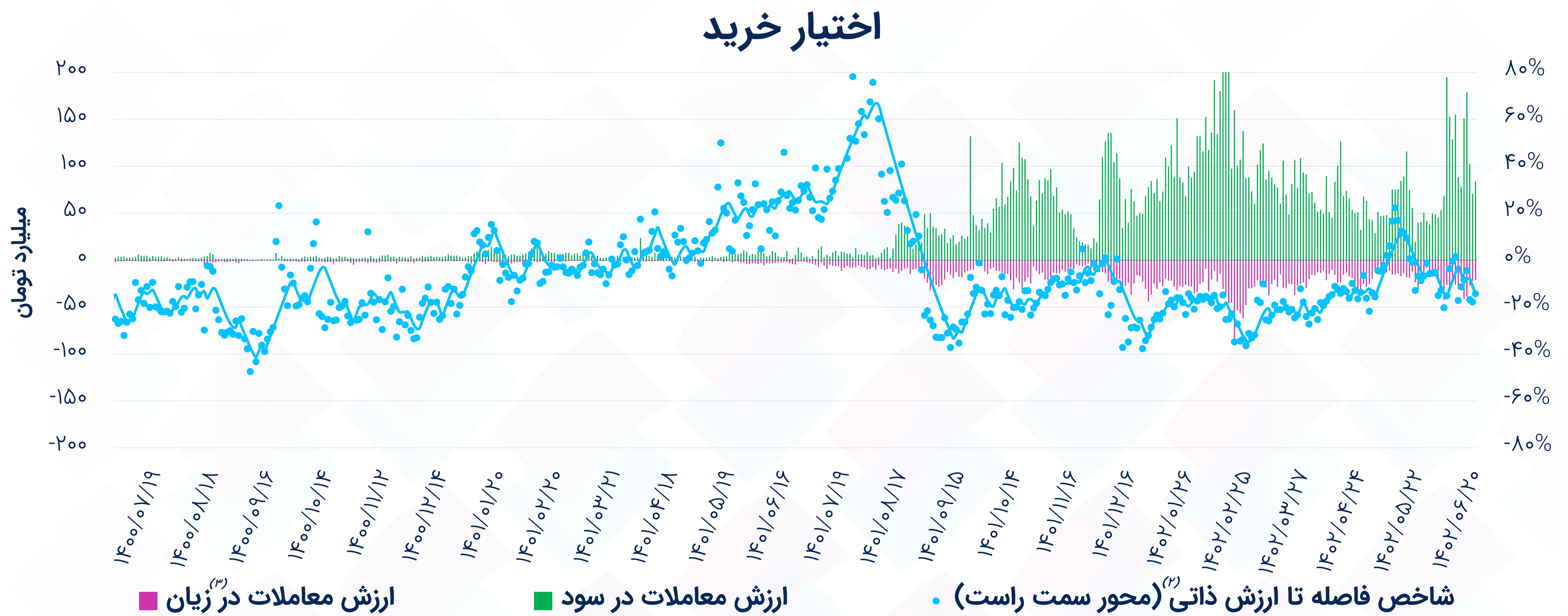


اختیار فروش



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

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی (۱)



(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

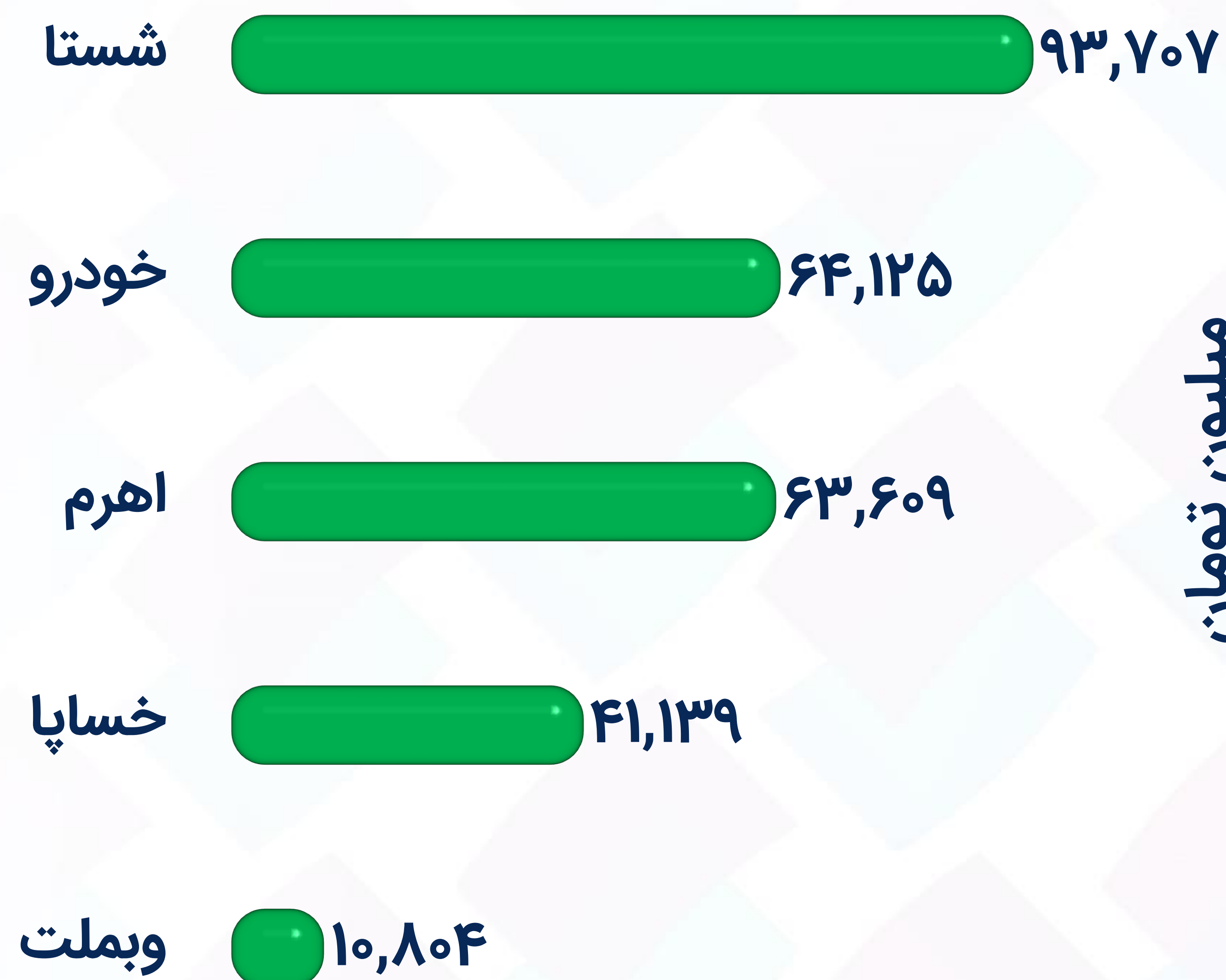
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
خودرو	۲۷	۶۶.۶	۴۴۷.۰	۶۴.۸	۱.۸	(۱۱.۴%)
خسپا	۱۹	۱۵.۹	۸۹.۱	۵.۸	۱۰.۱	(۲۸.۸%)
شستا	۲۵	۱۰.۶	۱۹۲.۵	۳.۷	۶.۹	(۱۹.۵%)
دی	۱۳	۳.۶	۱۰.۹	۳.۲	۰.۴	(۱۰.۶%)
اهرم	۲۵	۲.۳	۵۷.۰	۲.۰	۰.۴	(۲.۰%)
خاور	۵	۱.۰	۴.۲	۰.۵	۰.۵	(۱۶.۲%)
وبملت	۴	۱.۰	۱۹.۹	۰.۳	۰.۶	۱۱.۵%

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	۱,۲۹۱.۰	۲۰,۷۳۵.۳	۲۱.۱	۱,۲۷۰.۰	(۴۳.۱%)
خودرو	۲	۶۷.۳	۲۰,۱۱۵.۷	۰.۰	۶۷.۳	(۷۵.۹%)
حافرین	۱	۵.۸	۱۷.۵	۵.۸	۰.۰	۲۴.۰%
اهرم	۱	۲.۷	۲۰.۰	۲.۷	۰.۰	(۱۲.۷%)
توسن	۱	۱.۱	۱۶.۸	۱.۱	۰.۰	۲.۳%
فملی	۱	۰.۶	۲.۲	۰.۶	۰.۰	(۳.۱%)
کارا	۱	۰.۳	۴۶۰.۰	۰.۳	۰.۰	(۱۰۰.۰%)

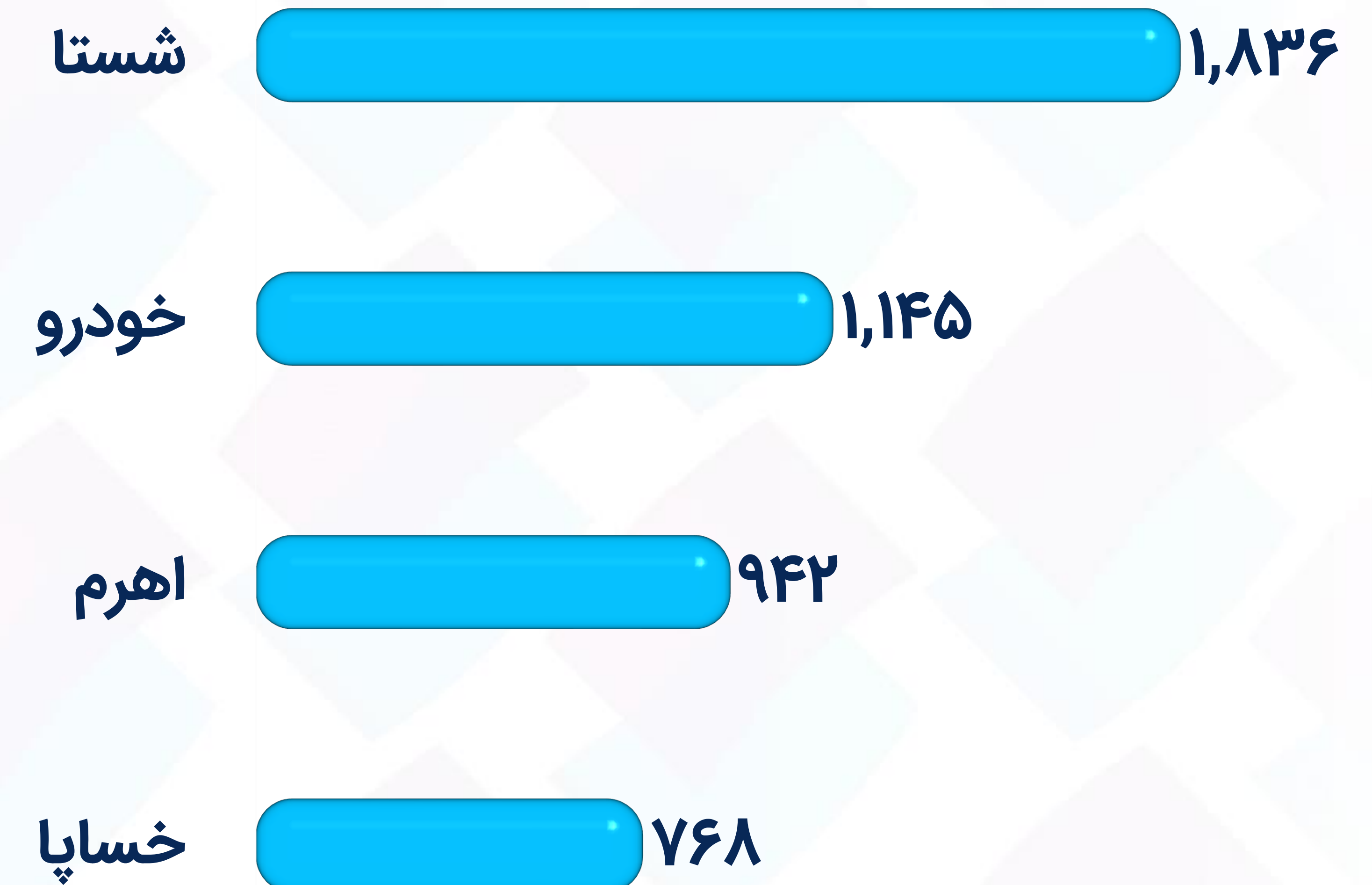
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

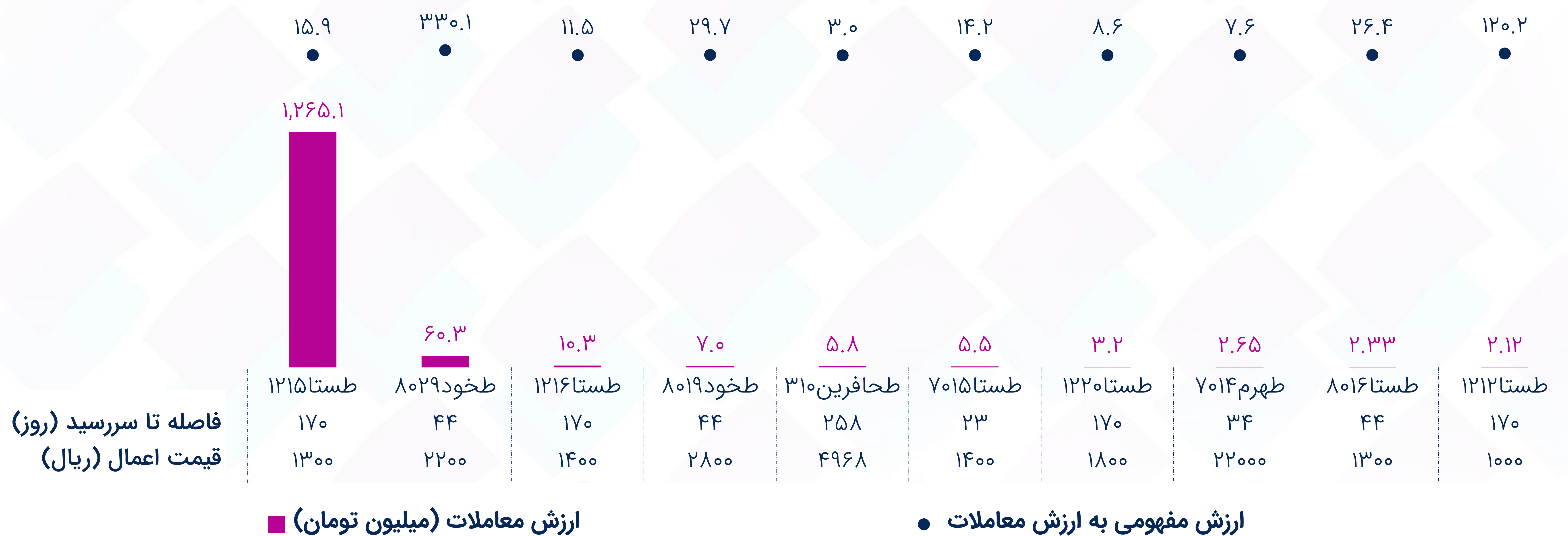


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۷۵%	۸۷۷	۰.۲۲	۶۹.۰	۷۲.۴%	۳۴,۵۰۰	۲۰,۰۱۰	۵۰۰	۵.۴	۱۸۵	۳۴,۰۰۰	اهرم ۱۲۳۰
۳۱%	۱,۴۱۵	۰.۳۲	۲۸.۹	۵۵.۳%	۳۱,۰۷۷	۲۰,۰۱۰	۱,۰۷۷	۱۶.۵	۱۸۵	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۲۲۹
۲۶%	۸۶۵	۰.۳۸	۳۳.۱	۱۳.۴%	۲۲,۶۸۶	۲۰,۰۱۰	۶۸۶	۶۲.۸	۳۵	۲۲,۰۰۰	اهرم ۷۰۱۴
۲۶%	۴,۷۷۸	۱.۰۰	۵.۴	(۳.۱%)	۲۰,۴۰۰	۲۱,۰۵۰	۳,۸۰۰	۱.۹	۲۸	۱۶,۶۰۰	توسن ۷۰۵
۲۱%	۲۲۱	۰.۴۹	۲۷.۸	۷.۸%	۵,۰۵۲	۴,۶۸۵	۱۸۲	۶۱۲.۷	۳۸	۴,۸۷۰	وبملت ۷۰۰۴

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	۳۳۴.۳	۱۰۳%	۶,۰۱۸	۲,۹۷۱	۱۸	۲.۷	۴۵	۶,۰۰۰	خودرو ۸۰۲۸
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۰۸۳.۳	۴۵%	۳,۲۵۰	۲,۲۴۵	۳	۱.۴	۲۴	۳,۲۴۷	وبصادر ۷۰۱
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۳۰۳.۸	۴۹%	۳,۶۴۵	۲,۴۴۵	۱۲	۵.۷	۳۱	۳,۶۳۳	های وب ۷۰۱۷
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۱,۰۰۱.۰	۳۵%	۴,۰۰۴	۲,۹۷۱	۴	۱.۳	۱۷	۴,۰۰۰	خودرو ۷۰۹۸
(۹۵%)	۱	۰.۰۰	۵۰۱.۰	۱۲۵%	۵,۵۱۱	۲,۴۵۰	۱۱	۳.۴	۱۲۲	۵,۵۰۰	خسپا ۱۰۱۱

(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 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
طستا ۱۲۲۰	شستا	۱۷۱	۳.۲	۱۵۳	۱,۳۲۲	۱,۶۴۷	۲۵%	۱۰.۸	-۰.۷۶	۳۱۰	۱۰۲.۶%
طحافرین ۳۱۰	حافرین	۲۵۹	۵.۸	۹۹۷	۳,۰۱۶	۳,۹۷۱	۳۲%	۴.۰	-۰.۷۷	۱,۲۳۶	۲۳.۹%
طتوسن ۷۰۸	توسن	۲۸	۱.۱	۱,۳۲۶	۲۱,۰۵۰	۲۱,۲۷۴	۱%	۱۶.۰	-۰.۷۳	۱,۳۵۷	۲.۳%
طستا ۷۰۱۶	شستا	۲۴	۱.۷	۱۷۵	۱,۳۲۲	۱,۳۲۵	۰%	۷.۶	-۰.۸۹	۱۵۸	(۹.۶%)
طهرم ۷۰۱۴	اهرم	۳۵	۲.۷	۲,۶۵۰	۲۰,۰۱۰	۱۹,۳۵۰	(۳%)	۷.۳	-۰.۶۲	۲,۳۱۳	(۱۲.۷%)

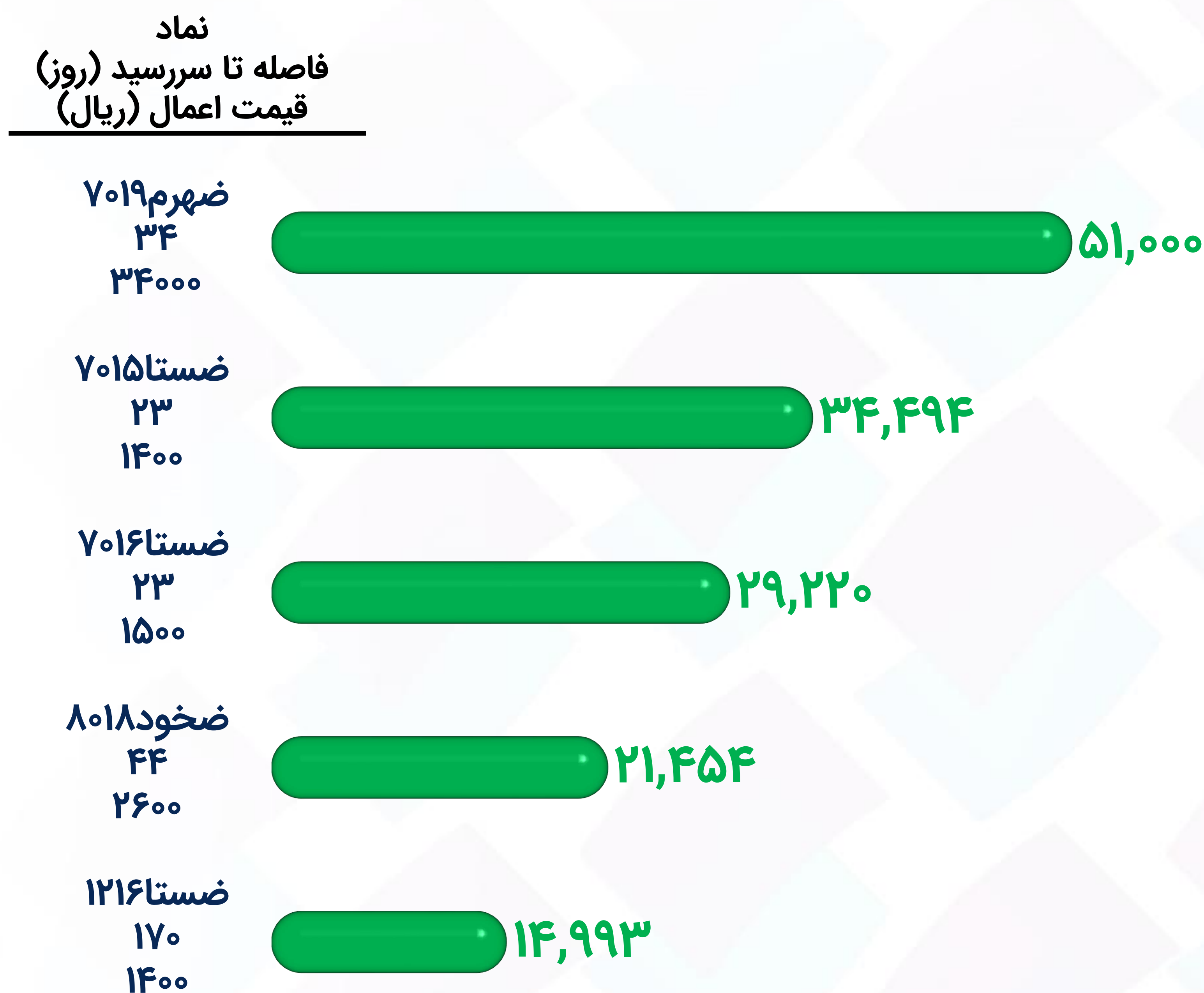
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طخود ۸۰۲۹	خودرو	۴۵	۶۰.۳	۹	۲,۹۷۱	۲,۱۹۱	(۲۶%)	۲۴۳.۴	-۰.۰۱	۲	(۸۱%)
طستا ۱۲۱۲	شستا	۱۷۱	۲.۱	۱۱	۱,۳۲۲	۹۸۹	(۲۵%)	۸۹.۹	-۰.۰۳	۴	(۶۵%)
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱۷۱	۱,۲۶۵.۱	۸۳	۱,۳۲۲	۱,۲۱۷	(۸%)	۱۴.۷	-۰.۲۴	۴۷	(۴۴%)
طستا ۸۰۱۶	شستا	۴۵	۲.۳	۵۰	۱,۳۲۲	۱,۲۵۰	(۵%)	۲۵.۰	-۰.۳۲	۳۴	(۳۲%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱۷۱	۱۰.۳	۱۱۵	۱,۳۲۲	۱,۲۸۵	(۳%)	۱۱.۲	-۰.۳۵	۸۰	(۳۱%)

(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



میلیون تومان

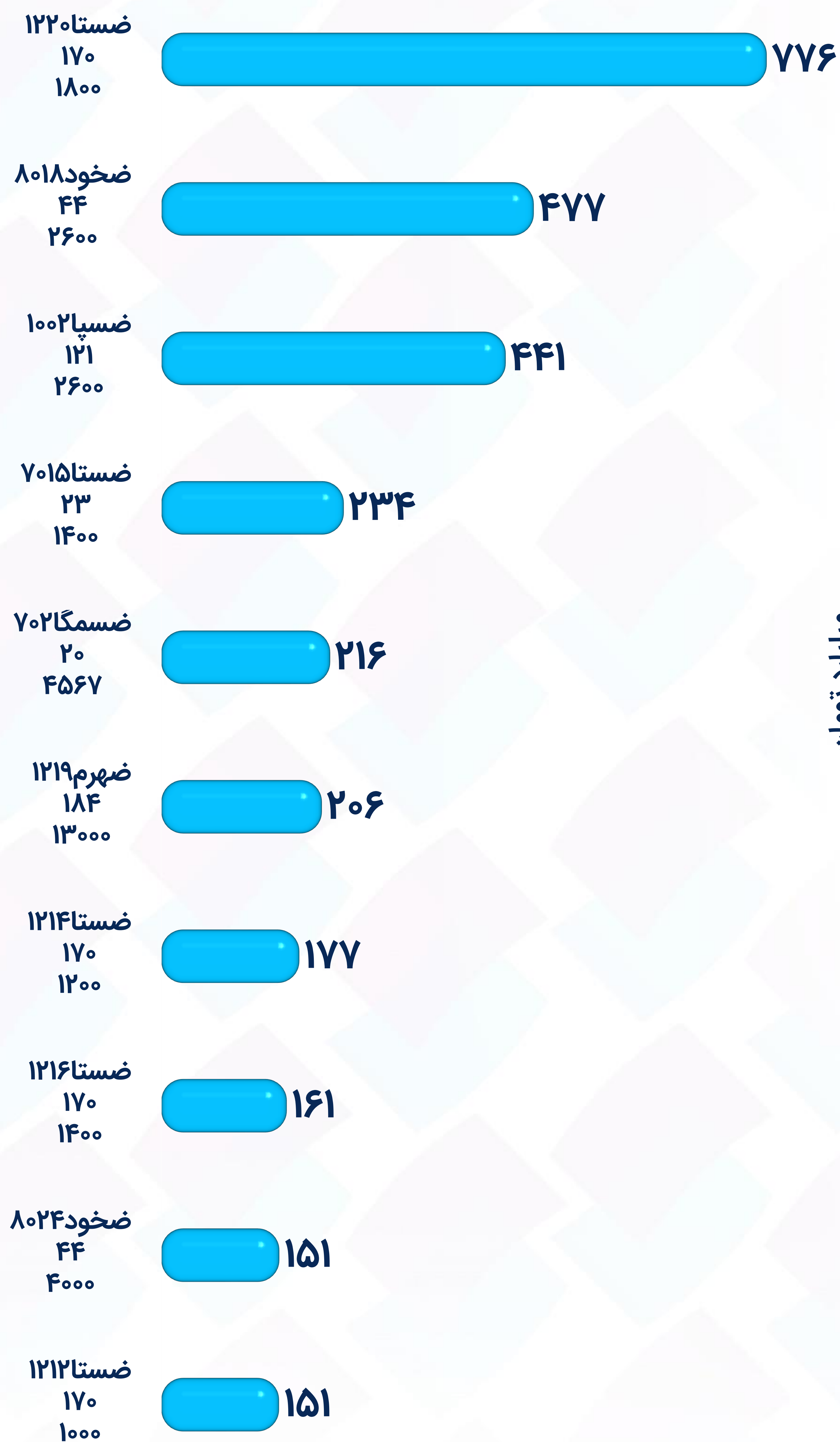
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

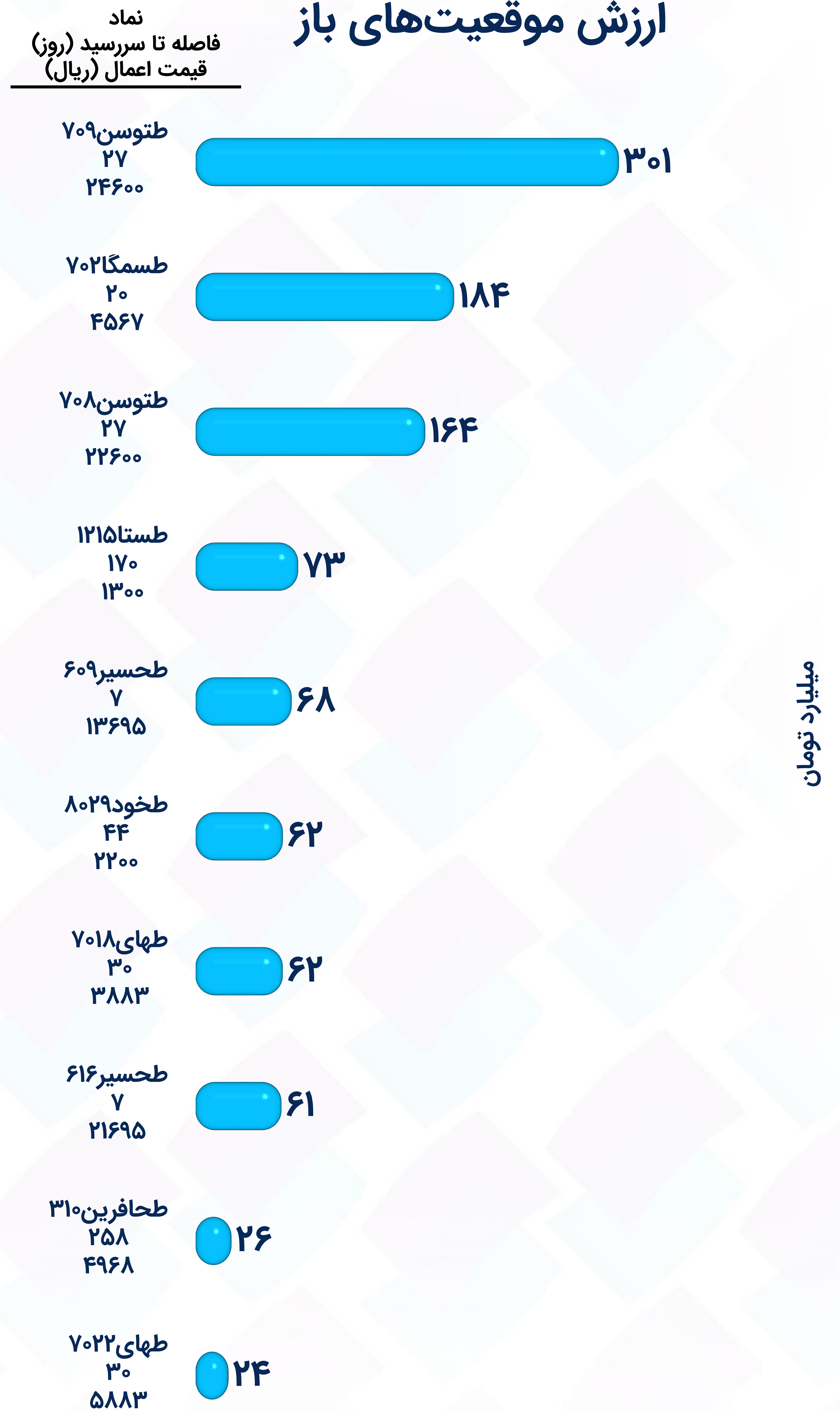
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

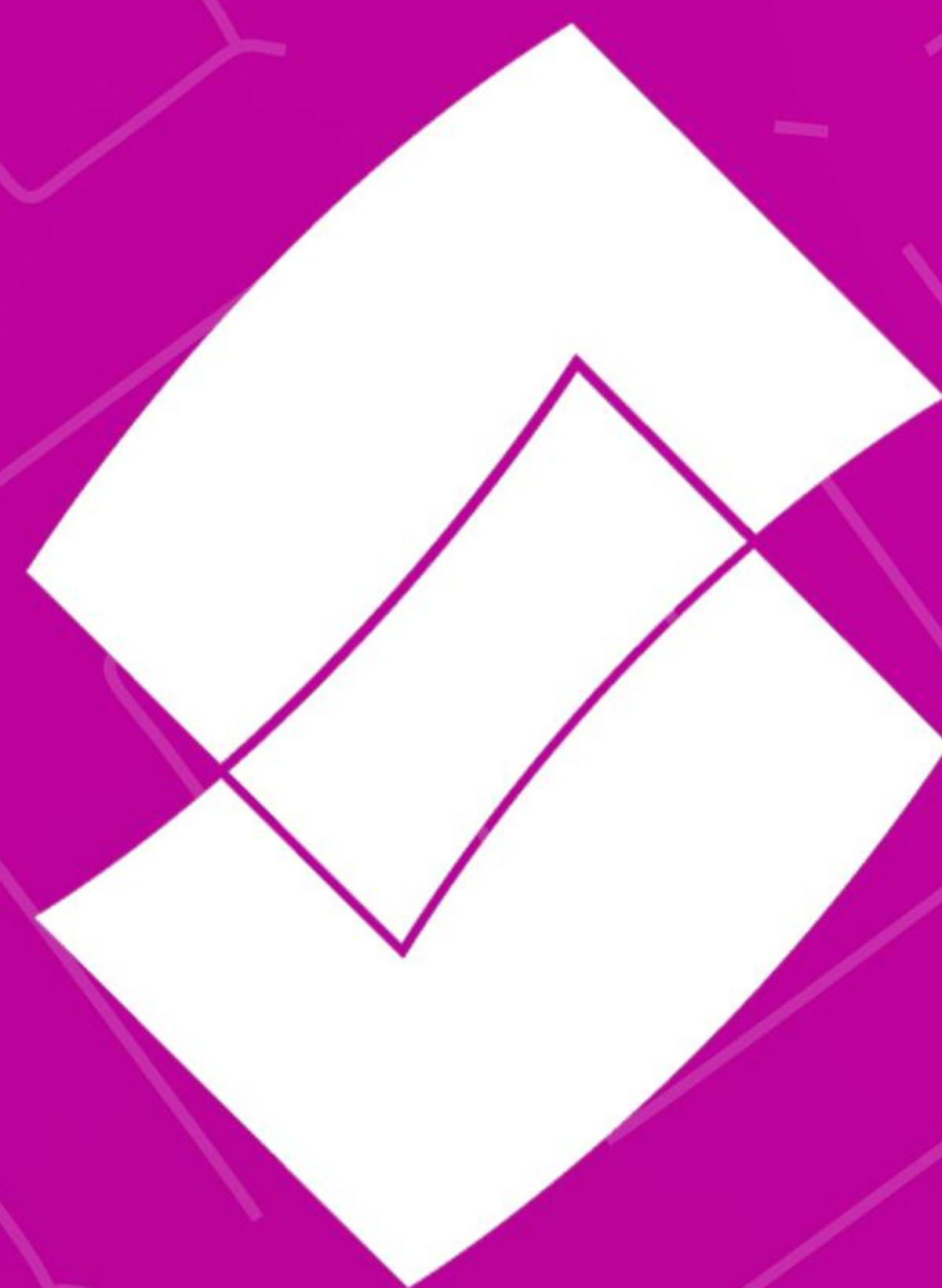
اختیار خرید



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.