

شماره

۱۵۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۴ 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), date (چهارشنبه 22 آذر), and account balance (2,161,266.62 / 0 (0%)). 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 buttons for "فروش" (Sell) and "خرید" (Buy). 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" (Executed), "قیمت" (Price), "آخرین معامله" (Last Trade), "زمان" (Time), and "اعتبار" (Validity). It shows an order for 3009.
- Bottom Left:** A section for "پرتفوی در یک نگاه" (Portfolio at a Glance) with a circular chart.

Callouts provide additional information:

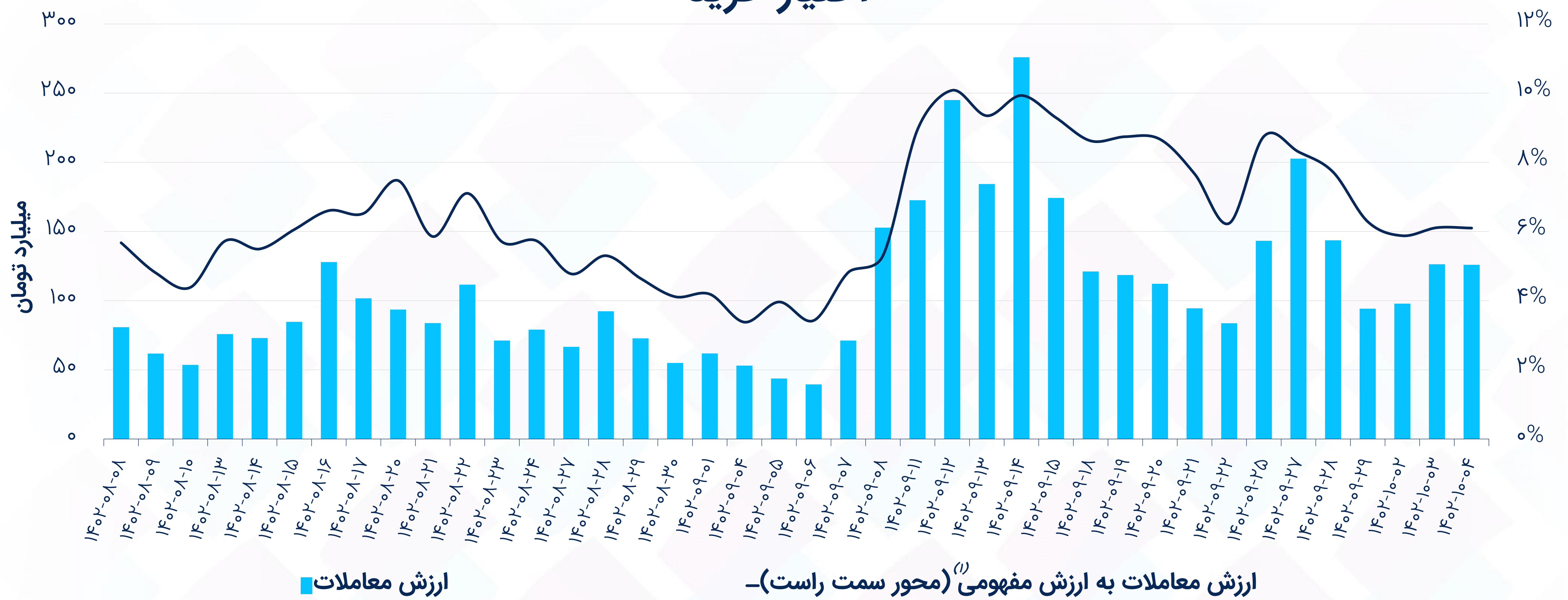
- Callout 1 (pointing to the 'موقعیت‌ها' table): "دارایی‌های شخص شامل سهام، صندوق، صندوق، موقعیت‌های باز اختیار را به همراه جزئیات مختلف نمایش می‌دهد، قسمت دیده‌بان در این بخش دسترسی سریع و جامع به سهم‌های انتخاب شده را امکان‌پذیر می‌کند."
- Callout 2 (pointing to the '3009 - مجاز' section): "دسترسی به سایر صفحه‌های سامانه از طریق نوار آبی سمت راست صفحه امکان‌پذیر است."
- Callout 3 (pointing to the 'سفرشات' table): "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."
- Callout 4 (pointing to the 'پرتفوی در یک نگاه' section): "ترکیب سهم‌های پرتفو را به صورت یک نمودار دایره‌ای نمایش می‌دهد."
- Callout 5 (pointing to the 'سفرشات' table): "در این بخش اطلاعاتی در مورد جزئیات سفارشات از جمله وضعیت سفارش، گردش معاملات، نوبت سفارش و غیره برای شما نمایش داده می‌شود."

At the bottom, there's a footer with account details: "قدرت خرید: 93,933,549", "مبلغ بلوکه: 0", "خرید آنلاین بلوکه شده: 0", "مانده نهایی: 93,933,549", "اعتبار: 0", "پرتفوی 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.

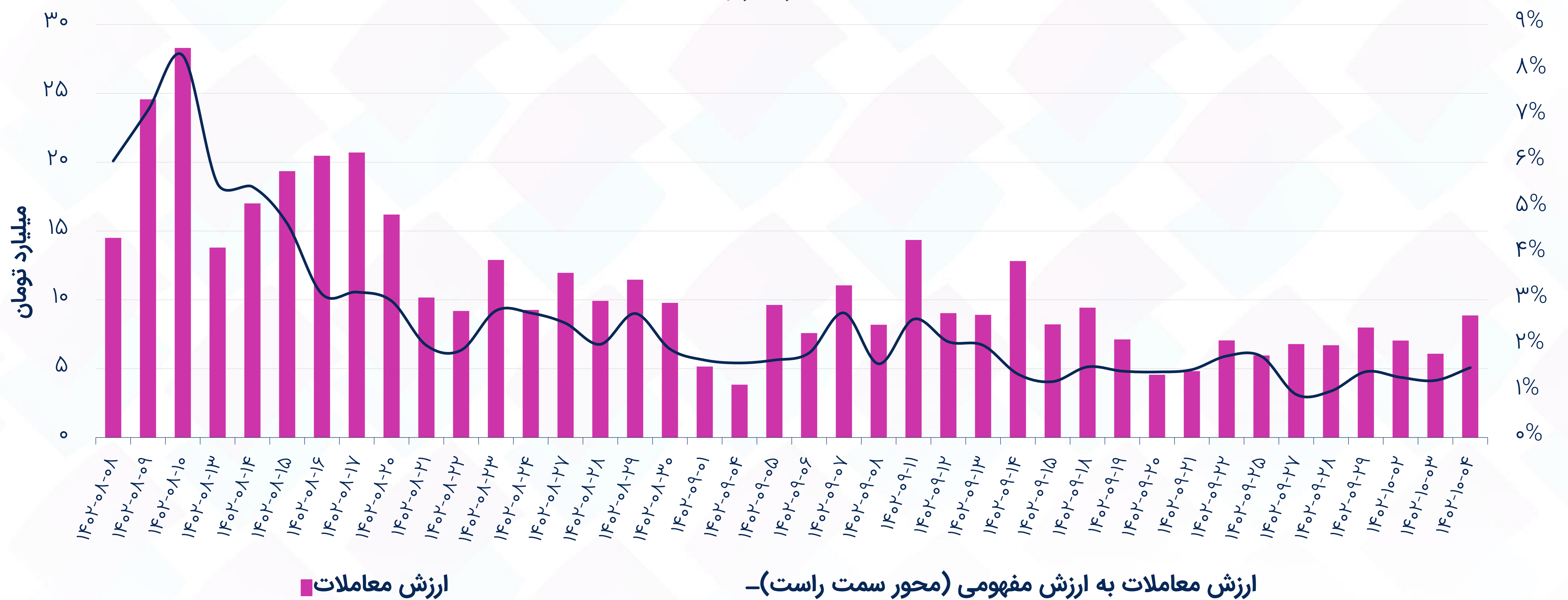
ارزش معاملات

اختیار خرید



ارزش معاملات به ارزش مفهومی (محور سمت راست) -

اختیار فروش

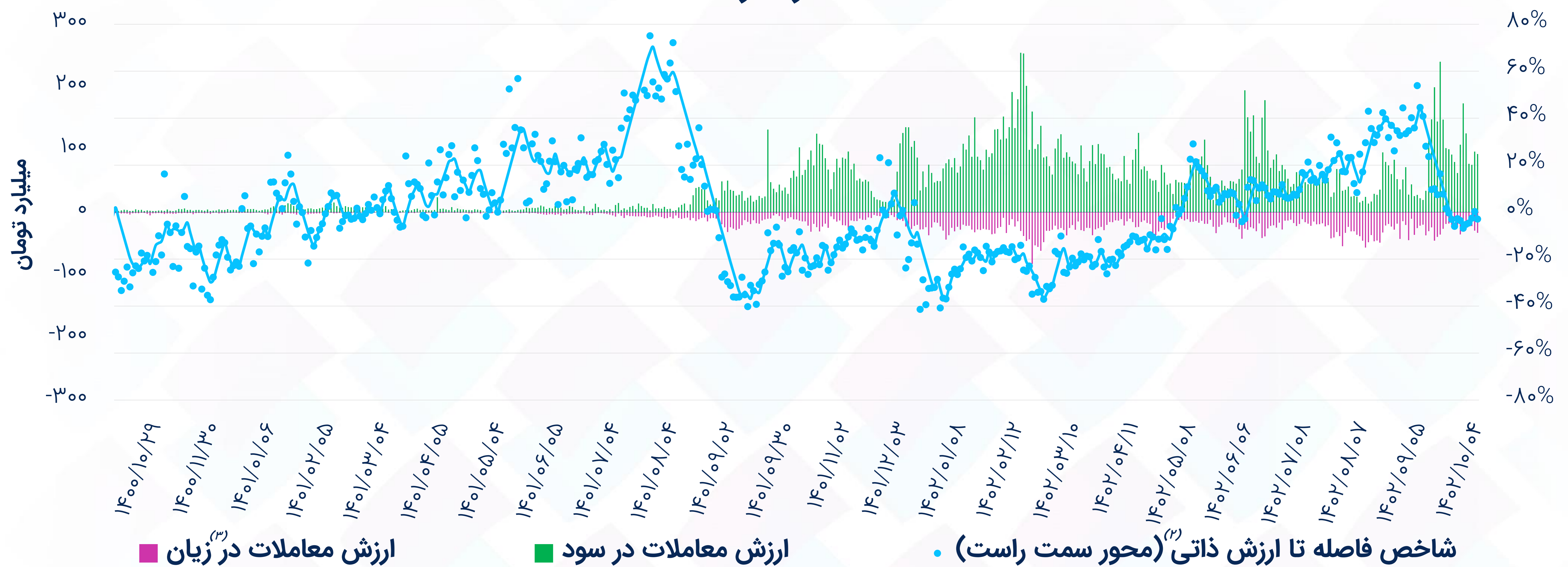


ارزش معاملات به ارزش مفهومی (محور سمت راست) -

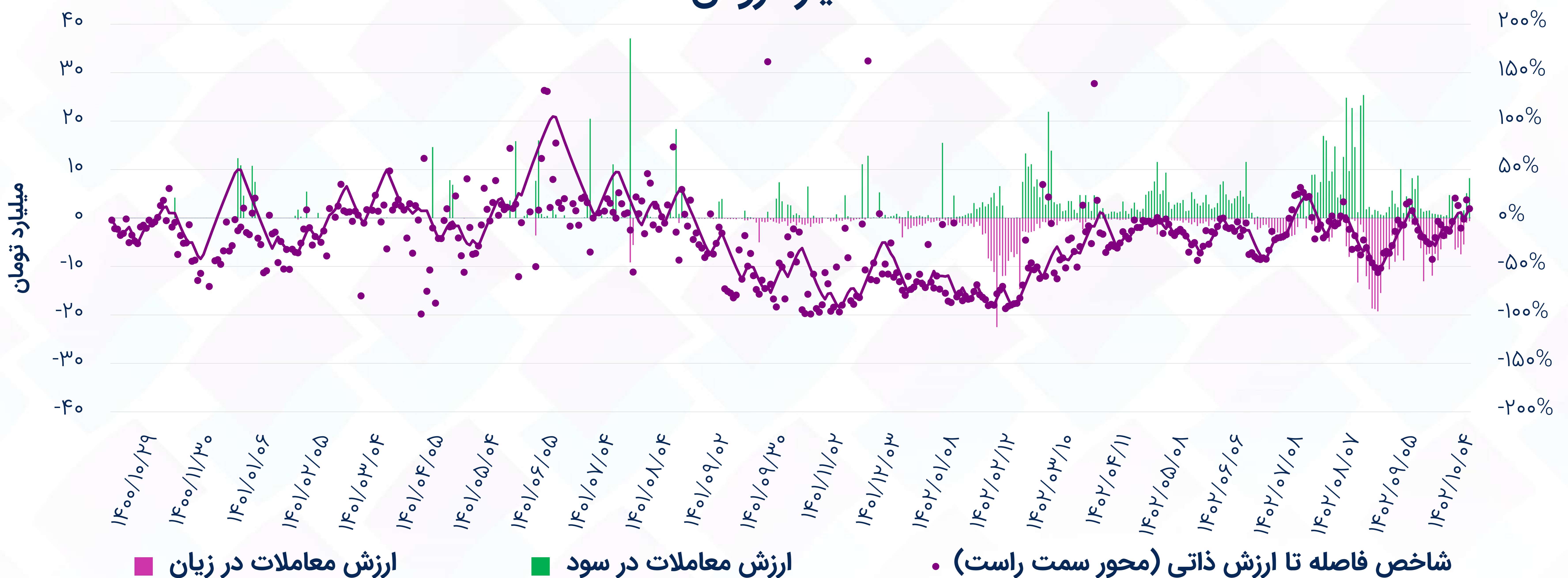
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۲	۳۹.۳	۱,۲۱۳.۳	۲۵.۸	۱۳.۴	۶.۱%
اهرم	۱۸	۲۵.۶	۱۴۰.۶	۲۲.۴	۳.۲	(۴.۶%)
حسابا	۲۱	۱۵.۶	۳۸۶.۸	۶.۱	۹.۵	(۸.۰%)
شستا	۲۰	۱۳.۷	۱۲۹.۸	۱۱.۶	۲.۰	(۱۲.۴%)
سرو	۱۱	۱۲.۷	۳۳.۱	۱۲.۷	۰.۰	۱.۲%
ذوب	۴	۴.۷	۲۹.۷	۴.۶	۰.۱	(۴.۴%)
دی	۱۱	۴.۴	۴۷.۹	۱.۵	۲.۸	(۳۵.۹%)

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
خودرو	۹	۷,۵۵۸.۶	۵۲۶,۱۷۰.۲	۷,۳۴۵.۲	۲۱۳.۴	۱۱.۰%
اهرم	۴	۶۷۹.۷	۸,۶۱۶.۲	۶۷۴.۲	۵.۵	۷.۷%
شستا	۴	۳۰۴.۷	۱۶,۸۳۳.۲	۰.۶	۳۰۴.۱	(۴۹.۴%)
حسابا	۵	۳۰۳.۵	۳۰,۸۹۲.۰	۱۹۱.۱	۱۱۲.۴	۳۹.۷%
کارپس	۱	۱۸.۳	۲۳۳.۲	۱۸.۳	۰.۰	۶.۷%
شتاب	۱	۳.۳	۴۵.۷	۳.۳	۰.۰	(۶.۱%)
شپنا	۱	۰.۵	۷.۸	۰.۵	۰.۰	۷.۳%

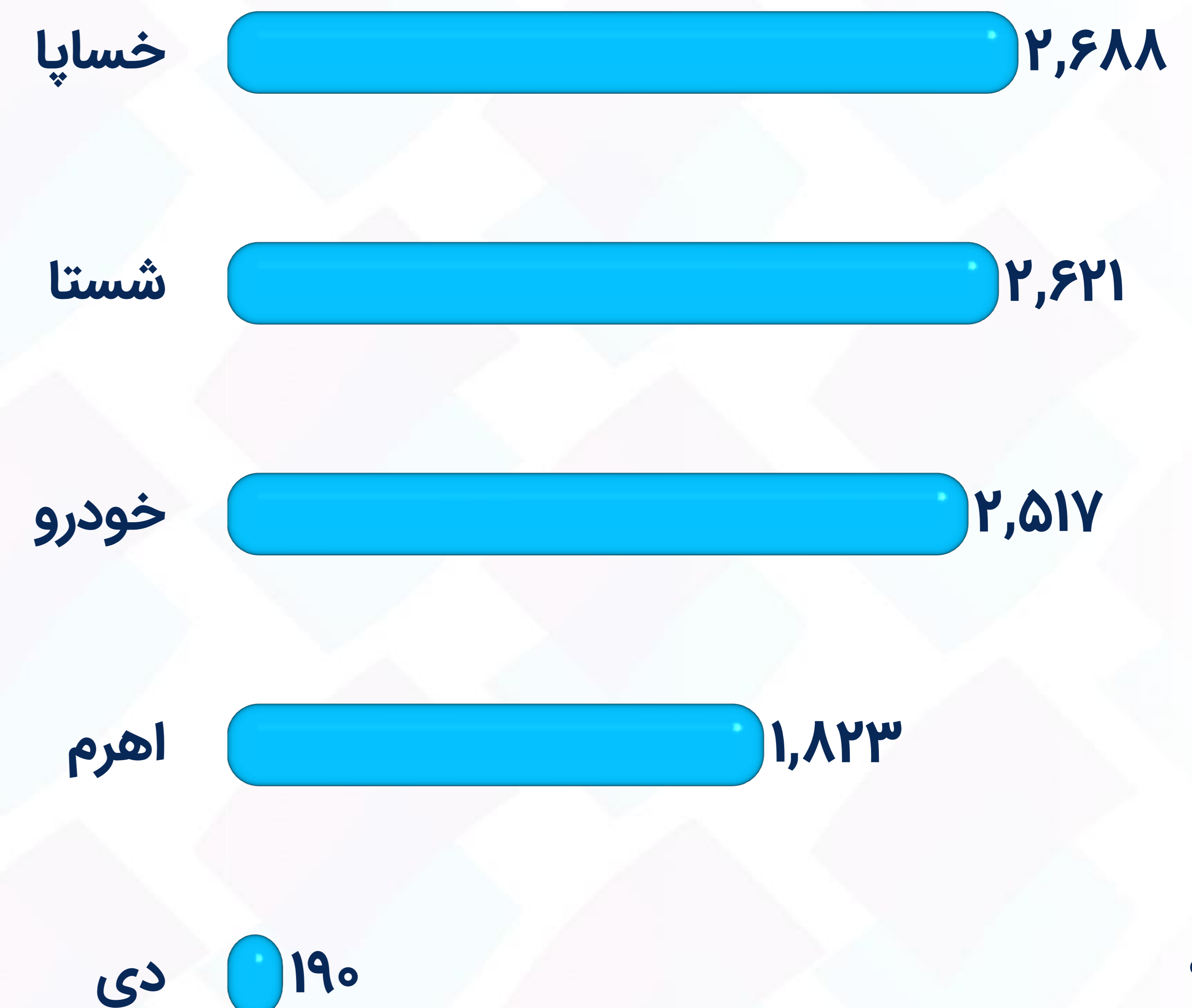
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

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 موقعیت‌های باز شده در روز جاری



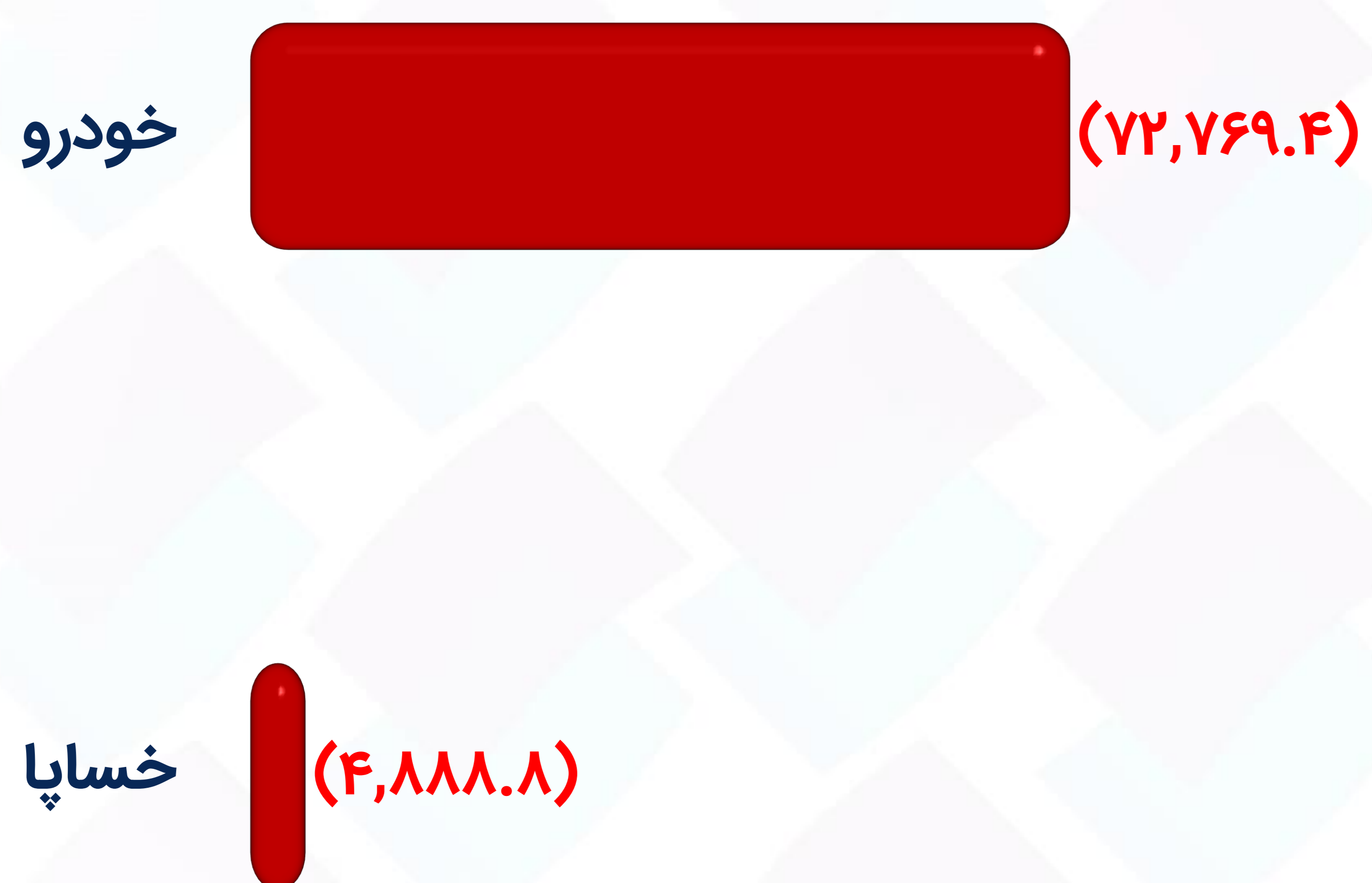
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

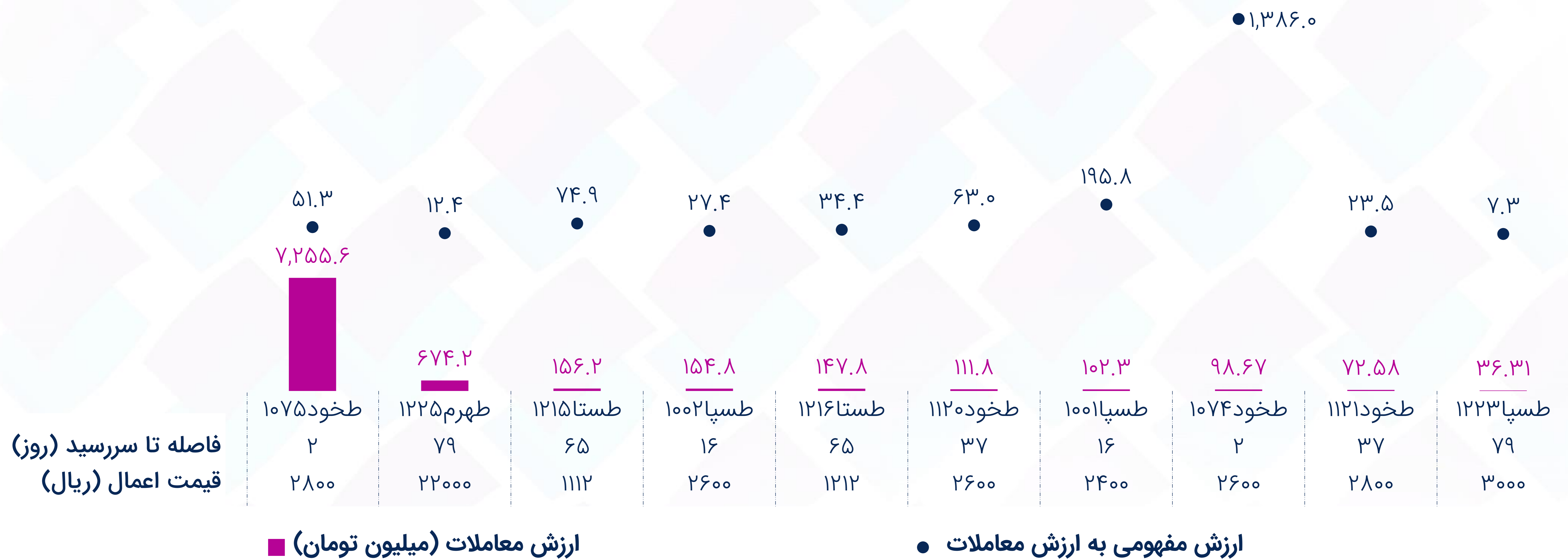


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۴۰۲%	۱,۴۶۵	۰.۷۲	۲۰.۹	(۶.۷%)	۶,۰۹۲	۶,۵۳۰	۲۹۲	۱۳.۵	۴۴	۵,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۲
۱۱۷%	۲,۸۶۱	۰.۸۳	۴.۶	(۶.۳%)	۶,۱۱۸	۶,۵۳۰	۱,۳۱۸	۱۶۱.۹	۱۶۷	۴,۸۰۰	ضفصبا ۳۰۰
۹۳%	۶۰۳	۰.۶۳	۳۳.۱	۲.۶%	۱۰,۳۱۲	۱۰,۰۵۰	۳۱۲	۲۶.۲	۳۰	۱۰,۰۰۰	ضبساما ۱۱۰۳
۸۷%	۲,۱۱۳	۰.۸۶	۵.۳	(۹.۲%)	۵,۹۲۹	۶,۵۳۰	۱,۱۲۹	۸۳.۱	۴۴	۴,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۰
۷۷%	۱۹۸	۰.۳۰	۹۹.۲	۱۰.۶%	۱۱,۱۱۲	۱۰,۰۵۰	۱۱۲	۱۱.۸	۳۰	۱۱,۰۰۰	ضبساما ۱۱۰۴

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	۳۷۶.۰	۶۳%	۴,۵۱۲	۲,۷۷۲	۱۲	۱۳.۲	۳۷	۴,۵۰۰	ضخود ۱۱۲۷
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۳,۲۵۱.۰	۱۷%	۳,۲۵۱	۲,۷۷۲	۱	۱۵.۴	۲	۳,۲۵۰	ضخود ۱۰۷۷
(۹۴%)	۴	۰.۰۲	۵۹.۸	۶۰%	۴,۰۶۸	۲,۵۴۵	۶۸	۲.۶	۷۹	۴,۰۰۰	ضسپا ۱۲۲۷
(۹۲%)	۱	۰.۰۱	۳۰۸.۷	۴۵%	۴,۰۱۳	۲,۷۷۲	۱۳	۵.۵	۳۷	۴,۰۰۰	ضخود ۱۱۲۶
(۹۱%)	۰	۰.۰۱	۶۵۱.۰	۲۸%	۳,۲۵۵	۲,۵۴۵	۵	۴۷.۹	۱۶	۳,۲۵۰	ضسپا ۱۰۰۵

(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 سرربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طسپا ۱۰۰۱	خسپا	۲,۴۰۰	۱۶	۱۰۲.۳	۱۳	۲,۵۴۵	۲,۳۸۷	(۶%)	۱۸۳.۶	-۰.۲۰	۲۶	۱۰۳.۸%
طخود ۱۰۷۴	خودرو	۲,۶۰۰	۲	۹۸.۷	۲	۲,۷۷۲	۲,۵۹۸	(۶%)	۱,۲۹۹.۰	-۰.۰۶	۳	۷۱.۷%
طهرم ۱۲۲۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷۹	۱.۴	۶۸۴	۲۱,۰۹۰	۱۹,۳۱۶	(۸%)	۲۸.۲	-۰.۲۸	۱,۰۰۲	۴۶.۵%
طهرم ۱۲۲۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۷۹	۴.۰	۳۷۶	۲۱,۰۹۰	۱۷,۶۲۴	(۱۶%)	۴۶.۹	-۰.۱۵	۴۵۸	۲۱.۹%
طخود ۱۱۲۰	خودرو	۲,۶۰۰	۳۷	۱۱۱.۸	۴۴	۲,۷۷۲	۲,۵۵۶	(۸%)	۵۸.۱	-۰.۲۲	۵۲	۱۸.۰%

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 سرربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طخود ۱۰۷۳	خودرو	۲,۴۰۰	۲	۲.۹	۱	۲,۷۷۲	۲,۳۹۹	(۱۳%)	۲,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۶%)
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱,۱۱۲	۶۵	۱۵۶.۲	۱۷	۱,۲۷۳	۱,۰۹۵	(۱۴%)	۶۴.۴	-۰.۰۸	۷	(۶۰.۸%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱,۲۱۲	۶۵	۱۴۷.۸	۳۷	۱,۲۷۳	۱,۱۷۵	(۸%)	۳۱.۸	-۰.۲۲	۲۳	(۳۷.۴%)
طسپا ۱۰۰۰	خسپا	۲,۲۰۰	۱۶	۹.۶	۴	۲,۵۴۵	۲,۱۹۶	(۱۴%)	۵۴۹.۰	-۰.۰۴	۳	(۱۷.۱%)
طخود ۰۱۲۱	خودرو	۳,۰۰۰	۹۳	۱.۰	۲۷۸	۲,۷۷۲	۲,۷۲۲	(۲%)	۹.۸	-۰.۴۸	۲۴۱	(۱۳.۲%)

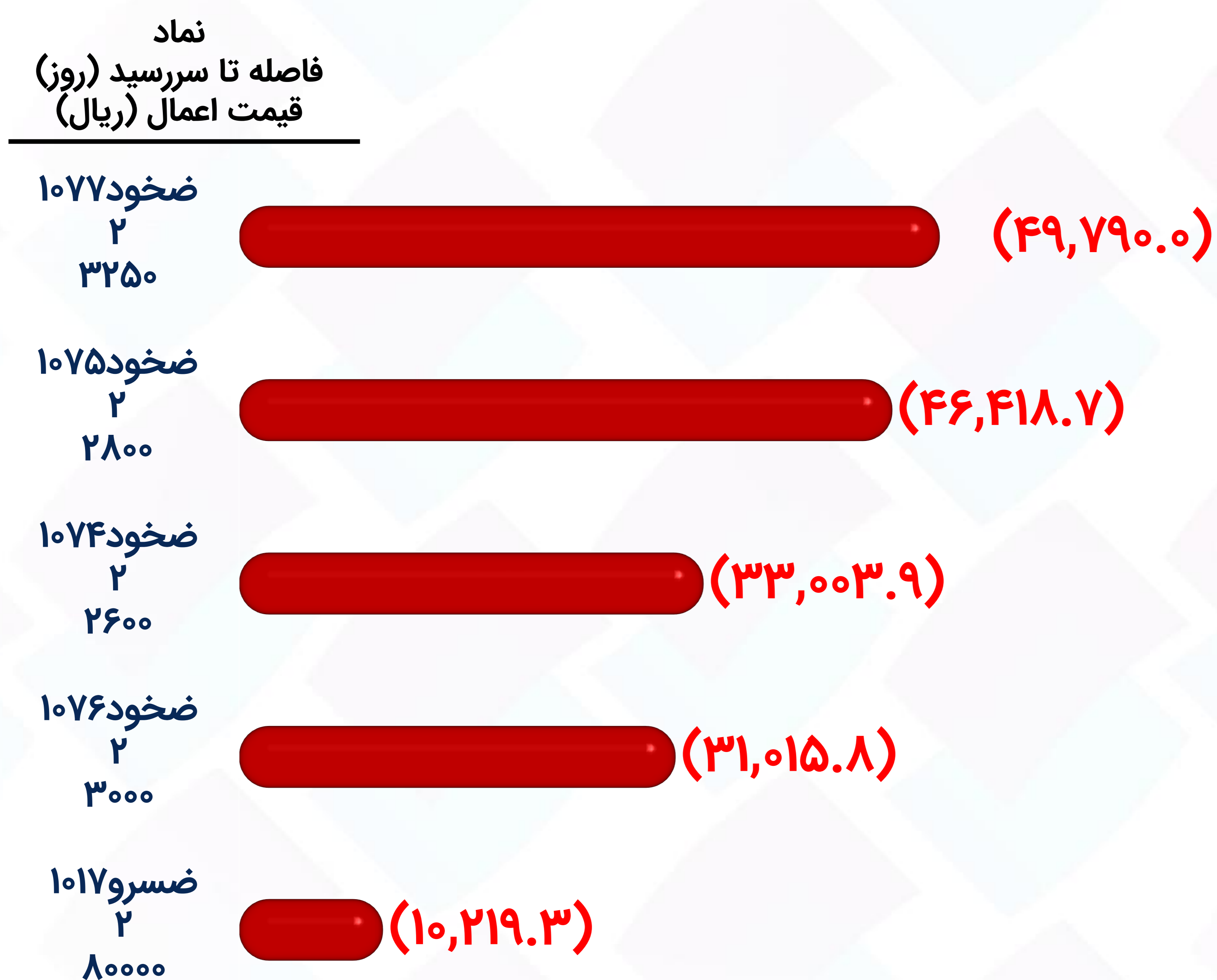
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

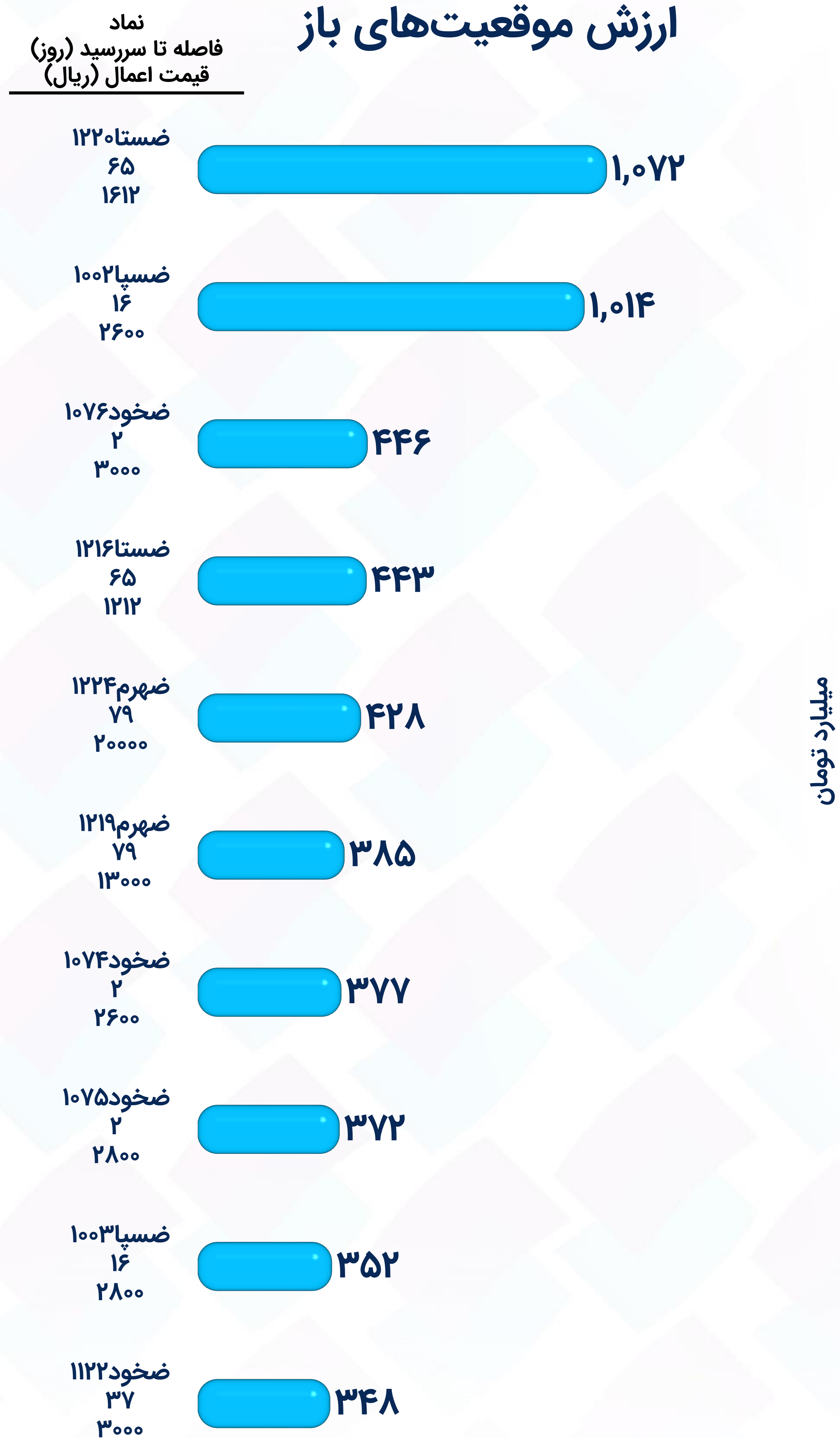
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

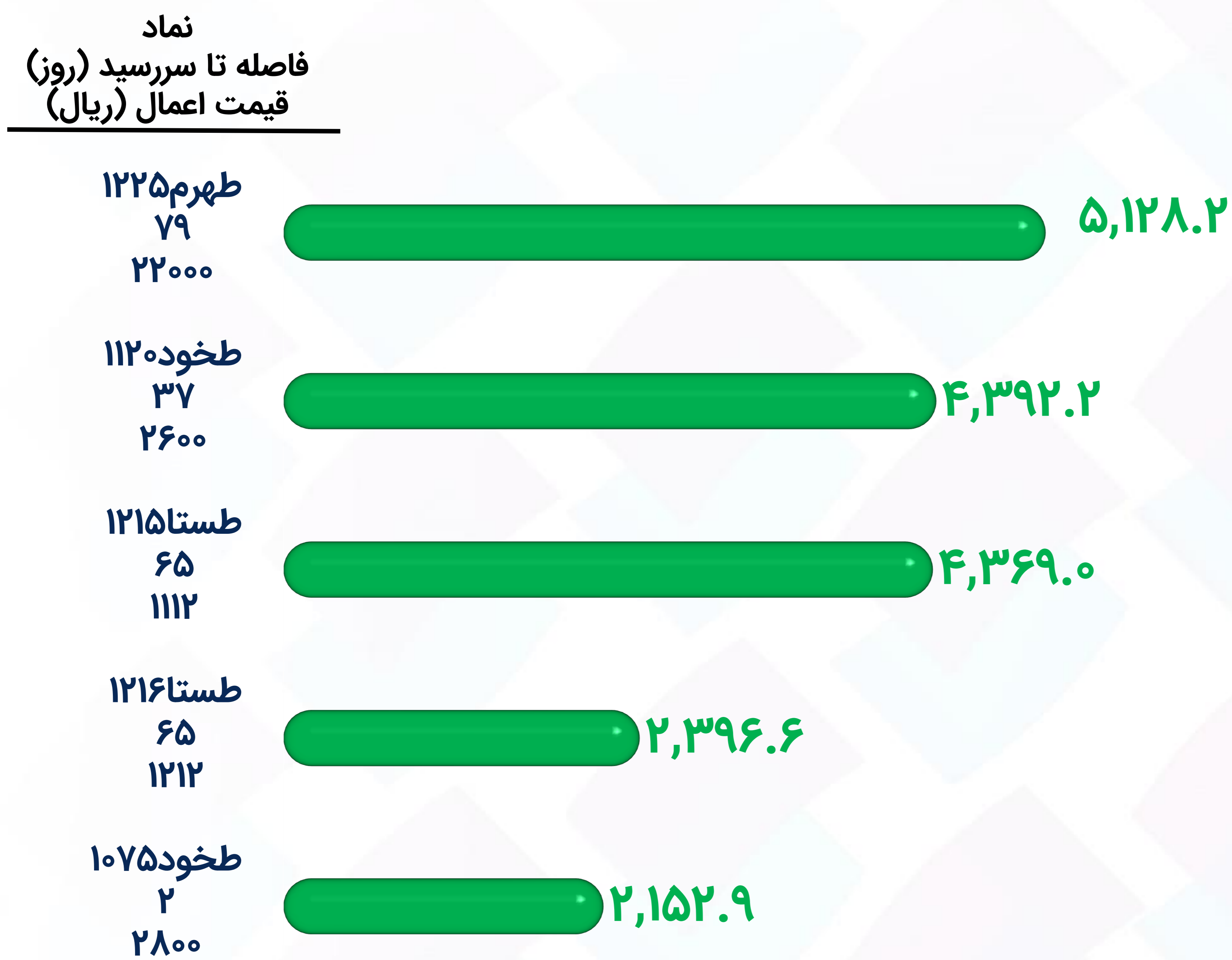


ارزش موقعیت‌های باز

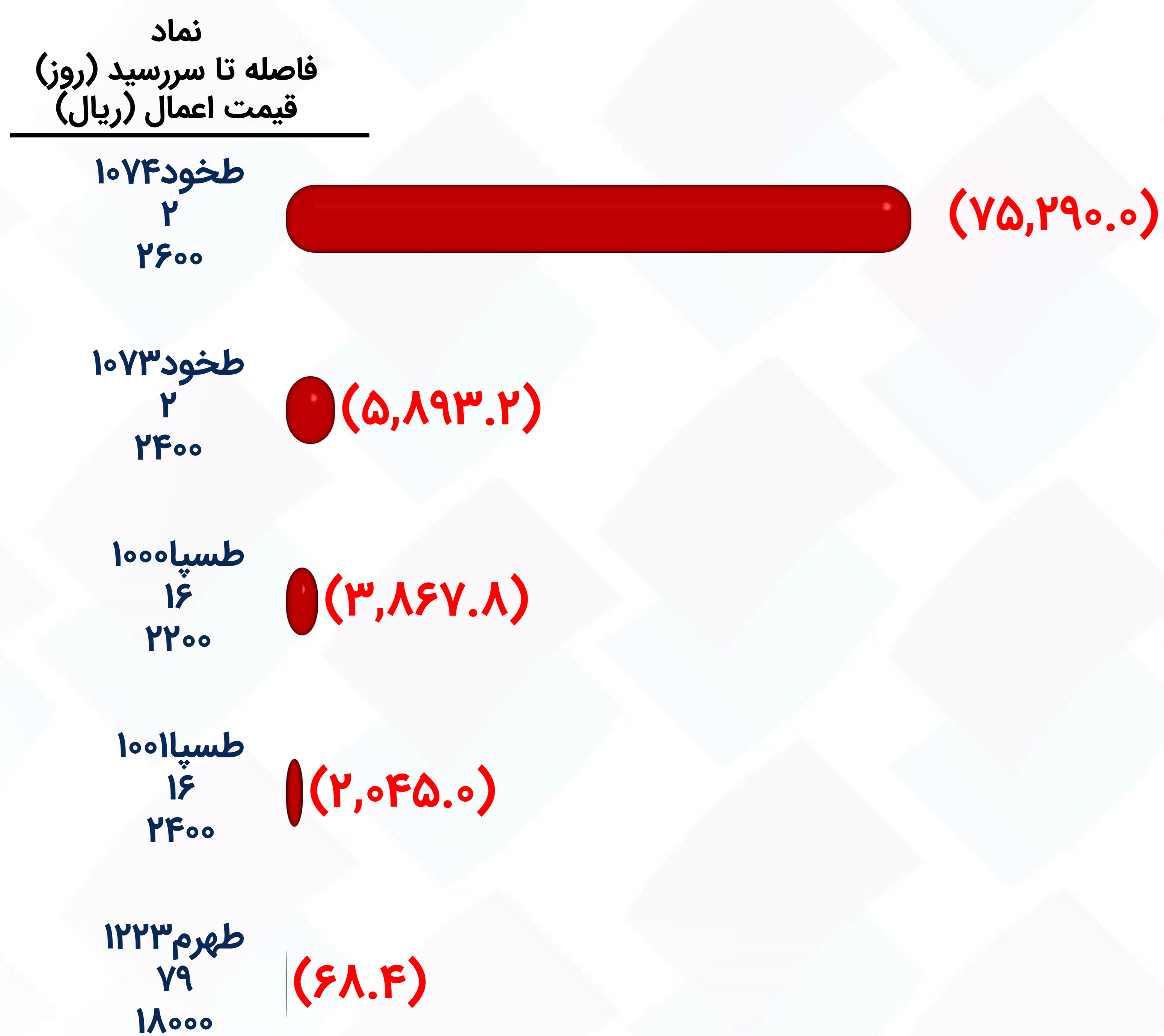


موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

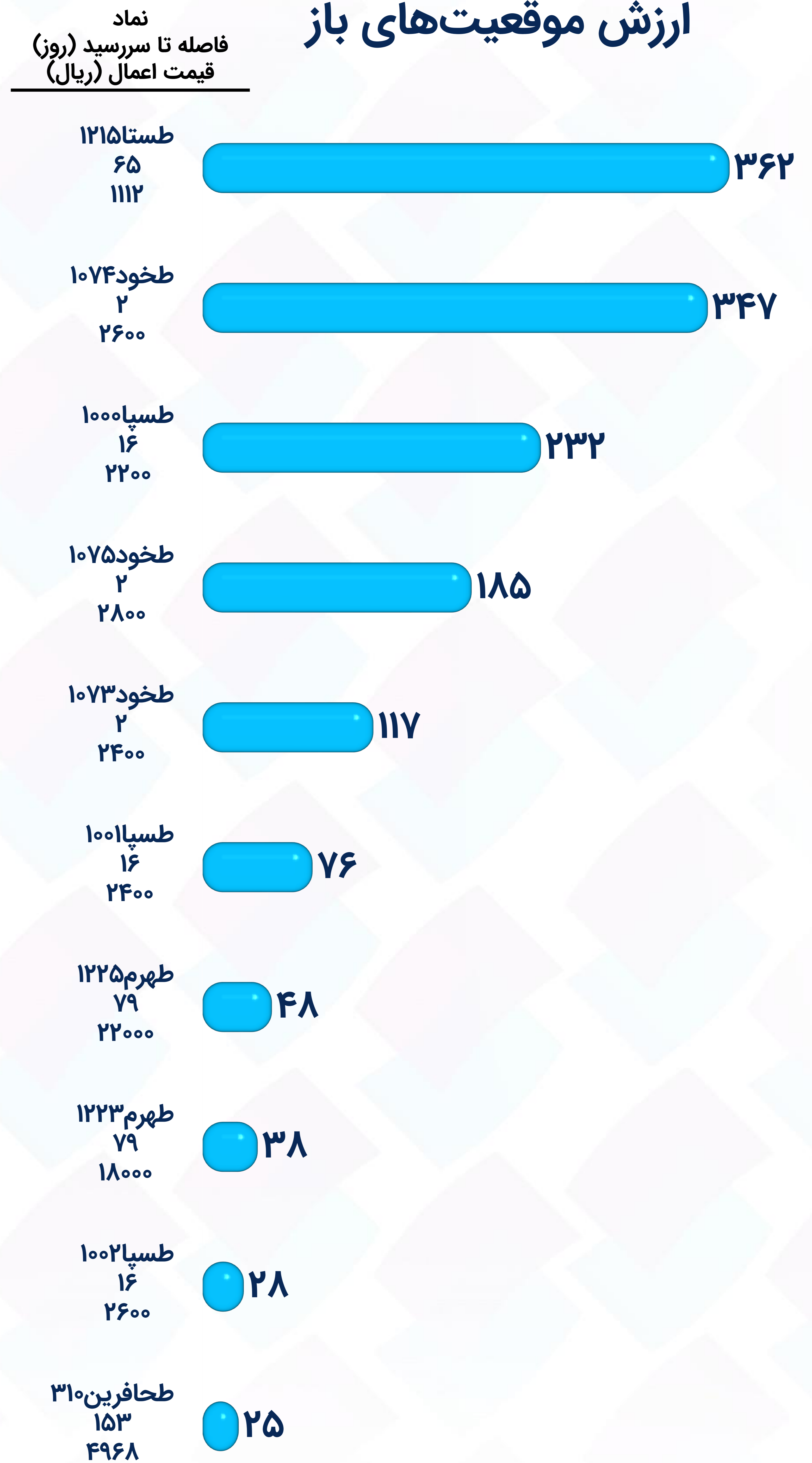
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

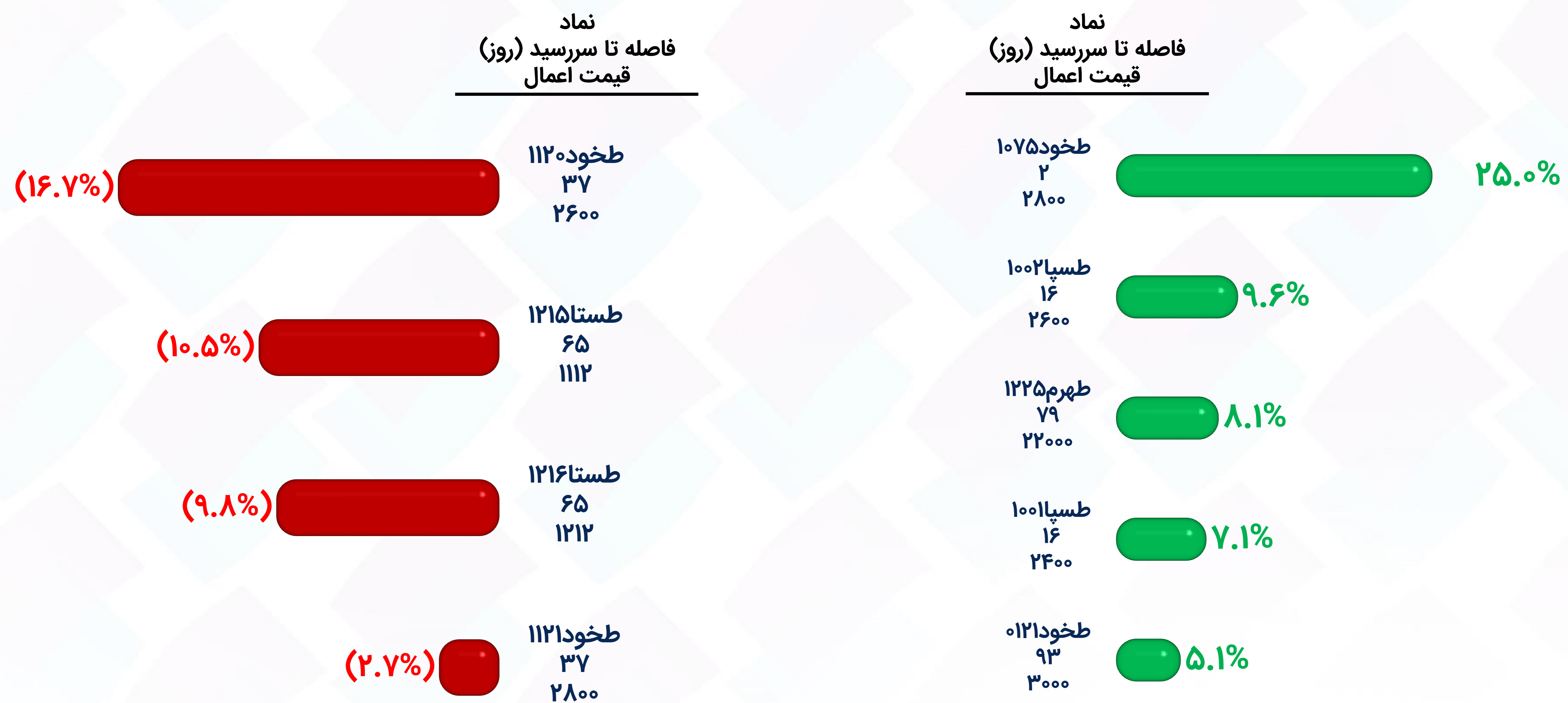


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

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.