

شماره
۳۹۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۹ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





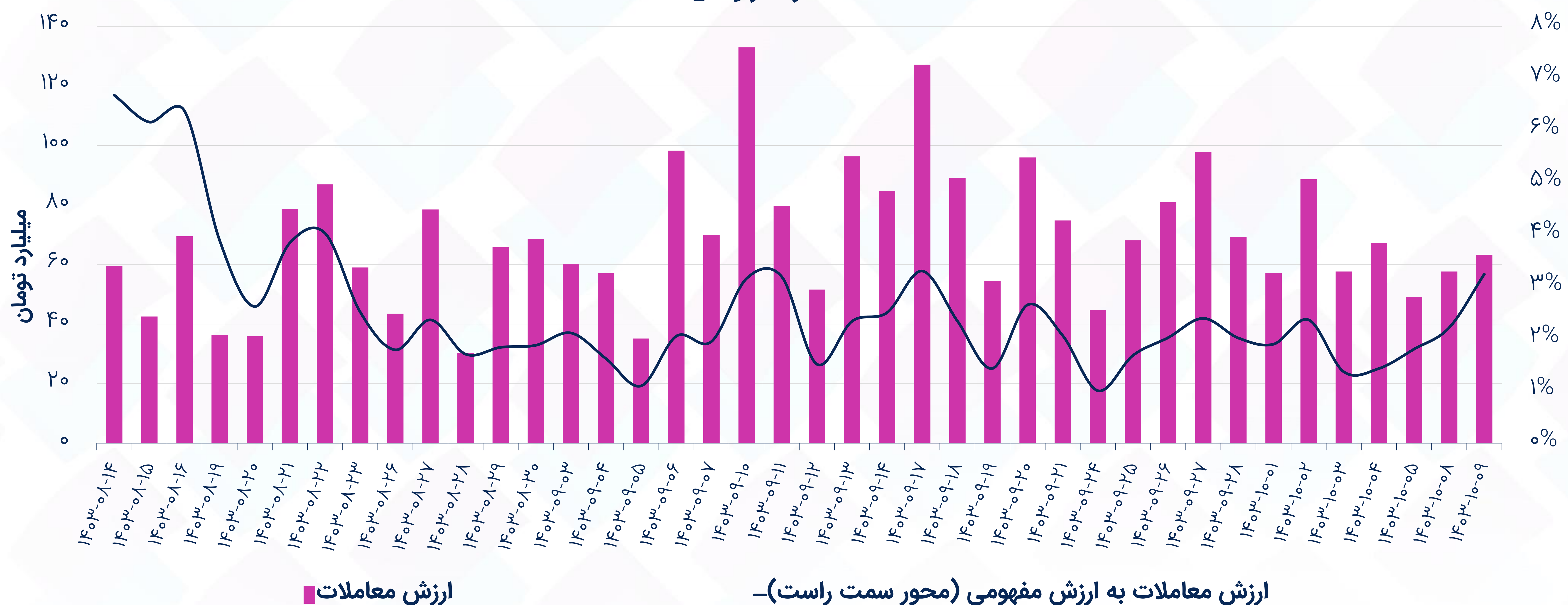
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



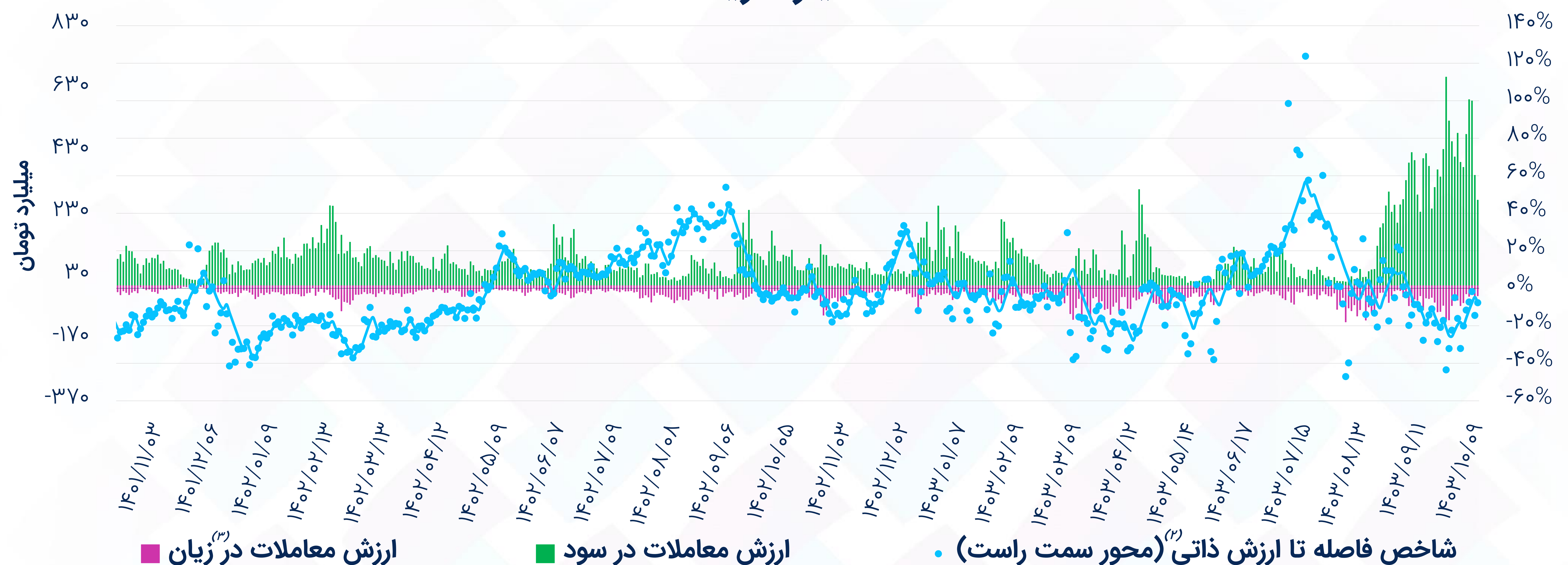
اختیار فروش



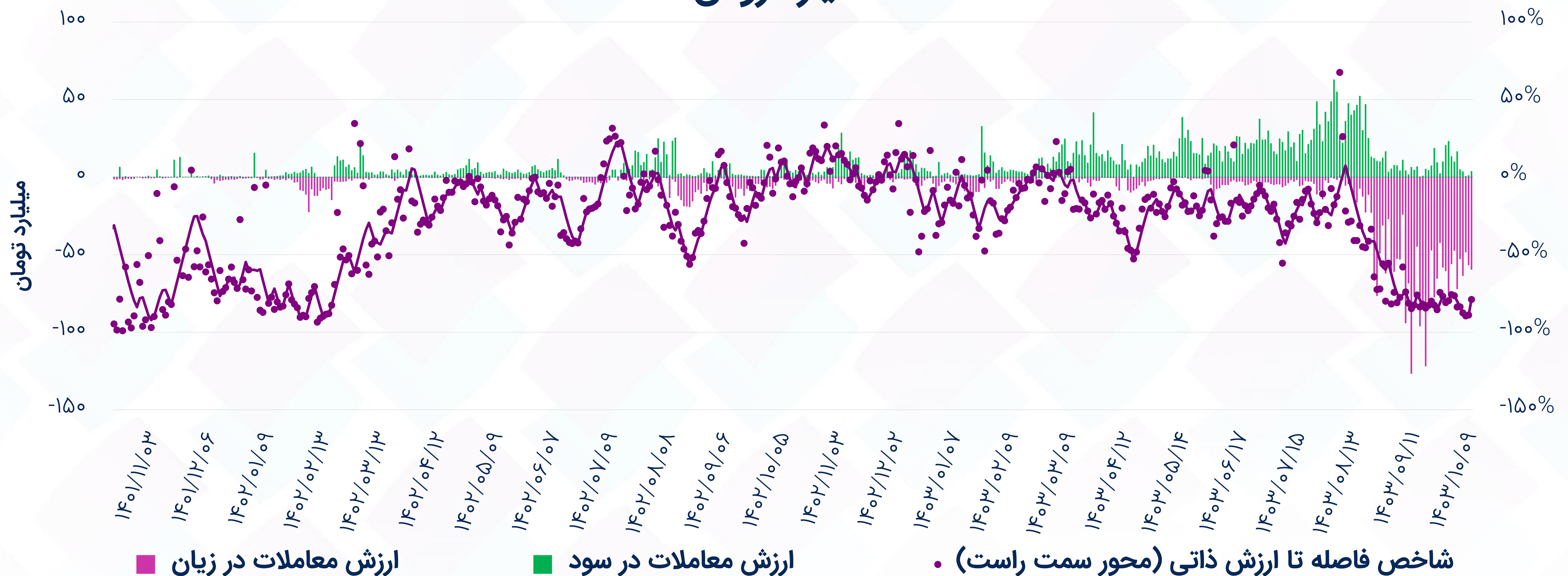
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۶	۱۰۵.۰	۷۹۳.۷	۹۸.۳	۶.۷	(۲۴.۶%)
خودرو	۲۹	۹۷.۱	۶۵۵.۱	۸۴.۴	۱۲.۶	(۱۱.۱%)
شستا	۳۸	۵۴.۶	۱,۴۶۶.۷	۵۰.۲	۴.۴	۴۲.۰%
ذوب	۱۸	۱۹.۰	۹۴.۱	۱۶.۸	۲.۲	(۱۹.۰%)
خسپا	۱۳	۸.۱	۱۸۱.۳	۳.۶	۴.۵	(۴۴.۲%)
وبملت	۱۲	۴.۹	۴۰.۵	۳.۰	۲.۰	(۳۷.۱%)
توان	۱۳	۳.۴	۸.۷	۳.۴	۰.۰	۷.۸%

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	۳۴,۷۰۸.۹	۸۱۸,۲۱۰.۶	۸۳۶.۰	۳۳,۸۷۲.۹	(۷۰.۸%)
خودرو	۵	۱۸,۰۱۲.۰	۷۳۸,۷۰۳.۲	۱,۰۲۰.۳	۱۶,۹۹۱.۸	(۹۰.۳%)
شستا	۲۶	۱۰,۴۰۴.۷	۳۸۷,۴۰۲.۲	۱,۸۶۵.۹	۸,۵۳۸.۸	(۸۶.۳%)
وبملت	۲	۱۰۴.۱	۲,۱۷۴.۴	۰.۰	۱۰۴.۱	(۷۷.۶%)
ذوب	۳	۷۶.۸	۲,۰۸۰.۲	۲۰.۶	۵۶.۲	(۸۰.۱%)
رویین	۲	۳.۵	۱۶۵.۱	۰.۰	۳.۵	(۸۷.۵%)
خودران	۱	۰.۷	۱۹.۷	۰.۰	۰.۷	(۶۹.۶%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان



میلیارد تومان



میلیون تومان

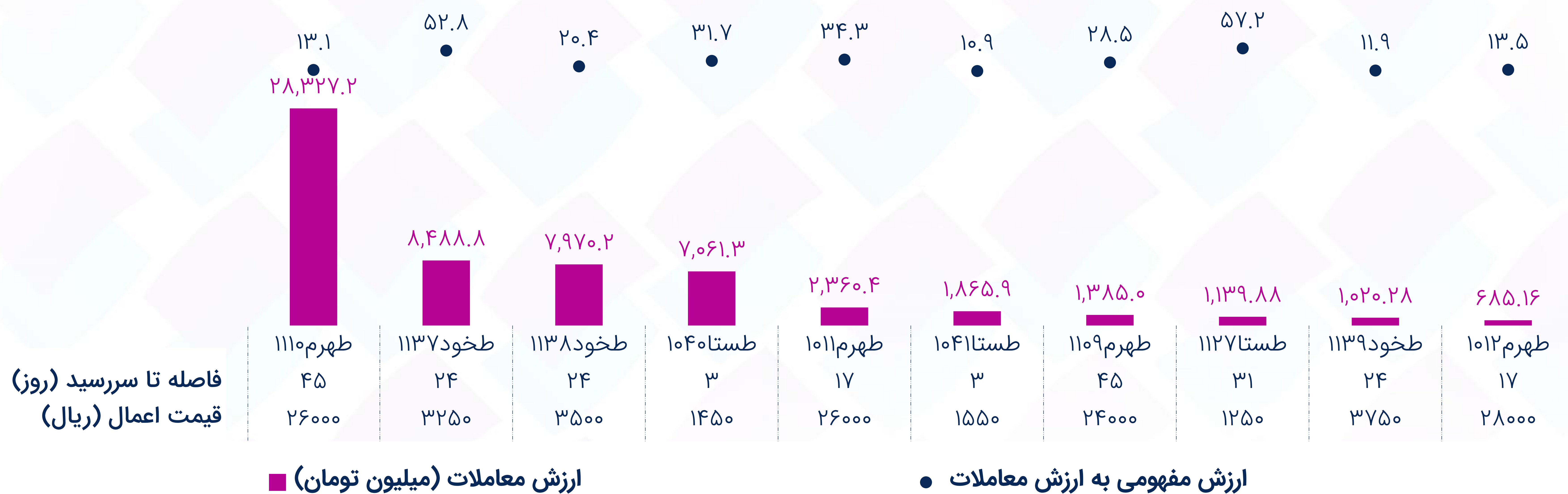


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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	۳	۵.۲	۱۹۷	۱۲,۷۳۰	۱۲,۱۹۷	(۴.۲%)	۶۱.۹	۰.۹۱	۸۱۹	۳۱۶%
ضشنا ۱۰۷۲	شپنا	۵,۰۰۰	۳	۴۷.۳	۷۱	۵,۲۰۰	۵,۰۷۱	(۲.۵%)	۷۱.۴	۰.۸۶	۲۴۱	۲۴۰%
ضستا ۱۰۳۹	شستا	۱,۳۵۰	۳	۷,۷۳۰.۶	۶۲	۱,۴۸۸	۱,۴۱۲	(۵.۱%)	۲۲.۸	۱.۰۰	۱۴۵	۱۳۴%
ضستا ۱۰۴۰	شستا	۱,۴۵۰	۳	۶,۷۳۹.۸	۲۴	۱,۴۸۸	۱,۴۷۴	(۰.۹%)	۶۱.۴	۰.۸۴	۵۰	۱۰۷%
ضشنا ۱۰۷۱	شپنا	۴,۵۰۰	۳	۱۳۴.۹	۳۹۶	۵,۲۰۰	۴,۸۹۶	(۵.۸%)	۱۲.۴	۱.۰۰	۷۲۳	۸۳%

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	۱۷	۱.۴	۳	۵۴۲	۱,۰۰۳	۸۵%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۵	۴۲.۶	۱۱	۵۴۲	۱,۰۱۱	۸۷%	۹۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۵	۲۳.۰	۱۵	۵۴۲	۹۱۵	۶۹%	۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۴۵	۵۵.۸	۲۲	۵۴۲	۸۲۲	۵۲%	۳۷.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۰۴۲	شستا	۱,۶۵۰	۳	۳۷۸.۱	۲	۱,۴۸۸	۱,۶۵۲	۱۱%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	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 ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۷	۶۸۵.۲	۱,۹۸۷	۲۶,۷۶۰	۲۶,۰۱۳	(۲.۸%)	۱۳.۱	-۰.۶۲	۱,۳۱۱	(۳۴.۰%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۵	۱۴۵.۲	۴,۴۱۳	۲۶,۷۶۰	۲۵,۵۸۷	(۴.۴%)	۵.۸	-۰.۷۰	۲,۶۴۳	(۴۰.۱%)
طهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۱۷	۲,۳۶۰.۴	۷۸۱	۲۶,۷۶۰	۲۵,۲۱۹	(۵.۸%)	۳۲.۳	-۰.۲۷	۳۷۳	(۵۲.۲%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۴۵	۲۰.۶	۱۰۶	۵۴۲	۴۹۴	(۸.۹%)	۴.۷	-۰.۶۶	۴۹	(۵۳.۶%)
طستا ۱۰۴۱	شستا	۱,۵۵۰	۳	۱,۸۶۵.۹	۱۳۷	۱,۴۸۸	۱,۴۱۳	(۵.۰%)	۱۰.۳	-۰.۸۶	۵۷	(۵۸.۲%)

گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

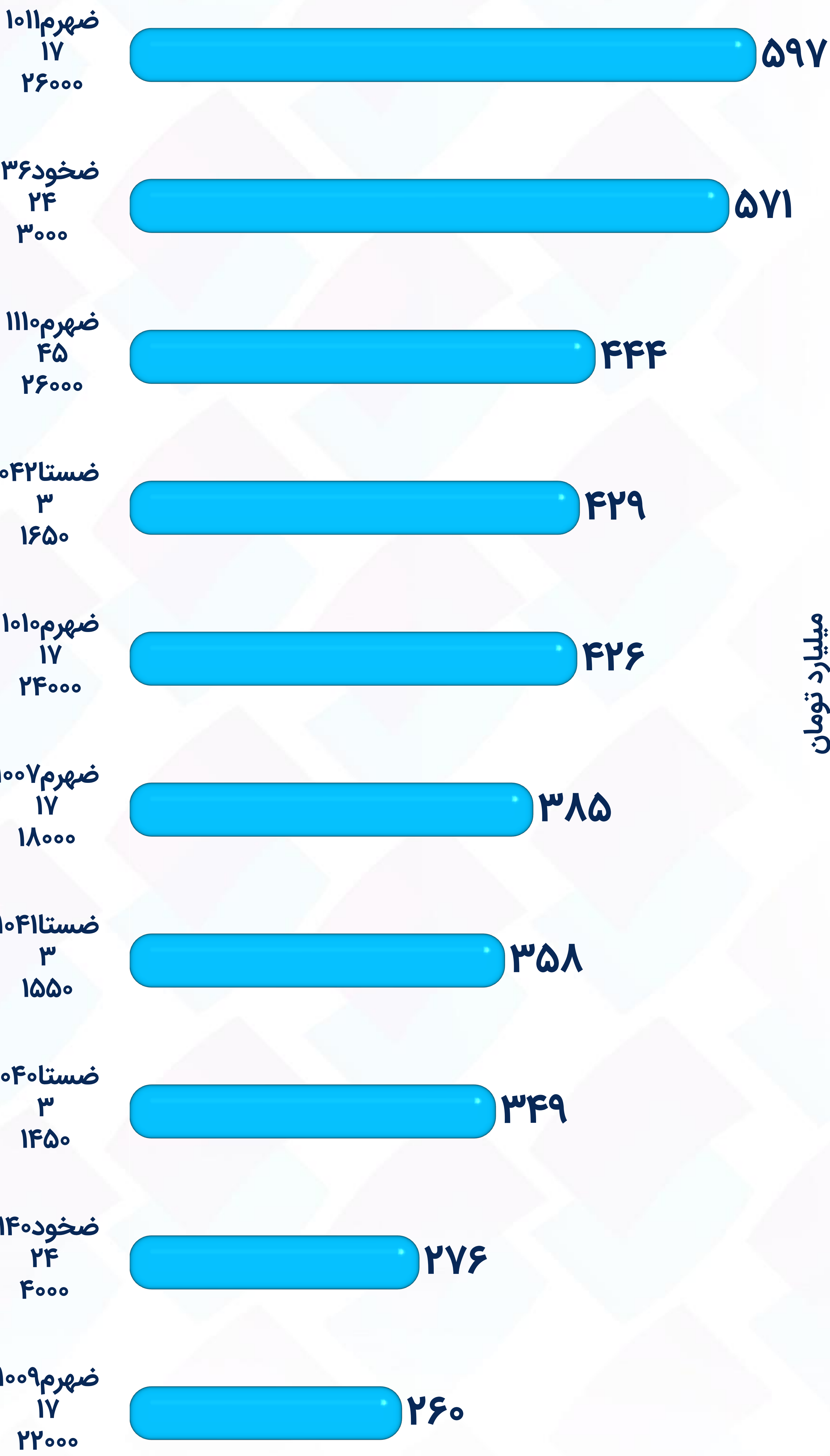
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۱۰۳۶	شستا	۱,۰۵۰	۳	۱.۳	۱	۱,۴۸۸	۱,۰۴۹	(۲۹.۵%)	۱,۰۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۷	۸.۲	۲۴	۲۶,۷۶۰	۱۳,۹۷۶	(۴۷.۸%)	۵۸۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۳۱	۱۸.۷	۴	۱,۴۸۸	۸۴۶	(۴۳.۱%)	۲۱۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۶	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۷	۸۶.۵	۴۵	۲۶,۷۶۰	۱۵,۹۵۵	(۴۰.۴%)	۳۵۴.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۳۱	۳۹.۴	۶	۱,۴۸۸	۹۴۴	(۳۶.۶%)	۱۵۷.۳	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

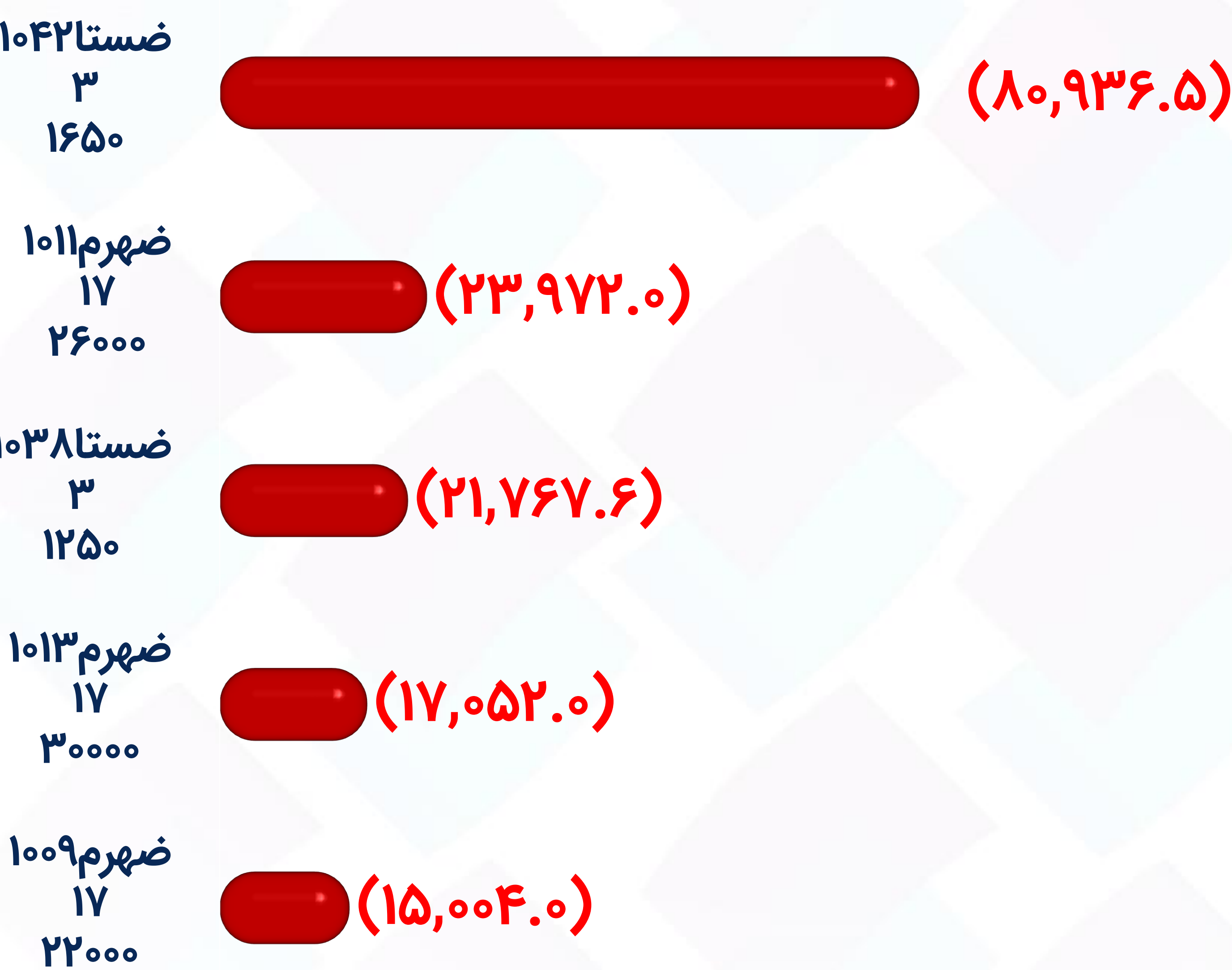
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

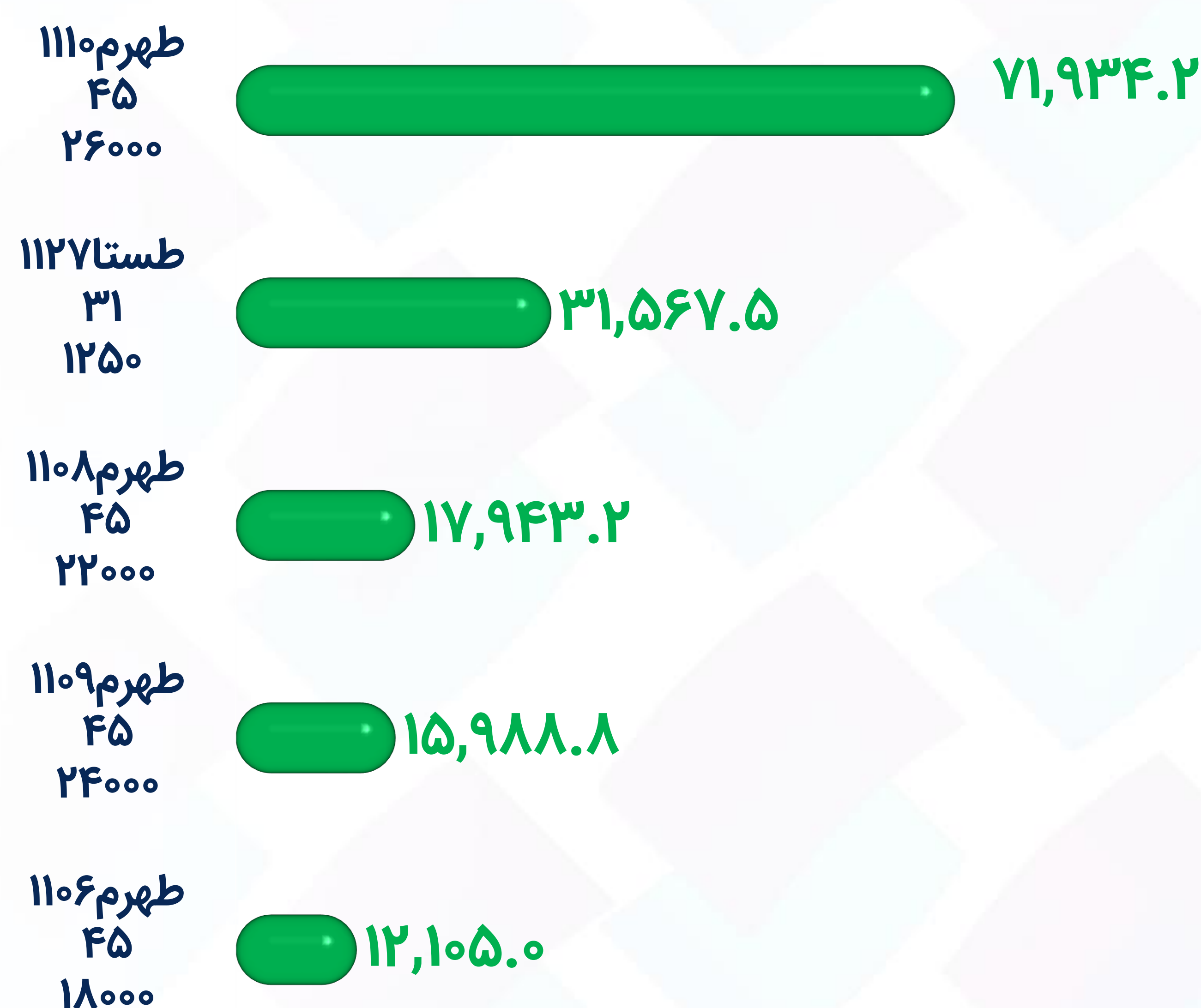
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

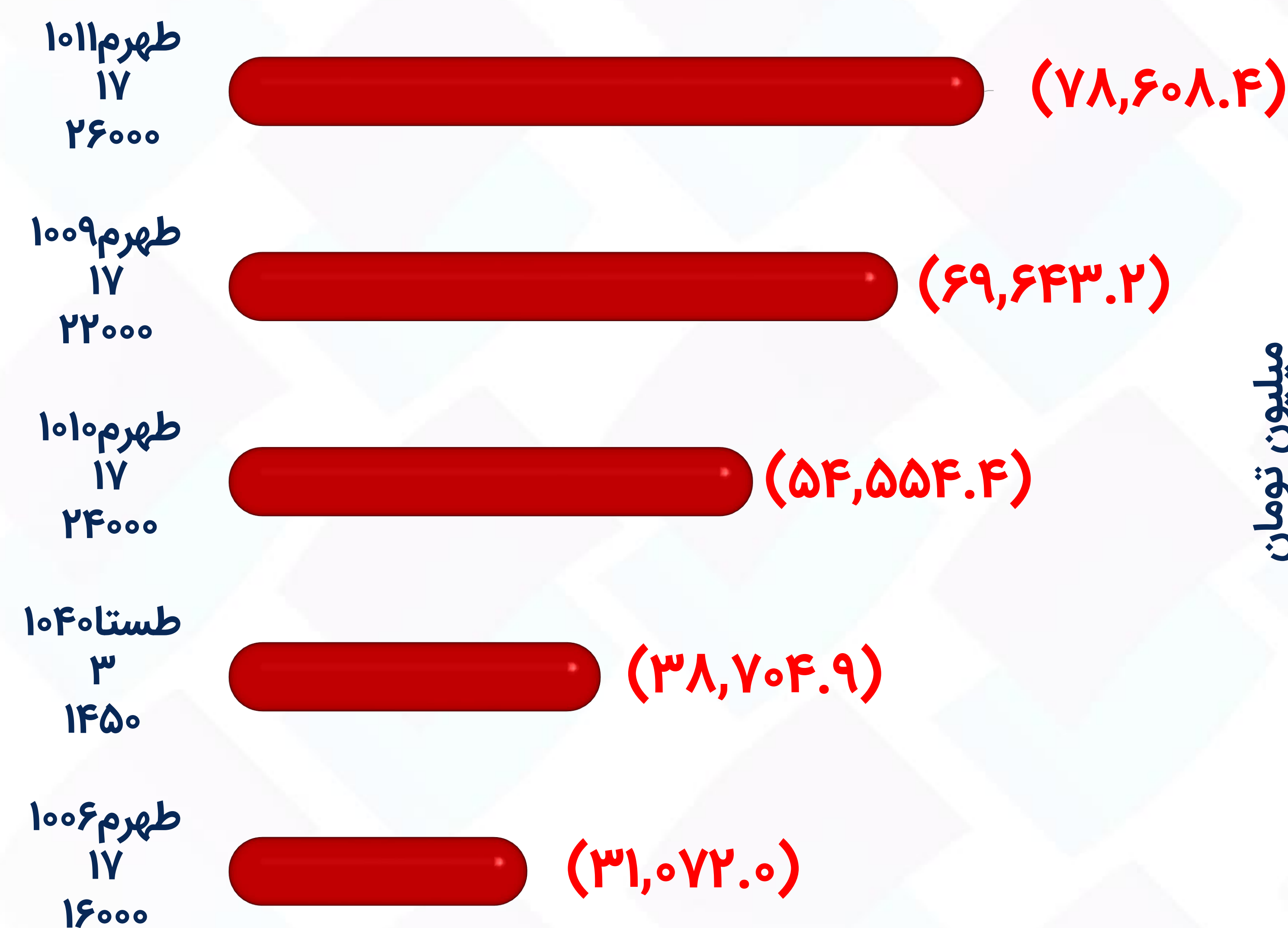
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

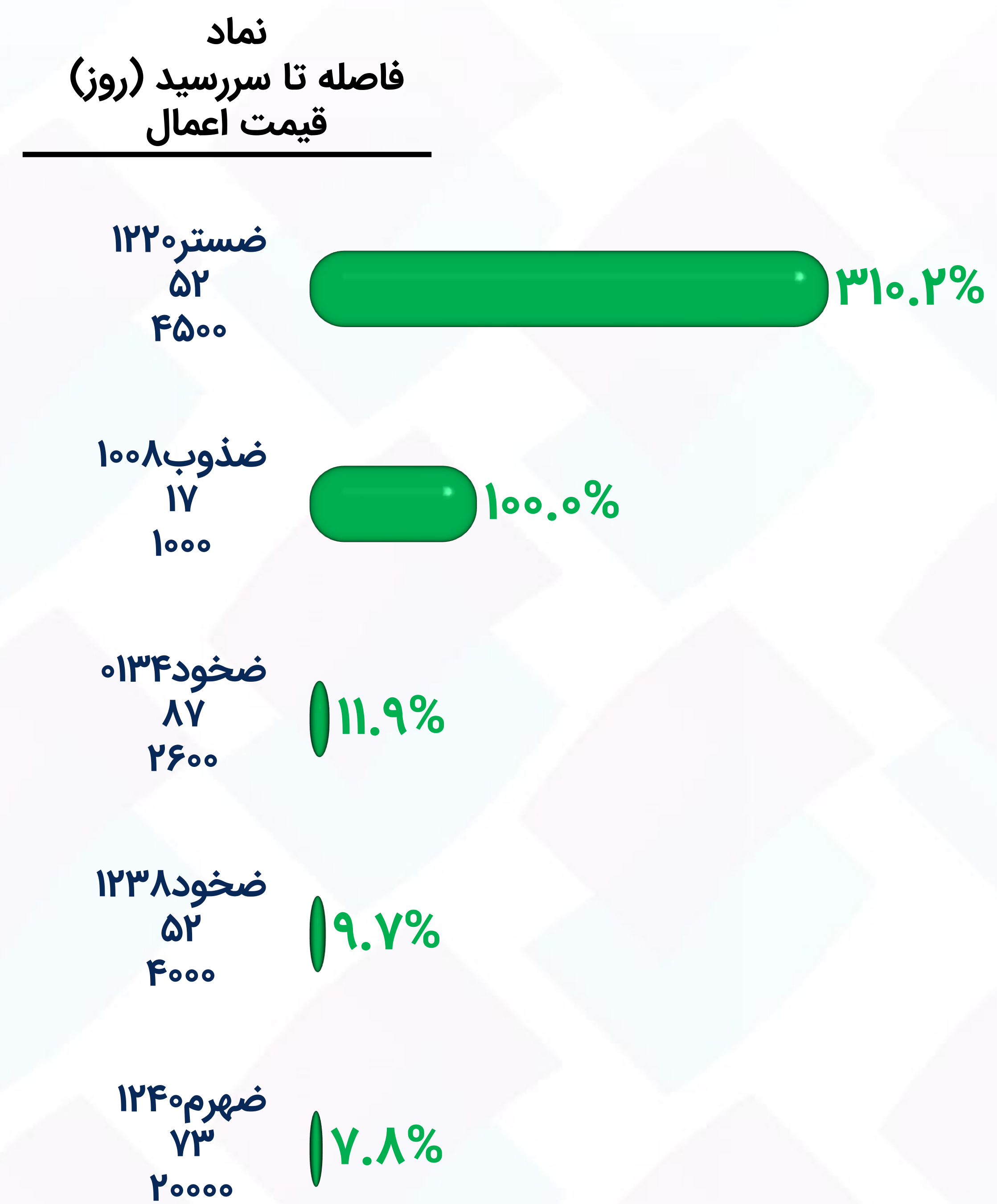
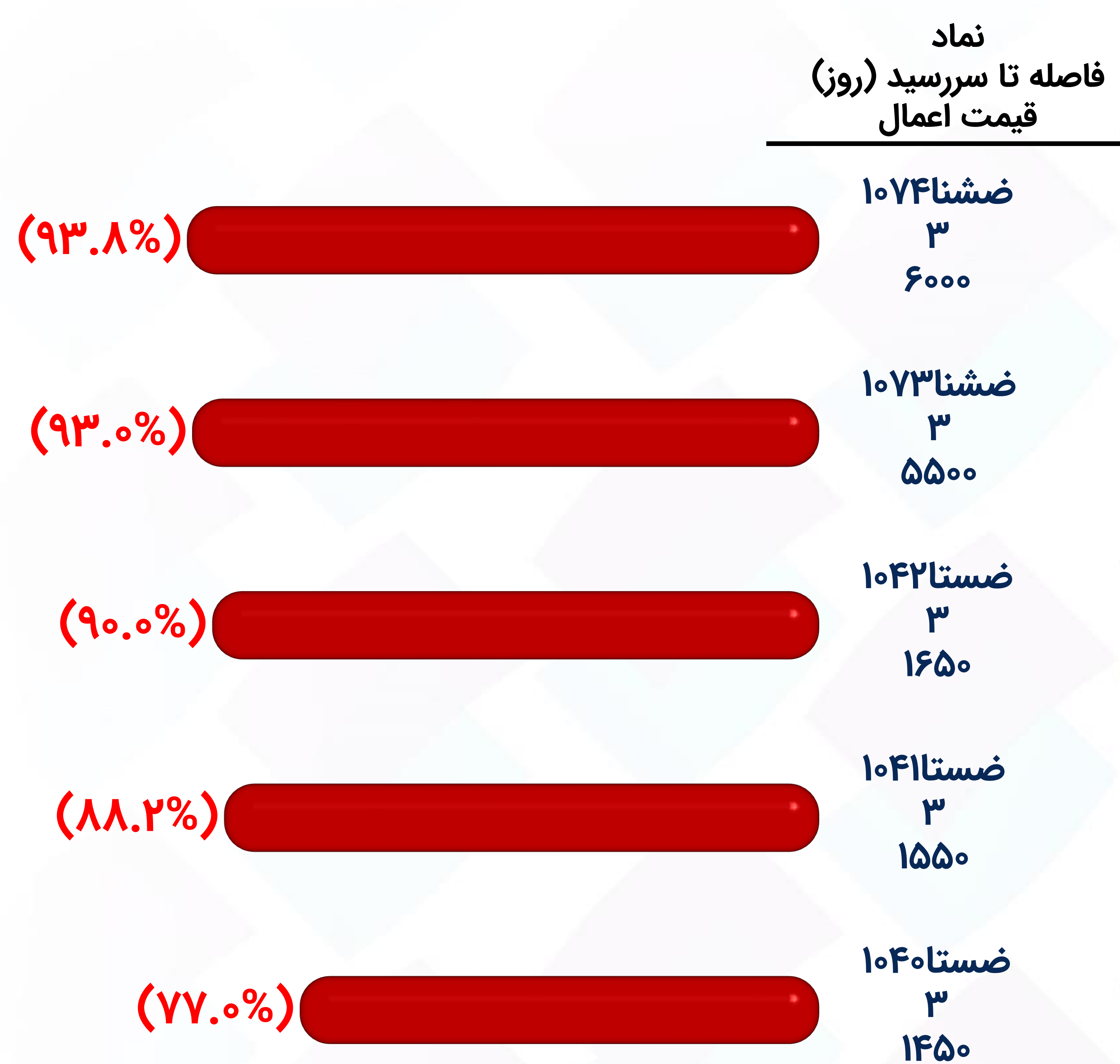
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



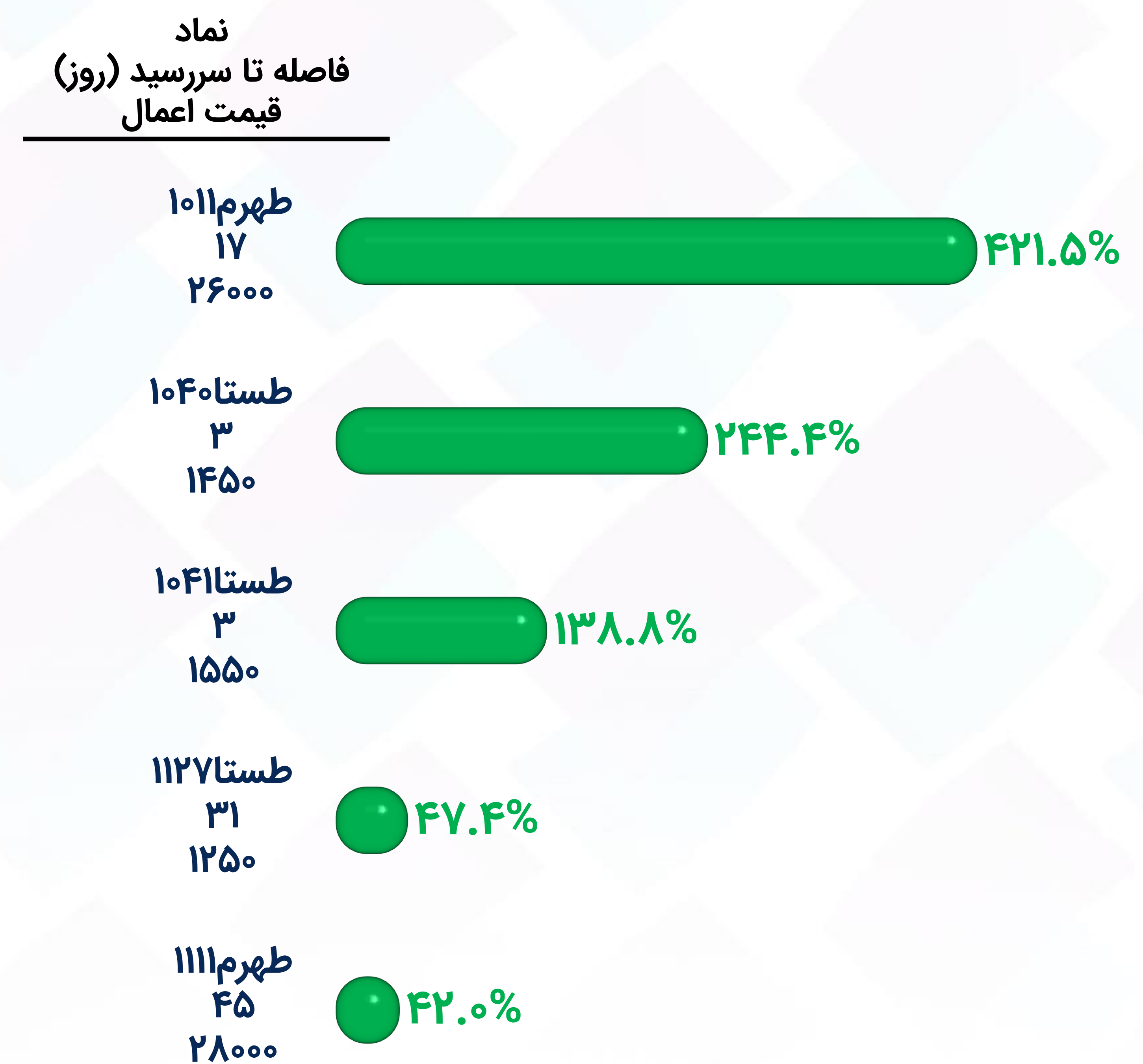
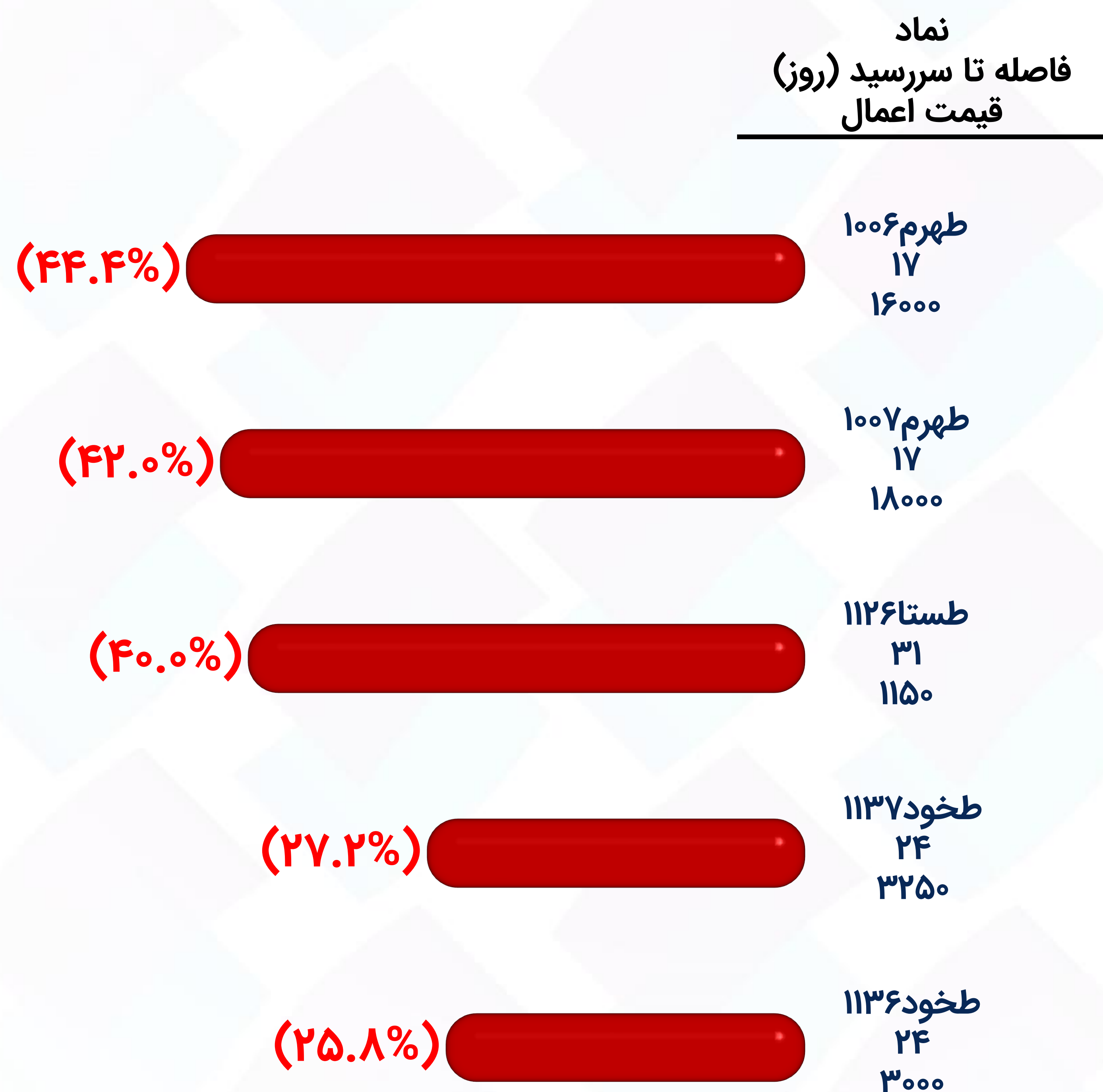
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

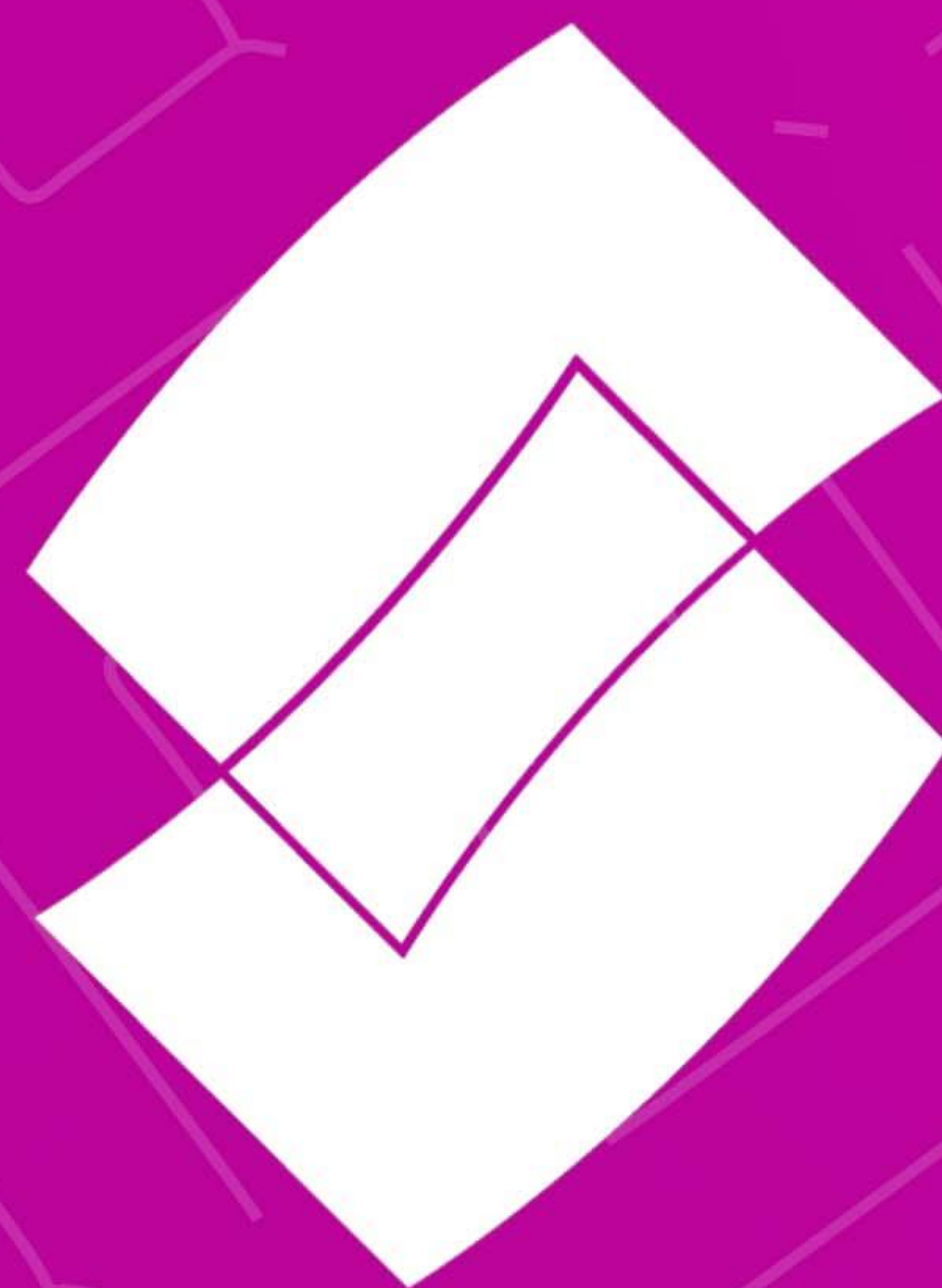
اختیار خرید



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.