

شماره
۳۹۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۱ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





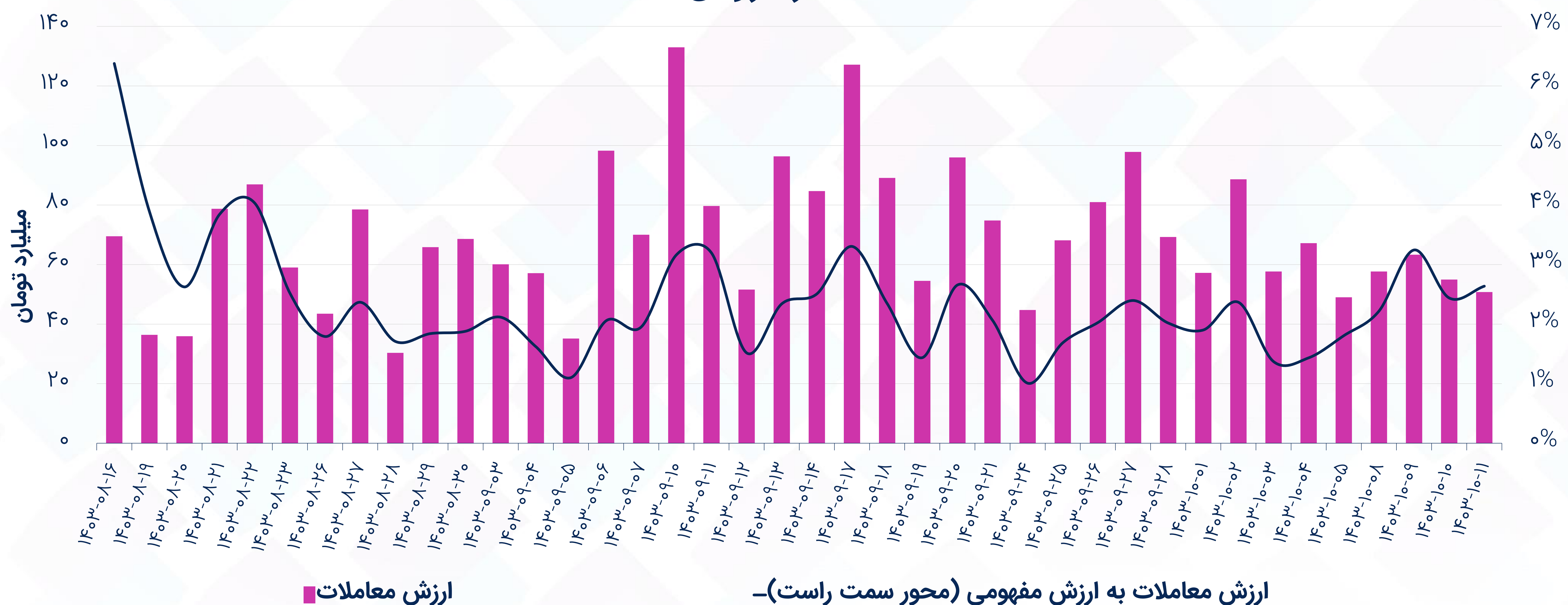
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



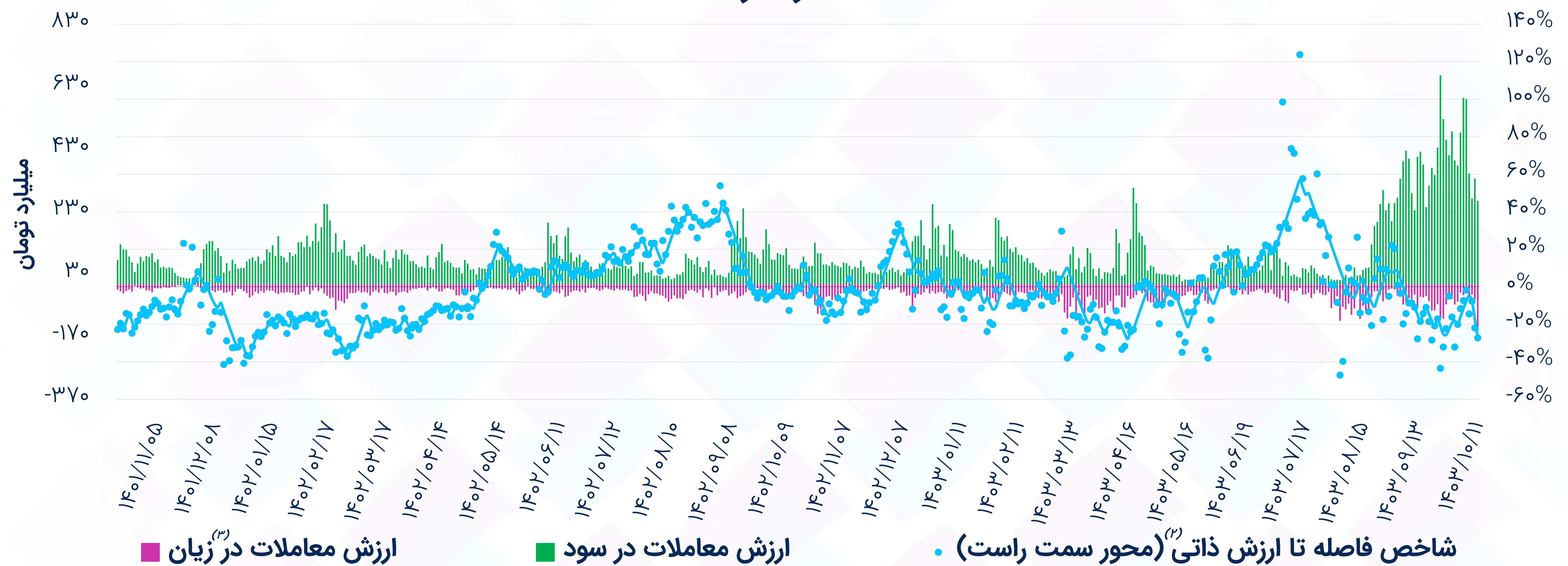
اختیار فروش



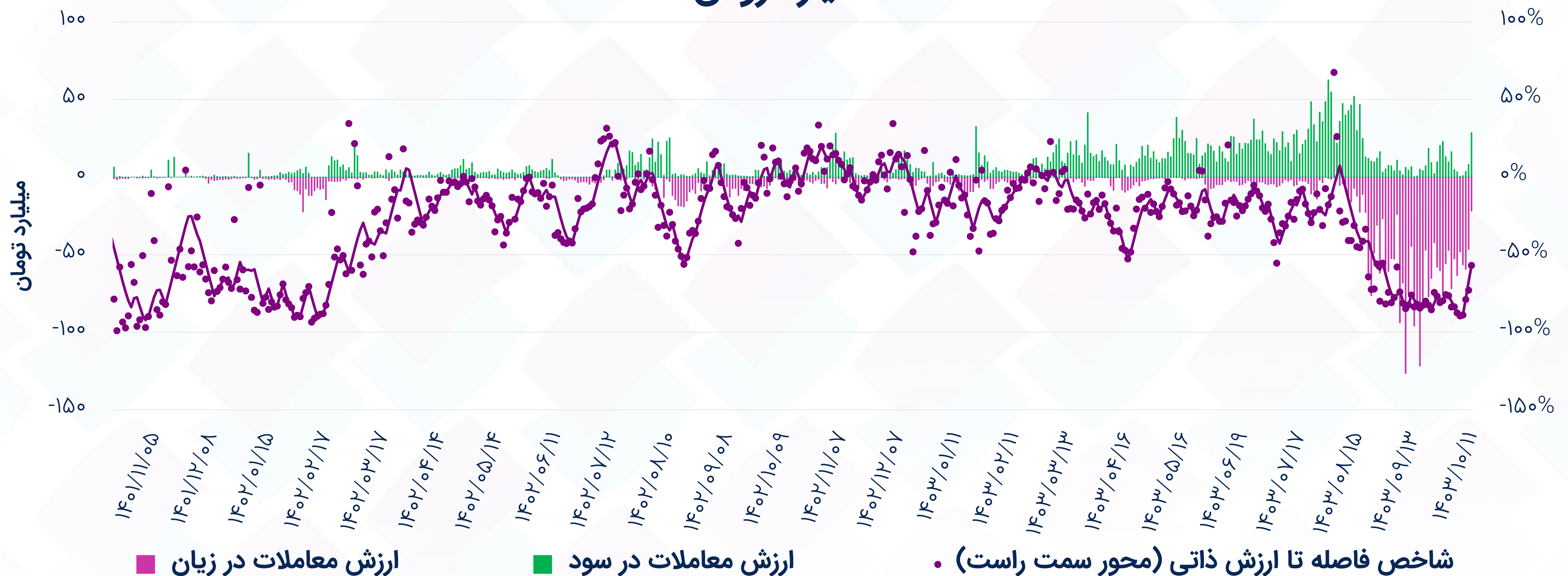
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

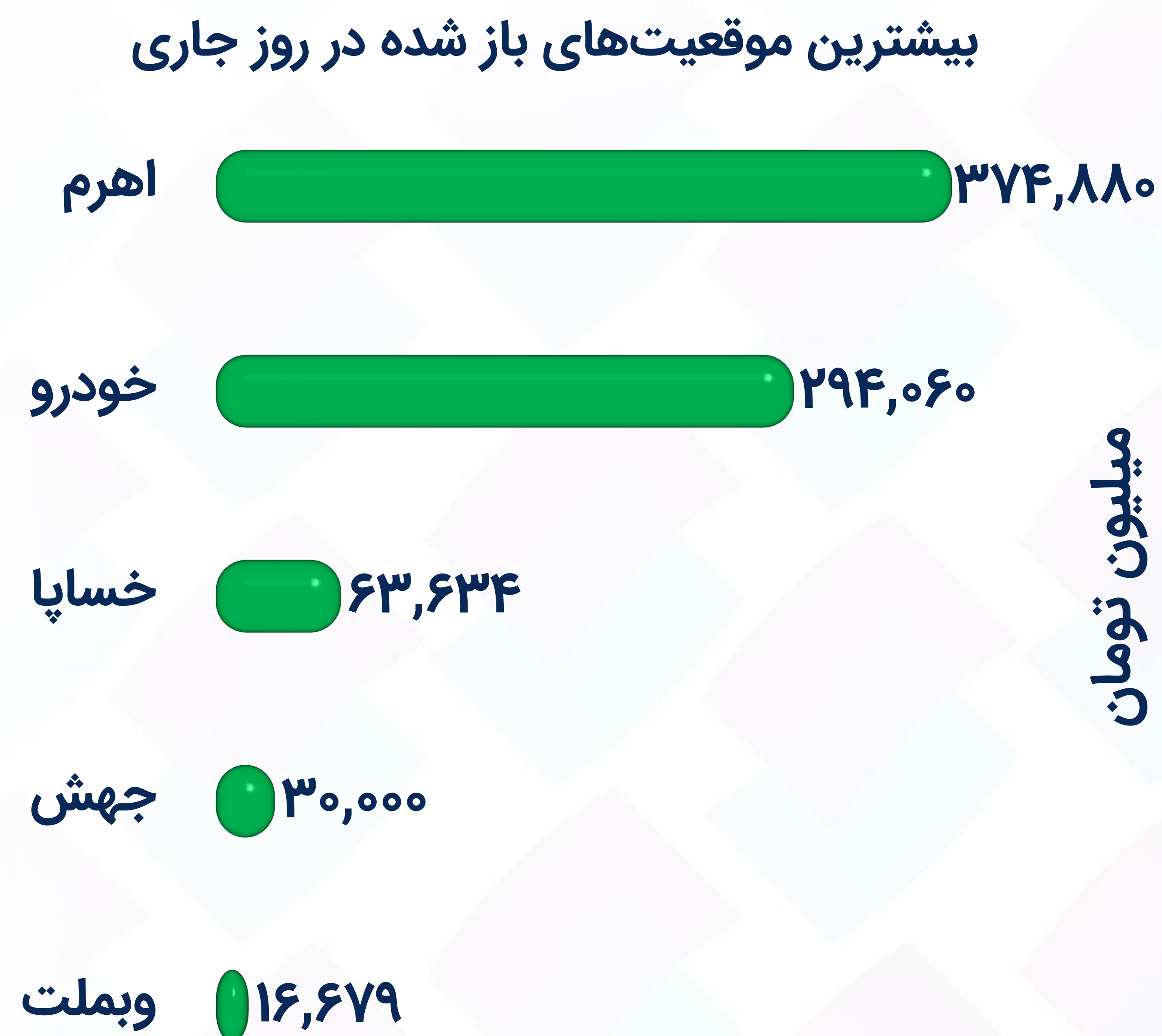
اختیار خرید

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	۱۴۰.۴	۱,۳۵۸.۱	۲۹.۲	۱۱۱.۲	(۴۵.۲%)
خودرو	۲۸	۱۱۱.۶	۱,۰۶۰.۸	۹۵.۶	۱۶.۰	(۲۵.۰%)
شستا	۴۱	۷۹.۴	۱,۶۷۸.۵	۶۶.۴	۱۲.۹	(۱۴.۶%)
پادا	۳	۱۵.۴	۴۹.۸	۱۵.۴	۰.۰	۵.۳%
ذوب	۱۸	۱۵.۴	۶۴.۳	۱۴.۰	۱.۴	(۱۴.۴%)
جهش	۱۳	۱۳.۶	۵۴.۱	۱۳.۶	۰.۰	(۳.۰%)
وبملت	۱۴	۷.۱	۴۸.۳	۵.۷	۱.۴	(۳۴.۷%)

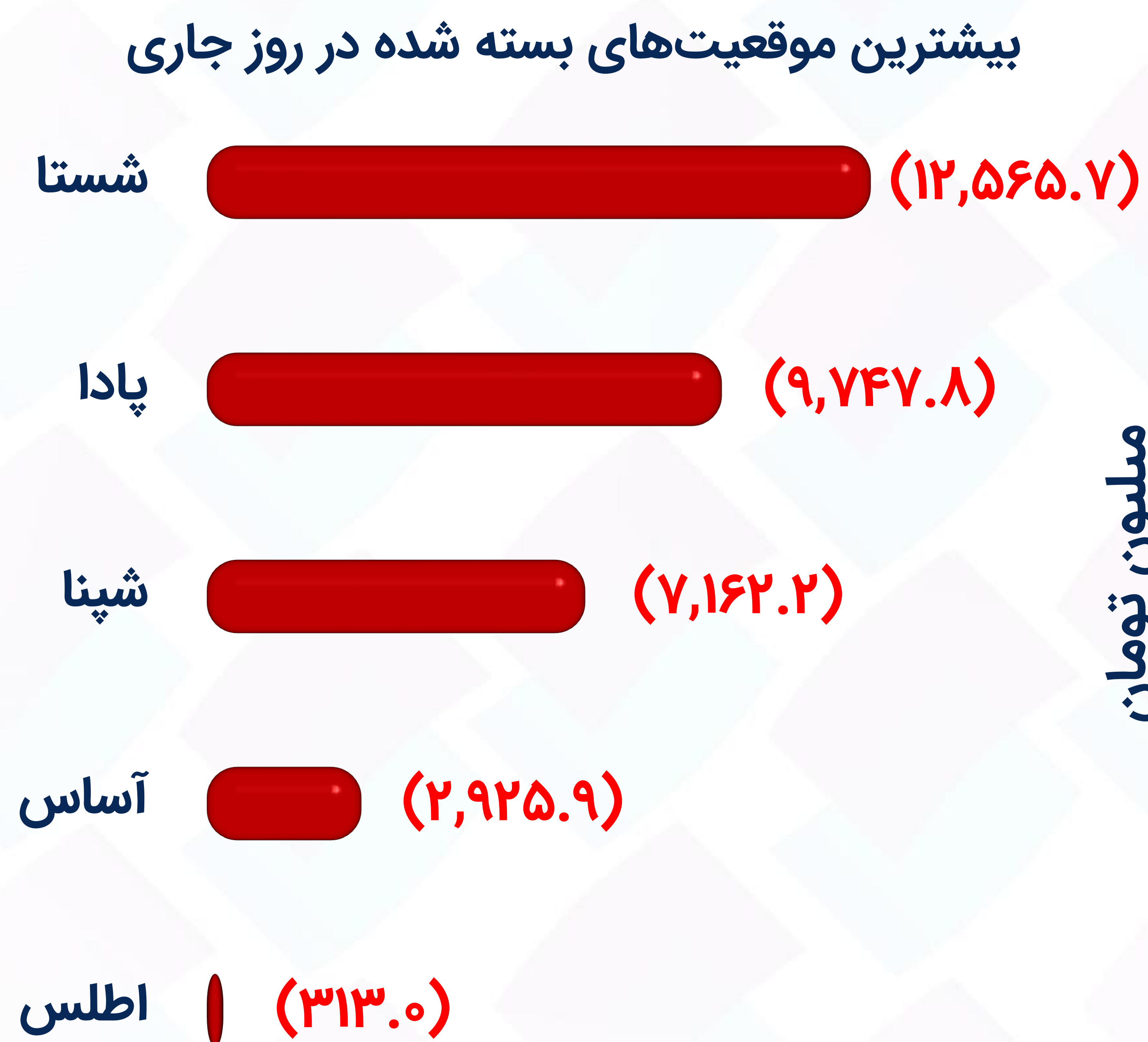
اختیار فروش

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
اهرم	۱۸	۲۶,۶۰۵.۳	۹۴۲,۳۸۷.۴	۲۱,۸۰۱.۵	۴,۸۰۳.۸	(۵۲.۱%)
خودرو	۷	۱۸,۳۶۰.۱	۷۶۰,۲۷۰.۹	۲,۴۵۱.۸	۱۵,۹۰۸.۳	(۷۴.۰%)
شستا	۱۷	۵,۲۱۴.۴	۲۰۶,۰۰۴.۶	۴,۵۱۲.۵	۷۰۲.۰	(۱۹.۹%)
وبملت	۲	۴۸۲.۴	۱۴,۵۵۴.۱	۰.۰	۴۸۲.۴	(۷۱.۳%)
ذوب	۳	۱۰۰.۷	۲,۰۳۹.۹	۱۱.۱	۸۹.۶	(۸۰.۱%)
توان	۲	۶.۱	۷۷.۸	۰.۰	۶.۱	(۶۶.۸%)
خسپا	۲	۰.۵	۵۷.۹	۰.۰	۰.۵	(۹۶.۸%)

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



میلیون تومان



میلیون تومان



میلیارد تومان

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

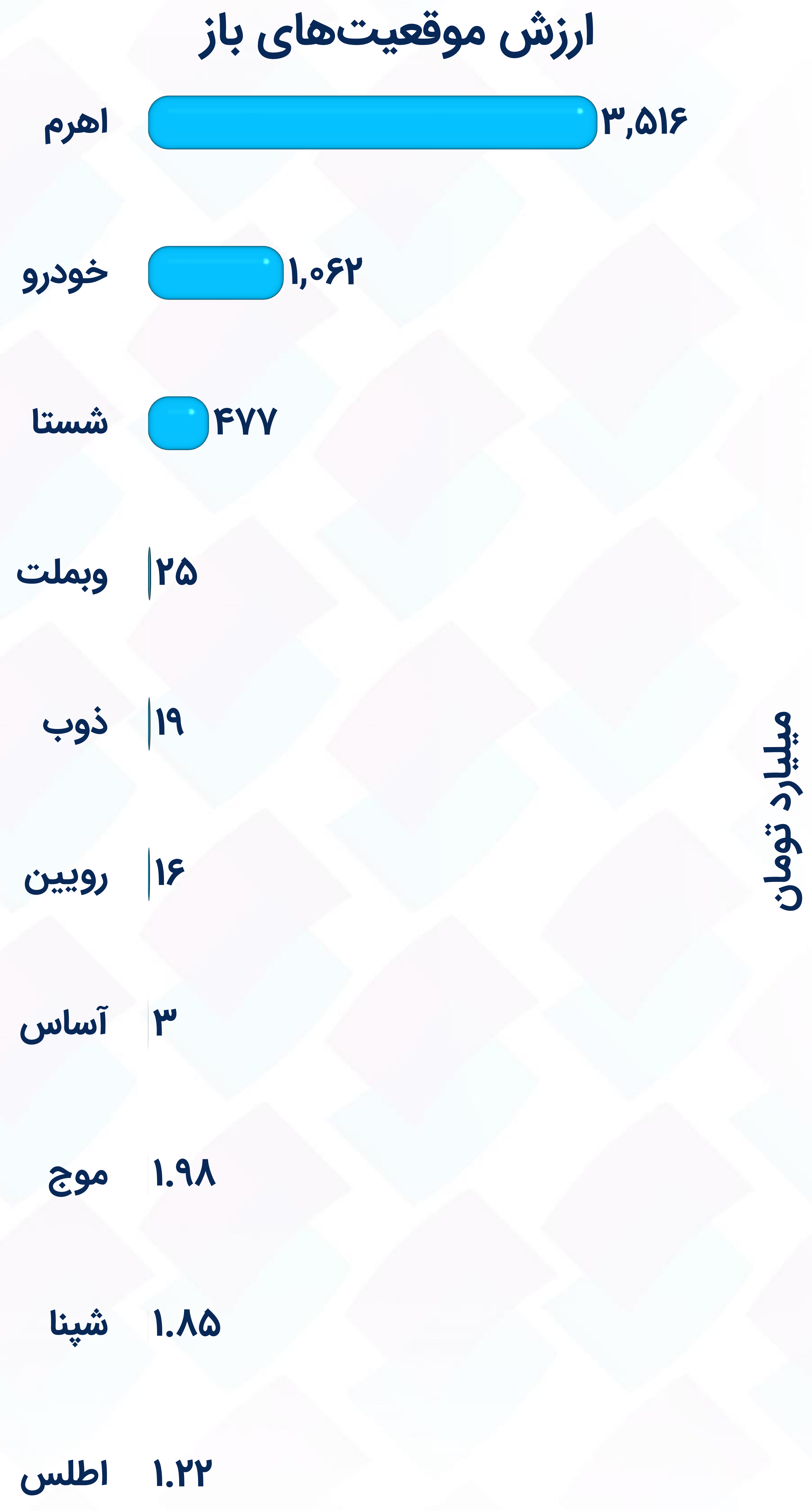
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



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
ضبساما ۲۱۸	بساما	۶,۶۶۲	۱۱۷	۱۳۳.۶	۲۷۷	۶,۲۴۰	۶,۹۳۹	۱۱.۲%	۲۵.۱	۰.۶۲	۴۴۴	۶۰%
ضموج ۱۲۰۷	موج	۱۲,۰۰۰	۶۸	۶۳.۷	۷,۸۷۰	۲۲,۵۹۹	۱۹,۸۷۰	(۱۲.۱%)	۲.۵	۱.۰۰	۱۱,۳۱۰	۴۴%
ضموج ۱۲۰۲	موج	۸,۵۰۰	۶۸	۶.۶	۱۰,۹۳۲	۲۲,۵۹۹	۱۹,۴۳۲	(۱۴.۰%)	۱.۸	۱.۰۰	۱۴,۶۰۳	۳۴%
ضموج ۱۰۱۵	موج	۲۰,۰۰۰	۵	۲۵.۶	۲,۰۶۱	۲۲,۵۹۹	۲۲,۰۶۱	(۲.۴%)	۱۰.۷	۰.۹۹	۲,۷۰۷	۳۱%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۱۷	۲۵۶.۳	۱,۰۶۶	۶,۲۴۰	۶,۴۷۹	۳.۸%	۶.۱	۰.۹۷	۱,۳۴۶	۲۶%

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
ضدوب ۱۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۱۵	۲.۲	۲	۵۳۹	۱,۰۰۲	۸۶%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۳	۱۳.۹	۱۰	۵۳۹	۱,۰۱۰	۸۷%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۳	۴.۱	۱۰	۵۳۹	۹۱۰	۶۹%	۹۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۵	۱۰.۳	۱۹۷	۲۵,۶۳۰	۳۴,۱۹۷	۳۳%	۱۷۳.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۴۳	۴۴.۵	۲۰	۵۳۹	۸۲۰	۵۲%	۴۱.۰	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 ۱۰۱۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۵	۲.۵	۴,۰۸۳	۲۵,۶۳۰	۲۵,۹۱۷	۱.۱%	۶.۳	-۰.۹۷	۳,۹۵۶	(۳.۱%)
طهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۵	۶۲۲.۹	۲,۴۳۹	۲۵,۶۳۰	۲۵,۵۶۱	(۰.۳%)	۱۰.۵	-۰.۸۳	۲,۱۳۱	(۱۲.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۳	۹۷.۶	۴,۳۹۷	۲۵,۶۳۰	۲۵,۶۰۳	(۰.۱%)	۵.۸	-۰.۸۲	۳,۵۱۸	(۲۰.۰%)
طهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۱۵	۳,۶۰۴.۵	۹۹۶	۲۵,۶۳۰	۲۵,۰۰۴	(۲.۴%)	۲۵.۱	-۰.۴۸	۷۵۷	(۲۴.۰%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۴۳	۶۴۷.۸	۳,۱۹۹	۲۵,۶۳۰	۲۴,۸۰۱	(۳.۲%)	۷.۸	-۰.۶۴	۲,۰۲۹	(۳۶.۶%)

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
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۵	۱۶.۷	۱۳	۲۵,۶۳۰	۱۳,۹۸۷	(۴۵.۴%)	۱,۰۷۵.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۲۹	۵.۶	۴	۱,۴۰۷	۸۴۶	(۳۹.۹%)	۲۱۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۶	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۵	۱۸.۸	۲۱	۲۵,۶۳۰	۱۵,۹۷۹	(۳۷.۷%)	۷۶۰.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۲۹	۴.۶	۵	۱,۴۰۷	۹۴۵	(۳۲.۸%)	۱۸۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۵	۷۹.۲	۴۷	۲۵,۶۳۰	۱۷,۹۵۳	(۳۰.۰%)	۳۸۲.۰	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

ارزش موقعیت‌های باز

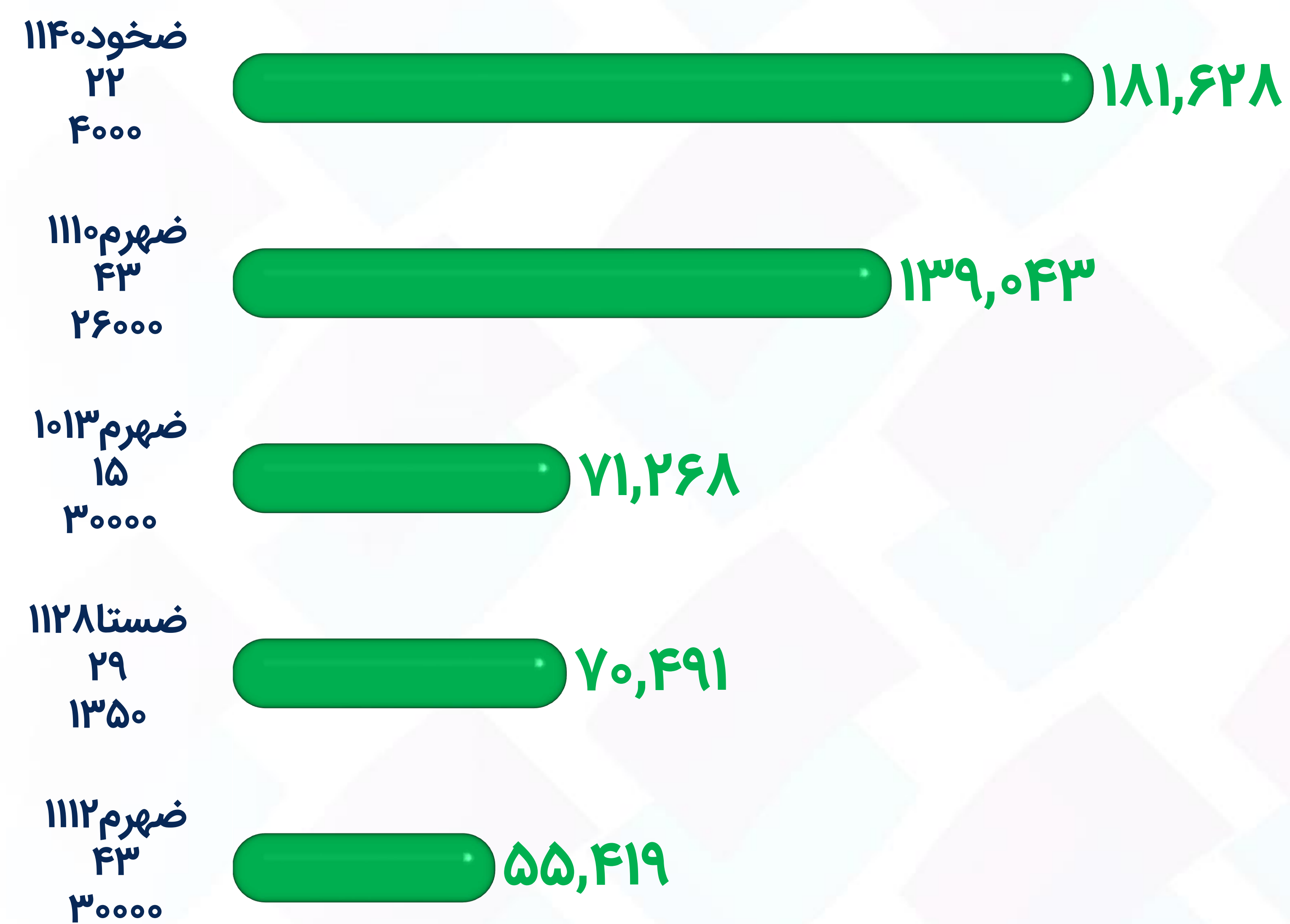
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

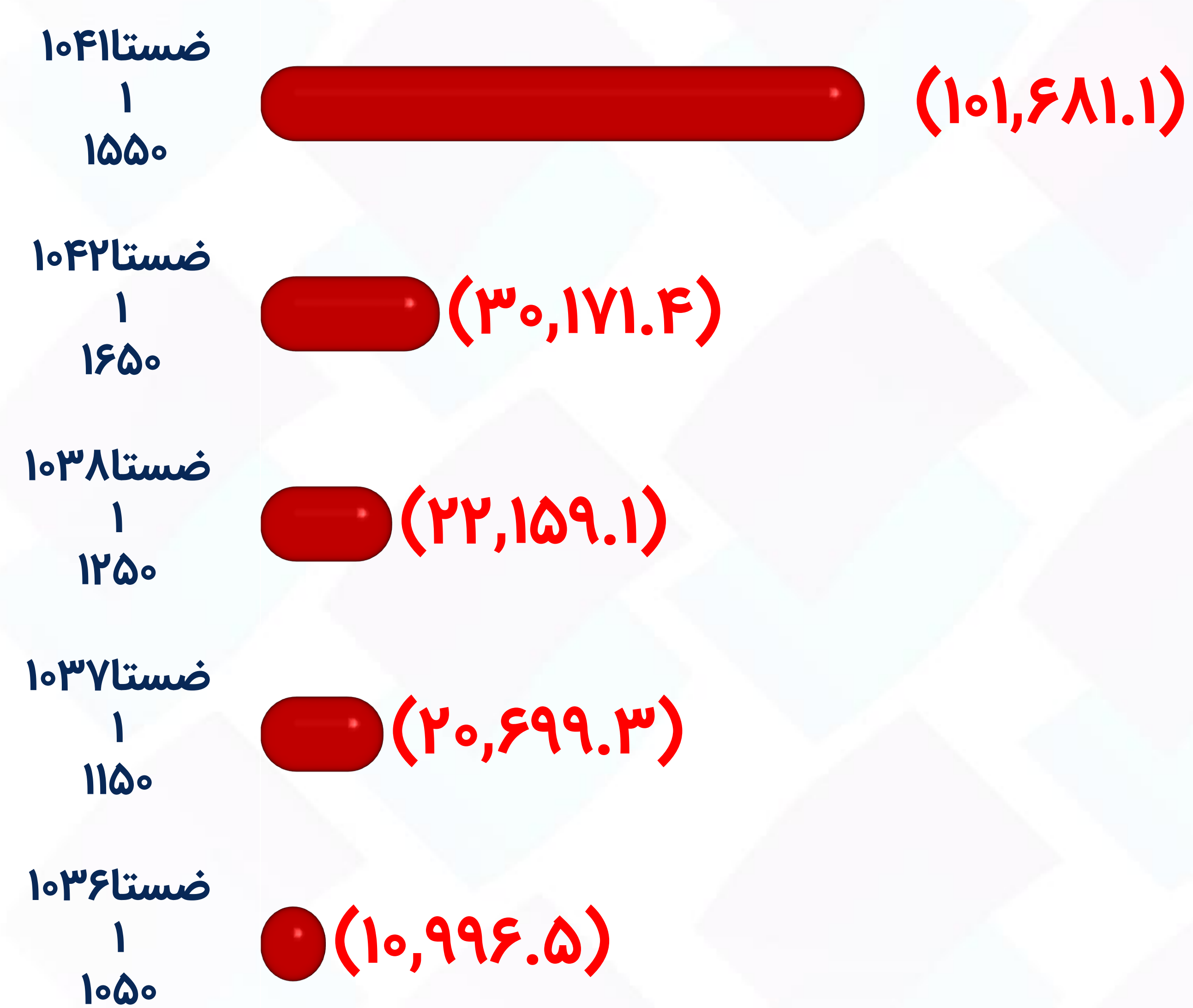
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

طهرم ۱۵ ۱۰۰۹ ۲۲۰۰۰ ۸۰۳

طهرم ۱۵ ۱۰۱۰ ۲۴۰۰۰ ۵۸۸

طهرم ۱۵ ۱۰۰۸ ۲۰۰۰۰ ۵۰۶

طخود ۲۲ ۱۱۳۷ ۳۲۵۰ ۴۹۸

طهرم ۱۵ ۱۰۰۶ ۱۶۰۰۰ ۳۶۹

طهرم ۱۵ ۱۰۰۷ ۱۸۰۰۰ ۳۵۵

طهرم ۴۳ ۱۱۱۰ ۲۶۰۰۰ ۲۷۱

طخود ۲۲ ۱۱۳۵ ۲۸۰۰ ۲۵۲

طهرم ۱۵ ۱۰۱۱ ۲۶۰۰۰ ۲۰۰

طخود ۲۲ ۱۱۳۶ ۳۰۰۰ ۱۶۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

طهرم ۱۵ ۱۰۰۸ ۲۰۰۰۰ ۳۸,۰۲۸.۰

طهرم ۱۵ ۱۰۰۹ ۲۲۰۰۰ ۲۴,۱۳۸.۴

طهرم ۴۳ ۱۱۱۰ ۲۶۰۰۰ ۲۰,۶۷۷.۸

طهرم ۱۵ ۱۰۰۷ ۱۸۰۰۰ ۱۵,۴۵۴.۸

طخود ۲۲ ۱۱۳۸ ۳۵۰۰ ۸,۲۳۷.۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

طخود ۲۲ ۱۱۳۷ ۳۲۵۰ (۶۰,۴۴۸.۴)

طهرم ۱۵ ۱۰۱۰ ۲۴۰۰۰ (۳۴,۳۹۲.۰)

طخود ۲۲ ۱۱۳۵ ۲۸۰۰ (۳۳,۲۰۵...)

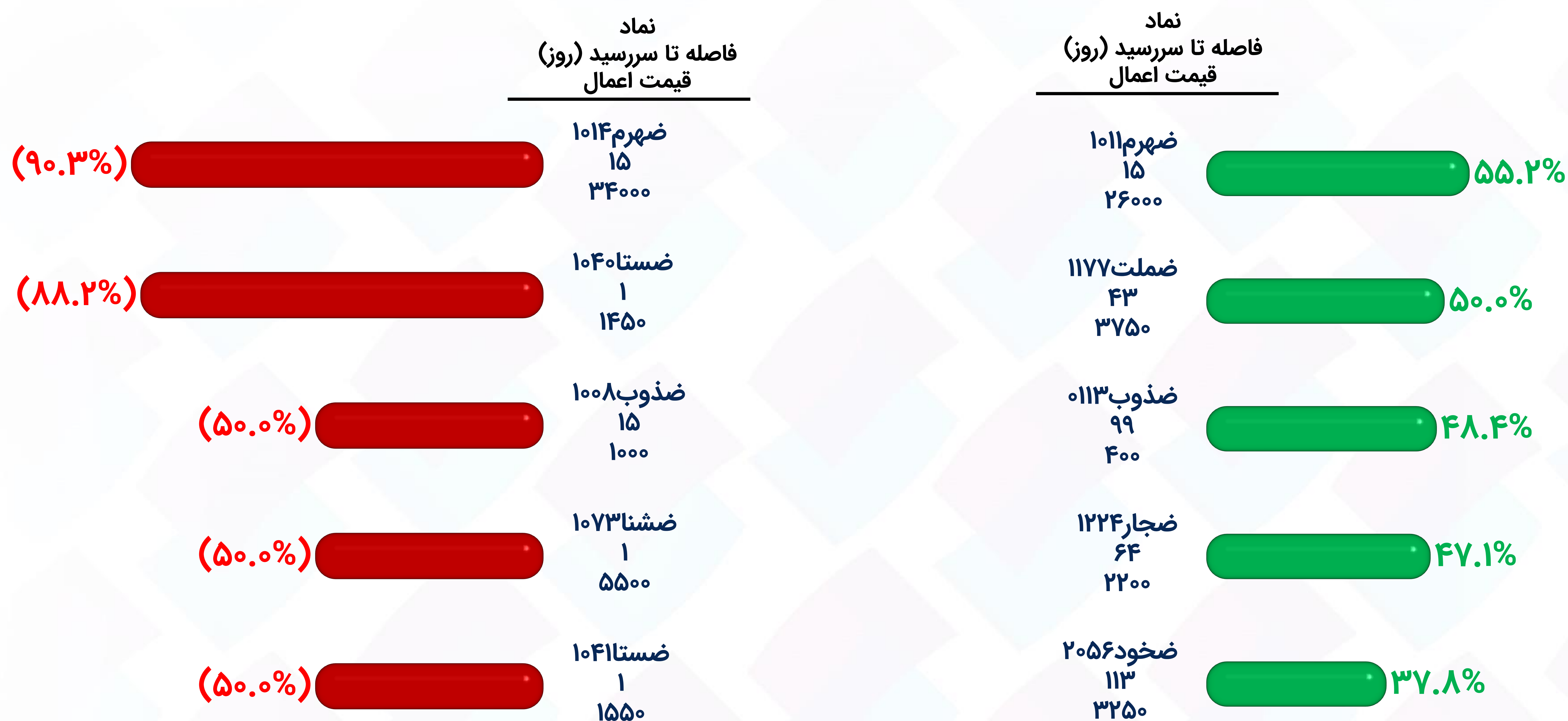
طستا ۱ ۱۰۴۰ ۱۴۵۰ (۲۹,۶۸۷.۳)

طهرم ۱۵ ۱۰۰۴ ۱۴۰۰ (۱۴,۲۴۵.۰)

میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

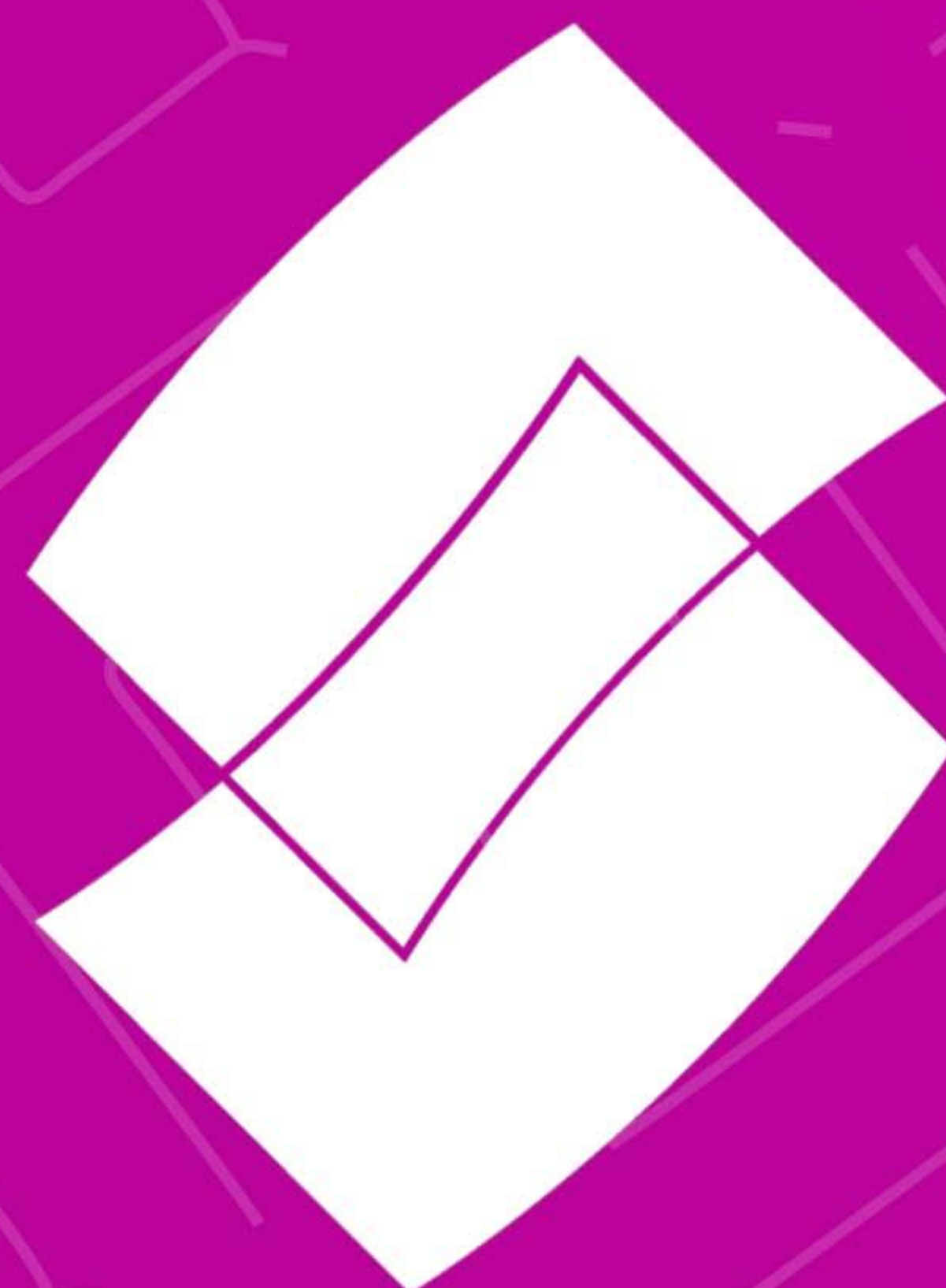
اختیار خرید



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.