

شماره
۳۹۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





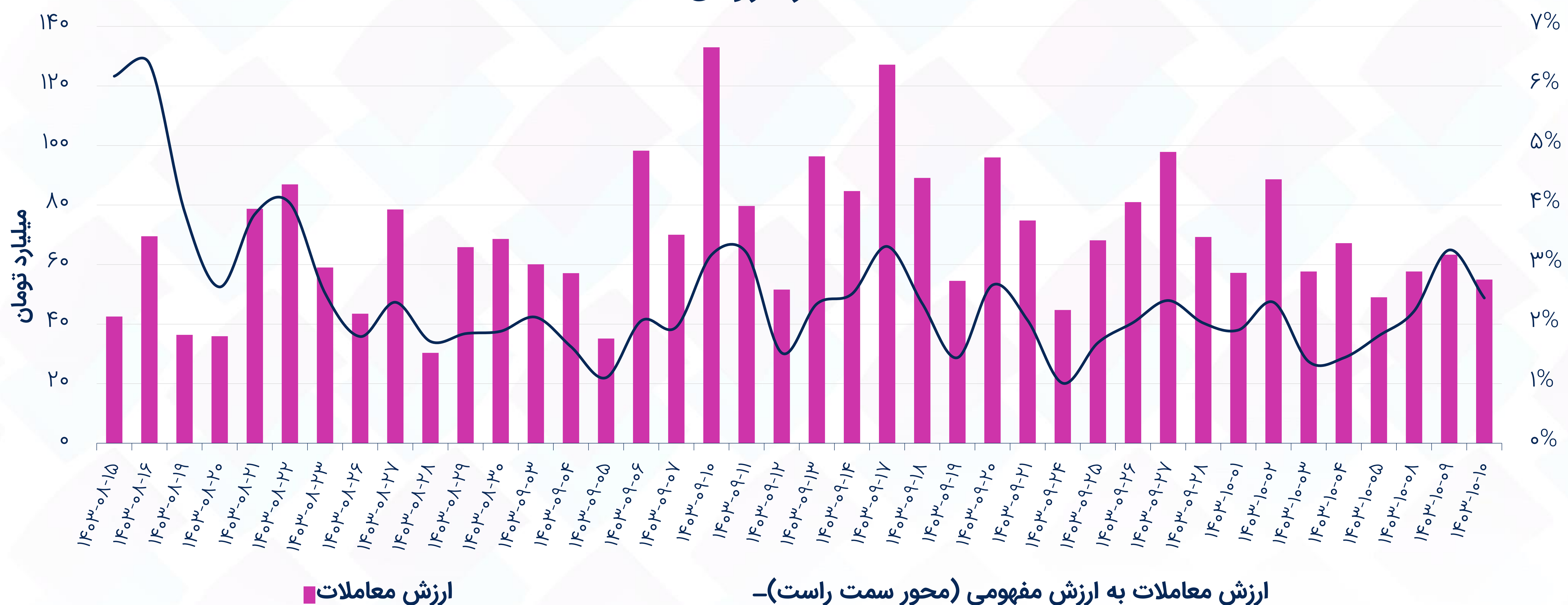
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



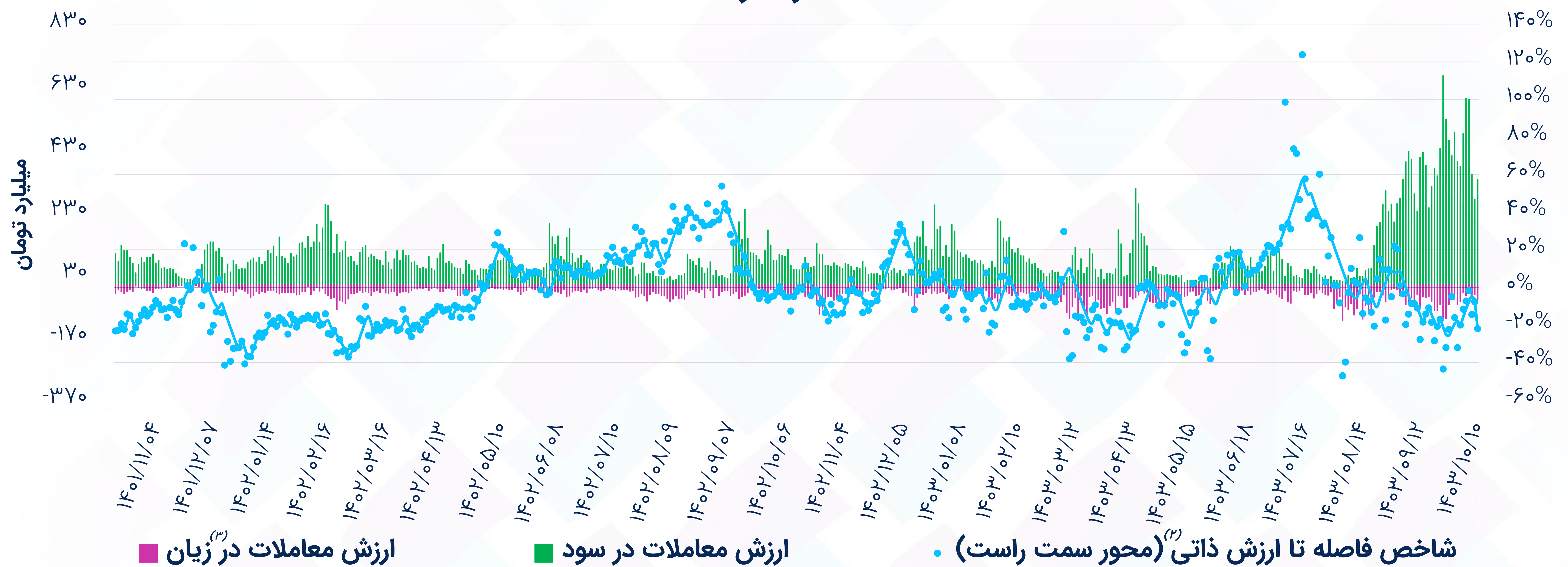
اختیار فروش



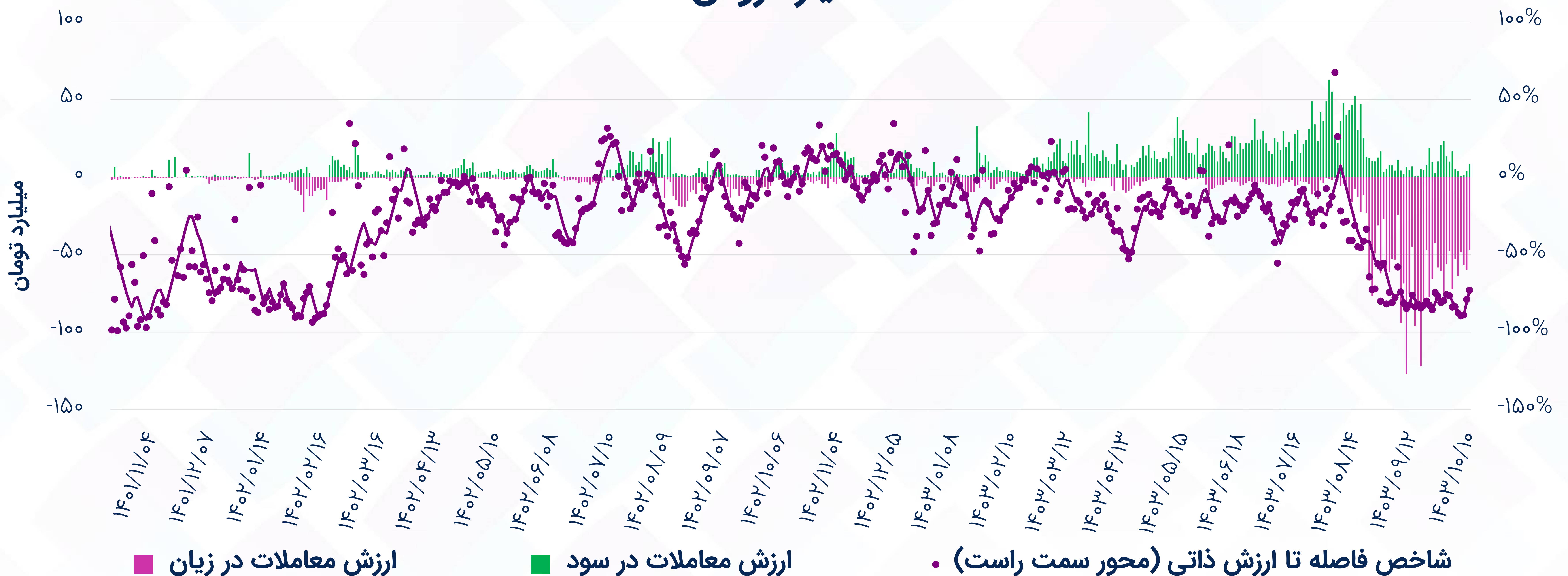
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

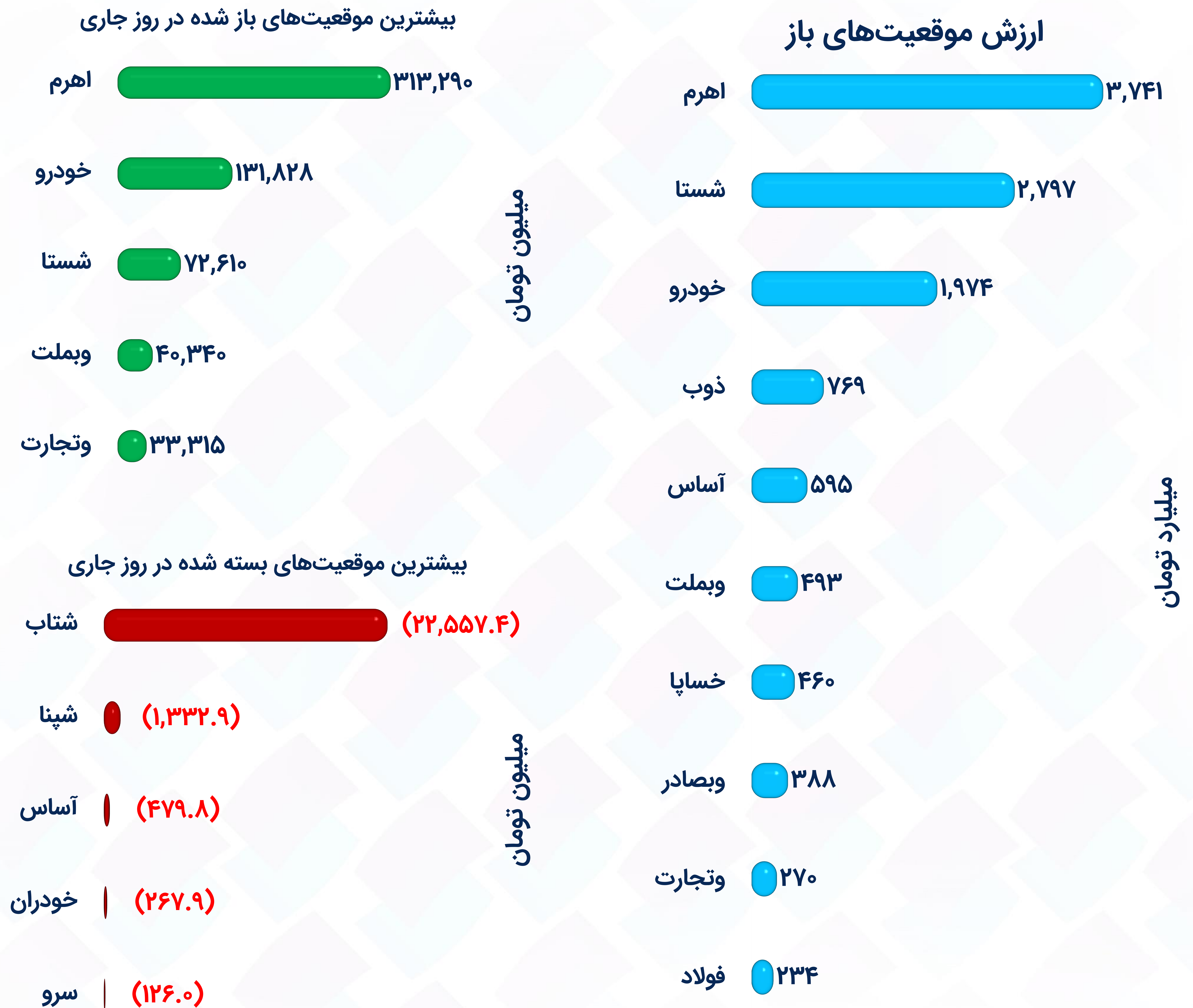
اختیار خرید

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	۳۳	۱۳۳.۱	۱,۰۳۷.۲	۱۲۵.۱	۸.۰	(۳۸.۹%)
خودرو	۳۳	۱۱۹.۱	۹۱۴.۲	۱۰۲.۹	۱۶.۲	(۱۸.۱%)
شستا	۴۳	۶۷.۵	۱,۶۸۷.۲	۵۱.۷	۱۵.۸	(۱.۷%)
ذوب	۱۹	۱۷.۵	۷۷.۶	۱۵.۸	۱.۶	(۲۱.۶%)
شتاب	۱۸	۱۶.۸	۵۹.۸	۱۶.۸	۰.۰	۷.۳%
وبملت	۱۱	۸.۳	۶۲.۰	۶.۸	۱.۵	(۳۴.۸%)
وتجارت	۱۳	۵.۷	۶۵.۷	۵.۰	۰.۷	(۲۱.۷%)

اختیار فروش

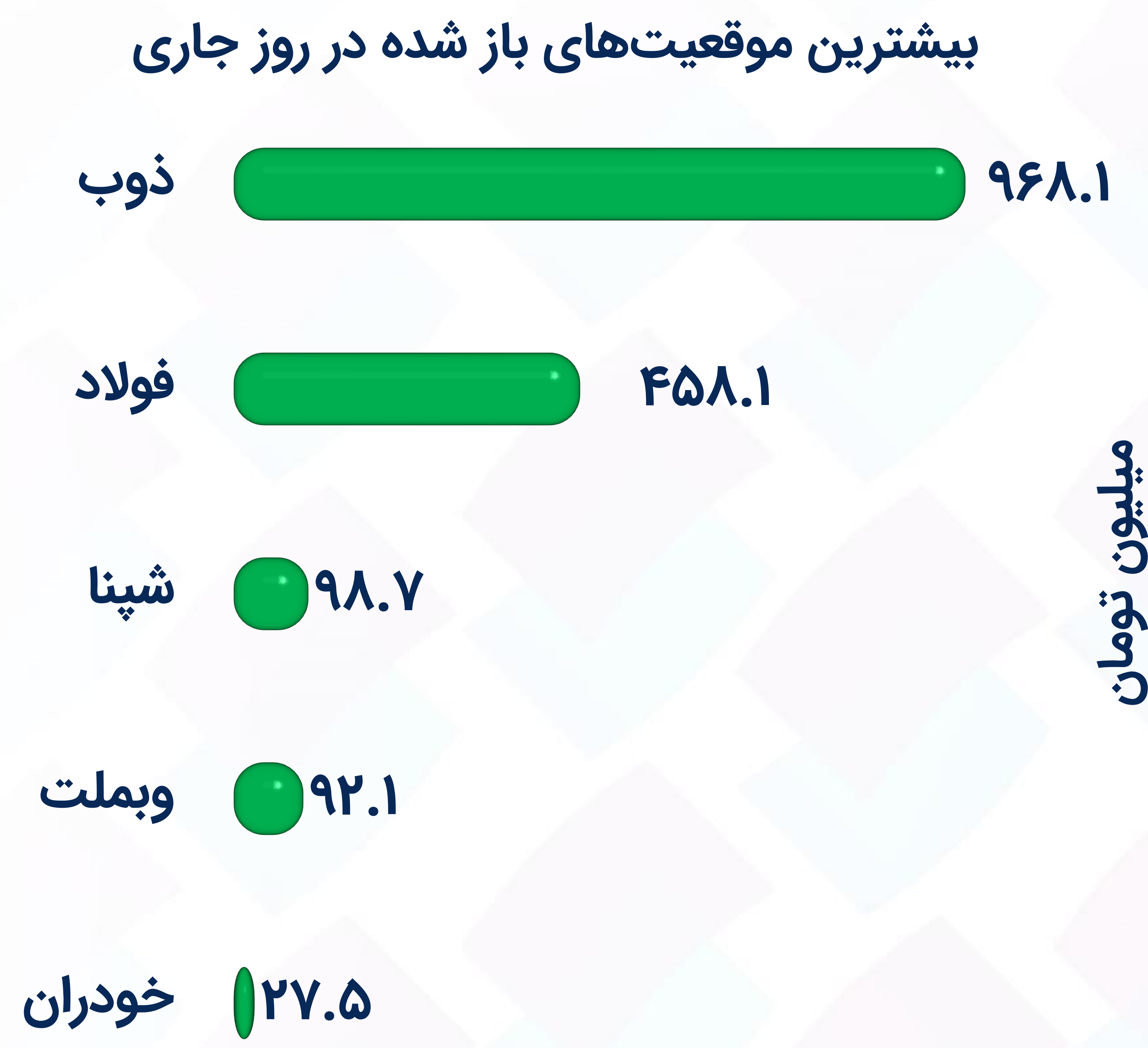
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
خودرو	۵	۲۵,۰۶۹.۷	۱,۱۴۴,۵۳۸.۲	۱,۵۵۸.۹	۲۳,۵۱۰.۸	(۸۳.۲%)
اهرم	۱۷	۲۲,۰۷۱.۲	۷۷۱,۵۴۶.۸	۵۸۸.۸	۲۱,۴۸۲.۴	(۶۲.۷%)
شستا	۱۸	۷,۵۹۸.۲	۳۲۹,۴۵۱.۴	۶,۰۵۷.۱	۱,۵۴۱.۱	(۶۸.۸%)
وبملت	۲	۱۴۲.۹	۳,۴۴۲.۷	۰.۰	۱۴۲.۹	(۶۷.۰%)
ذوب	۳	۷۶.۴	۲,۷۰۹.۰	۰.۷	۷۵.۸	(۸۳.۵%)
فولاد	۲	۳.۸	۷۱۱.۶	۰.۰	۳.۸	(۹۹.۷%)
خودران	۱	۲.۲	۲۶.۷	۲.۲	۰.۰	(۴۱.۶%)

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



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

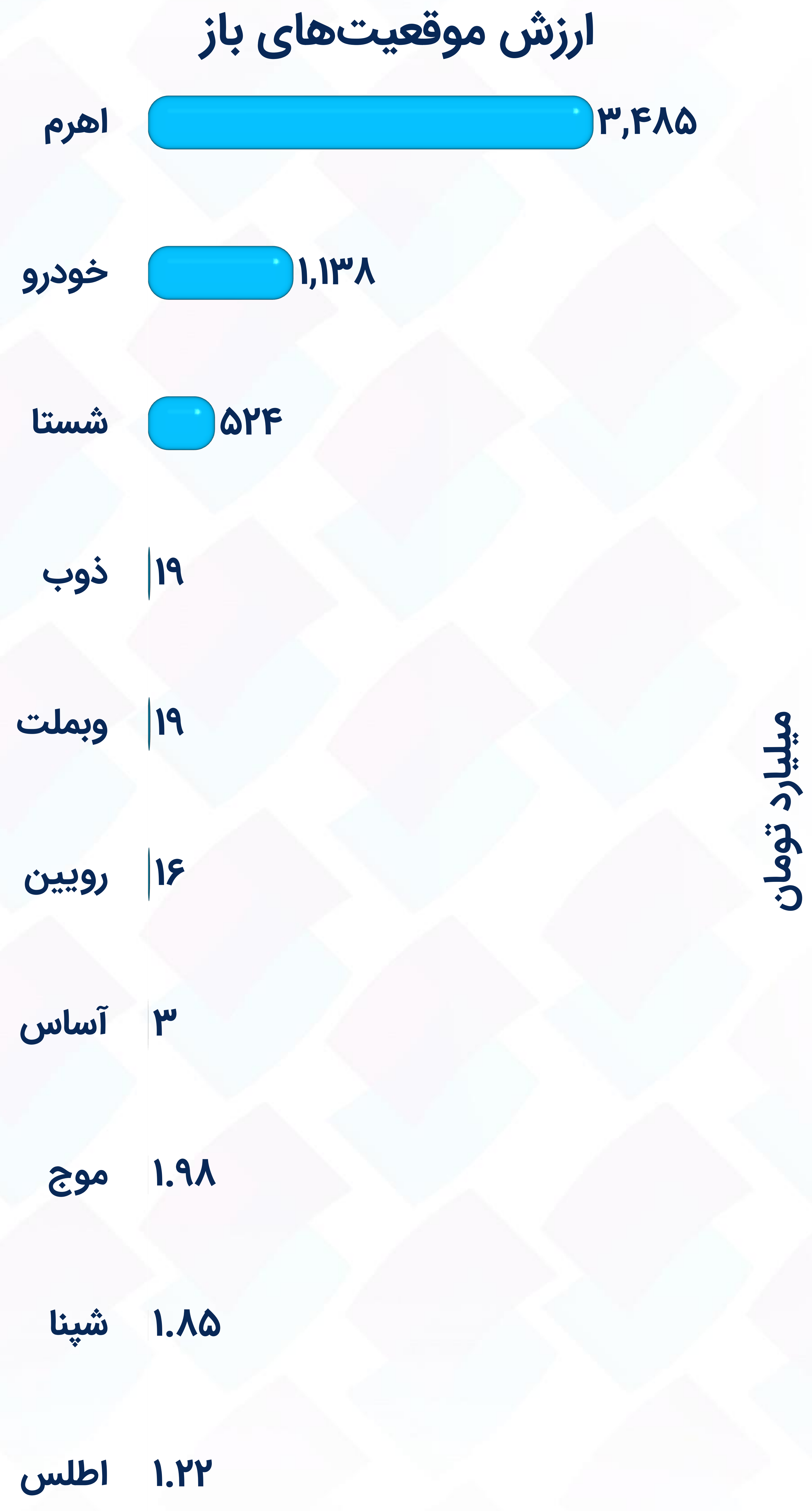
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



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
ضشنا ۱۰۷۲	شپنا	۵,۰۰۰	۲	۱۵.۵	۵۴	۵,۰۵۰	۵,۰۵۴	۰.۱%	۹۳.۶	۰.۶۶	۱۱۲	۱۰۸%
ضجهش ۱۰۱۰	جهش	۱۱,۰۰۰	۲	۶.۲	۸۳۲	۱۲,۳۵۰	۱۱,۸۳۲	(۴.۲%)	۱۴.۲	۱.۰۰	۱,۳۹۳	۶۷%
ضشنا ۱۰۷۱	شپنا	۴,۵۰۰	۲	۲۲۷.۱	۳۵۴	۵,۰۵۰	۴,۸۵۴	(۳.۹%)	۱۳.۷	۱.۰۰	۵۶۸	۶۰%
ضستا ۱۰۳۹	شستا	۱,۳۵۰	۲	۹,۱۶۸.۵	۶۷	۱,۴۴۴	۱,۴۱۷	(۱.۹%)	۲۱.۱	۰.۹۹	۹۹	۴۸%
ضشنا ۱۰۷۰	شپنا	۴,۰۰۰	۲	۱,۲۶۵.۸	۷۶۹	۵,۰۵۰	۴,۷۶۹	(۵.۶%)	۶.۲	۱.۰۰	۱,۰۶۶	۳۹%

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	۱۶	۲.۲	۲	۵۲۹	۱,۰۰۲	۸۹%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۴	۲۴.۴	۱۰	۵۲۹	۱,۰۱۰	۹۱%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۰۴۲	شستا	۱,۶۵۰	۲	۱۵۹.۰	۱	۱,۴۴۴	۱,۶۵۱	۱۴%	۱,۶۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۴	۱۶.۸	۱۵	۵۲۹	۹۱۵	۷۳%	۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۶	۵.۹	۳۳۰	۲۶,۰۳۰	۳۴,۳۳۰	۳۲%	۱۰۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)

(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	۱۶	۲۸۱.۳	۲,۲۷۶	۲۶,۰۳۰	۲۵,۷۲۴	(۱.۲%)	۱۱.۳	-۰.۷۶	۱,۸۱۳	(۲۰.۳%)
طستا ۱۰۴۱	شستا	۱,۵۵۰	۲	۷۴۷.۸	۱۴۴	۱,۴۴۴	۱,۴۰۶	(۲.۶%)	۹.۸	-۰.۹۹	۱۰۰	(۳۰.۵%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۴	۲۰۸.۹	۴,۸۸۰	۲۶,۰۳۰	۲۵,۱۲۰	(۳.۵%)	۵.۱	-۰.۷۸	۳,۱۹۸	(۳۴.۵%)
طهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۱۶	۱,۱۳۹.۹	۹۸۴	۲۶,۰۳۰	۲۵,۰۱۶	(۳.۹%)	۲۵.۴	-۰.۴۰	۶۰۰	(۳۹.۰%)
طران ۱۱۰۹	خودران	۱۱,۰۰۰	۴۸	۲.۲	۸۶۰	۱۰,۶۸۰	۱۰,۱۴۰	(۵.۱%)	۱۱.۸	-۰.۴۴	۵۰۲	(۴۱.۶%)

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	۲	۵.۴	۱	۱,۴۴۴	۱,۰۴۹	(۲۷.۴%)	۱,۰۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۷	شستا	۱,۱۵۰	۲	۱.۴	۱	۱,۴۴۴	۱,۱۴۹	(۲۰.۴%)	۱,۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۶	۲۷.۹	۲۱	۲۶,۰۳۰	۱۳,۹۷۹	(۴۶.۳%)	۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۳۰	۵.۶	۴	۱,۴۴۴	۸۴۶	(۴۱.۴%)	۲۱۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۶	۱.۰	۱۰	۲۶,۰۳۰	۱۴,۹۹۰	(۴۲.۴%)	۱,۴۹۹.۰	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

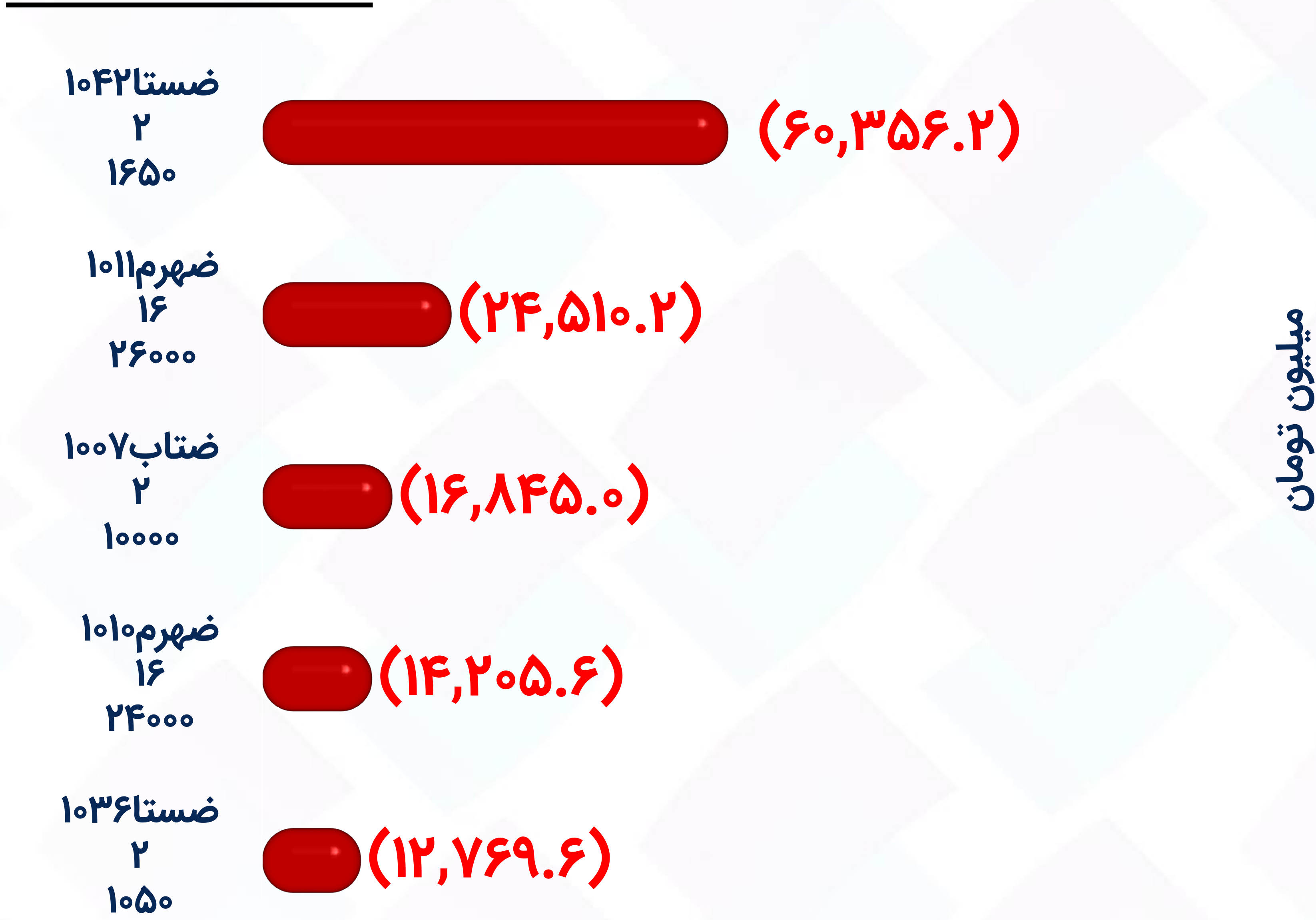
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



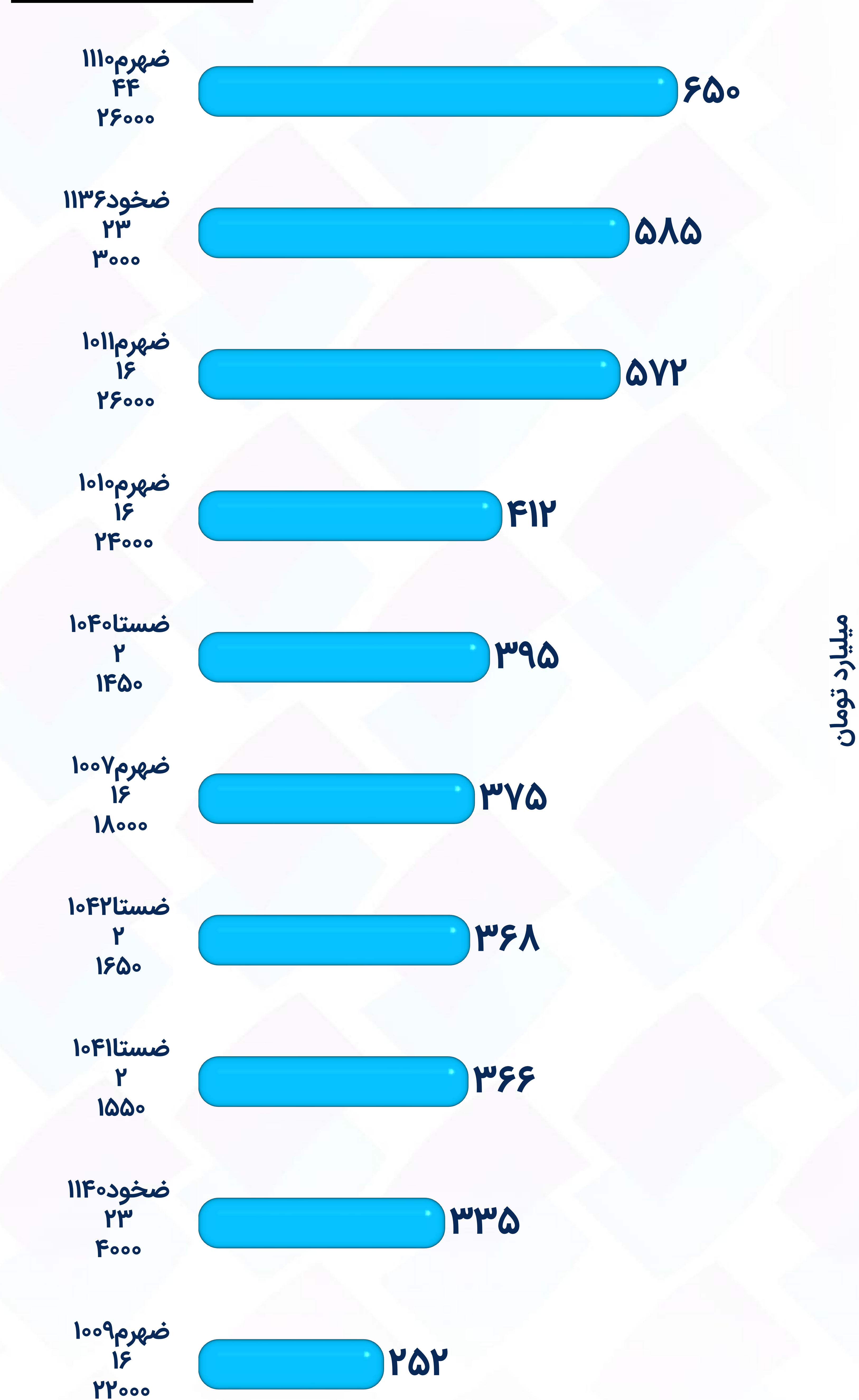
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



ارزش موقعیت‌های باز

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



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

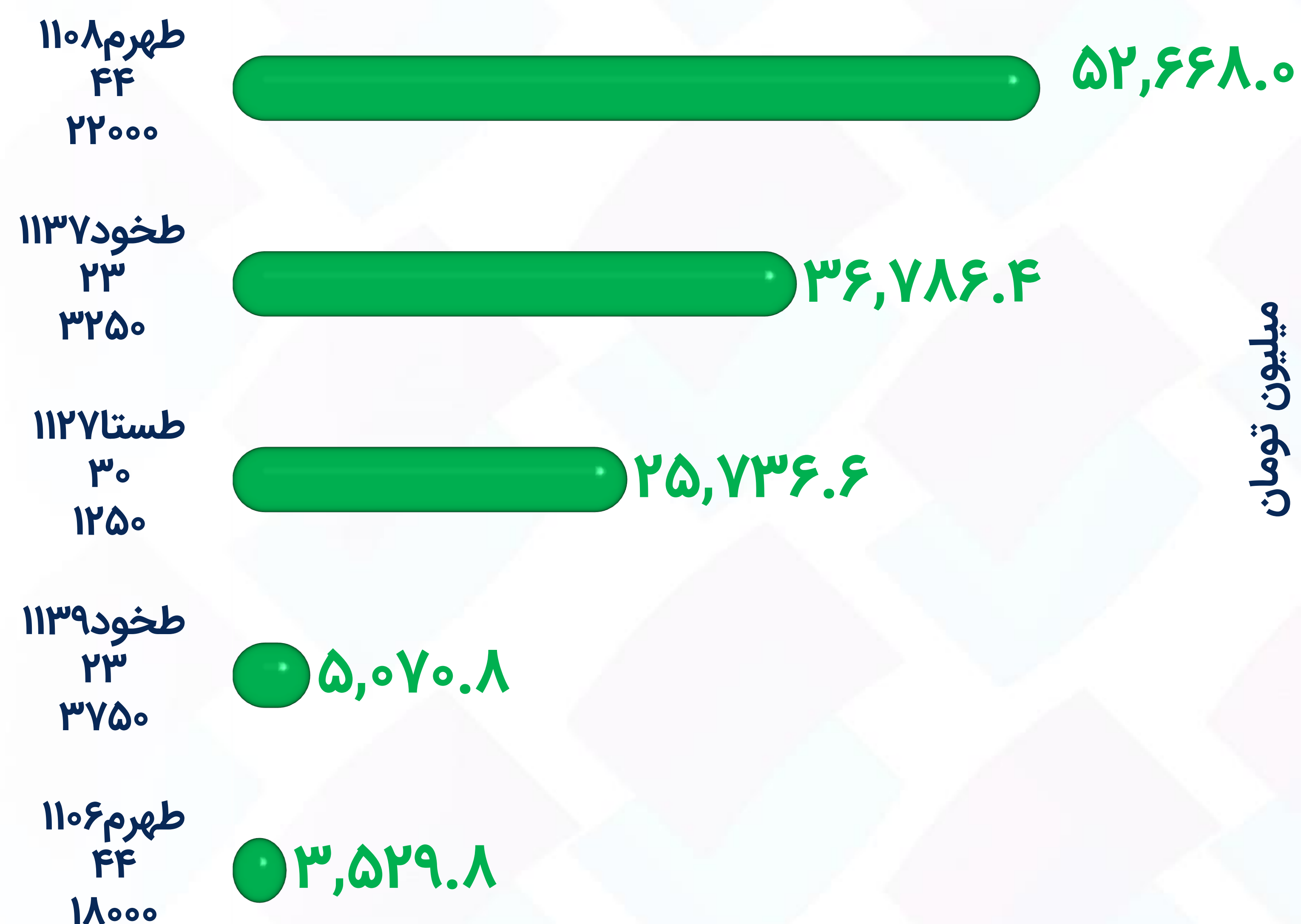
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

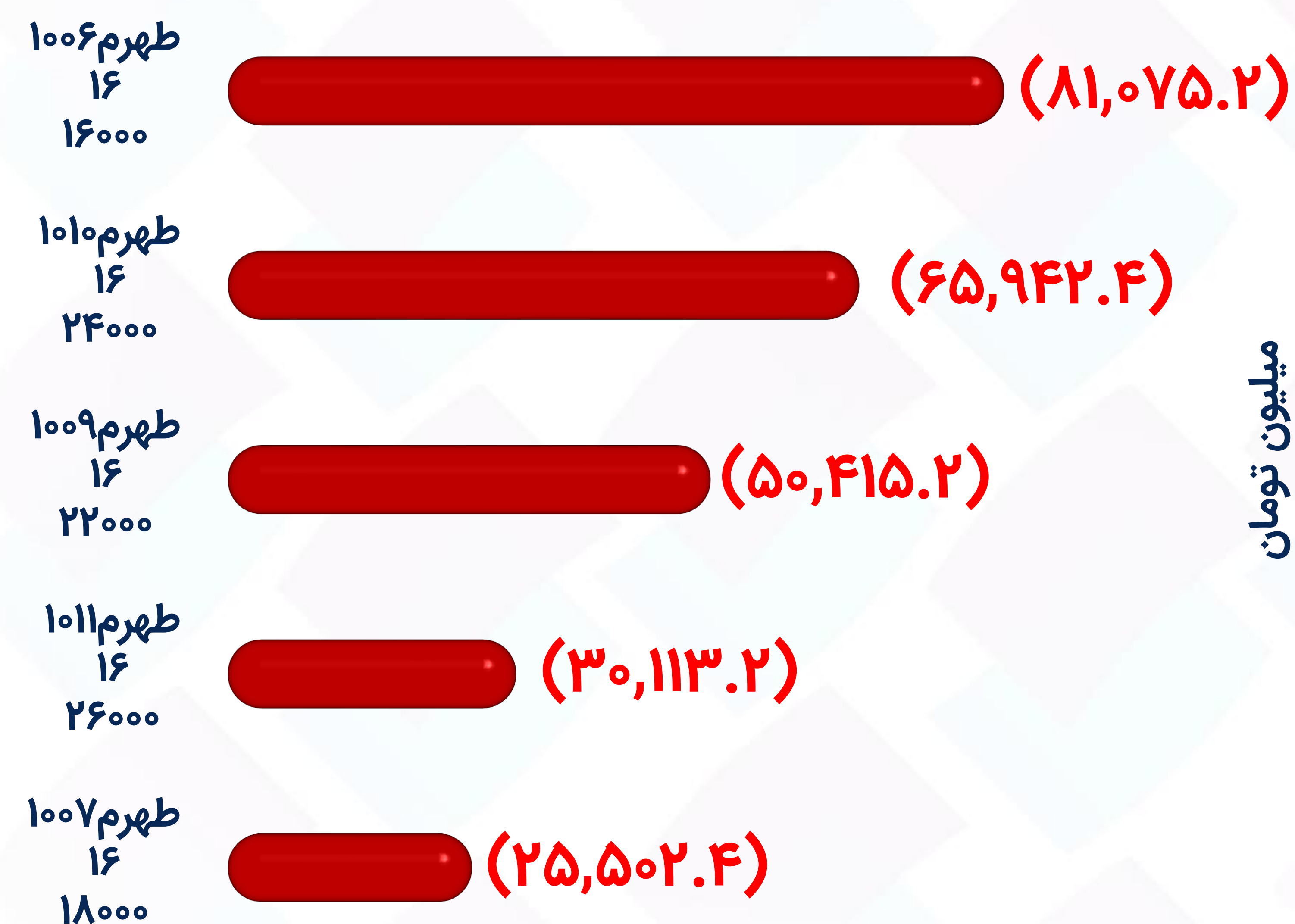
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

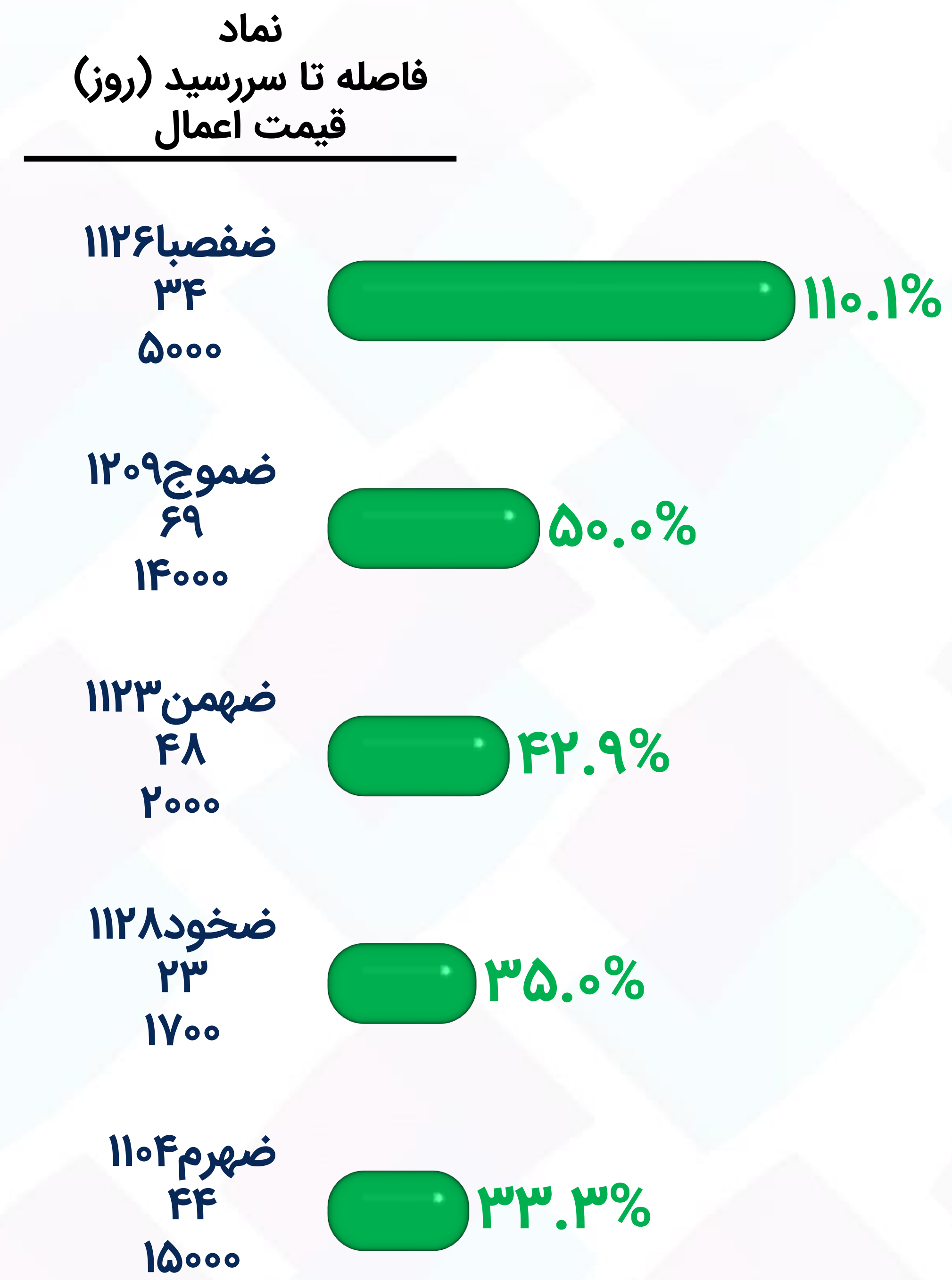
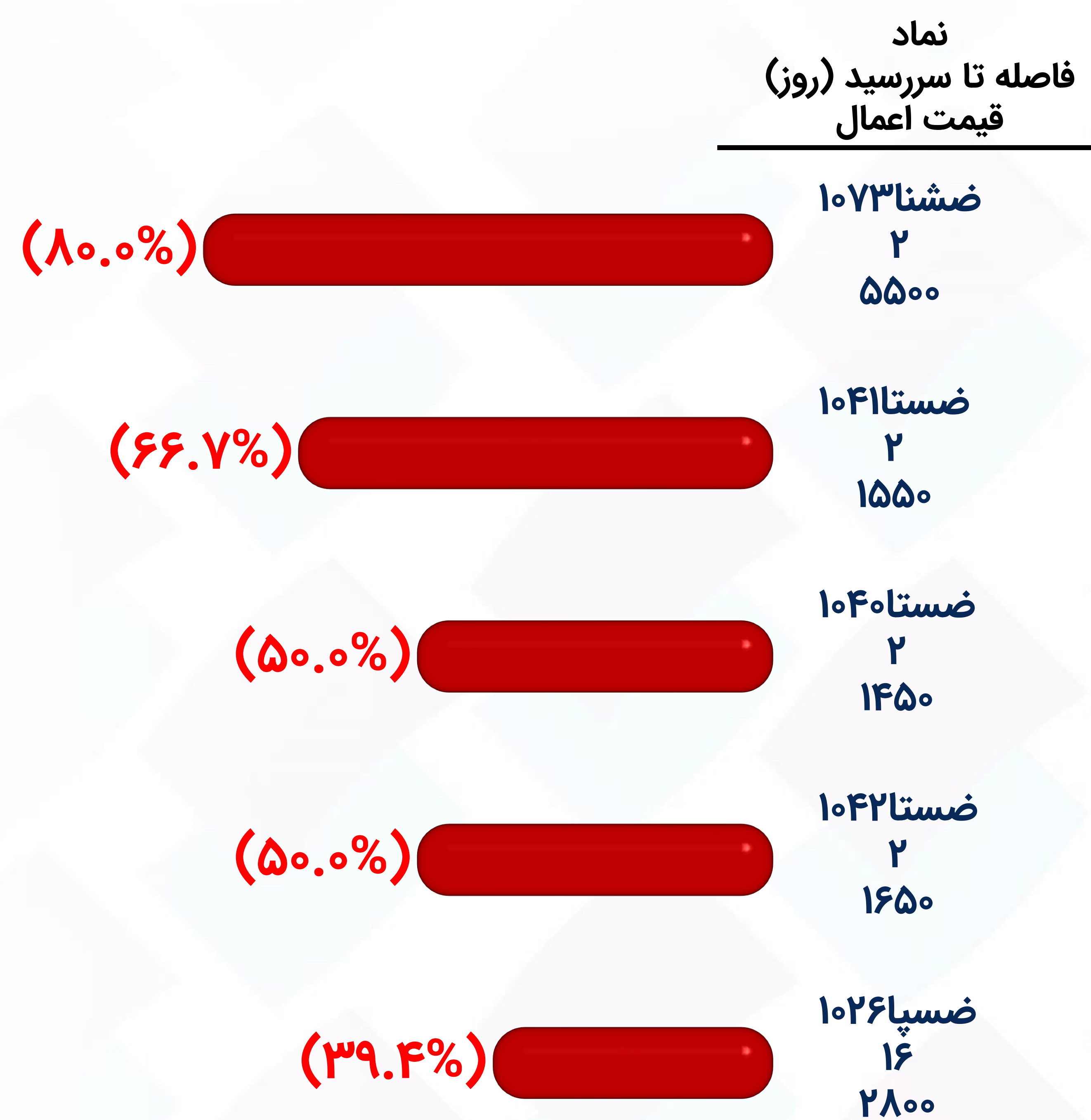
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



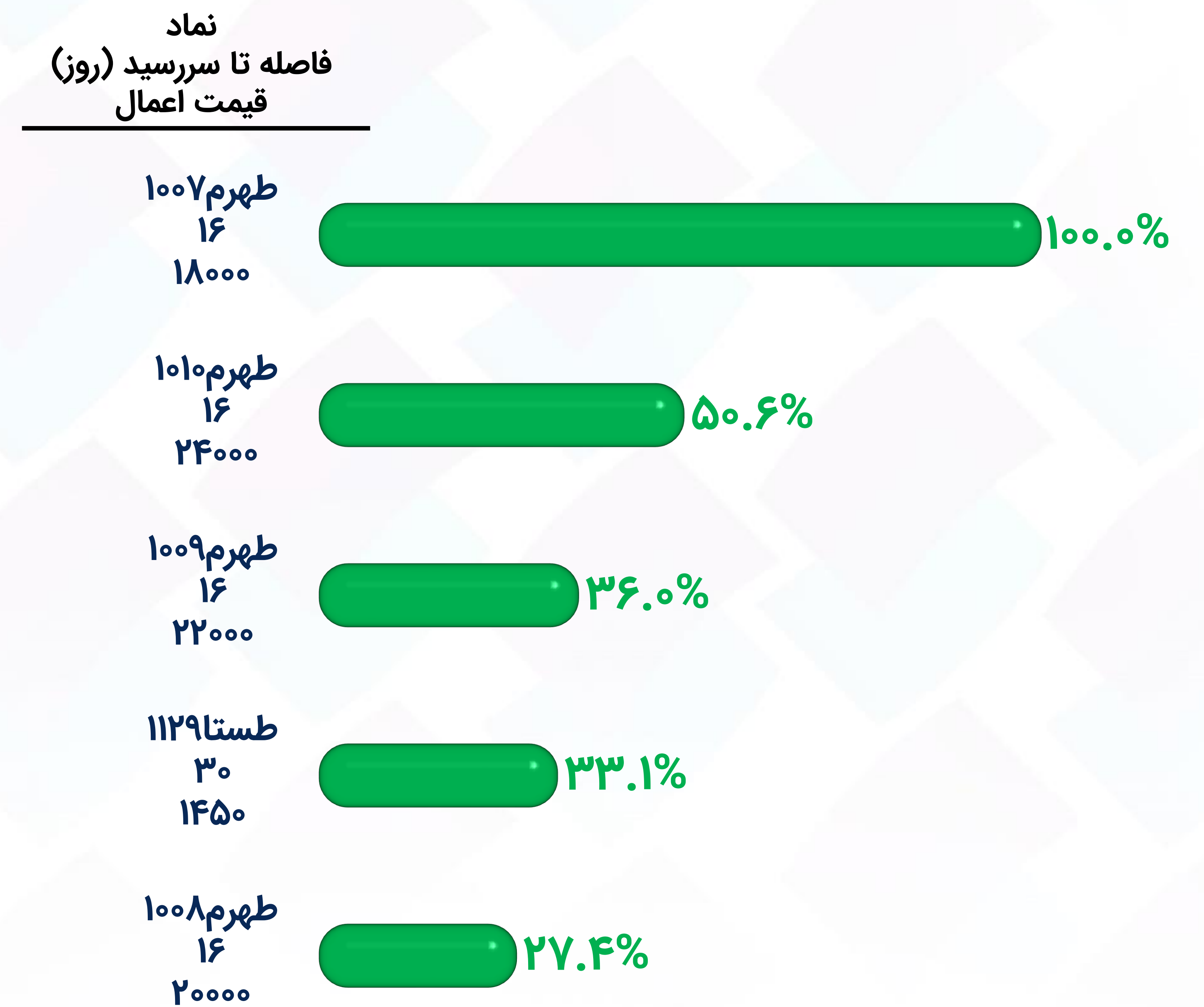
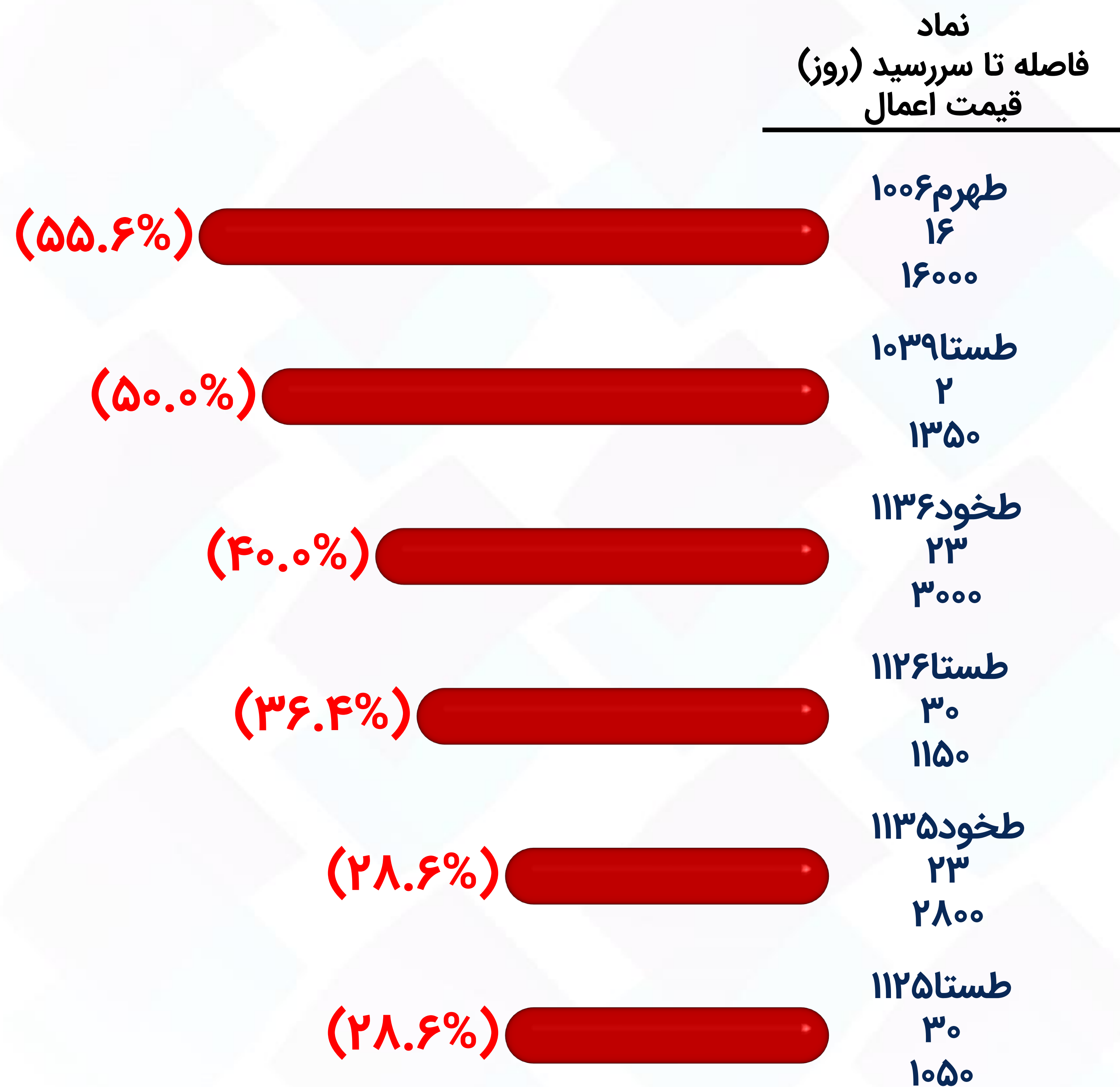
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

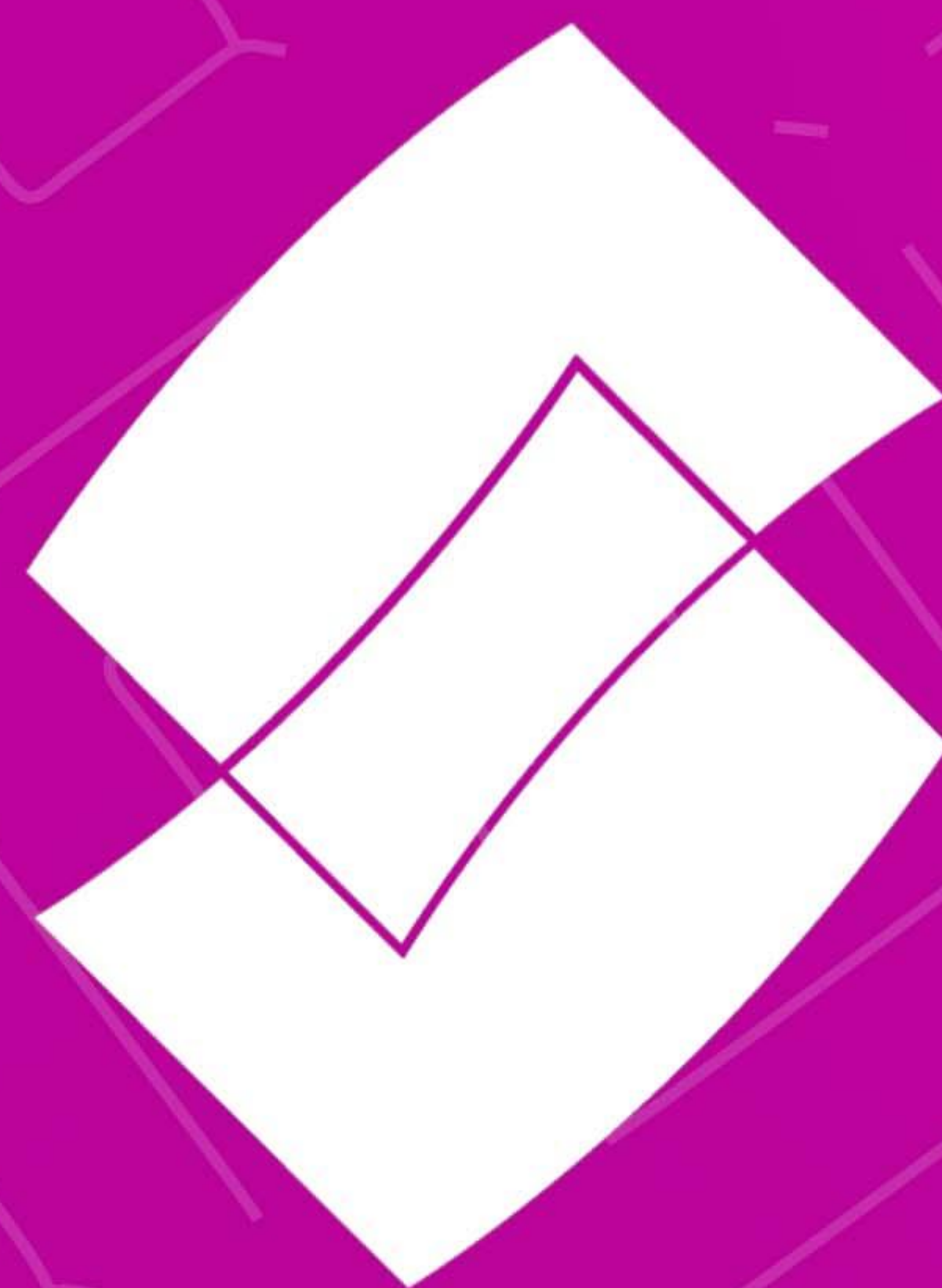
اختیار خرید



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.