

شماره
۳۹۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





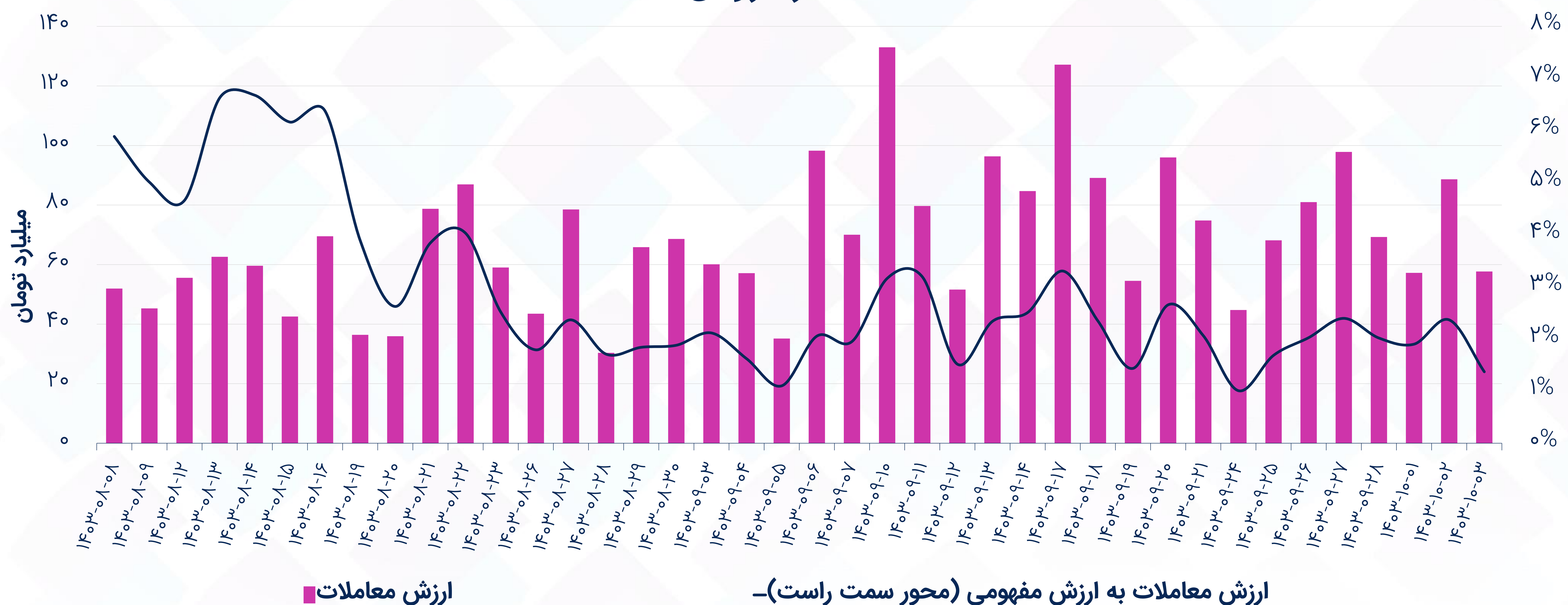
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



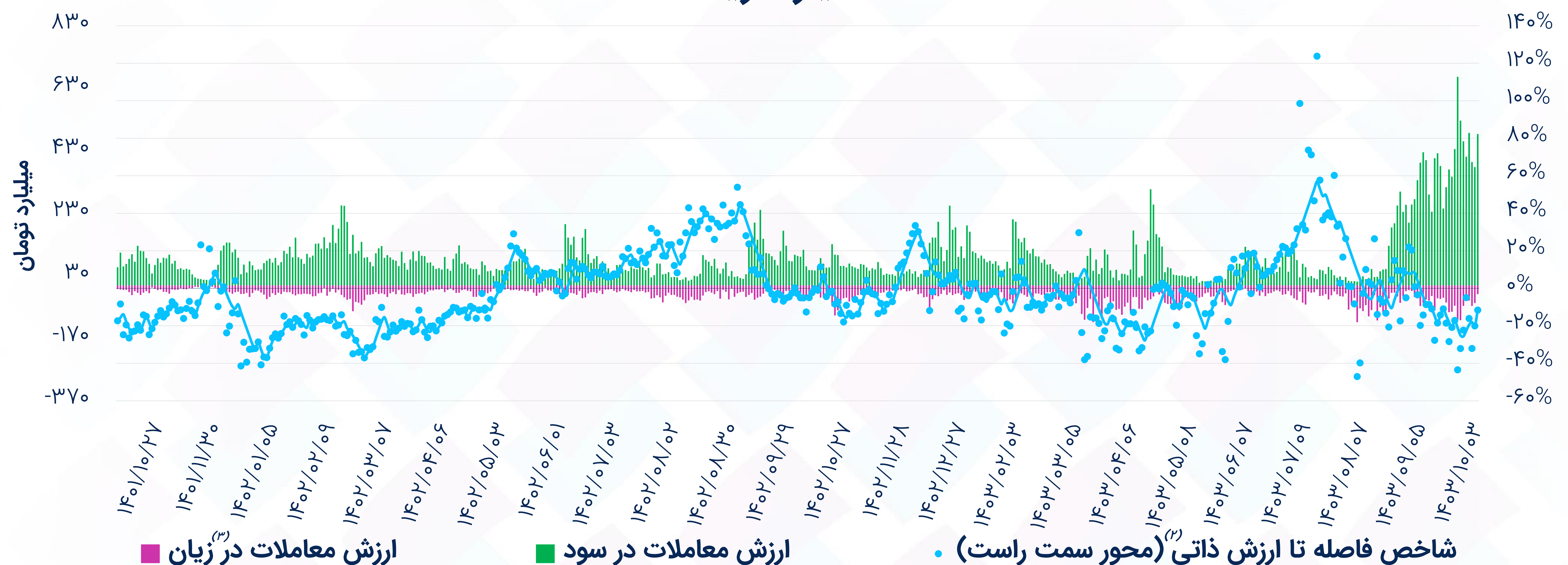
اختیار فروش



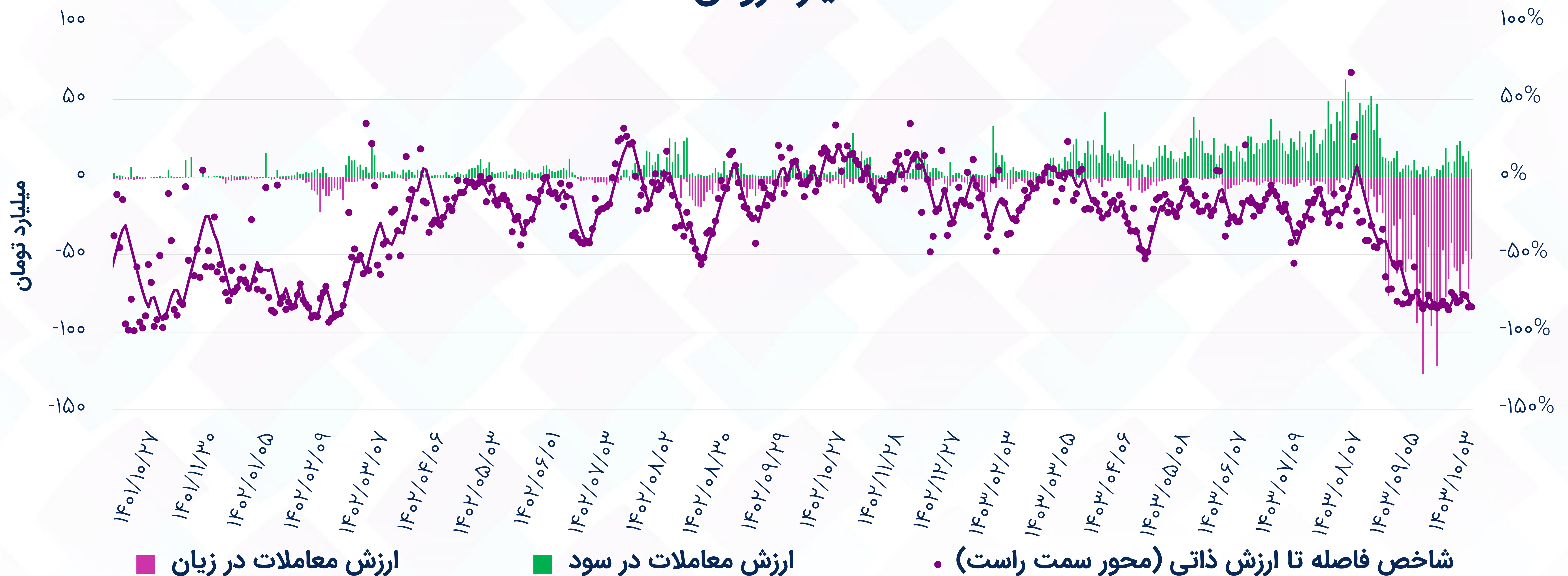
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

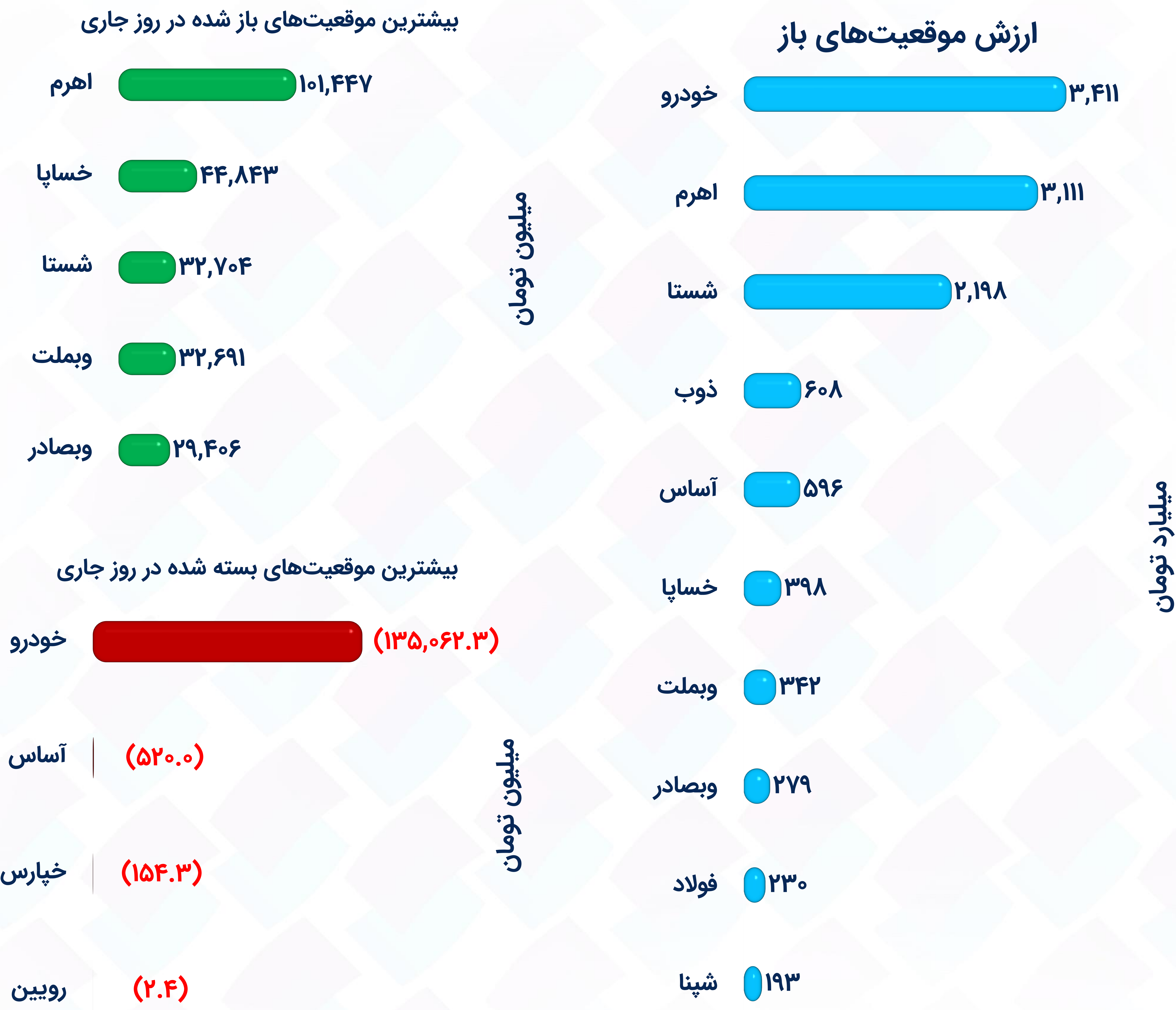
اختیار خرید

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
خودرو	۳۹	۲۲۷.۴	۲,۴۹۴.۸	۲۲۴.۰	۳.۴	(۵.۳%)
اهرم	۴۳	۱۷۴.۷	۹۹۵.۳	۱۶۵.۰	۹.۷	(۱۸.۰%)
شستا	۴۳	۵۴.۷	۵۳۳.۶	۵۱.۱	۳.۶	(۶.۷%)
ذوب	۱۴	۱۳.۹	۵۱.۱	۱۲.۲	۱.۷	(۲۱.۶%)
وبملت	۱۵	۶.۱	۴۵.۳	۴.۵	۱.۶	(۳۴.۰%)
خسپا	۱۶	۶.۱	۹۰.۱	۲.۱	۳.۹	(۵۱.۵%)
جهش	۱۷	۵.۶	۲۱.۴	۵.۶	۰.۰	(۱۱.۳%)

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
اهرم	۱۶	۴۰,۱۲۸.۴	۲,۳۰۹,۴۴۸.۴	۳,۶۱۲.۴	۳۶,۵۱۶.۰	(۸۷.۳%)
خودرو	۱۱	۱۵,۹۱۱.۶	۱,۶۹۸,۶۷۵.۴	۱,۳۱۲.۴	۱۴,۵۹۹.۲	(۷۳.۲%)
شستا	۲۰	۱,۴۹۱.۹	۱۹۴,۲۰۲.۲	۰.۷	۱,۴۹۱.۲	(۹۷.۴%)
ذوب	۲	۶۲.۷	۲,۹۵۴.۴	۰.۰	۶۲.۷	(۹۸.۲%)
وبملت	۱	۴۶.۰	۱,۶۱۵.۴	۰.۰	۴۶.۰	(۸۸.۷%)
نارنج اهرم	۱	۳۶.۴	۲۷۴.۵	۰.۰	۳۶.۴	(۸۱.۰%)
خودران	۲	۶.۸	۱۰۷.۰	۴.۸	۲.۱	(۴۸.۸%)

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



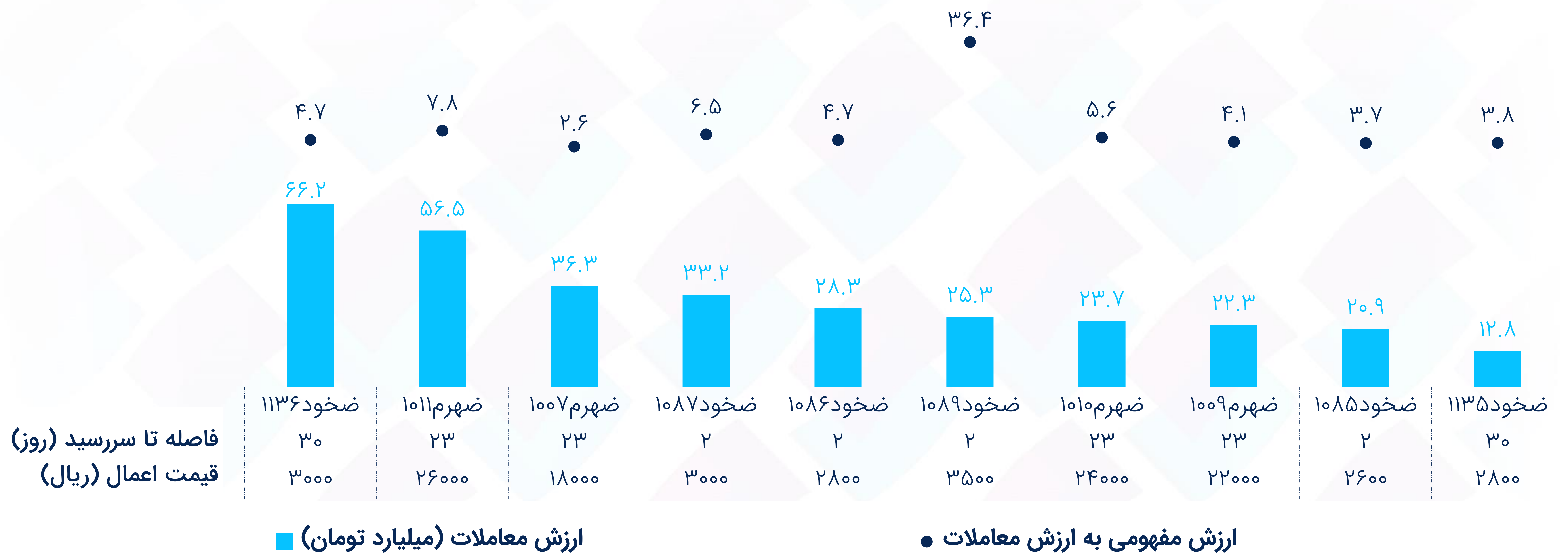
میلیون تومان



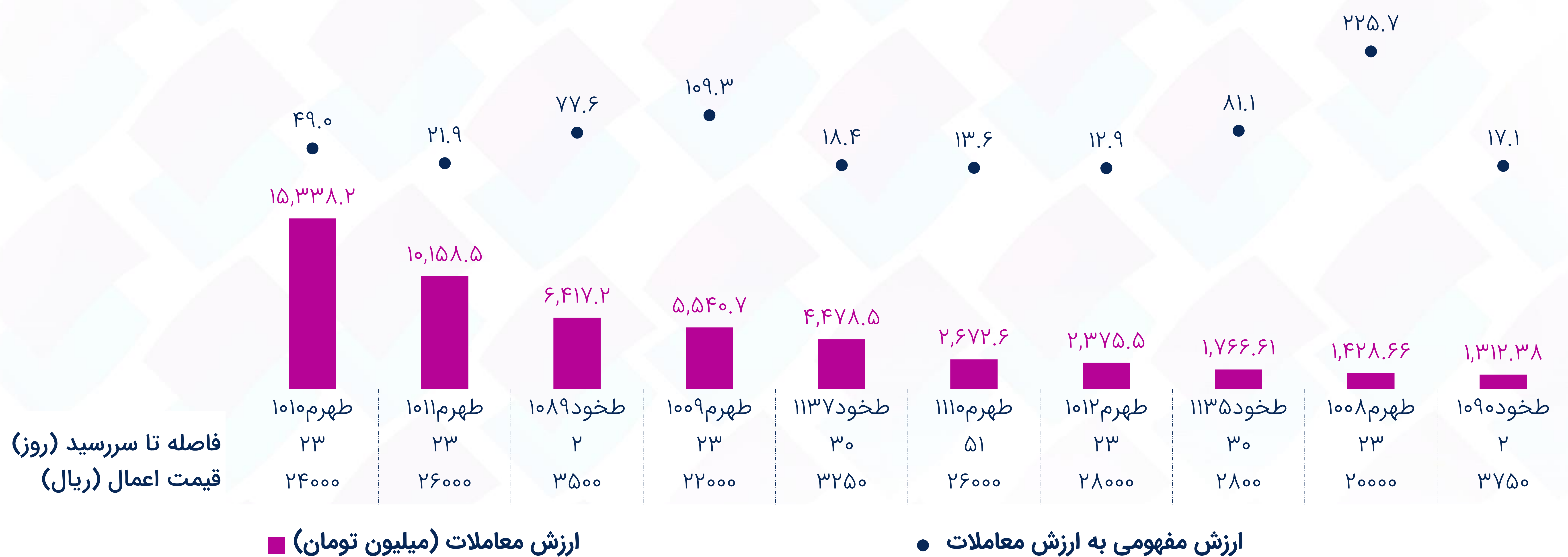
میلیارد تومان

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
ضموج ۱۰۰۰	موج	۷,۵۰۰	۱۳	۳۰۰.۰	۳,۰۰۰	۲۲,۴۸۰	۱۰,۵۰۰	(۵۳.۳%)	۳.۵	۱.۰۰	۱۵,۰۷۱	۴۰۲%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۱۱۸	۹.۸	۲,۰۰۰	۱۳,۰۶۰	۱۳,۰۰۰	(۰.۵%)	۶.۵	۰.۹۹	۳,۰۳۴	۵۲%
ضتاب ۱۱۰۳	شتاب	۷,۰۰۰	۴۴	۷۹.۳	۵,۲۸۷	۱۴,۰۳۰	۱۲,۲۸۷	(۱۲.۴%)	۲.۳	۱.۰۰	۷,۲۹۱	۳۸%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۲۵	۳۲.۰	۱,۰۶۶	۶,۱۲۰	۶,۴۷۹	۵.۹%	۶.۱	۰.۹۴	۱,۲۳۸	۱۶%
ضتوان ۱۲۱۷	توان	۱۹,۰۰۰	۷۶	۱۲.۴	۷,۲۹۴	۲۶,۱۵۴	۲۶,۲۹۴	۰.۵%	۳.۶	۰.۹۹	۸,۳۳۸	۱۴%

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
ضخود ۱۰۹۲	خودرو	۴,۵۰۰	۲	۹.۳	۱	۳,۵۶۹	۴,۵۰۱	۲۶%	۴,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۲۳	۵.۳	۵	۵۶۵	۱,۰۰۵	۷۸%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۵۱	۶۳.۹	۲۱	۵۶۵	۱,۰۲۱	۸۱%	۴۸.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۵۱	۲۸.۲	۳۱	۵۶۵	۹۳۱	۶۵%	۳۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۵۱	۱۰۴.۶	۳۴	۵۶۵	۸۳۴	۴۸%	۲۴.۵	۰.۰۲	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
طهرم ۱۰۱۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۳	۱.۲	۲,۳۰۰	۲۷,۷۶۰	۲۷,۷۰۰	(۰.۲%)	۱۲.۰	-۰.۷۲	۲,۰۴۷	(۱۱.۰%)
طخود ۱۰۹۰	خودرو	۳,۷۵۰	۲	۱,۳۱۲.۴	۲۰۹	۳,۵۶۹	۳,۵۴۱	(۰.۸%)	۱۶.۹	-۰.۹۰	۱۷۳	(۱۷.۱%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۵۱	۱,۲۳۵.۸	۲,۶۹۴	۲۷,۷۶۰	۲۷,۳۰۶	(۱.۶%)	۱۰.۱	-۰.۵۸	۲,۰۱۹	(۲۵.۱%)
طران ۱۱۰۹	خودران	۱۱,۰۰۰	۵۵	۴.۸	۹۵۰	۱۰,۷۰۰	۱۰,۰۵۰	(۶.۱%)	۱۰.۶	-۰.۴۲	۵۱۹	(۴۵.۴%)
طران ۱۱۰۸	خودران	۱۰,۰۰۰	۵۵	۲.۱	۴۱۴	۱۰,۷۰۰	۹,۵۸۶	(۱۰.۴%)	۲۳.۲	-۰.۲۰	۱۷۹	(۵۶.۸%)

گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

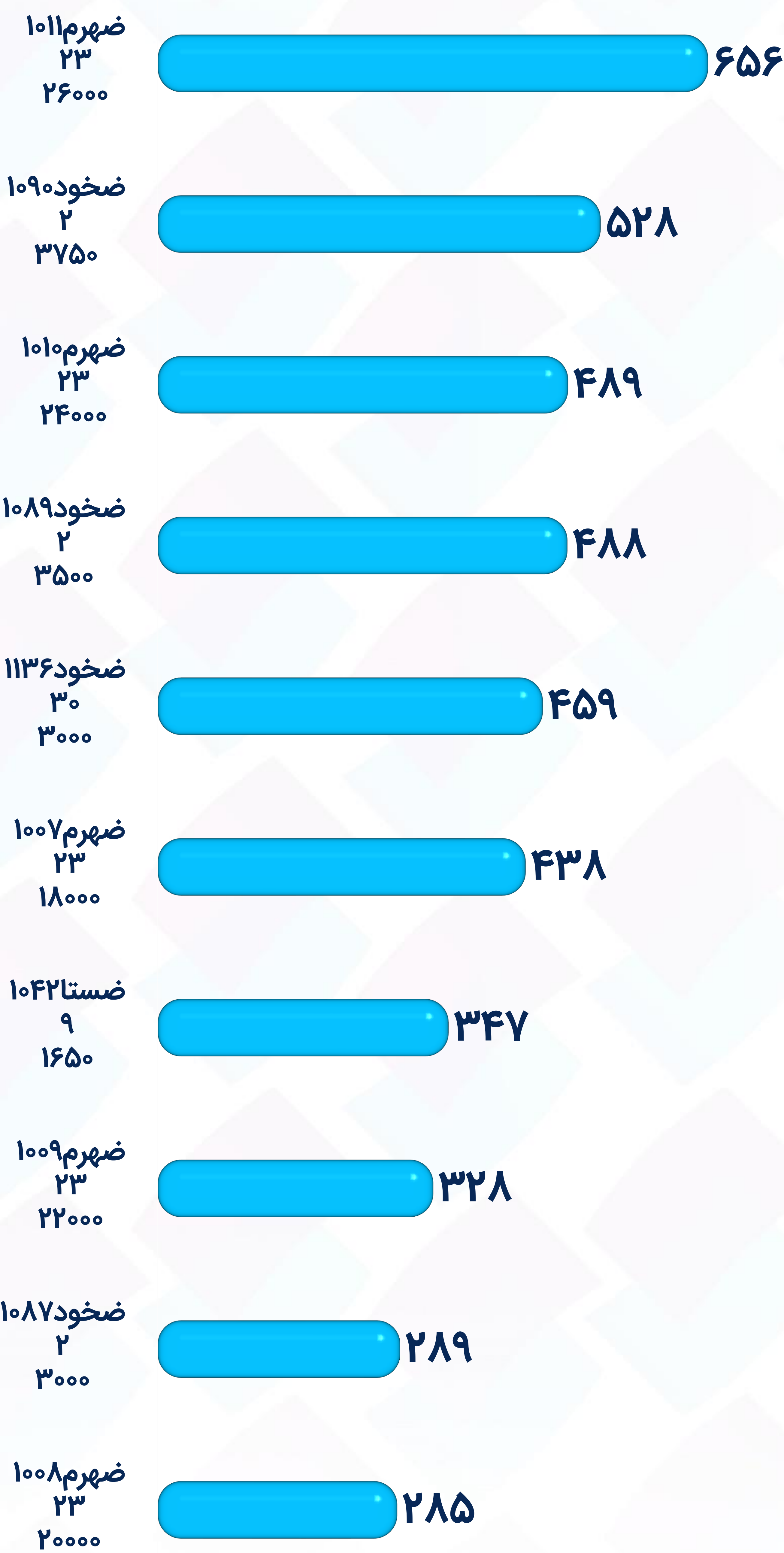
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طخود ۱۰۸۴	خودرو	۲,۴۰۰	۲	۴۴.۶	۴	۳,۵۶۹	۲,۳۹۶	(۳۲.۹%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۵	شستا	۹۵۰	۹	۱۳.۷	۳	۱,۵۰۳	۹۴۷	(۳۷.۰%)	۳۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۰	شستا	۵۵۰	۳۷	۲.۳	۱۰	۱,۵۰۳	۵۴۰	(۶۴.۱%)	۵۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۴	شستا	۸۵۰	۹	۱۱.۲	۵	۱,۵۰۳	۸۴۵	(۴۳.۸%)	۱۶۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۰۸۵	خودرو	۲,۶۰۰	۲	۷۶.۸	۳	۳,۵۶۹	۲,۵۹۷	(۲۷.۲%)	۸۶۵.۷	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

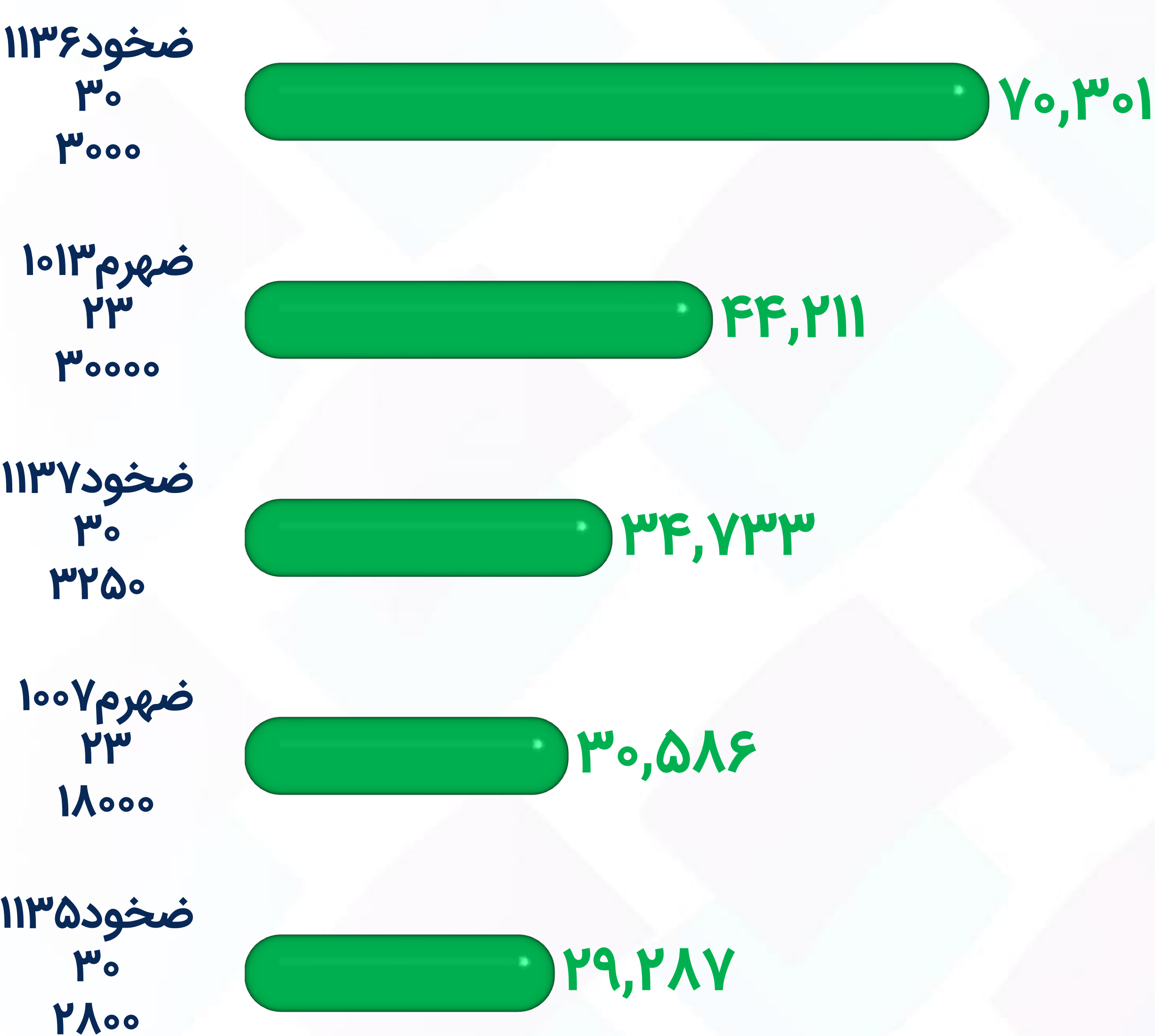
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

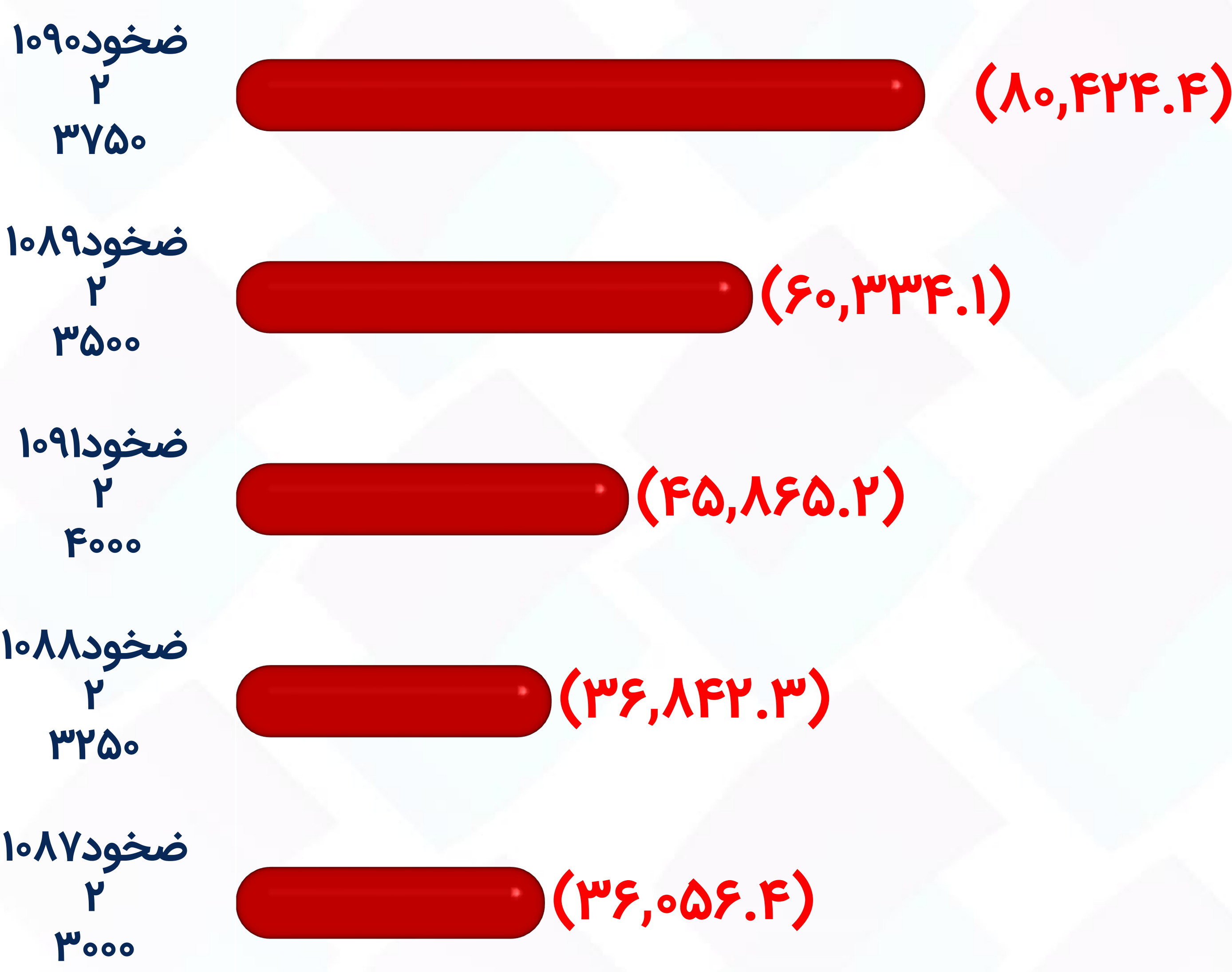
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

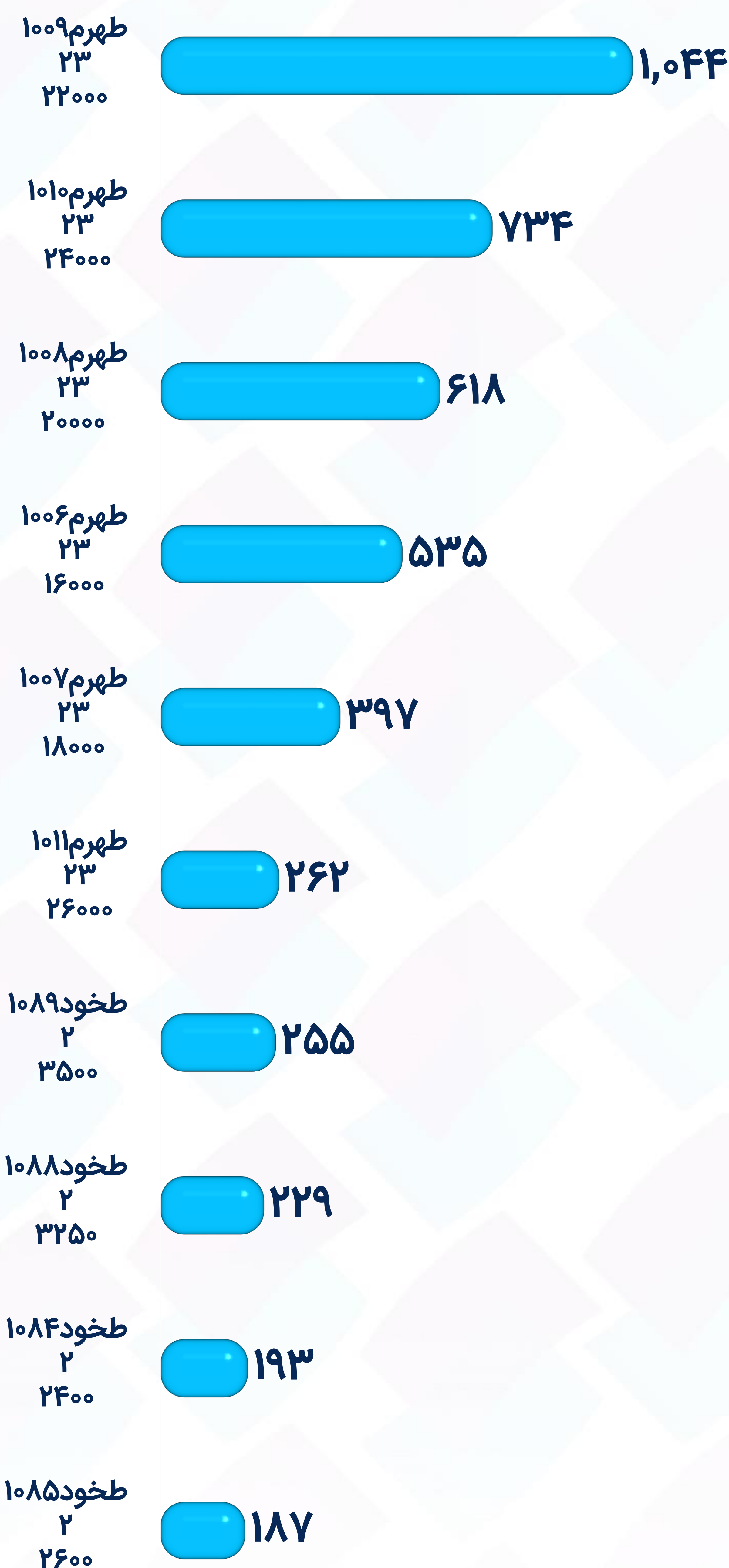


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

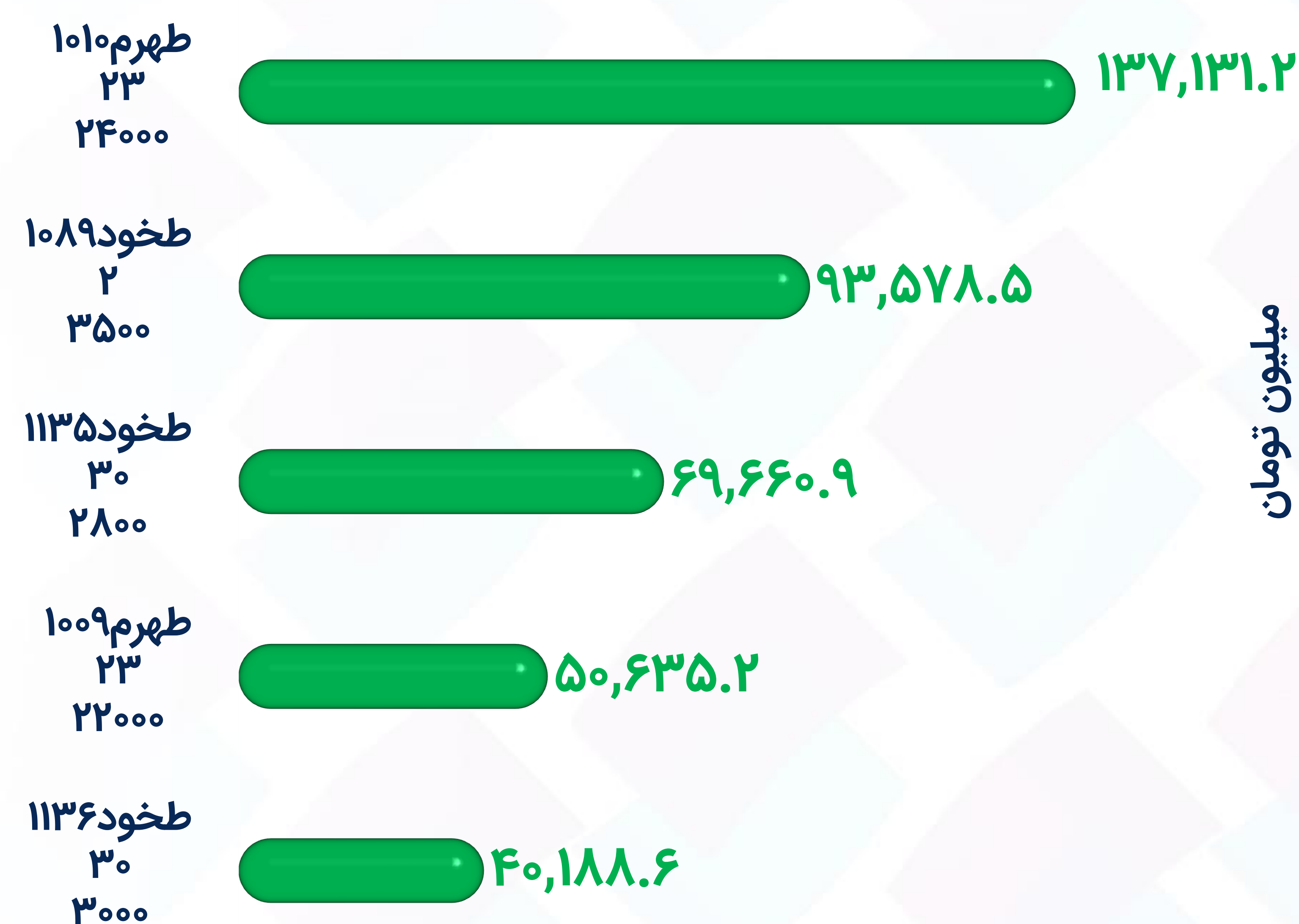
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

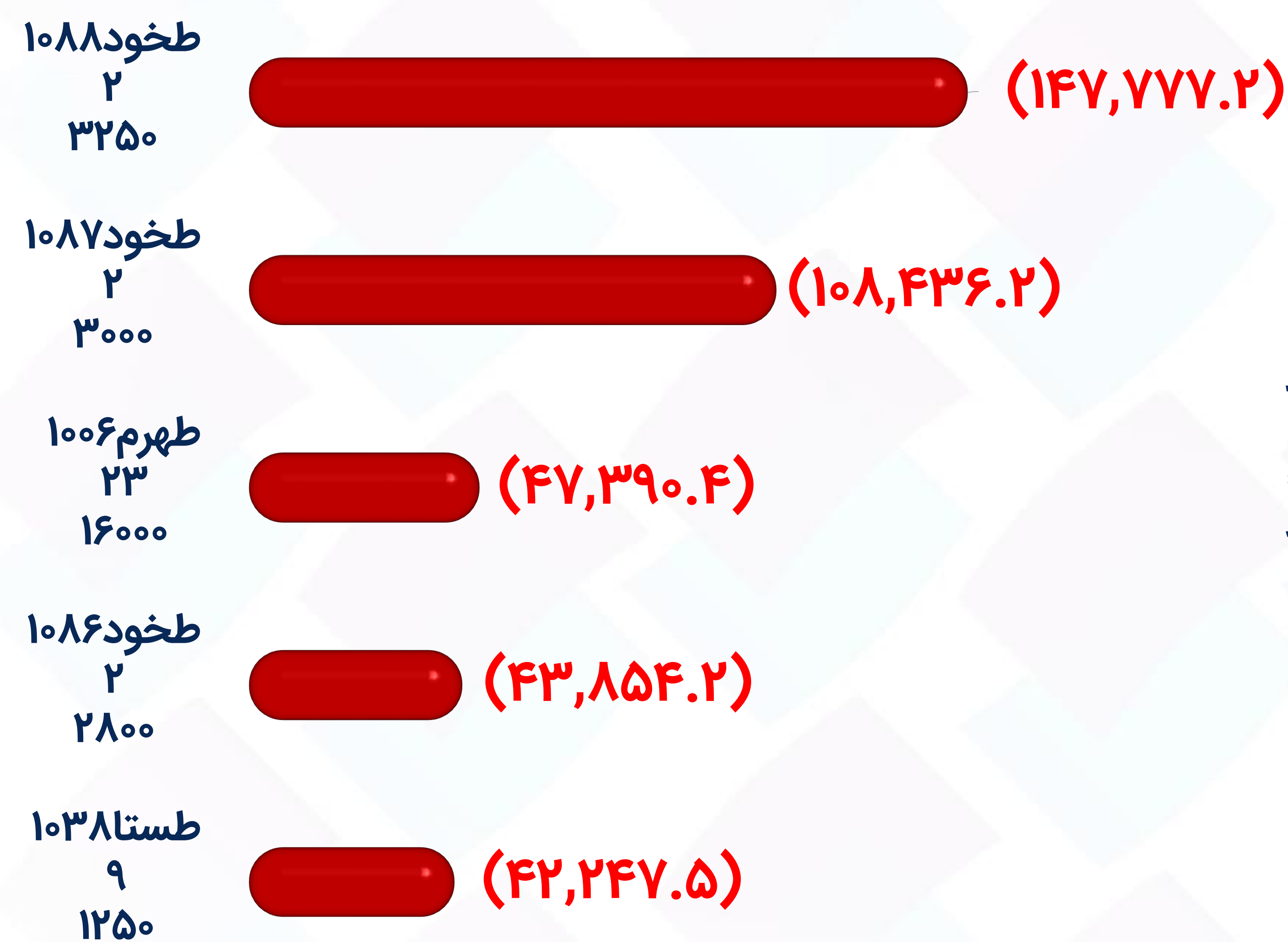
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

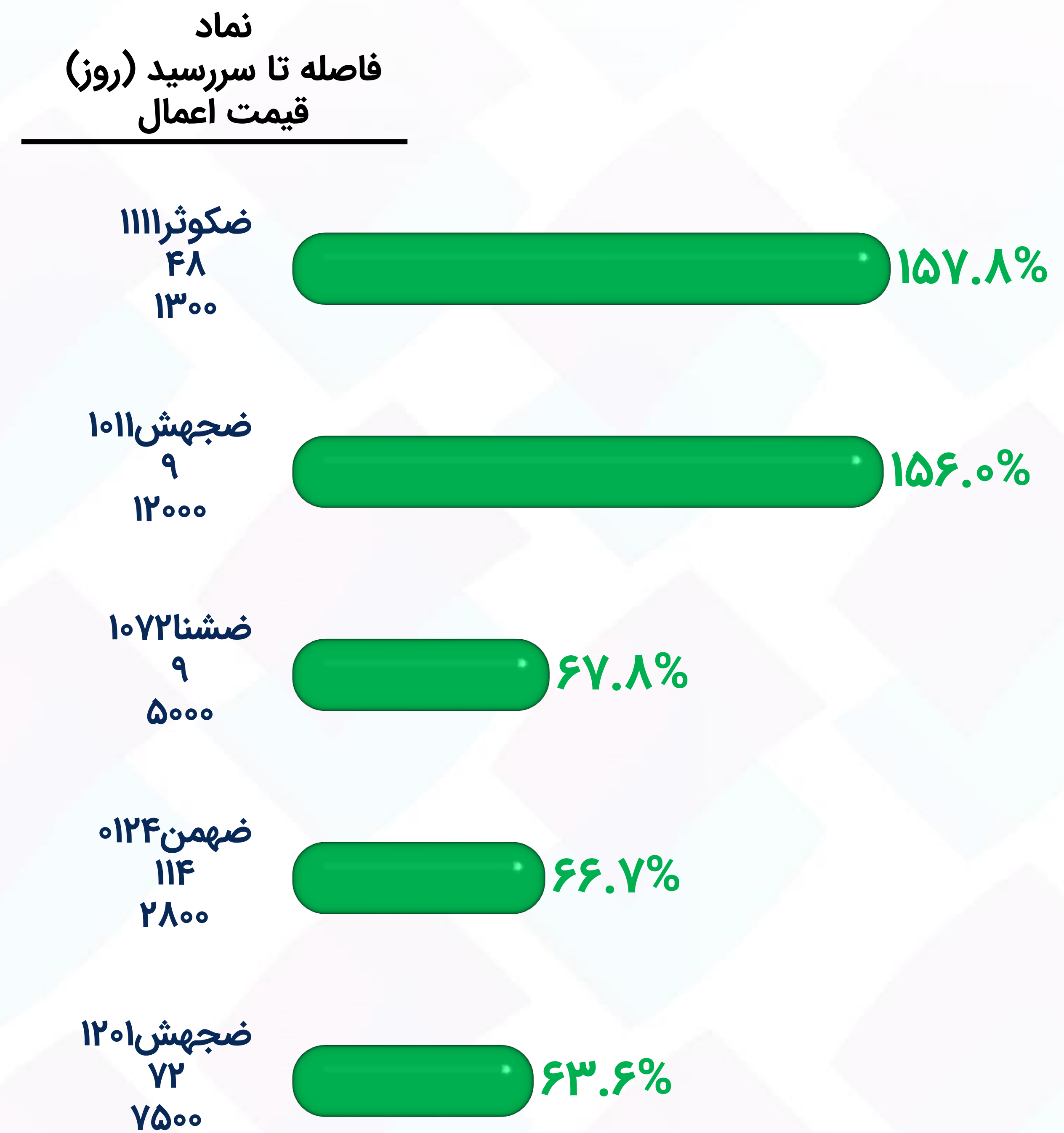
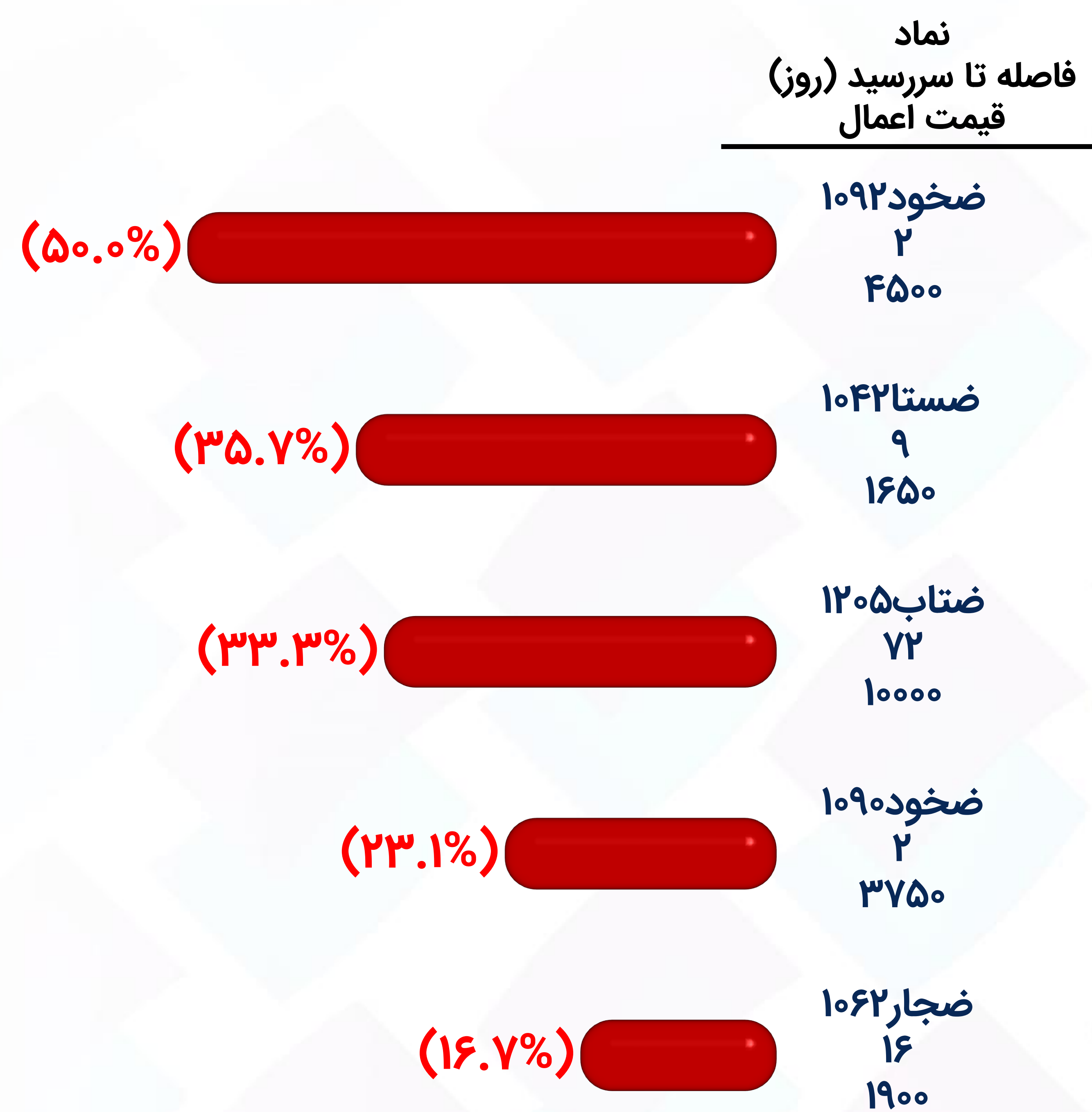
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



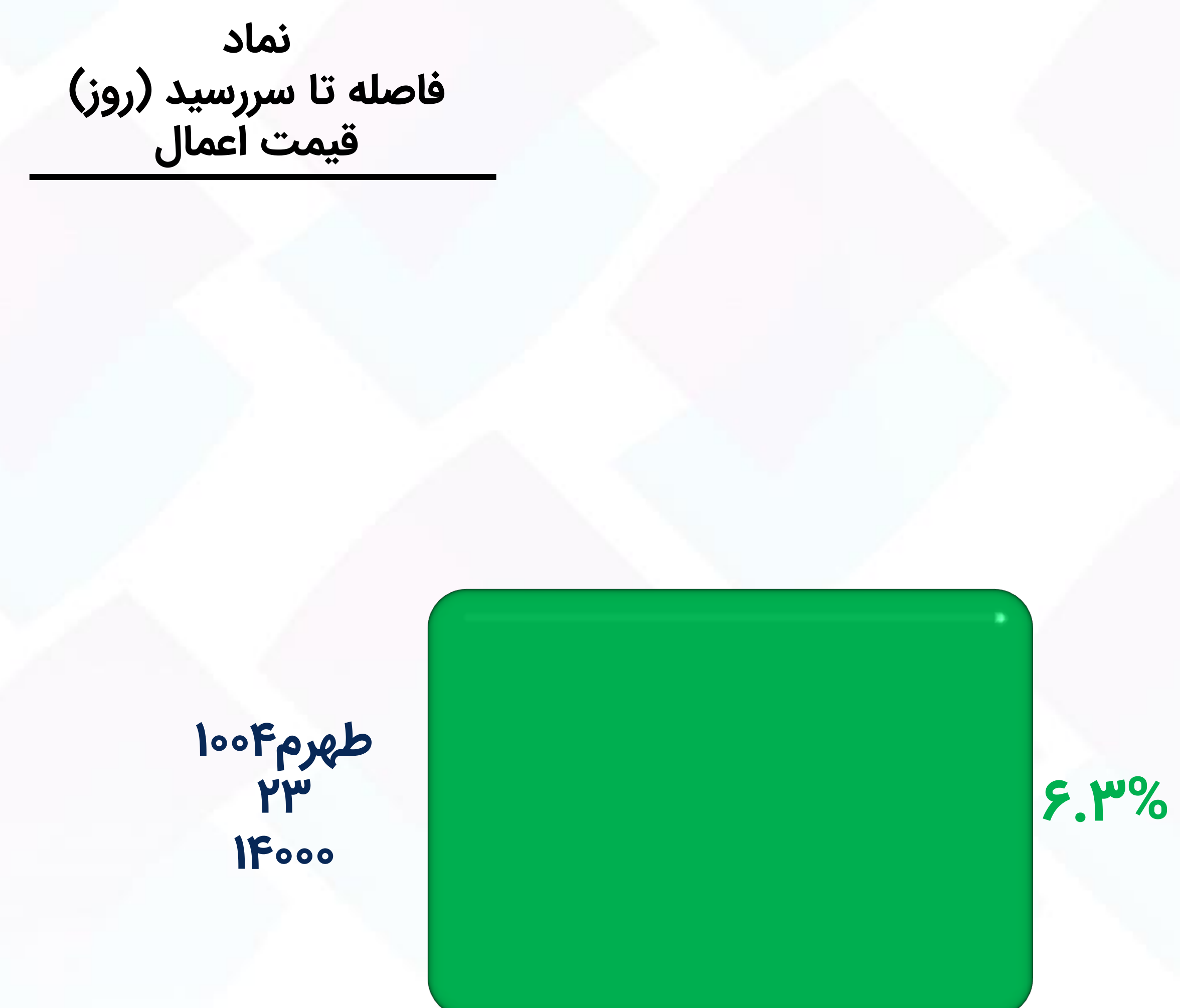
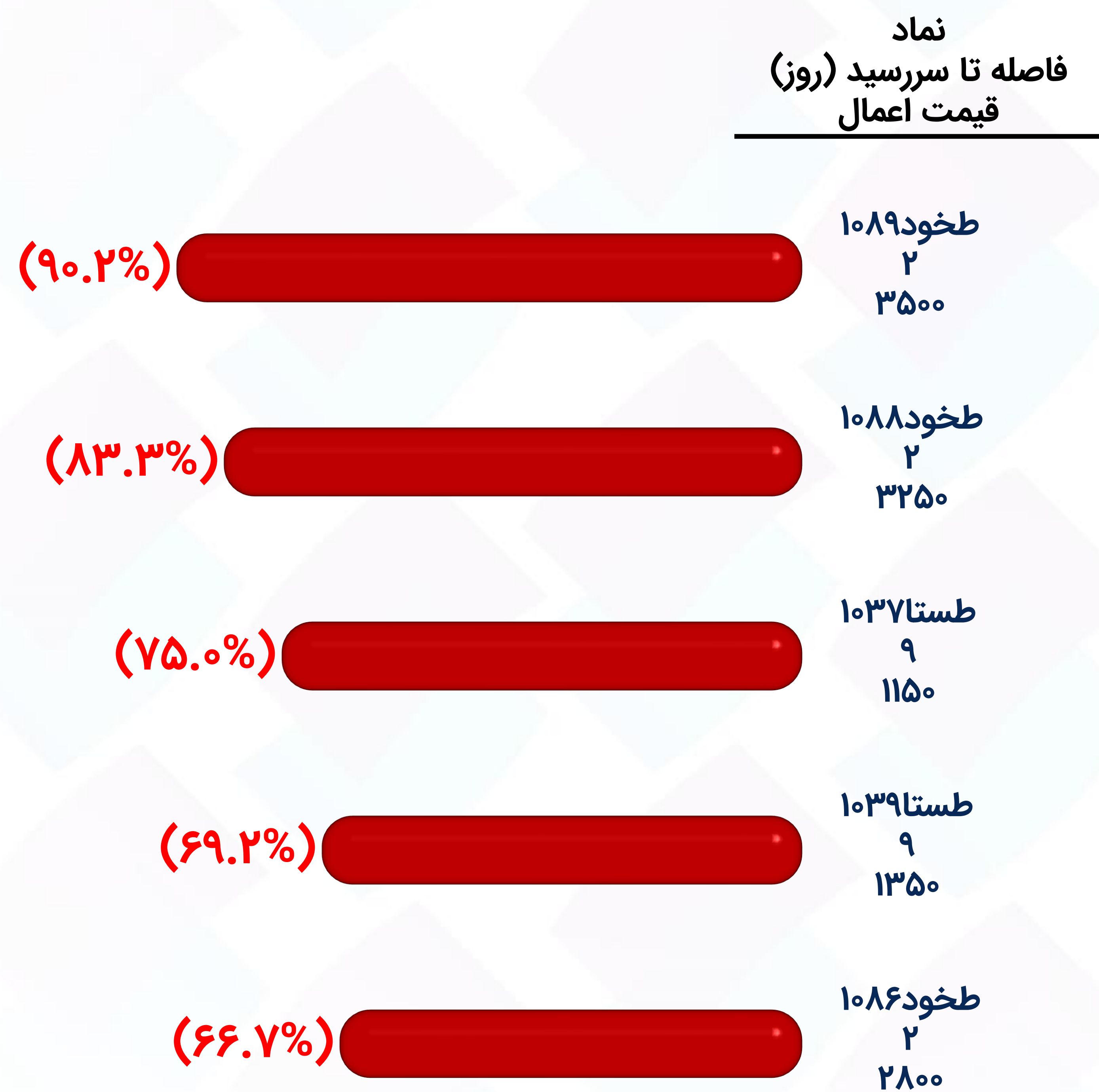
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

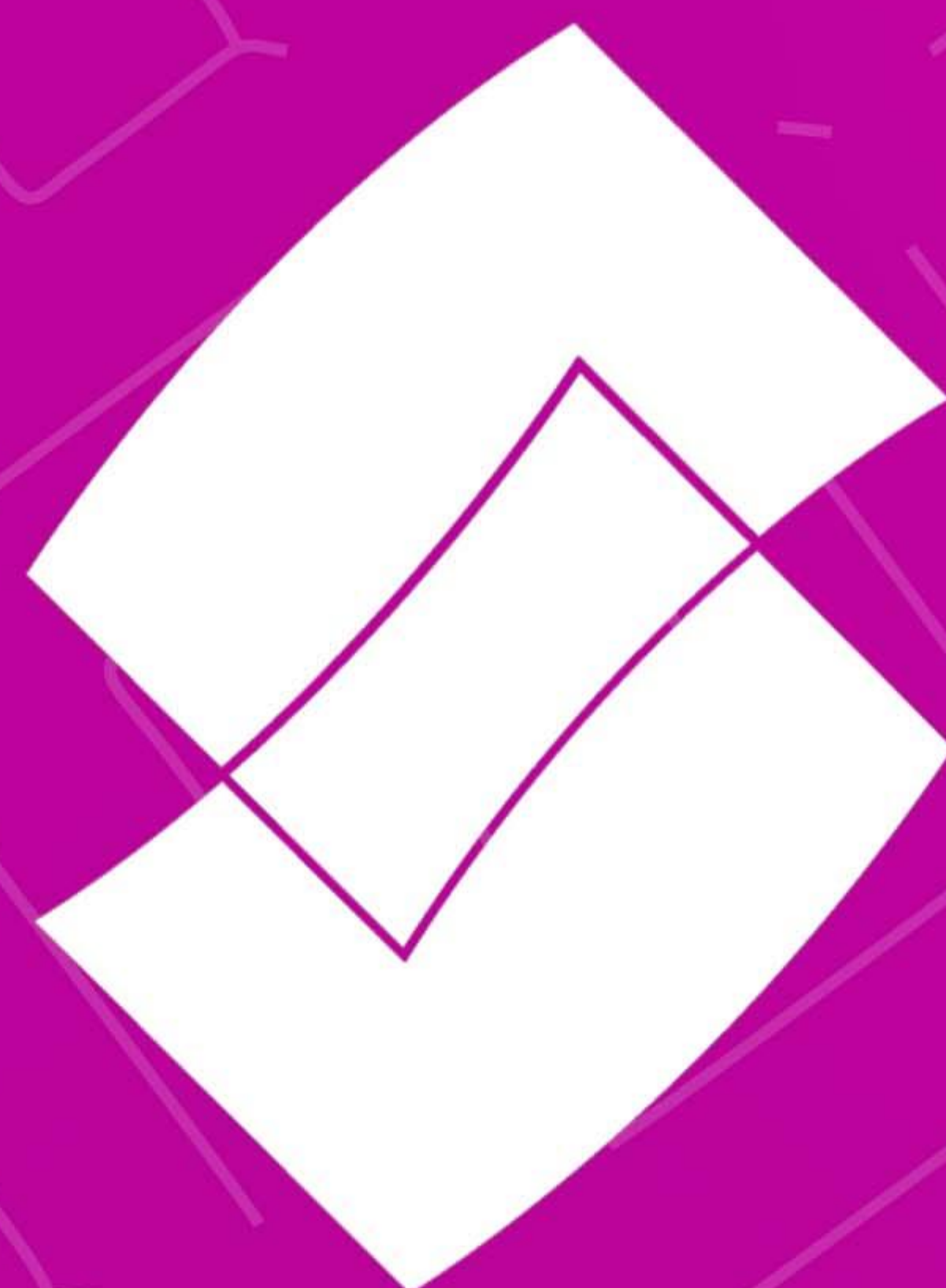
اختیار خرید



اختیار فروش



(۱) تنها قراردادهایی که طی 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.