

شماره
۳۹۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۴ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





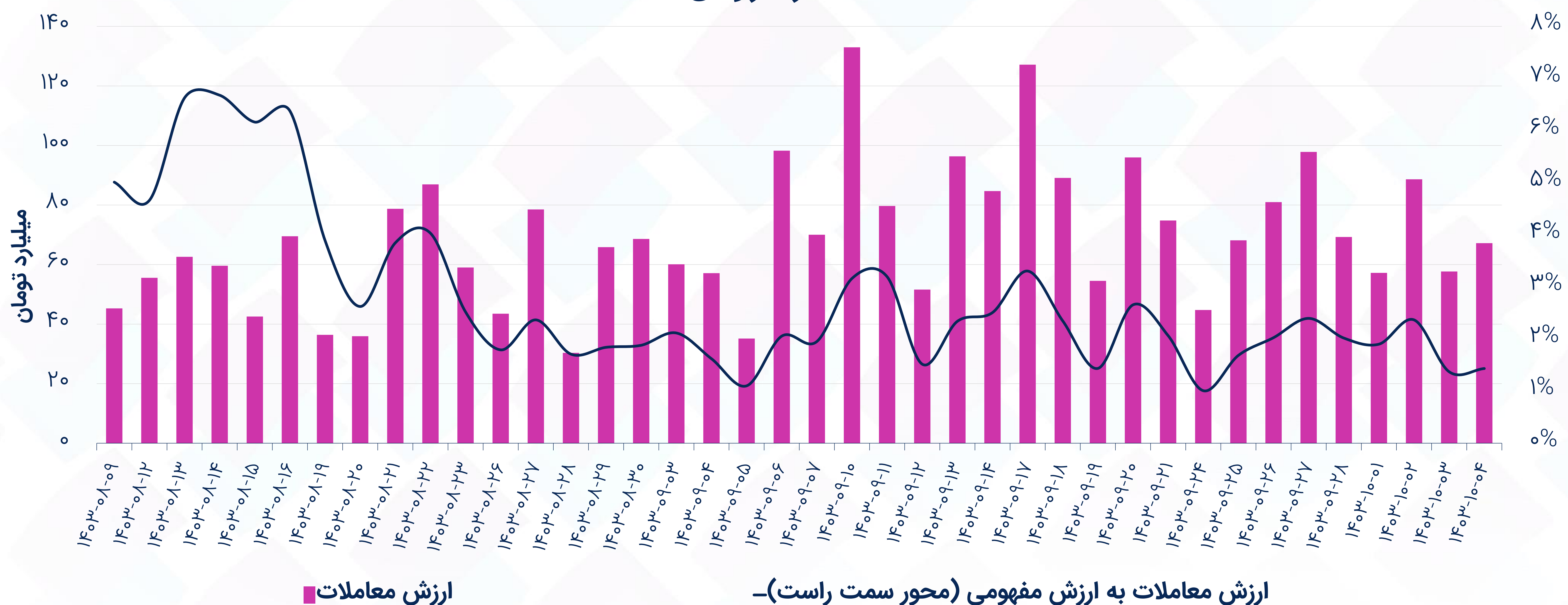
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



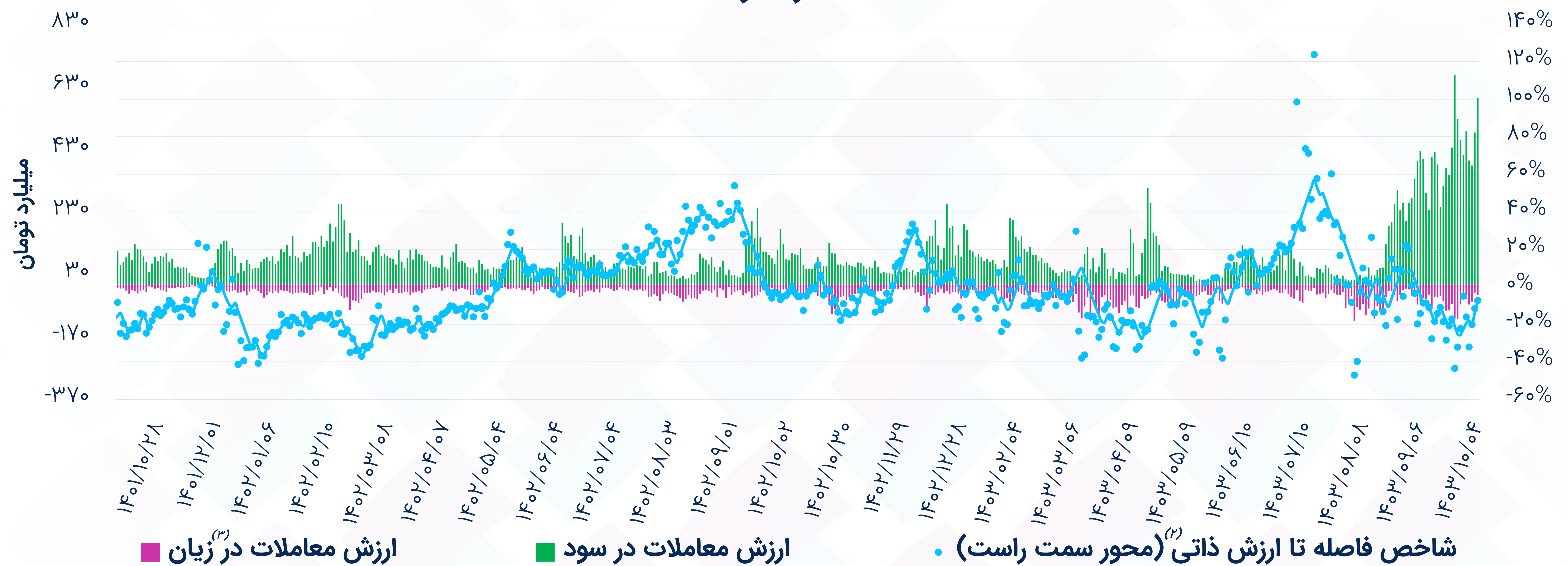
اختیار فروش



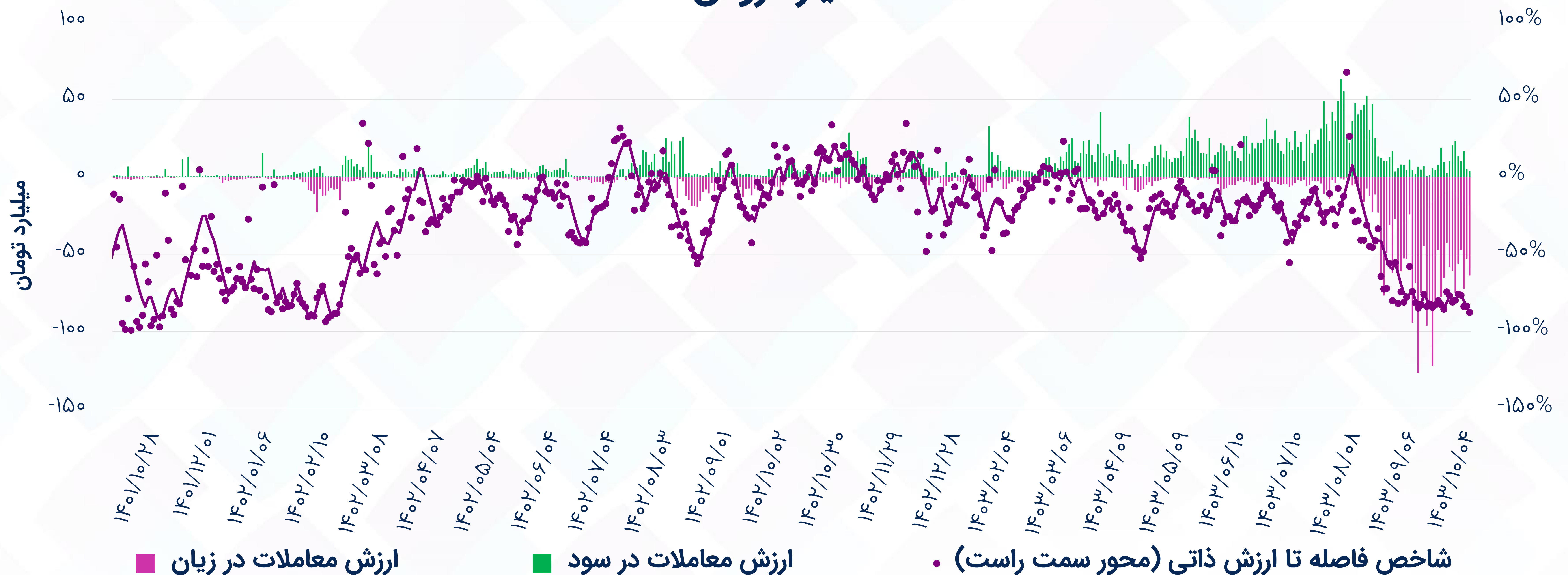
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

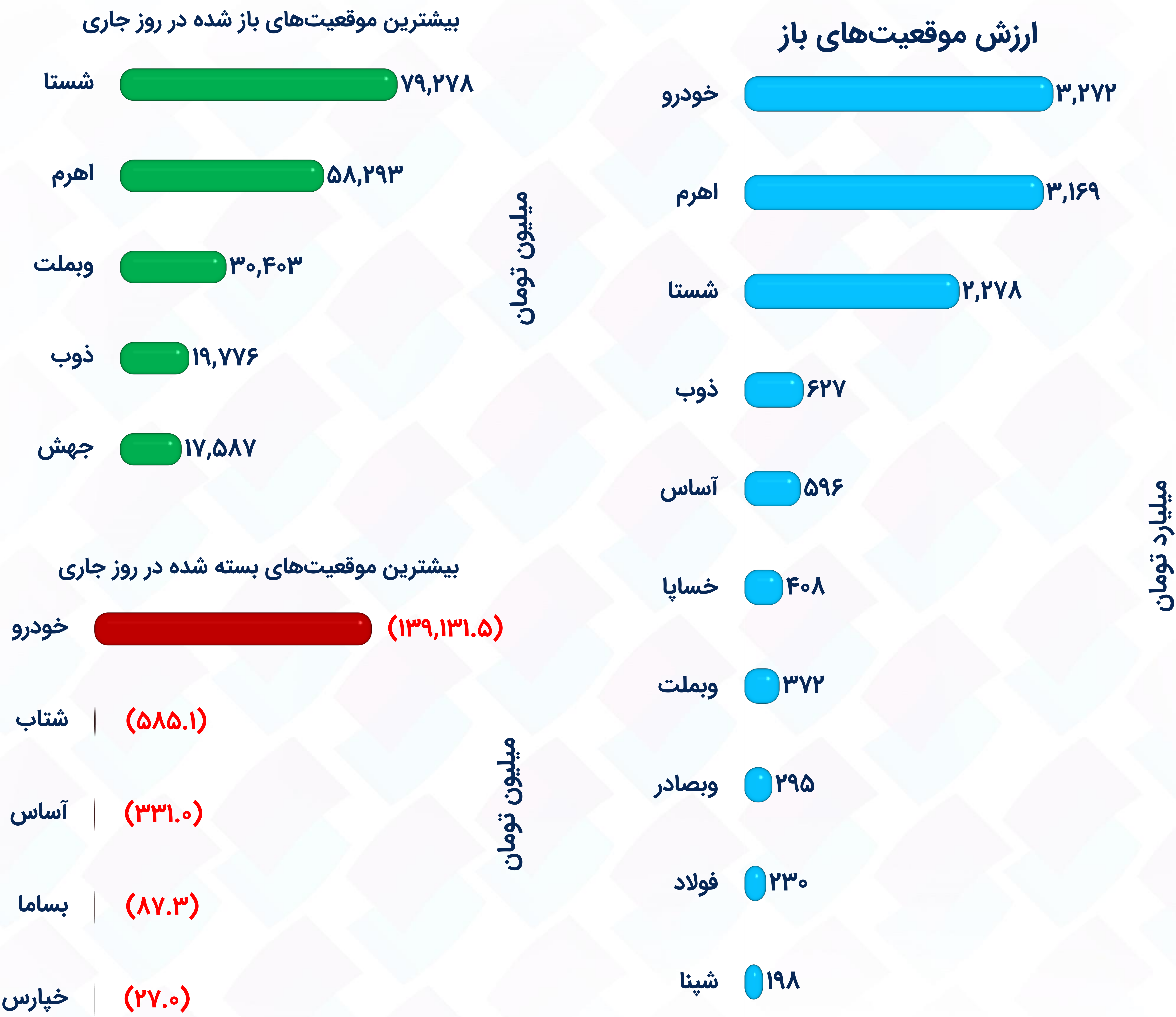
اختیار خرید

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	۴۰	۲۷۹.۲	۲,۵۴۲.۸	۲۶۷.۷	۱۱.۵	(۶.۱%)
اهرم	۴۴	۱۸۴.۲	۱,۱۵۰.۱	۱۸۰.۶	۳.۶	(۶.۵%)
شستا	۵۲	۹۵.۰	۸۸۲.۸	۸۵.۴	۹.۶	(۴.۹%)
ذوب	۱۷	۲۶.۵	۱۰۱.۵	۲۳.۰	۳.۵	(۱۴.۹%)
وبملت	۱۲	۸.۶	۵۲.۶	۷.۵	۱.۱	(۲۳.۲%)
جهش	۱۸	۷.۹	۲۸.۳	۷.۷	۰.۲	(۱۰.۲%)
خسپا	۱۱	۵.۶	۷۹.۵	۲.۰	۳.۶	(۳۷.۶%)

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	۴۵,۲۶۰.۲	۲,۶۱۳,۳۶۵.۲	۱,۰۳۹.۹	۴۴,۲۲۰.۳	(۸۸.۹%)
خودرو	۱۴	۱۸,۹۶۹.۲	۱,۷۵۳,۹۴۳.۷	۲,۴۶۱.۵	۱۶,۵۰۷.۷	(۸۳.۳%)
شستا	۱۸	۲,۷۵۹.۸	۳۱۱,۴۴۱.۴	۳۷.۶	۲,۷۲۲.۲	(۹۵.۶%)
ذوب	۳	۱۰۰.۲	۲,۸۲۹.۸	۱۸.۴	۸۱.۹	(۸۶.۶%)
وبملت	۲	۷۱.۲	۳,۱۲۳.۵	۰.۰	۷۱.۲	(۹۲.۹%)
اطلس	۲	۱۴.۶	۱,۱۹۹.۷	۰.۴	۱۴.۲	(۹۸.۸%)
خودران	۲	۷.۹	۱۳۱.۹	۵.۹	۲.۰	(۵۷.۹%)

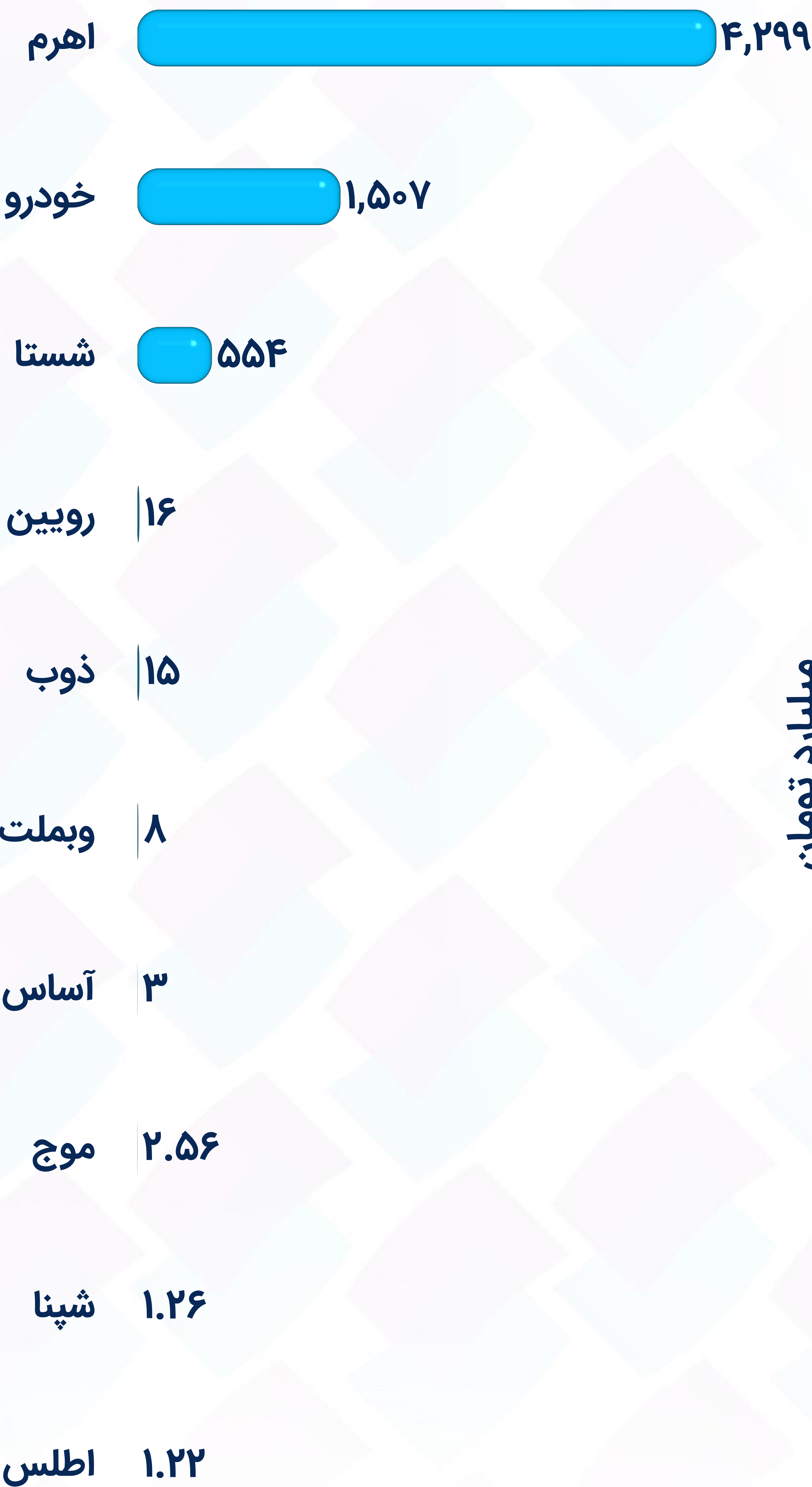
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

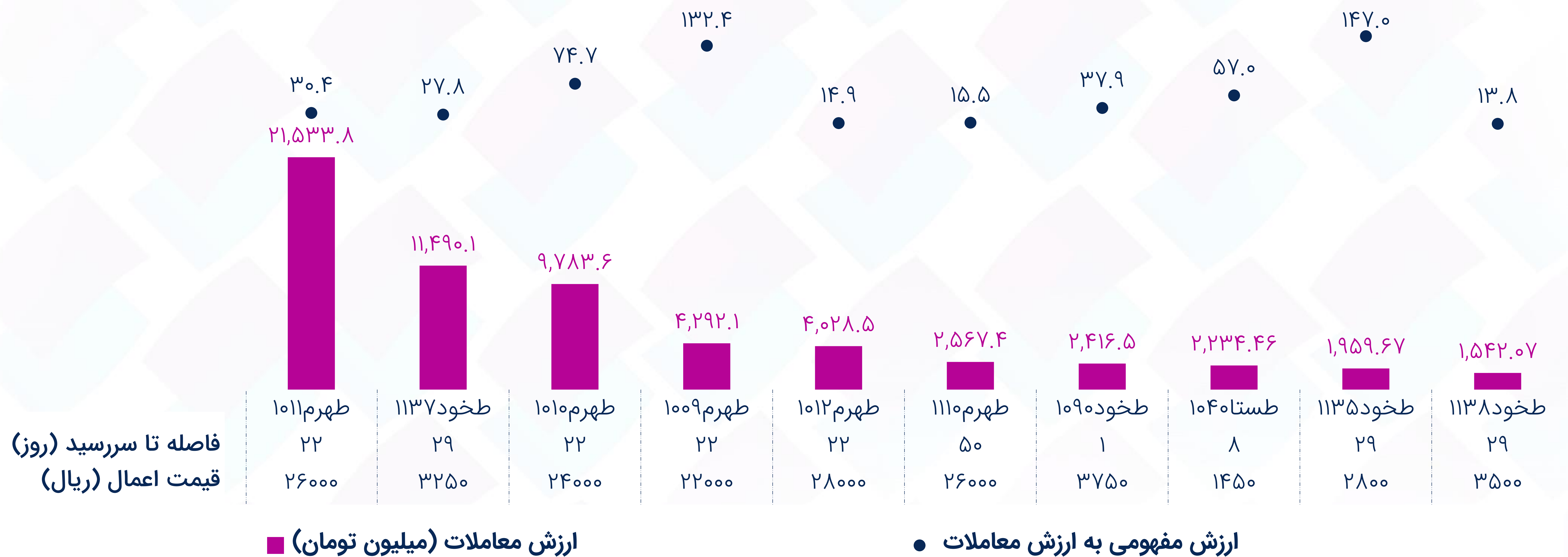


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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 ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷۸	۱۲.۰	۵۰	۲۸,۴۷۰	۳۴,۰۵۰	۱۹.۶%	۶۸۱.۰	۰.۲۸	۷۵۹	۱۴۱۸%
ضهم وزن ۱۲۰۱	هم وزن	۱۴,۰۰۰	۶۱	۲.۷	۱,۲۸۴	۱۹,۸۱۴	۱۵,۲۸۴	(۲۲.۹%)	۱۱.۹	۱.۰۰	۶,۵۵۲	۴۱۰%
ضبساما ۱۲۰۵	بساما	۴,۹۹۶	۶۱	۲.۳	۵۳۳	۶,۱۳۰	۵,۵۲۹	(۹.۸%)	۱۰.۴	۰.۹۹	۱,۳۹۹	۱۶۲%
ضهرم ۰۱۱۱	اهرم	۱۱,۰۰۰	۱۱۳	۵.۵	۱۱,۰۶۷	۲۸,۴۷۰	۲۲,۰۶۷	(۲۲.۵%)	۲.۰	۱.۰۰	۱۸,۴۶۸	۶۷%
ضرویین ۱۰۰۲	رویین	۹,۰۰۰	۲۶	۳.۱	۳,۴۳۳	۱۳,۳۸۸	۱۲,۴۳۳	(۷.۱%)	۳.۶	۱.۰۰	۴,۵۹۹	۳۴%

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	۲۲	۳.۸	۵	۵۸۰	۱,۰۰۵	۷۳%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۵۰	۱۲۶.۸	۱۹	۵۸۰	۱,۰۱۹	۷۶%	۵۳.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۱۰۷۵	شپنا	۶,۵۰۰	۸	۲.۵	۱۸	۵,۳۵۷	۶,۵۱۸	۲۲%	۳۶۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۵۰	۶۱.۳	۲۲	۵۸۰	۹۲۲	۵۹%	۴۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۵۰	۳۰۵.۴	۳۱	۵۸۰	۸۳۱	۴۳%	۲۶.۸	۰.۰۲	۱	(۹۸%)

(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

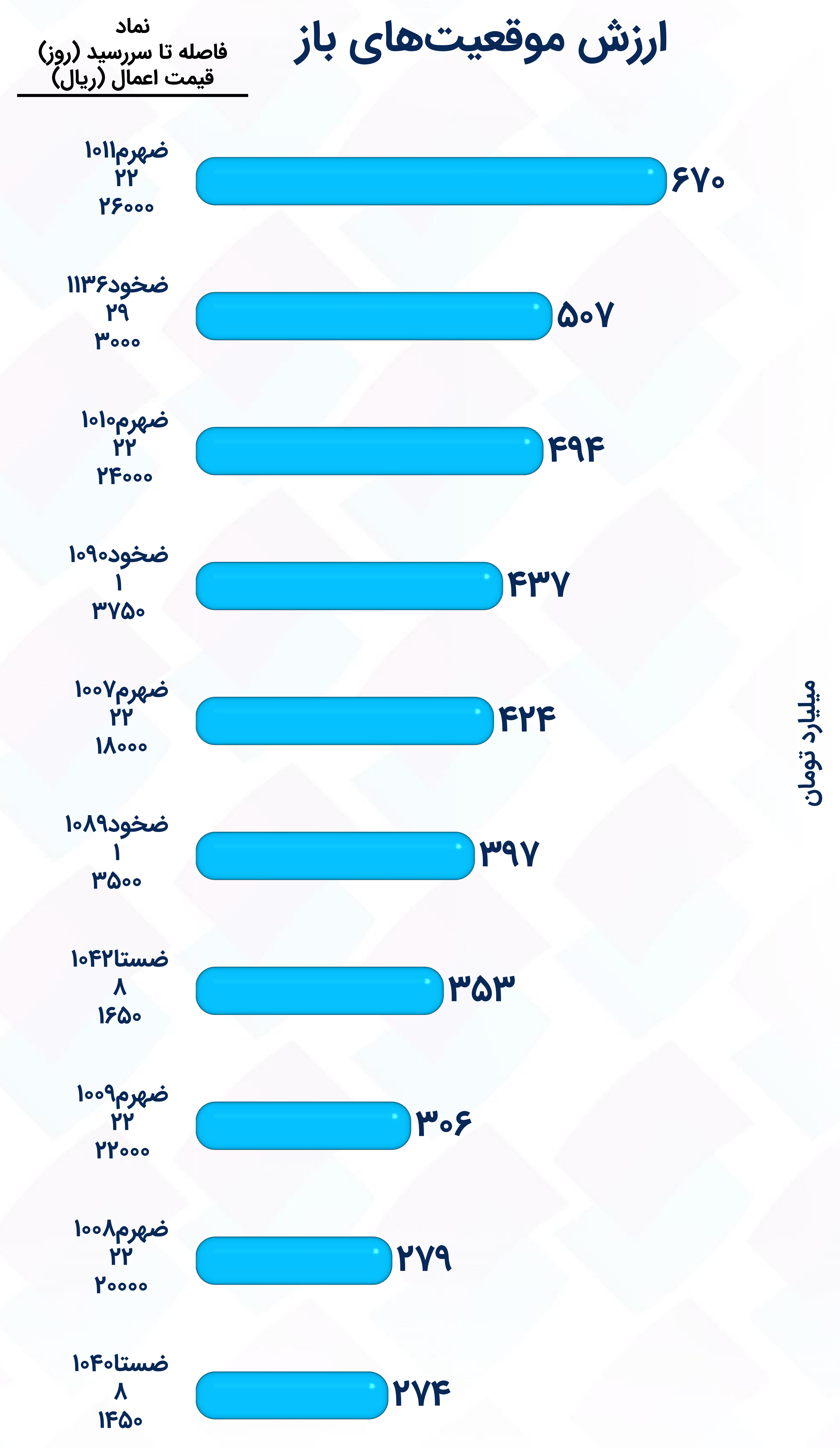
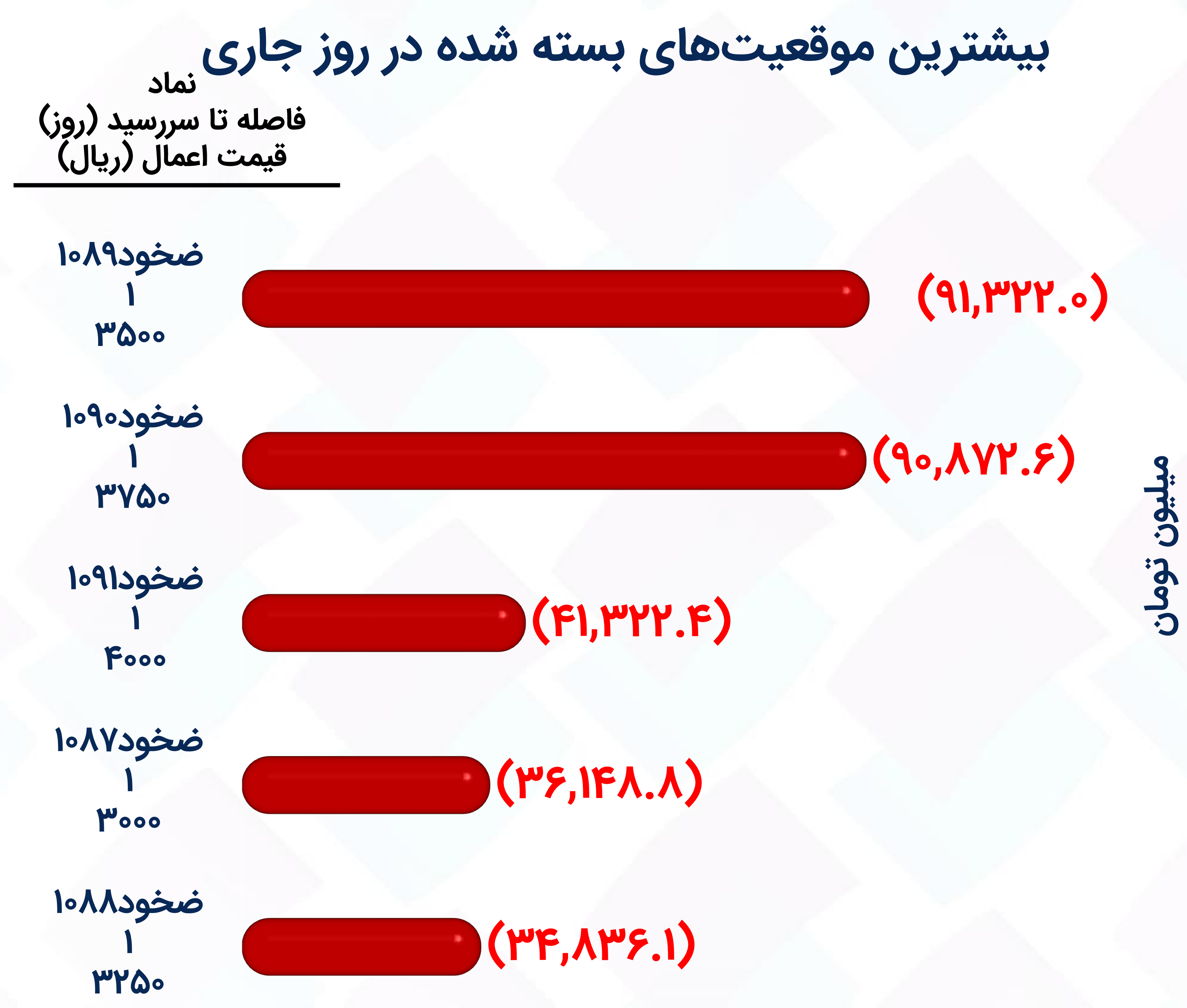
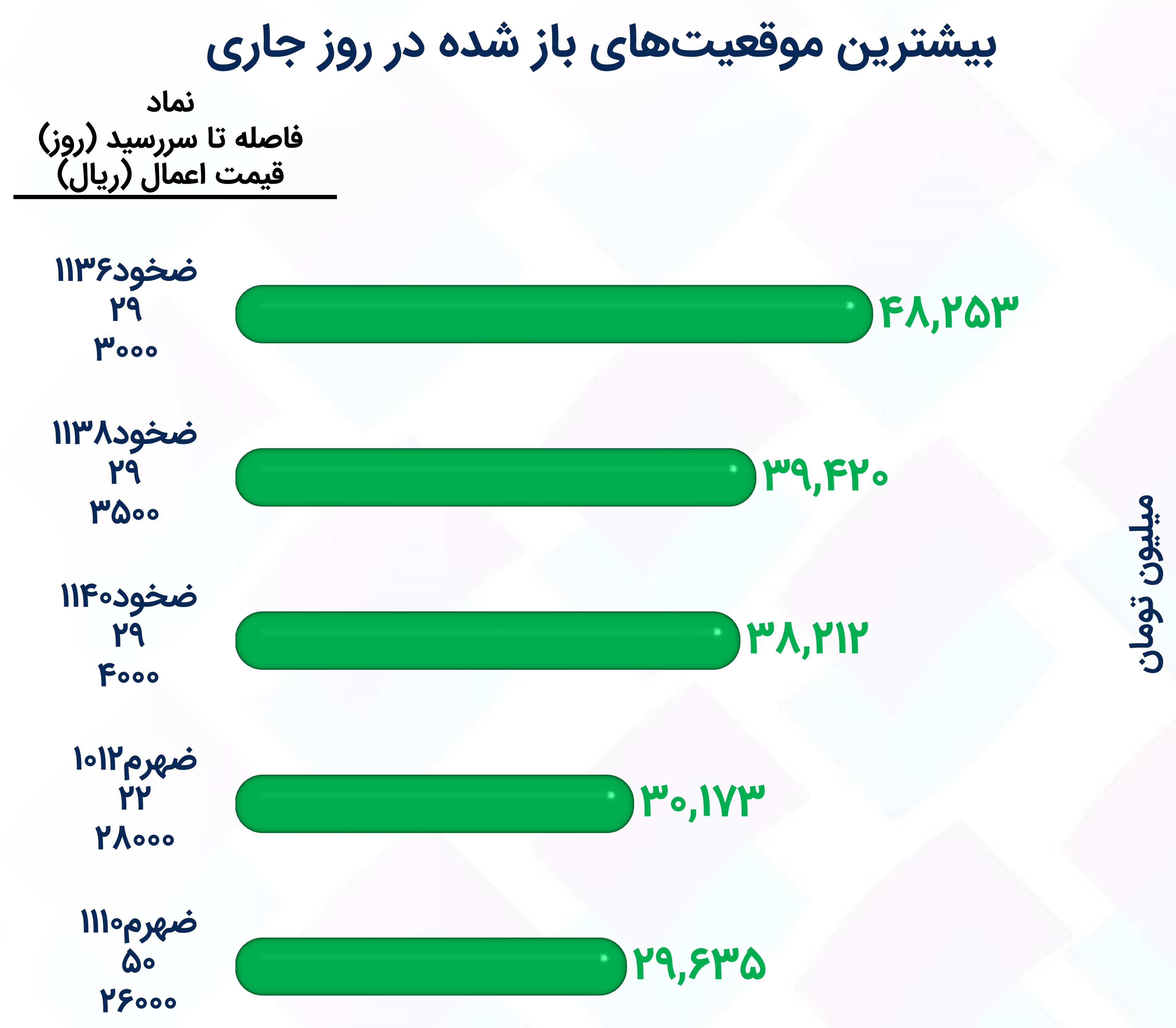
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طران ۱۱۰۹	خودران	۱۱,۰۰۰	۵۴	۵.۹	۸۴۵	۱۰,۹۹۰	۱۰,۱۵۵	(۷.۶%)	۱۲.۰	-۰.۳۴	۳۹۰	(۵۳.۹%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۵۰	۱,۰۳۹.۰	۳,۵۶۵	۲۸,۴۷۰	۲۶,۴۳۵	(۷.۱%)	۷.۴	-۰.۵۰	۱,۵۸۴	(۵۵.۶%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۵۰	۱۸.۴	۷۰	۵۸۰	۵۳۰	(۸.۶%)	۷.۶	-۰.۴۴	۲۸	(۶۰.۱%)
طستا ۱۰۴۱	شستا	۱,۵۵۰	۸	۳۷.۶	۷۴	۱,۵۴۰	۱,۴۷۶	(۴.۲%)	۱۹.۹	-۰.۴۷	۲۴	(۶۷.۹%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۲۹	۴۴.۹	۴۰۰	۳,۶۷۴	۳,۳۵۰	(۸.۸%)	۸.۴	-۰.۴۵	۱۲۵	(۶۸.۷%)

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 ۱۱۲۲	شستا	۷۵۰	۳۶	۱.۲	۹	۱,۵۴۰	۷۴۱	(۵۱.۹%)	۸۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۴	شستا	۸۵۰	۸	۱.۵	۲	۱,۵۴۰	۸۴۸	(۴۴.۹%)	۴۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۵	شستا	۹۵۰	۸	۵.۵	۲	۱,۵۴۰	۹۴۸	(۳۸.۴%)	۴۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۶	شستا	۱,۰۵۰	۸	۵۱.۹	۳	۱,۵۴۰	۱,۰۴۷	(۳۲.۰%)	۳۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۲۲	۴.۸	۴۱	۲۸,۴۷۰	۱۳,۹۵۹	(۵۱.۰%)	۳۴۰.۵	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.

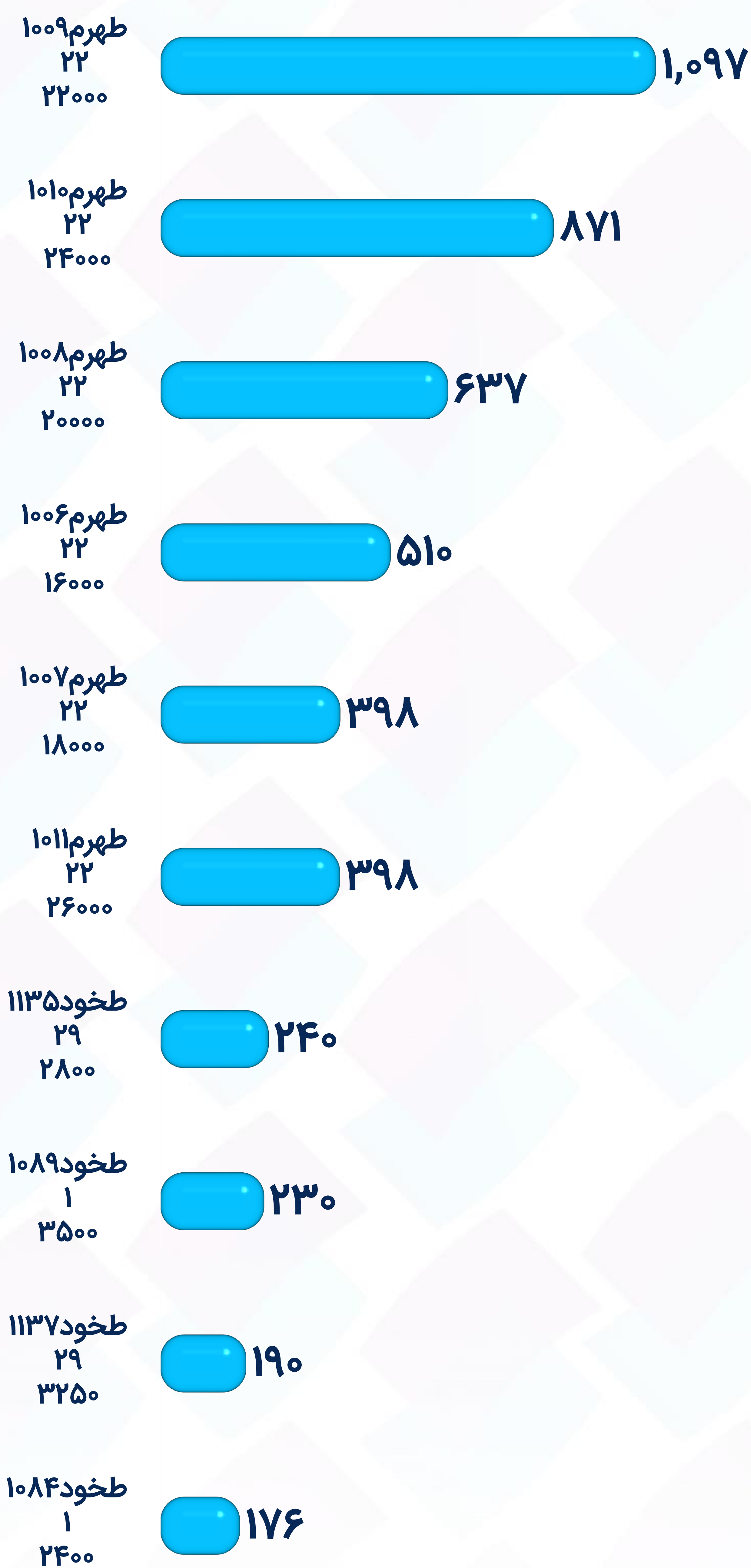
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

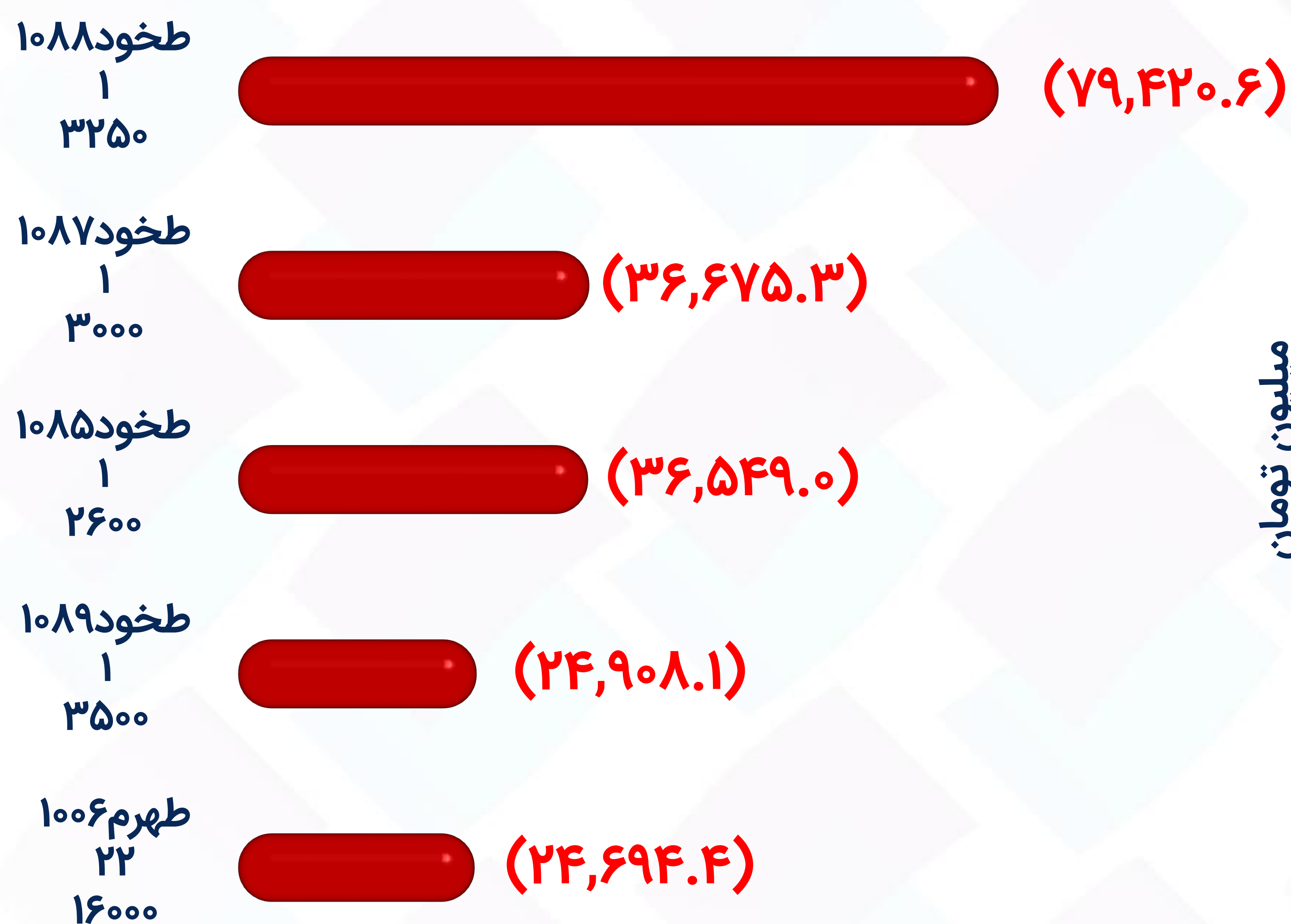
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

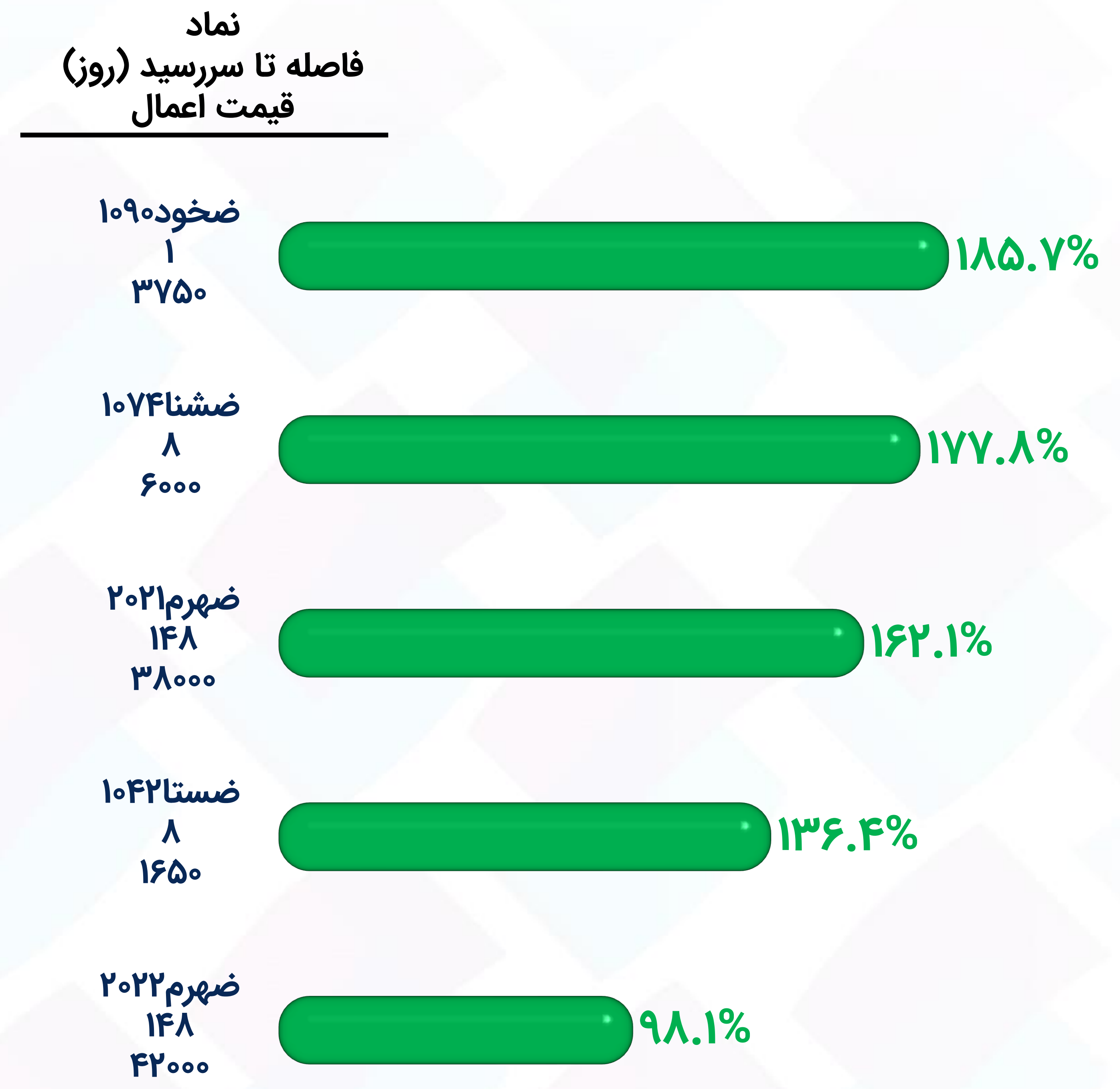
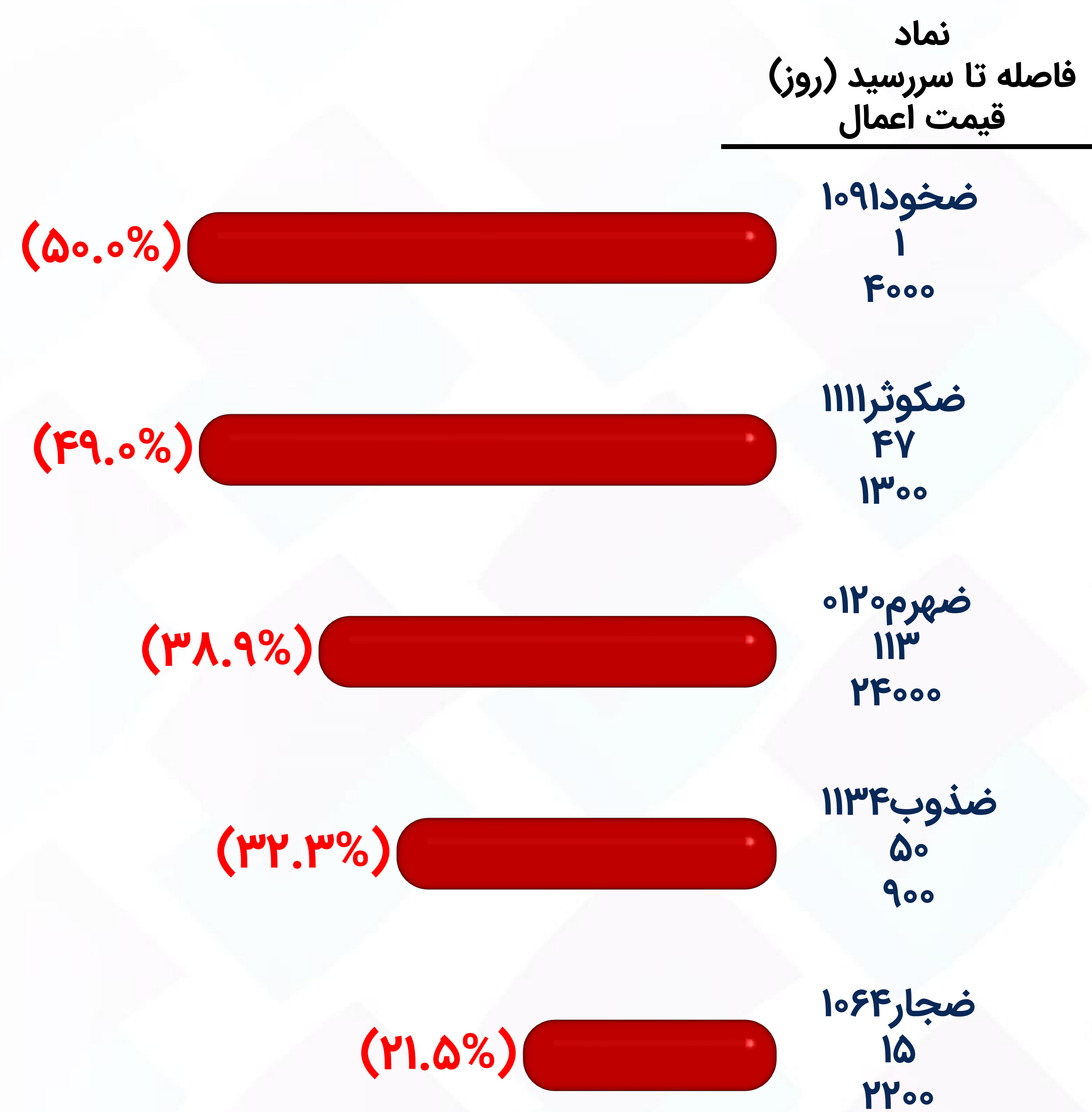
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



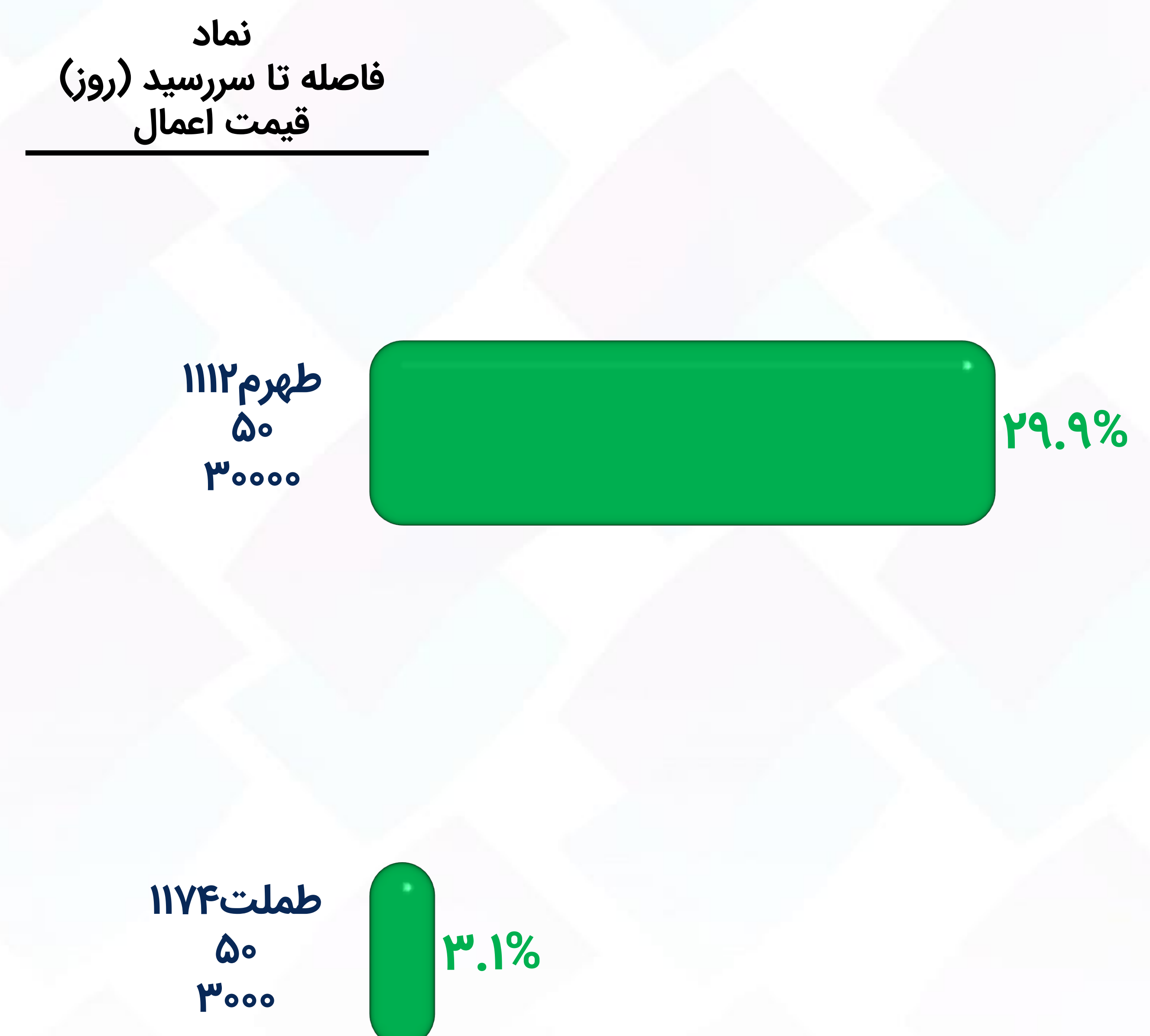
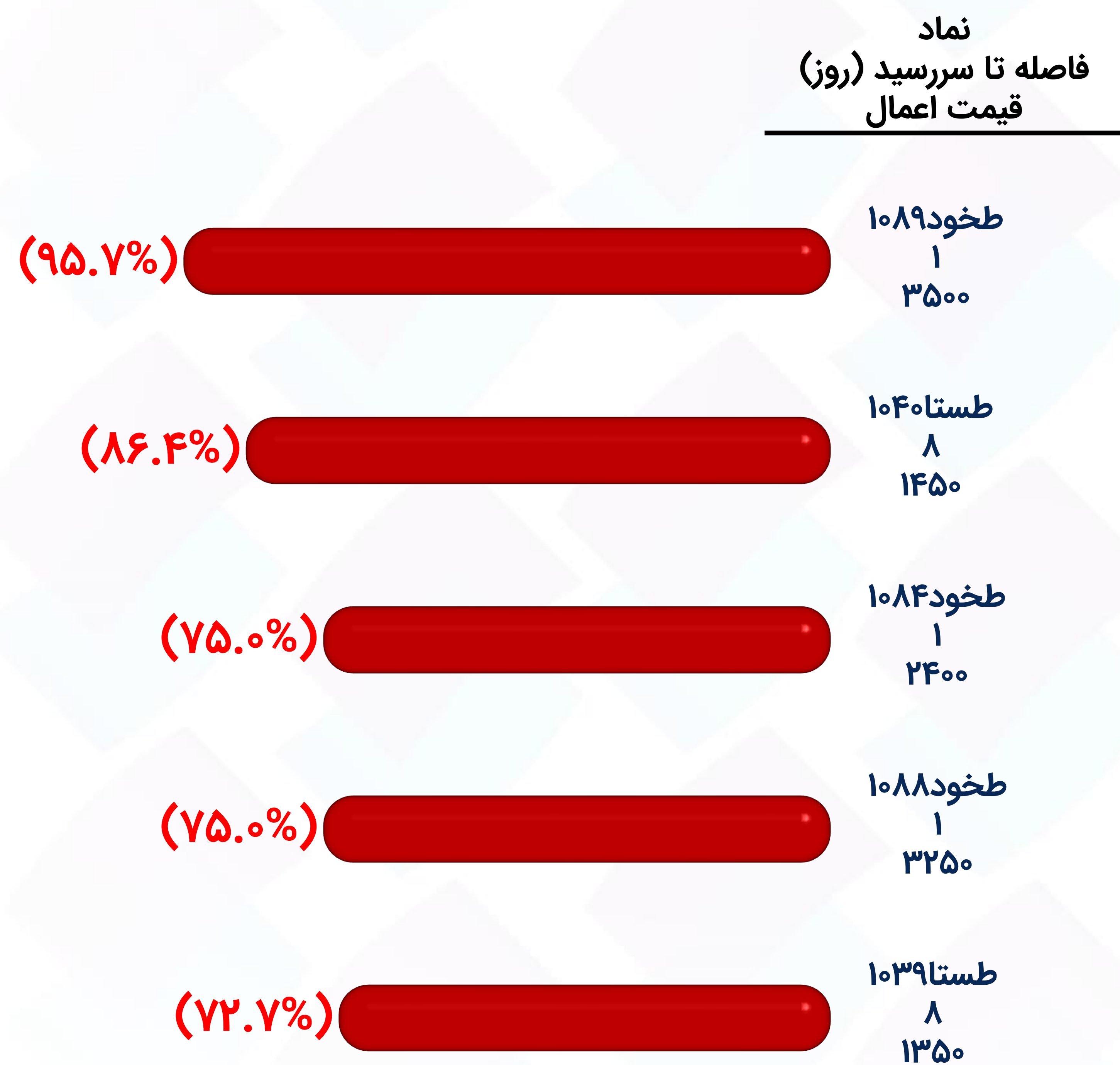
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

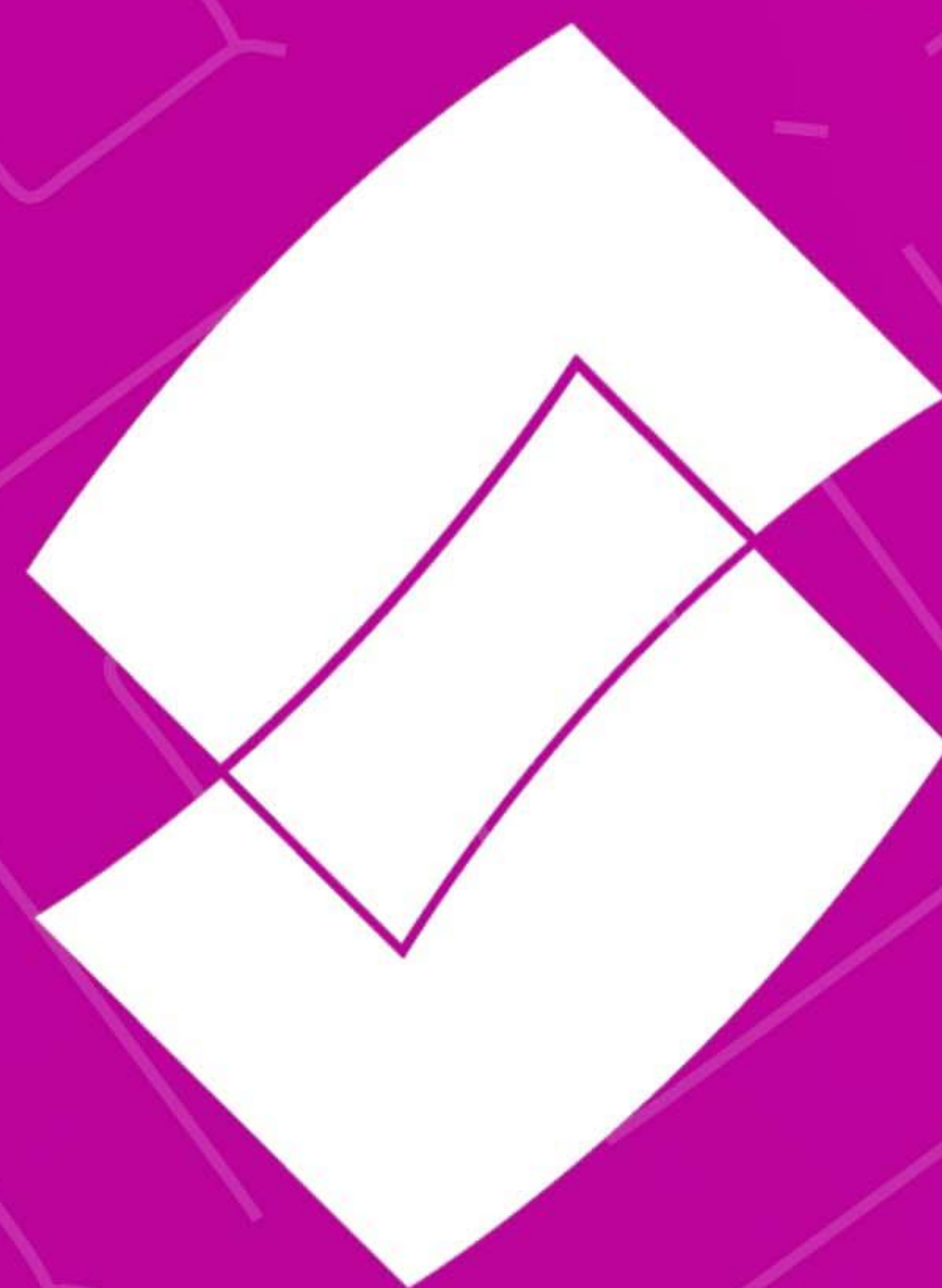
اختیار خرید



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.