

شماره

۱۵۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ دی ۱۴۰۲

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage



با کارمزد صفر معامله کنید!

انجام معاملات صندوق های با درآمد ثابت نهال و ارمغان بدون کارمزد در کارگزاری تامین سرمایه نوین



نئوکارگزاری نوین
my.nibb.ir



با ما تماس بگیرید:
۰۲۱ ۸۶۷۹ ۱۰۰۰



صندوق سرمایه گذاری
نهال سرمایه ایرانیان



کارگزاری تامین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage



معاملات اختیار در سامانه صحرا

آموزش
قسمت ۲۵

سامانه صحرا یکی از سامانه‌هایی است که معامله‌گران با استفاده از آن می‌توانند به معاملات اختیار بپردازند. برای ایجاد دسترسی به سامانه صحرا، شما می‌توانید با استفاده از لینک my.nibb.ir در کارگزاری تأمین سرمایه نوین ثبت نام نموده و پس از ثبت درخواست پشتیبانی دسترسی خود به سامانه صحرا را فعال نمایید. پس از دریافت نام کاربری و رمز عبور با استفاده از لینک nibb.ePhoenix.ir می‌توانید وارد سامانه صحرا شوید.

در اولین مراجعه به این سامانه، لیست توافق‌نامه‌های لازم جهت انجام معاملات به شما نمایش داده خواهد شد که باید پس مطالعه دقیق، نسبت به اعلام موافقت خود اقدام نمایید. در نهایت، صفحه داشبورد به شما نمایش داده خواهد شد. صفحه داشبورد یکی از پرکاربردترین صفحات در این سامانه است که در تصویر ذیل به توضیح بخش‌های مختلف آن پرداخته‌ایم:

The screenshot shows the Sahra trading platform interface. At the top, there's a header with the user's name (محمد حسین نادعلی), time (07:53:34), and date (چهارشنبه 22 آذر). The main area is divided into several sections:

- Top Left:** A table showing "نمادهای هم گروه" (Related Symbols) with columns for "نماد" (Symbol), "تغییرات روزانه" (Daily Changes), "آخرین قیمت" (Last Price), "قیمت پایانی" (Closing Price), "حجم معاملات" (Volume), and "ارزش معاملات" (Value). It lists symbols like 1232, 1231, and 3010.
- Top Right:** A table showing "موقعیت‌ها (اختیار)" (Positions) with columns for "نماد" (Symbol), "موقعیت" (Position), "آخرین قیمت" (Last Price), "وجه مسدودی" (Frozen Amount), "دارایی مسدودی" (Frozen Assets), "سودوزیان مانده" (Remaining P/L), and "سودوزیان تحقق‌یافته روزها" (Realized P/L Days). It shows a position for 1224 with a value of 33.
- Middle Left:** A section for "3009 - مجاز" (3009 - Mazar) with "فروش" (Sell) and "خرید" (Buy) buttons. Below it is a table for "حجم معاملات" (Transaction Volume) with columns for "تعداد" (Quantity), "حجم" (Volume), "فروش" (Sell), and "خرید" (Buy).
- Middle Right:** A section for "سفرشات" (Orders) with a table showing "ردیف" (Row), "نوع" (Type), "نماد" (Symbol), "حجم" (Volume), "حجم‌شده" (Fulfilled), "قیمت" (Price), "آخرین معامله" (Last Trade), "زمان" (Time), and "اعتبار" (Validity).

Callouts provide instructions:

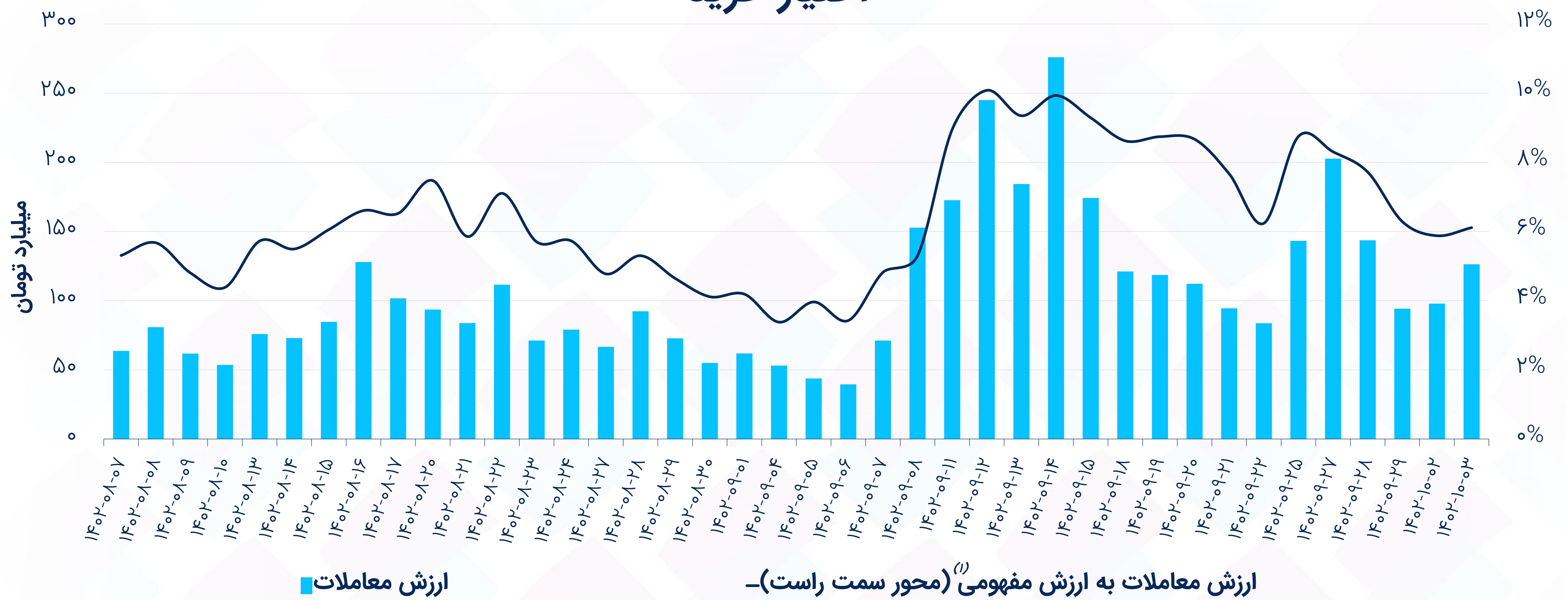
- Top Left: "این قسمت به نمایش نمادهای هم‌گروه اختصاص داده شده است و امکان دسترسی به چارت تکنیکال، انتقال به tsetmc، کدال و اضافه کردن یادداشت و هشدار برای هر یک از نمادها وجود دارد." (This section is dedicated to displaying related symbols, and it allows access to technical charts, transfer to tsetmc, Codal, and adding notes and alerts for each symbol.)
- Top Right: "دراستی‌های شخص شامل سهام، صندوق، صندوق، موقعیت‌های باز اختیار را به همراه جزئیات مختلف نمایش می‌دهد، قسمت دیده‌بان در این بخش دسترسی سریع و جامع به سهم‌های انتخاب شده را امکان‌پذیر می‌کند." (It displays personal holdings including stocks, funds, and open options positions along with their details. The 'دیده‌بان' (Watchlist) section provides quick and comprehensive access to selected securities.)
- Middle Right: "دسترسی به سایر صفحه‌های سامانه از طریق نوار آبی سمت راست امکان‌پذیر است." (Access to other platform pages is available through the blue sidebar on the right.)
- Middle Left: "این بخش مربوط به سفارش‌گذاری بوده و با جستجو نماد معاملاتی و دریافت اطلاعات مرتبط با نماد، می‌توانید اقدام به خرید یا فروش دارایی نمایید. با کلیک بر روی هر یک از گزینه‌های خرید و فروش، باکس سفارش‌گیری باز می‌شود. با وارد کردن اطلاعات مرتبط با قیمت و تعداد مورد نظر، میزان سرمایه مورد نیاز برای شما نمایش داده می‌شود." (This section is for order entry. You can search for a trading symbol and get related information to buy or sell assets. Clicking on buy or sell options opens the order entry box. After entering price and quantity, the required investment amount is displayed.)
- Bottom Right: "در این بخش اطلاعاتی در مورد جزئیات سفارشات از جمله وضعیت سفارش، گردش معاملات، نوبت سفارش و غیره برای شما نمایش داده می‌شود." (In this section, you get information about order details such as order status, trade turnover, order priority, and other details for your orders.)
- Bottom Left: "ترکیب سهم‌های پرتفو را به صورت یک نمودار دایره‌ای نمایش می‌دهد." (It displays the composition of your portfolio as a pie chart.)

At the bottom, there's a status bar with various indicators: "قدرت خرید: 93,933,549", "مبلغ بلوکه: 0", "خرید آنلاین بلوکه شده: 0", "مانده نهایی: 93,933,549", "اعتبار: 0", "پرتفو لحظه‌ای: 0", "وجه تضمین اختیار معامله: 0", "وجه تضمین آتی: 0", "وضعیت مشتری: عادی", "نسخه 9.1.0".

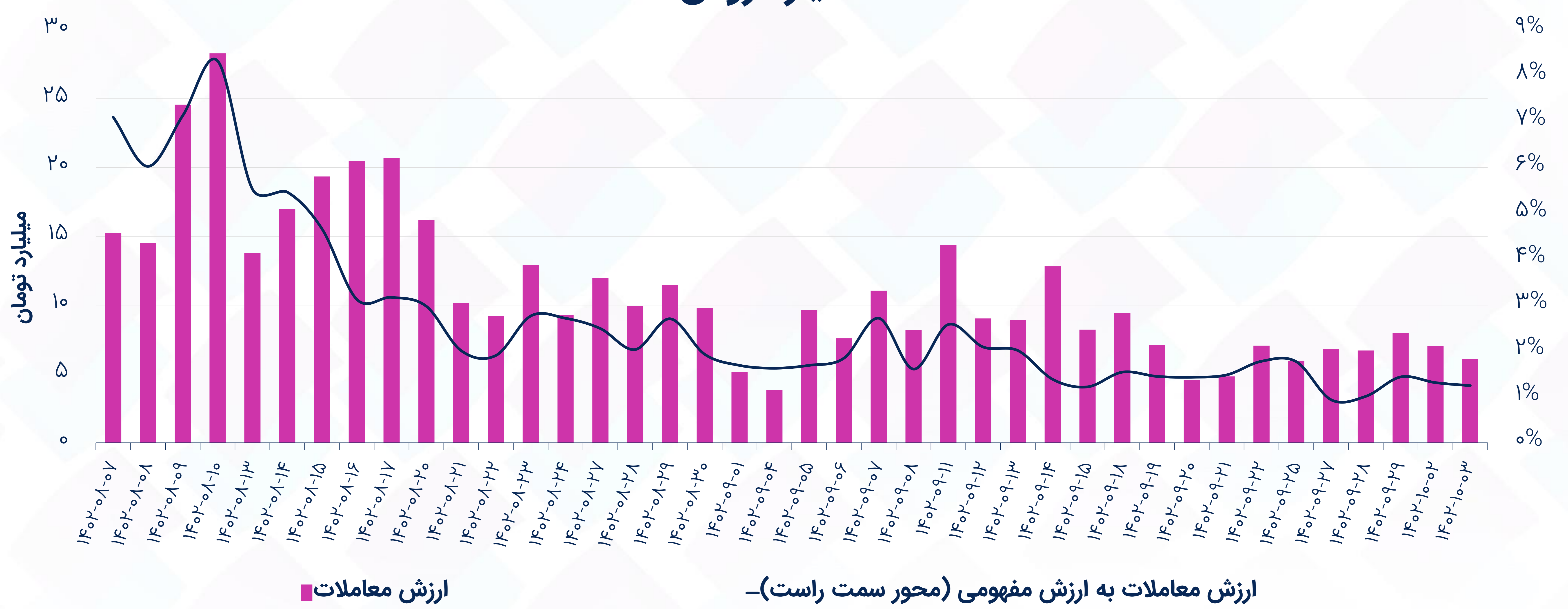
در قسمت‌های آموزشی بعدی با جزئیات بیشتری به آموزش نحوه انجام معاملات در سامانه صحرا خواهیم پرداخت.

ارزش معاملات

اختیار خرید



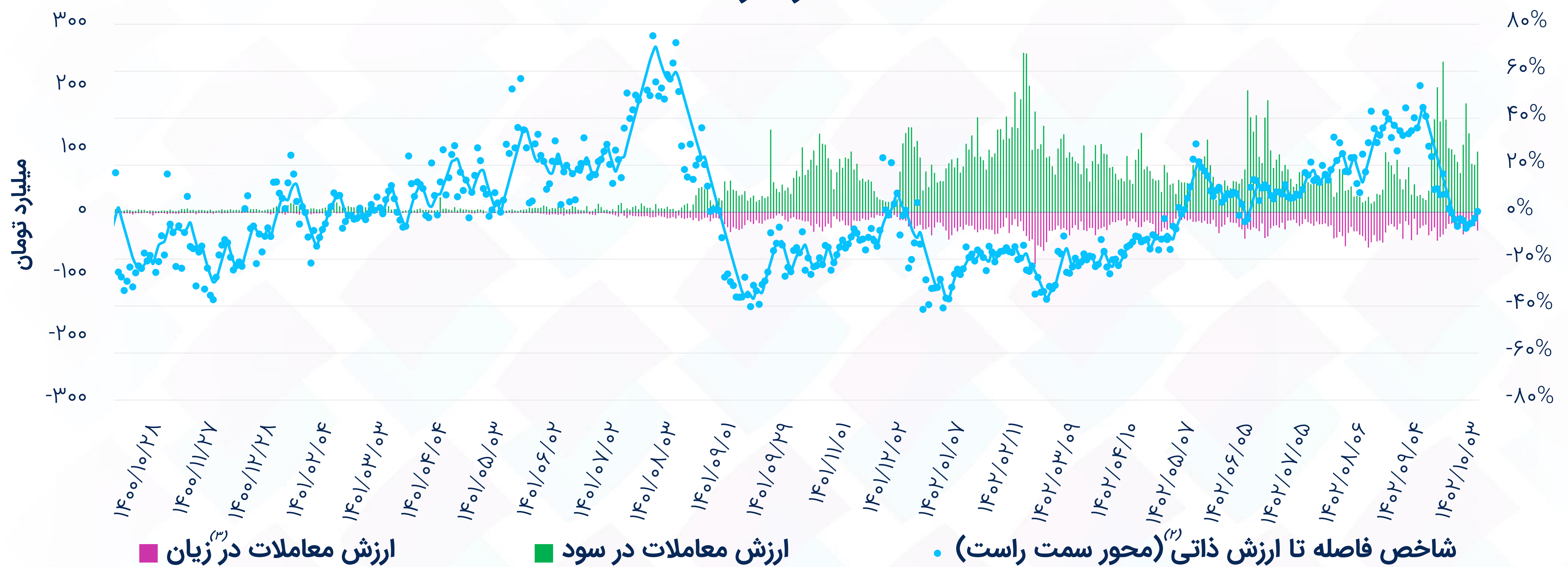
اختیار فروش



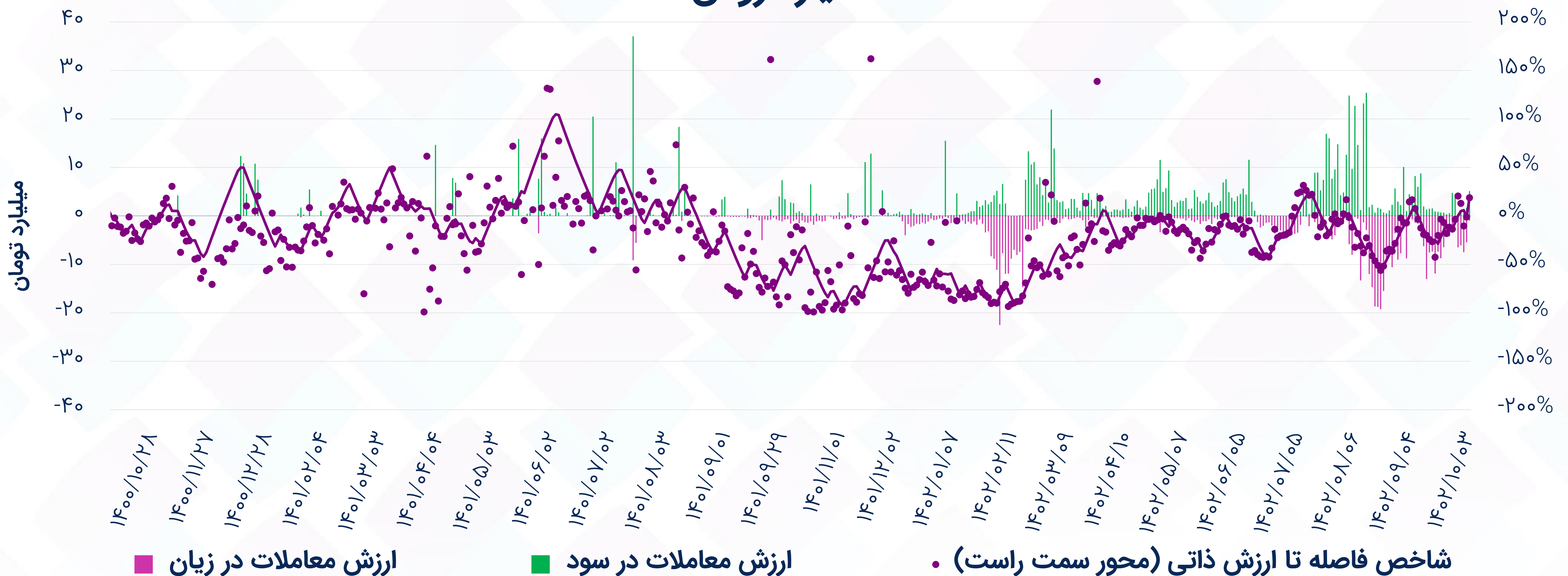
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

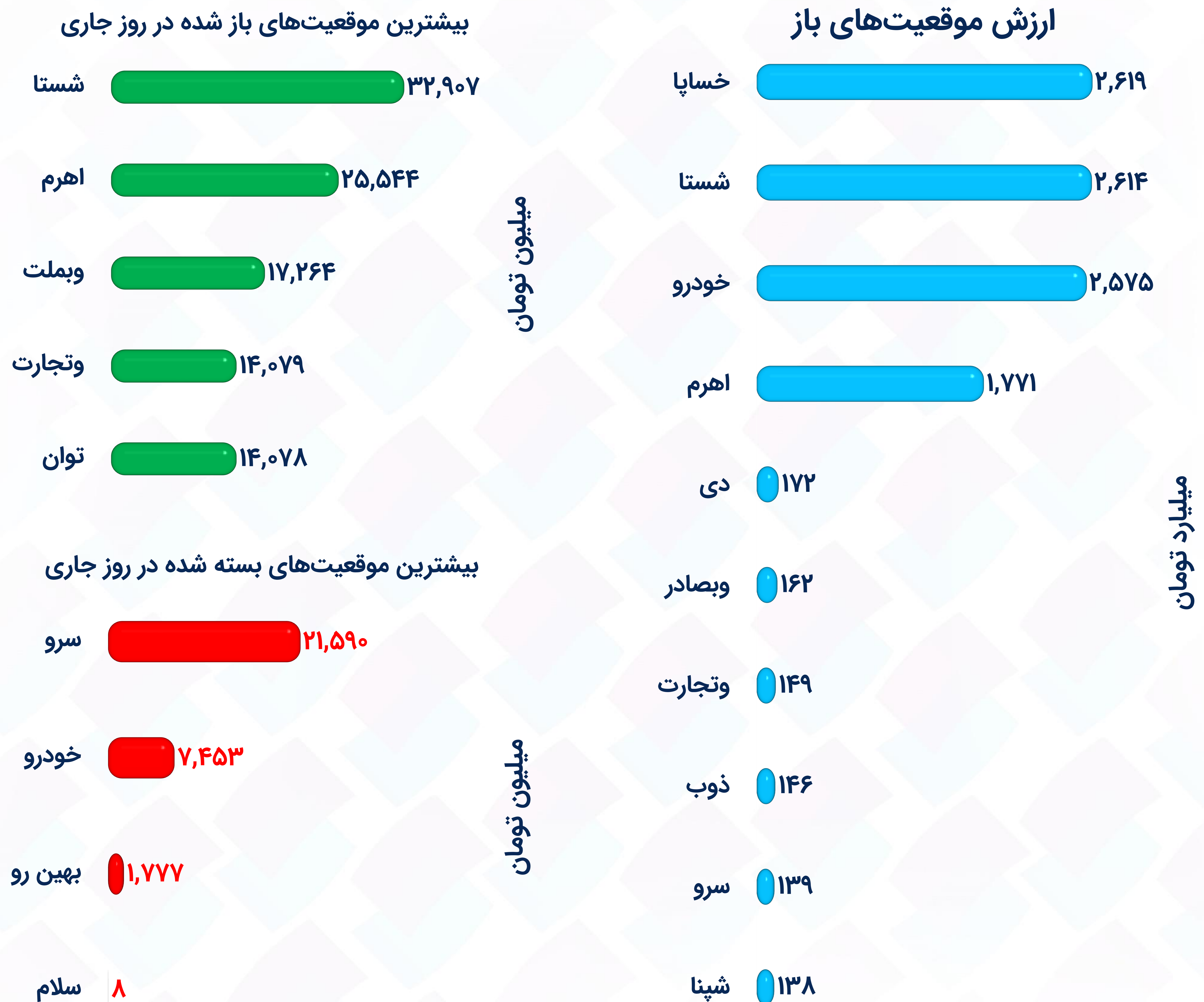
اختیار خرید

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	۳۸	۵۰.۰	۱,۴۵۱.۵	۳۳.۶	۱۶.۴	۷.۸%
اهرم	۲۱	۱۹.۰	۸۵.۶	۱۶.۴	۲.۶	(۴.۰%)
سرو	۱۳	۱۵.۷	۵۲.۶	۱۵.۷	۰.۰	۲.۰%
شستا	۲۰	۱۵.۱	۱۱۰.۷	۱۳.۴	۱.۸	(۹.۳%)
خسپا	۲۲	۱۱.۴	۲۳۴.۲	۵.۱	۶.۳	(۱۰.۹%)
ذوب	۴	۳.۵	۲۴.۳	۳.۵	۰.۱	۱.۷%
وبملت	۱۲	۳.۳	۲۳.۳	۲.۶	۰.۷	۴.۳%

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
خودرو	۱۰	۴,۵۴۰.۸	۳۹۹,۸۰۶.۷	۴,۱۴۸.۵	۳۹۲.۳	۲۵.۳%
اهرم	۴	۷۹۵.۷	۱۳,۶۶۳.۰	۷۲۲.۲	۷۳.۵	۱۲.۱%
خسپا	۵	۴۱۲.۵	۵۵,۸۰۱.۸	۲۲۷.۷	۱۸۴.۸	۲۲.۷%
شستا	۳	۳۲۱.۱	۱۹,۶۲۱.۹	۰.۰	۳۲۱.۱	(۶۱.۶%)
حافرین	۱	۱۰.۲	۱۸.۲	۱۰.۲	۰.۰	۱۵.۸%
شپنا	۲	۲.۵	۴۶.۵	۲.۵	۰.۰	۱۱.۱%
شتاب	۱	۰.۴	۵.۱	۰.۴	۰.۰	(۱۷.۴%)

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



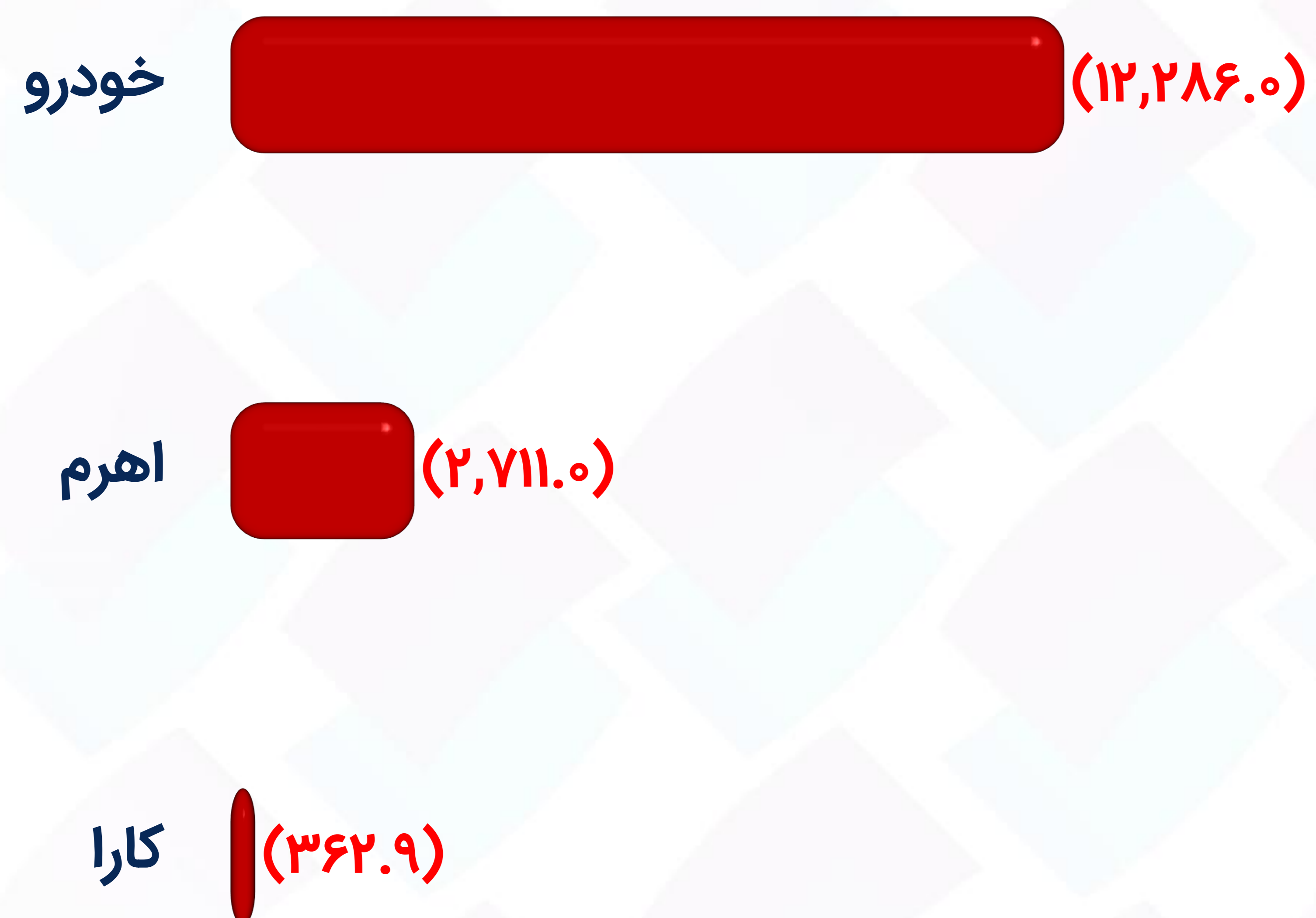
میلیون تومان

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
۴۷۹%	۳۰۷	۰.۴۵	۱۰۴.۸	۱۵.۵%	۵,۵۵۳	۴,۸۰۶	۵۳	۴۴.۴	۱۱۵	۵,۵۰۰	وبملت ۰۱۰۷
۳۸۸%	۱,۴۹۸	۰.۷۲	۱۹.۹	(۶.۵%)	۶,۱۰۷	۶,۵۳۰	۳۰۷	۳.۱	۴۵	۵,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۲
۲۳۹%	۲۰	۰.۱۹	۲۶۷.۷	۲۵.۸%	۱,۶۰۶	۱,۲۷۷	۶	۶.۶	۹۴	۱,۶۰۰	ضستا ۰۱۱۶
۱۰۱%	۲,۱۳۶	۰.۸۶	۵.۵	(۱۰.۲%)	۵,۸۶۳	۶,۵۳۰	۱,۰۶۳	۹.۹	۴۵	۴,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۰
۷۶%	۶۰	۰.۵۲	۸۳.۴	۱.۵%	۲,۸۳۴	۲,۷۹۲	۳۴	۶,۰۰۸.۴	۳	۲,۸۰۰	ضخود ۱۰۷۵

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	۵,۰۰۱.۰	۹۴%	۵,۰۰۱	۲,۵۷۴	۱	۶.۰	۱۷	۵,۰۰۰	ضسپا ۱۰۱۰
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۵۰۱.۰	۶۱%	۴,۵۰۹	۲,۷۹۲	۹	۵.۴	۳۸	۴,۵۰۰	ضخود ۱۱۲۷
(۹۵%)	۱۴	۰.۰۱	۱۷۱.۷	۹۹%	۴۲,۲۴۶	۲۱,۲۵۰	۲۴۶	۱۰.۱	۸۰	۴۲,۰۰۰	ضهرم ۱۲۳۲
(۹۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۲۵۱.۰	۱۶%	۳,۲۵۱	۲,۷۹۲	۱	۴۴.۹	۳	۳,۲۵۰	ضخود ۱۰۷۷
(۸۸%)	۱	۰.۰۱	۳۳۴.۳	۴۴%	۴,۰۱۲	۲,۷۹۲	۱۲	۹.۴	۳۸	۴,۰۰۰	ضخود ۱۱۲۶

(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

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک 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
۶۶.۲%	۲۳	-۰.۱۷	۱۷۰.۴	(۷%)	۲,۳۸۶	۲,۵۷۴	۱۴	۱۴۰.۱	۱۷	۲,۴۰۰	طسپا ۱۰۰۱
۴۹.۷%	۴	-۰.۰۷	۸۶۵.۷	(۷%)	۲,۵۹۷	۲,۷۹۲	۳	۱۲۹.۶	۳	۲,۶۰۰	طخود ۱۰۷۴
۲۶.۵%	۵۶	-۰.۴۸	۶۲.۶	(۱%)	۲,۷۵۶	۲,۷۹۲	۴۴	۴,۰۶۵.۸	۳	۲,۸۰۰	طخود ۱۰۷۵
۲۶.۳%	۳۷۹	-۰.۶۲	۹.۸	۶%	۲,۹۵۰	۲,۷۹۲	۳۰۰	۱.۷	۹۴	۳,۲۵۰	طخود ۰۱۲۲
۱۵.۸%	۱,۶۷۹	-۰.۹۵	۲.۳	۲۸%	۳,۳۱۸	۲,۶۰۰	۱,۴۵۰	۱۰.۲	۱۵۴	۴,۷۶۸	طحافرین ۳۰۹

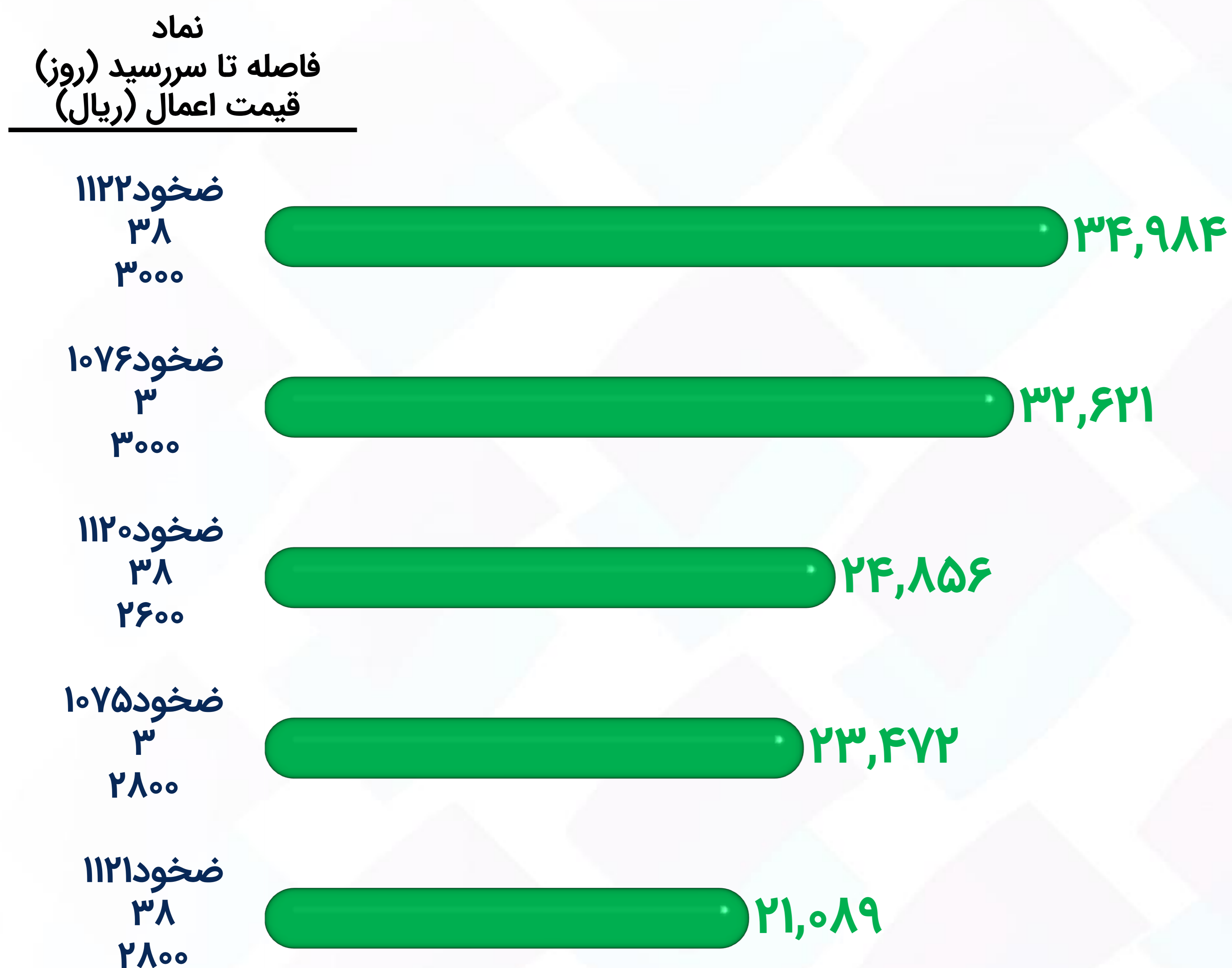
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک 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
(۹۷.۱%)	۰	۰.۰۰	۳۹۹.۰	(۲۲%)	۱,۹۹۵	۲,۵۷۴	۵	۲.۰	۱۷	۲,۰۰۰	طسپا ۱۰۱۳
(۹۴.۹%)	۰	۰.۰۰	۲,۳۹۹.۰	(۱۴%)	۲,۳۹۹	۲,۷۹۲	۱	۱.۵	۳	۲,۴۰۰	طخود ۱۰۷۳
(۶۵.۵%)	۷	-۰.۰۸	۵۷.۵	(۱۴%)	۱,۰۹۳	۱,۲۷۷	۱۹	۲۵۶.۹	۶۶	۱,۱۱۲	طستا ۱۲۱۵
(۴۴.۹%)	۲۳	-۰.۲۱	۲۸.۶	(۸%)	۱,۱۷۱	۱,۲۷۷	۴۱	۶۳.۴	۶۶	۱,۲۱۲	طستا ۱۲۱۶
(۴۰.۱%)	۳	-۰.۰۳	۴۳۹.۰	(۱۵%)	۲,۱۹۵	۲,۵۷۴	۵	۴۲.۶	۱۷	۲,۲۰۰	طسپا ۱۰۰۰

(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



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

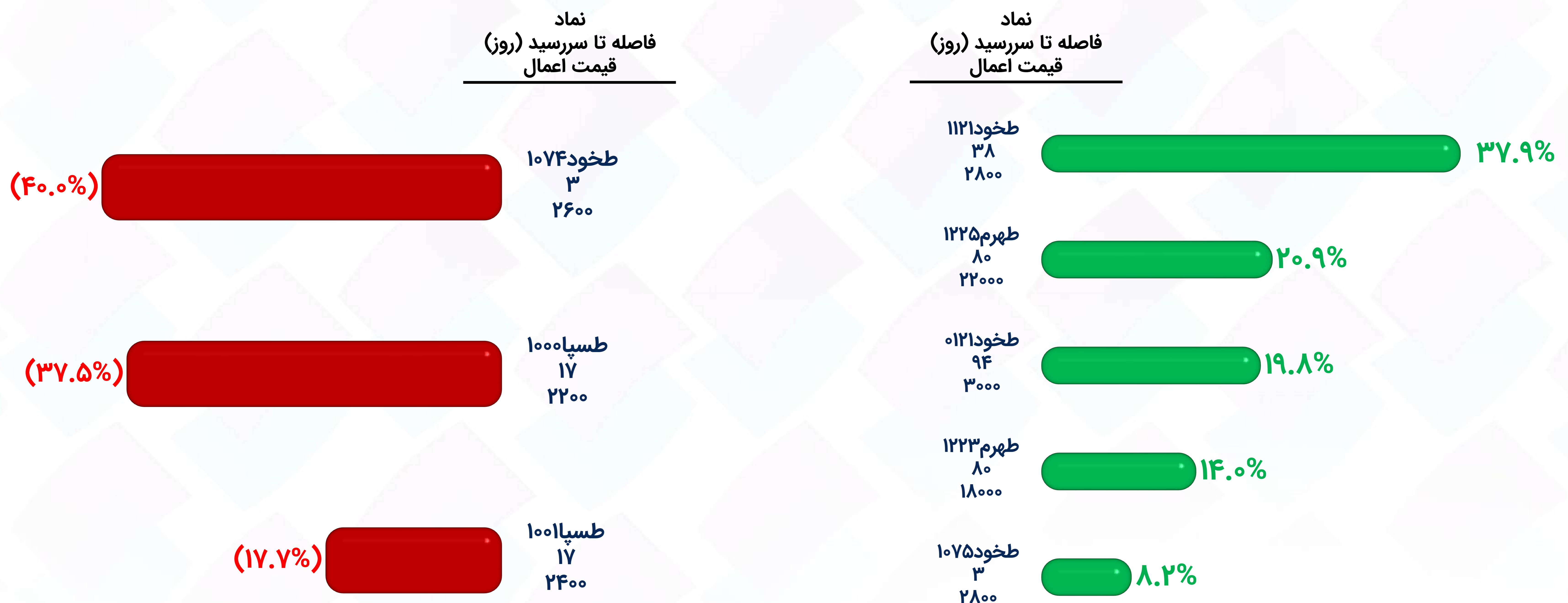


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



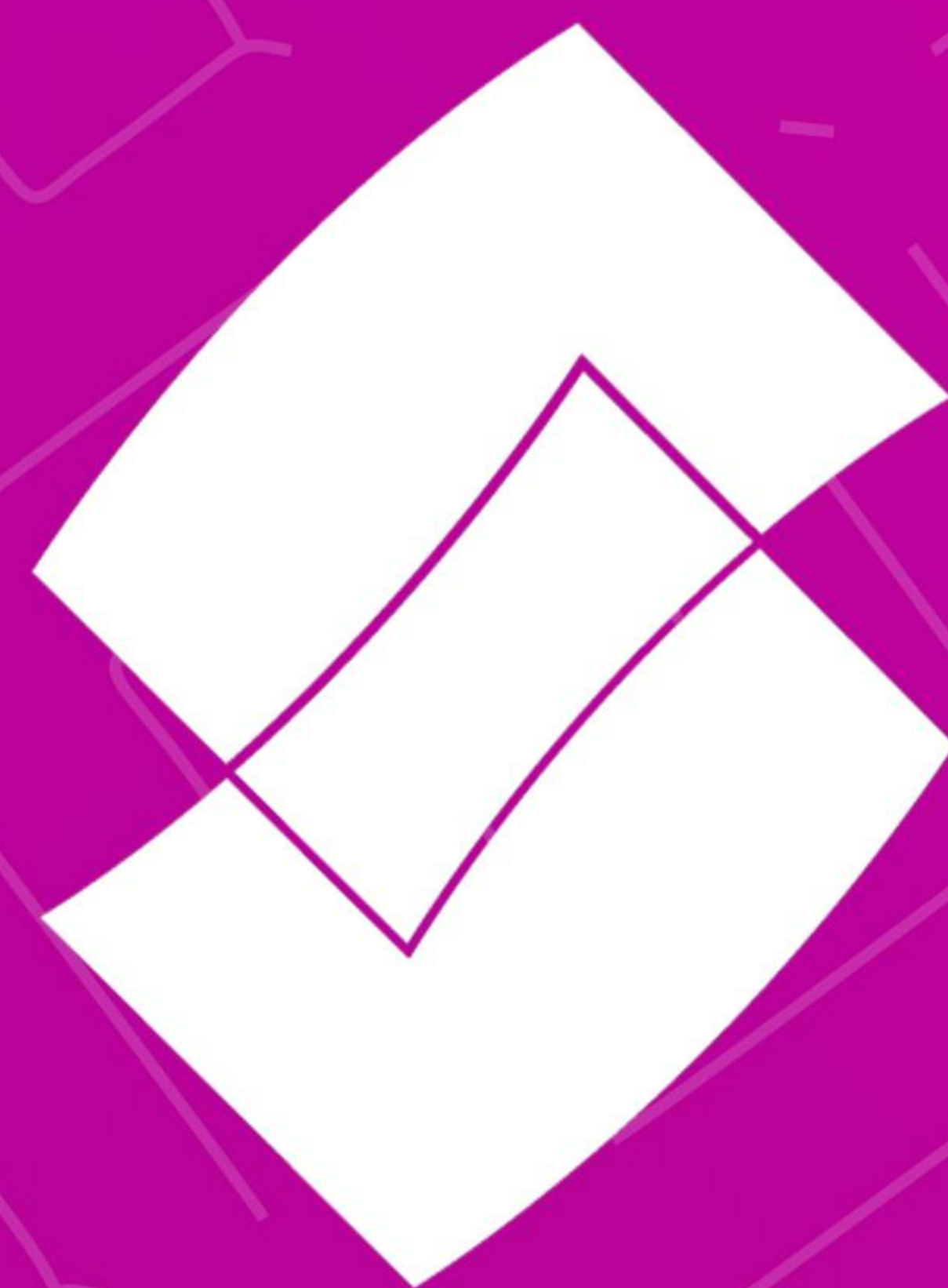
اختیار فروش



(۱) تنها قراردادهایی که طی دور معاملاتی منتهی به روز جاری دارای ارزش معاملاتی بیش از یک میلیون تومان هستند، لحاظ شده‌اند.



اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!



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.