

شماره
۳۹۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۵ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





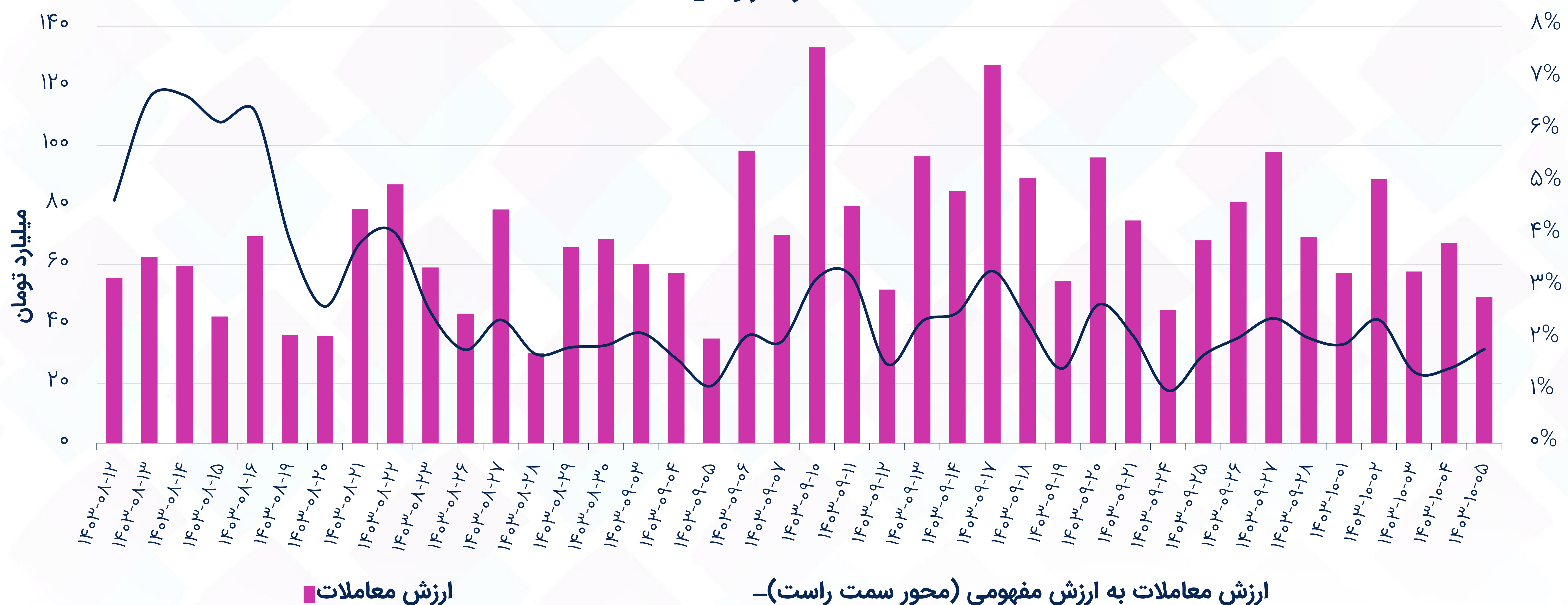
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



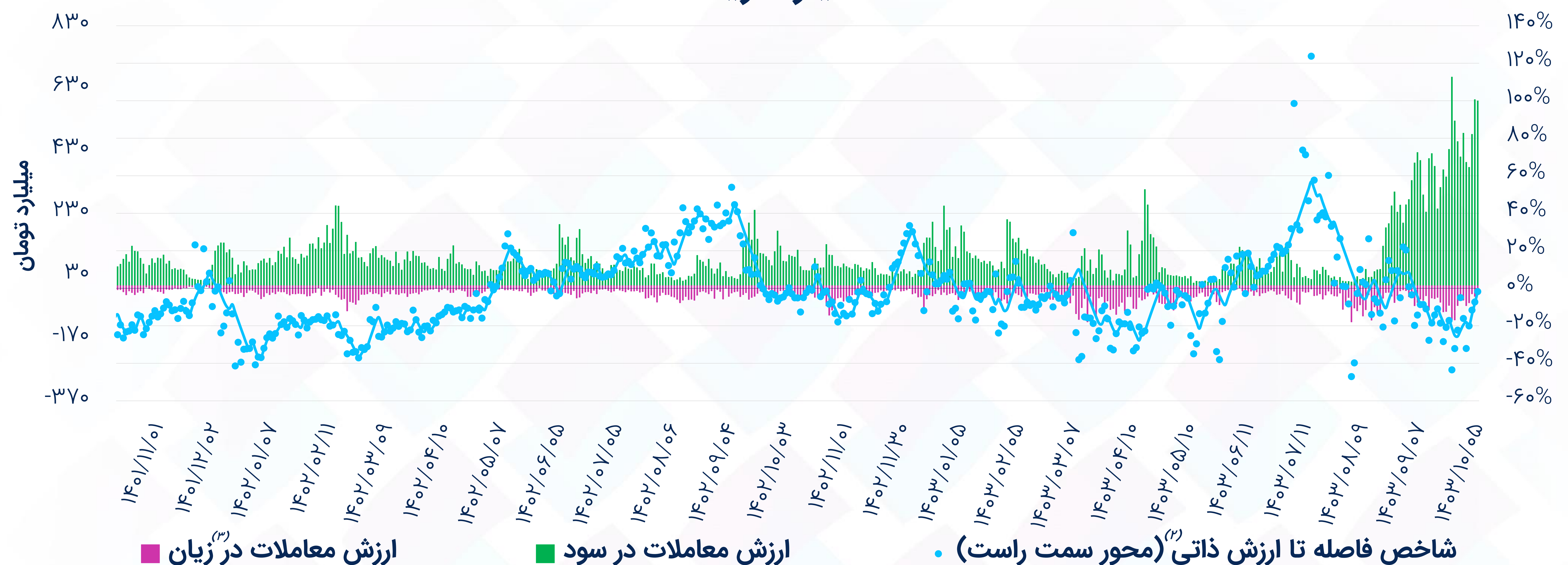
اختیار فروش



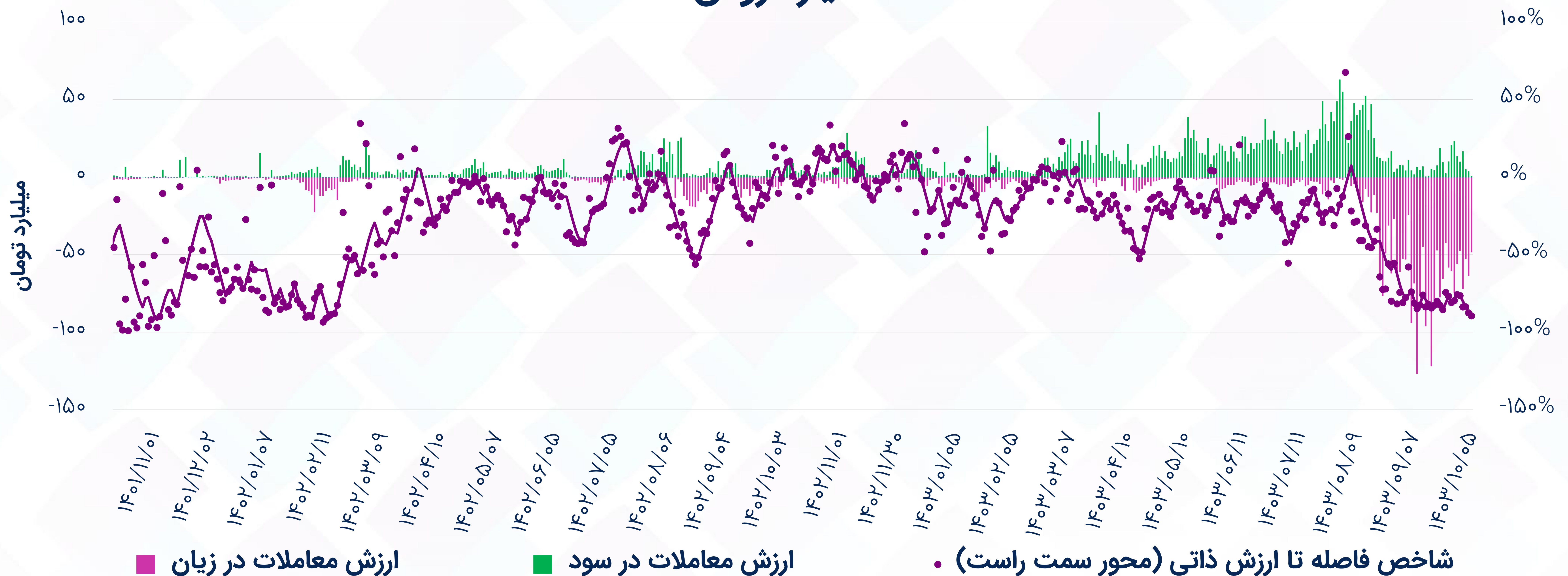
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۵	۳۴۴.۶	۳,۵۴۷.۵	۳۳۶.۳	۸.۴	۳.۸%
شستا	۵۰	۱۰۱.۱	۱,۰۵۲.۲	۹۵.۱	۶.۰	(۴.۴%)
اهرم	۴۳	۱۰۰.۴	۵۳۴.۴	۹۸.۷	۱.۸	(۸.۴%)
ذوب	۱۷	۲۰.۰	۷۸.۷	۱۷.۸	۲.۲	(۱۷.۲%)
شپنا	۱۱	۷.۴	۳۹.۹	۷.۴	۰.۰	۴.۵%
توان	۱۷	۷.۲	۱۸.۶	۷.۱	۰.۲	۲.۴%
خسپا	۱۴	۶.۶	۸۳.۷	۴.۹	۱.۷	(۳۳.۲%)

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	۱۳	۳۰,۴۵۲.۶	۱,۷۲۶,۰۵۸.۲	۴.۳	۳۰,۴۴۸.۳	(۹۲.۰%)
اهرم	۱۷	۱۵,۴۲۱.۵	۶۰۱,۹۴۰.۱	۶۲۵.۱	۱۴,۷۹۶.۴	(۸۳.۳%)
شستا	۲۰	۲,۷۸۶.۴	۳۷۶,۴۸۹.۵	۰.۴	۲,۷۸۶.۰	(۹۶.۳%)
وبملت	۲	۲۶۵.۶	۷,۴۵۲.۶	۰.۰	۲۶۵.۶	(۸۸.۴%)
ذوب	۳	۶۹.۰	۲,۲۷۴.۴	۰.۲	۶۸.۸	(۹۲.۳%)
خودران	۳	۱۳.۸	۱۹۰.۱	۰.۰	۱۳.۸	(۶۵.۱%)
بساما	۳	۰.۴	۳۵.۷	۰.۰	۰.۴	(۹۵.۹%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۲۴۷,۶۳۱

شستا ۱۰۲,۷۴۴

وبملت ۲۶,۳۱۶

وبصادر ۲۵,۴۴۳

ذوب ۲۴,۸۳۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۳۹,۲۷۰.۹)

بساما (۳,۰۱۴.۲)

خیارس (۱۶۴.۷)

موج (۸۰.۰)

رویین (۵۴.۳)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۳,۱۳۰

خودرو ۲,۸۲۲

شستا ۲,۳۸۰

ذوب ۶۵۲

آساس ۵۹۷

خسپا ۴۱۷

وبملت ۳۹۸

وبصادر ۳۲۱

فولاد ۲۳۲

وتجارت ۲۰۹

میلیارد تومان

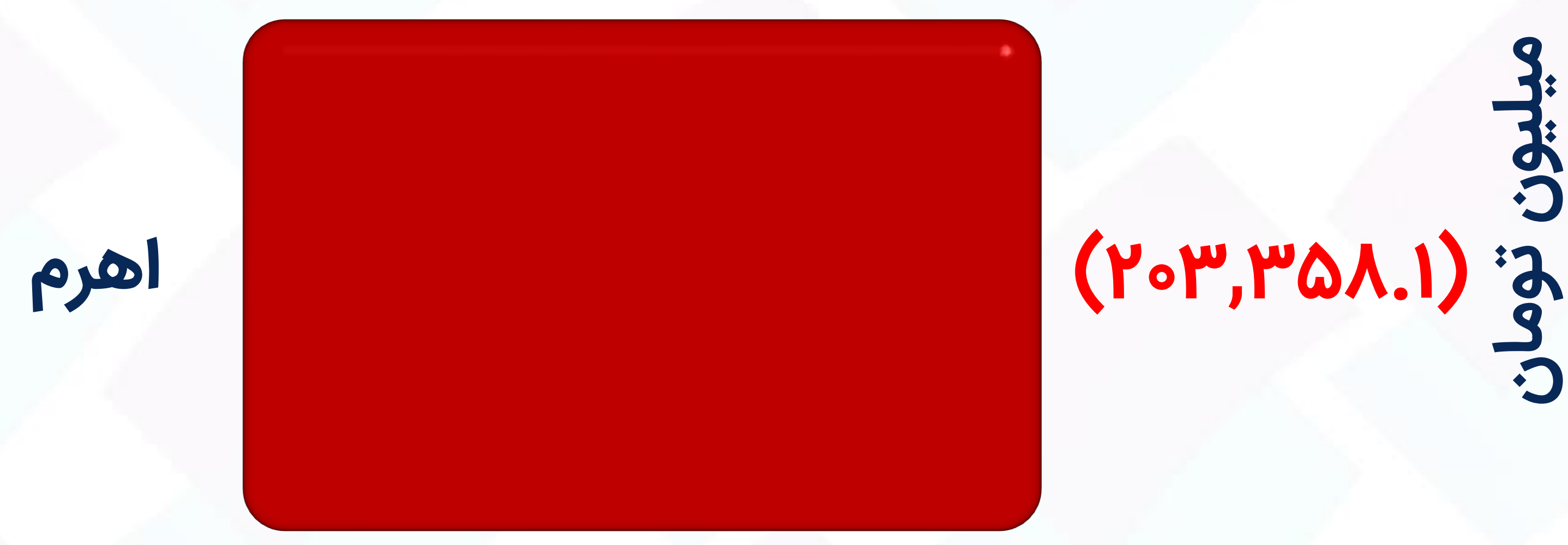
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضرویین ۱۰۰۱	رویین	۸,۵۰۰	۲۵	۲۷۲.۲	۲,۷۰۳	۱۳,۲۹۱	۱۱,۲۰۳	(۱۵.۷%)	۴.۱	۱.۰۰	۴,۹۷۶	۸۴%
ضجهش ۱۲۰۱	جهش	۷,۵۰۰	۷۰	۲.۰	۵,۰۰۱	۱۳,۴۸۰	۱۲,۵۰۱	(۷.۳%)	۲.۵	۱.۰۰	۶,۴۳۲	۲۹%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۲۳	۳۷.۲	۱,۰۸۹	۶,۲۰۰	۶,۵۰۲	۴.۹%	۶.۰	۰.۹۶	۱,۳۲۴	۲۲%
ضملی ۱۱۸۸	فملی	۴,۰۰۰	۲۸	۱.۱	۳,۵۷۰	۸,۱۹۰	۷,۵۷۰	(۷.۶%)	۲.۱	۱.۰۰	۴,۲۹۲	۲۰%
ضهرم ۱۰۱۰	اهرم	۲۴,۰۰۰	۲۱	۶,۳۳۱.۷	۴,۰۱۴	۲۸,۲۷۰	۲۸,۰۱۴	(۰.۹%)	۷.۰	۰.۹۸	۴,۷۴۵	۱۸%

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	۲۱	۲.۱	۴	۵۶۹	۱,۰۰۴	۷۶%	۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۹	۲۹.۱	۱۷	۵۶۹	۱,۰۱۷	۷۹%	۵۹.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۹	۲۰.۷	۲۰	۵۶۹	۹۲۰	۶۲%	۴۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۴۹	۱۲۰.۲	۲۹	۵۶۹	۸۲۹	۴۶%	۲۸.۶	۰.۰۱	۰	(۹۹%)
ضجار ۱۰۶۴	وتجارت	۲,۲۰۰	۱۴	۳۷۳.۴	۳۲	۱,۸۶۲	۲,۲۳۲	۲۰%	۶۹.۸	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
طهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۲۱	۴۸۴.۳	۲۶۲	۲۸,۲۷۰	۲۵,۷۳۸	(۹.۰%)	۹۸.۲	-۰.۱۱	۱۳۱	(۵۰.۲%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۹	۶۲۴.۳	۳,۸۱۶	۲۸,۲۷۰	۲۶,۱۸۴	(۷.۴%)	۶.۹	-۰.۵۳	۱,۷۰۳	(۵۵.۴%)
طهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۱	۲۸۲.۰	۱,۵۹۳	۲۸,۲۷۰	۲۶,۴۰۷	(۶.۶%)	۱۶.۶	-۰.۳۵	۶۰۷	(۶۱.۹%)
طران ۰۱۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۱۱۲	۱۱.۰	۱,۱۰۰	۱۱,۱۲۰	۹,۹۰۰	(۱۱.۰%)	۹.۰	-۰.۲۷	۴۰۶	(۶۳.۱%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۴۹	۳۲۴.۱	۲,۹۴۱	۲۸,۲۷۰	۲۵,۰۵۹	(۱۱.۴%)	۸.۵	-۰.۳۲	۷۹۹	(۷۲.۸%)

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
طستا ۱۰۳۶	شستا	۱,۰۵۰	۷	۶۱.۸	۲	۱,۵۷۸	۱,۰۴۸	(۳۳.۶%)	۵۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۵	شستا	۹۵۰	۷	۳.۷	۱	۱,۵۷۸	۹۴۹	(۳۹.۹%)	۹۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۳۵	۲۰.۶	۶	۱,۵۷۸	۸۴۴	(۴۶.۵%)	۱۴۰.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۷	شستا	۱,۱۵۰	۷	۲.۲	۱	۱,۵۷۸	۱,۱۴۹	(۲۷.۲%)	۱,۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۲۱	۱.۴	۳۳	۲۸,۲۷۰	۱۴,۹۶۷	(۴۷.۱%)	۴۵۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

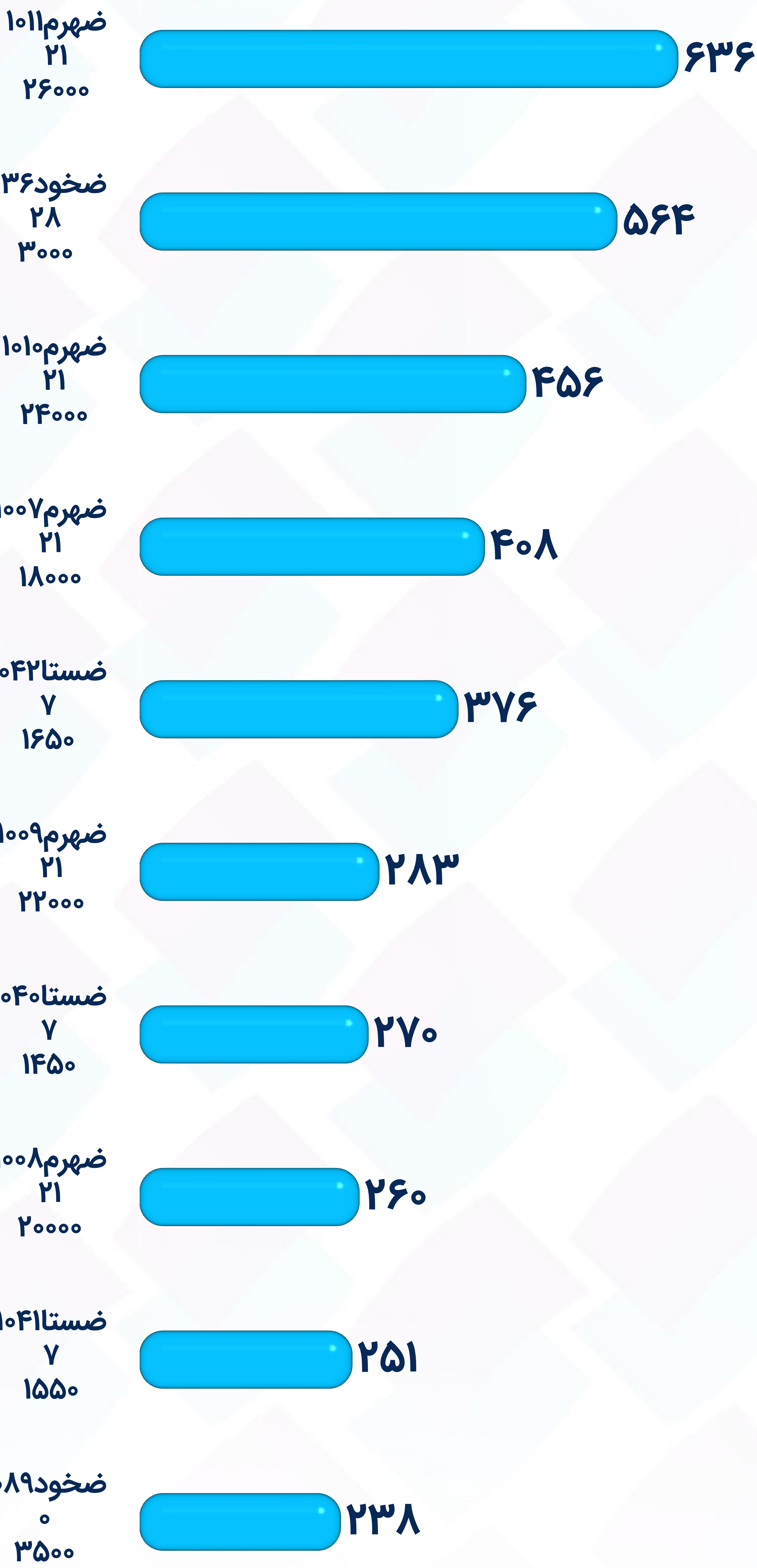
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

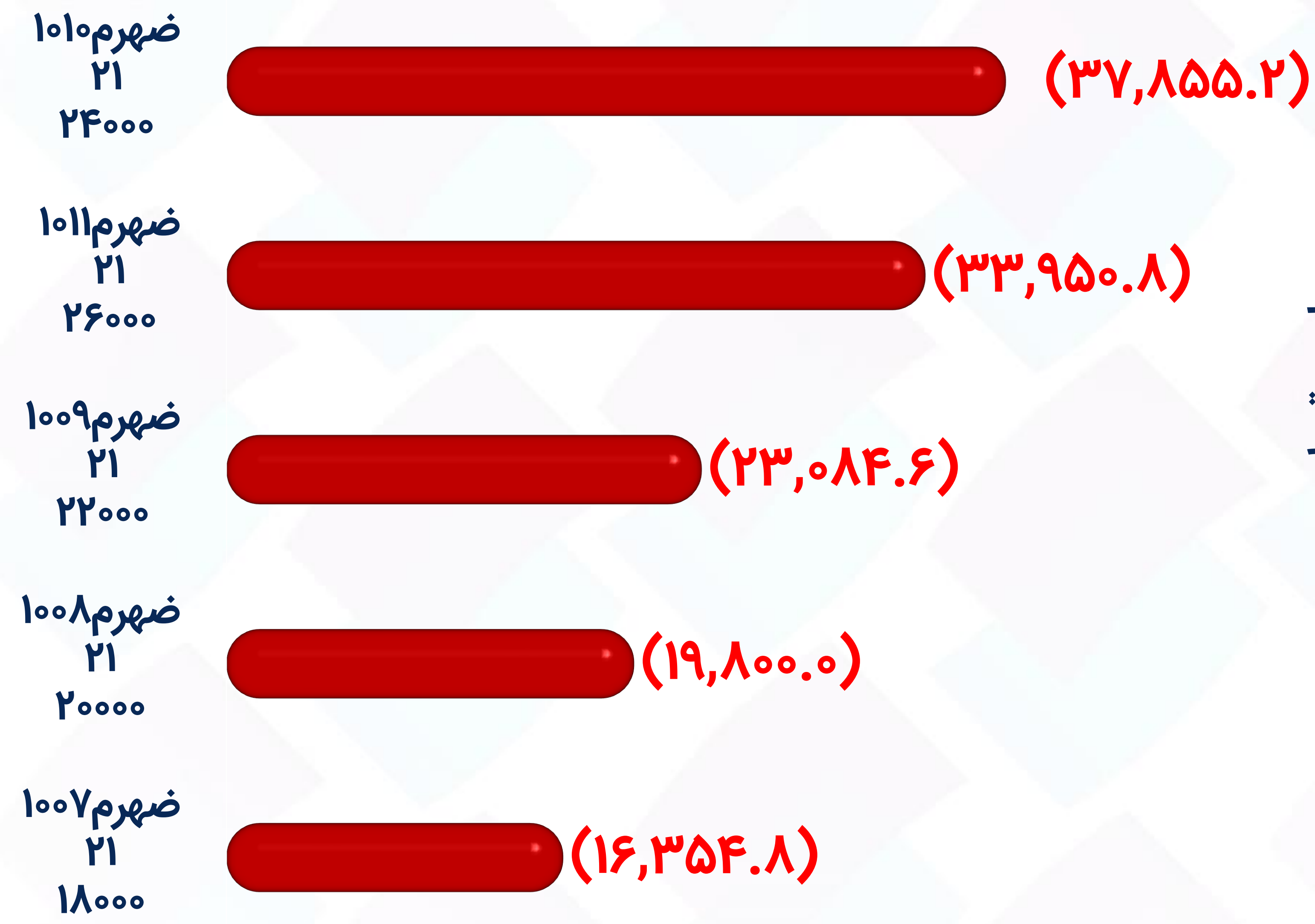
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

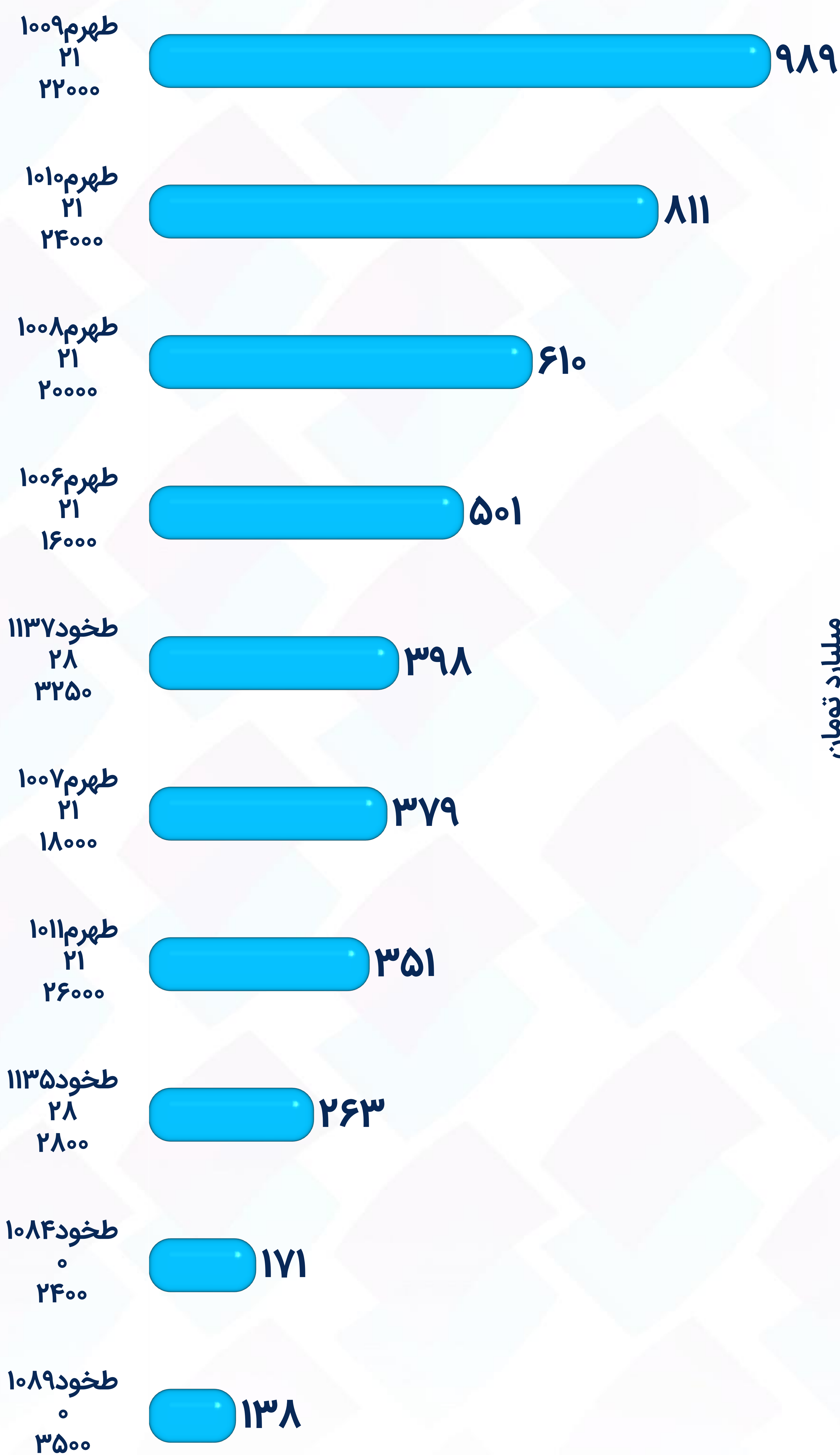


میلیون تومان

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

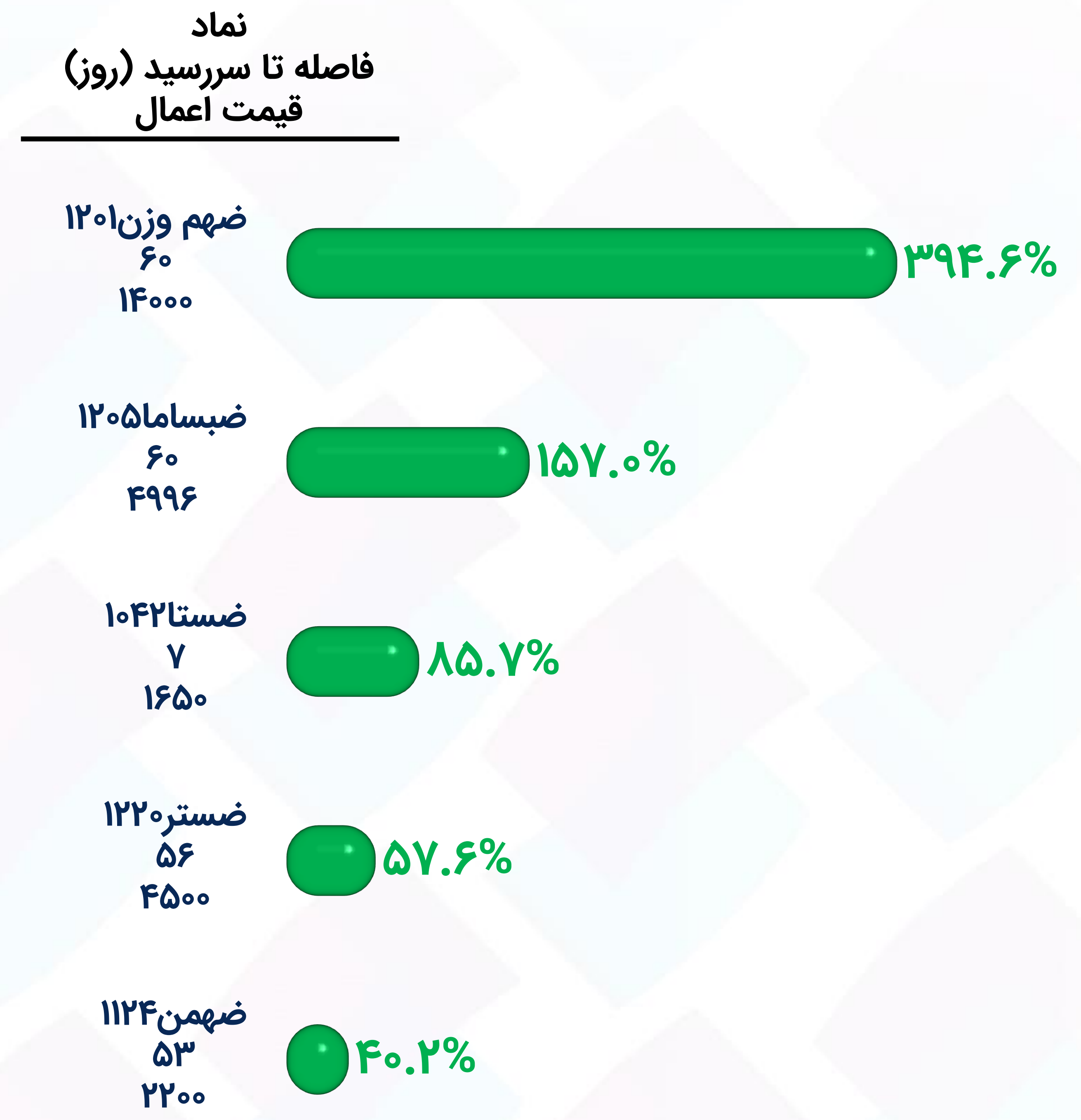
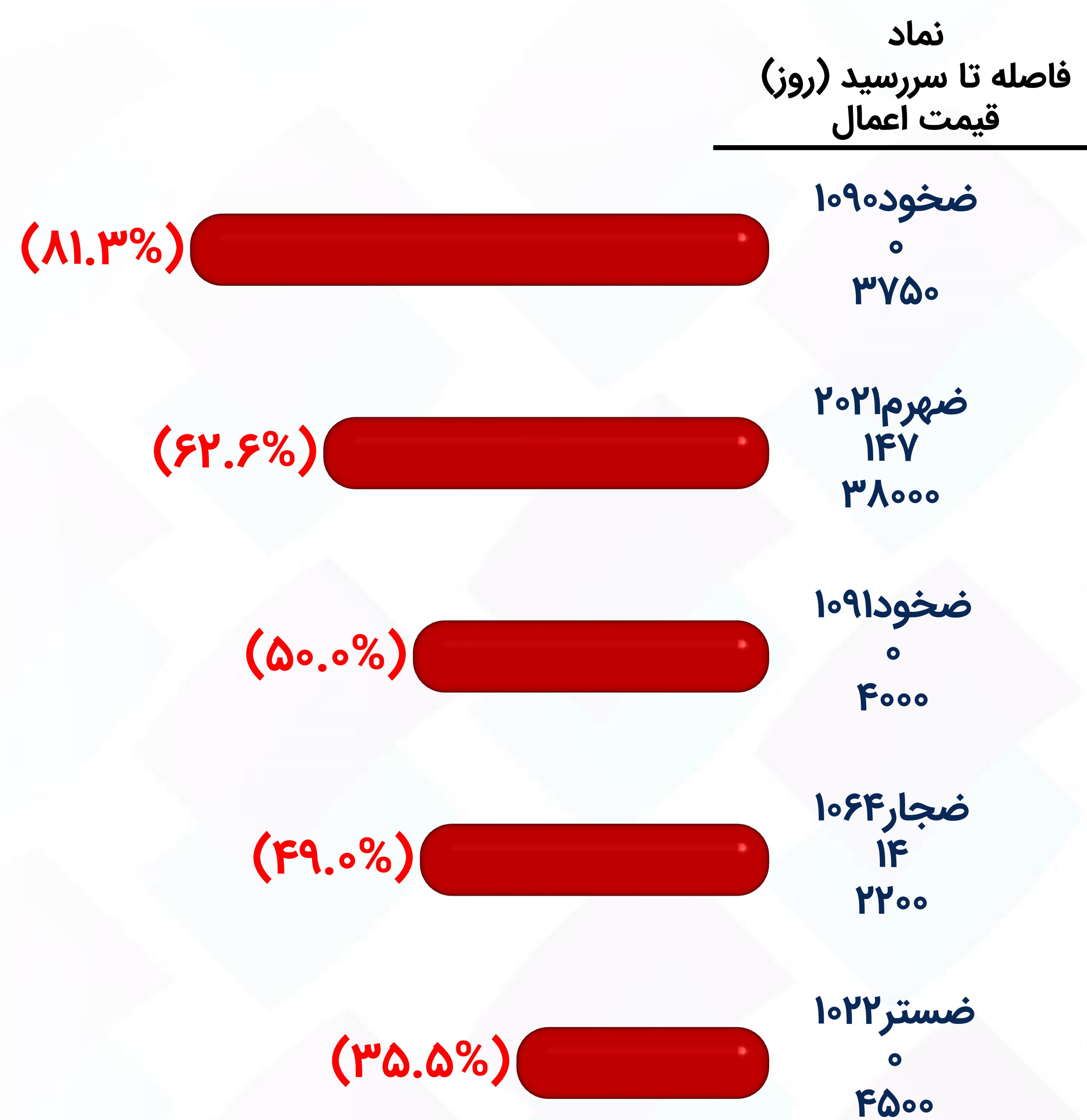
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



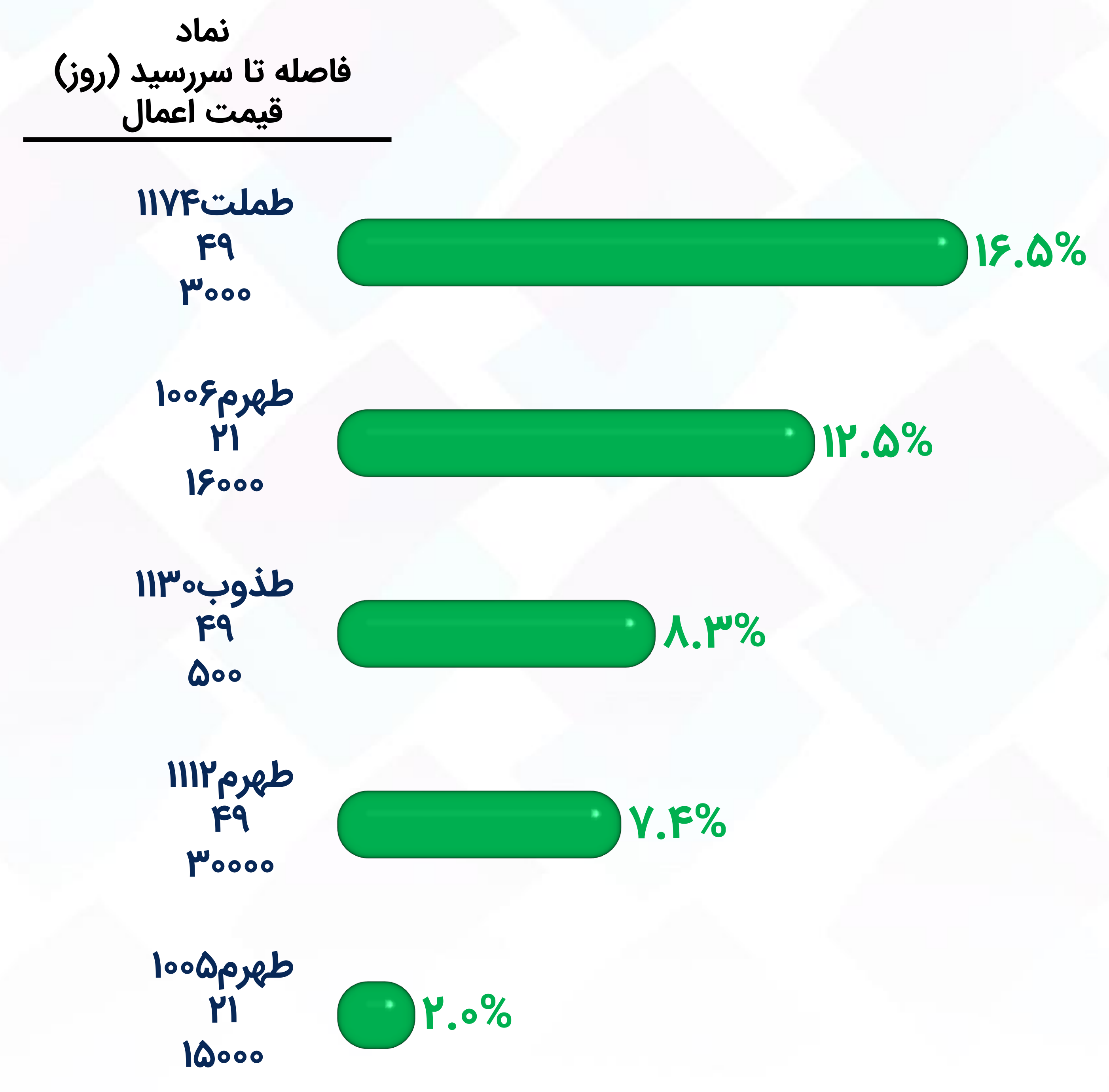
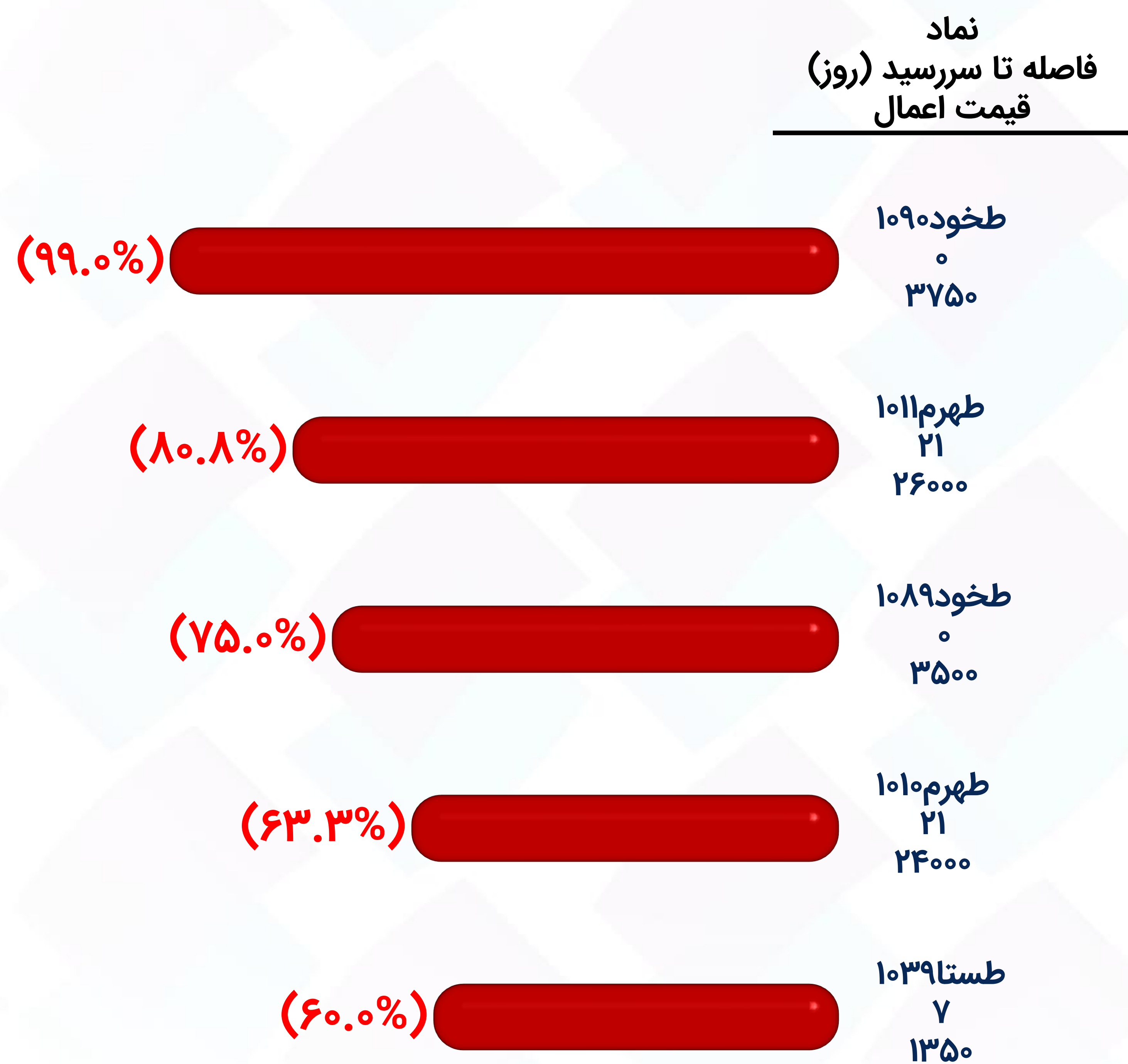
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

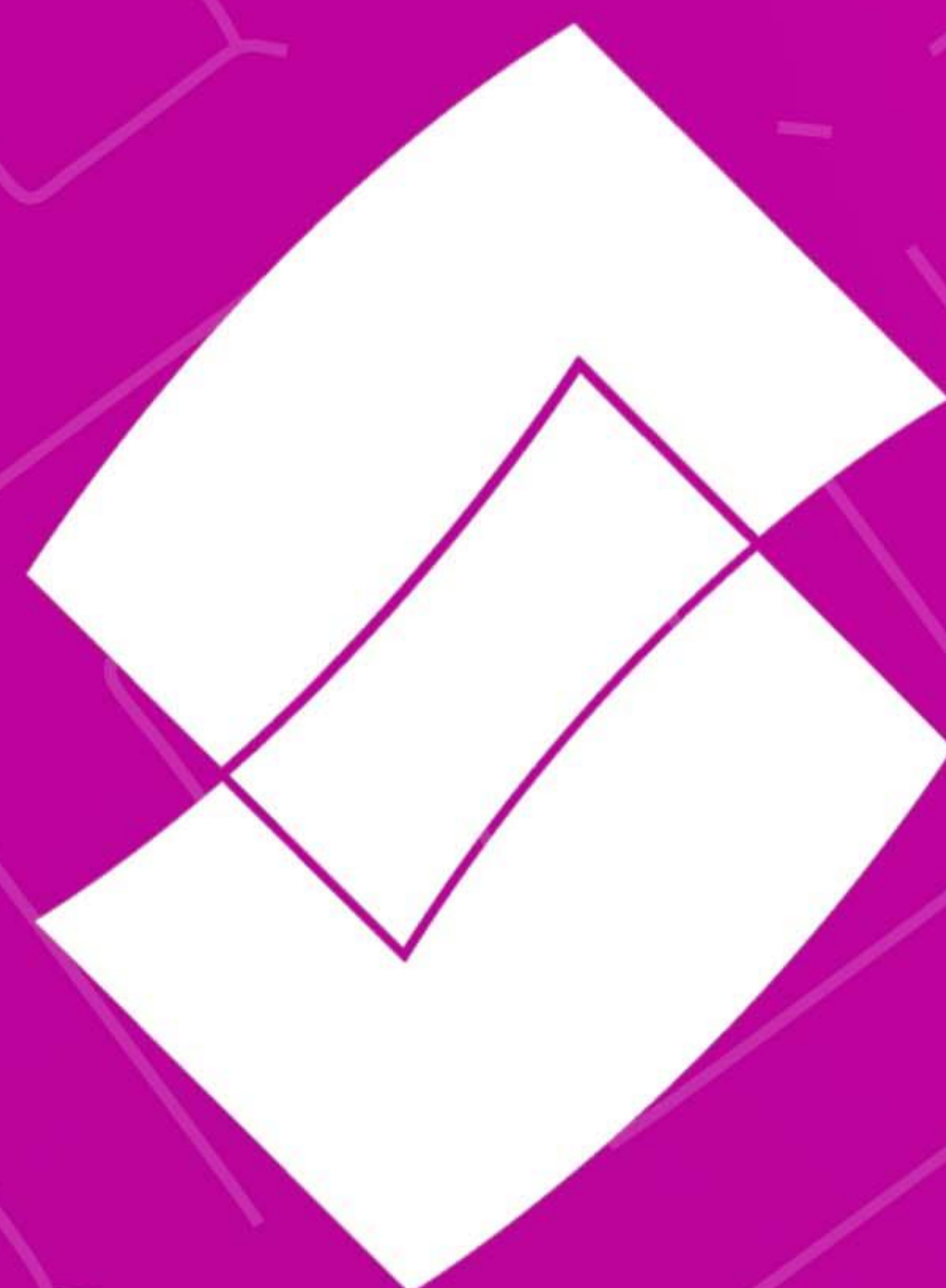
اختیار خرید



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.