

شماره

۱۵۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ 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



نئوکارگزاری نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage



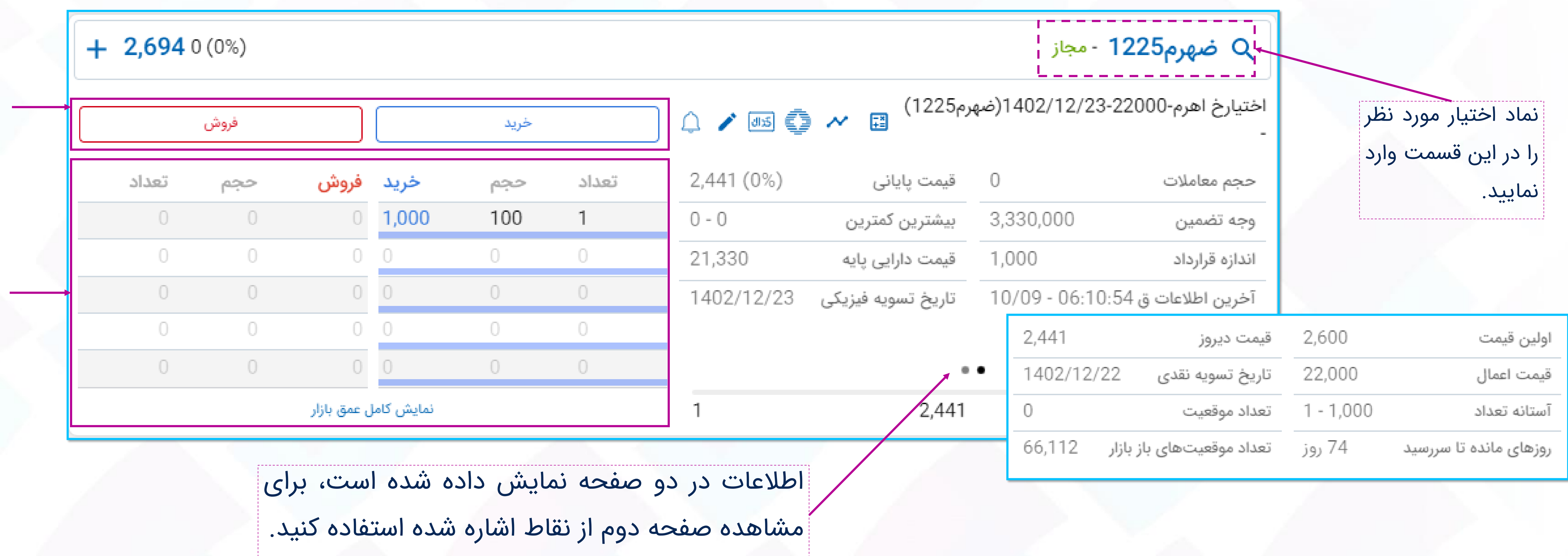
ارسال سفارش خرید/فروش در سامانه صحرا

آموزش
قسمت ۶۲

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.



صفحه سفارش‌گذاری:

بعد از باز شدن صفحه سفارش‌گذاری می‌توانید با کمک ابزارهای موجود در صفحه خرید و فروش انجام دهید. در ساده ترین 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 شخصی سازی نمایید.



سفارش

پاک شدن اطلاعات سفارش پس از ارسال

نمایش پیام تأیید پیش از حذف سفارش

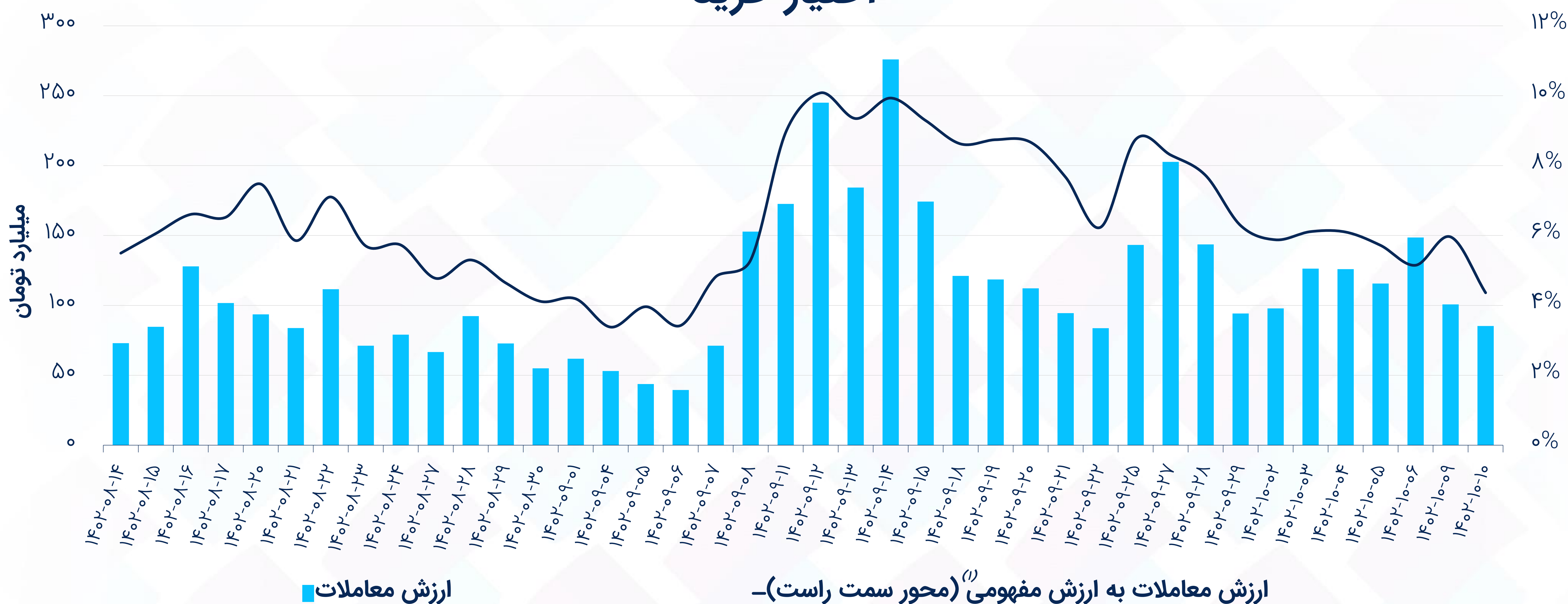
فعال شدن سفارش خرید با کلیک روی مظنه فروش و بالعکس

نمایش پیام تأیید پیش از ارسال سفارش

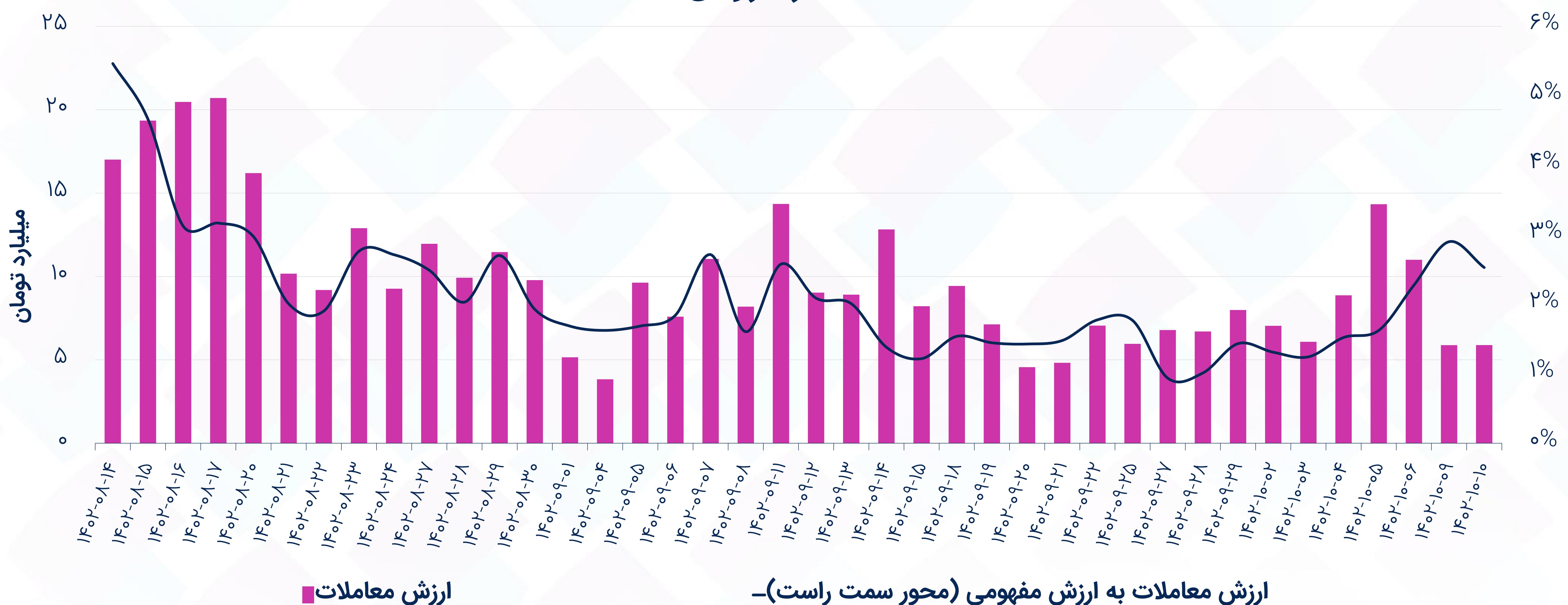
فعال شدن اعلان نوتیفیکیشن

ارزش معاملات

اختیار خرید



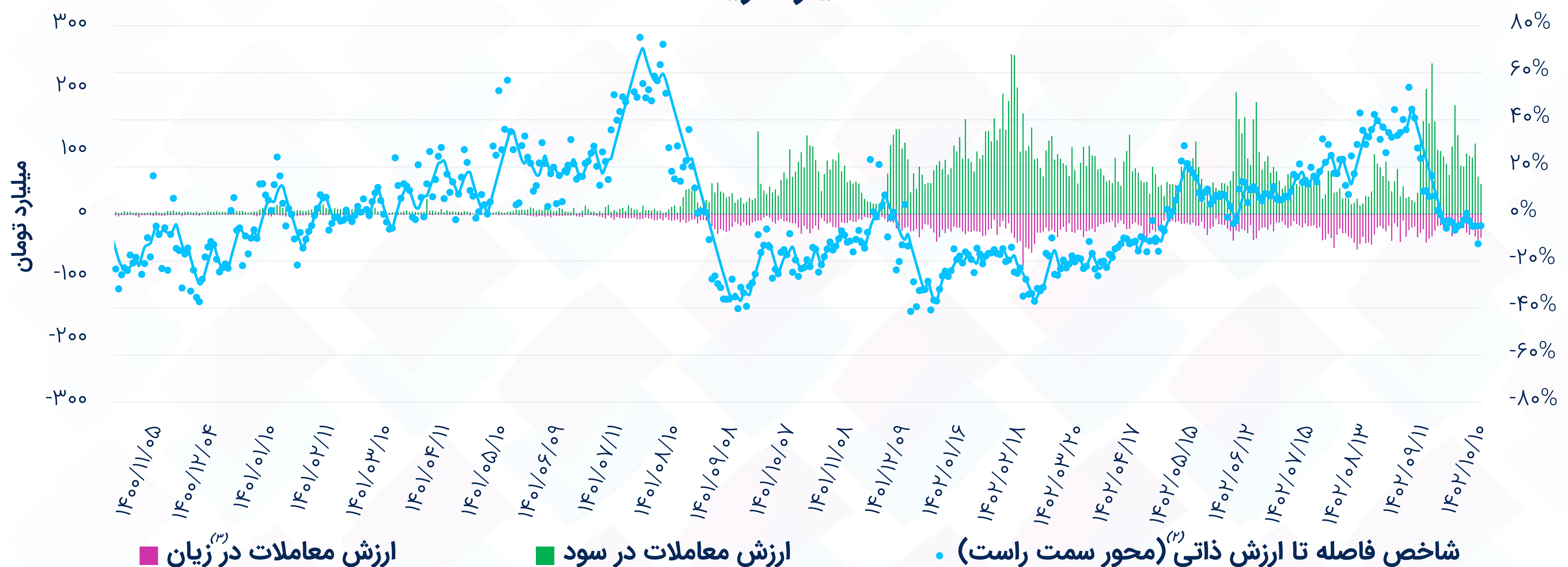
اختیار فروش



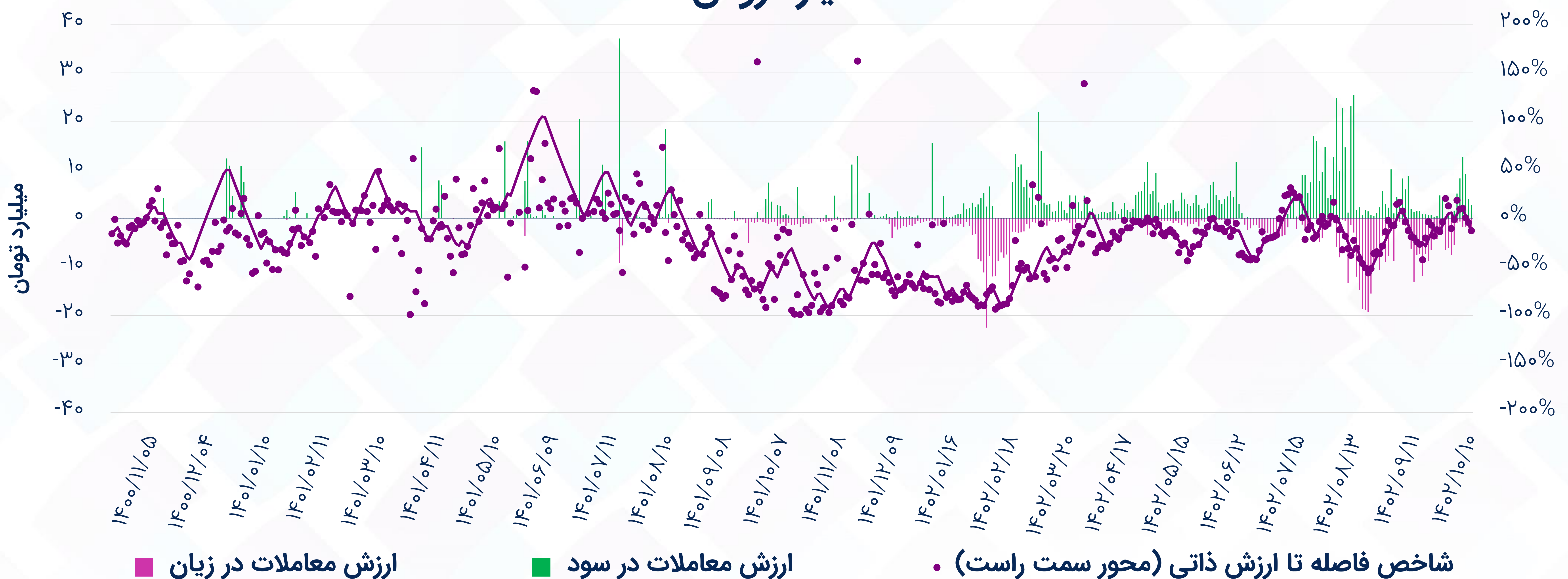
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

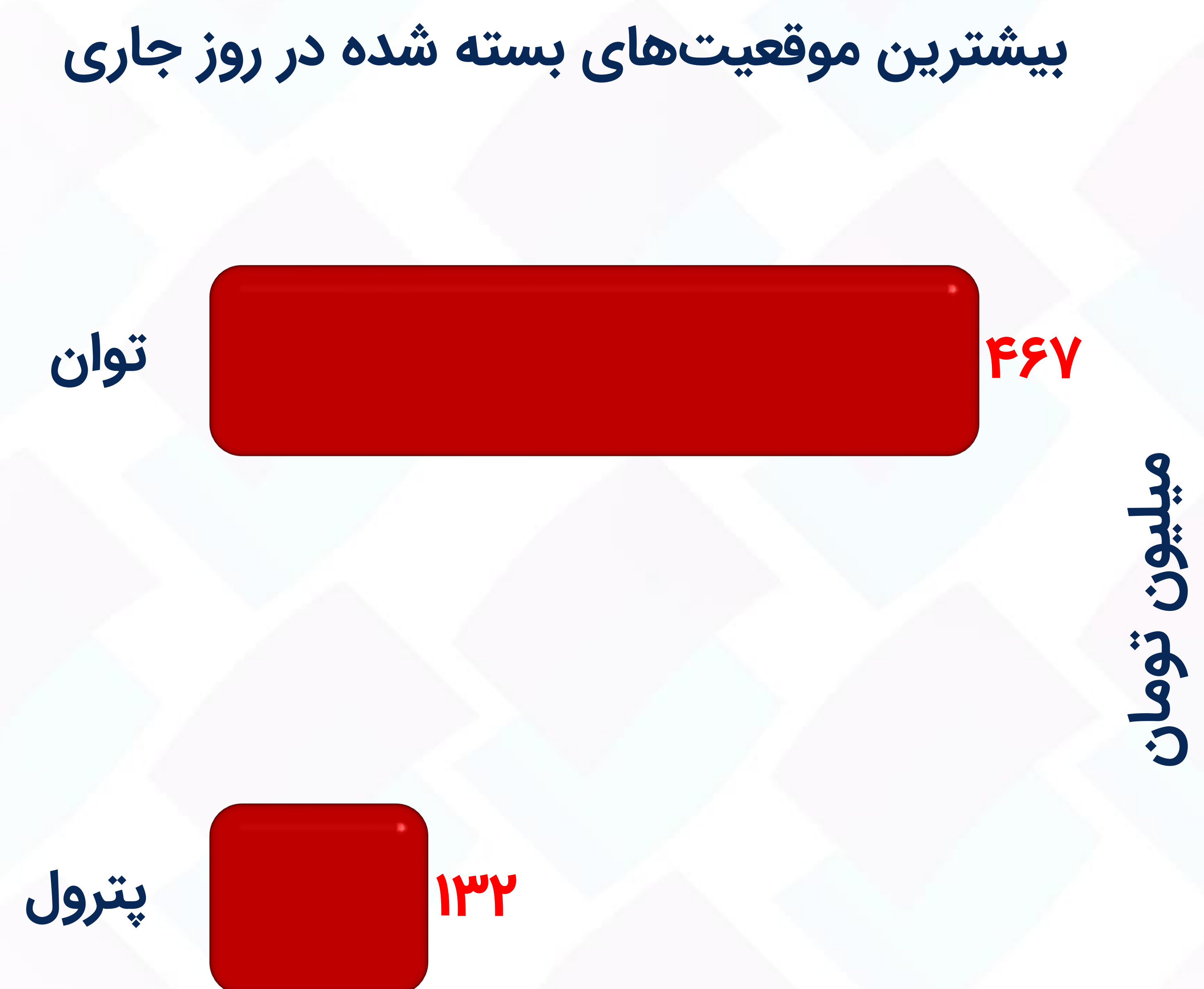
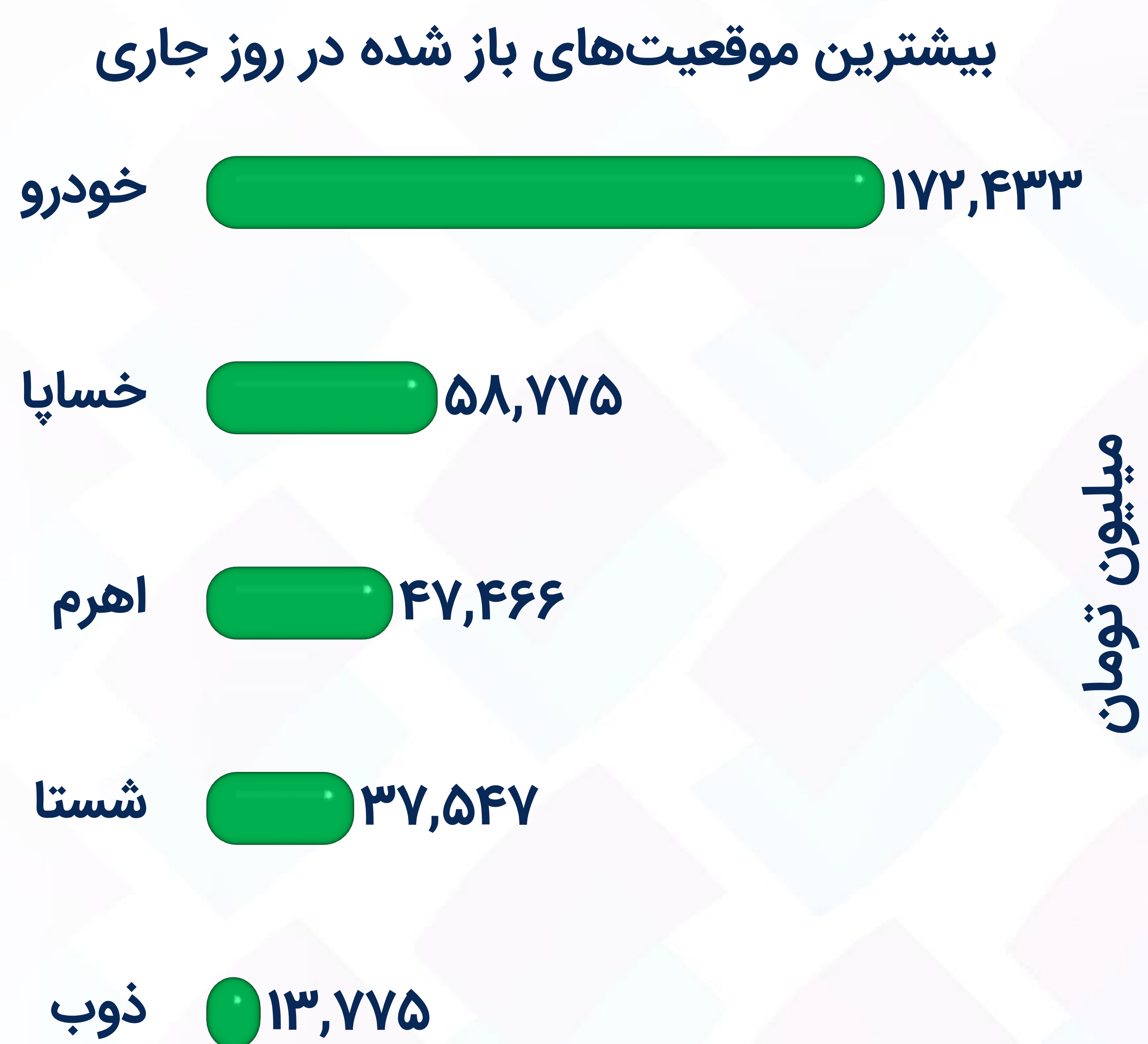
اختیار خرید

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	۳۵.۳	۸۳۹.۹	۱۲.۲	۲۳.۱	(۱۱.۰%)
خسپا	۱۸	۱۷.۳	۷۴۸.۰	۸.۶	۸.۷	۱۲.۸%
اهرم	۲۰	۱۵.۴	۷۴.۶	۱۴.۱	۱.۴	(۴.۴%)
شستا	۱۷	۶.۵	۱۶۳.۹	۴.۱	۲.۴	(۲۵.۳%)
ذوب	۴	۲.۹	۲۶.۷	۲.۸	۰.۱	(۶.۲%)
توان	۶	۲.۳	۲۱.۲	۱.۶	۰.۶	(۲.۷%)
جهش	۴	۱.۶	۳.۴	۱.۶	۰.۰	(۵.۷%)

اختیار فروش

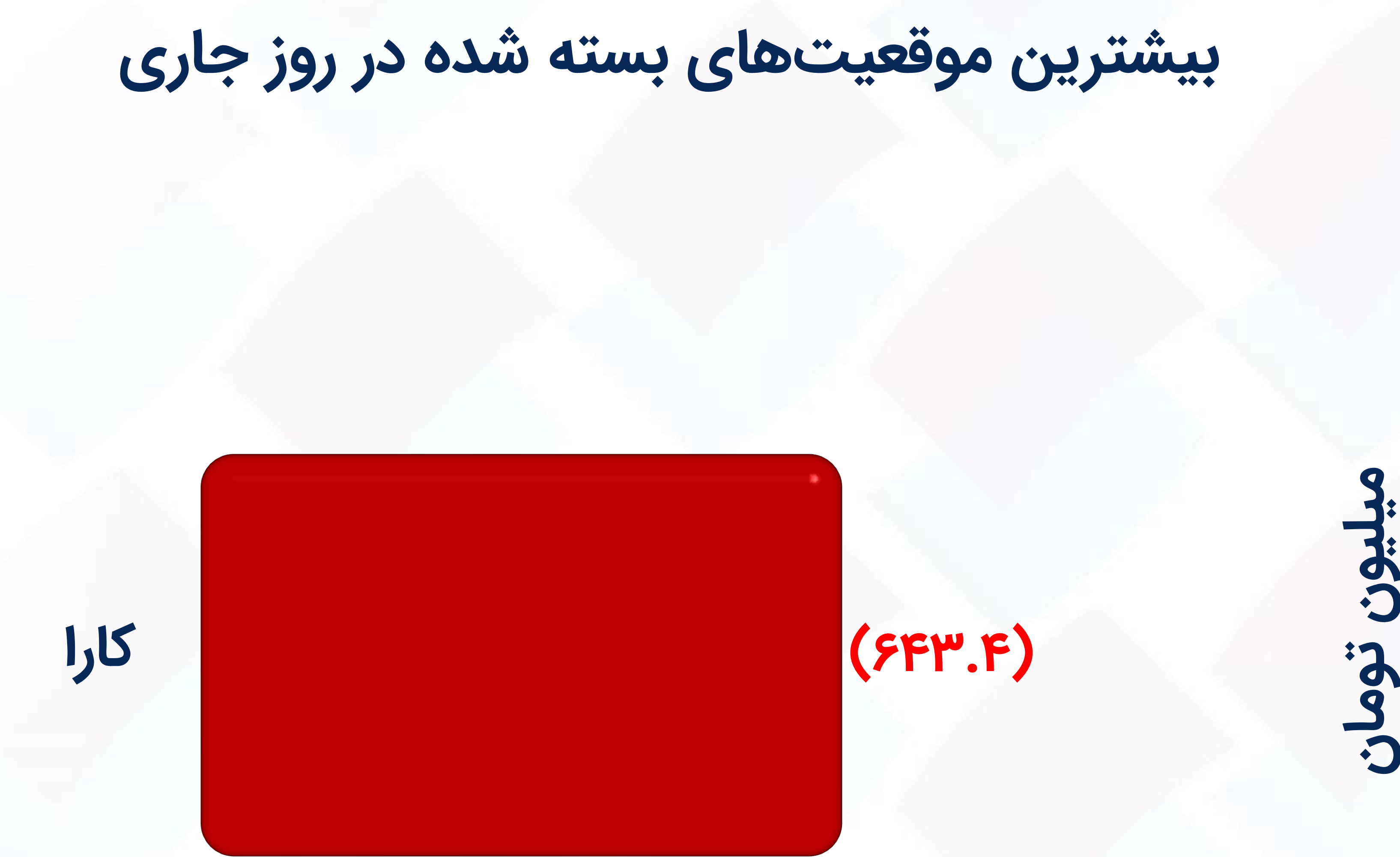
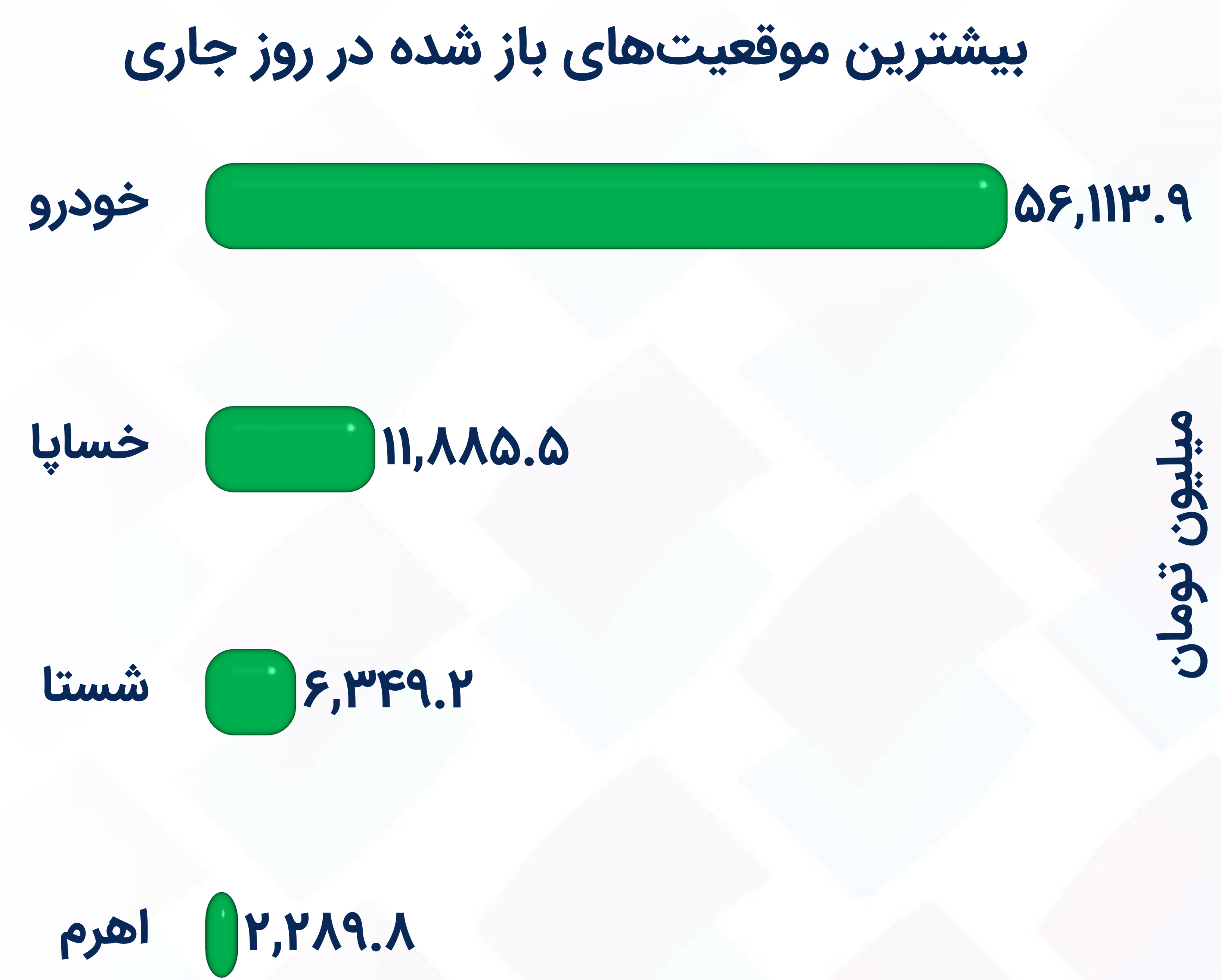
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
خودرو	۷	۴,۱۶۱.۷	۱۵۹,۸۰۵.۵	۱,۴۵۱.۰	۲,۷۱۰.۸	(۲۰.۶%)
خسپا	۴	۷۷۳.۶	۵۲,۲۴۳.۹	۵۷۹.۹	۱۹۳.۷	۱۲.۹%
اهرم	۴	۷۵۲.۴	۱۰,۰۲۸.۴	۷۵۲.۳	۰.۱	۹.۲%
شستا	۷	۱۸۱.۷	۹,۸۹۴.۲	۲.۴	۱۷۹.۳	(۳۲.۳%)
حافرین	۱	۱۴.۶	۲۱.۰	۱۴.۶	۰.۰	۹.۳%

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



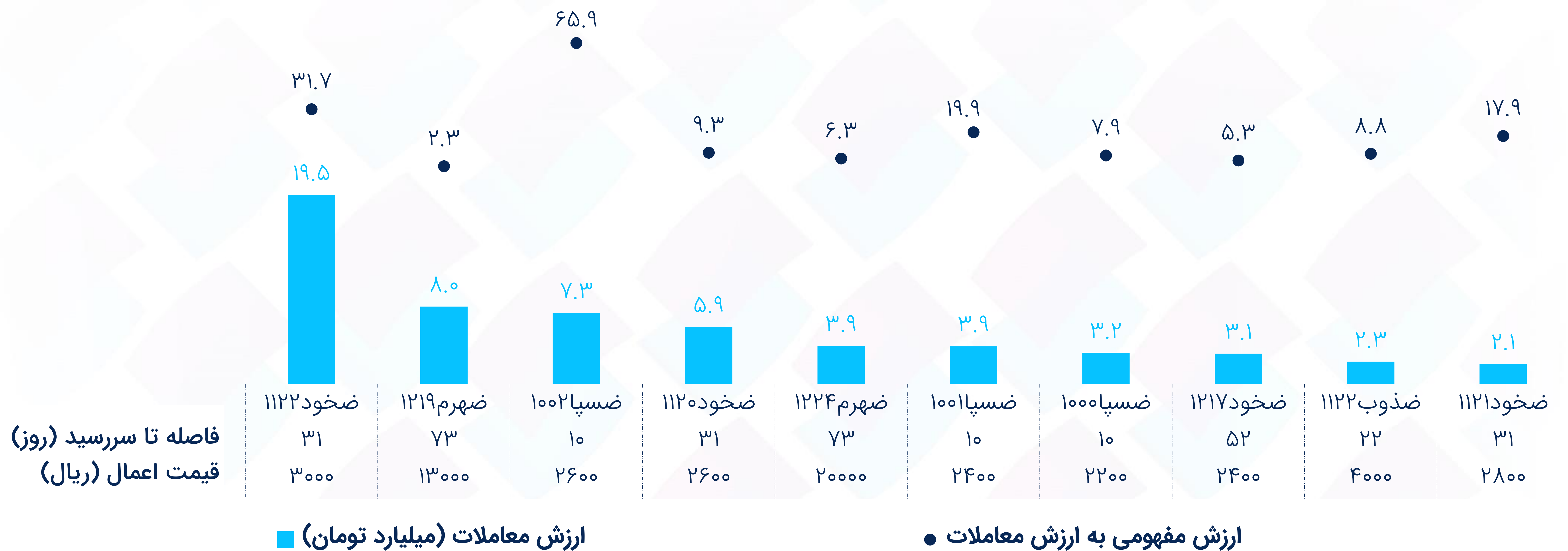
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید 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 سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضهرم ۱۱۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۰۱	۶.۰	۳۰	۲۱,۱۲۰	۲۸,۰۳۰	۳۲.۷%	۹۳۴.۳	۰.۲۵	۶۹۸	۲۲۲۸%
ضفصبا ۱۱۰۲	فصبا	۵,۸۰۰	۳۸	۲۹.۸	۳۲۴	۶,۴۸۰	۶,۱۲۴	(۵.۵%)	۱۸.۹	۰.۷۲	۱,۳۰۷	۳۰۳%
ضشنا ۱۲۰۷	شپنا	۱۰,۰۰۰	۵۲	۱۸.۸	۴۶	۸,۴۸۰	۱۰,۰۴۶	۱۸.۵%	۲۱۸.۴	۰.۲۲	۱۵۱	۲۲۸%
ضهای ۱۱۰۶	های وب	۲,۴۰۰	۳۵	۴.۵	۲۰	۲,۱۸۹	۲,۴۲۰	۱۰.۶%	۱۲۱.۰	۰.۳۴	۶۲	۲۰۸%
ضترا ۱۱۵۷	شتران	۵,۰۰۰	۴۳	۲.۰	۲۲	۴,۳۳۷	۵,۰۲۲	۱۵.۸%	۲۲۸.۳	۰.۲۰	۵۶	۱۵۴%

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 سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
ضصاد ۱۱۴۵	وبصادر	۳,۶۱۷	۳۱	۱.۸	۴	۱,۹۱۷	۳,۶۲۱	۸۹%	۹۰۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۱۲۷	خودرو	۴,۵۰۰	۳۱	۳.۷	۴	۲,۷۶۱	۴,۵۰۴	۶۳%	۱,۱۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضسپا ۱۰۰۵	خسپا	۳,۲۵۰	۱۰	۸.۹	۲	۲,۵۰۴	۳,۲۵۲	۳۰%	۱,۶۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضخود ۱۲۲۵	خودرو	۴,۵۰۰	۵۲	۳۷.۲	۱۹	۲,۷۶۱	۴,۵۱۹	۶۴%	۲۳۷.۸	۰.۰۰	۰	(۹۸%)
ضدی ۱۱۱۲	دی	۱,۸۰۰	۳۸	۱.۲	۴	۱,۰۷۸	۱,۸۰۴	۶۷%	۴۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۶%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
(۲) فاصله تا سربه‌سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سربه‌سر)
(۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سربه‌سر
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

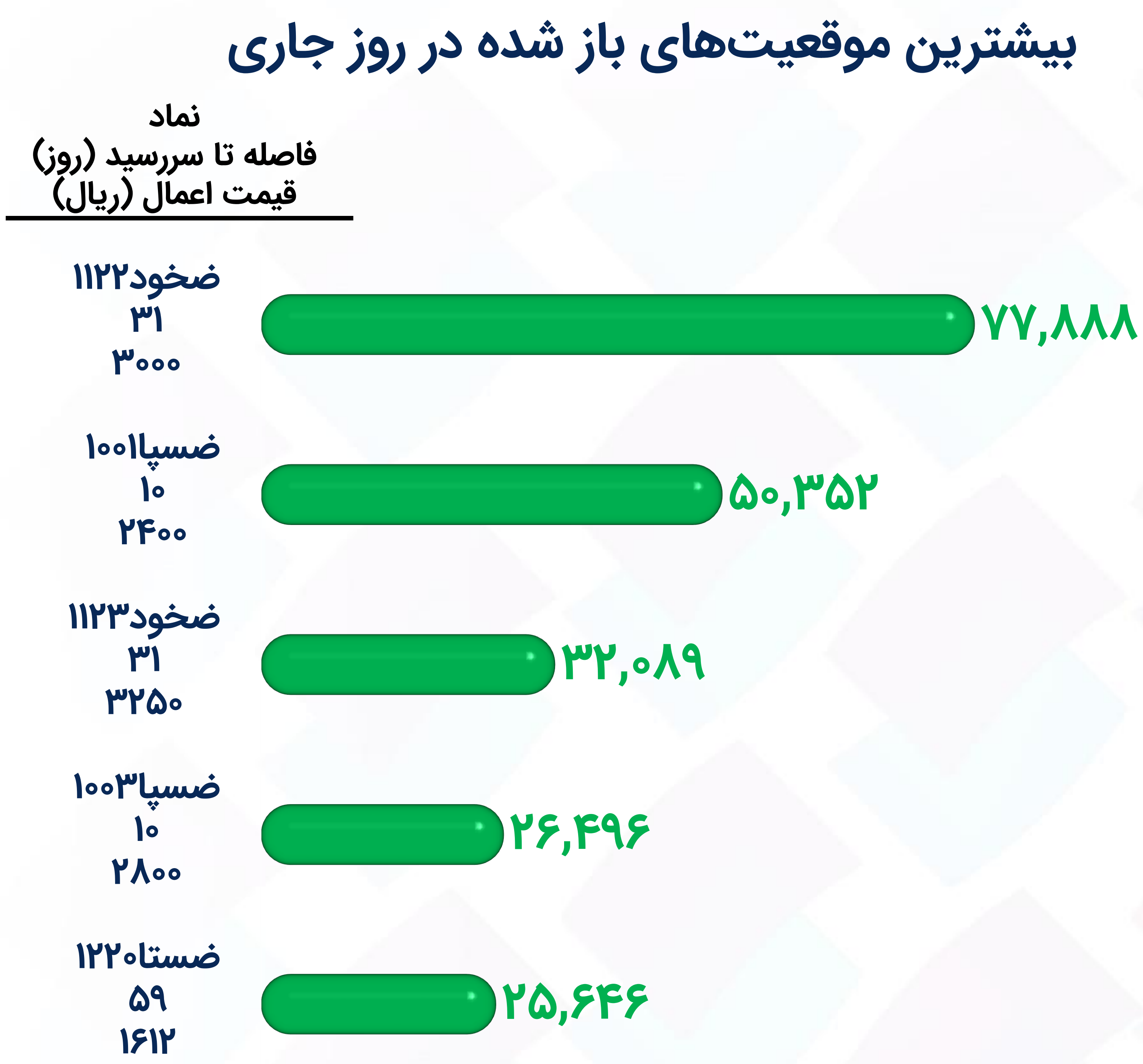
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طسپا ۱۰۰۱	خسپا	۲,۴۰۰	۱۰	۱۸۴.۰	۱۴	۲,۵۰۴	۲,۳۸۶	(۵%)	۱۷۰.۴	-۰.۲۳	۲۶	۸۵.۳%
طخود ۱۱۱۹	خودرو	۲,۴۰۰	۳۱	۳۲.۲	۱۲	۲,۷۶۱	۲,۳۸۸	(۱۴%)	۱۹۹.۰	-۰.۰۸	۱۳	۱۰.۵%
طحافرین ۳۰۹	حافرین	۴,۷۶۸	۱۴۷	۱۴.۶	۱,۶۹۲	۲,۴۴۳	۳,۰۷۶	۲۶%	۱.۸	-۰.۹۸	۱,۸۴۹	۹.۳%
طهرم ۱۲۲۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷۳	۷۵۲.۳	۱,۵۸۸	۲۱,۱۲۰	۲۰,۴۱۲	(۳%)	۱۲.۹	-۰.۴۳	۱,۷۳۵	۹.۲%
طخود ۱۱۲۲	خودرو	۳,۰۰۰	۳۱	۱۱.۴	۲۳۸	۲,۷۶۱	۲,۷۶۲	۰%	۱۱.۶	-۰.۶۵	۲۳۶	(۰.۹%)

گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

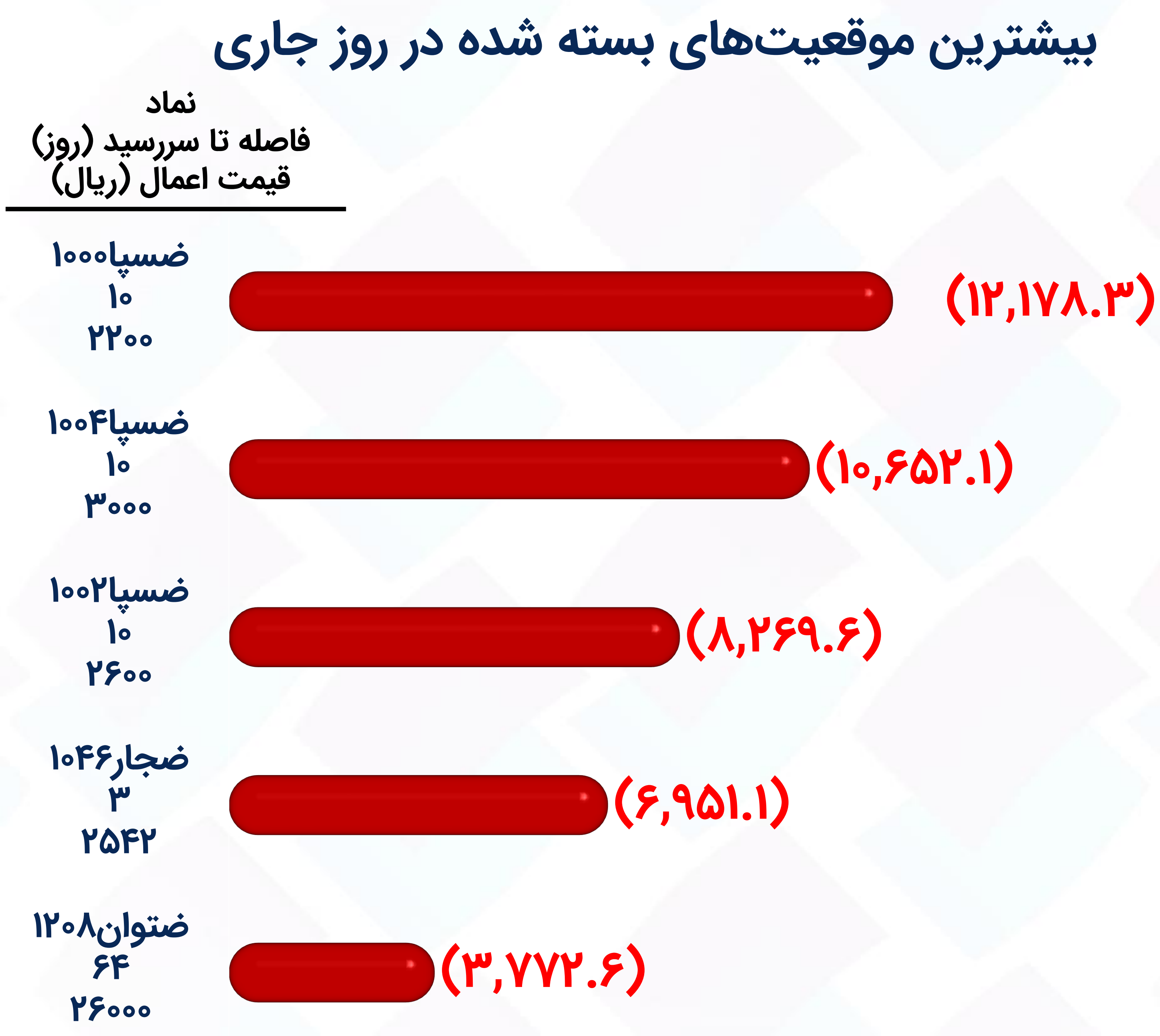
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۱۲۱۵	شستا	۱,۱۱۲	۵۹	۴۳.۶	۱۴	۱,۲۶۵	۱,۰۹۸	(۱۳%)	۷۸.۴	-۰.۰۸	۶	(۵۷.۰%)
طخود ۱۲۱۷	خودرو	۲,۴۰۰	۵۲	۱۳۰.۶	۴۵	۲,۷۶۱	۲,۳۵۵	(۱۵%)	۵۲.۳	-۰.۱۱	۲۴	(۴۶.۸%)
طسپا ۱۰۰۰	خسپا	۲,۲۰۰	۱۰	۹.۷	۳	۲,۵۰۴	۲,۱۹۷	(۱۲%)	۷۳۲.۳	-۰.۰۳	۲	(۳۰.۲%)
طستا ۱۲۱۶	شستا	۱,۲۱۲	۵۹	۱۳۵.۴	۳۰	۱,۲۶۵	۱,۱۸۲	(۷%)	۳۹.۴	-۰.۲۳	۲۳	(۲۴.۳%)
طستا ۱۲۲۰	شستا	۱,۶۱۲	۵۹	۲.۰	۳۶۰	۱,۲۶۵	۱,۲۵۲	(۱%)	۳.۵	-۰.۹۳	۲۷۹	(۲۲.۴%)

(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



میلیون تومان



میلیون تومان



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

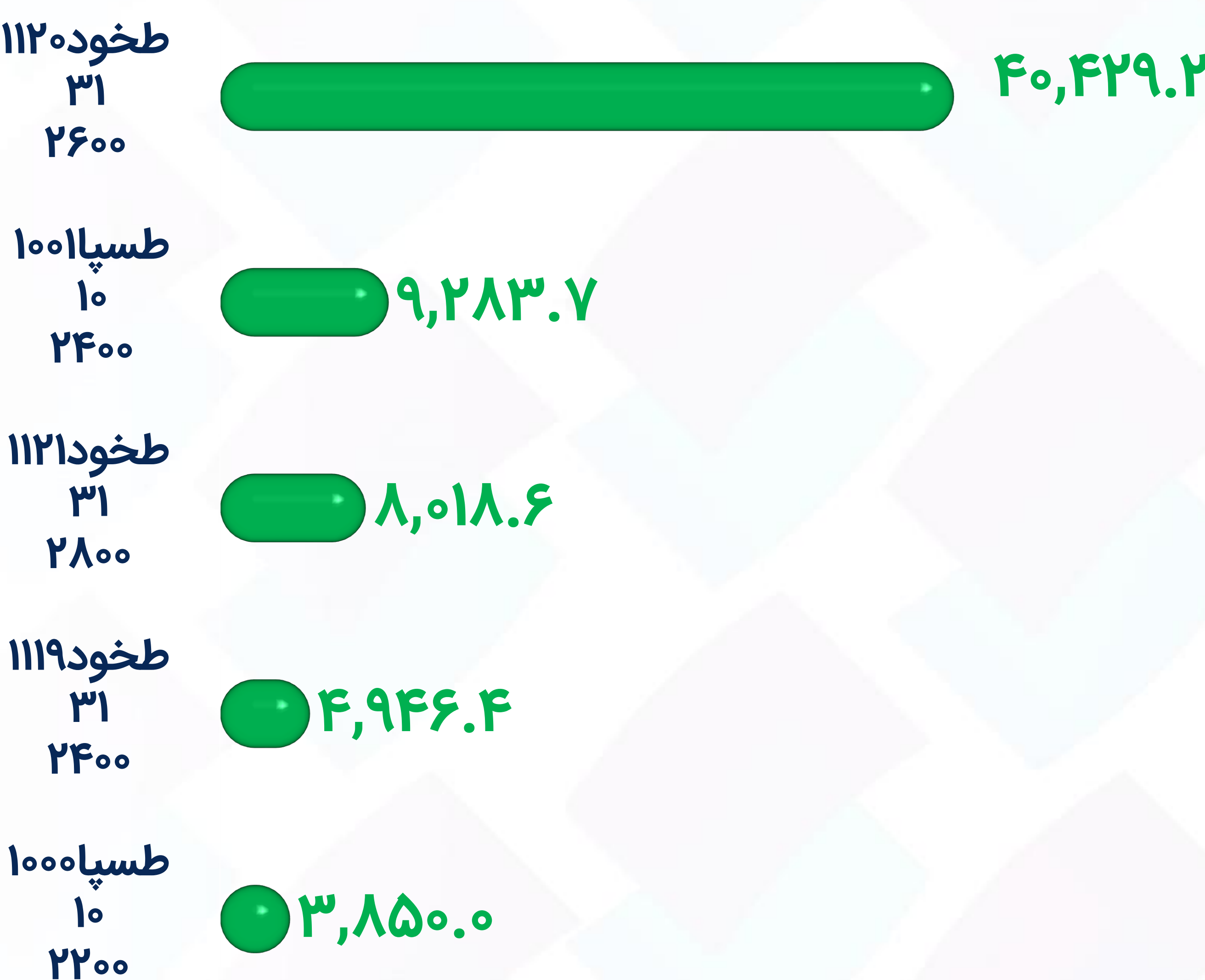
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

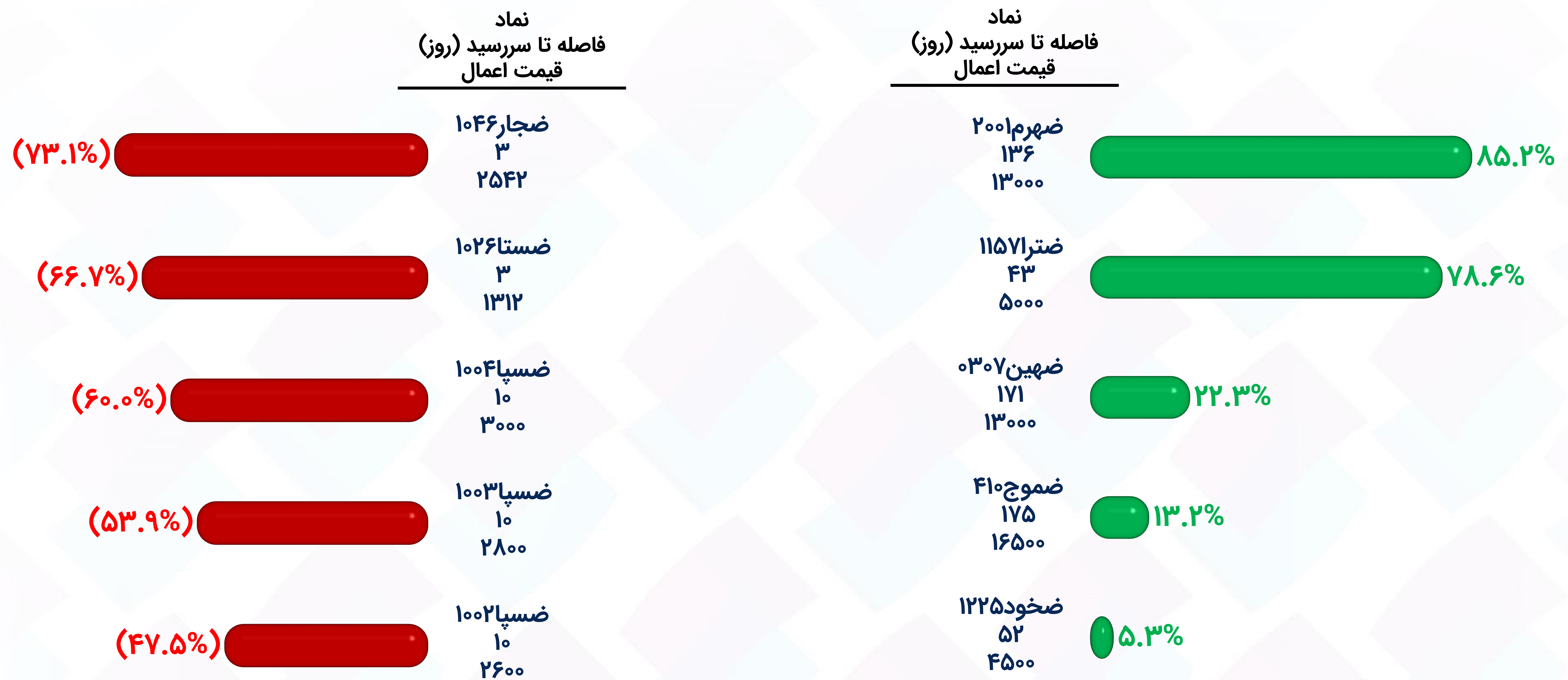
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



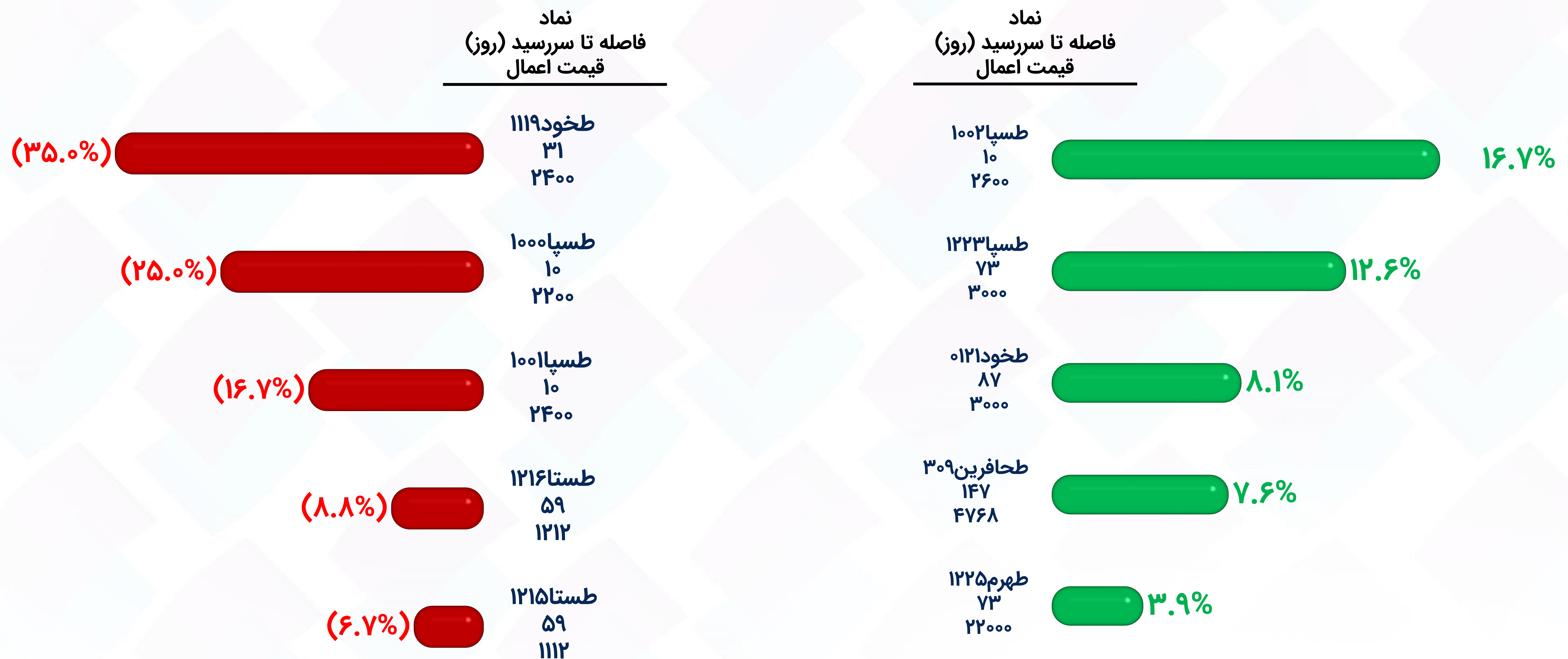
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

اختیار خرید



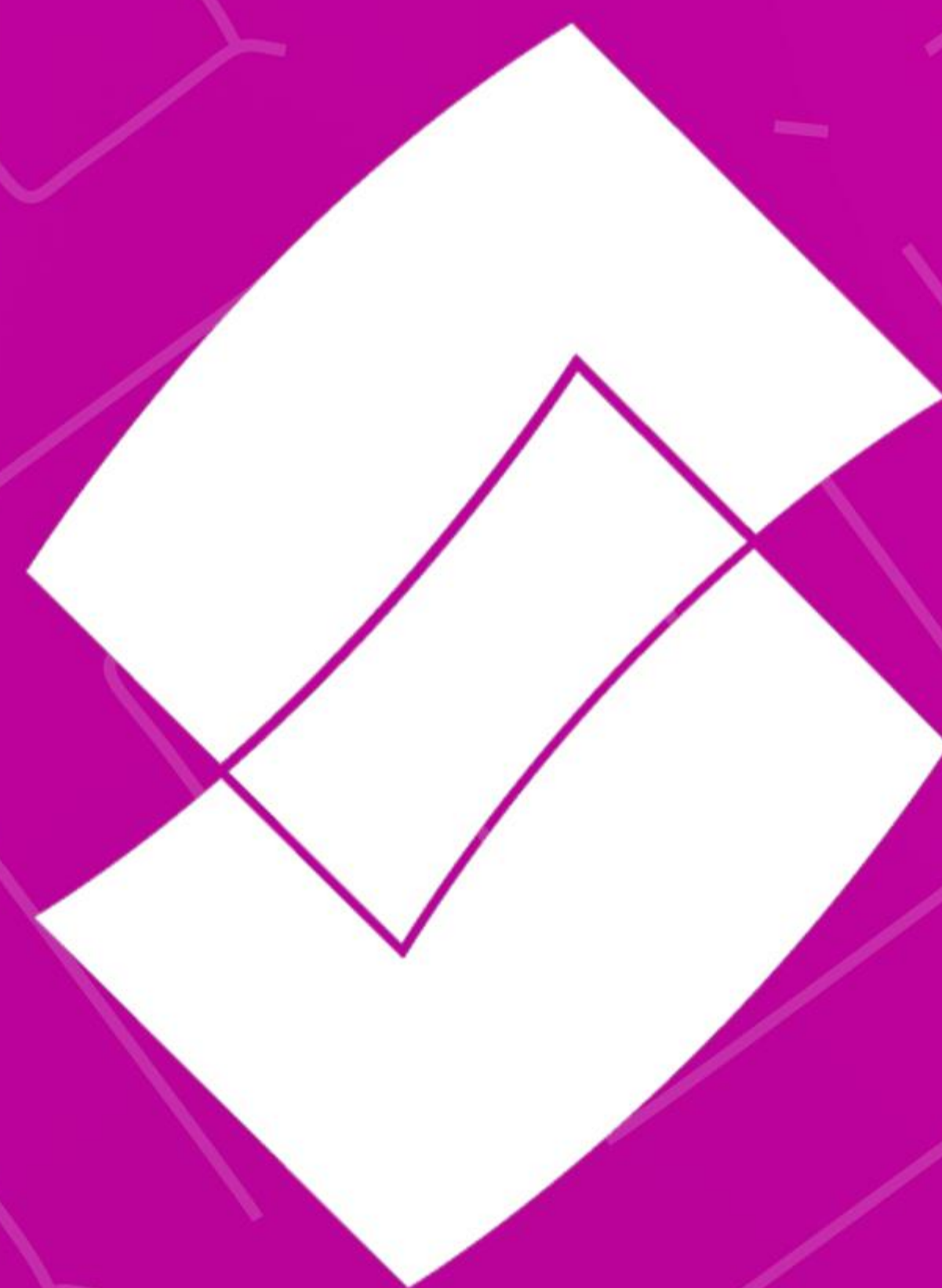
اختیار فروش



(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، محمدحسین 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.