

شماره

۱۶۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

# بازار اختیار معامله

۱۱ 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](http://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

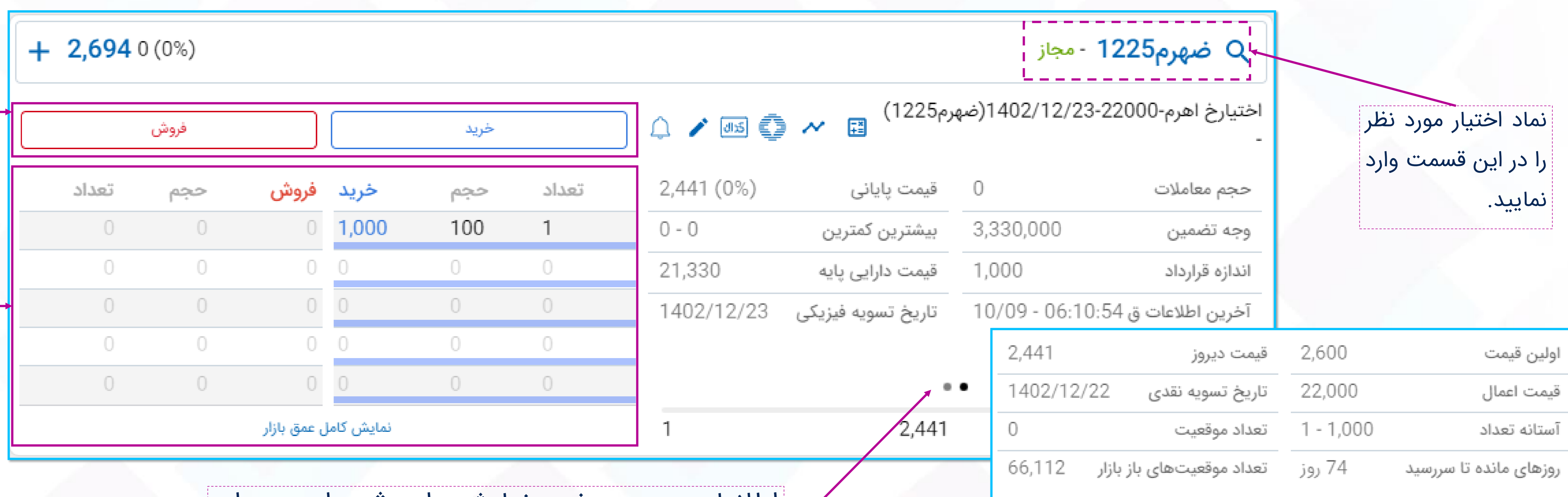


# ارسال سفارش خرید/فروش در سامانه صحرا

برای ارسال سفارش در سامانه صحرا ابتدا در صفحه داشبورد خود نماد مورد نظر را جست‌وجو نموده تا اطلاعات مربوط به نماد برای شما نمایش داده شود. این اطلاعات شامل قیمت اعمال، تاریخ سررسید (تسویه فیزیکی)، وجه تضمین لازم برای هر قرارداد، قیمت دارایی پایه و ... هستند.

با کلیک بر روی این قسمت صفحه سفارش‌گذاری برای شما باز می‌شود.

نمایش قیمت و حجم پنج مظنه برتر خرید و فروش به شما کمک می‌کند به ارسال سفارش خرید/فروش بهینه اقدام نمایید. در صورت نیاز به اطلاعات بیشتر می‌توانید از نمودار عمق بازار استفاده نمایید. نمودار عمق بازار قیمت و حجم تمامی سفارش‌های فعال را نمایش می‌دهد.

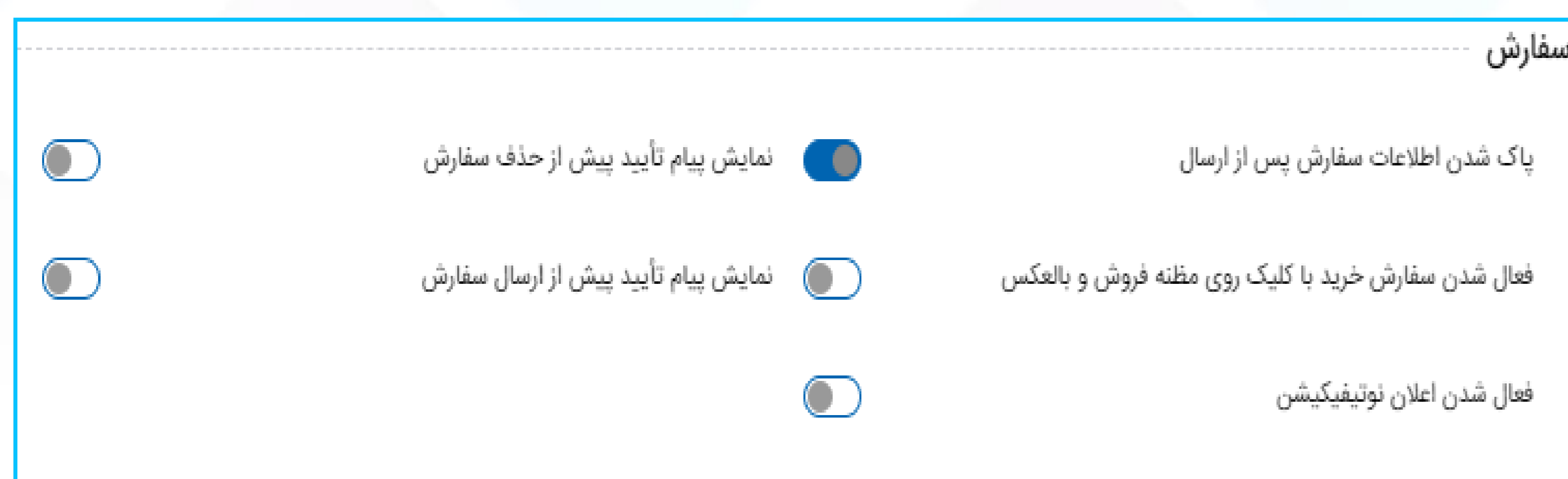


اطلاعات در دو صفحه نمایش داده شده است، برای مشاهده صفحه دوم از نقاط اشاره شده استفاده کنید.

## صفحه سفارش‌گذاری:

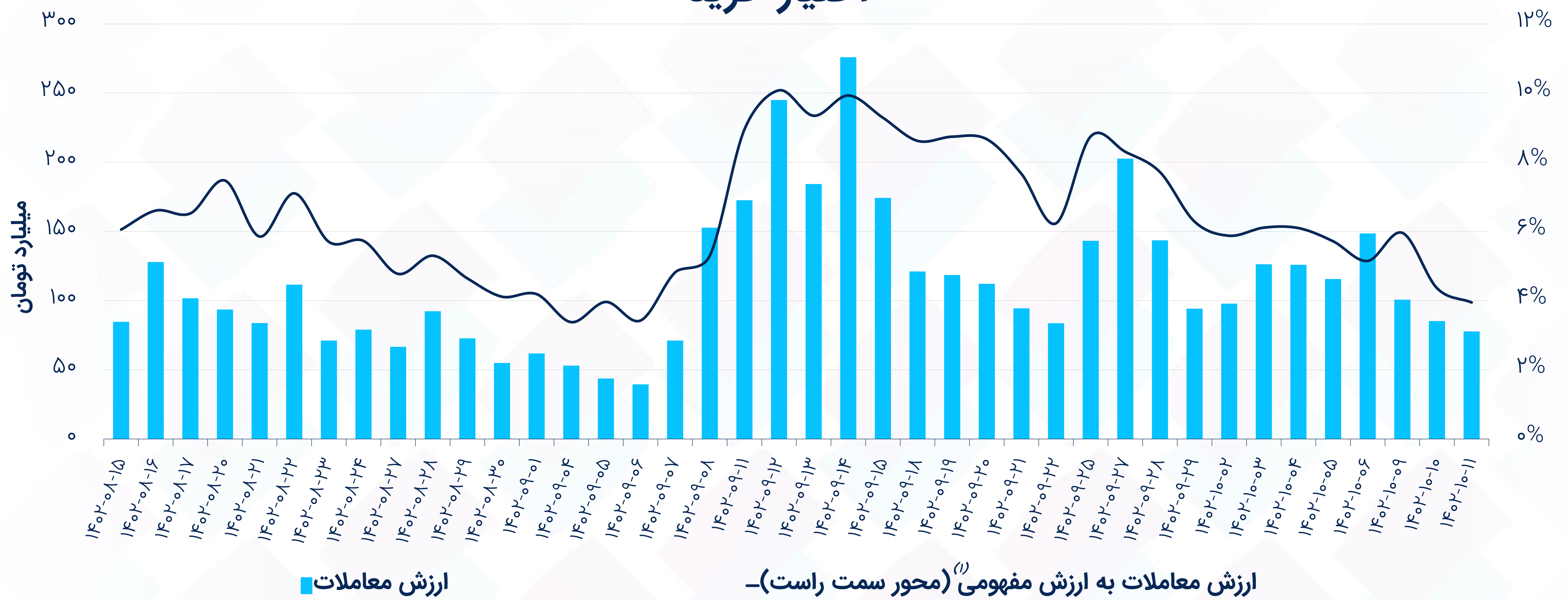
بعد از باز شدن صفحه سفارش‌گذاری می‌توانید با کمک ابزارهای موجود در صفحه خرید و فروش انجام دهید. در ساده‌ترین حالت می‌توانید با قرار دادن قیمت و تعداد مورد نظر خود سفارش را بلافاصله ارسال نموده و با توجه به روند عرضه و تقاضای بازار منتظر اجرای سفارش باشید. اعتبار سفارش به صورت پیش‌فرض تا پایان روز معاملاتی است. در صورت تمایل می‌توانید اعتبار سفارش خود را تغییر دهید (معتبر تا لغو و معتبر تا تاریخ مشخص). در حالت اجرای فوری و حذف هم اگر سفارش در لحظه ارسال قابل انجام باشد، معامله انجام می‌شود و در غیر این صورت سفارش حذف شده و روی تابلو قرار نمی‌گیرد. گزینه دیگری که ممکن است مورد استفاده قرار بگیرد ایجاد پیش‌نویس است. با استفاده از این قابلیت کاربر می‌تواند سفارشات خود را ذخیره و ویرایش کرده تا در زمان مناسب با استفاده از یک دکمه اقدام به ارسال سفارش کند.

همچنین در صورت تمایل می‌توانید از طریق نوار آبی رنگ سمت راست - قسمت تنظیمات - سفارش، می‌توانید پیام‌های مرتبط با بخش سفارش (تصویر روبه‌رو) را شخصی‌سازی نمایید.

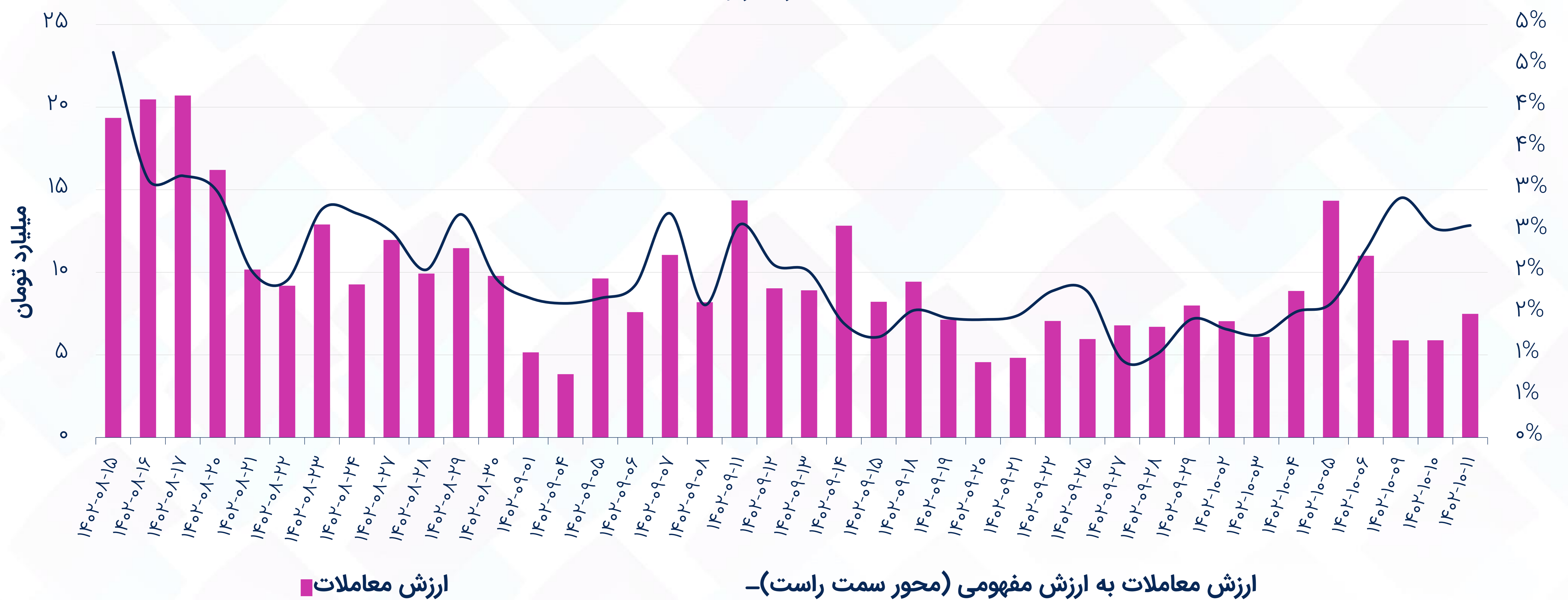


# ارزش معاملات

## اختیار خرید



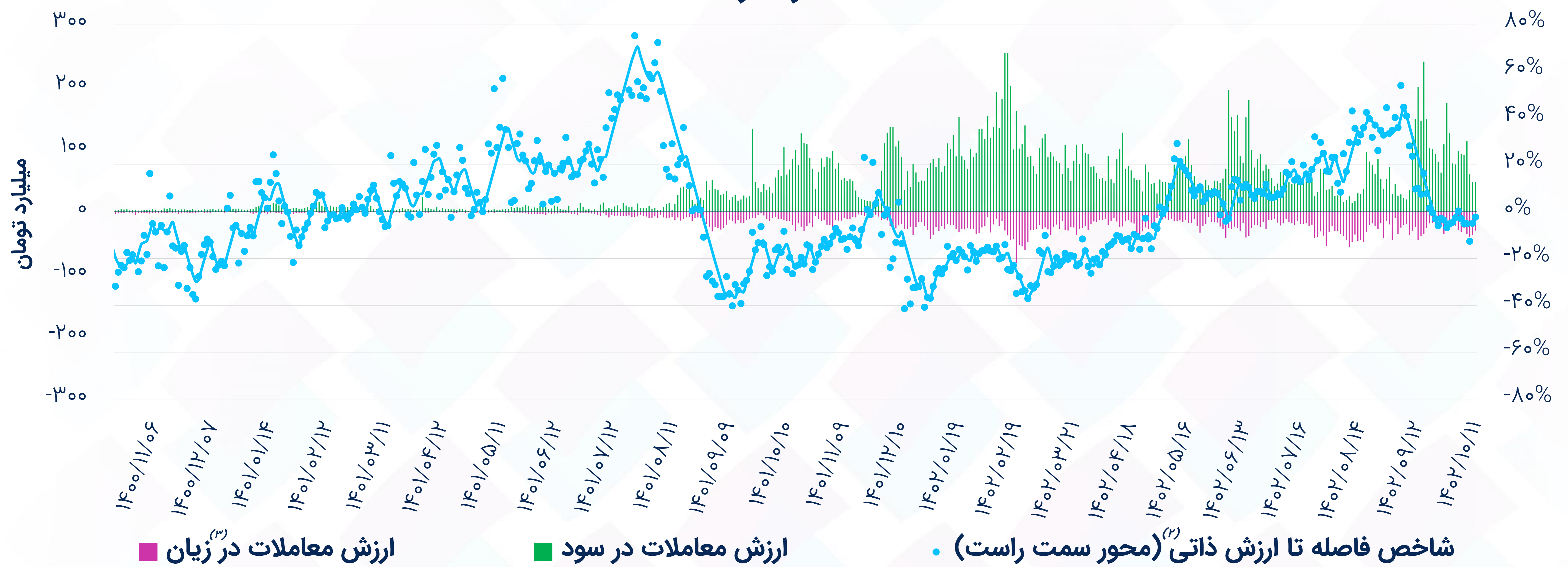
## اختیار فروش



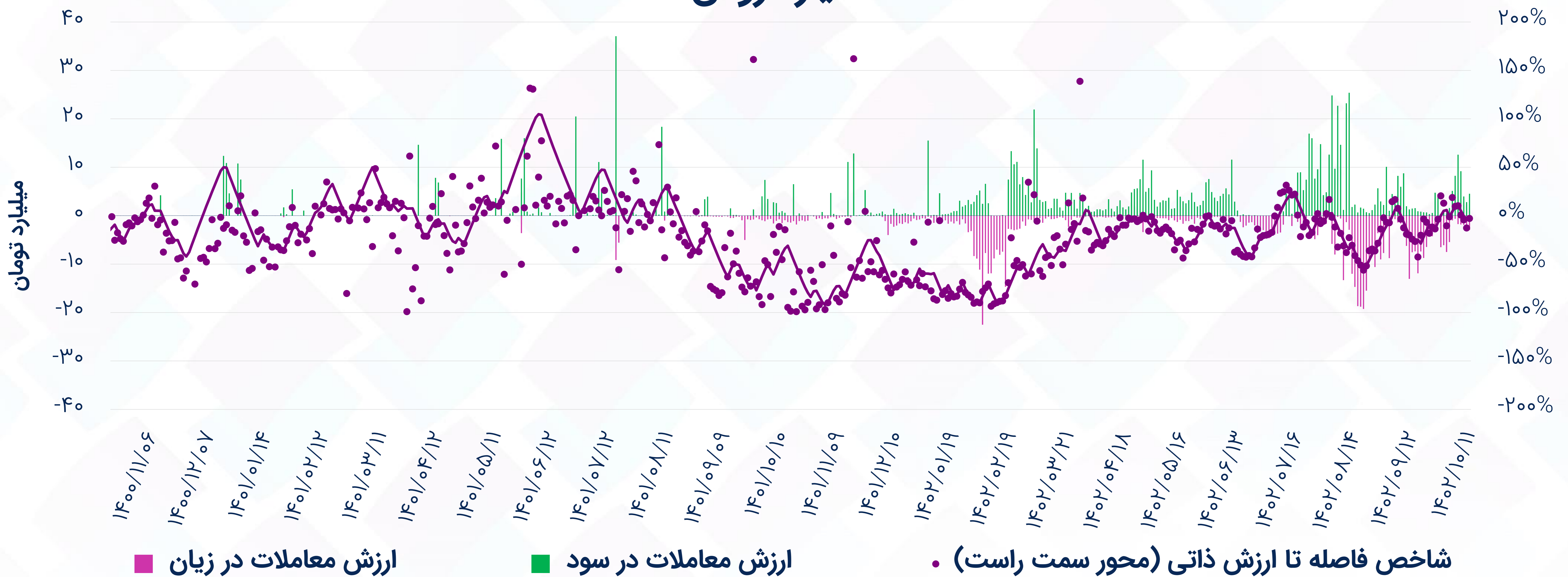
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله \* اندازه قرارداد \* قیمت دارایی پایه

# 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	۲۳	۲۷.۷	۷۵۵.۰	۱۰.۵	۱۷.۲	(۲.۹%)
اهرم	۲۳	۱۷.۵	۱۰۷.۹	۱۴.۸	۲.۷	(۵.۳%)
حسابا	۱۶	۱۳.۴	۷۸۰.۴	۷.۹	۵.۵	۱۴.۲%
شستا	۲۰	۷.۰	۱۸۴.۲	۴.۴	۲.۶	(۲۲.۲%)
ذوب	۵	۵.۰	۴۶.۱	۴.۹	۰.۱	۴.۵%
توان	۶	۲.۵	۲۱.۲	۲.۰	۰.۶	(۲.۶%)
خپارس	۹	۱.۳	۸.۴	۰.۴	۰.۸	(۲۹.۳%)

## 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	۷	۳,۷۸۹.۶	۱۲۱,۵۷۳.۲	۲,۰۶۶.۲	۱,۷۲۳.۴	(۱۵.۰%)
حسابا	۴	۲,۵۶۹.۹	۱۳۴,۳۹۶.۲	۱,۶۷۳.۸	۸۹۶.۰	۱۶.۶%
اهرم	۲	۸۰۸.۲	۱۲,۱۰۲.۶	۷۶۸.۱	۴۰.۱	۶.۸%
شستا	۳	۲۹۵.۵	۲۳,۴۲۳.۴	۰.۰	۲۹۵.۵	(۴۳.۳%)
حافرین	۲	۲۱.۲	۳۰.۲	۲۱.۲	۰.۰	۱۳.۷%
تپسی	۱	۰.۱	۴.۰	۰.۰	۰.۱	(۹۲.۲%)

# موقعیت‌های باز<sup>(۱)</sup> به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۱۲۵,۵۲۹

خسپا ۴۴,۹۲۷

اهرم ۳۴,۳۷۴

وبصادر ۱۹,۹۵۴

ذوب ۱۱,۹۰۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

بهین رو ۳۷۷

پترول ۴

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

خسپا ۲,۹۷۶

شستا ۲,۷۹۷

خودرو ۲,۰۸۷

اهرم ۲,۰۳۶

دی ۲۱۸

ذوب ۲۱۶

وبصادر ۱۸۴

وتجارت ۱۷۵

خپارس ۱۵۷

وبملت ۱۵۶

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

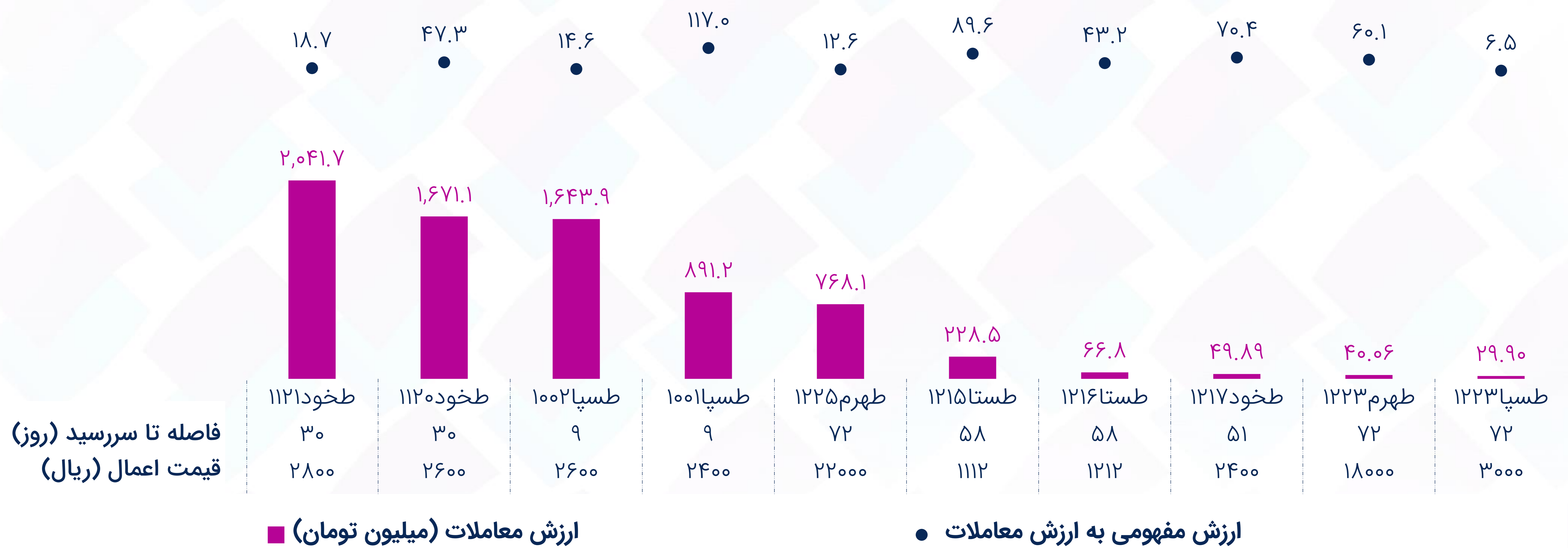


# بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

## 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 <sup>(۳)</sup>	فاصله تا سر به سر <sup>(۲)</sup>	سر به سر <sup>(۱)</sup>	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۱۷۹۰%	۱,۰۰۲	۰.۶۳	۱۱۹.۹	(۱.۸%)	۶,۳۵۳	۶,۴۷۰	۵۳	۴.۸	۳۷	۶,۳۰۰	ضفصبا ۱۱۰۳
۴۱۲%	۶۵۵	۰.۲۴	۲۱۹.۸	۳۳.۸%	۲۸,۱۲۸	۲۱,۰۲۰	۱۲۸	۲۴.۵	۱۰۰	۲۸,۰۰۰	ضهرم ۰۱۱۰
۴۱۱%	۱,۲۷۱	۰.۷۲	۲۴.۳	(۶.۵%)	۶,۰۴۹	۶,۴۷۰	۲۴۹	۹.۵	۳۷	۵,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۲
۱۳۱%	۶۹	۰.۱۶	۱۸۰.۳	۴۰.۰%	۵,۴۱۰	۳,۸۶۳	۳۰	۳.۰	۹۳	۵,۳۸۰	ضخاور ۱۲۸
۱۰۶%	۲,۶۷۴	۰.۸۳	۴.۷	(۵.۸%)	۶,۰۹۷	۶,۴۷۰	۱,۲۹۷	۷.۴	۱۶۰	۴,۸۰۰	ضفصبا ۳۰۰

## 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	۶۰۱.۰	۱۷۸%	۳,۰۰۵	۱,۰۷۹	۵	۸.۵	۳۷	۳,۰۰۰	ضدی ۱۱۱۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۸۰۹.۵	۸۹%	۳,۶۱۹	۱,۹۱۳	۲	۳.۴	۳۰	۳,۶۱۷	ضصاد ۱۱۴۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۲۵۱.۰	۳۲%	۳,۲۵۱	۲,۴۵۷	۱	۱۲.۴	۹	۳,۲۵۰	ضسپا ۱۰۰۵
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۲۵۱.۰	۶۵%	۴,۵۱۸	۲,۷۴۴	۱۸	۱۱.۱	۵۱	۴,۵۰۰	ضخود ۱۲۲۵
(۹۷%)	۱	۰.۰۱	۱۰۱.۰	۶۴%	۴,۰۴۰	۲,۴۵۷	۴۰	۱.۴	۷۲	۴,۰۰۰	ضسپا ۱۲۲۷

(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 <sup>(۱)</sup>	فاصله تا سرربه‌سر <sup>(۲)</sup>	اهرم <sup>(۳)</sup>	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طسپا ۱۰۰۱	خسپا	۲,۴۰۰	۹	۸۹۱.۲	۲۱	۲,۴۵۷	۲,۳۷۹	(۳%)	۱۱۳.۳	-۰.۳۱	۳۶	۷۰.۶%
طسپا ۱۰۰۰	خسپا	۲,۲۰۰	۹	۴.۸	۲	۲,۴۵۷	۲,۱۹۸	(۱۱%)	۱,۰۹۹.۰	-۰.۰۴	۳	۵۰.۰%
طخود ۱۱۱۹	خودرو	۲,۴۰۰	۳۰	۲.۳	۱۰	۲,۷۴۴	۲,۳۹۰	(۱۳%)	۲۳۹.۰	-۰.۰۸	۱۴	۳۵.۶%
طسپا ۱۲۲۳	خسپا	۳,۰۰۰	۷۲	۲۹.۹	۳۷۹	۲,۴۵۷	۲,۶۲۱	۷%	۶.۹	-۰.۷۶	۴۳۵	۱۴.۹%
طحافرین ۳۱۰	حافرین	۴,۹۶۸	۱۴۶	۱۷.۹	۱,۷۵۰	۲,۴۷۶	۳,۲۱۸	۳۰%	۱.۸	-۰.۹۸	۲,۰۰۱	۱۴.۳%

## 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	۵۸	۲۲۸.۵	۱۴	۱,۲۵۴	۱,۰۹۸	(۱۳%)	۷۸.۴	-۰.۰۹	۷	(۵۲.۰%)
طخود ۱۲۱۷	خودرو	۲,۴۰۰	۵۱	۴۹.۹	۳۹	۲,۷۴۴	۲,۳۶۱	(۱۴%)	۶۰.۵	-۰.۱۱	۲۵	(۳۶.۸%)
طخود ۰۱۲۱	خودرو	۳,۰۰۰	۸۶	۶.۶	۳۱۷	۲,۷۴۴	۲,۶۸۳	(۲%)	۸.۵	-۰.۵۲	۲۵۱	(۲۰.۹%)
طخود ۱۱۲۰	خودرو	۲,۶۰۰	۳۰	۱,۶۷۱.۱	۵۸	۲,۷۴۴	۲,۵۴۲	(۷%)	۴۳.۸	-۰.۲۴	۴۹	(۱۴.۹%)
طخود ۱۱۲۱	خودرو	۲,۸۰۰	۳۰	۲,۰۴۱.۷	۱۴۷	۲,۷۴۴	۲,۶۵۳	(۳%)	۱۸.۰	-۰.۴۶	۱۲۶	(۱۴.۶%)

(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

## ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیارد تومان

## بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

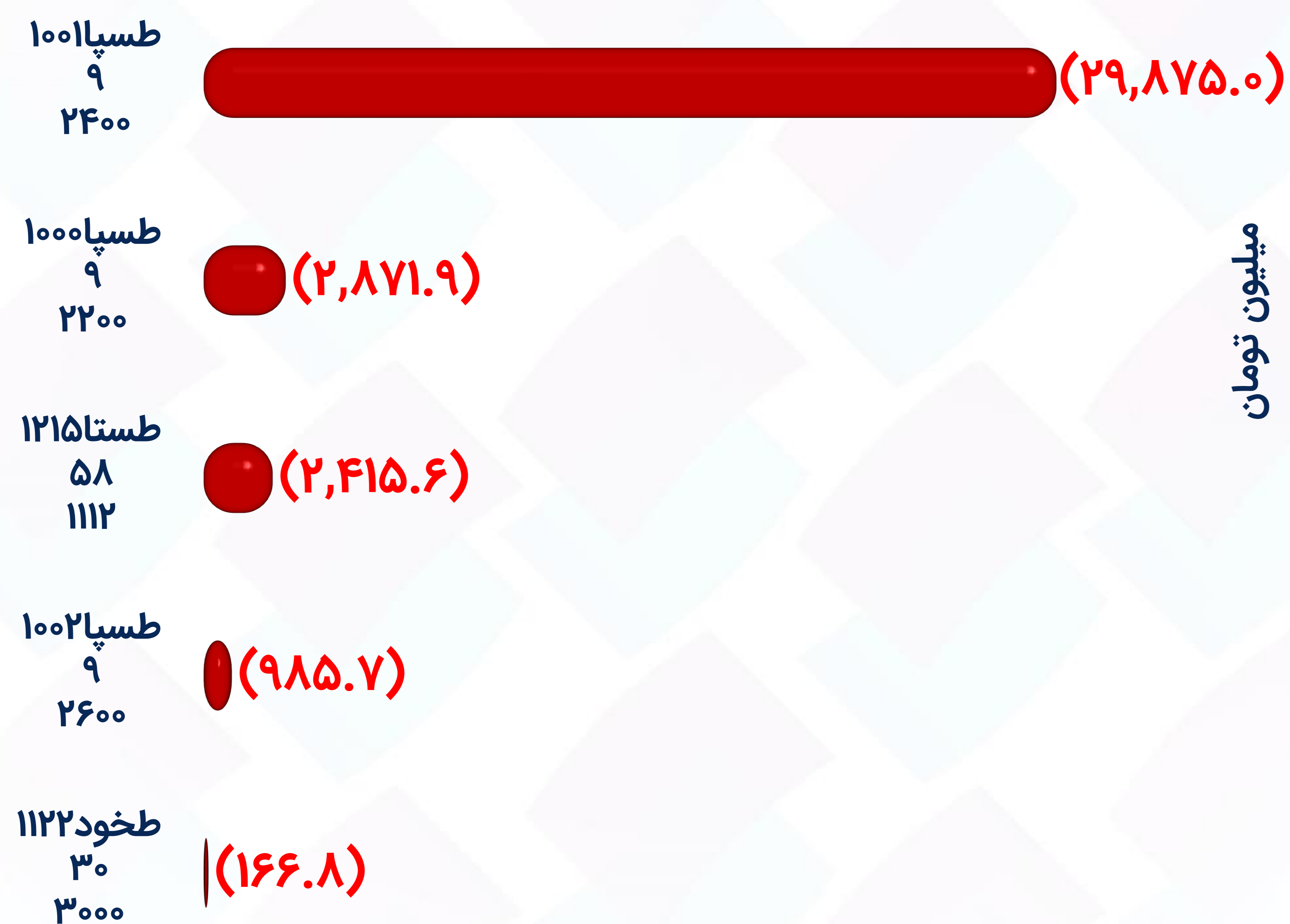
نماد  
فاصله تا سررسید (روز)  
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

## بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



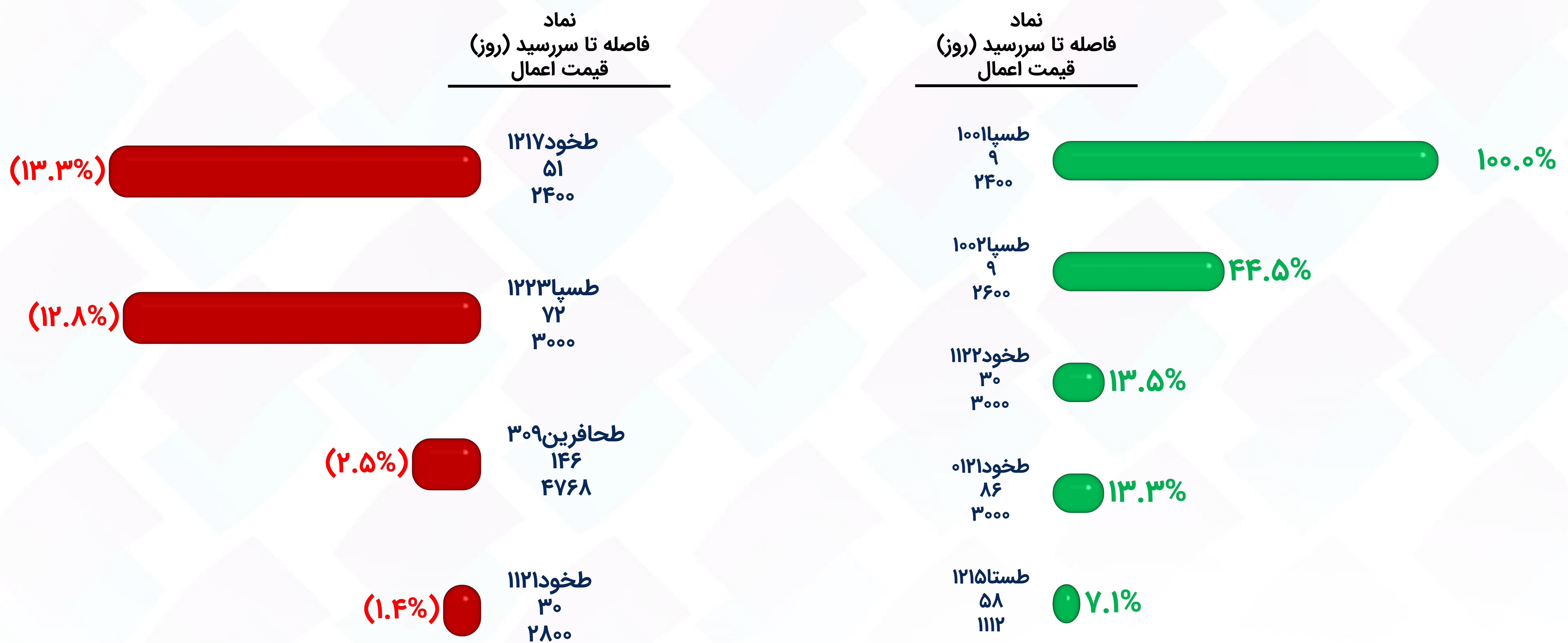
میلیون تومان

# بیشترین تغییرات قیمت (۱)

## اختیار خرید



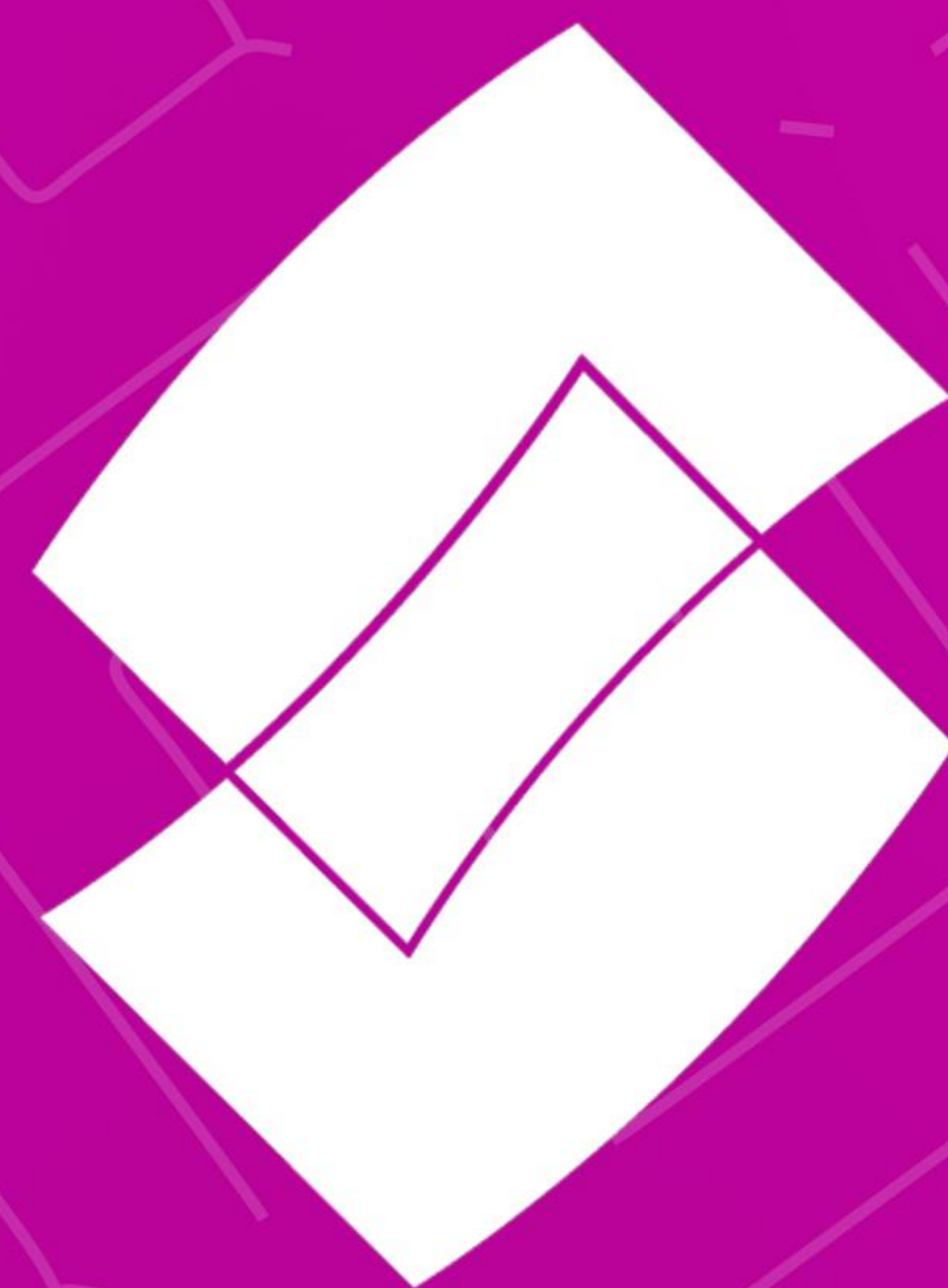
## اختیار فروش



(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.