

شماره

۸۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ 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 ماه	بازه سال	500	1,200
تعداد قرارداد	تعداد سهام	1,000	
	حجم مینا	1	
	سهام شناور	%	
	میانگین حجم ماه	6,991	

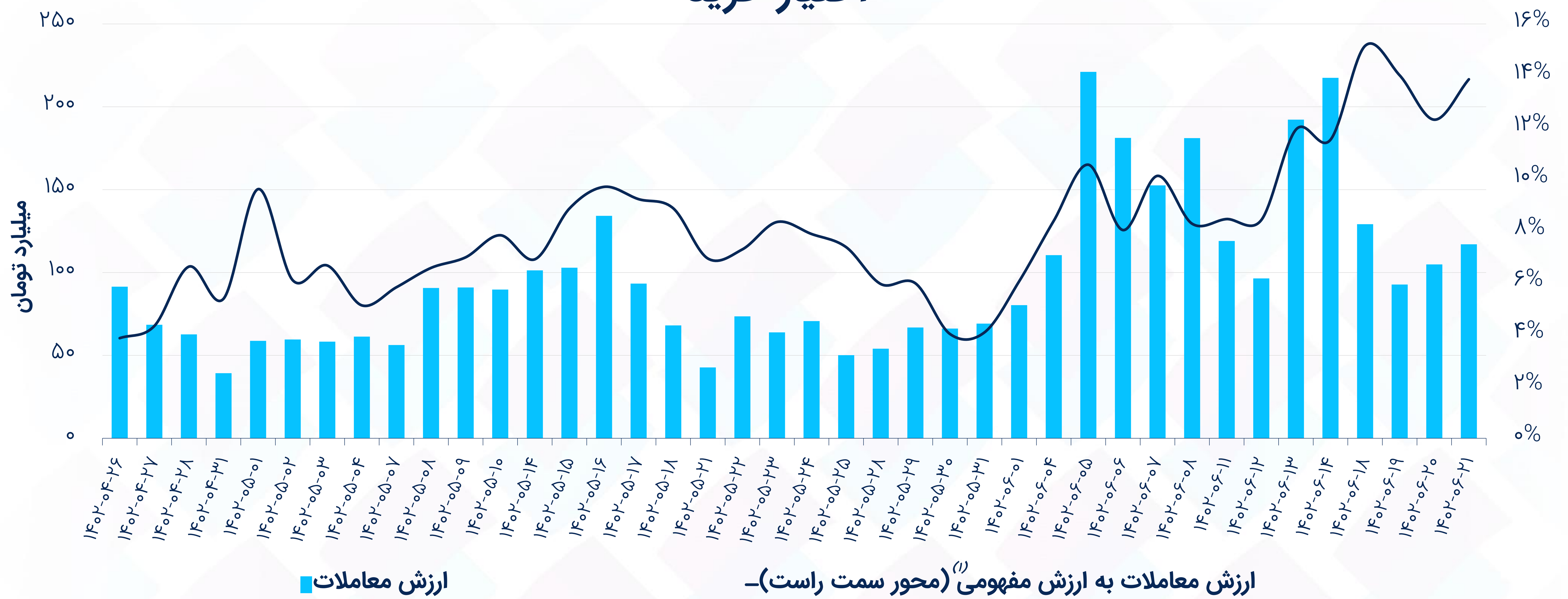
حجم	خرید	فروش	تعداد قرارداد های خرید و فروش به تفکیک حقیقی و حقوقی
حقیقی	3,601 [100.0%]	3,101 [86.1%]	تعداد قرارداد های خرید و فروش به تفکیک حقیقی و حقوقی
حقوقی	0 [0%]	500 [13.9%]	تعداد خریدار و فروشنده به تفکیک حقیقی و حقوقی
تعداد	خرید	فروش	
مجموع	32	18	
حقیقی	32	17	
حقوقی	0	1	

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

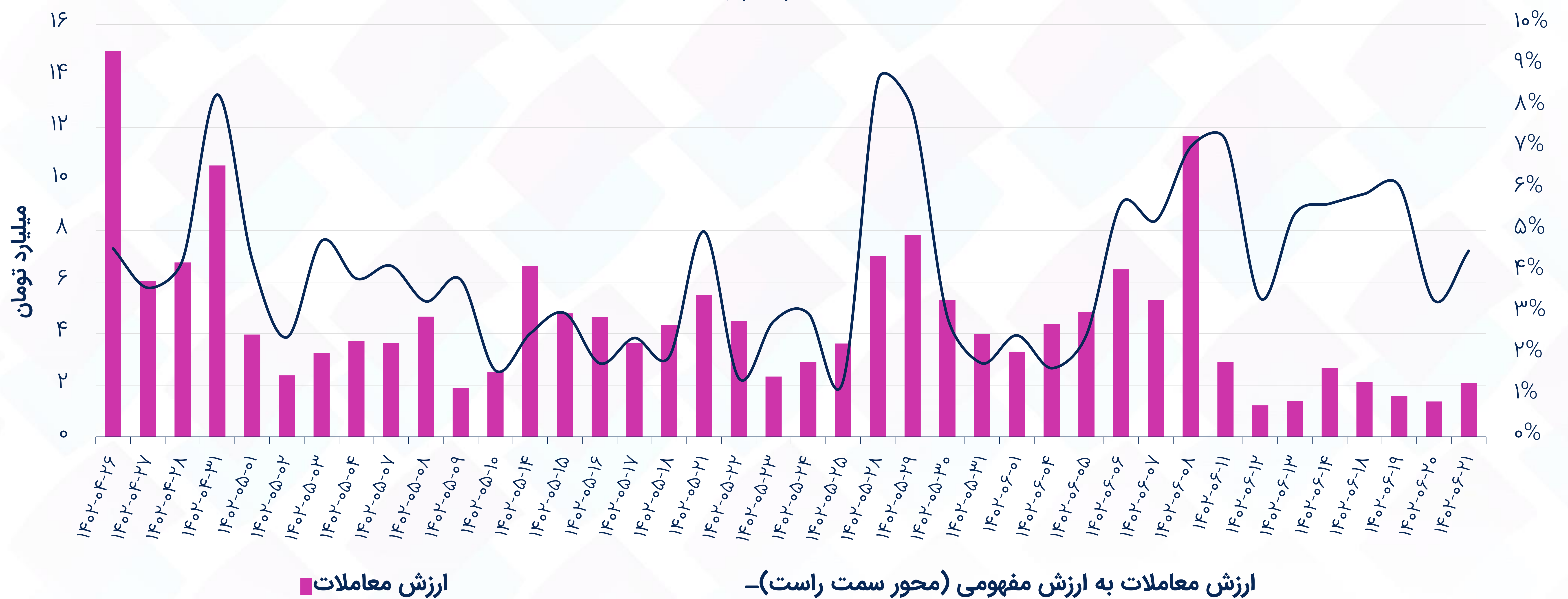
تعداد	حجم	خرید	فروش	تعداد
1	1	643	653	18
1	2	630	654	30

ارزش معاملات

اختیار خرید

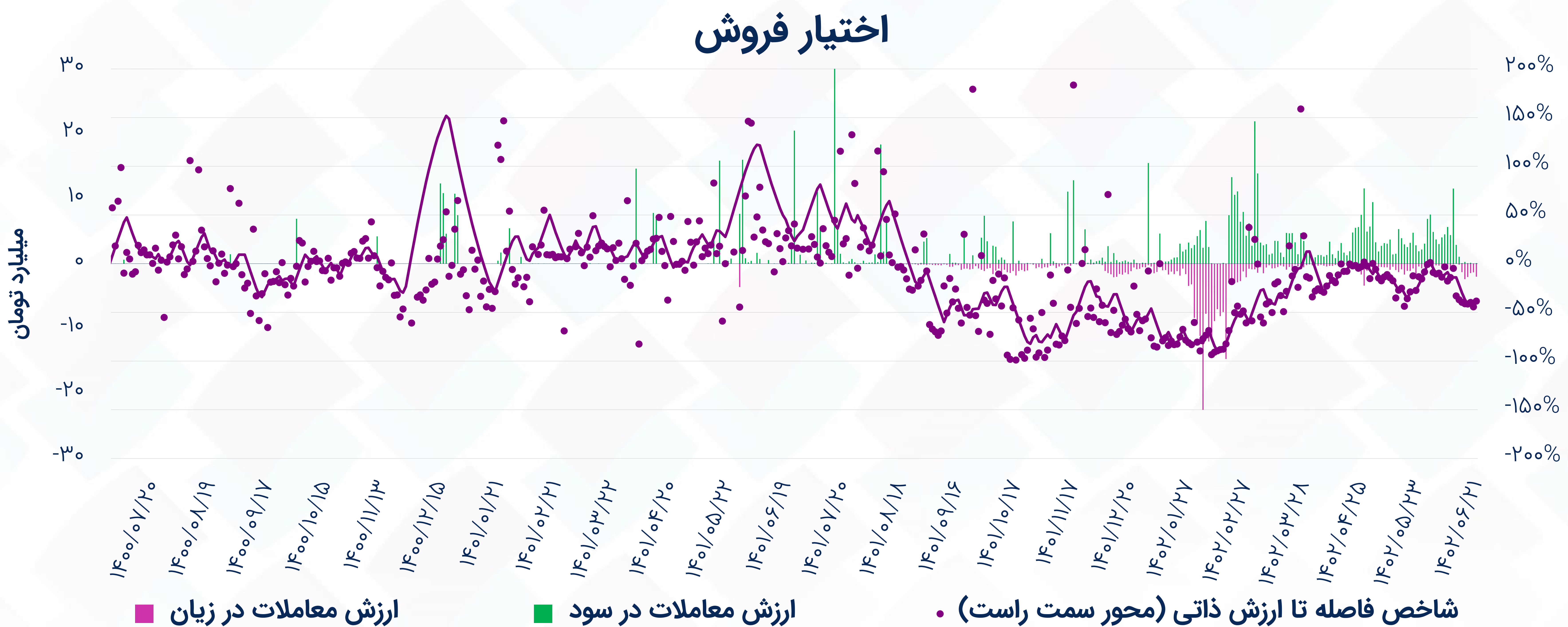
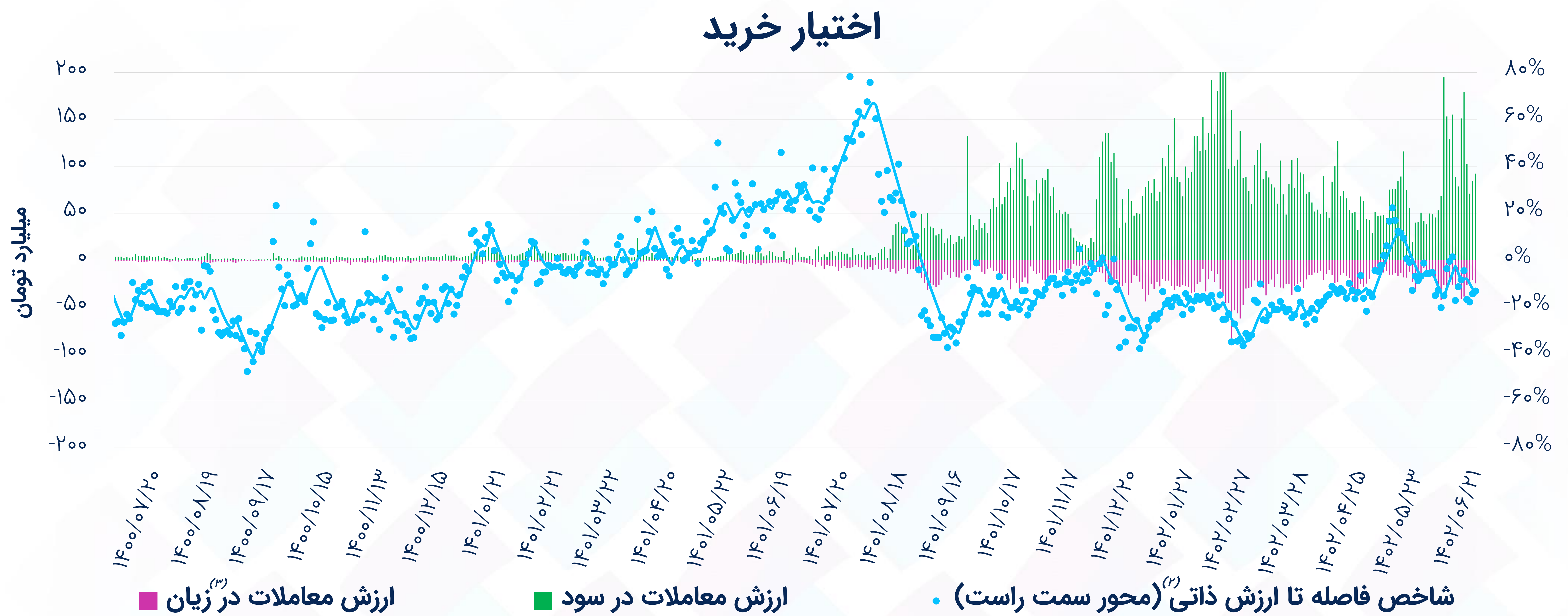


اختیار فروش



(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

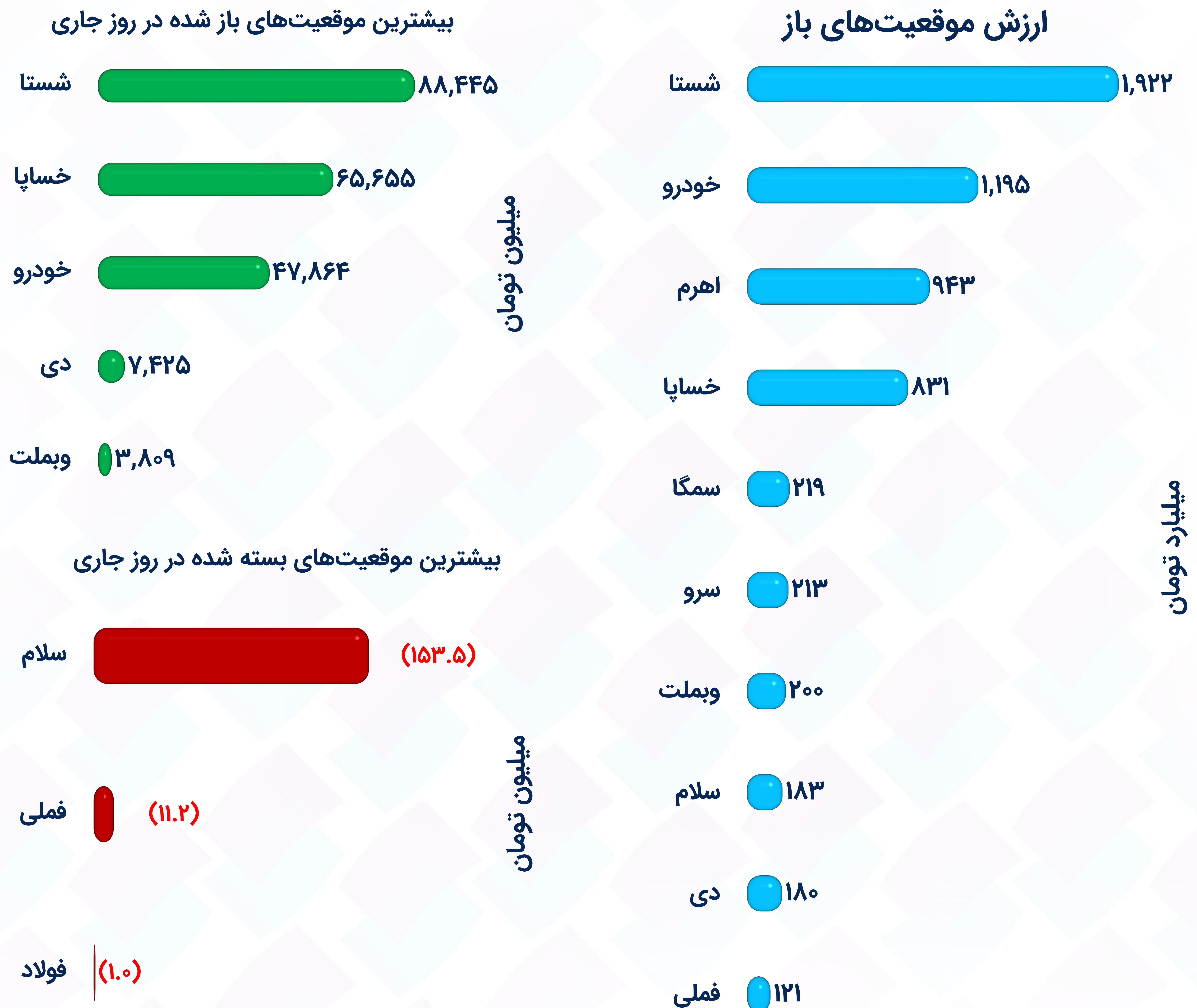
اختیار خرید

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	۳۰	۶۳.۹	۴۰۶.۷	۶۳.۲	۰.۸	(۸.۳%)
خسایا	۱۷	۲۹.۶	۱۶۴.۵	۱۴.۶	۱۵.۰	(۲۳.۳%)
شستا	۲۲	۱۳.۸	۲۱۷.۲	۶.۷	۷.۰	(۱۷.۰%)
اهرم	۲۲	۳.۹	۱۳.۲	۳.۶	۰.۲	۰.۳%
دی	۱۵	۳.۲	۱۲.۳	۱.۸	۱.۳	(۱۹.۴%)
خپارس	۳	۰.۸	۸.۳	۰.۸	۰.۰	(۲۲.۰%)
وتجارت	۴	۰.۴	۳.۷	۰.۳	۰.۰	(۴.۴%)

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	۱,۶۷۷.۰	۲۸,۲۲۹.۳	۲۸.۰	۱,۶۴۹.۰	(۴۳.۰%)
خودرو	۲	۳۴۶.۵	۱۷,۳۷۸.۴	۰.۰	۳۴۶.۵	(۲۶.۱%)
حافرین	۱	۶۴.۲	۱۶۷.۲	۶۴.۲	۰.۰	۹.۷%
اهرم	۲	۴.۲	۲۶۳.۸	۰.۰	۴.۲	۳۲.۹%
سمگا	۲	۰.۲	۴.۸	۰.۱	۰.۱	۴۰.۰%
فولاد	۱	۰.۱	۳.۴	۰.۰	۰.۱	(۲۵.۹%)
کارا	۱	۰.۱	۳۴۳.۷	۰.۱	۰.۰	(۹۹.۹%)

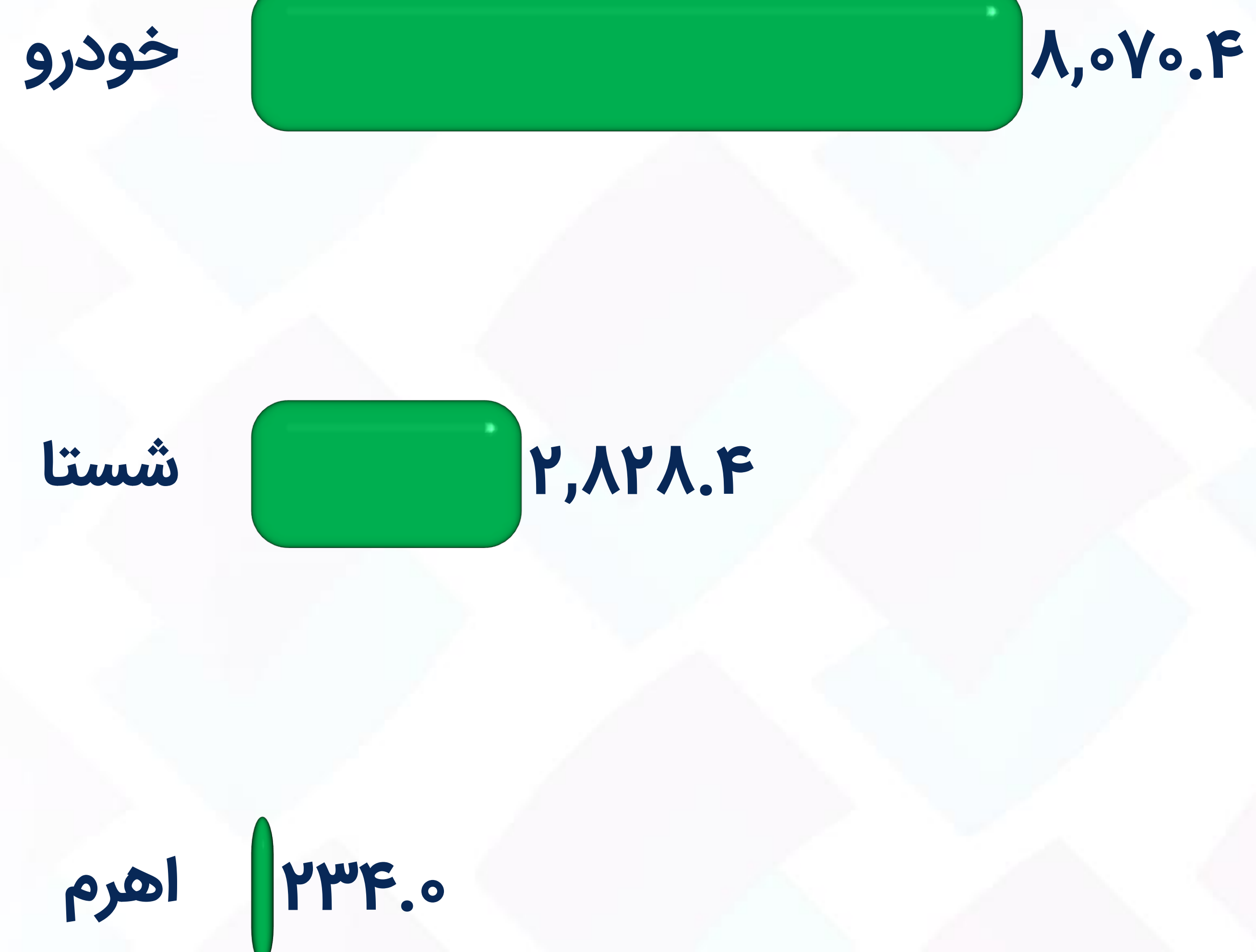
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



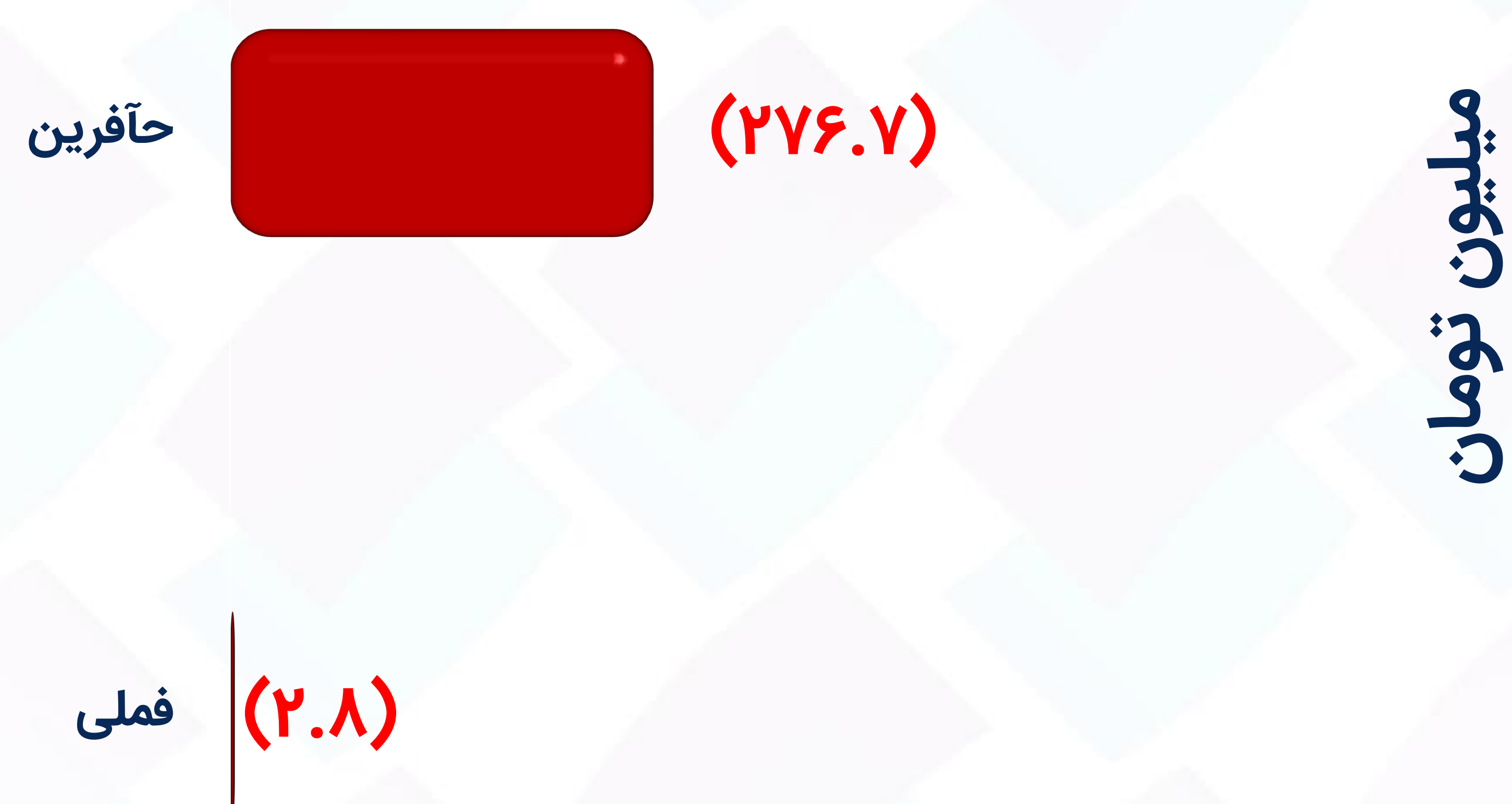
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

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

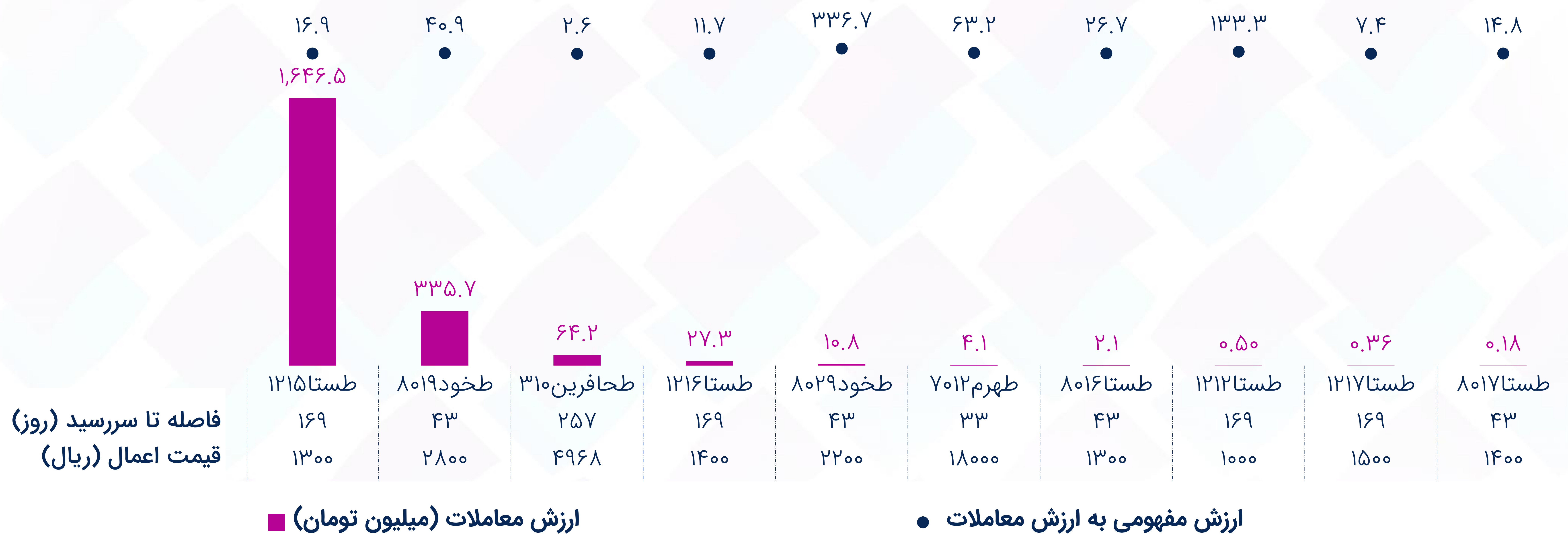


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۱۲۴%	۳,۶۰۳	۰.۶۲	۱۴.۷	۱۷.۴%	۲۳,۶۰۸	۲۰,۱۱۰	۱,۶۰۸	۳۶.۳	۱۸۴	۲۲,۰۰۰	ضهرم ۱۲۲۵
۲۹%	۱,۲۸۳	۰.۶۹	۱۰.۵	۱۱.۲%	۱۰,۴۹۶	۹,۴۴۰	۹۹۶	۱۰.۲	۱۳۵	۹,۵۰۰	ضبساما ۱۱۰۲
۲۶%	۸۷۶	۰.۳۹	۳۲.۶	۱۲.۹%	۲۲,۶۹۶	۲۰,۱۱۰	۶۹۶	۳۴.۰	۳۴	۲۲,۰۰۰	ضهرم ۷۰۱۴
۲۴%	۱,۷۰۲	۰.۶۰	۱۵.۶	۶.۳%	۲۱,۳۷۲	۲۰,۱۱۰	۱,۳۷۲	۴۱.۶	۳۴	۲۰,۰۰۰	ضهرم ۷۰۱۳
۲۱%	۴۲	۰.۲۷	۹۳.۹	۸.۴%	۳,۲۸۵	۳,۰۳۰	۳۵	۱۵.۸	۱۶	۳,۲۵۰	ضخود ۷۰۹۵

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	۳۵۳.۹	۹۹%	۶,۰۱۷	۳,۰۳۰	۱۷	۳.۰	۴۴	۶,۰۰۰	ضخود ۸۰۲۸
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۲۶۰.۵	۵۰%	۳,۶۴۷	۲,۴۳۲	۱۴	۲.۶	۳۰	۳,۶۳۳	ضهای ۷۰۱۷
(۹۷%)	۰	۰.۰۰	۱,۰۰۱.۰	۳۲%	۴,۰۰۴	۳,۰۳۰	۴	۲.۶	۱۶	۴,۰۰۰	ضخود ۷۰۹۸
(۹۵%)	۱	۰.۰۰	۳۹۳.۹	۱۲۱%	۵,۵۱۴	۲,۴۹۴	۱۴	۳۹.۰	۱۲۱	۵,۵۰۰	ضسپا ۱۰۱۱
(۹۳%)	۱	۰.۰۱	۲۶۵.۷	۴۹%	۴,۵۱۷	۳,۰۳۰	۱۷	۲.۹	۴۴	۴,۵۰۰	ضخود ۸۰۲۵

(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
۳۳.۳%	۴۲۴	-۰.۲۰	۵۵.۶	(۱۲%)	۱۷,۶۸۲	۲۰,۱۱۰	۳۱۸	۴.۱	۳۴	۱۸,۰۰۰	طهرم ۷۰۱۲
۹.۷%	۱,۲۶۳	-۰.۷۸	۳.۳	۲۷%	۳,۸۱۷	۲,۹۹۸	۱,۱۵۱	۶۴.۲	۲۵۸	۴,۹۶۸	طحافرین ۳۱۰

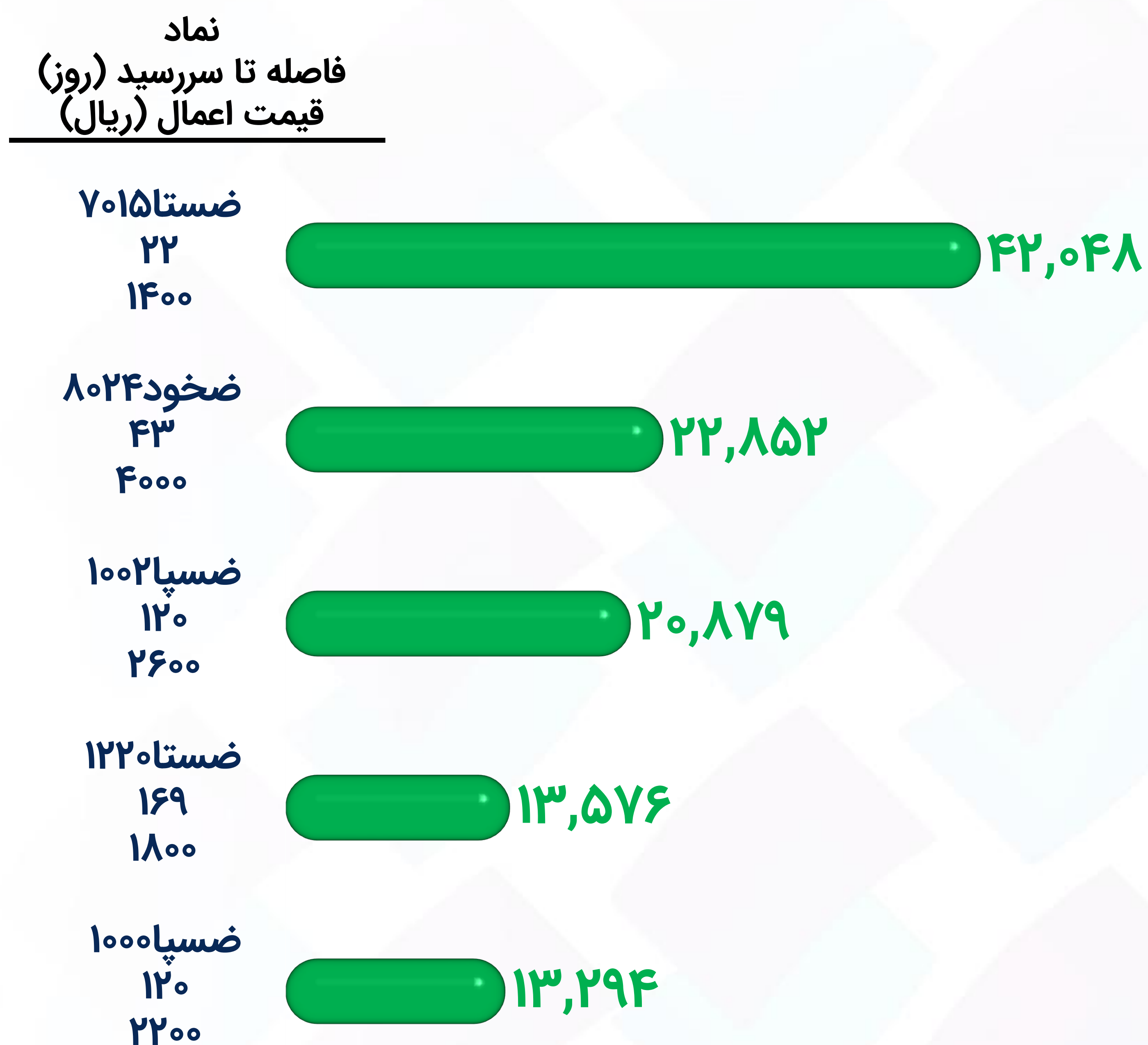
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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
(۸۸%)	۱	-۰.۰۱	۲۴۳.۴	(۲۸%)	۲,۱۹۱	۳,۰۳۰	۹	۱۰.۸	۴۴	۲,۲۰۰	طخود ۸۰۲۹
(۴۳%)	۴۵	-۰.۲۳	۱۵.۵	(۸%)	۱,۲۲۱	۱,۳۳۳	۷۹	۱,۶۴۶.۵	۱۷۰	۱,۳۰۰	طستا ۱۲۱۵
(۳۹%)	۳۰	-۰.۲۹	۲۵.۰	(۶%)	۱,۲۵۰	۱,۳۳۳	۵۰	۲.۱	۴۴	۱,۳۰۰	طستا ۸۰۱۶
(۳۲%)	۷۷	-۰.۳۴	۱۱.۳	(۴%)	۱,۲۸۶	۱,۳۳۳	۱۱۴	۲۷.۳	۱۷۰	۱,۴۰۰	طستا ۱۲۱۶
(۲۴%)	۵۶	-۰.۲۱	۳۶.۸	(۱۰%)	۲,۷۲۶	۳,۰۳۰	۷۴	۳۳۵.۷	۴۴	۲,۸۰۰	طخود ۸۰۱۹

(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

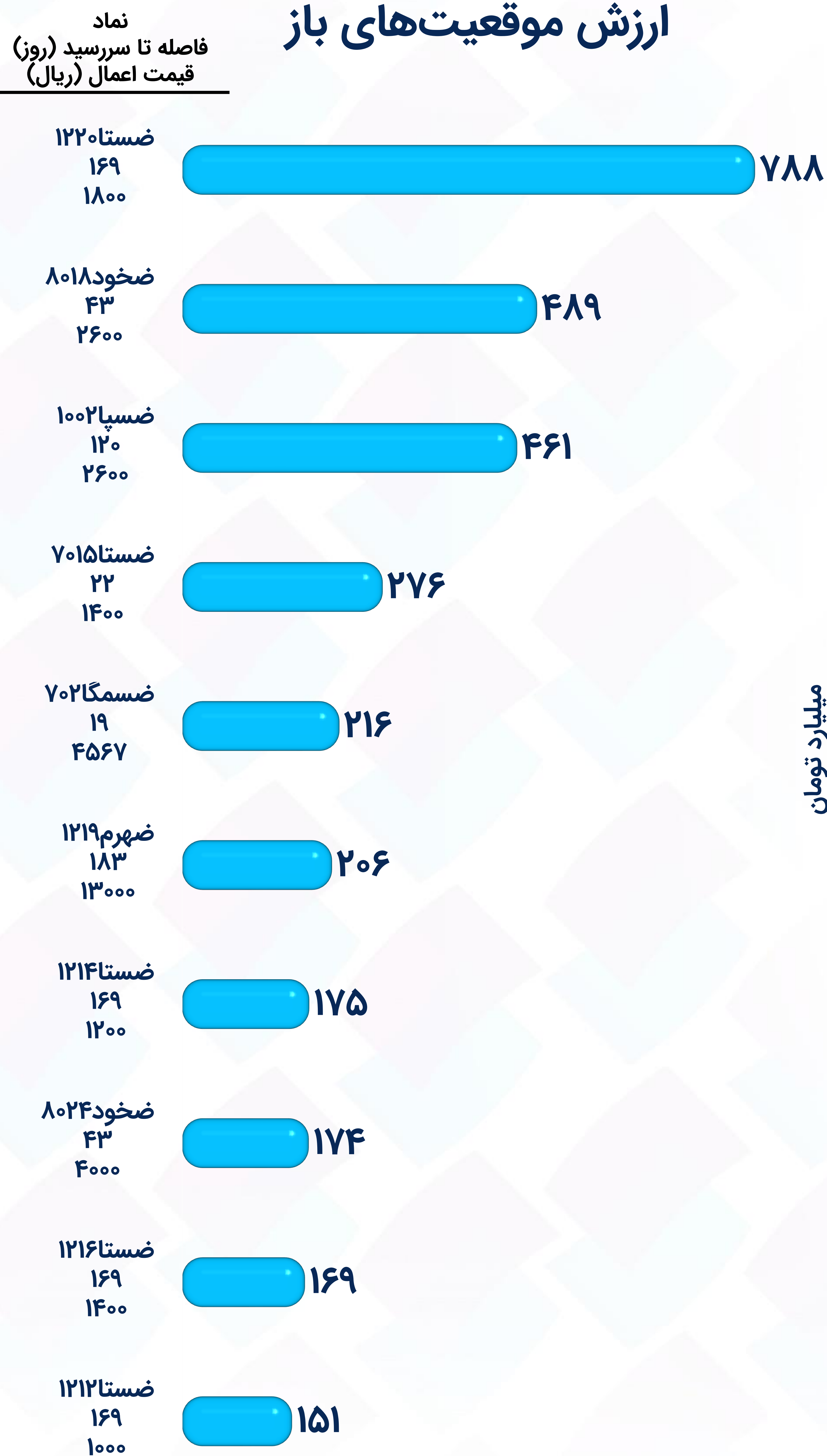
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

میلیون تومان

میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



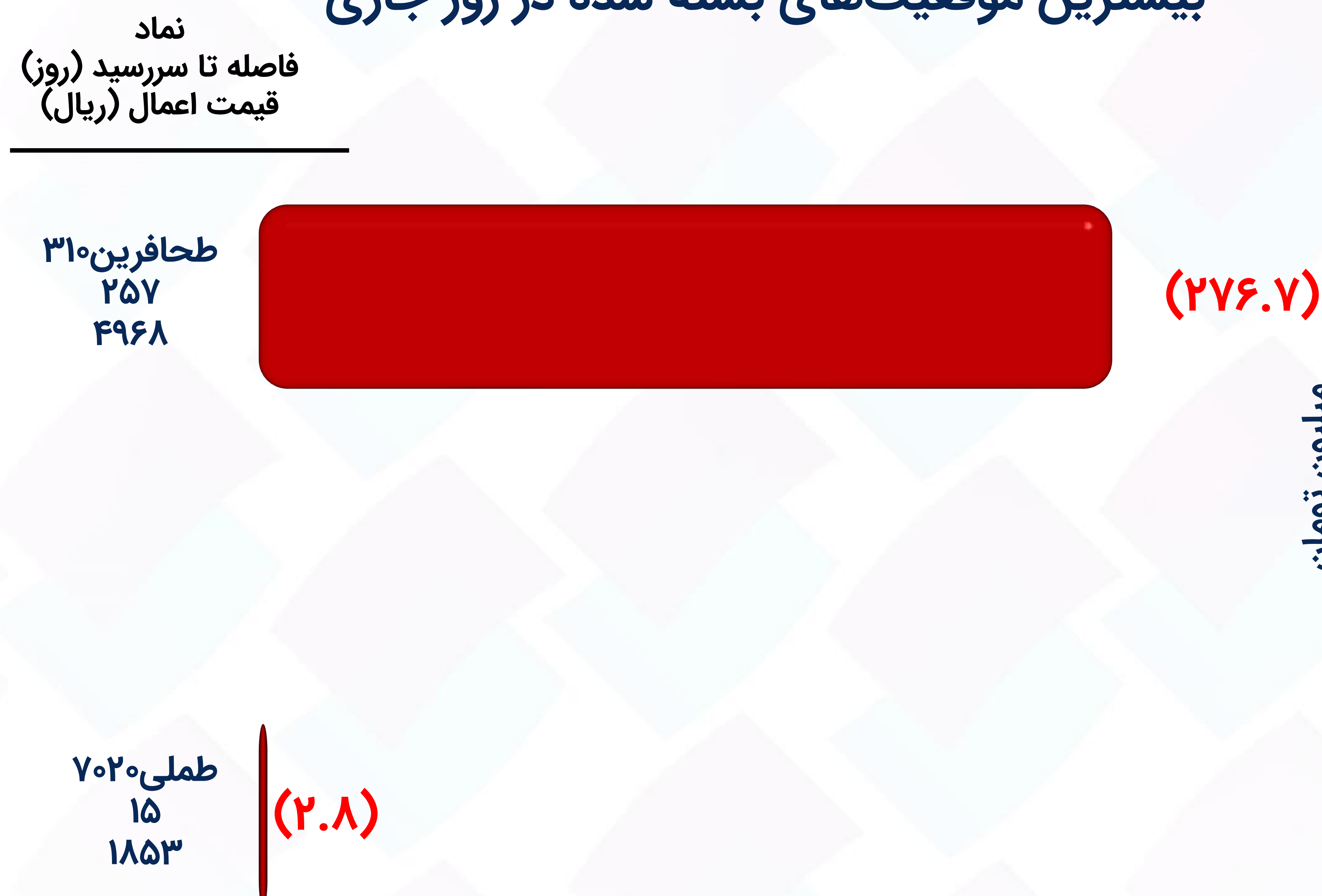
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



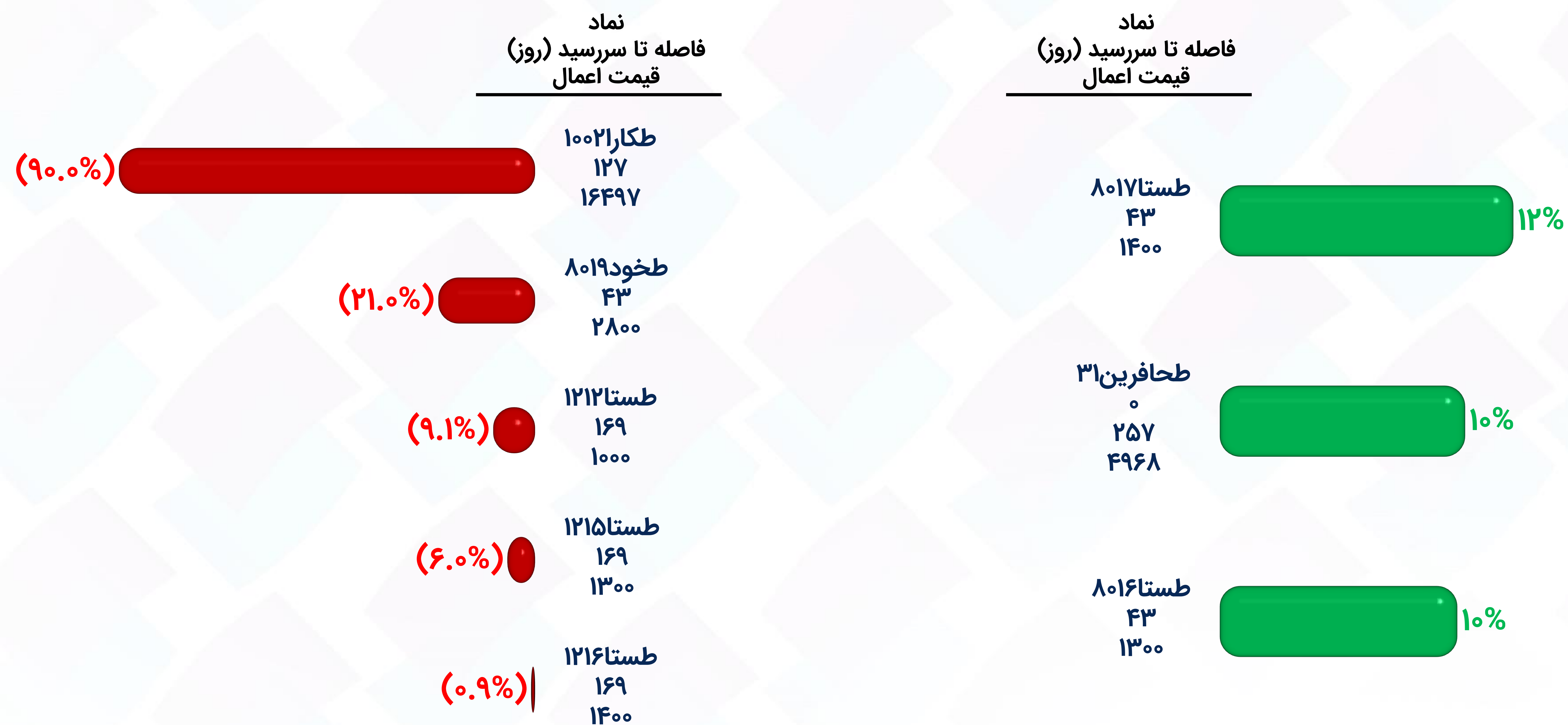
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

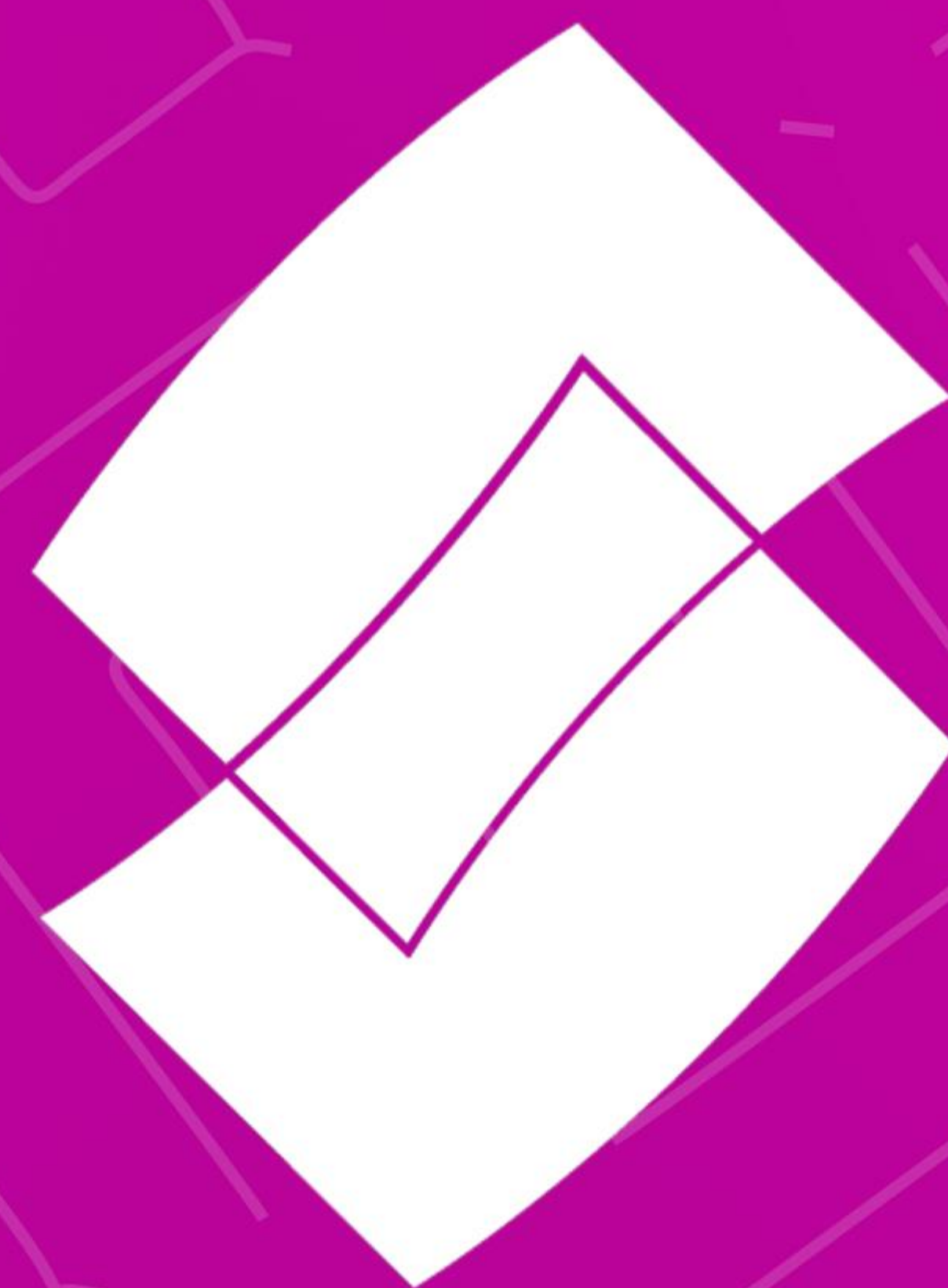
اختیار خرید



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.