

شماره

۱۶۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۲ 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

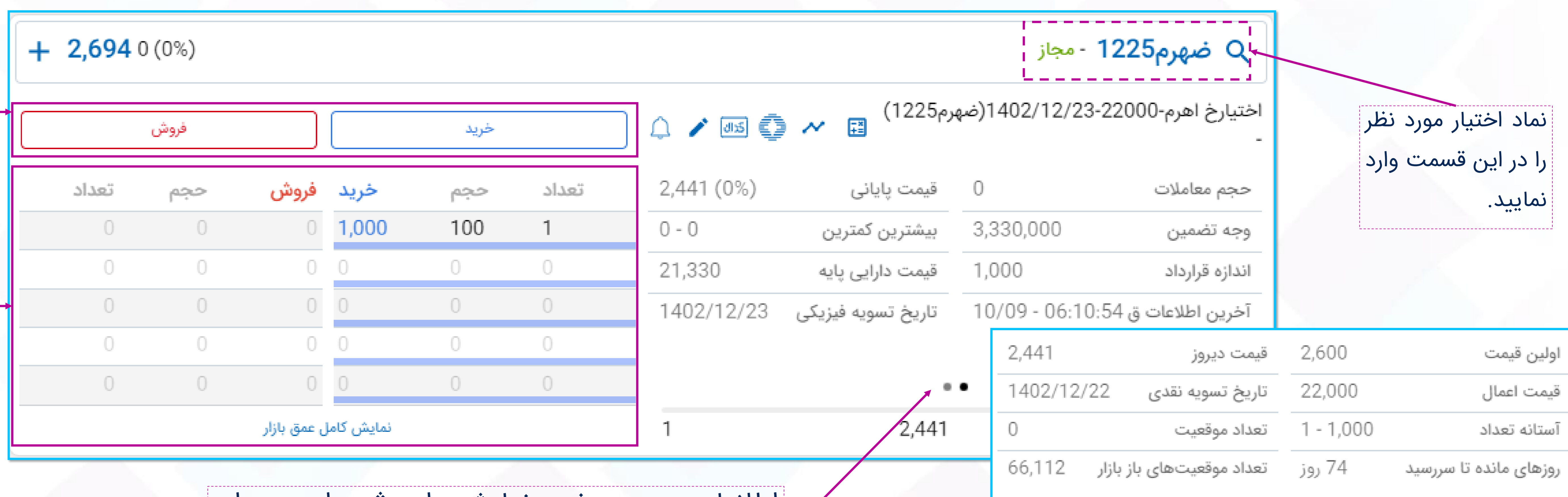


ارسال سفارش خرید/فروش در سامانه صحرا

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.

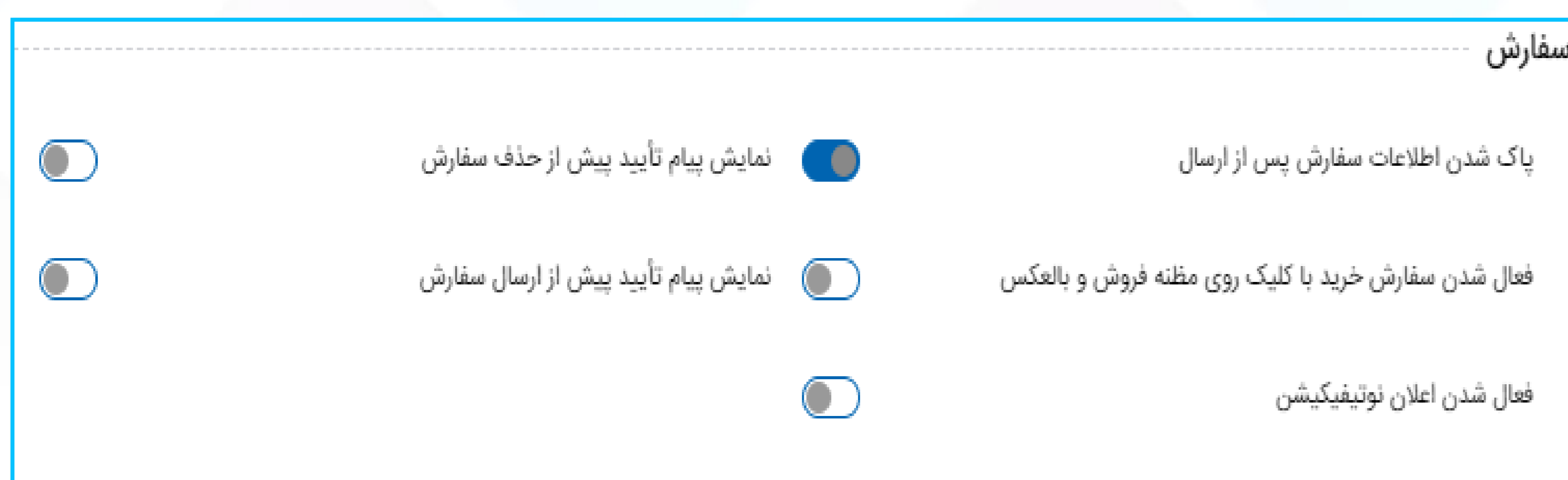


اطلاعات در دو صفحه نمایش داده شده است، برای مشاهده صفحه دوم از نقاط اشاره شده استفاده کنید.

صفحه سفارش‌گذاری:

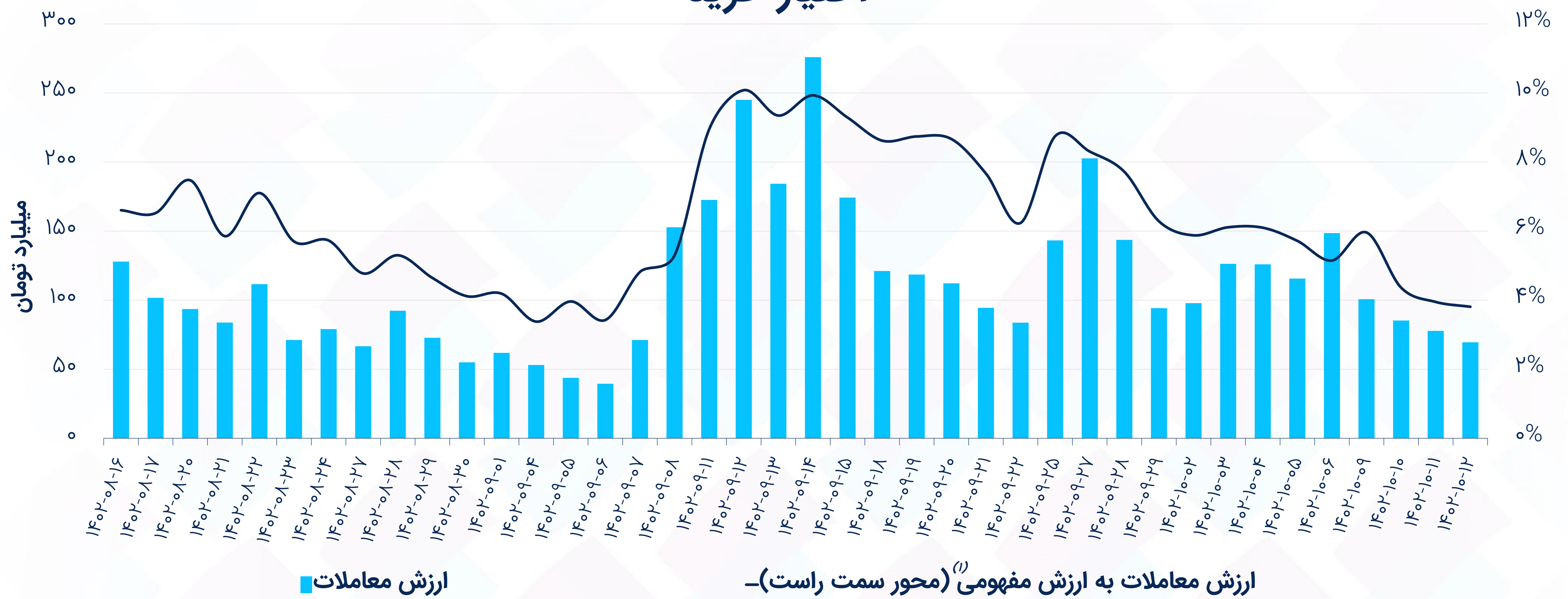
بعد از باز شدن صفحه سفارش‌گذاری می‌توانید با کمک ابزارهای موجود در صفحه خرید و فروش انجام دهید. در ساده‌ترین حالت می‌توانید با قرار دادن قیمت و تعداد مورد نظر خود سفارش را بلافاصله ارسال نموده و با توجه به روند عرضه و تقاضای بازار منتظر اجرای سفارش باشید. اعتبار سفارش به صورت پیش‌فرض تا پایان روز معاملاتی 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.

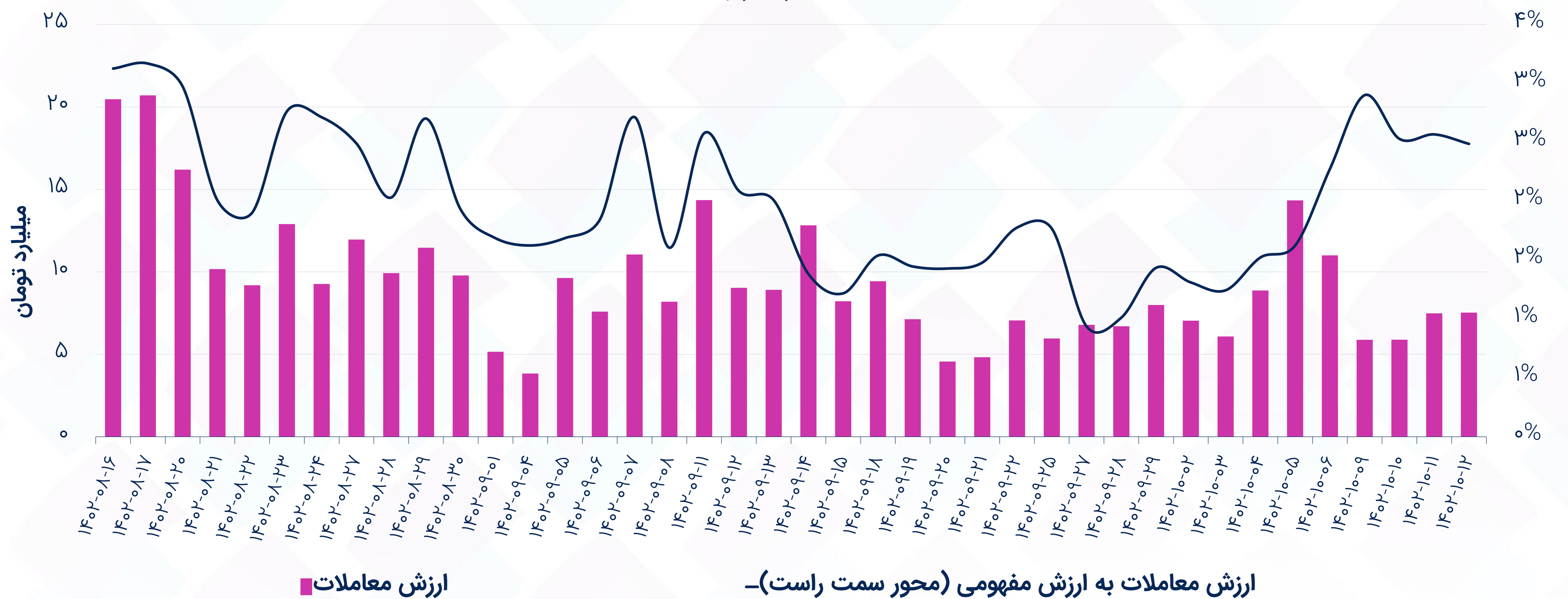


ارزش معاملات

اختیار خرید



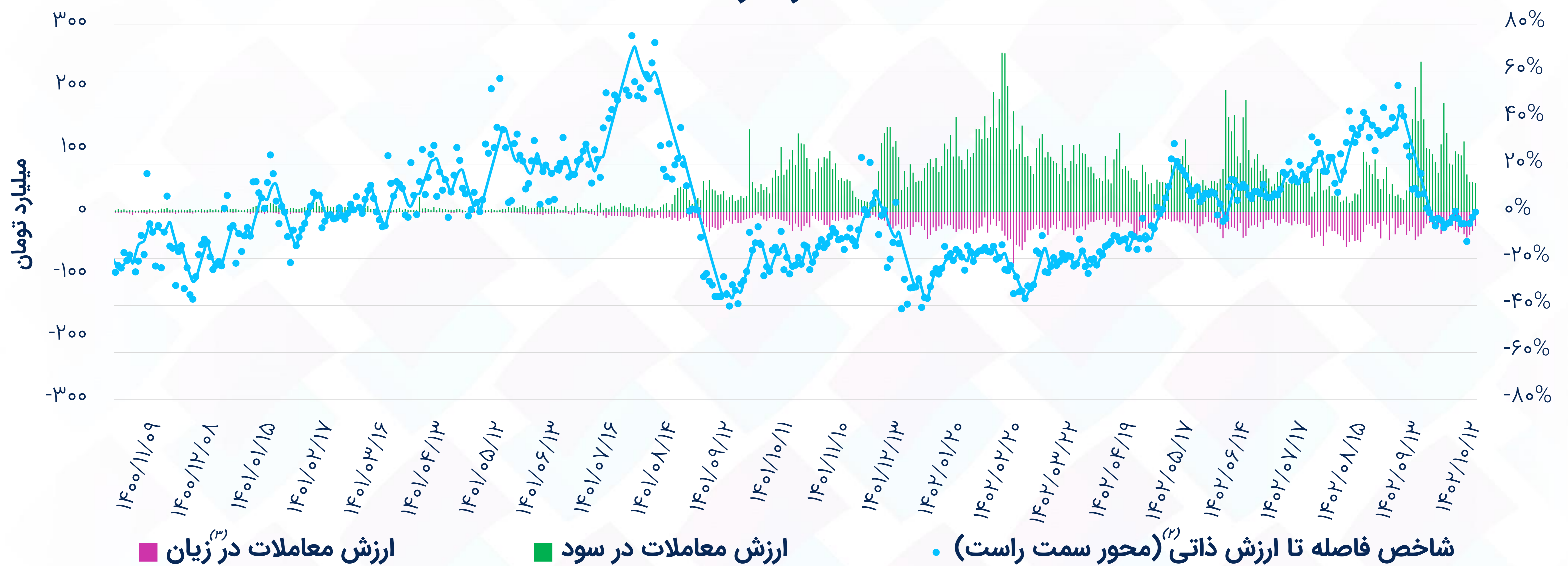
اختیار فروش



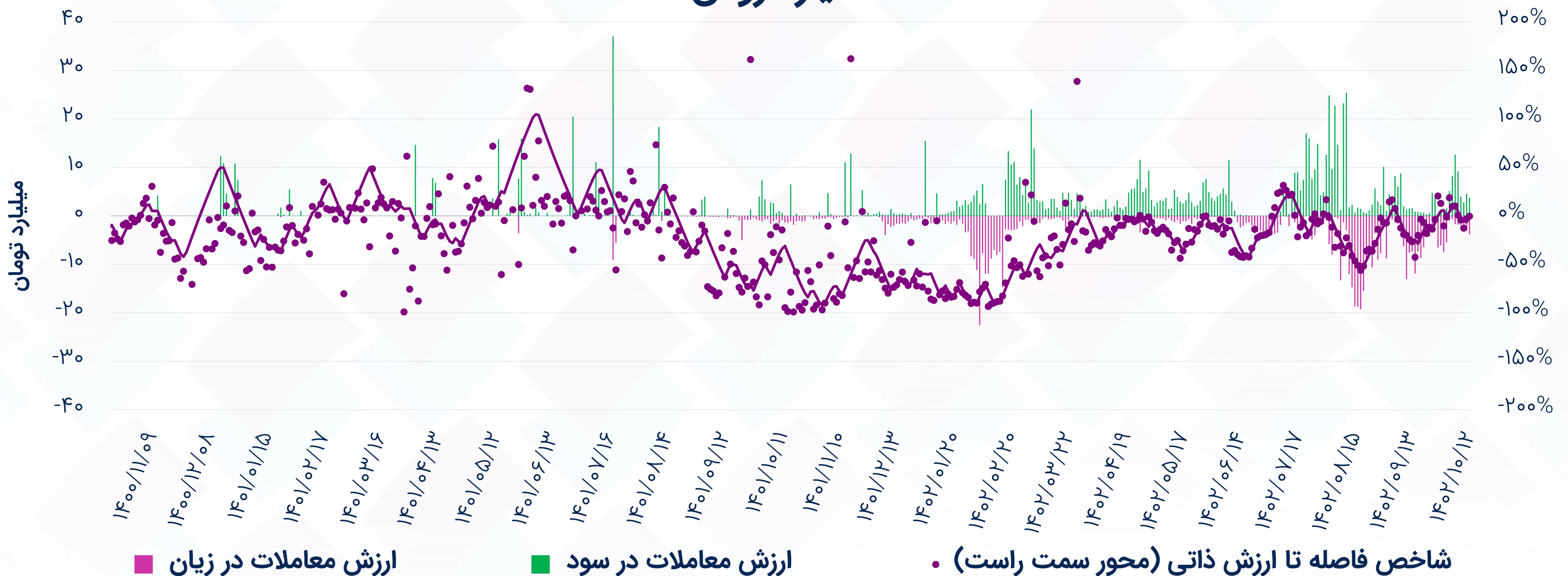
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

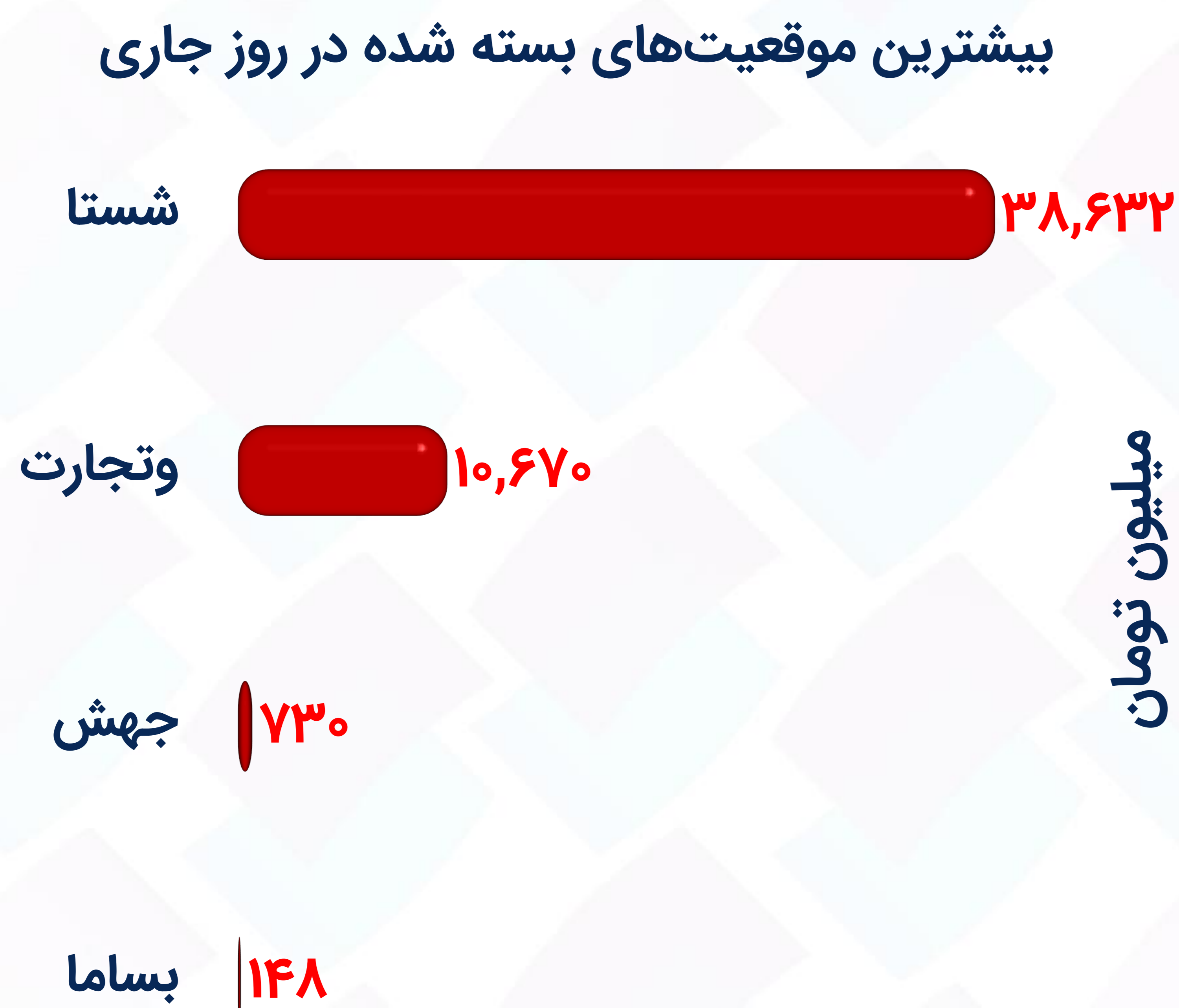
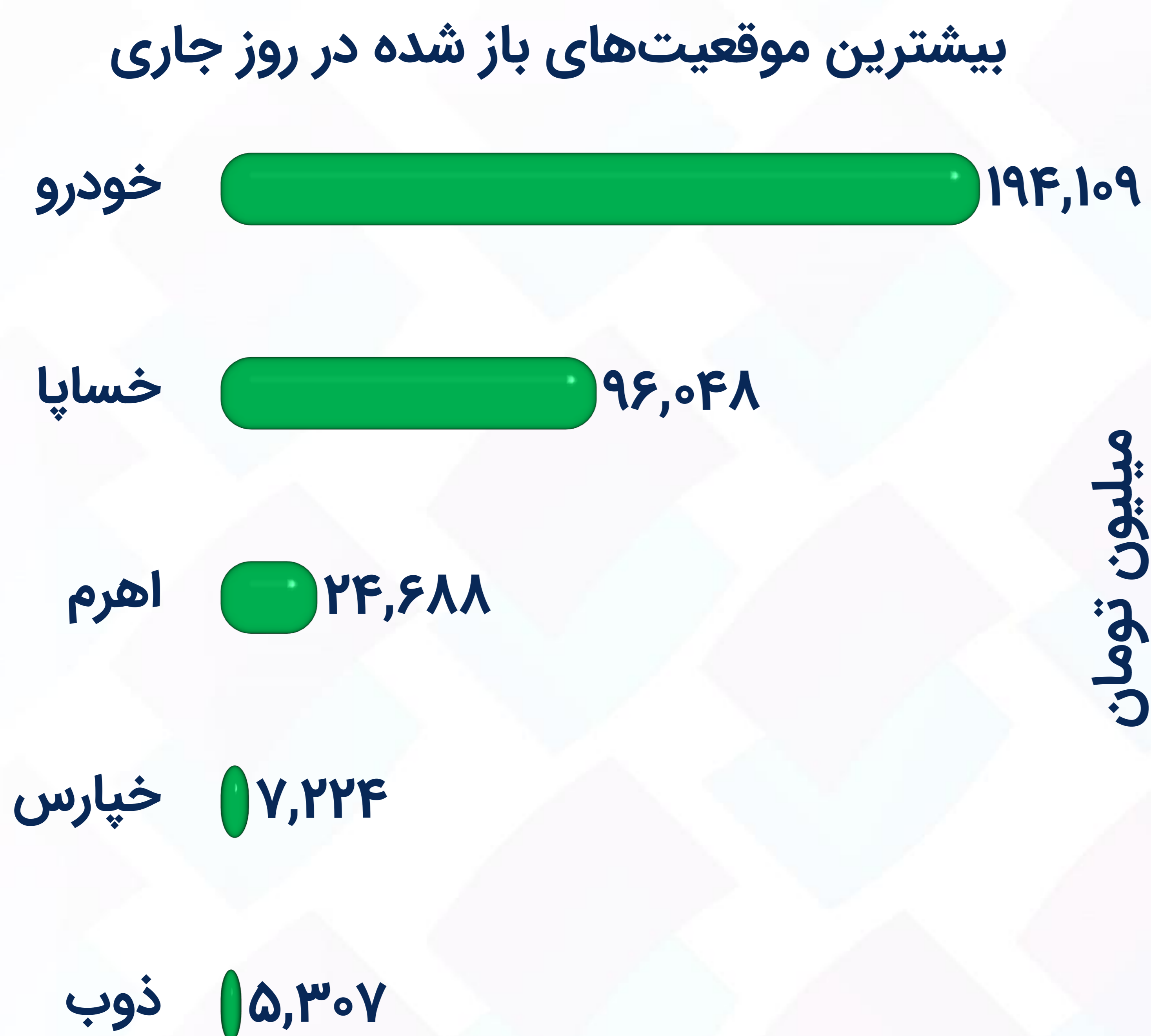
اختیار خرید

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	۲۶	۲۳.۲	۶۷۶.۵	۹.۵	۱۳.۶	(۲.۹%)
خسپا	۲۲	۲۰.۴	۷۹۷.۲	۱۶.۱	۴.۴	۱۵.۶%
اهرم	۲۰	۱۳.۱	۷۸.۱	۱۱.۲	۲.۰	(۷.۰%)
شستا	۲۳	۴.۸	۱۷۳.۵	۳.۱	۱.۷	(۲۵.۶%)
ذوب	۵	۲.۶	۲۲.۳	۲.۶	۰.۰	۴.۴%
توان	۴	۱.۷	۱۳.۷	۱.۵	۰.۲	(۵.۰%)
خیارس	۸	۱.۳	۹.۴	۰.۶	۰.۷	(۲۴.۹%)

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	۶	۳,۴۴۲.۴	۱۵۸,۲۸۸.۰	۱,۲۶۳.۳	۲,۱۷۹.۱	۰.۹%
خسپا	۴	۲,۹۲۱.۶	۱۱۲,۸۳۷.۵	۱,۶۴۹.۵	۱,۲۷۲.۱	(۰.۲%)
اهرم	۴	۸۵۵.۸	۱۱,۸۱۹.۹	۸۰۸.۵	۴۷.۳	۶.۸%
شستا	۶	۳۰۲.۰	۱۹,۸۰۷.۹	۳.۲	۲۹۸.۸	(۳۶.۲%)
حافرین	۱	۶.۴	۱۰.۳	۶.۴	۰.۰	۷.۵%
خیارس	۱	۱.۳	۲۴.۰	۱.۳	۰.۰	(۲۹.۱%)

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



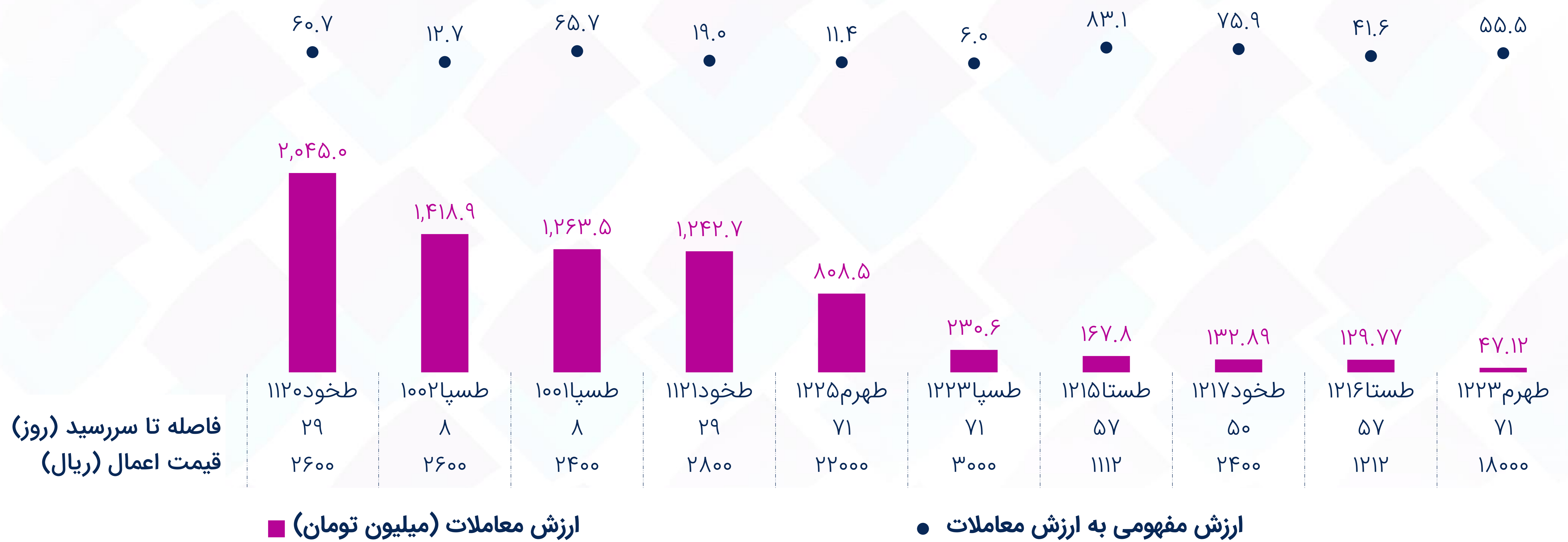
میلیون تومان

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
۱۷۵۹%	۹۶۷	۰.۶۳	۱۲۲.۲	(۱.۷%)	۶,۳۵۲	۶,۴۶۰	۵۲	۳.۶	۳۶	۶,۳۰۰	ضفصبا ۱۱۰۳
۳۱۶%	۱,۲۳۸	۰.۷۲	۲۰.۵	(۵.۶%)	۶,۰۹۸	۶,۴۶۰	۲۹۸	۱۲.۸	۳۶	۵,۸۰۰	ضفصبا ۱۱۰۲
۲۴۱%	۳۸	۰.۱۵	۴۵۵.۵	۱۷.۴%	۵,۰۱۱	۴,۲۶۹	۱۱	۱.۱	۴۱	۵,۰۰۰	ضترا ۱۱۵۷
۱۴۳%	۱۰۲	۰.۱۷	۲۳۹.۱	۲۱.۰%	۱۰,۰۴۲	۸,۳۰۰	۴۲	۳.۳	۵۰	۱۰,۰۰۰	ضشنا ۱۲۰۷
۹۶%	۲,۶۴۸	۰.۸۴	۴.۶	(۴.۸%)	۶,۱۵۰	۶,۴۶۰	۱,۳۵۰	۲۷.۵	۱۵۹	۴,۸۰۰	ضفصبا ۳۰۰

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	۶۰۱.۰	۱۷۸%	۳,۰۰۵	۱,۰۸۱	۵	۱.۱	۳۶	۳,۰۰۰	ضدی ۱۱۱۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۷۳.۷	۱۵۳%	۳,۰۱۱	۱,۱۹۱	۱۱	۵.۶	۶۸	۳,۰۰۰	ضخپارس ۱۲۱۳
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۸۰۹.۵	۹۳%	۳,۶۱۹	۱,۸۷۹	۲	۱.۴	۲۹	۳,۶۱۷	ضصاد ۱۱۴۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۲۵۱.۰	۳۴%	۳,۲۵۱	۲,۴۳۰	۱	۱.۵	۸	۳,۲۵۰	ضسپا ۱۰۰۵
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۲۶۵.۷	۶۵%	۴,۵۱۷	۲,۷۳۲	۱۷	۲۰.۵	۵۰	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 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 ۱۰۰۰	خسپا	۲,۲۰۰	۸	۸.۶	۲	۲,۴۳۰	۲,۱۹۸	(۱۰%)	۱,۰۹۹.۰	-۰.۰۵	۳	۵۷.۵%
طهرم ۱۲۲۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۷۱	۴۷.۱	۳۷۲	۲۰,۶۴۰	۱۷,۶۲۸	(۱۵%)	۴۷.۴	-۰.۱۶	۴۴۶	۱۹.۹%
طسپا ۱۲۲۳	خسپا	۳,۰۰۰	۷۱	۲۳۰.۶	۴۰۲	۲,۴۳۰	۲,۵۹۸	۷%	۶.۵	-۰.۷۹	۴۵۴	۱۳.۰%
طسپا ۱۰۰۱	خسپا	۲,۴۰۰	۸	۱,۲۶۳.۵	۳۷	۲,۴۳۰	۲,۳۶۳	(۳%)	۶۳.۹	-۰.۳۷	۴۱	۱۱.۶%
طخود ۱۱۲۰	خودرو	۲,۶۰۰	۲۹	۲,۰۴۵.۰	۴۵	۲,۷۳۲	۲,۵۵۵	(۶%)	۵۶.۸	-۰.۲۵	۵۰	۱۰.۳%

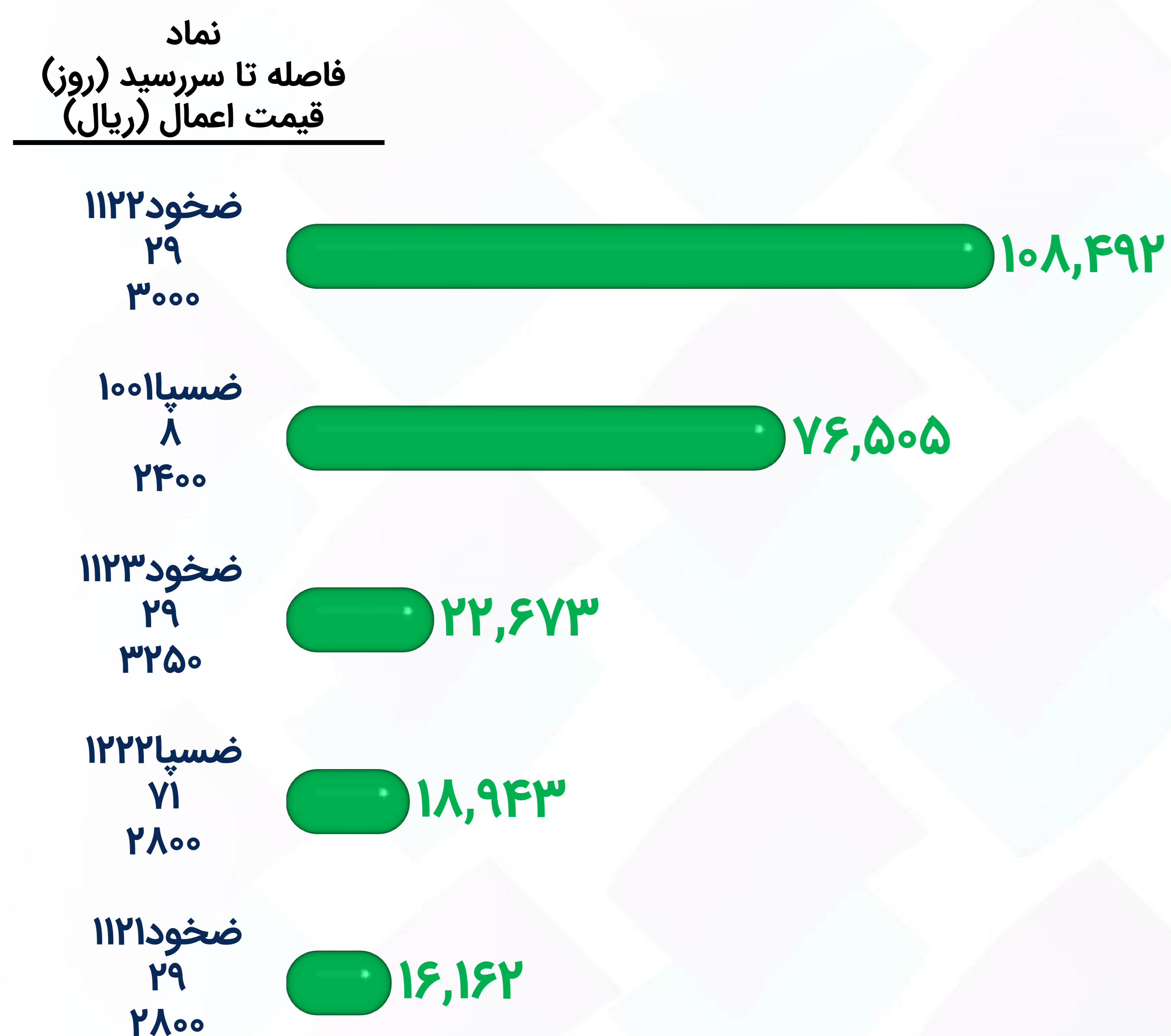
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۵۷	۱۶۷.۸	۱۵	۱,۲۴۷	۱,۰۹۷	(۱۲%)	۷۳.۱	-۰.۰۹	۷	(۵۳.۹%)
طخود ۱۲۱۷	خودرو	۲,۴۰۰	۵۰	۱۳۲.۹	۳۶	۲,۷۳۲	۲,۳۶۴	(۱۳%)	۶۵.۷	-۰.۱۱	۲۴	(۳۲.۲%)
طخپارس ۱۲۰	خپارس	۱,۲۰۰	۶۸	۱.۳	۶۴	۱,۱۹۱	۱,۱۳۶	(۵%)	۱۷.۸	-۰.۳۵	۴۵	(۲۹.۱%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱,۲۱۲	۵۷	۱۲۹.۸	۳۰	۱,۲۴۷	۱,۱۸۲	(۵%)	۳۹.۴	-۰.۲۶	۲۶	(۱۳.۵%)
طسپا ۱۰۰۲	خسپا	۲,۶۰۰	۸	۱,۴۱۸.۹	۱۹۱	۲,۴۳۰	۲,۴۰۹	(۱%)	۱۲.۶	-۰.۸۱	۱۶۶	(۱۳.۲%)

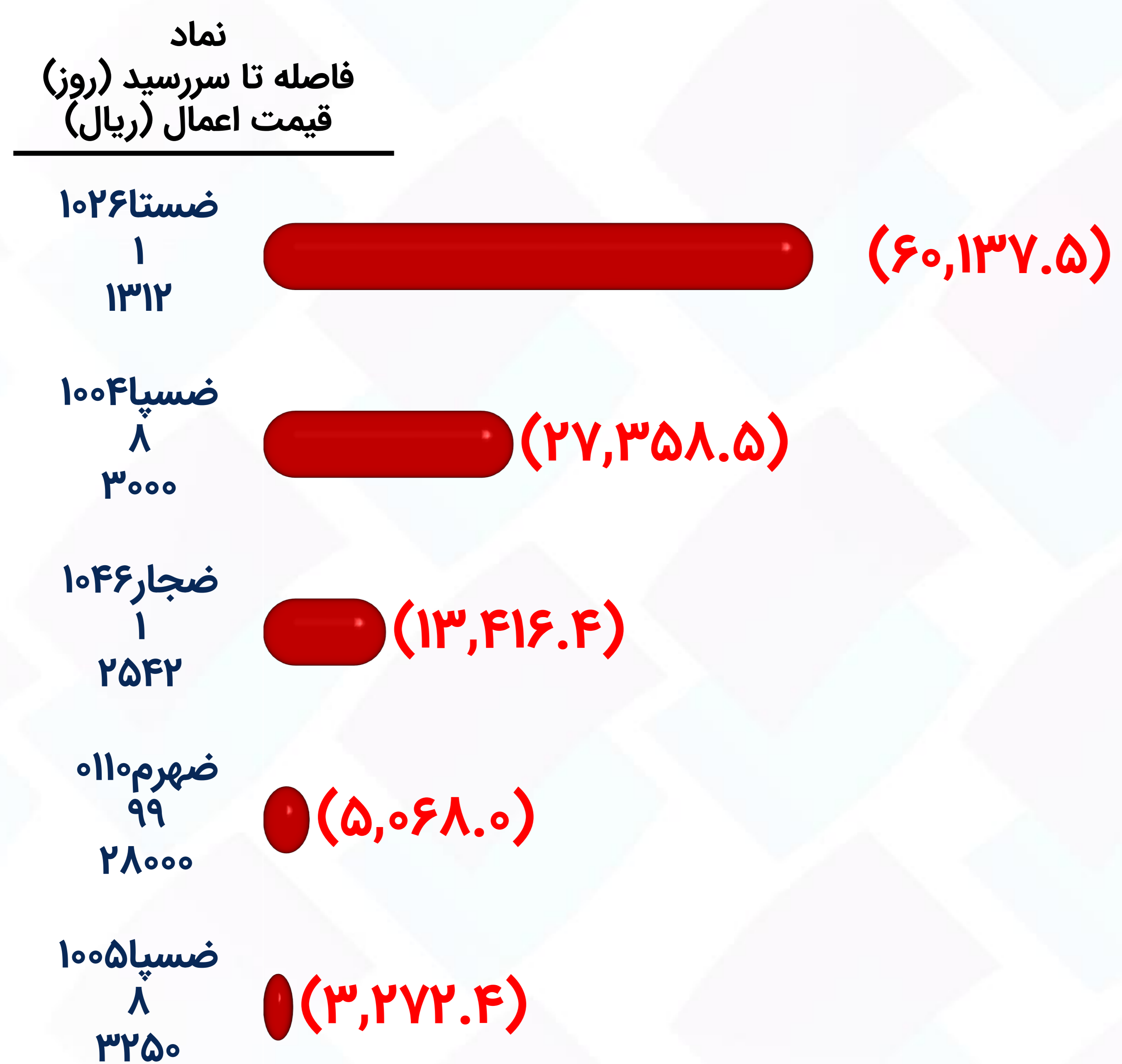
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

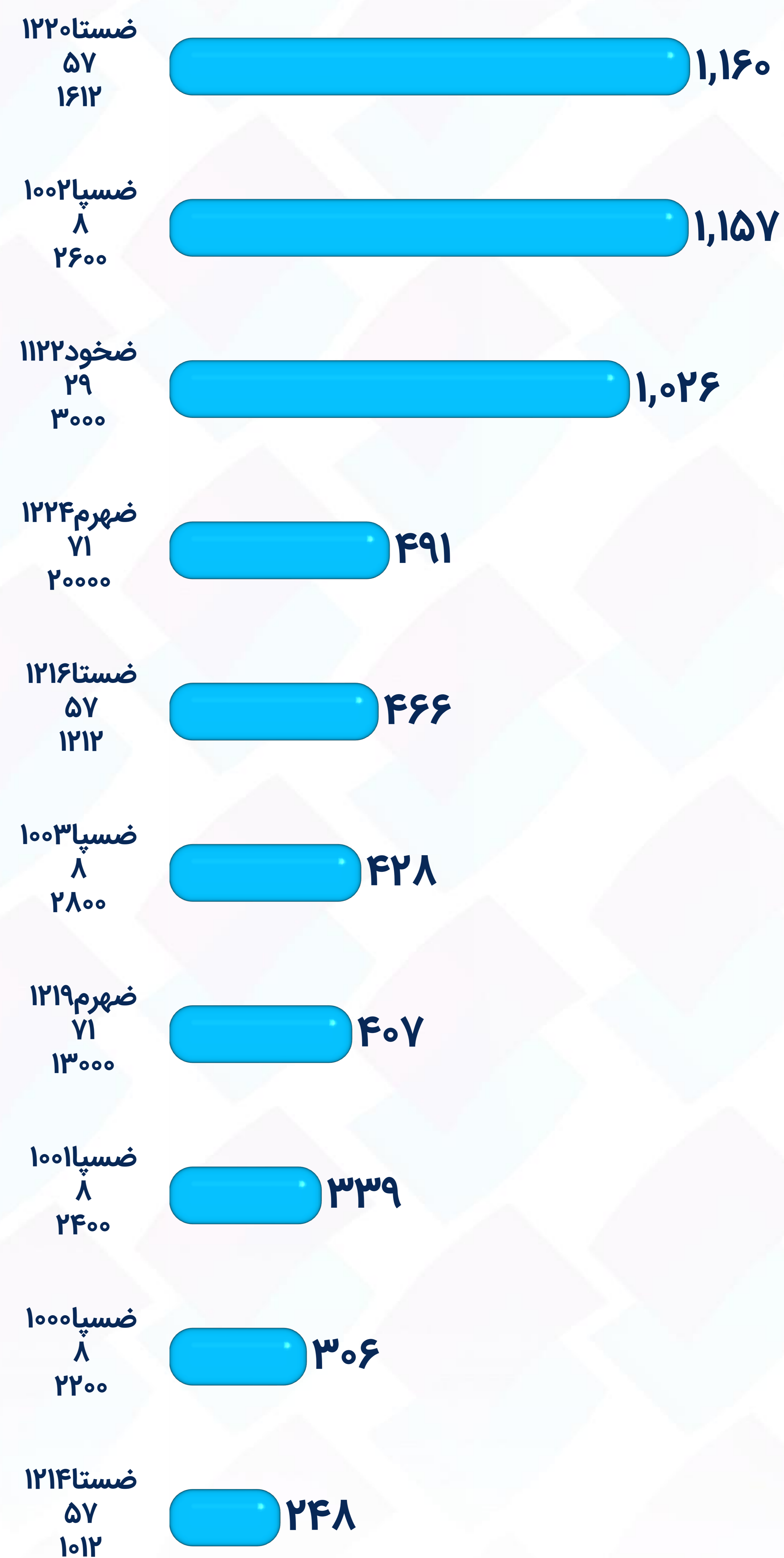


بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

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



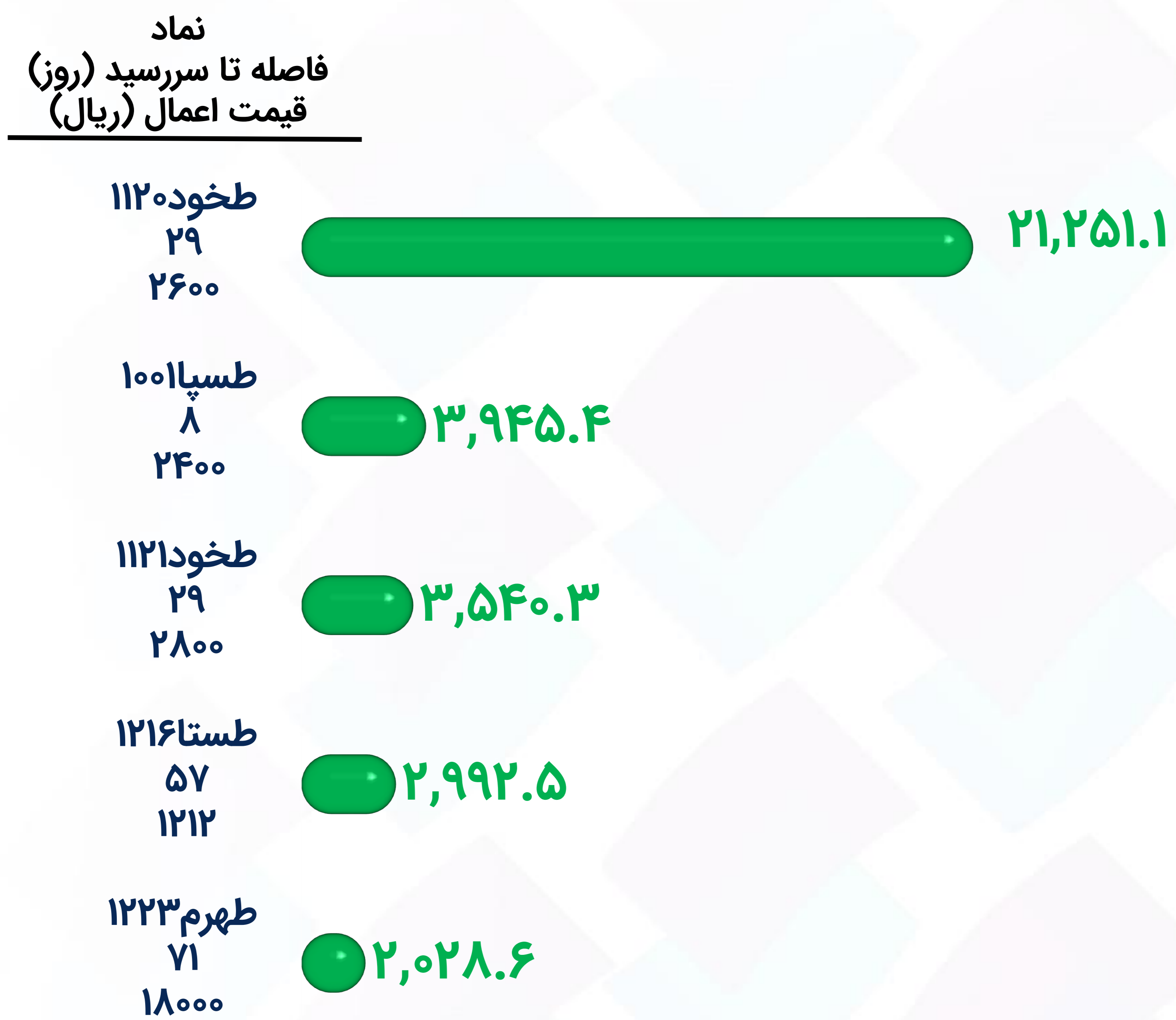
میلیون تومان

میلیون تومان

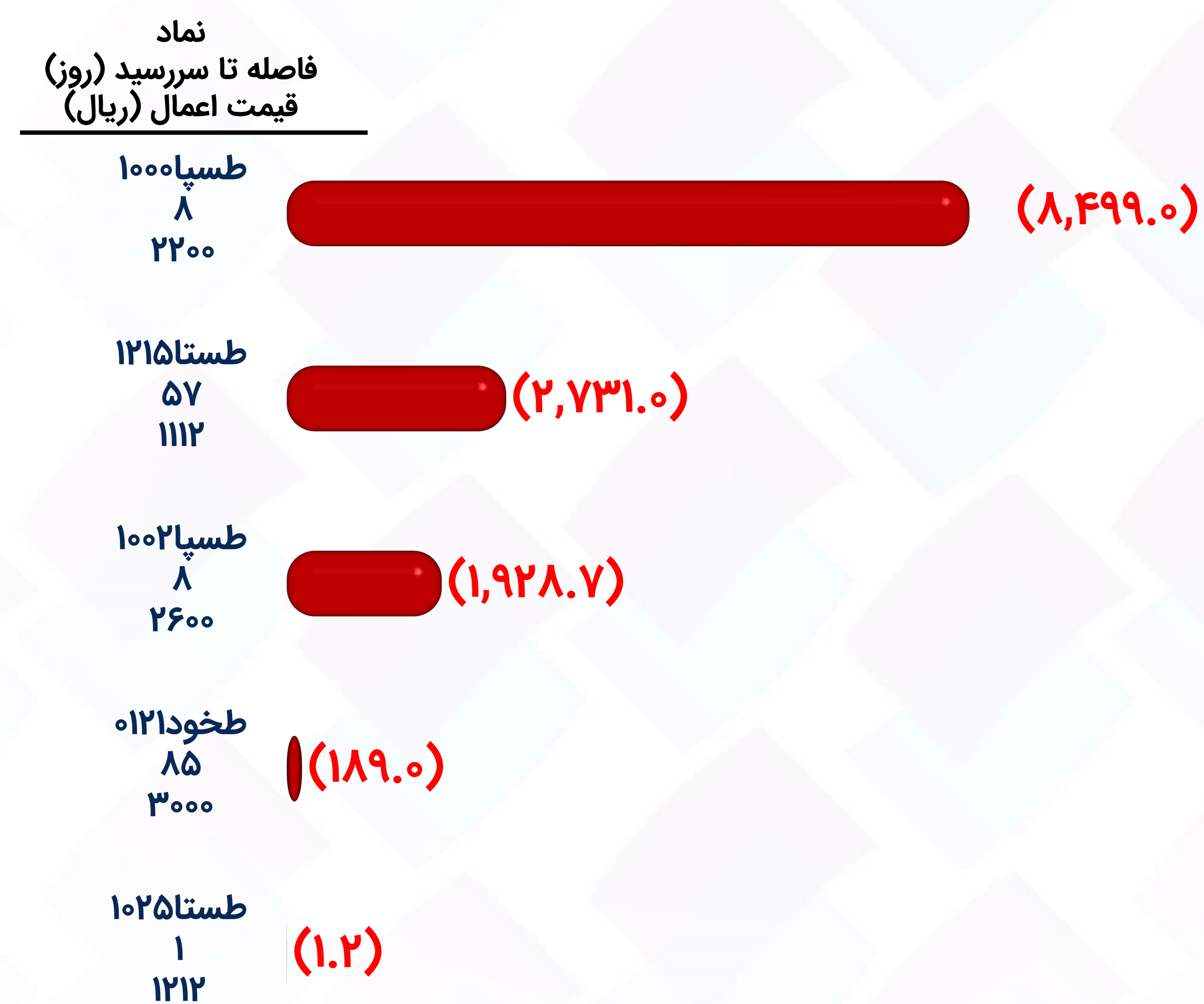
میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

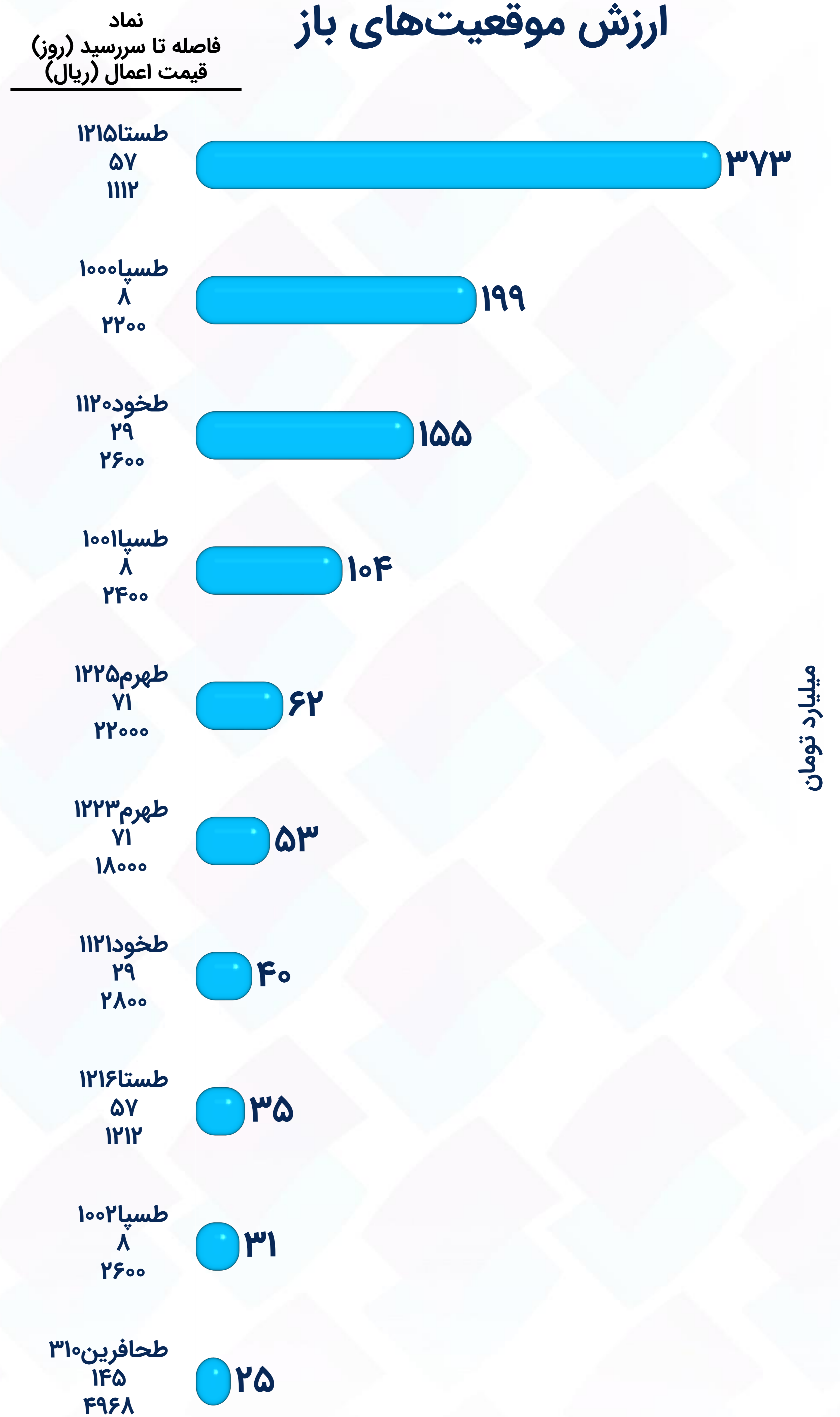
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

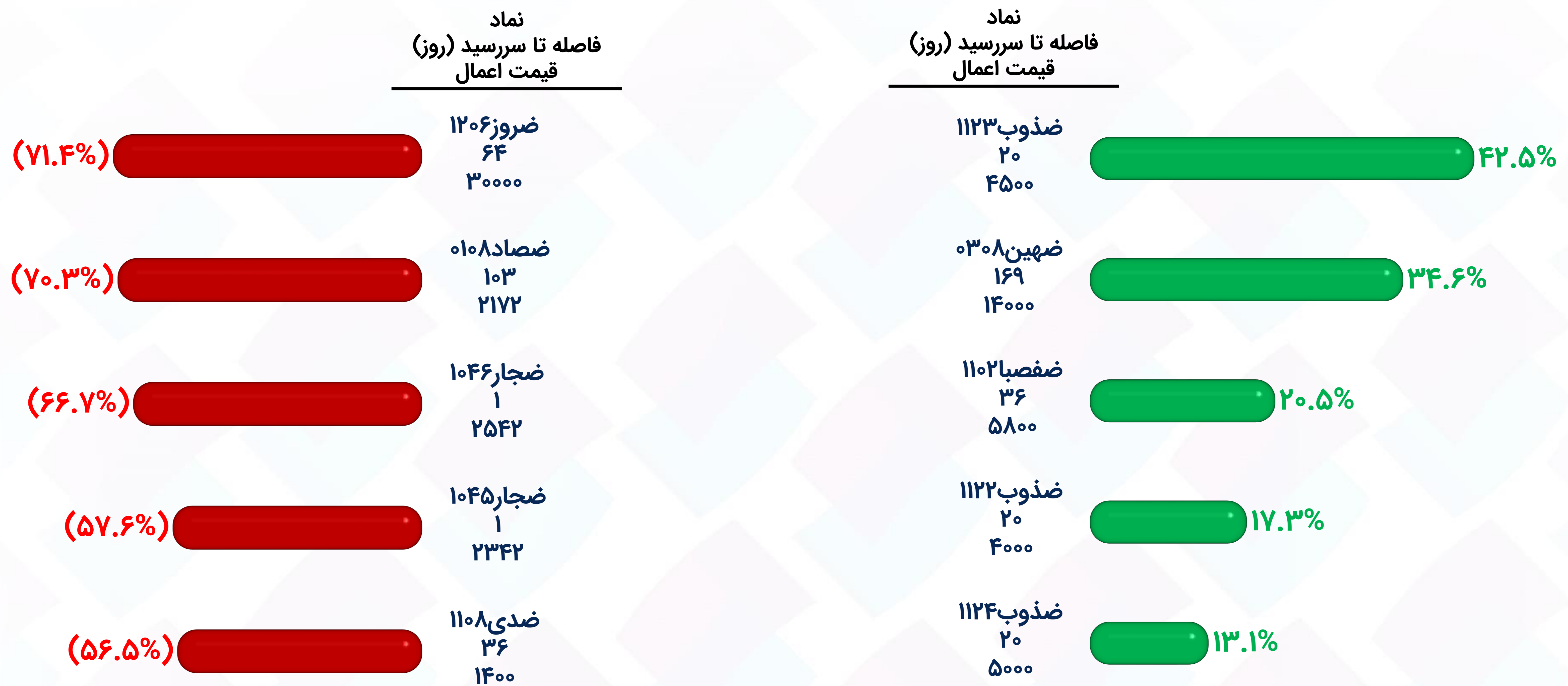


ارزش موقعیت‌های باز

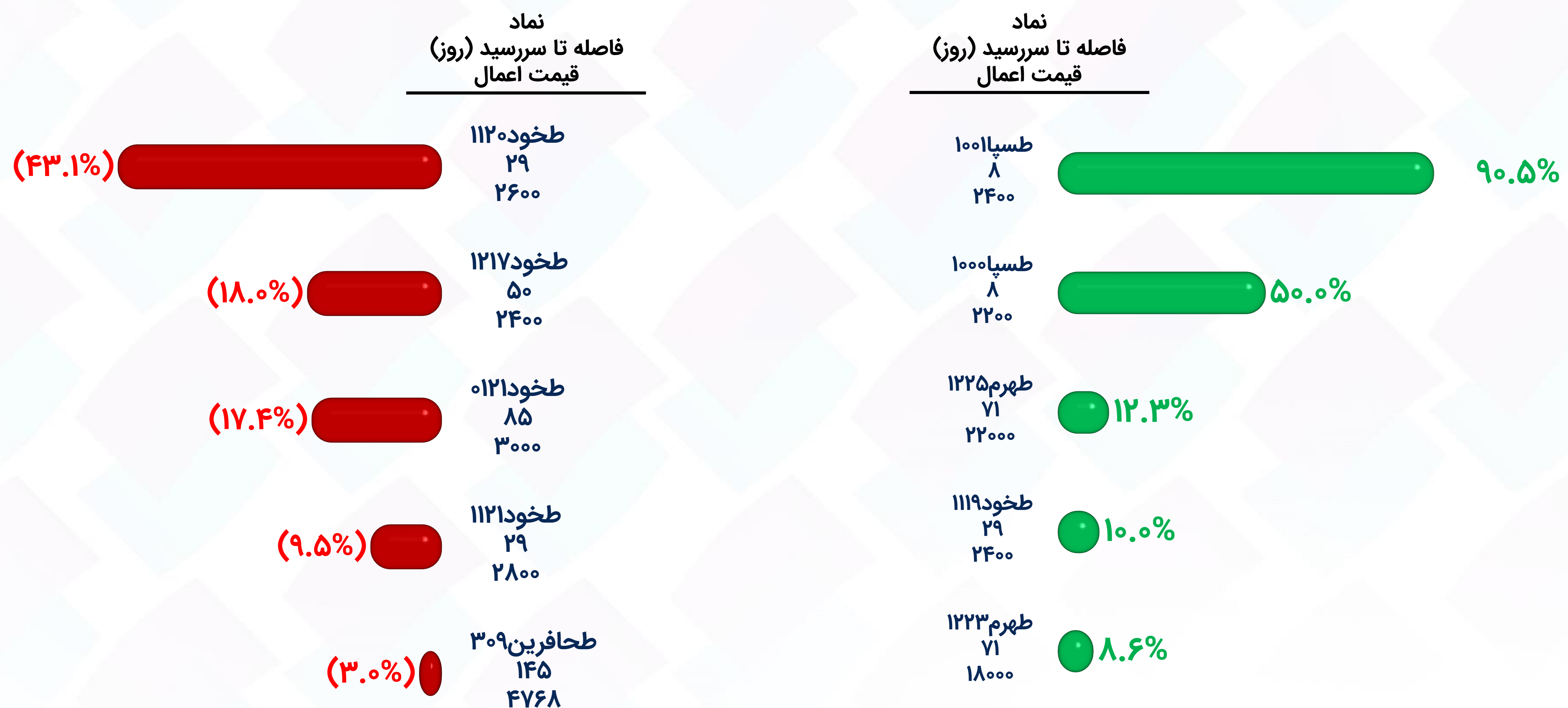


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



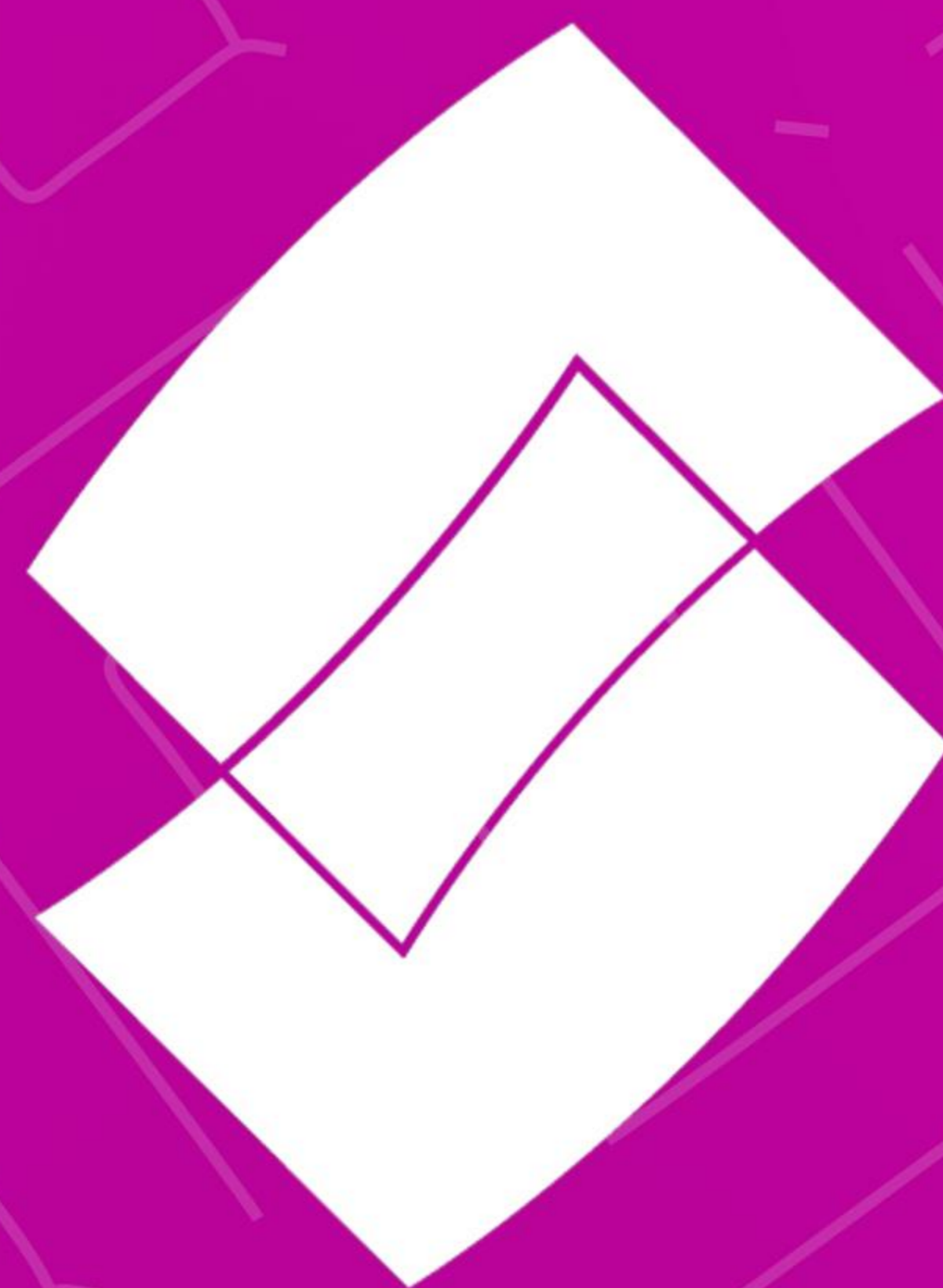
اختیار فروش



(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.