

شماره

۱۵۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۵ 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 user information: محمد حسین نادعلی, 07:53:34, چهارشنبه 22 آذر, 2,161,266.62 / 0 (0%). The main area is divided into several sections:

- Top Left:** A table of "نمادهای هم گروه" (Related Symbols) with columns for "نماد", "تغییرات روزانه", "آخرین قیمت", "قیمت پایانی", "حجم معاملات", and "ارزش معاملات".
- Top Right:** A table of "موقعیت‌ها (اختیار)" (Positions) with columns for "نماد", "موقعیت", "آخرین قیمت", "وجه مسدودی", "دارایی مسدودی", "سودوزیان مانده", "سودوزیان تحقق یافته", and "روزها".
- Middle Left:** A section for "اختیارخ اهرم-26000" (Leveraged Option) with "فروش" (Sell) and "خرید" (Buy) buttons, and a table for "حجم معاملات" (Transaction Volume).
- Middle Right:** A section for "ضهرم 3009 - مجاز" (3009 Shares - Authorized) with "فروش" and "خرید" buttons.
- Bottom:** A "سفارشات" (Orders) section with a table for "سفارشات نماد (ضهرم 3009)" and "معاملات نماد (ضهرم 3009)".

Annotations with arrows point to specific elements:

- Home Icon:** دسترسی به سایر صفحه‌های سامانه از طریق نوار آبی سمت راست امکان‌پذیر است.
- Dropdown Menu:** دارایی‌های شخص شامل سهام، 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.
- Option Section:** 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.
- Orders Section:** در این بخش اطلاعاتی در مورد جزئیات سفارشات از جمله وضعیت سفارش، گردش معاملات، نوبت سفارش و غیره برای شما نمایش داده می‌شود.
- Portfolio Section:** ترکیب سهم‌های پرتفو را به صورت یک نمودار دایره‌ای نمایش می‌دهد.

Footer information: 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

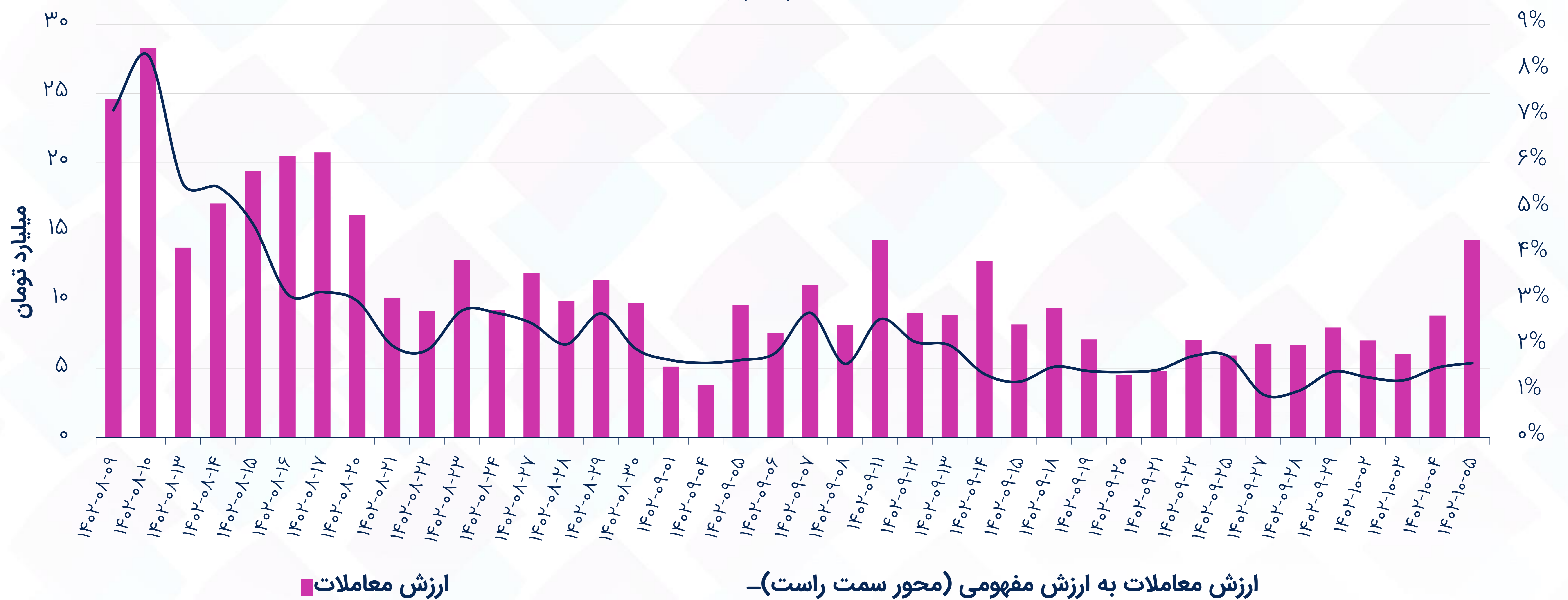
در قسمت‌های آموزشی بعدی با جزئیات بیشتری به آموزش نحوه انجام معاملات در سامانه صحرا خواهیم پرداخت.

ارزش معاملات

اختیار خرید



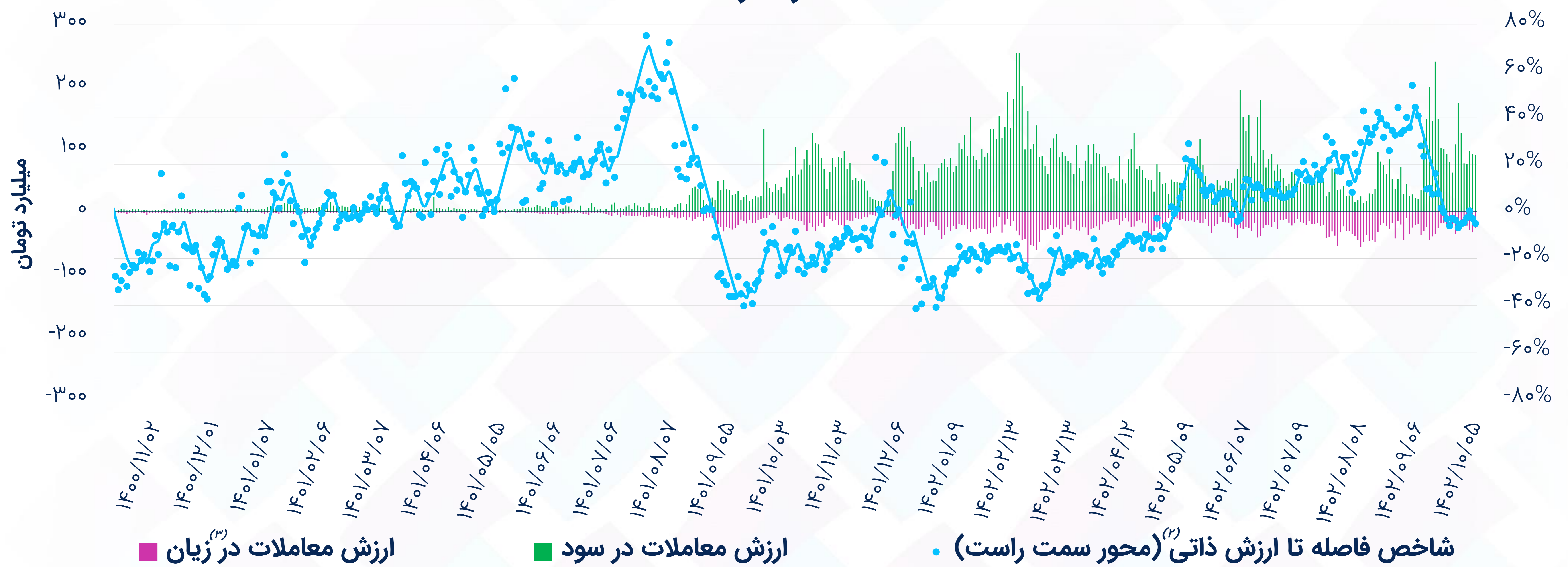
اختیار فروش



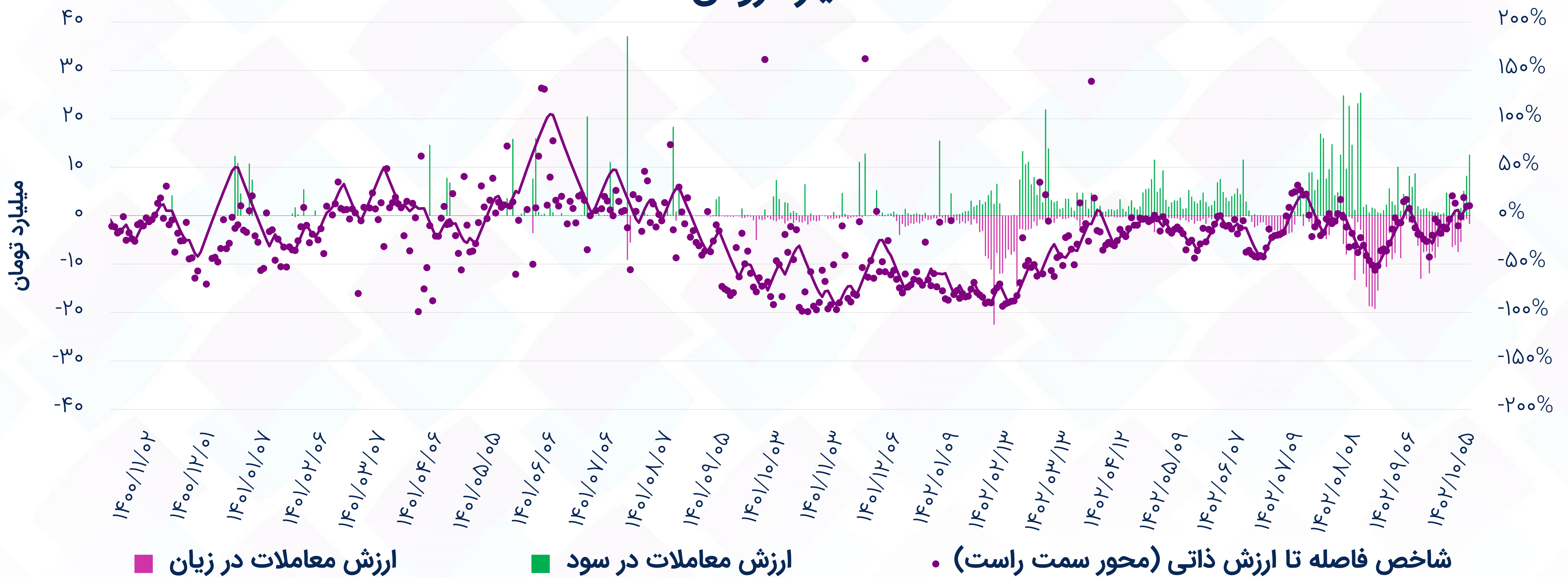
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

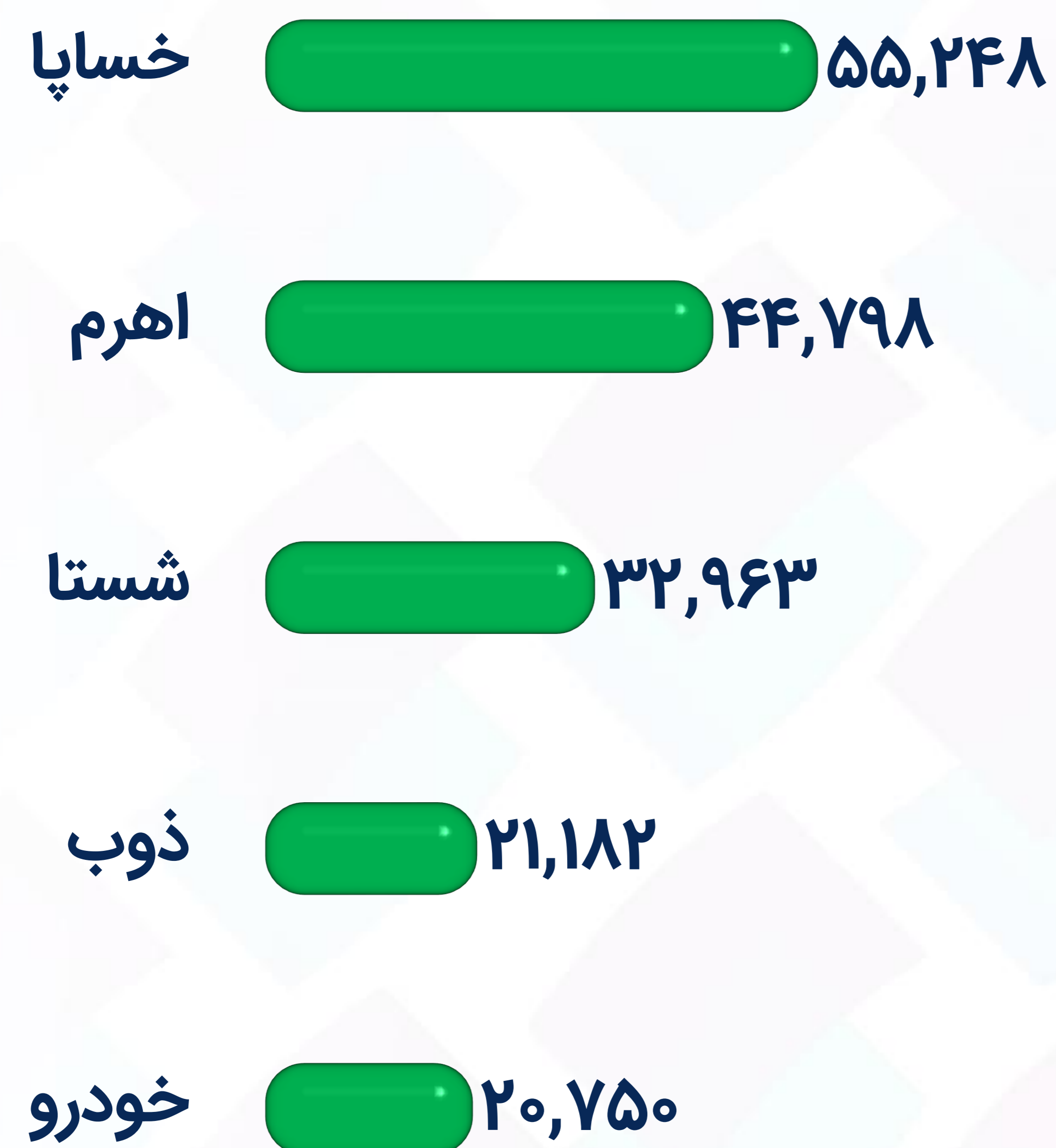
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
خودرو	۳۵	۴۲.۵	۱,۱۹۹.۴	۳۱.۳	۱۱.۲	(۲.۵%)
اهرم	۲۰	۲۵.۵	۱۱۵.۴	۲۲.۵	۳.۰	(۳.۸%)
حسابا	۲۱	۱۱.۷	۴۳۴.۰	۴.۲	۷.۵	(۵.۰%)
سرو	۱۰	۱۱.۰	۳۰.۸	۱۱.۰	۰.۰	۱.۸%
شستا	۱۸	۱۰.۴	۱۳۱.۱	۸.۳	۲.۱	(۱۵.۲%)
ذوب	۵	۶.۷	۳۹.۹	۶.۷	۰.۰	(۱۲.۵%)
خپارس	۹	۲.۴	۱۴.۲	۲.۲	۰.۲	(۳۱.۹%)

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	۱۲,۳۱۴.۶	۷۴۹,۶۷۴.۴	۱۱,۶۴۴.۴	۶۷۰.۲	۹.۹%
حسابا	۴	۱,۳۰۷.۴	۱۰۷,۲۸۴.۴	۶۵۲.۹	۶۵۴.۵	۳۱.۶%
شستا	۷	۳۸۷.۳	۲۰,۱۳۵.۶	۱.۶	۳۸۵.۷	(۵۲.۲%)
اهرم	۳	۳۲۴.۴	۵,۷۱۷.۴	۳۰۱.۱	۲۳.۲	۱۴.۳%
خپارس	۱	۰.۳	۴.۸	۰.۰	۰.۳	(۳۹.۹%)
توان	۱	۰.۱	۳.۷	۰.۰	۰.۱	۲۰.۴%

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

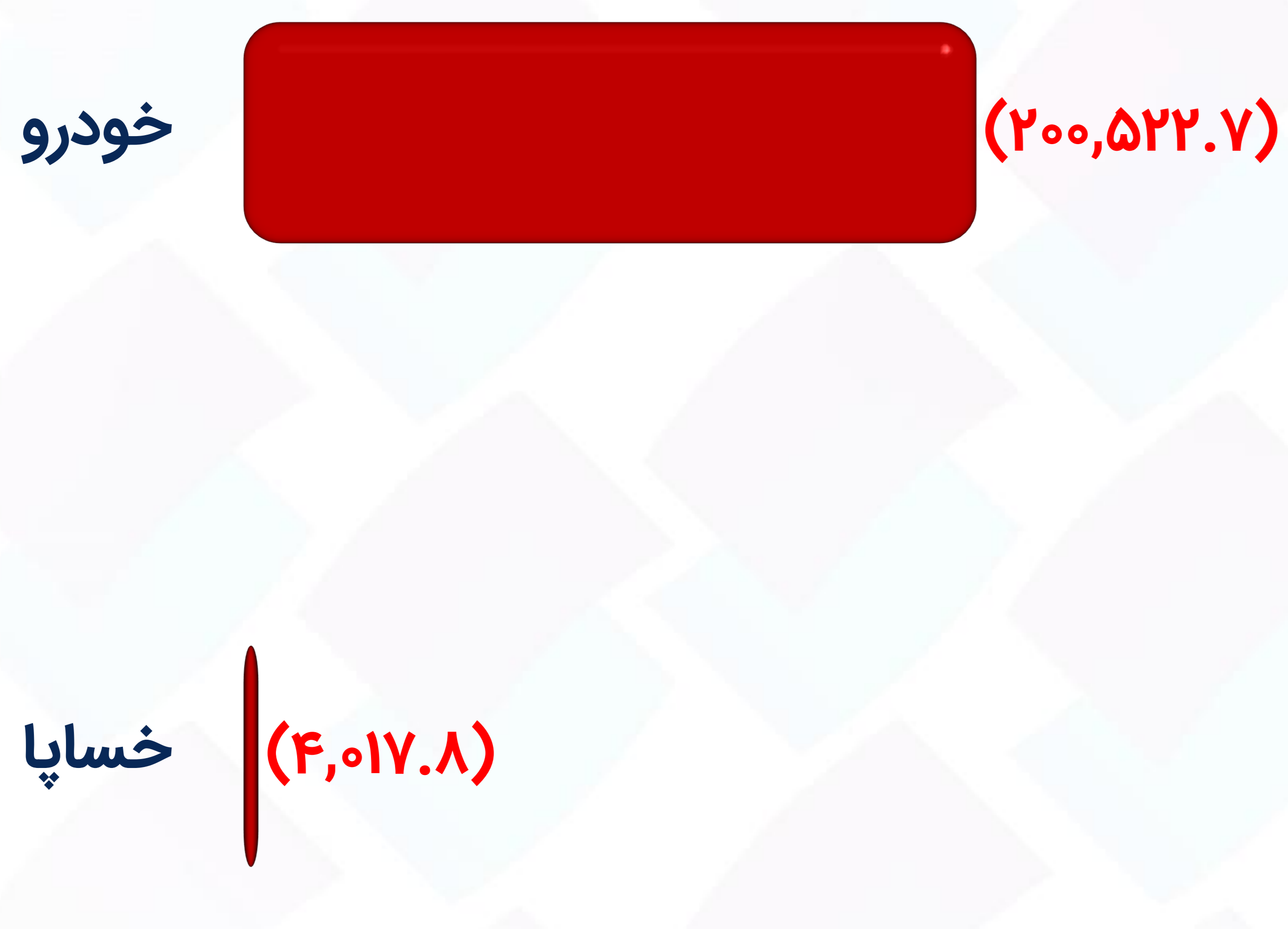
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

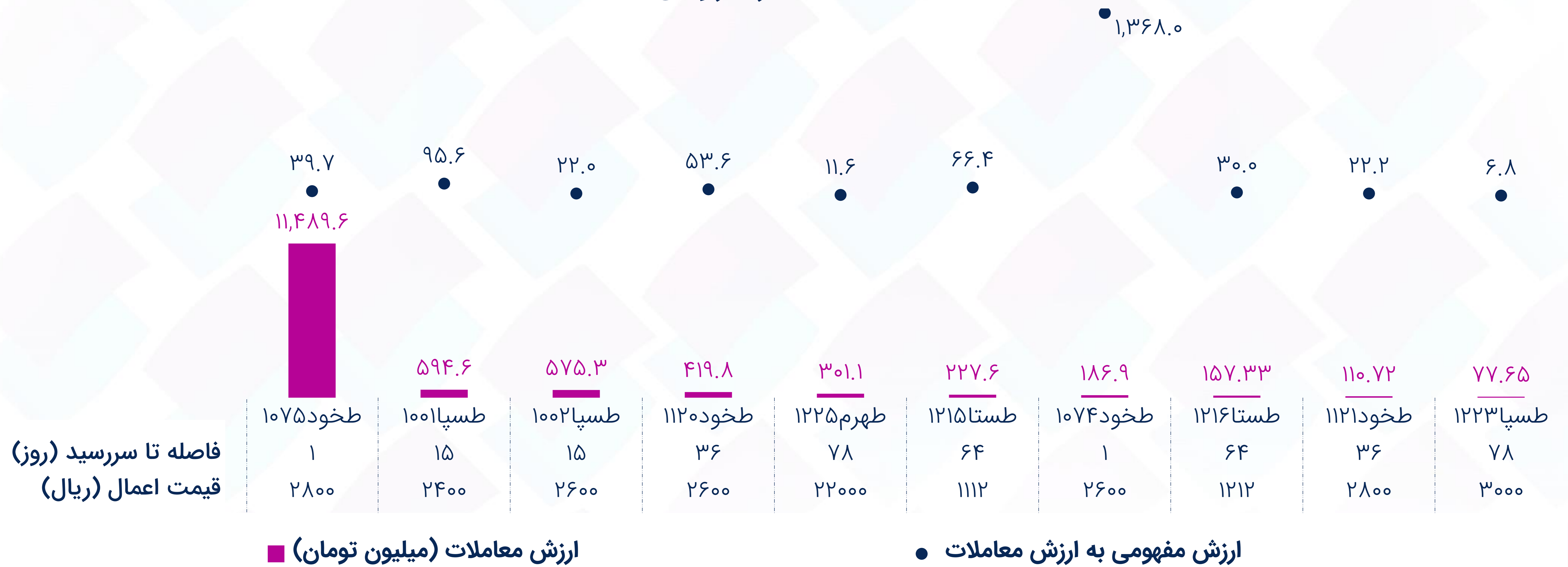


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
۴۴۱%	۱,۴۱۸	۰.۷۲	۲۳.۱	(۶.۹%)	۶,۰۶۲	۶,۵۱۰	۲۶۲	۶.۵	۴۳	۵,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۲
۱۳۲%	۲,۵۵۶	۰.۷۹	۵.۸	(۱.۷%)	۶,۴۰۰	۶,۵۱۰	۱,۱۰۰	۲.۲	۱۶۶	۵,۳۰۰	ضفصبا ۳۰۱
۱۲۸%	۲,۸۱۴	۰.۸۳	۴.۹	(۷.۳%)	۶,۰۳۵	۶,۵۱۰	۱,۲۳۵	۱۳۸.۷	۱۶۶	۴,۸۰۰	ضفصبا ۳۰۰
۸۸%	۲,۰۷۳	۰.۸۶	۵.۴	(۹.۳%)	۵,۹۰۲	۶,۵۱۰	۱,۱۰۲	۶۲.۷	۴۳	۴,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۰
۸۰%	۱۹۱	۰.۴۹	۲۹.۳	۱۳.۵%	۳,۱۰۶	۲,۷۳۶	۱۰۶	۳.۳	۹۲	۳,۰۰۰	ضخود ۰۱۲۱

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	۲۳۱.۸	۱۵۱%	۳,۰۱۳	۱,۲۰۱	۱۳	۱.۳	۷۵	۳,۰۰۰	ضخپارس ۱۲۱۳
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۶۹۳.۰	۵۲%	۳,۶۹۳	۲,۴۲۸	۱	۱.۰	۸	۳,۶۹۲	ضجار ۱۰۵۱
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۷۶.۰	۶۵%	۴,۵۱۲	۲,۷۳۶	۱۲	۱۰.۸	۳۶	۴,۵۰۰	ضخود ۱۱۲۷
(۹۷%)	۰	۰.۰۰	۸۱۳.۵	۳۱%	۳,۲۵۴	۲,۴۸۶	۴	۲۰.۲	۱۵	۳,۲۵۰	ضسپا ۱۰۰۵
(۹۵%)	۱	۰.۰۰	۴۱۰.۱	۶۵%	۴,۵۱۱	۲,۷۳۶	۱۱	۴.۲	۵۷	۴,۵۰۰	ضخود ۱۲۲۵

(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 ^(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
۱۲۴.۸%	۴۸۱	-۰.۱۶	۸۳.۱	(۱۵%)	۱۷,۷۸۶	۲۰,۹۰۰	۲۱۴	۲۲.۶	۷۸	۱۸,۰۰۰	طهرم ۱۲۲۳
۴۷.۲%	۳۸	-۰.۲۷	۹۱.۳	(۵%)	۲,۳۷۴	۲,۴۸۶	۲۶	۵۹۴.۶	۱۵	۲,۴۰۰	طسپا ۱۰۰۱
۳۰.۶%	۵	-۰.۰۵	۵۴۹.۰	(۱۲%)	۲,۱۹۶	۲,۴۸۶	۴	۵۹.۹	۱۵	۲,۲۰۰	طسپا ۱۰۰۰
۱۸.۱%	۱۳۳	-۰.۶۳	۲۲.۰	۰%	۲,۴۸۷	۲,۴۸۶	۱۱۳	۵۷۵.۳	۱۵	۲,۶۰۰	طسپا ۱۰۰۲
۱۵.۲%	۵۹	-۰.۲۵	۵۰.۰	(۷%)	۲,۵۴۹	۲,۷۳۶	۵۱	۴۱۹.۸	۳۶	۲,۶۰۰	طخود ۱۱۲۰

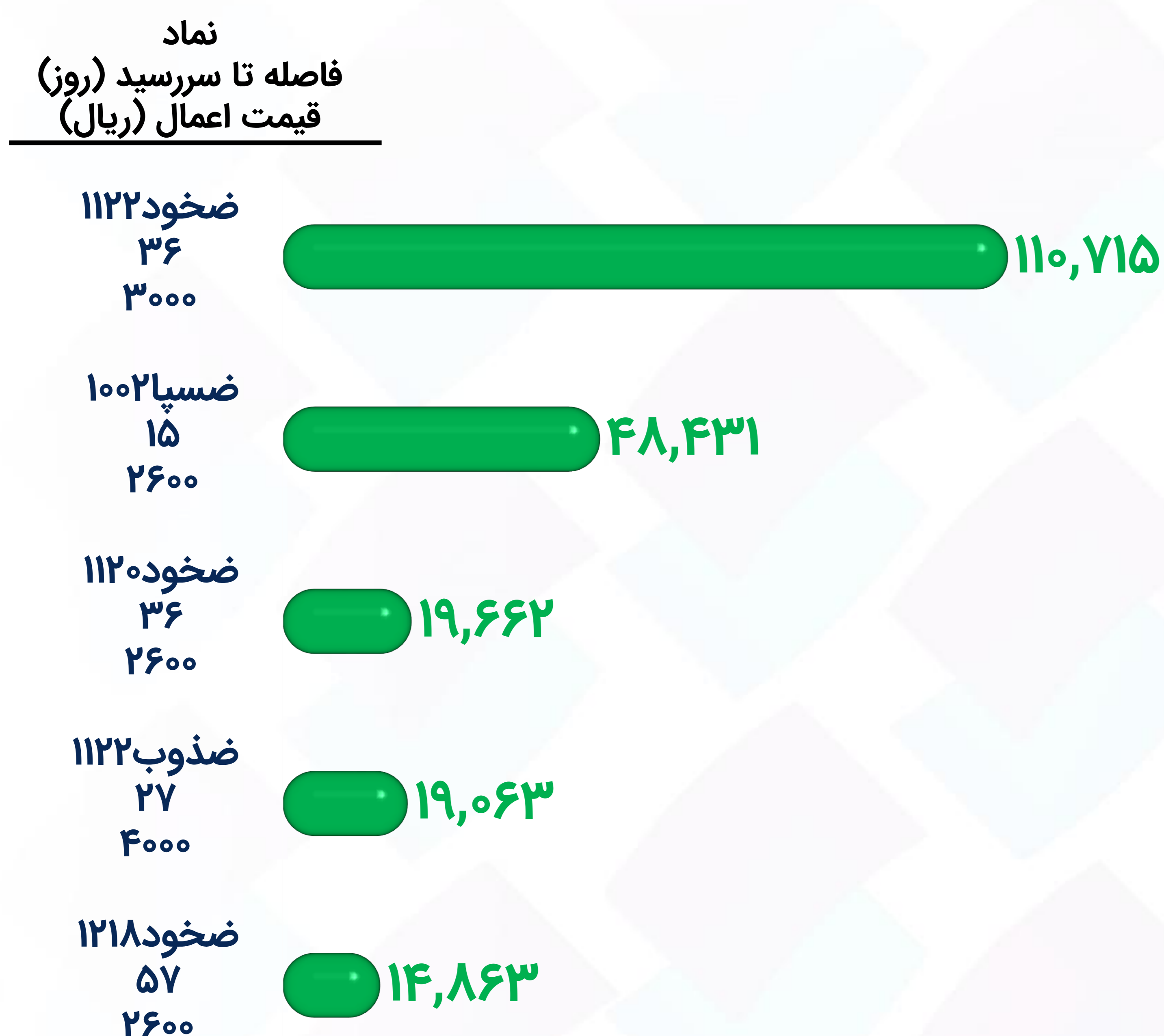
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

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
(۶۱.۰%)	۷	-۰.۰۹	۵۷.۵	(۱۳%)	۱,۰۹۳	۱,۲۶۲	۱۹	۲۲۷.۶	۶۴	۱,۱۱۲	طستا ۱۲۱۵
(۵۰.۱%)	۳۰	-۰.۱۲	۳۹.۰	(۱۴%)	۲,۳۴۰	۲,۷۳۶	۶۰	۵۹.۸	۵۷	۲,۴۰۰	طخود ۱۲۱۷
(۳۹.۶%)	۲۵	-۰.۲۳	۲۷.۹	(۷%)	۱,۱۷۰	۱,۲۶۲	۴۲	۱۵۷.۳	۶۴	۱,۲۱۲	طستا ۱۲۱۶
(۲۴.۶%)	۲۷۹	-۰.۹۱	۳.۴	(۲%)	۱,۲۴۲	۱,۲۶۲	۳۷۰	۱.۲	۶۴	۱,۶۱۲	طستا ۱۲۲۰
(۴.۴%)	۲۵۸	-۰.۵۱	۱۰.۱	(۰%)	۲,۷۳۰	۲,۷۳۶	۲۷۰	۷.۵	۹۲	۳,۰۰۰	طخود ۰۱۲۱

(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

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



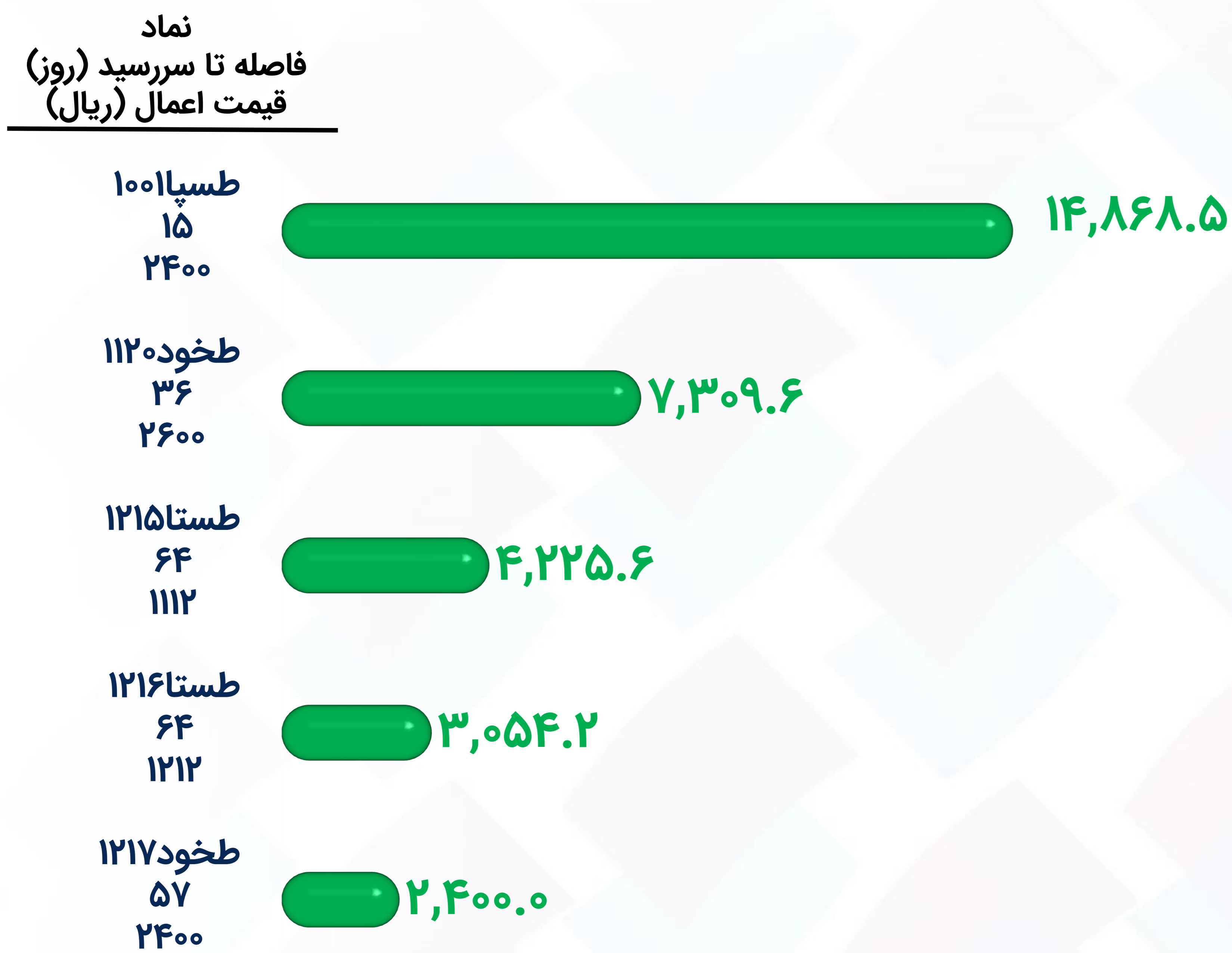
میلیون تومان

میلیون تومان

میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

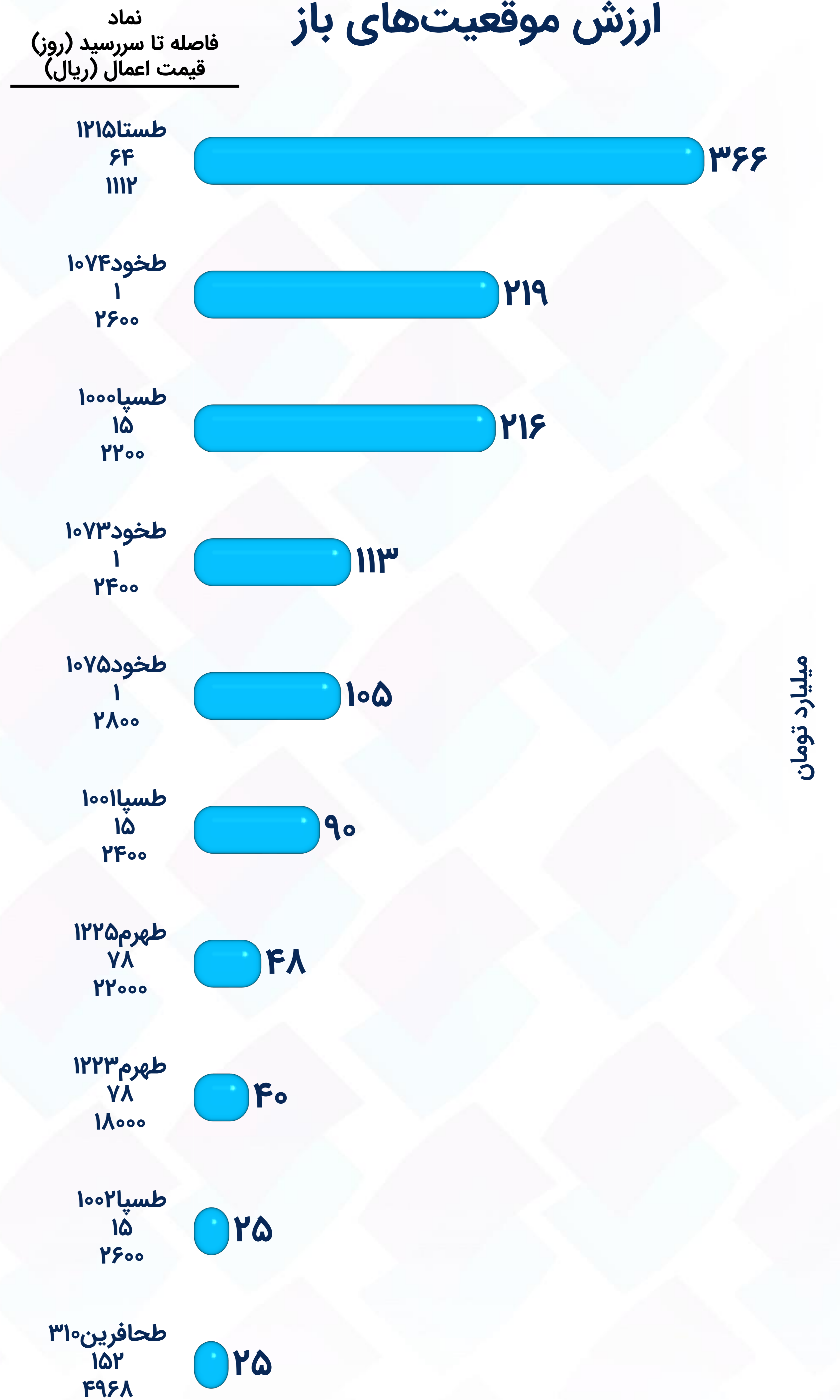
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

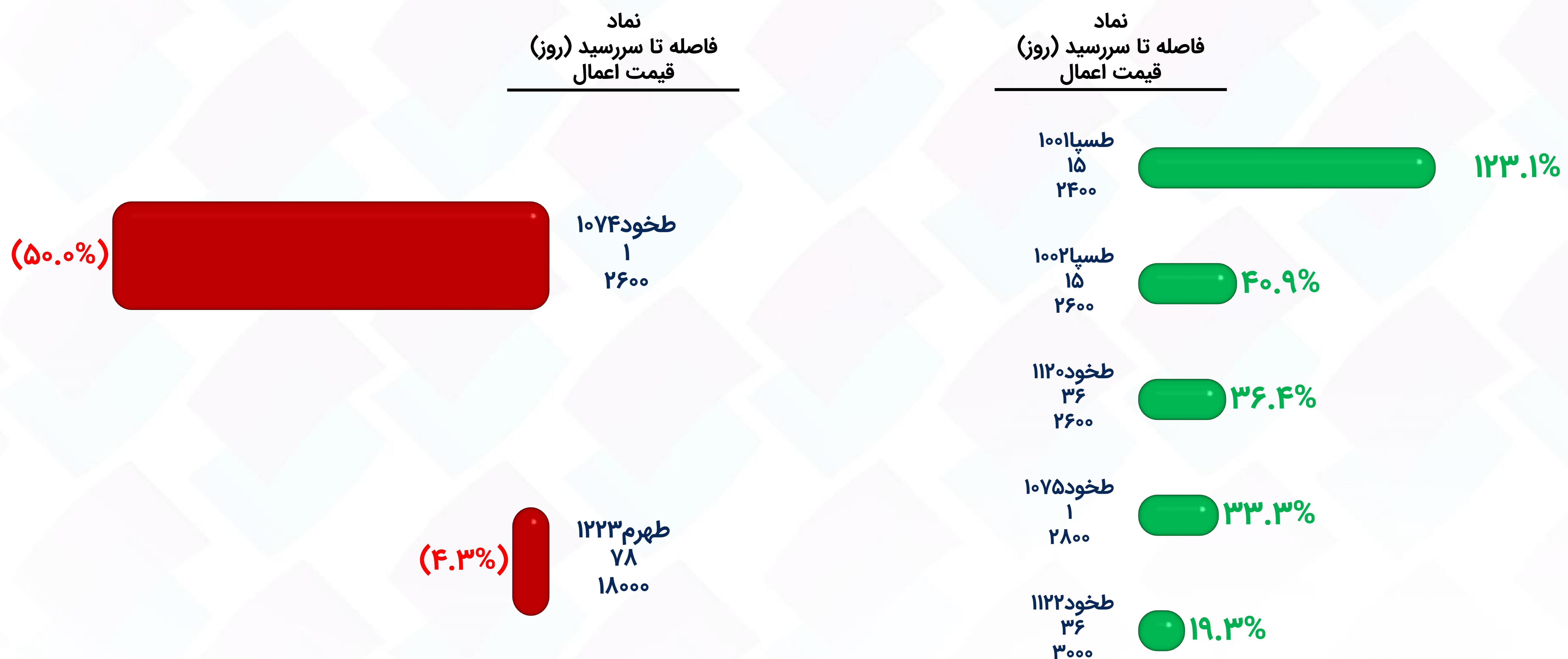


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



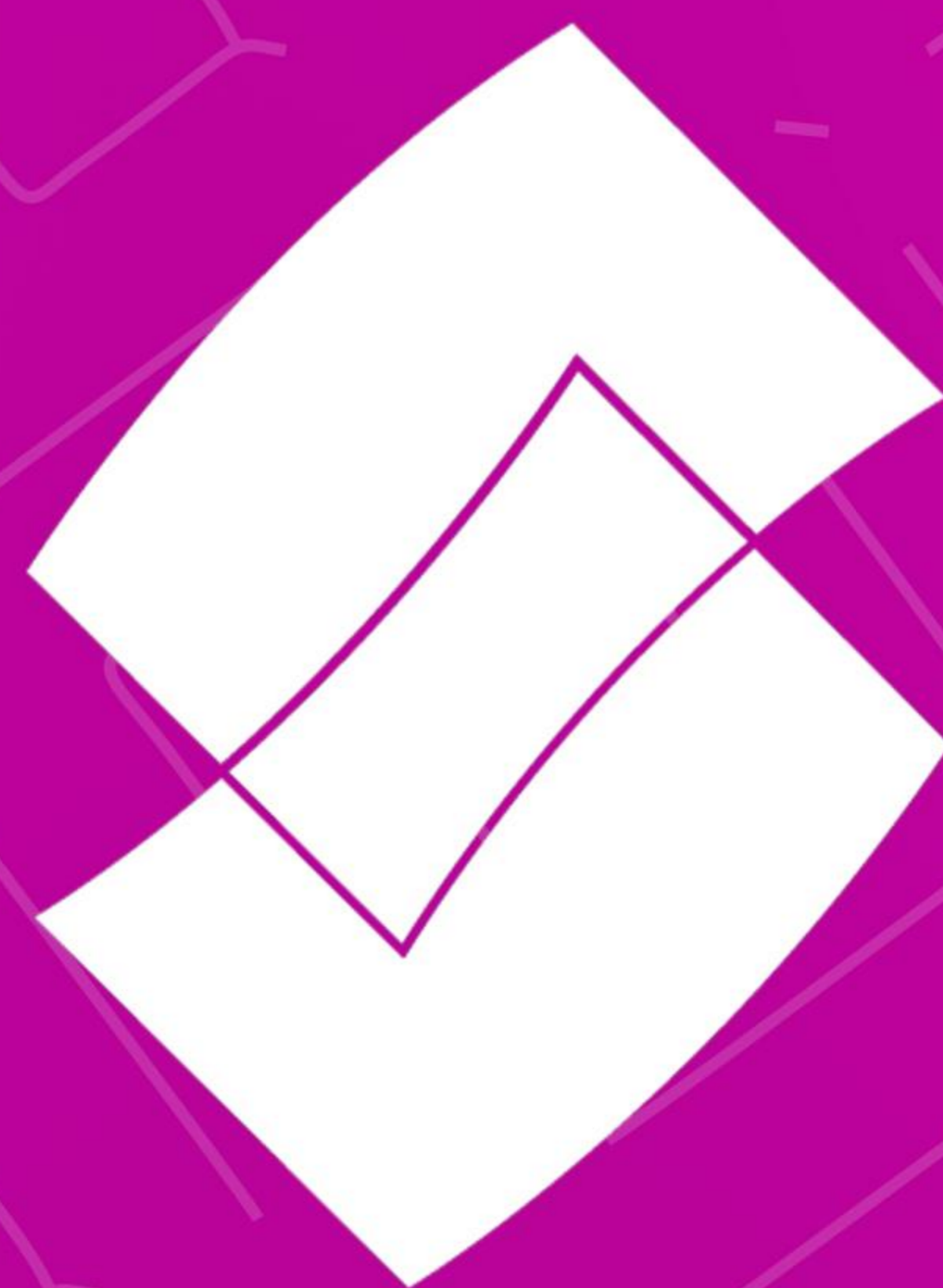
اختیار فروش



(۱) تنها 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.