

شماره

۱۵۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۶ 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, and account balance 2,161,266.62 / 0 (0%). The main area is divided into several sections:

- Left Panel:** A table of securities 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 securities like 1232, 1231, and 3010.
- Right Panel:** A table of '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.
- Order Entry Section:** A section for entering orders with buttons for 'فروش' (Sell) and 'خرید' (Buy). It shows an order for 26000 shares of 3009.
- Bottom Panel:** A section for 'سفارشات' (Orders) with columns for 'ردیف' (Row), 'نوع' (Type), 'نماد' (Symbol), 'حجم' (Volume), 'حجم‌شده' (Fulfilled), 'قیمت' (Price), 'آخرین معامله' (Last Trade), 'زمان' (Time), and 'اعتبار' (Validity). It shows a list of orders.

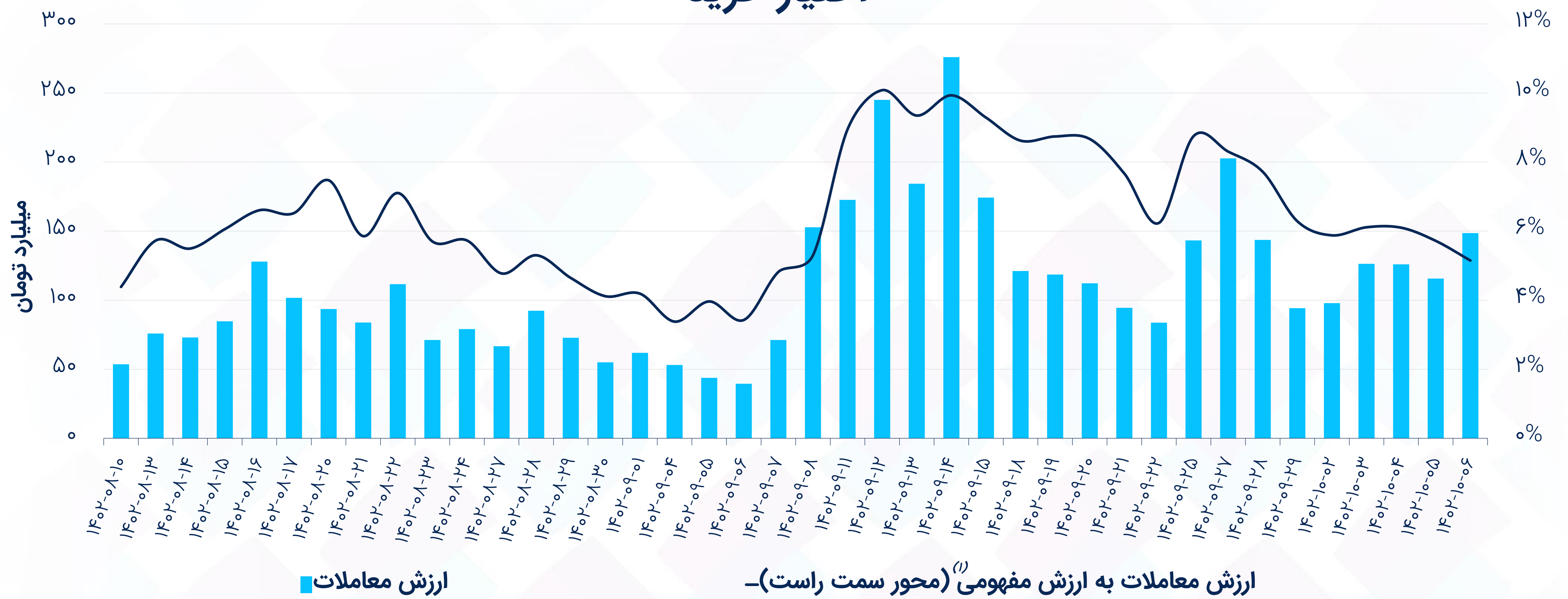
Callouts provide instructions:

- Callout 1: '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.'
- Callout 2: 'دراستی‌های 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.'
- Callout 3: 'دسترسی به سایر صفحه‌های سامانه از طریق نوار آبی سمت راست صفحه امکان‌پذیر است.'
- Callout 4: 'این بخش مربوط به سفارش‌گذاری بوده و با جستجو نماد معاملاتی و دریافت اطلاعات مرتبط با نماد، می‌توانید اقدام به خرید یا فروش درستی 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 5: 'در این بخش اطلاعاتی در مورد جزئیات سفارشات از جمله وضعیت سفارش، گردش معاملات، نوبت سفارش و غیره برای شما نمایش داده می‌شود.'
- Callout 6: 'ترکیب سهم‌های پرتفو را به صورت یک نمودار دایره‌ای نمایش می‌دهد.'

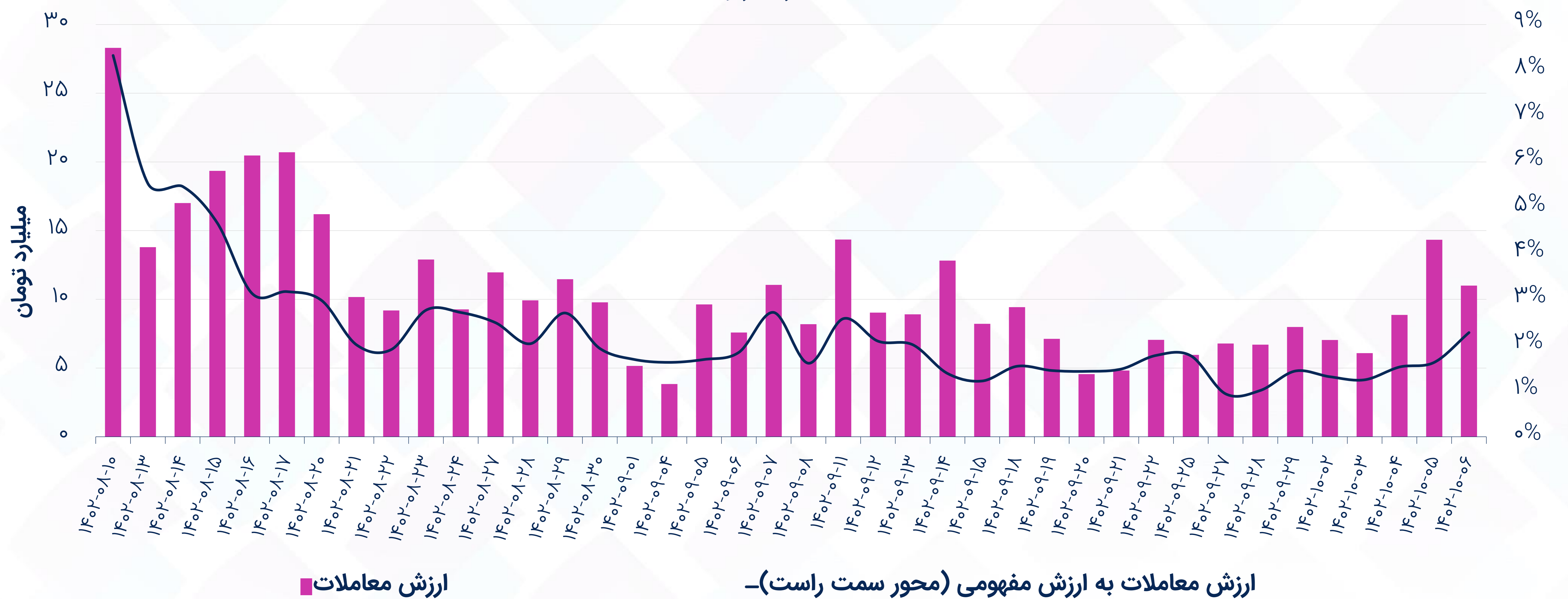
در قسمت‌های آموزشی بعدی با جزئیات بیشتری به آموزش نحوه انجام معاملات در سامانه صحرا خواهیم پرداخت.

ارزش معاملات

اختیار خرید



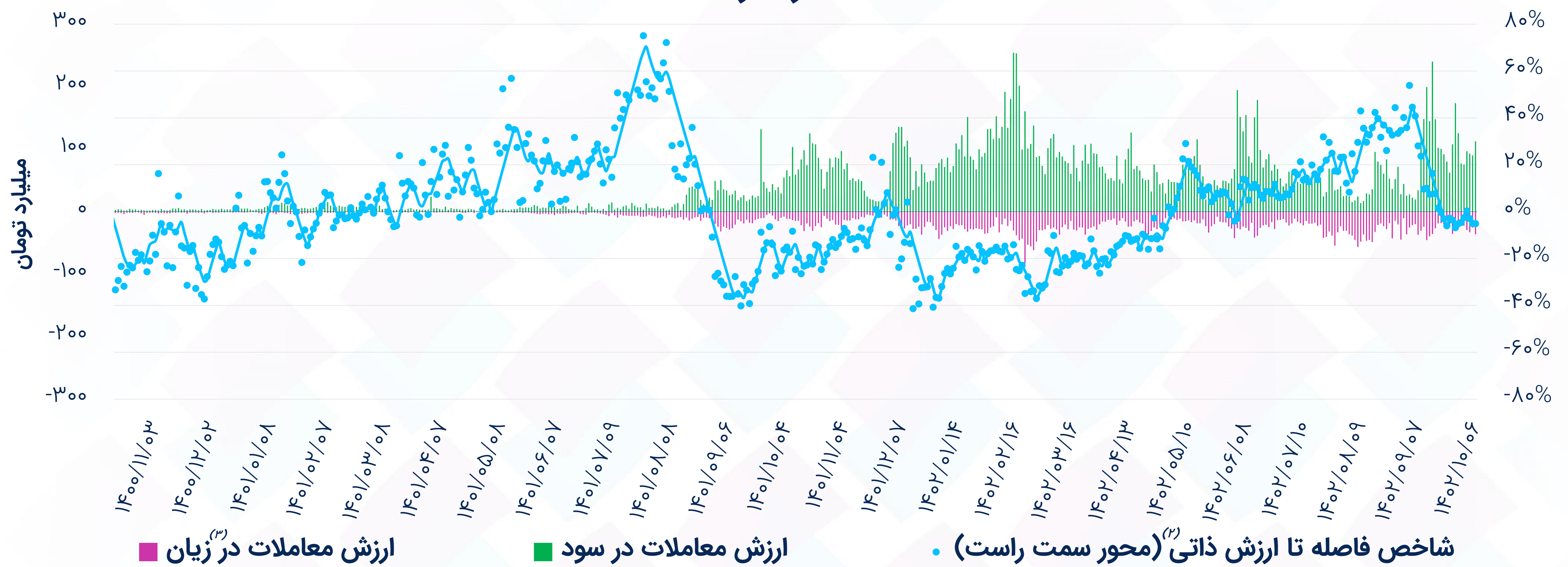
اختیار فروش



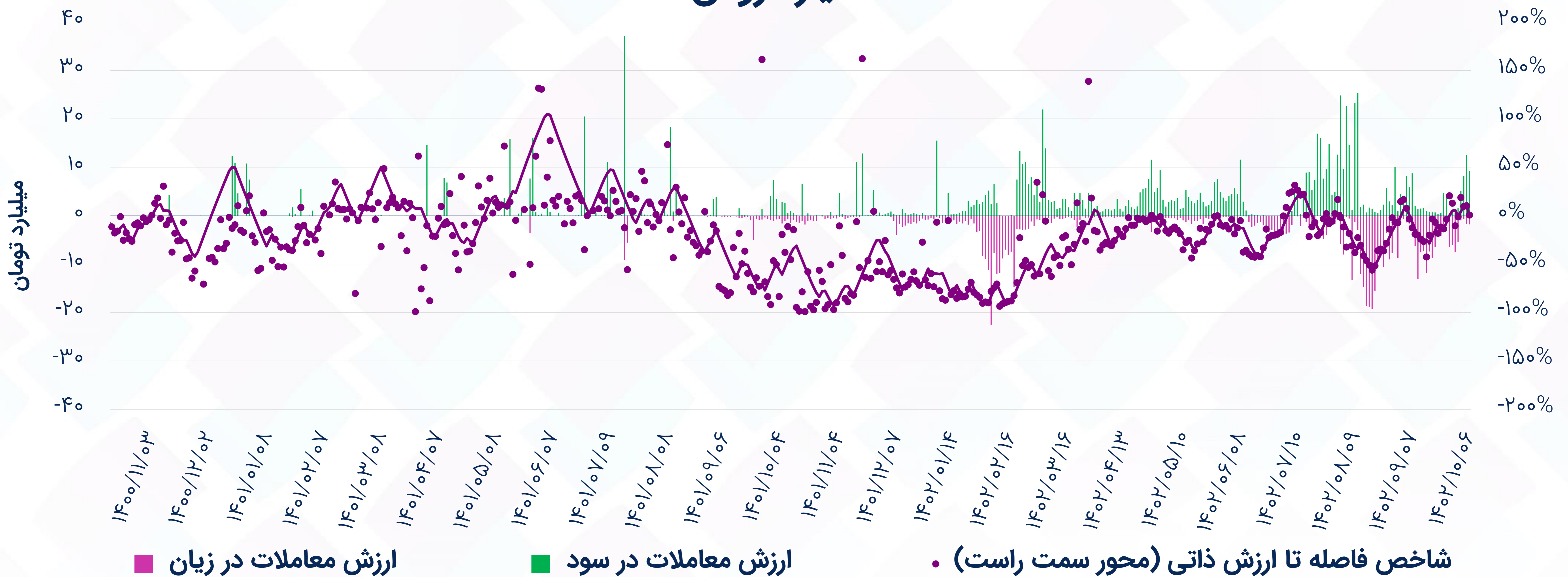
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۳	۷۸.۷	۲,۰۷۶.۵	۵۸.۶	۲۰.۱	(۳.۹%)
اهرم	۱۹	۳۲.۴	۱۲۸.۸	۲۹.۹	۲.۴	(۵.۲%)
خسایا	۲۰	۱۳.۵	۴۵۸.۷	۵.۸	۷.۷	۱.۹%
شستا	۲۰	۷.۸	۱۰۳.۷	۵.۹	۱.۹	(۱۶.۰%)
سرو	۱۱	۳.۲	۱۵.۰	۳.۲	۰.۰	۴.۵%
توان	۴	۳.۰	۲۲.۴	۲.۸	۰.۱	(۴.۴%)
ذوب	۴	۲.۴	۱۵.۰	۲.۴	۰.۰	(۱۱.۷%)

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	۸,۵۱۲.۰	۳۶۴,۴۵۷.۳	۷,۶۸۷.۹	۸۲۴.۱	(۲.۷%)
اهرم	۳	۱,۳۷۷.۳	۲۸,۶۸۰.۹	۱,۱۱۰.۱	۲۶۷.۲	۱۷.۱%
خسایا	۵	۸۶۲.۲	۷۳,۴۳۳.۰	۳۸۸.۲	۴۷۴.۰	۲۳.۹%
شستا	۳	۲۴۸.۱	۱۶,۸۸۴.۳	۰.۰	۲۴۸.۰	(۵۶.۹%)
حافرین	۲	۲.۸	۴.۴	۲.۸	۰.۰	۲۰.۶%
فملی	۱	۰.۶	۱۵.۰	۰.۶	۰.۰	(۳۴.۸%)
خیارس	۱	۰.۱	۲.۵	۰.۱	۰.۰	(۲۳.۲%)

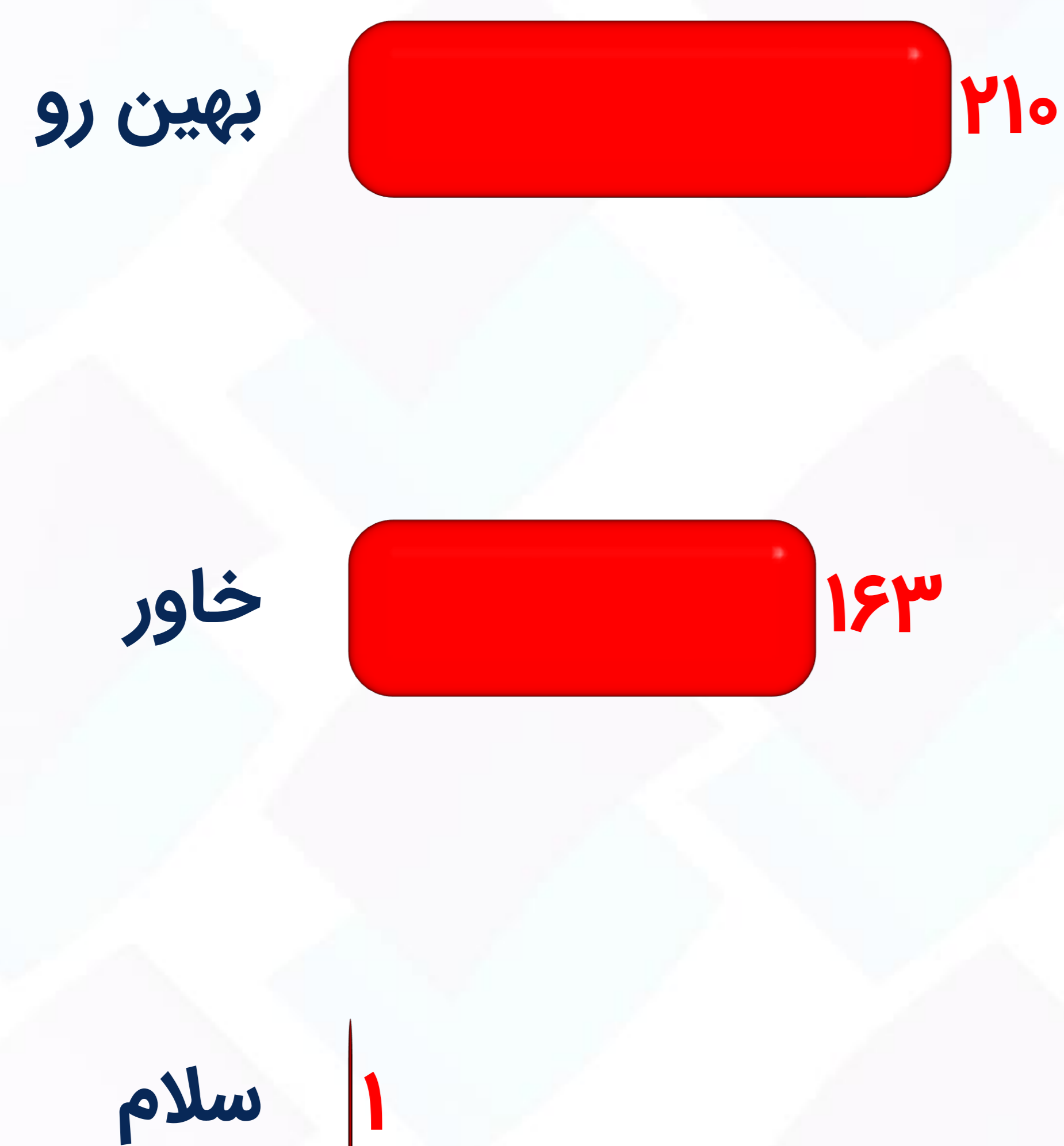
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد 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



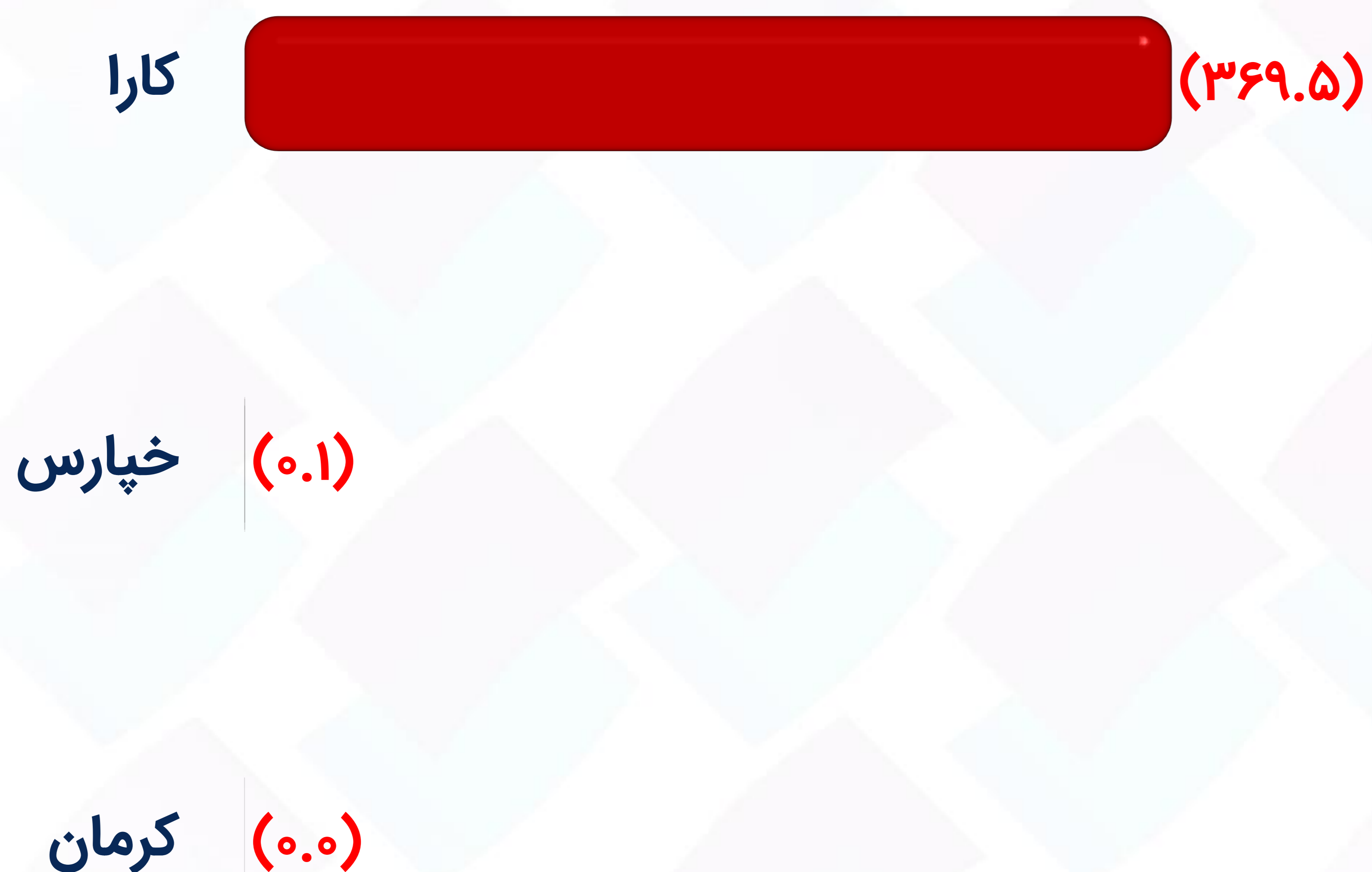
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

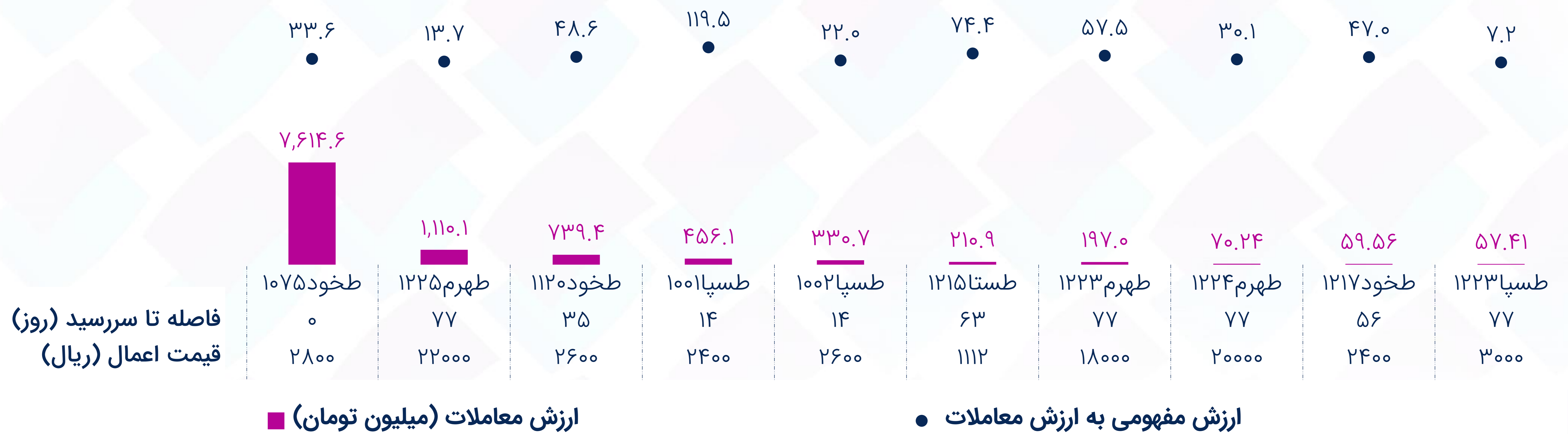


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش 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
۵۳۳%	۷۰	۰.۲۳	۴۵۵.۵	۱۴.۹%	۵,۰۱۱	۴,۳۶۲	۱۱	۱.۱	۴۷	۵,۰۰۰	شتران
۴۴۳%	۱,۳۷۳	۰.۷۲	۲۳.۹	(۶.۷%)	۶,۰۵۳	۶,۴۹۰	۲۵۳	۳.۵	۴۲	۵,۸۰۰	فصبا
۱۳۲%	۱,۱۵۹	۰.۳۵	۵۳.۰	۲۵.۶%	۲۶,۵۰۰	۲۱,۱۰۰	۵۰۰	۹۷.۵	۱۰۵	۲۶,۰۰۰	اهرم
۱۰۵%	۲,۷۷۰	۰.۸۳	۴.۶	(۵.۲%)	۶,۱۵۰	۶,۴۹۰	۱,۳۵۰	۴۴.۳	۱۶۵	۴,۸۰۰	فصبا
۸۸%	۲,۰۳۴	۰.۸۷	۵.۴	(۹.۴%)	۵,۸۸۱	۶,۴۹۰	۱,۰۸۱	۲۷.۸	۴۲	۴,۸۰۰	فصبا

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
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۳۱.۸	۱۵۲%	۳,۰۱۳	۱,۱۹۴	۱۳	۱.۳	۷۴	۳,۰۰۰	خپارس
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۲۸۲.۳	۶۶%	۴,۵۱۶	۲,۷۲۴	۱۶	۲.۶	۵۶	۴,۵۰۰	خودرو
(۹۷%)	۰	۰.۰۰	۱,۰۸۴.۳	۳۰%	۳,۲۵۳	۲,۵۰۹	۳	۸.۹	۱۴	۳,۲۵۰	خسپا
(۹۶%)	۰	۰.۰۰	۴۰۱.۰	۴۷%	۴,۰۱۰	۲,۷۲۴	۱۰	۶.۶	۳۵	۴,۰۰۰	خودرو
(۹۴%)	۳	۰.۰۲	۹۸.۶	۶۱%	۴,۰۴۱	۲,۵۰۹	۴۱	۵.۴	۷۷	۴,۰۰۰	خسپا

(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	۱۴	۴۵۶.۱	۲۱	۲,۵۰۹	۲,۳۷۹	(۵%)	۱۱۳.۳	-۰.۲۴	۳۰	۴۲.۲%
طهرم ۱۲۲۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷۷	۷۰.۲	۷۰۰	۲۱,۱۰۰	۱۹,۳۰۰	(۹%)	۲۷.۶	-۰.۲۸	۹۵۸	۳۶.۸%
طحافرین ۳۱۰	حافرین	۴,۹۶۸	۱۵۱	۱.۳	۱,۶۰۰	۲,۴۶۸	۳,۳۶۸	۳۶%	۲.۱	-۰.۹۸	۱,۹۹۴	۲۴.۶%
طحافرین ۳۰۹	حافرین	۴,۷۶۸	۱۵۱	۱.۶	۱,۵۵۰	۲,۴۶۸	۳,۲۱۸	۳۰%	۲.۱	-۰.۹۷	۱,۸۱۶	۱۷.۲%
طهرم ۱۲۲۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷۷	۱,۱۱۰.۱	۱,۵۳۷	۲۱,۱۰۰	۲۰,۴۶۳	(۳%)	۱۳.۳	-۰.۴۲	۱,۷۸۵	۱۶.۱%

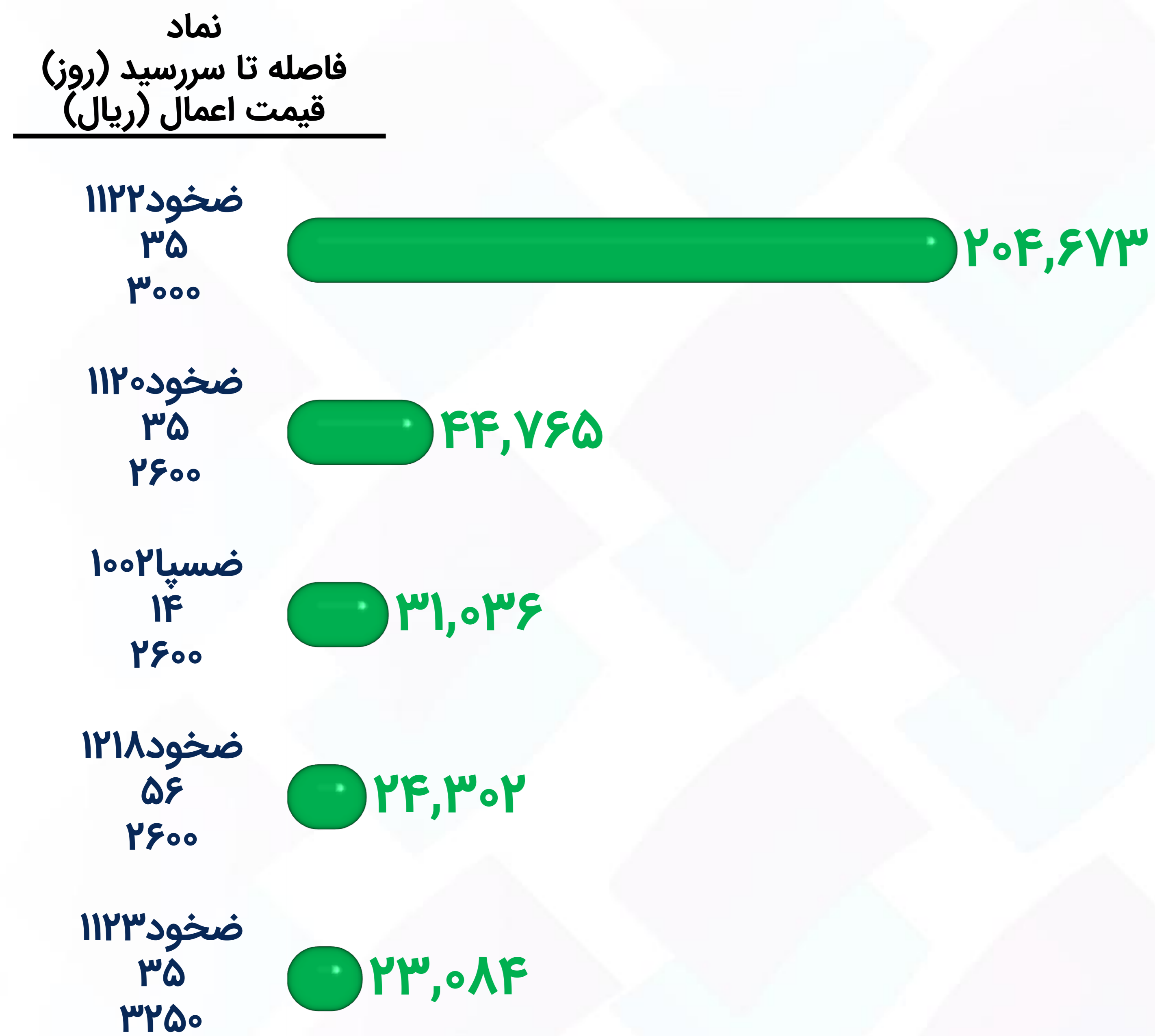
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱,۱۱۲	۶۳	۲۱۰.۹	۱۷	۱,۲۶۴	۱,۰۹۵	(۱۳%)	۶۴.۴	-۰.۰۸	۷	(۶۰.۲%)
طخود ۱۲۱۷	خودرو	۲,۴۰۰	۵۶	۵۹.۶	۵۸	۲,۷۲۴	۲,۳۴۲	(۱۴%)	۴۰.۴	-۰.۱۳	۳۰	(۴۸.۲%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱,۲۱۲	۶۳	۳۷.۲	۳۹	۱,۲۶۴	۱,۱۷۳	(۷%)	۳۰.۱	-۰.۲۳	۲۴	(۳۸.۲%)
طسپا ۱۰۰۰	خسپا	۲,۲۰۰	۱۴	۱۷.۹	۴	۲,۵۰۹	۲,۱۹۶	(۱۲%)	۵۴۹.۰	-۰.۰۴	۳	(۱۷.۶%)
طخود ۰۱۲۱	خودرو	۳,۰۰۰	۹۱	۳.۱	۲۸۰	۲,۷۲۴	۲,۷۲۰	(۰%)	۹.۷	-۰.۵۲	۲۶۳	(۶.۱%)

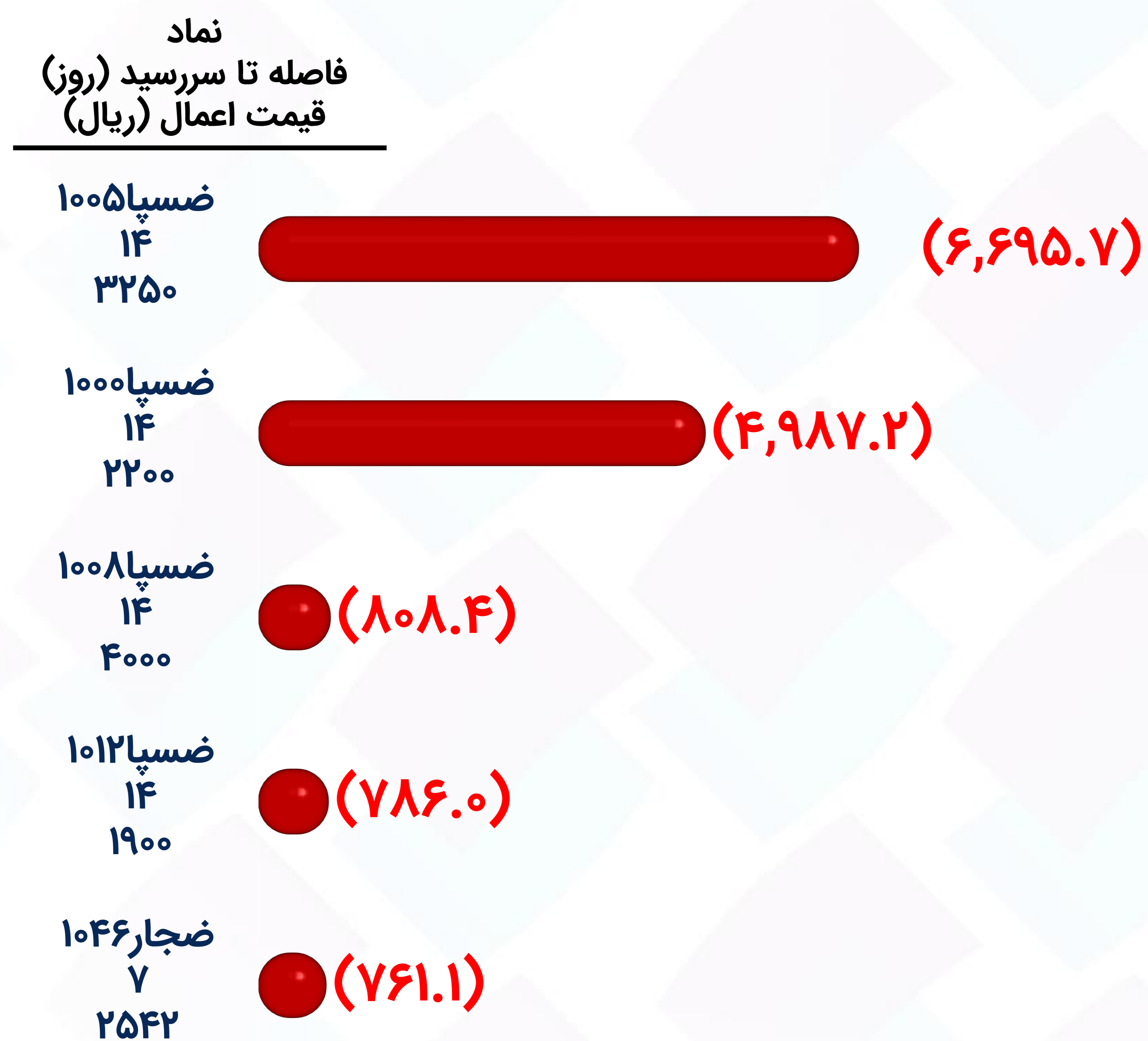
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



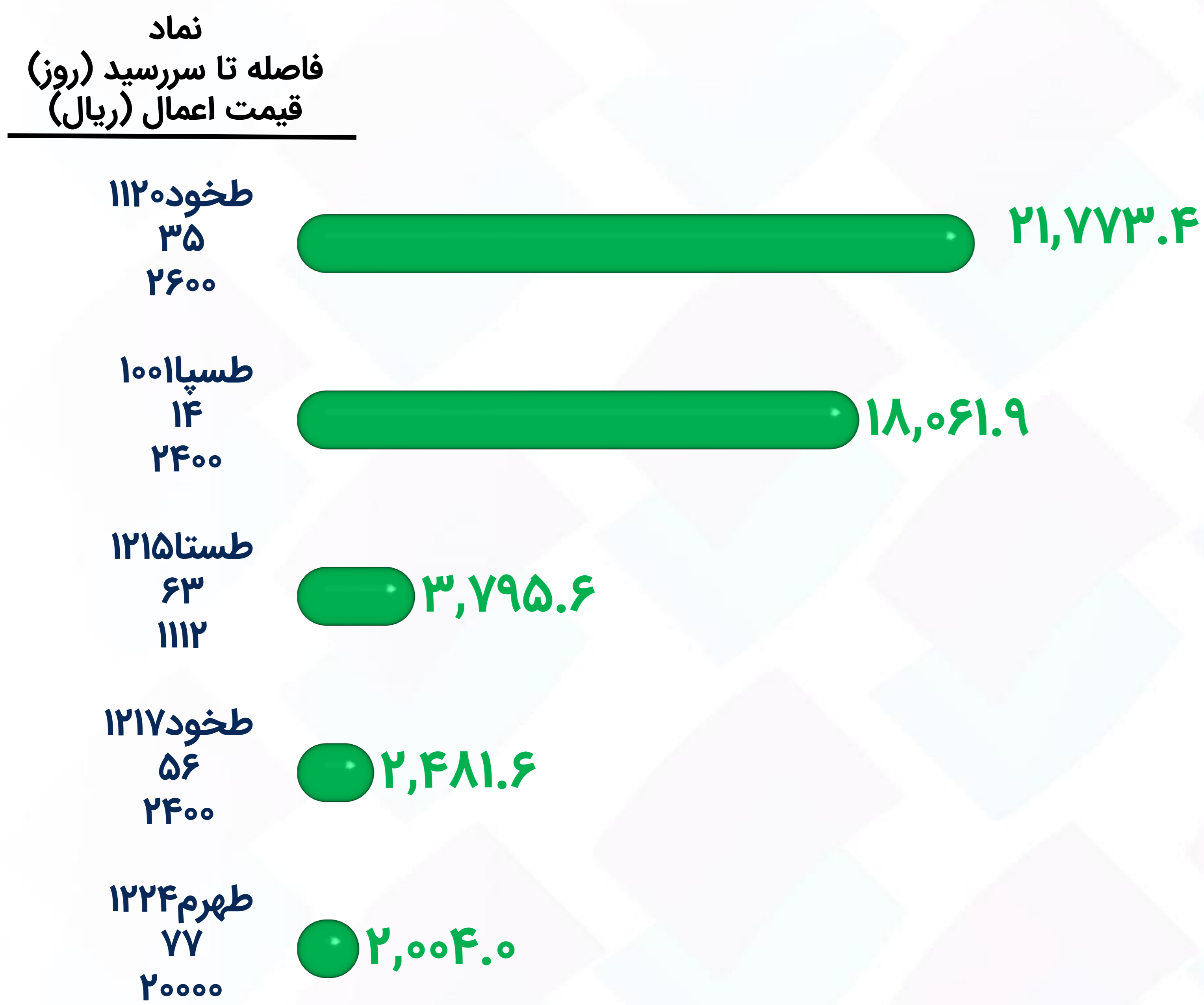
میلیون تومان

میلیون تومان

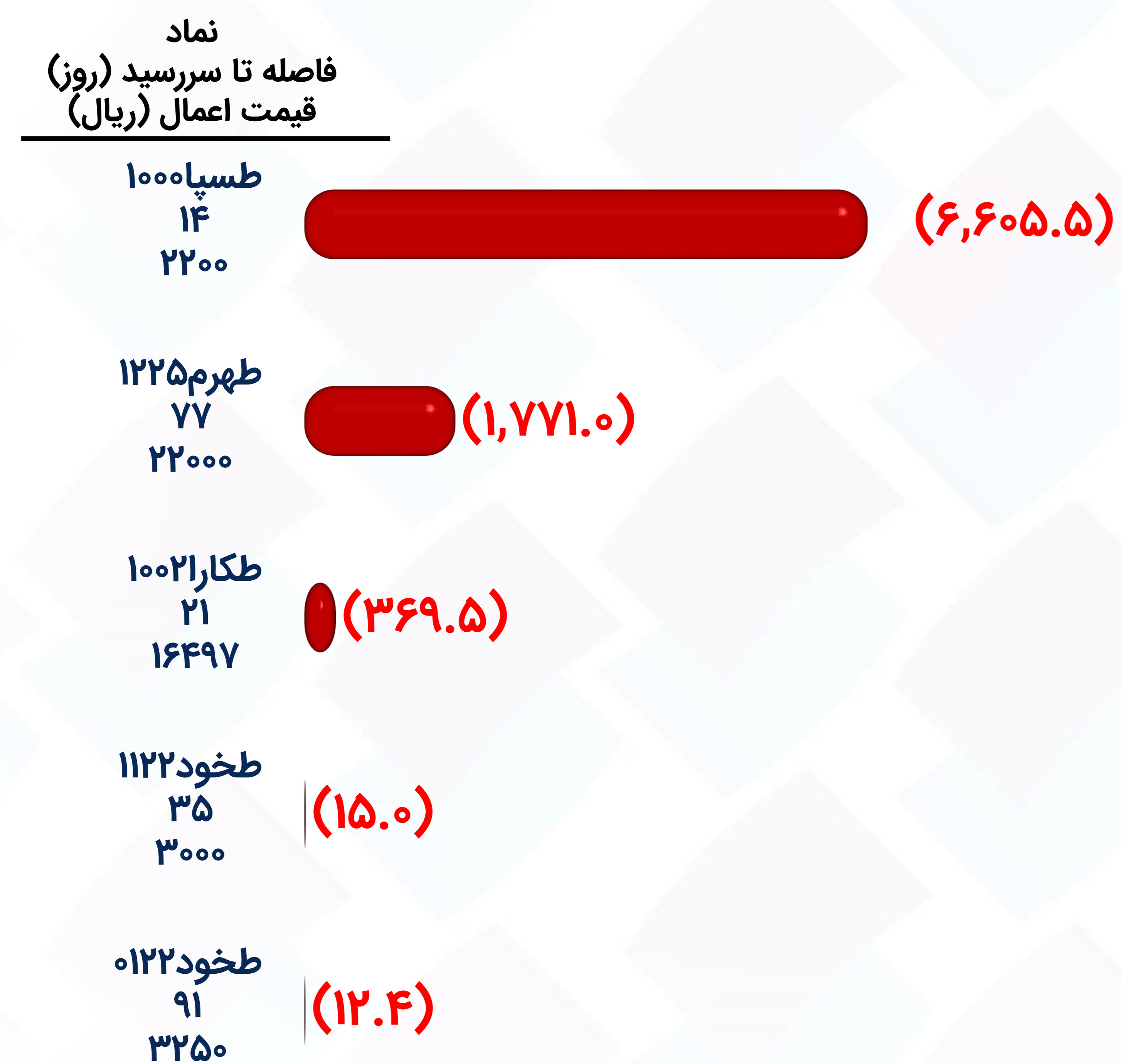
میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

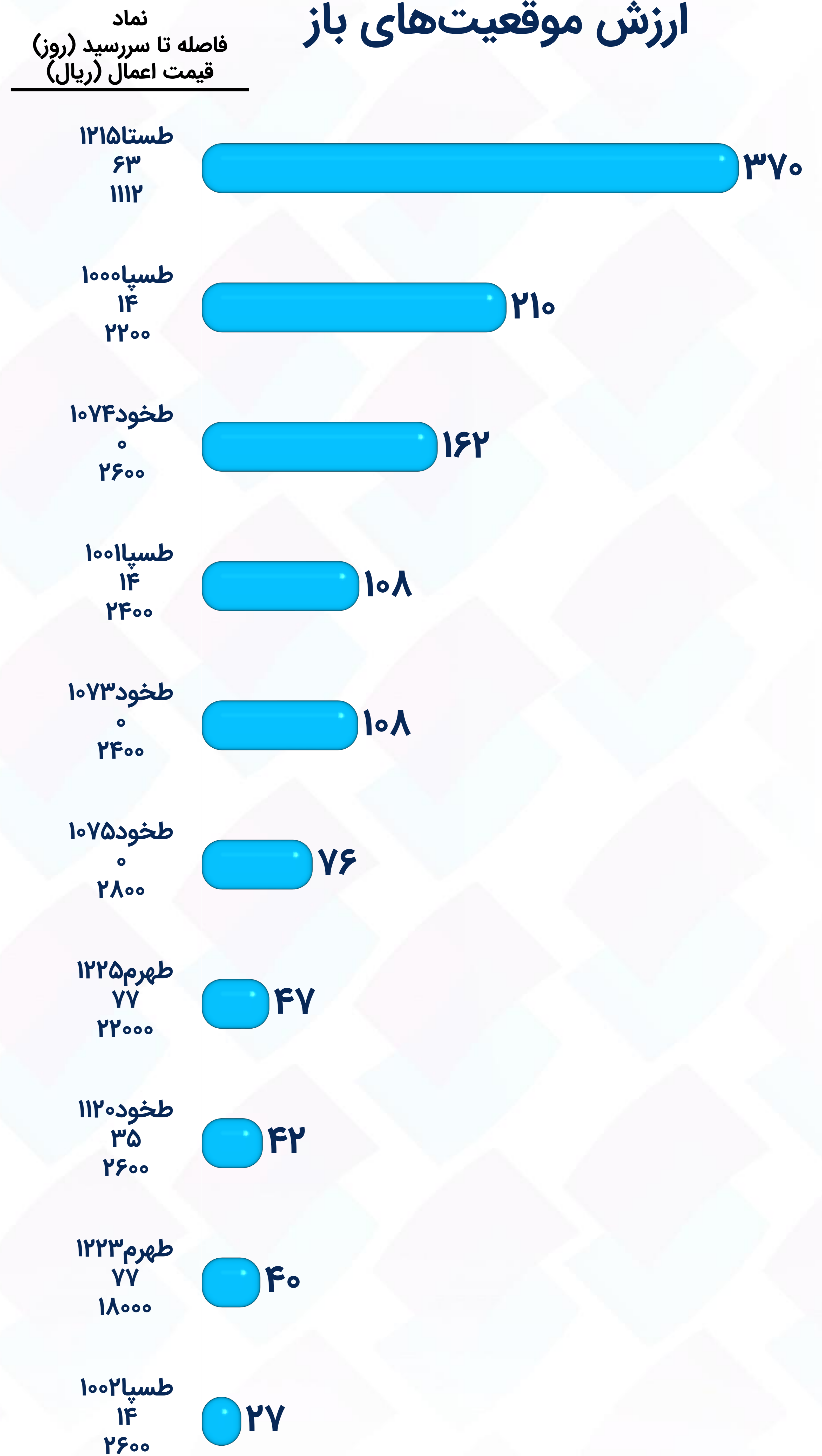
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



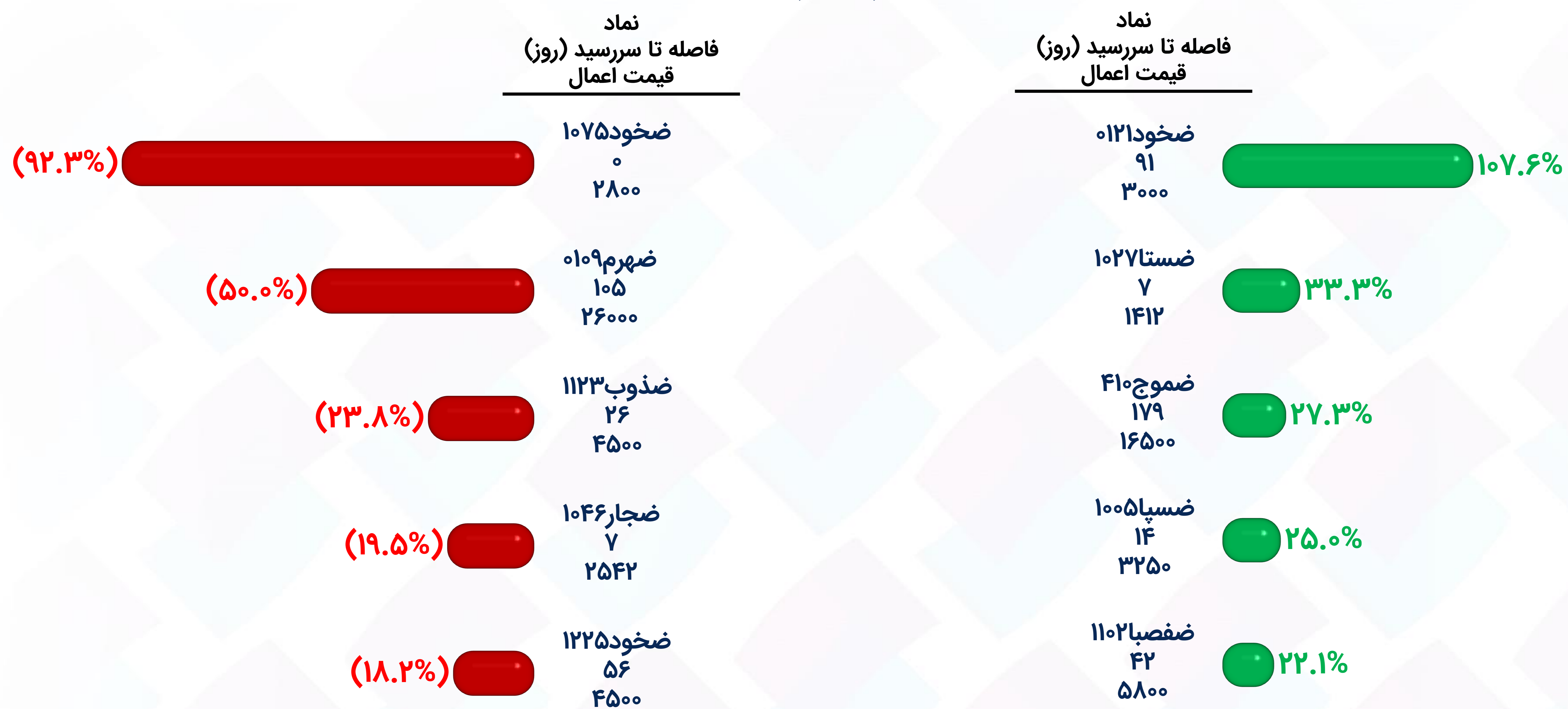
میلیون تومان

میلیون تومان

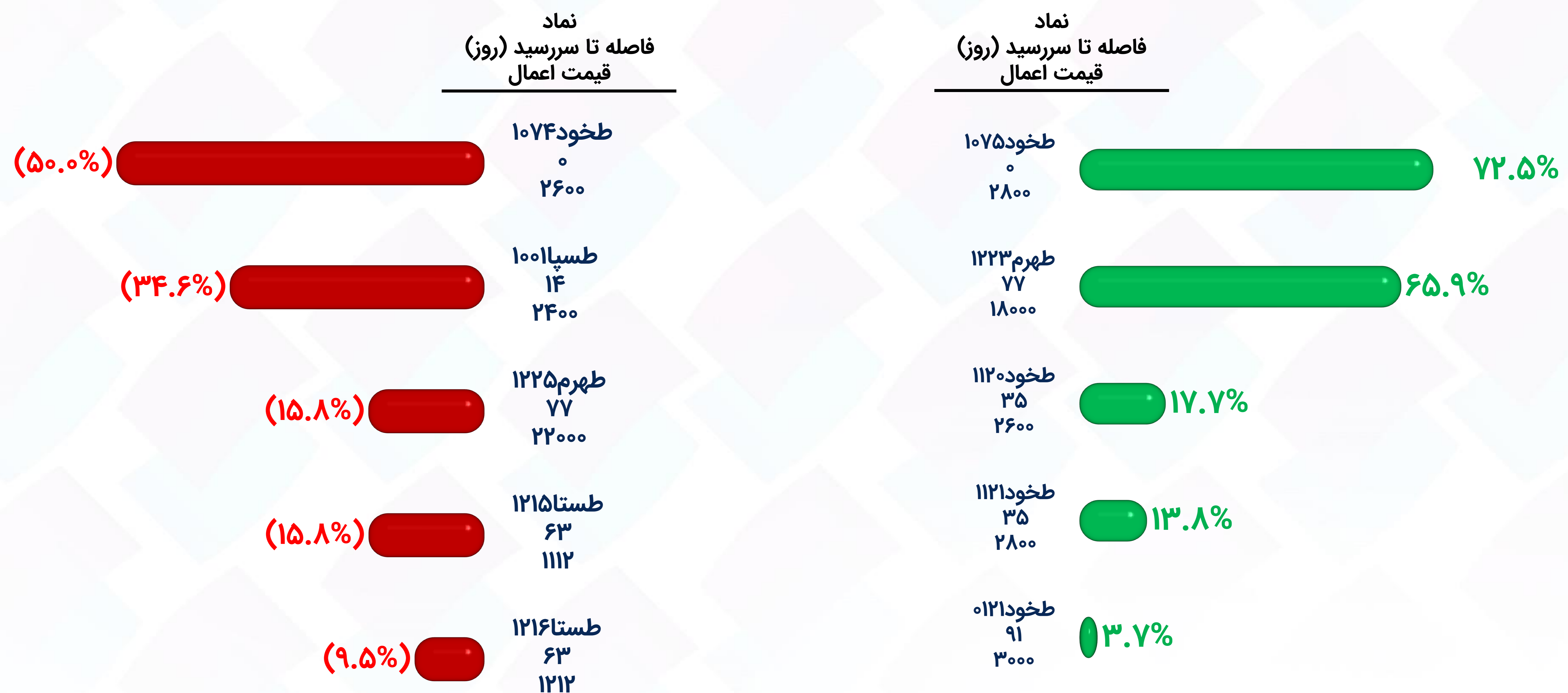
میلیارد تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



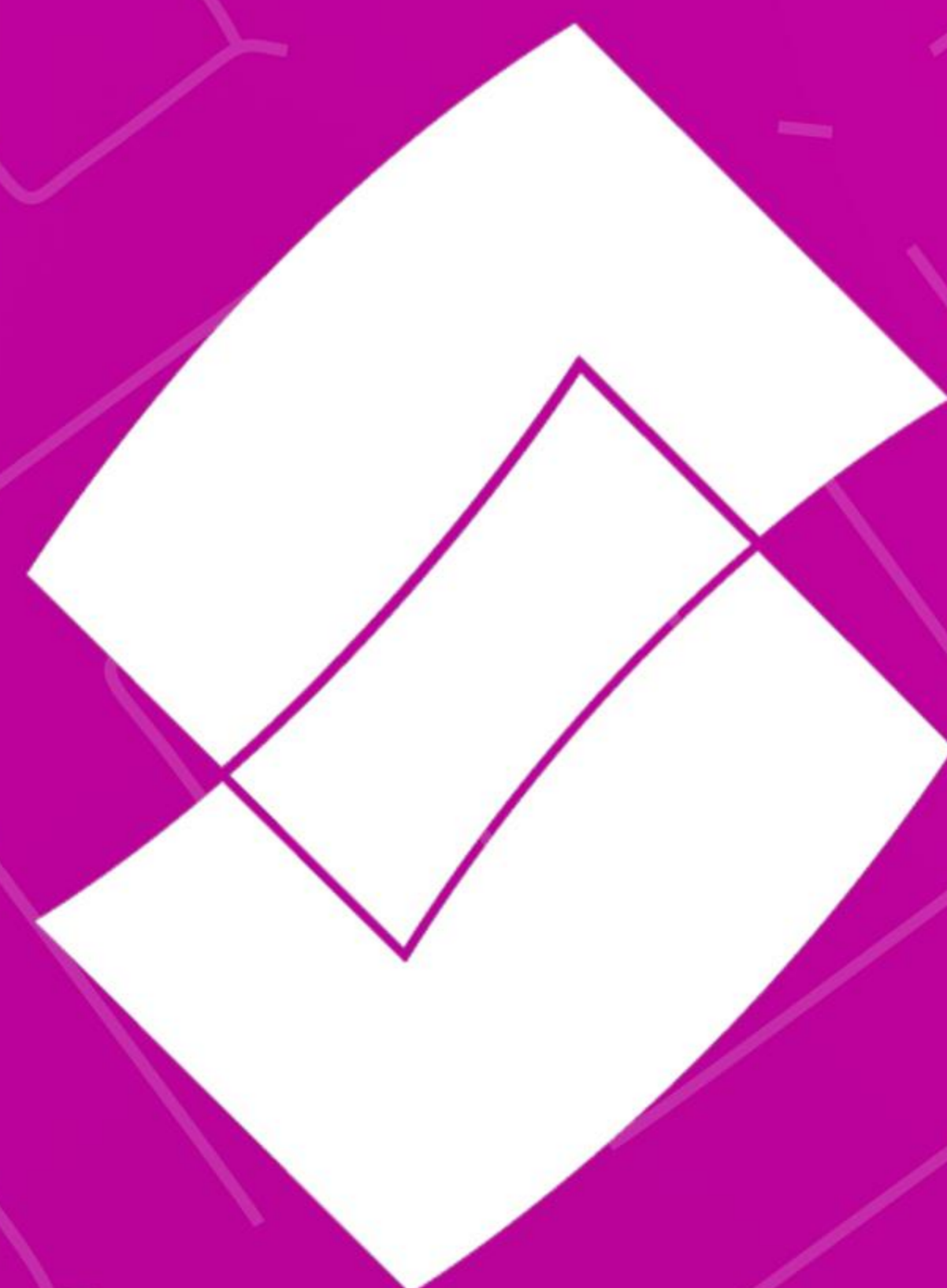
اختیار فروش



(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.