

شماره

۱۶۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ 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.

The screenshot shows the order entry interface for '1225 - مجاز'. At the top, there's a search bar with the symbol and a price change indicator (+2,694 0 (0%)). Below it are buttons for 'فروش' (Sell) and 'خرید' (Buy). A table displays market data with columns for 'تعداد' (Quantity), 'حجم' (Volume), 'فروش' (Sell), and 'خرید' (Buy). The 'خرید' column shows a volume of 1,000 for a quantity of 1. To the right, there's a summary table with rows for 'حجم معاملات', 'وجه تضمین', 'اندازه قرارداد', and 'آخرین اطلاعات ق'. Below that is a 'نمایش کامل عمق بازار' (Full Market Depth) section with a table showing 'اولین قیمت', 'قیمت اعمال', 'آستانه تعداد', and 'روزهای مانده تا سررسید'.

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.

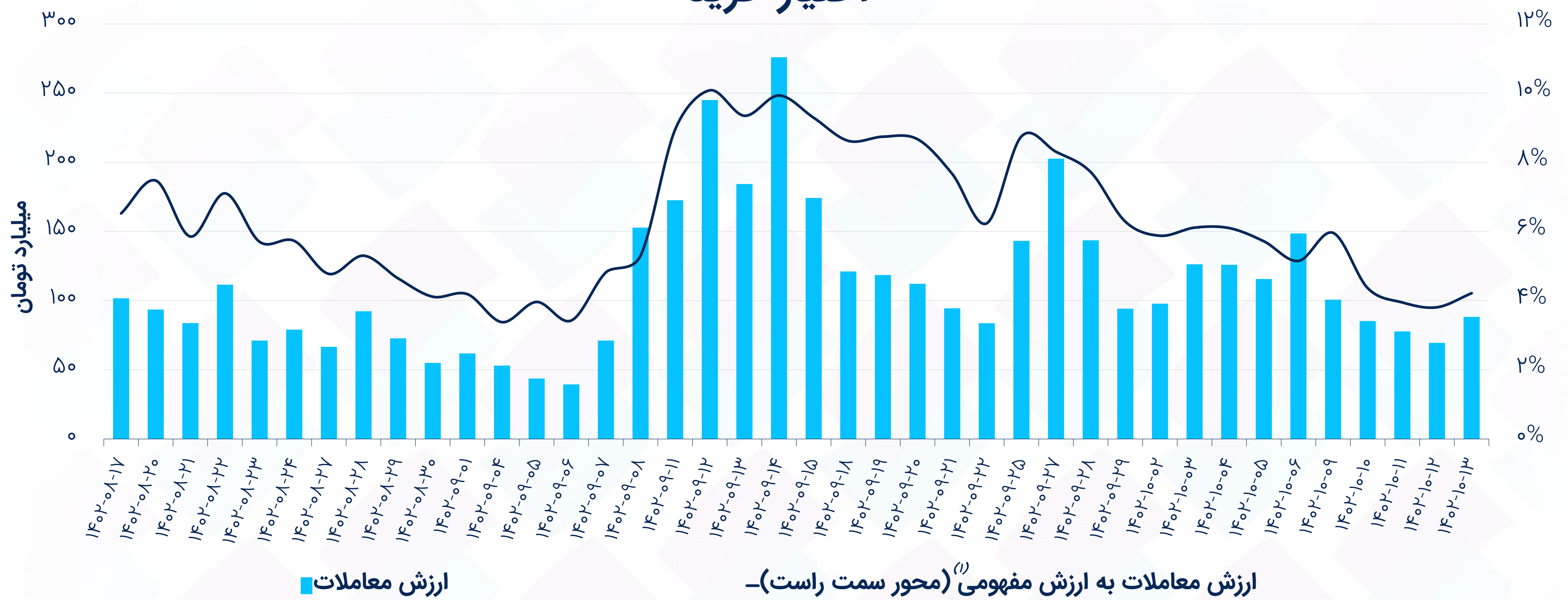
همچنین در صورت تمایل می‌توانید از طریق نوار آبی رنگ سمت راست -> قسمت تنظیمات -> سفارش، می‌توانید پیام‌های مرتبط با بخش سفارش (تصویر روبه‌رو) را شخصی‌سازی نمایید.

This screenshot shows the order entry details. On the left, there are input fields for 'قیمت' (Price) with a value of 500,000, 'تعداد' (Quantity) with a value of 1, and 'سرمایه' (Capital) with a value of 2,759,480. On the right, there's a table with columns for 'تعداد', 'حجم', 'فروش', 'خرید', 'حجم', and 'تعداد'. The 'خرید' column shows a volume of 2,682 for a quantity of 1. Below the table, there are buttons for 'روز' (Day), 'معتبر تا لغو' (Valid until cancelled), 'معتبر تا تاریخ' (Valid until date), and 'اجرای فوری و حذف' (Immediate execution and cancellation).

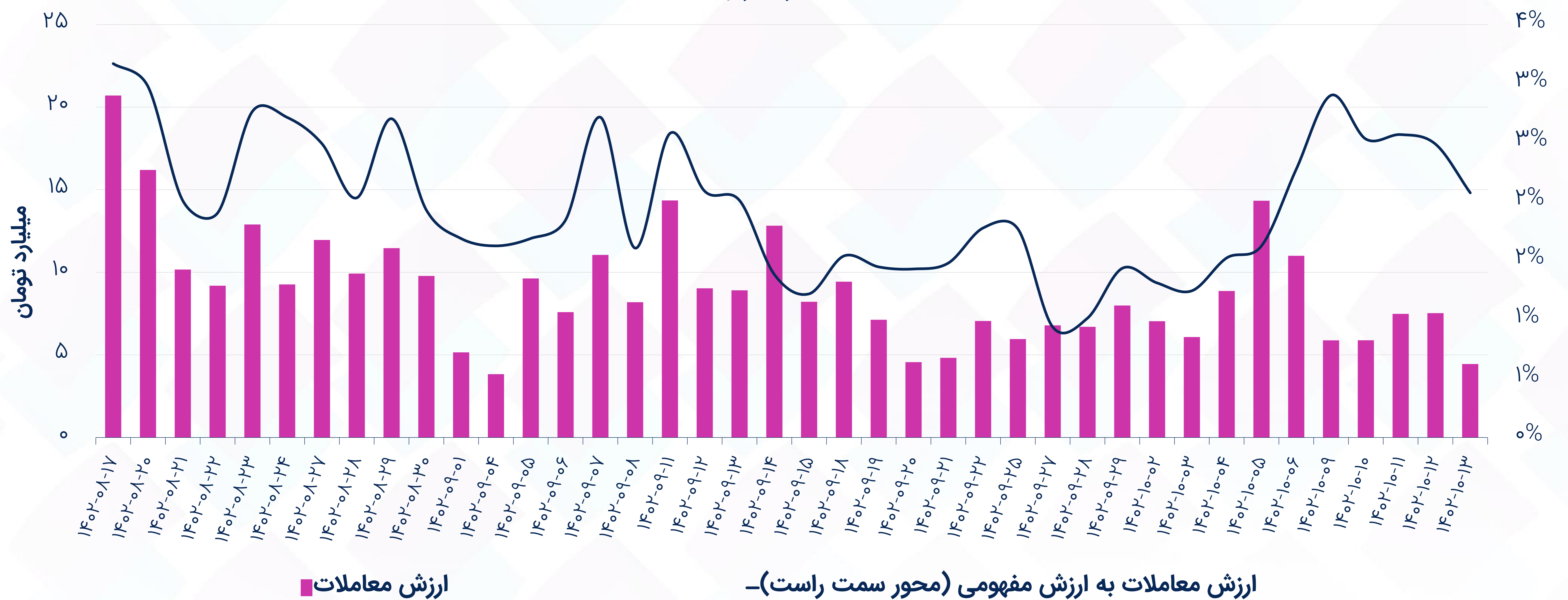
This screenshot shows the notification settings for orders. It includes a title 'سفارش' (Order) and four toggle switches: 'پاک شدن اطلاعات سفارش پس از ارسال' (Clear order information after submission), 'فعال شدن سفارش خرید با کلیک روی مظنه فروش و بالعکس' (Activate buy order when clicking on sell quote and vice versa), 'نمایش پیام تأیید پیش از حذف سفارش' (Show confirmation message before deleting order), and 'نمایش پیام تأیید پیش از ارسال سفارش' (Show confirmation message before submitting order). There is also a 'فعال شدن اعلان نوتیفیکیشن' (Activate notification alert) toggle.

ارزش معاملات

اختیار خرید



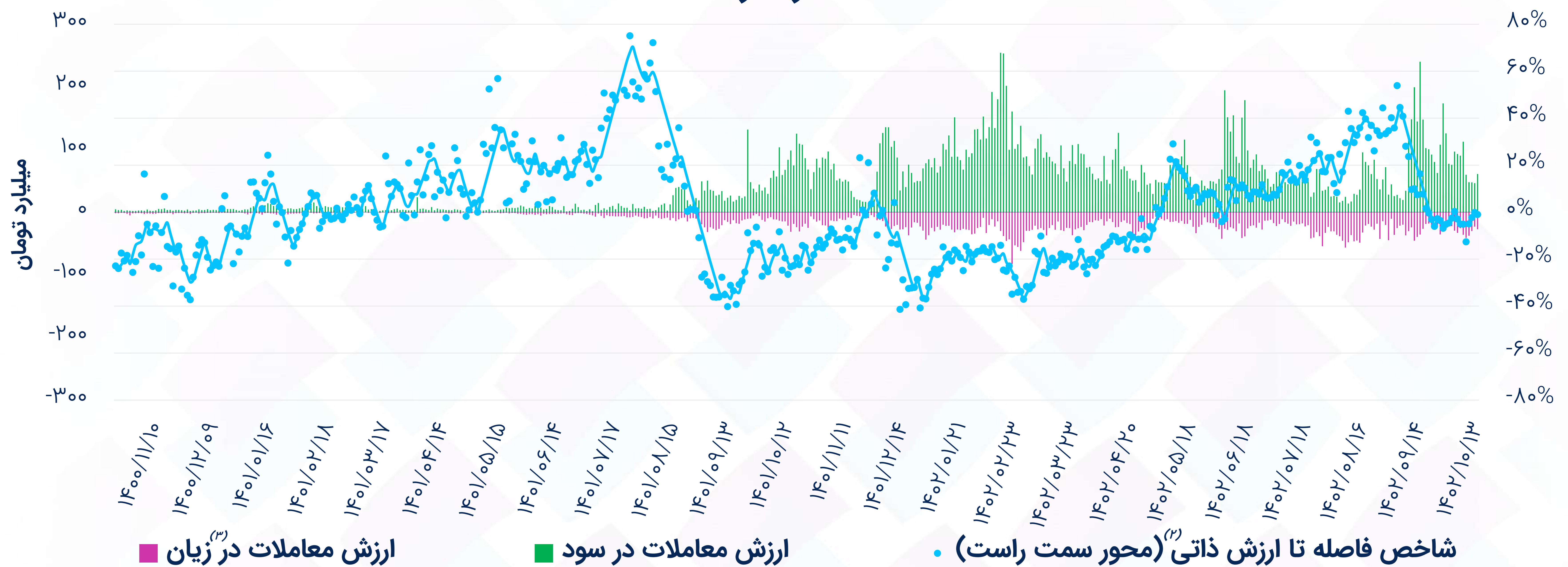
اختیار فروش



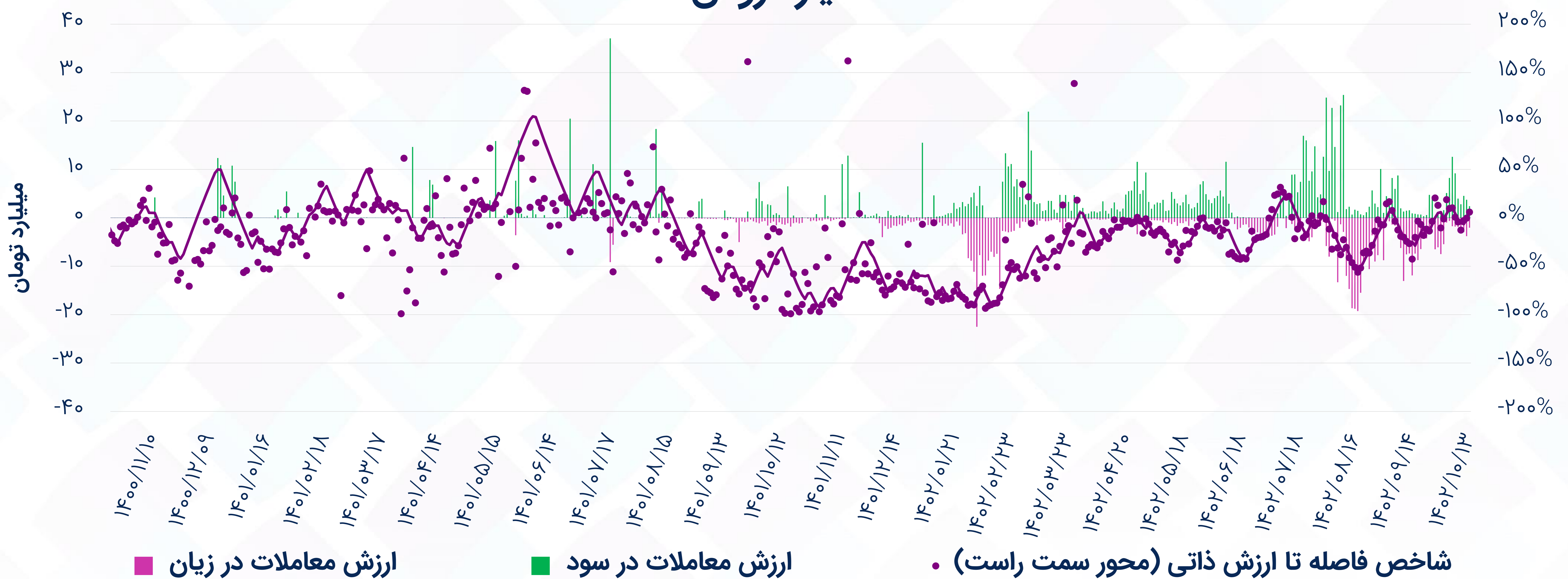
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

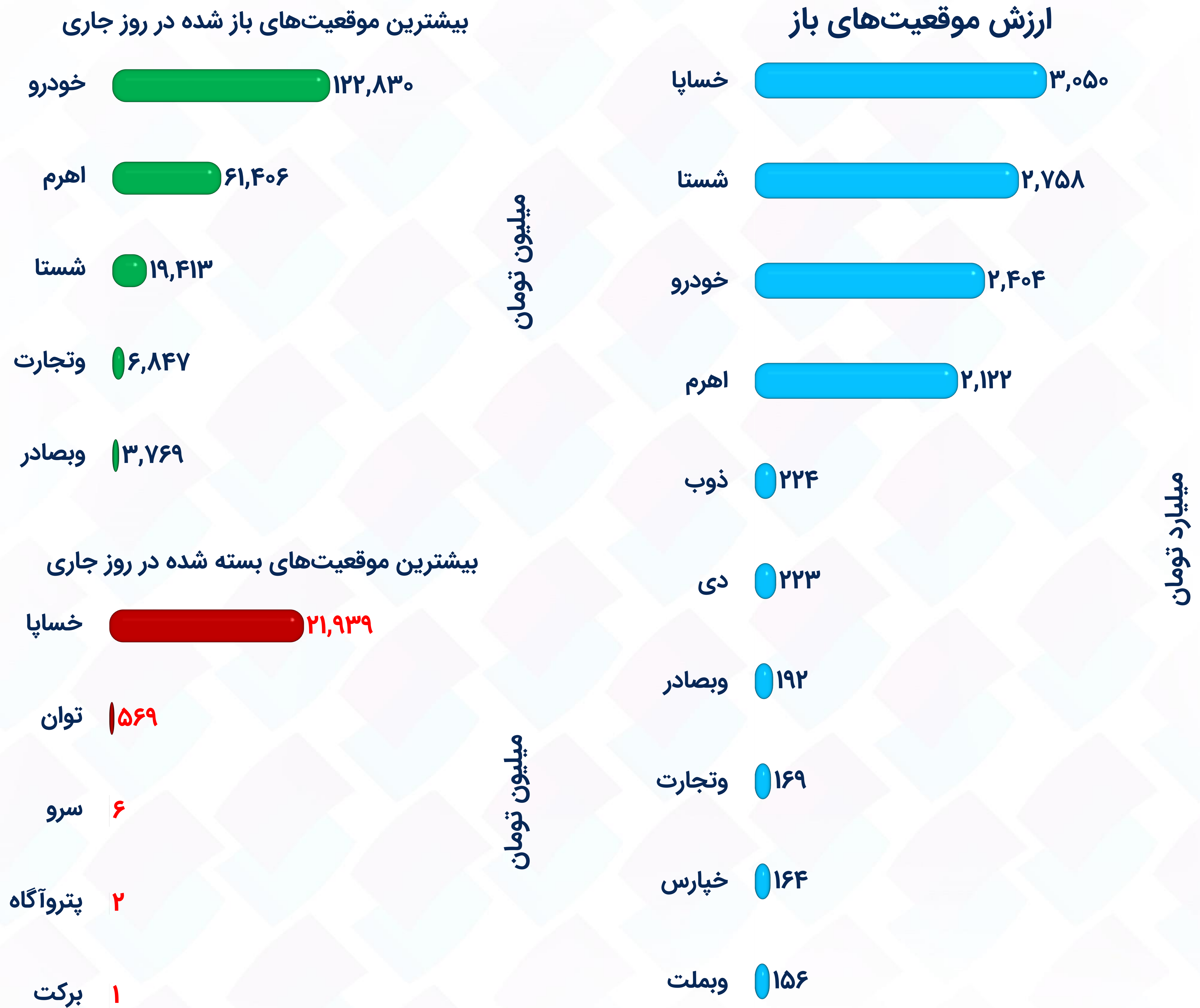
اختیار خرید

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	۳۱.۹	۸۷۲.۰	۱۲.۷	۱۹.۲	(۷.۰%)
اهرم	۲۳	۲۵.۵	۱۲۶.۸	۲۳.۵	۲.۰	(۵.۷%)
حسابا	۲۴	۱۸.۲	۹۱۱.۲	۱۴.۳	۴.۰	۱۷.۷%
شستا	۲۳	۶.۱	۱۲۲.۸	۴.۵	۱.۶	(۱۶.۱%)
وتجارت	۲۰	۱.۸	۲۱.۸	۱.۷	۰.۲	۱.۶%
ذوب	۵	۱.۷	۱۵.۷	۱.۶	۰.۱	۷.۱%
بساما	۳	۰.۸	۳.۹	۰.۷	۰.۰	(۱۰.۸%)

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	۲,۱۹۶.۰	۱۳۵,۷۵۳.۵	۹۶۱.۸	۱,۲۳۴.۲	۱۹.۰%
حسابا	۴	۱,۴۳۲.۲	۵۴,۱۲۷.۵	۹۰۳.۹	۵۲۸.۳	(۹.۲%)
اهرم	۴	۵۸۶.۴	۸,۴۵۲.۷	۵۳۴.۷	۵۱.۶	۱۱.۲%
شستا	۶	۲۳۳.۴	۱۶,۱۷۴.۰	۰.۴	۲۳۲.۹	(۳۸.۲%)

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



ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

میلیارد 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
۱۴۸۸%	۸۱۰	۰.۲۹	۵۱۰.۸	۲۷.۶%	۲۶,۰۵۱	۲۰,۴۱۰	۵۱	۹.۱	۹۸	۲۶,۰۰۰	اهرم
۱۳۱۲%	۹۳۲	۰.۶۳	۹۶.۵	(۱.۳%)	۶,۳۶۶	۶,۴۵۰	۶۶	۲.۰	۳۵	۶,۳۰۰	فصبا
۱۴۵%	۸۶	۰.۱۵	۲۸۶.۷	۲۱.۹%	۱۰,۰۳۵	۸,۲۳۰	۳۵	۳.۰	۴۹	۱۰,۰۰۰	شپنا
۱۰۴%	۲,۶۱۹	۰.۸۴	۴.۷	(۵.۷%)	۶,۰۸۵	۶,۴۵۰	۱,۲۸۵	۳۵۶.۹	۱۵۸	۴,۸۰۰	فصبا
۸۷%	۱,۹۰۷	۰.۸۹	۵.۷	(۹.۷%)	۵,۸۲۲	۶,۴۵۰	۱,۰۲۲	۱۹۰.۲	۳۵	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	۳,۲۵۱.۰	۳۳%	۳,۲۵۱	۲,۴۴۳	۱	۶.۸	۷	۳,۲۵۰	خسپا
(۹۹%)	۲	۰.۰۰	۱۹۱.۹	۱۰۷%	۴۲,۲۲۰	۲۰,۴۱۰	۲۲۰	۳.۶	۷۰	۴۲,۰۰۰	اهرم
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۶۶۷.۷	۴۵%	۴,۰۰۶	۲,۷۵۵	۶	۳.۷	۲۸	۴,۰۰۰	خودرو
(۹۸%)	۰	۰.۰۰	۳,۰۰۱.۰	۲۳%	۳,۰۰۱	۲,۴۴۳	۱	۲۰.۴	۷	۳,۰۰۰	خسپا
(۹۸%)	۱	۰.۰۱	۹۱.۹	۶۶%	۴,۰۴۴	۲,۴۴۳	۴۴	۱.۳	۷۰	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

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
۳۹.۶%	۴۲	-۰.۲۲	۸۵.۷	(۷%)	۲,۵۷۰	۲,۷۵۵	۳۰	۱,۱۹۱.۶	۲۸	۲,۶۰۰	طخود ۱۱۲۰
۱۴.۱%	۴۴۴	-۰.۷۹	۶.۷	۷%	۲,۶۱۱	۲,۴۴۳	۳۸۹	۱۹۶.۹	۷۰	۳,۰۰۰	طسپا ۱۲۲۳
۱۳.۷%	۴۷۵	-۰.۱۸	۴۲.۱	(۱۴%)	۱۷,۵۸۲	۲۰,۴۱۰	۴۱۸	۵۱.۵	۷۰	۱۸,۰۰۰	طهرم ۱۲۲۳
۱۲.۰%	۳,۲۶۳	-۰.۶۵	۷.۲	۳%	۲۱,۰۸۷	۲۰,۴۱۰	۲,۹۱۳	۱۱.۴	۷۰	۲۴,۰۰۰	طهرم ۱۲۲۶
۱۰.۹%	۲,۰۲۳	-۰.۴۹	۱۱.۱	(۱%)	۲۰,۱۷۶	۲۰,۴۱۰	۱,۸۲۴	۵۲۳.۴	۷۰	۲۲,۰۰۰	طهرم ۱۲۲۵

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
(۵۵.۴%)	۷	-۰.۰۹	۷۳.۱	(۱۳%)	۱,۰۹۷	۱,۲۴۷	۱۵	۱۴۰.۶	۵۶	۱,۱۱۲	طستا ۱۲۱۵
(۳۱.۶%)	۲۱	-۰.۱۰	۷۹.۰	(۱۴%)	۲,۳۷۰	۲,۷۵۵	۳۰	۴۰.۸	۴۹	۲,۴۰۰	طخود ۱۲۱۷
(۱۴.۴%)	۱۵۴	-۰.۸۱	۱۳.۴	(۱%)	۲,۴۲۰	۲,۴۴۳	۱۸۰	۷۰۶.۹	۷	۲,۶۰۰	طسپا ۱۰۰۲
(۱۴.۳%)	۲	-۰.۰۳	۱,۰۹۹.۰	(۱۰%)	۲,۱۹۸	۲,۴۴۳	۲	۷.۳	۷	۲,۲۰۰	طسپا ۱۰۰۰
(۱۱.۸%)	۲۶	-۰.۲۶	۴۰.۸	(۵%)	۱,۱۸۳	۱,۲۴۷	۲۹	۹۱.۹	۵۶	۱,۲۱۲	طستا ۱۲۱۶

(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

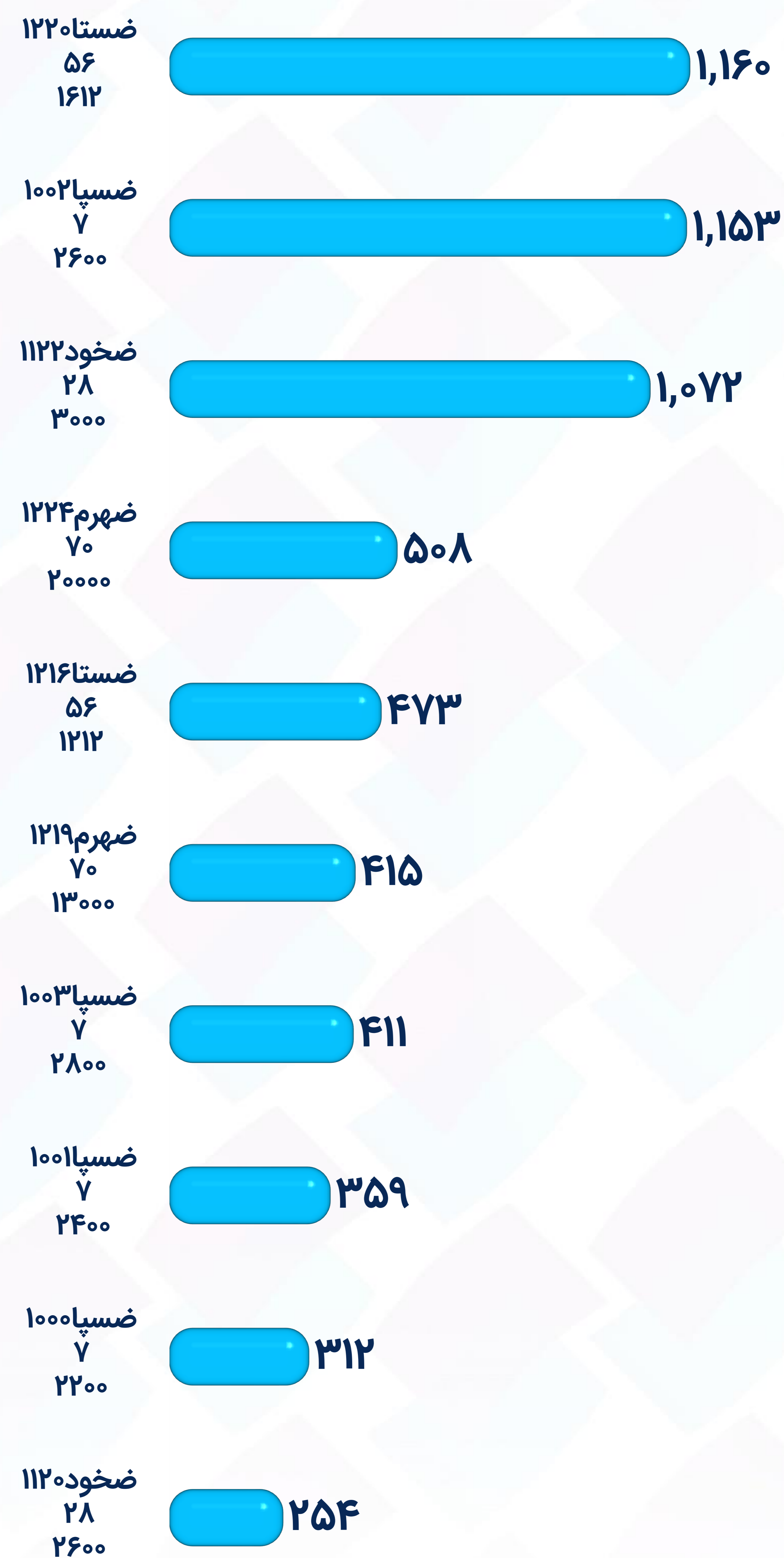


بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیون تومان

میلیون تومان

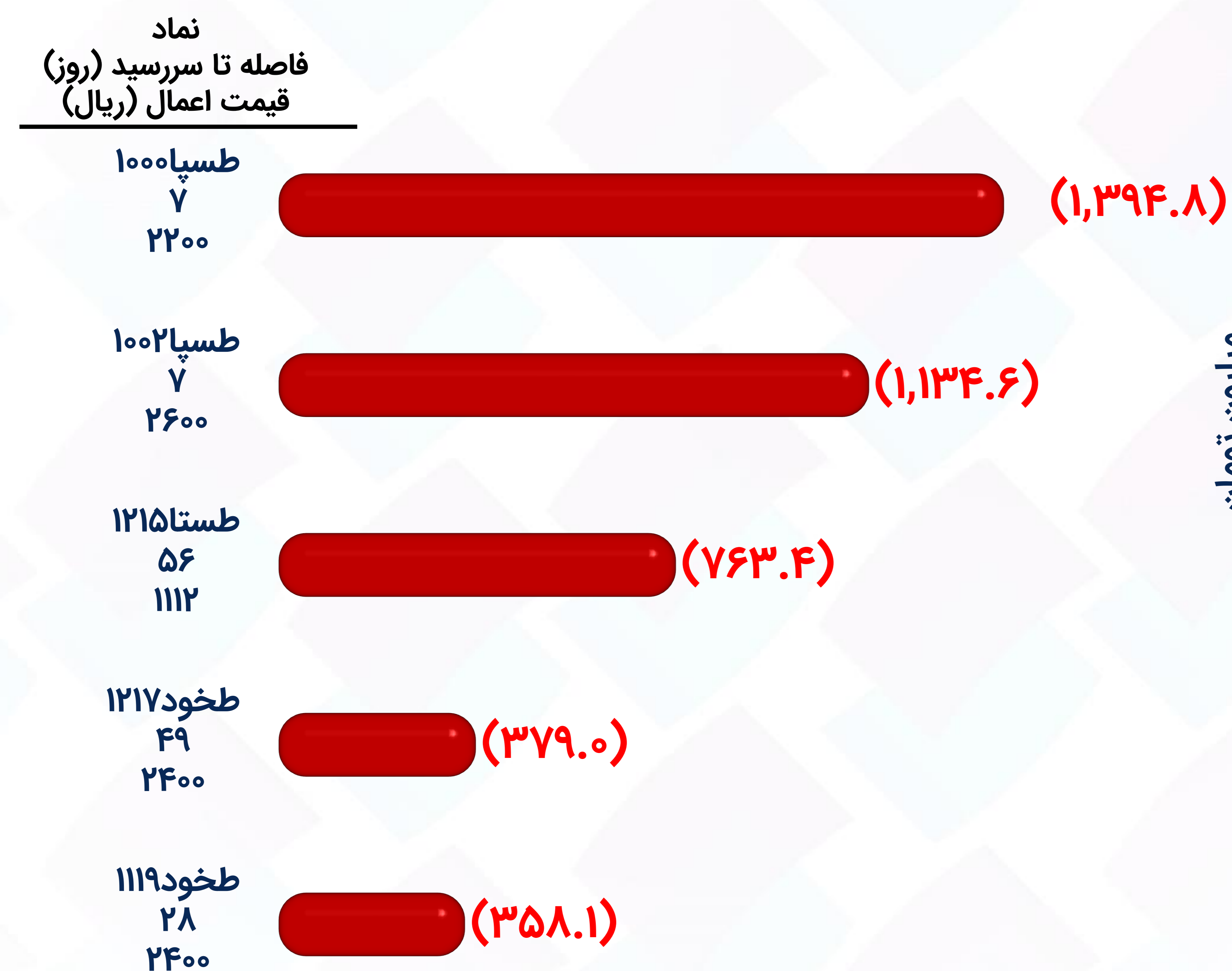
میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



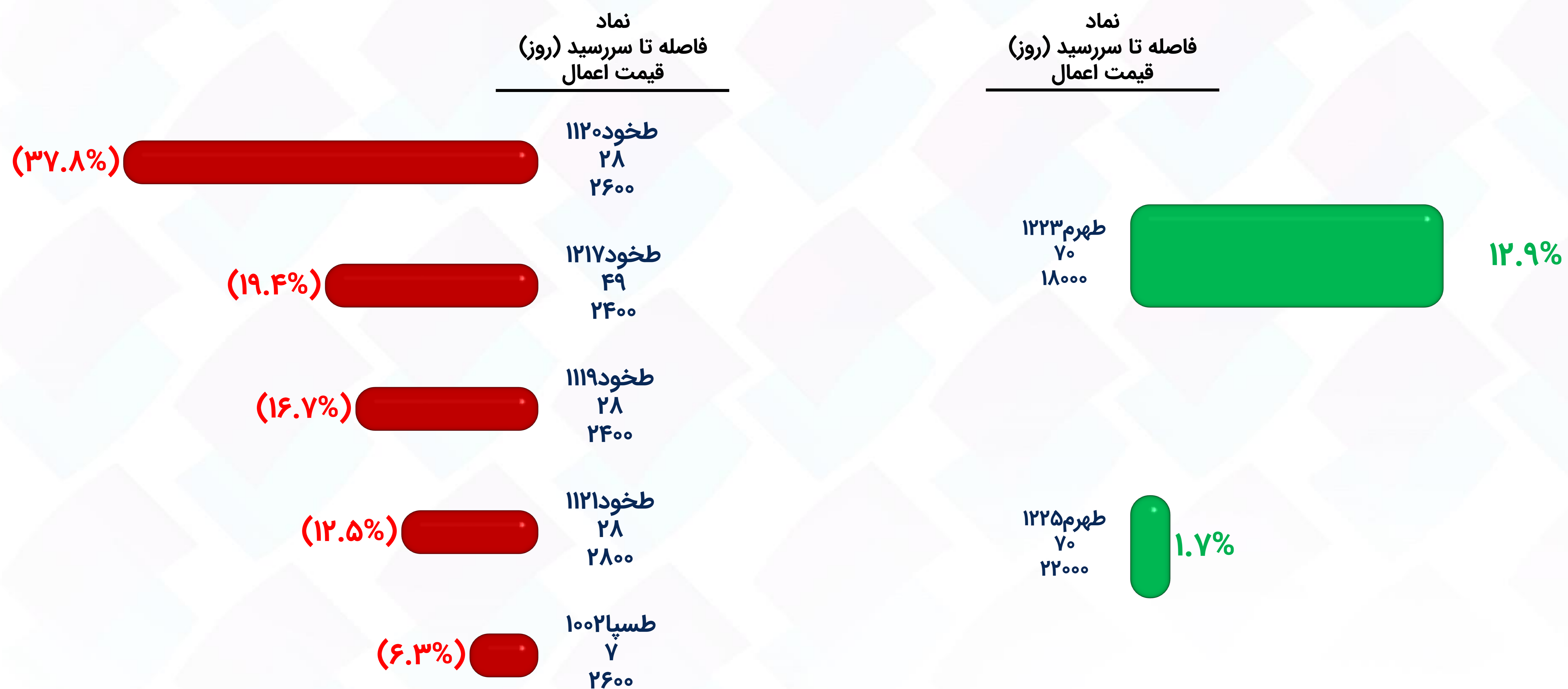
میلین تومن

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



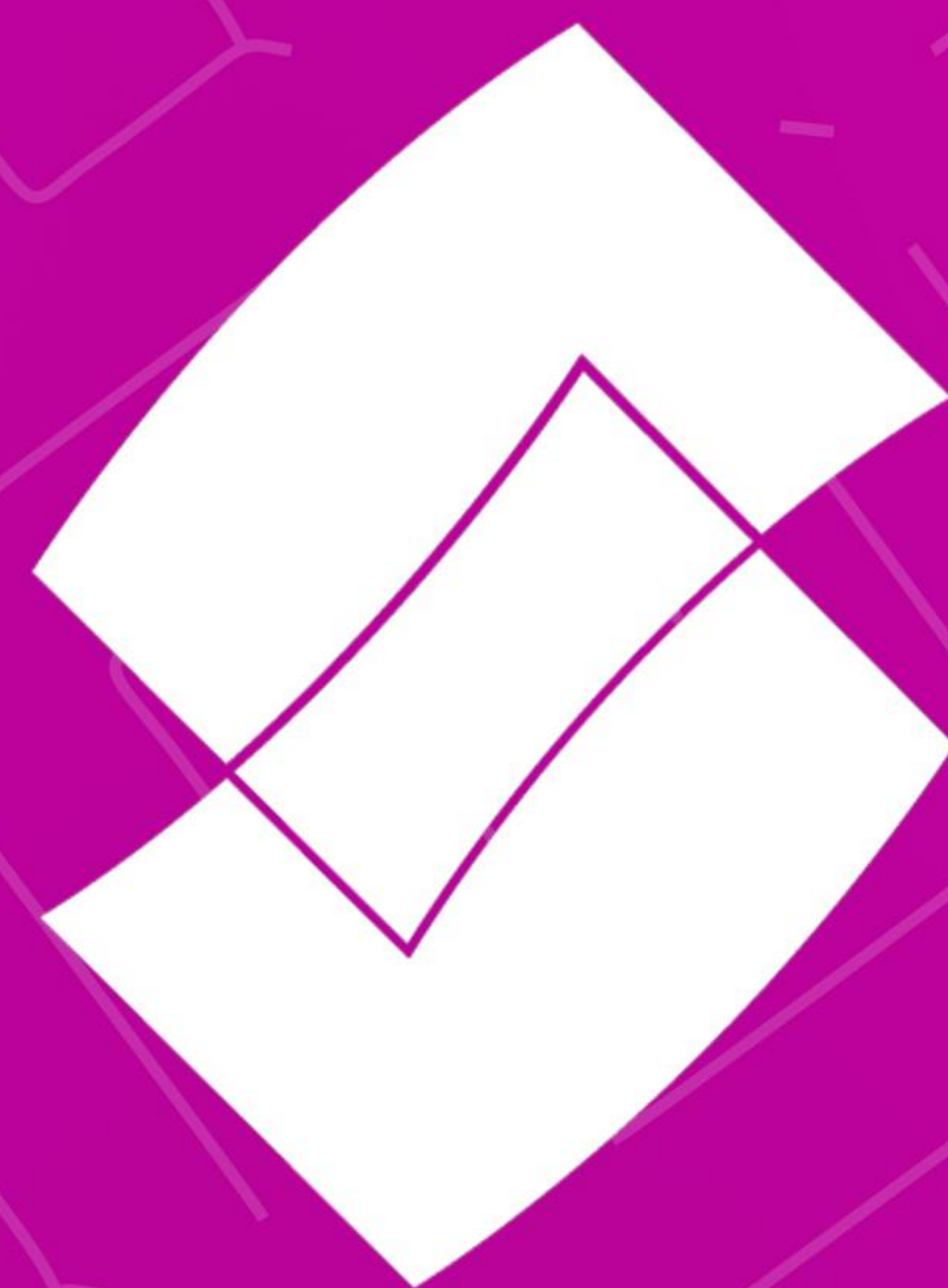
اختیار فروش



(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.