

شماره
۳۹۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





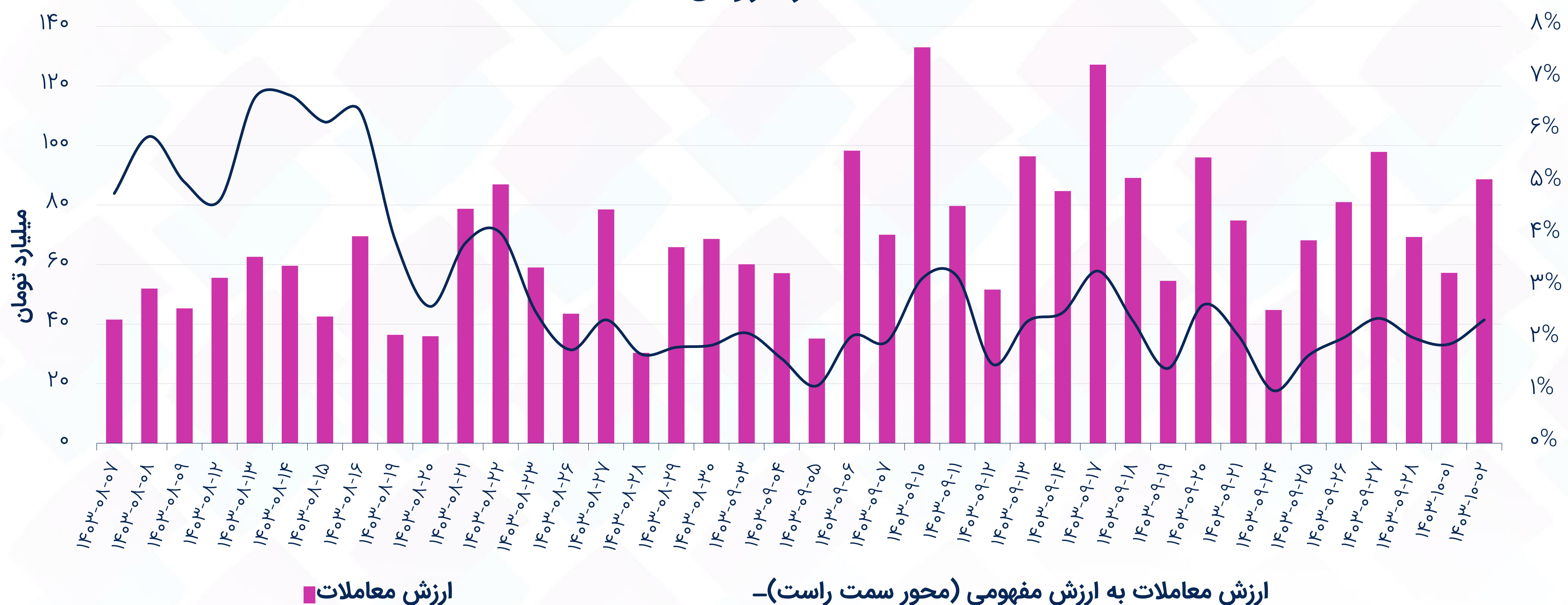
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



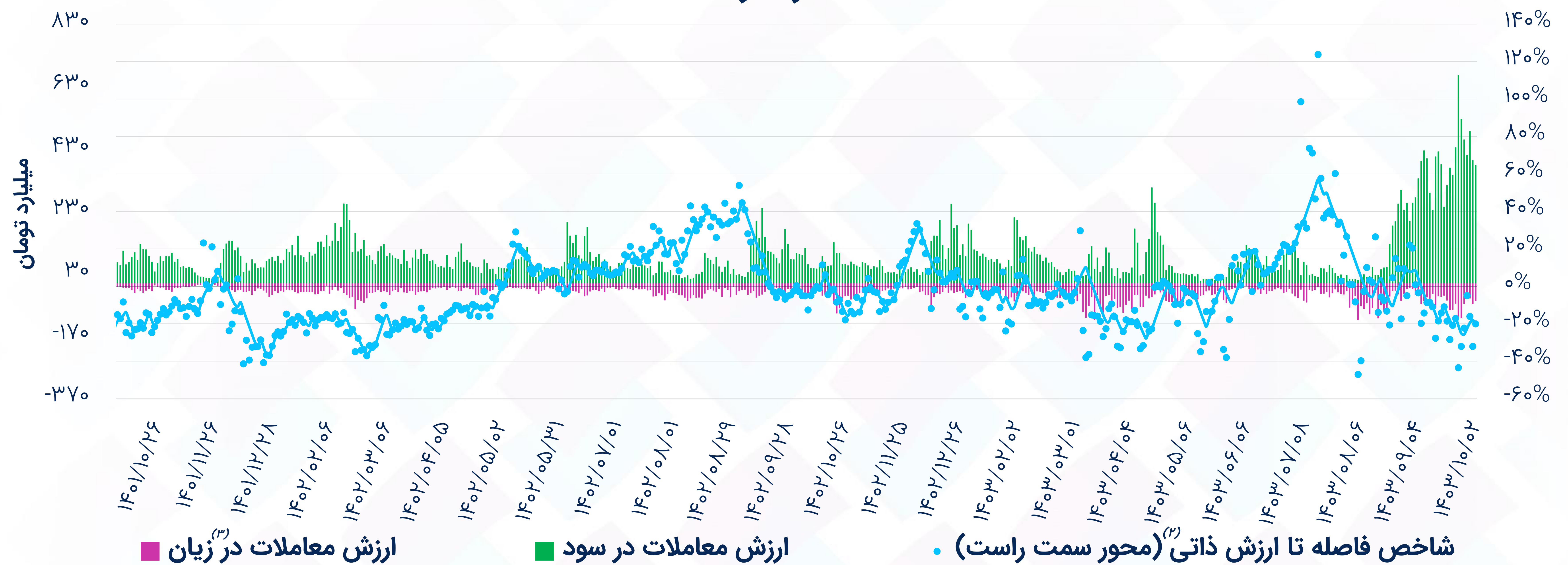
اختیار فروش



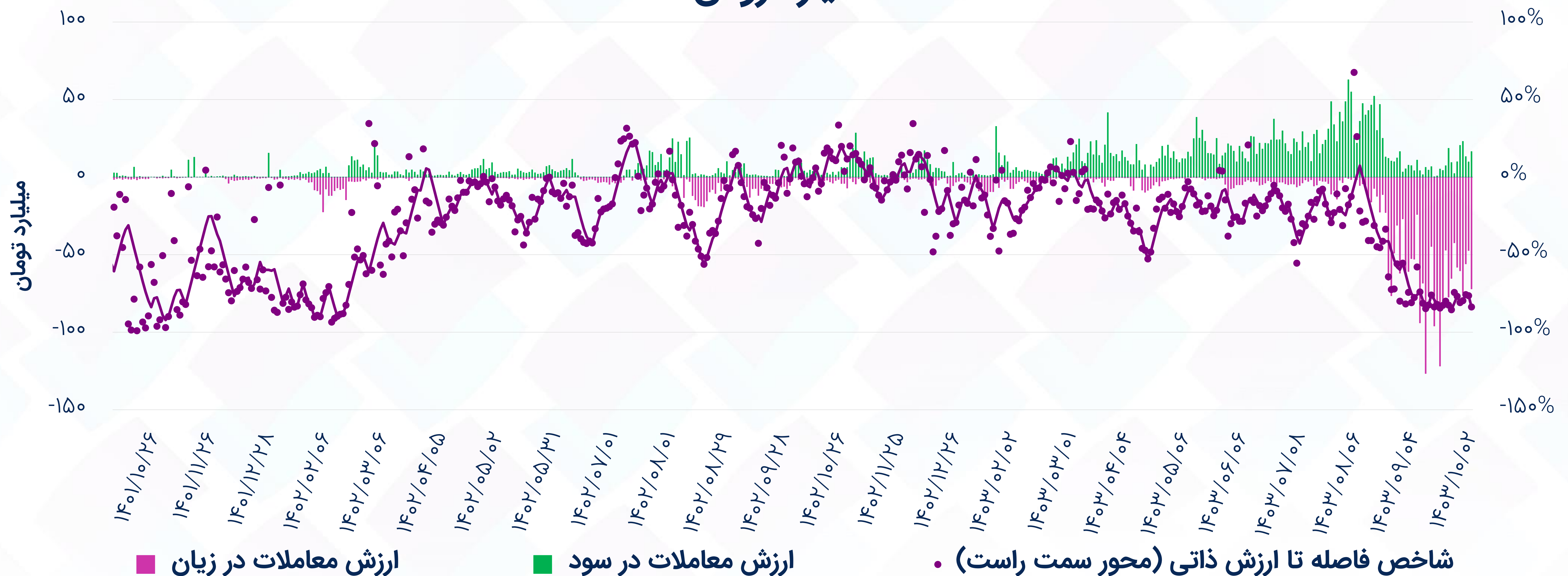
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

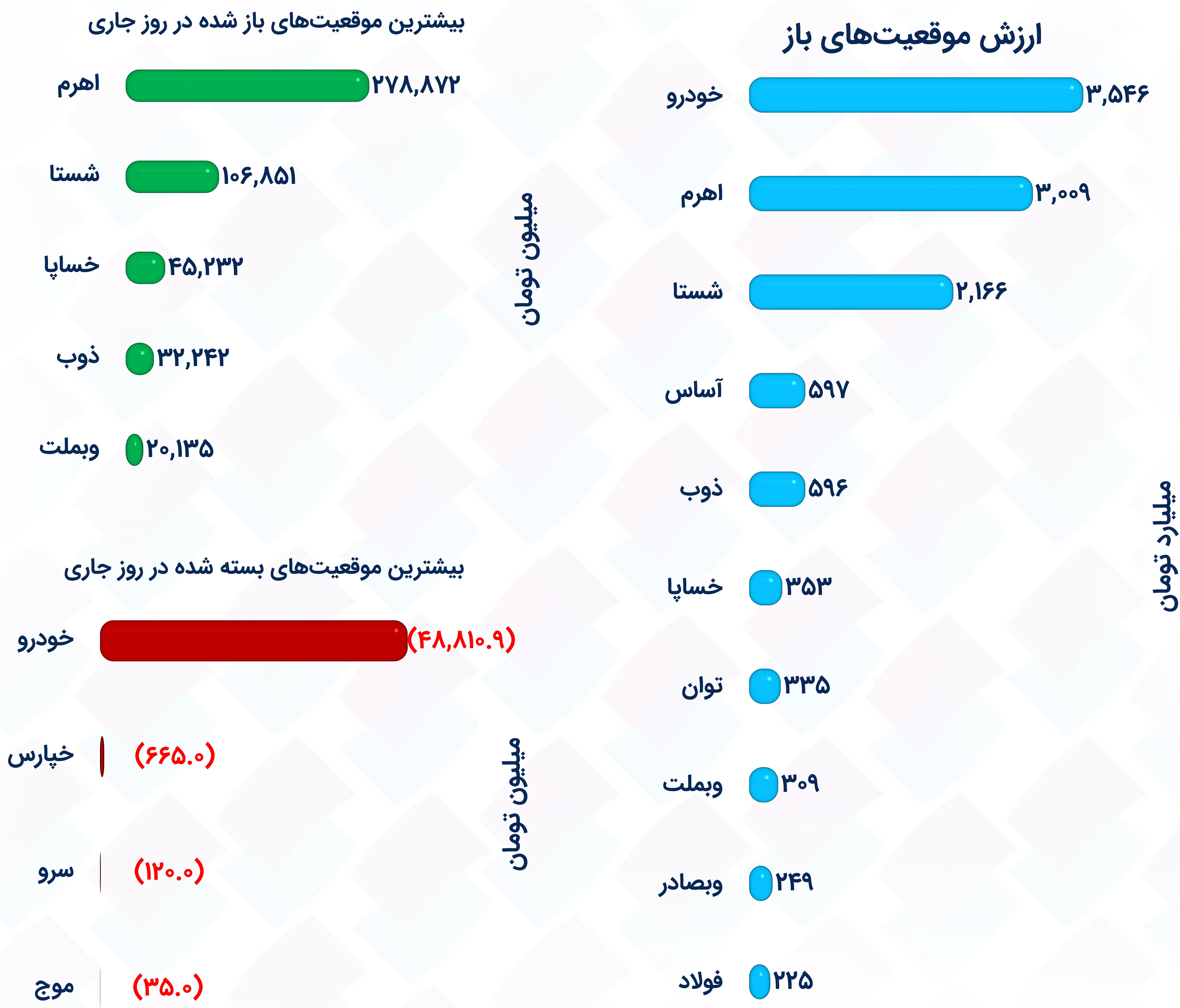
اختیار خرید

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
اهرم	۲۹	۱۹۰.۰	۱,۱۸۰.۵	۱۷۲.۷	۱۷.۳	(۲۳.۷%)
خودرو	۳۸	۱۱۸.۳	۱,۹۲۳.۹	۹۴.۳	۲۴.۰	(۱۶.۸%)
شستا	۳۹	۳۵.۴	۴۵۳.۸	۳۰.۹	۴.۵	(۲۰.۹%)
ذوب	۱۷	۳۰.۹	۱۱۲.۷	۲۷.۳	۳.۶	(۲۲.۳%)
توان	۲۳	۲۳.۳	۶۹.۵	۲۳.۳	۰.۰	۲.۶%
وبملت	۱۲	۹.۴	۴۴.۹	۸.۷	۰.۷	(۲۰.۰%)
خسپا	۱۲	۵.۸	۹۰.۹	۲.۶	۳.۲	(۵۵.۴%)

اختیار فروش

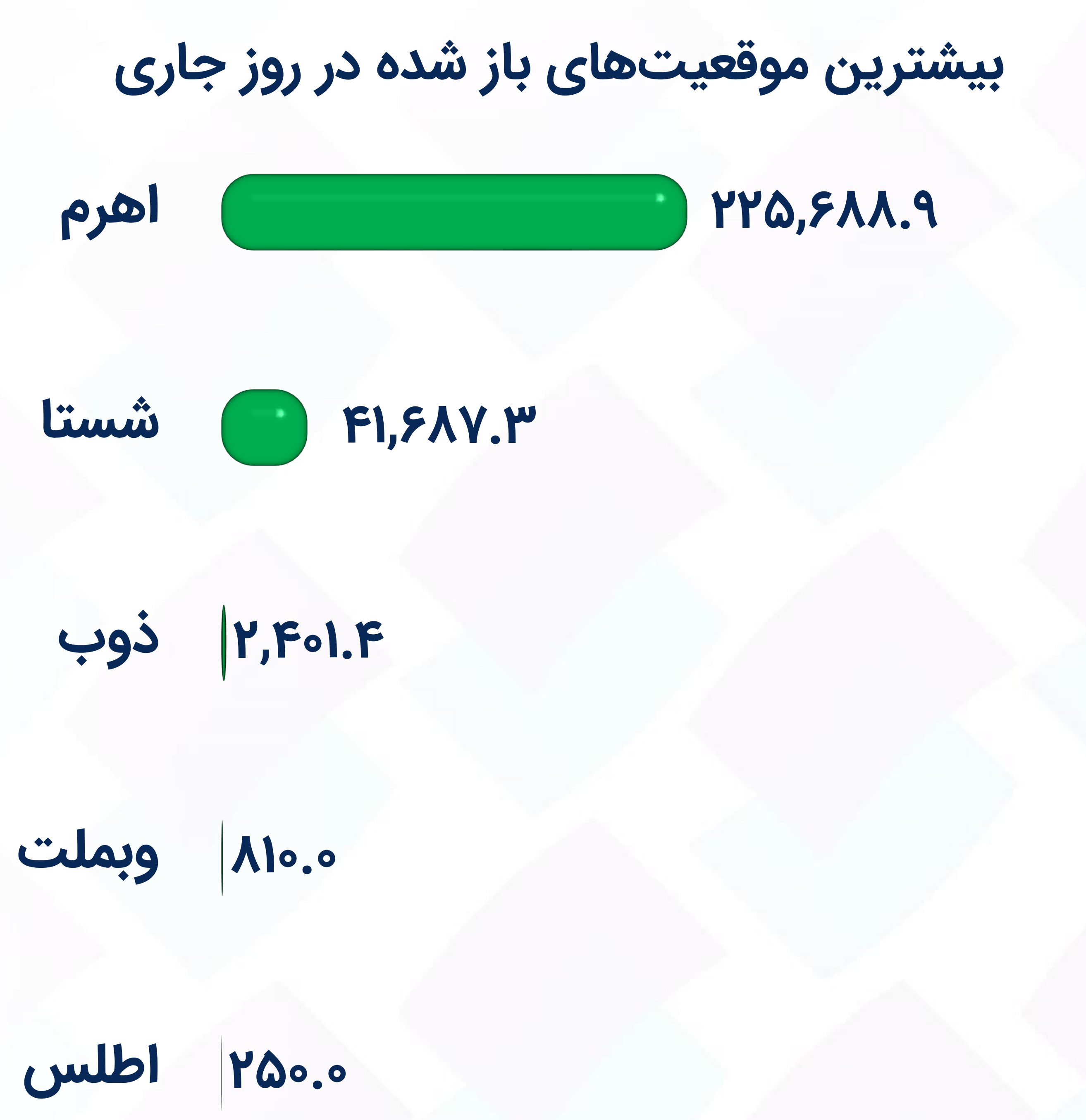
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۱۴	۶۰,۷۸۵.۹	۲,۴۵۲,۱۵۲.۶	۲,۱۴۱.۰	۵۸,۶۴۴.۸	(۸۹.۶%)
خودرو	۱۱	۲۵,۰۴۹.۶	۱,۱۱۹,۰۰۱.۱	۱۴,۳۵۰.۸	۱۰,۶۹۸.۸	(۶۸.۵%)
شستا	۱۳	۲,۶۰۰.۵	۱۶۶,۴۲۲.۸	۰.۰	۲,۶۰۰.۵	(۹۲.۷%)
ذوب	۲	۱۲۱.۸	۳,۶۹۲.۵	۰.۰	۱۲۱.۸	(۹۵.۰%)
وبملت	۱	۳۷.۸	۱,۱۹۹.۲	۰.۰	۳۷.۸	(۸۹.۶%)
توان	۴	۲۰.۶	۱,۹۸۲.۳	۰.۰	۲۰.۶	(۶۷.۳%)
خودران	۲	۱۲.۵	۱۵۰.۲	۸.۷	۳.۸	(۴۷.۰%)

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

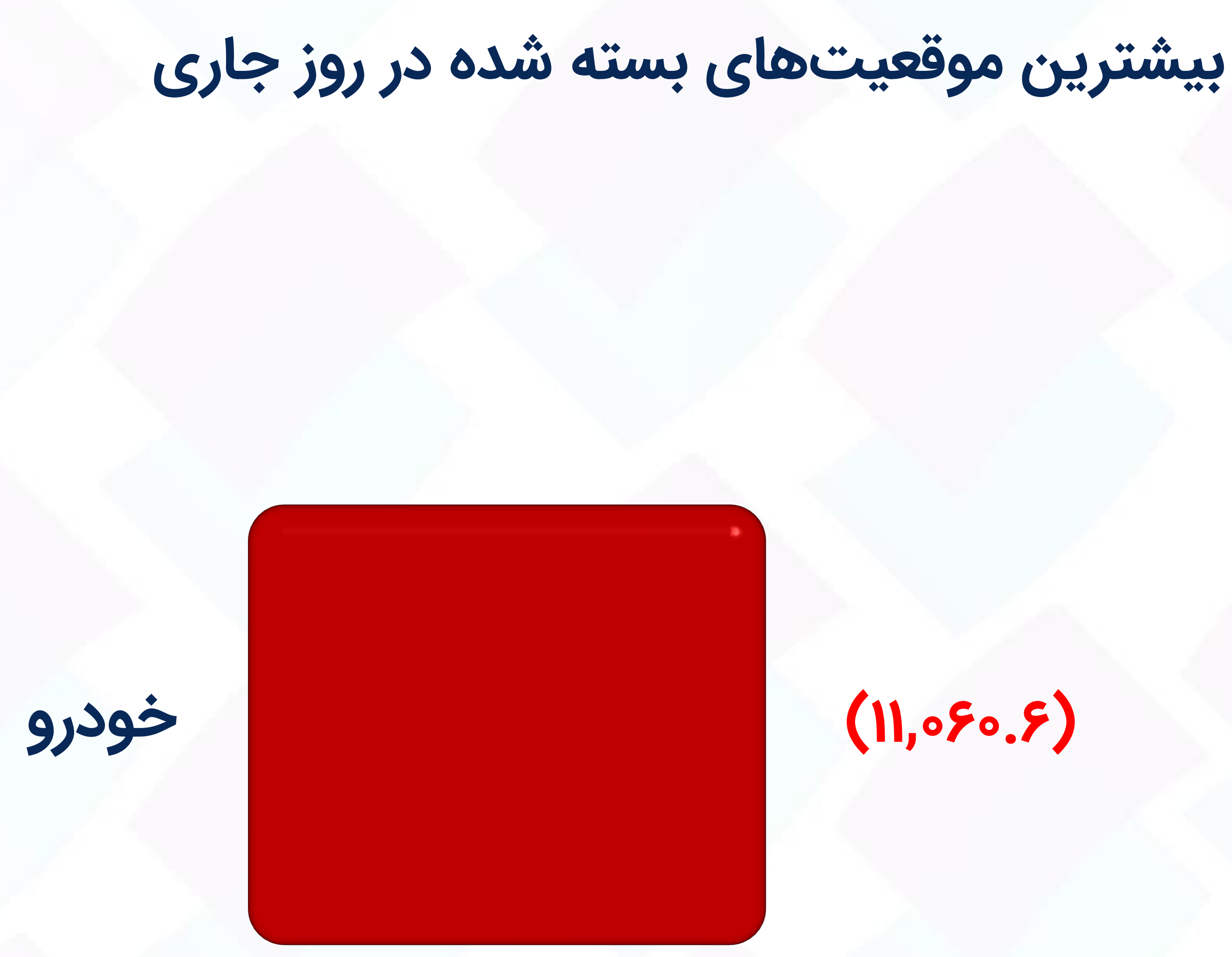


(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

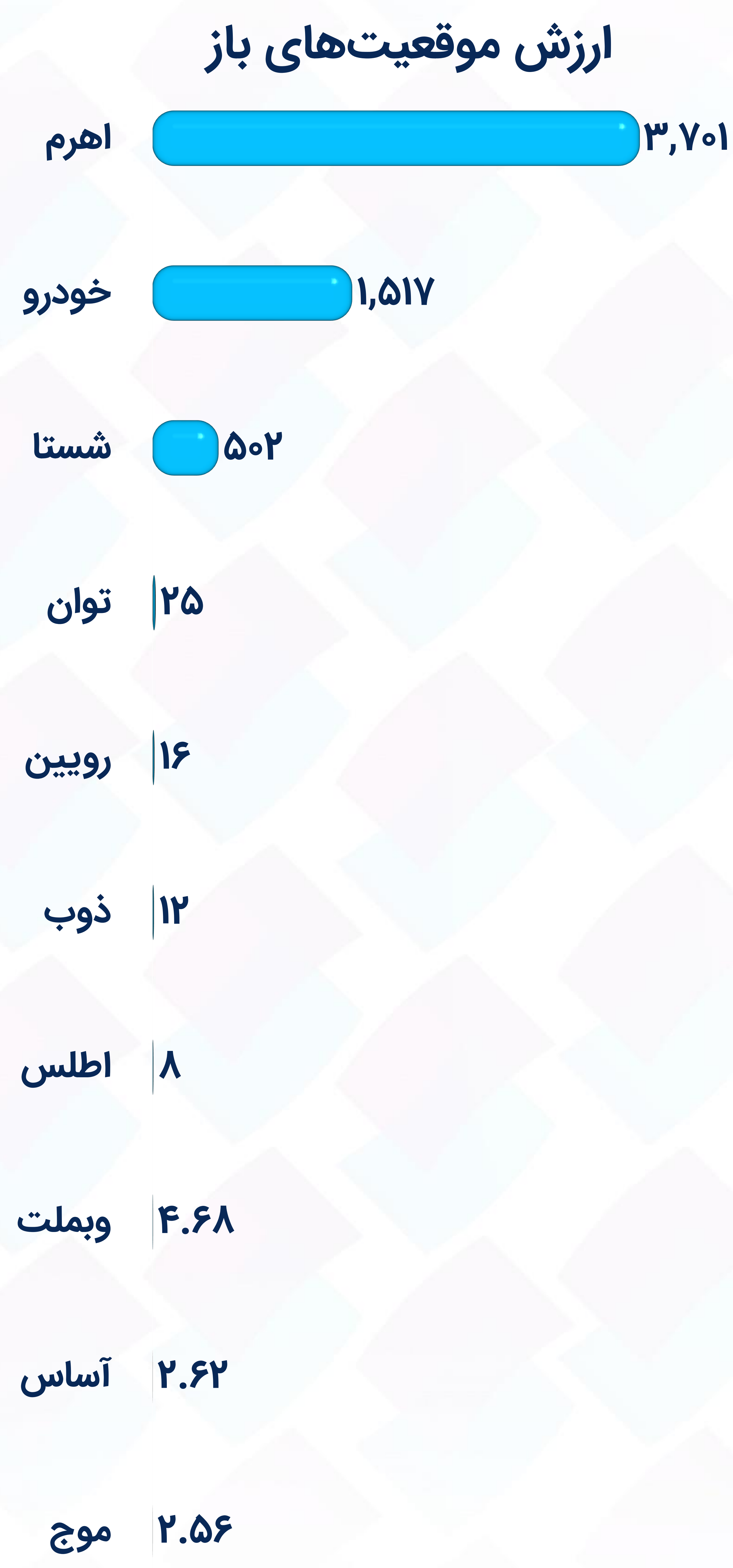
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان



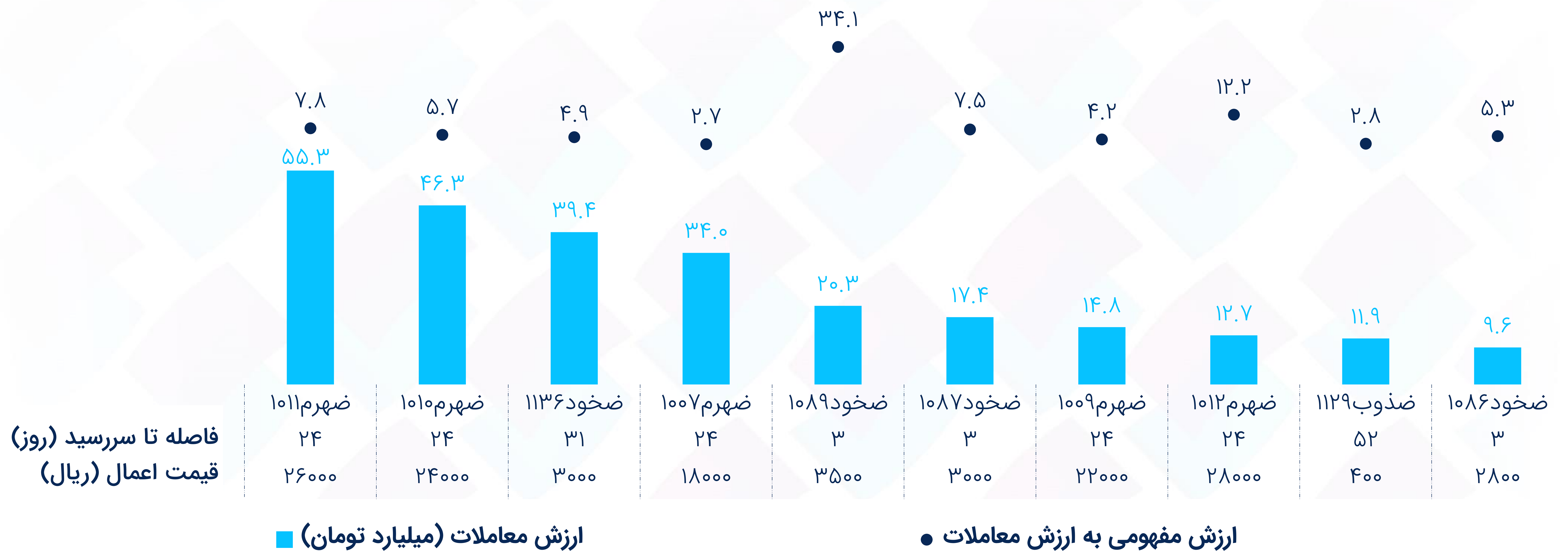
میلیون تومان



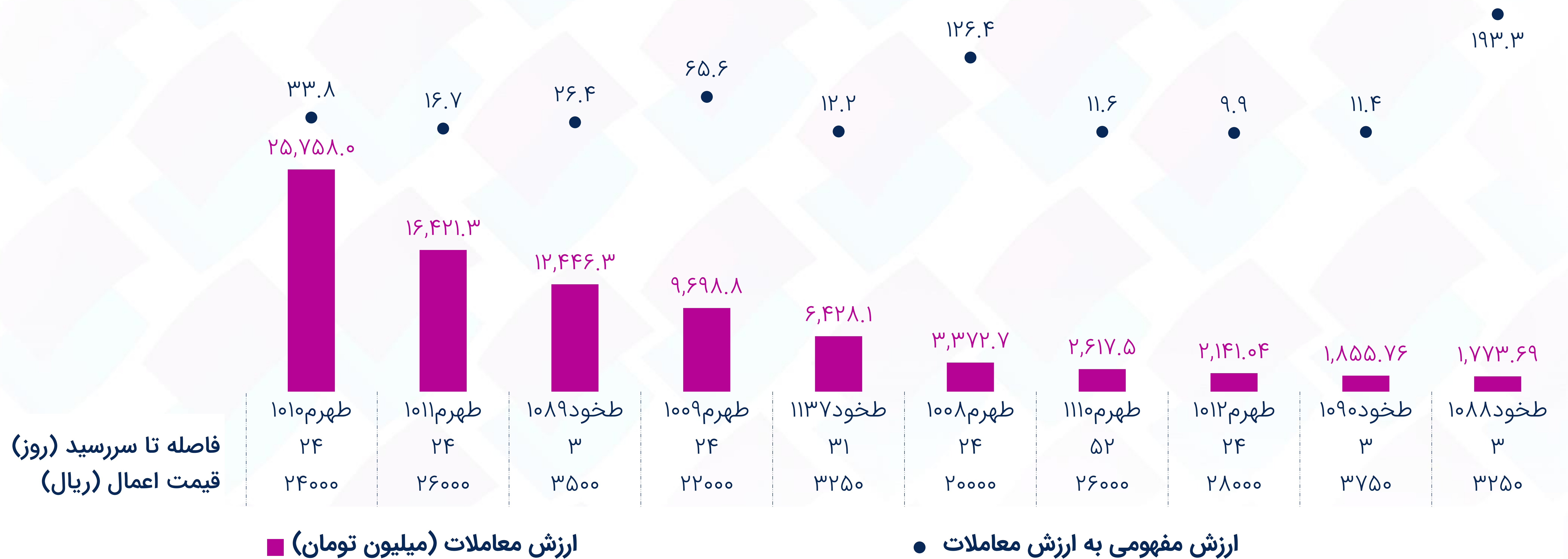
میلیارد تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزان‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
ضجهش ۱۰۱۱	جهش	۱۲,۰۰۰	۱۰	۲۹.۷	۵۰۴	۱۲,۴۹۰	۱۲,۵۰۴	۰.۱%	۲۴.۸	۰.۷۷	۷۵۶	۵۰%
ضجهش ۱۲۰۱	جهش	۷,۵۰۰	۷۳	۱.۱	۳,۶۶۷	۱۲,۴۹۰	۱۱,۱۶۷	(۱۰.۶%)	۳.۰	۱.۰۰	۵,۴۷۰	۴۹%
ضکوثر ۱۱۱۱	کوثر	۱,۳۰۰	۴۹	۴.۸	۷۳۲	۲,۲۹۳	۲,۰۳۲	(۱۱.۴%)	۲.۸	۱.۰۰	۱,۰۴۹	۴۳%
ضتاب ۱۰۰۱	شتاب	۶,۰۰۰	۱۰	۱.۲	۶,۲۰۰	۱۳,۶۹۰	۱۲,۲۰۰	(۱۰.۹%)	۲.۰	۱.۰۰	۷,۷۶۰	۲۵%
ضفصبا ۱۱۲۲	فصبا	۴,۲۰۰	۴۲	۶۴.۸	۷۱۹	۴,۹۴۱	۴,۹۱۹	(۰.۴%)	۶.۸	۰.۹۹	۸۹۸	۲۵%

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
ضذوب ۱۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۲۴	۲.۴	۵	۵۵۰	۱,۰۰۵	۸۳%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۰۹۲	خودرو	۴,۵۰۰	۳	۲۷.۴	۲	۳,۴۸۰	۴,۵۰۲	۲۹%	۲,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۵۲	۶۶.۶	۲۲	۵۵۰	۱,۰۲۲	۸۶%	۴۶.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۵۲	۲۱.۲	۲۷	۵۵۰	۹۲۷	۶۹%	۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۵۲	۲۵۳.۲	۳۶	۵۵۰	۸۳۶	۵۲%	۲۳.۲	۰.۰۱	۰	(۹۹%)

(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
طخود ۱۰۹۰	خودرو	۳,۷۵۰	۳	۱,۸۵۵.۸	۳۰۵	۳,۴۸۰	۳,۴۴۵	(۱.۰%)	۱۱.۳	-۰.۹۵	۲۵۳	(۱۶.۹%)
طران ۱۱۰۹	خودران	۱۱,۰۰۰	۵۶	۸.۷	۱,۰۶۰	۱۰,۴۳۰	۹,۹۴۰	(۴.۷%)	۹.۴	-۰.۴۸	۶۲۹	(۴۰.۶%)
طخود ۱۰۸۹	خودرو	۳,۵۰۰	۳	۱۲,۴۴۶.۳	۱۳۲	۳,۴۸۰	۳,۳۶۸	(۳.۲%)	۲۵.۵	-۰.۵۰	۵۸	(۵۶.۰%)
طران ۱۱۰۸	خودران	۱۰,۰۰۰	۵۶	۳.۸	۶۱۳	۱۰,۴۳۰	۹,۳۸۷	(۱۰.۰%)	۱۵.۳	-۰.۲۴	۲۳۵	(۶۱.۶%)
طهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۴	۲,۱۴۱.۰	۲,۷۵۳	۲۷,۳۱۰	۲۵,۲۴۷	(۷.۶%)	۹.۲	-۰.۴۹	۱,۰۴۹	(۶۱.۹%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

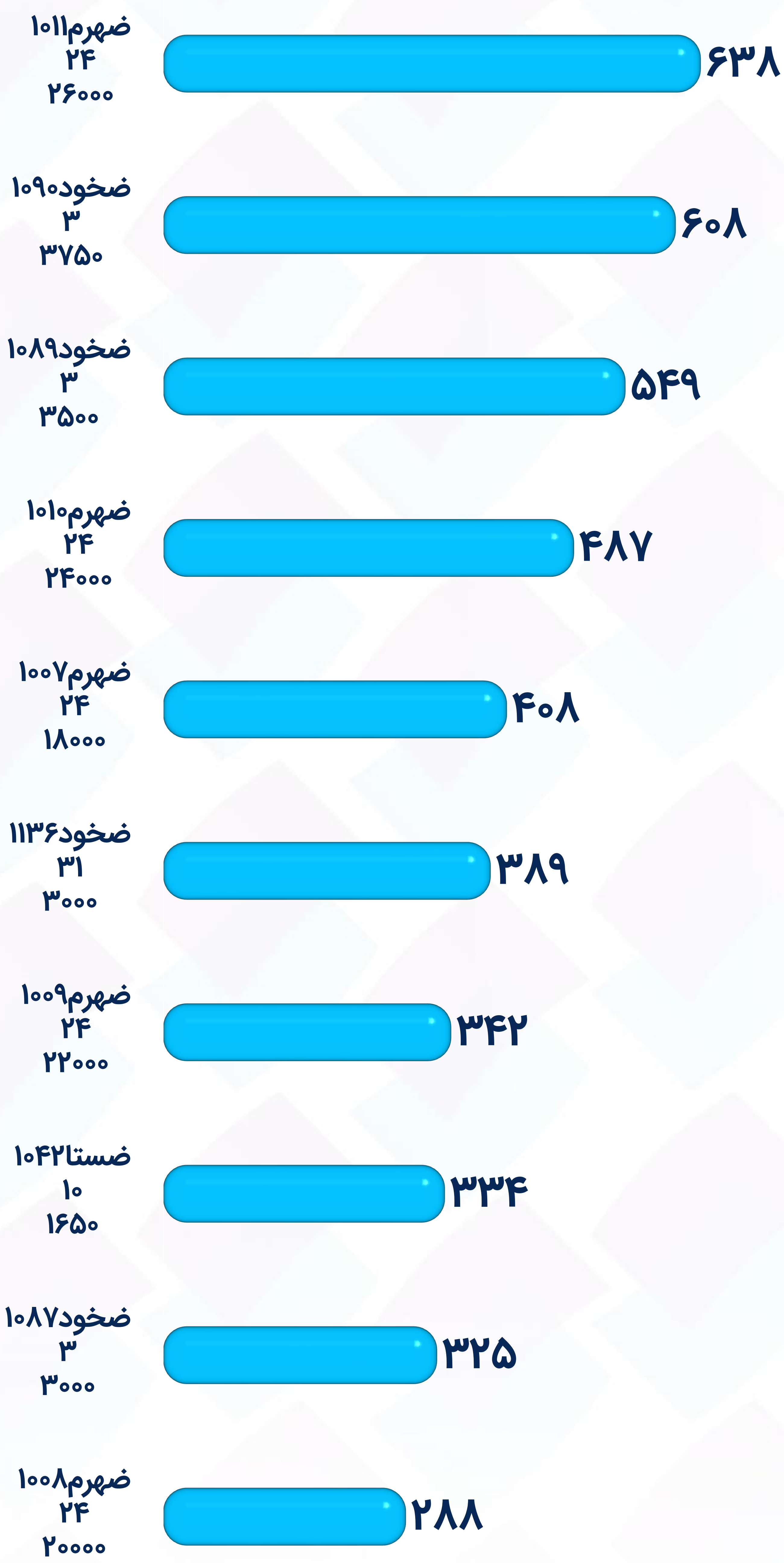
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۱۰۳۴	شستا	۸۵۰	۱۰	۶.۵	۲	۱,۴۶۸	۸۴۸	(۴۲.۲%)	۴۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۰۸۴	خودرو	۲,۴۰۰	۳	۱۹.۱	۳	۳,۴۸۰	۲,۳۹۷	(۳۱.۱%)	۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۵	شستا	۹۵۰	۱۰	۸.۰	۳	۱,۴۶۸	۹۴۷	(۳۵.۵%)	۳۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۶	شستا	۱,۰۵۰	۱۰	۱۸.۸	۳	۱,۴۶۸	۱,۰۴۷	(۲۸.۷%)	۳۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۲۴	۱۲.۱	۴۸	۲۷,۳۱۰	۱۳,۹۵۲	(۴۸.۹%)	۲۹۰.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

(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

ارزش موقعیت‌های باز

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



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

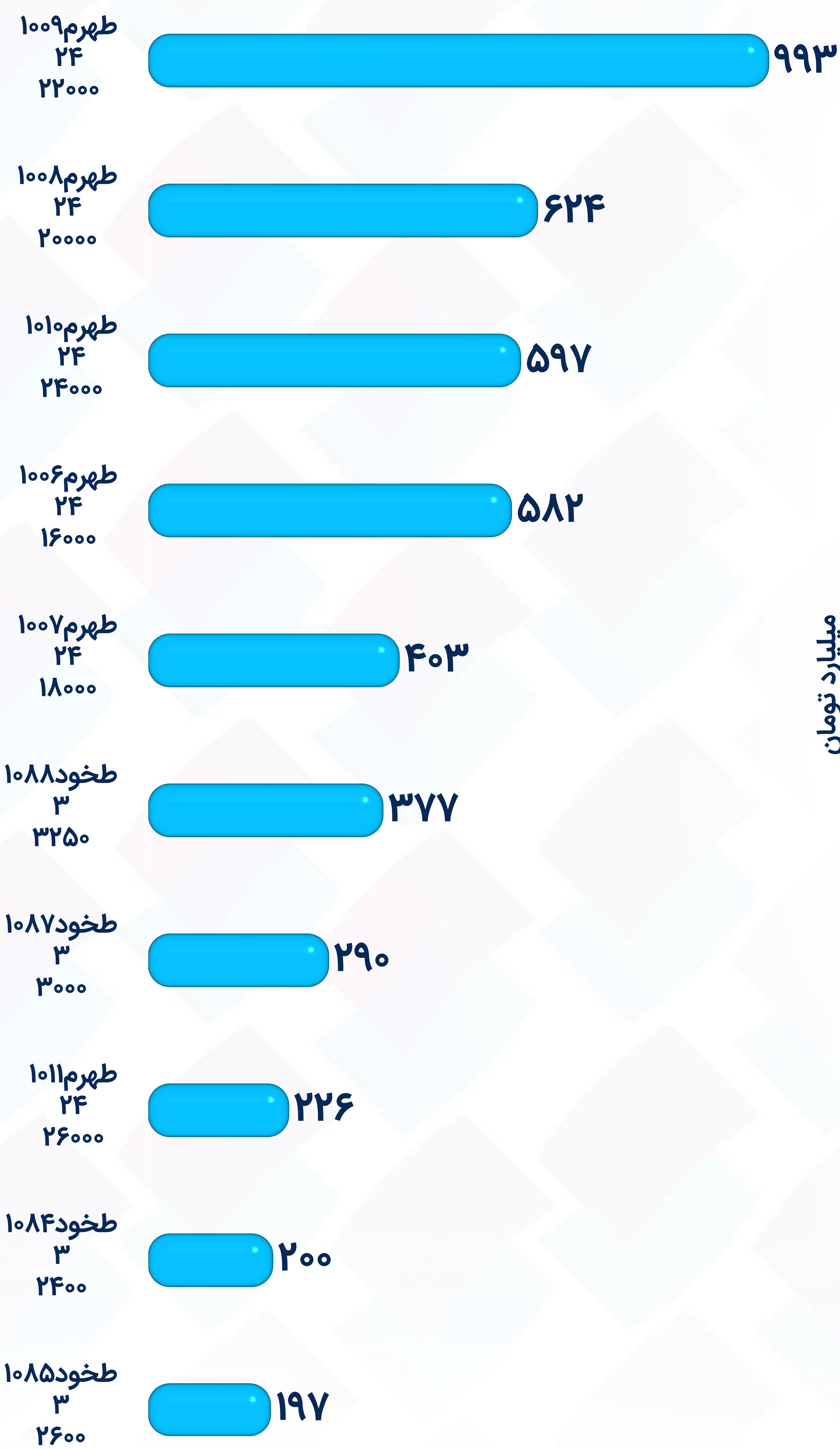
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

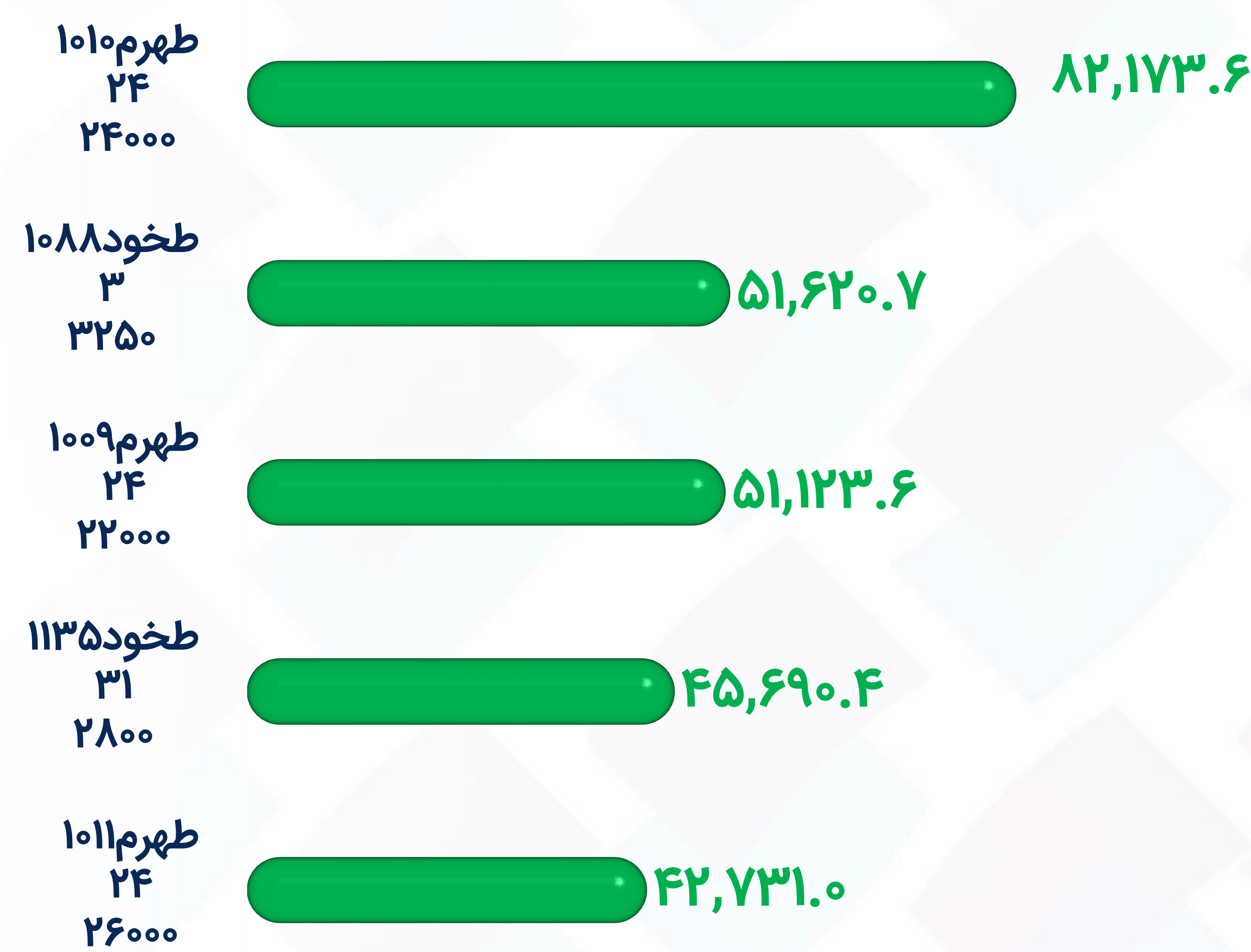
ارزش موقعیت‌های باز

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



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

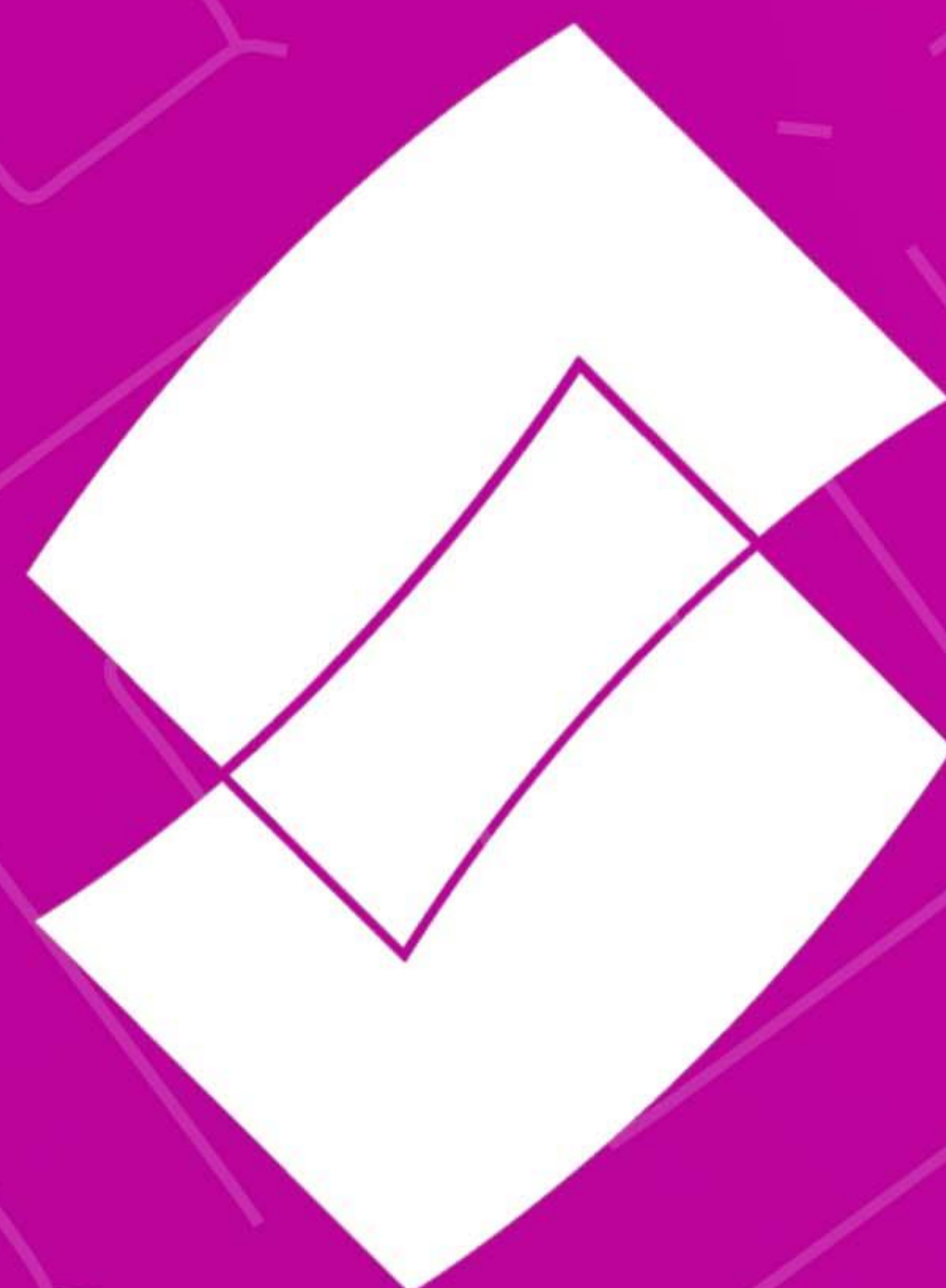
اختیار خرید



اختیار فروش



(۱) تنها قراردادهایی که طی دو روز معاملاتی منتهی به روز جاری دارای ارزش معاملاتی بیش از یک میلیون تومان هستند، لحاظ شده‌اند.



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 تأمین سرمایه نوین

مدیریت واحد تحلیل: علیرضا پیامی

کارشناس واحد تحلیل: زهره عباسی

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.