

شماره
۳۹۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۲ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

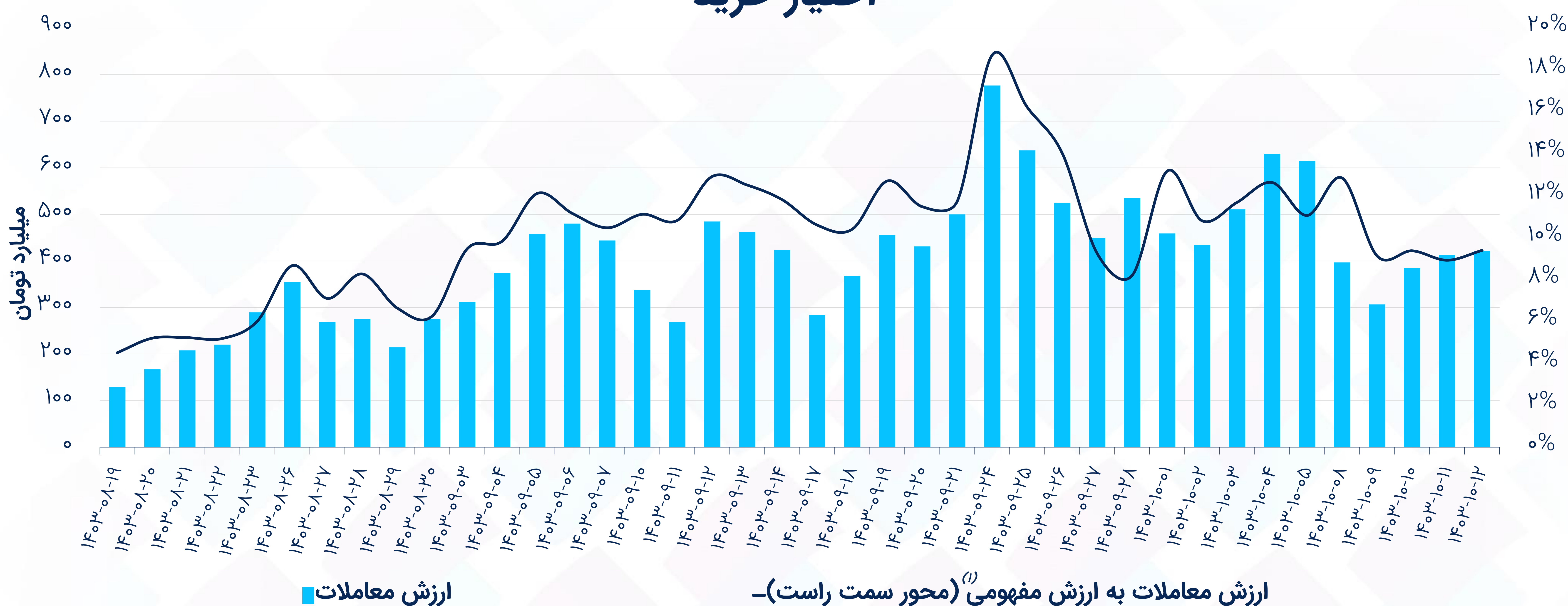




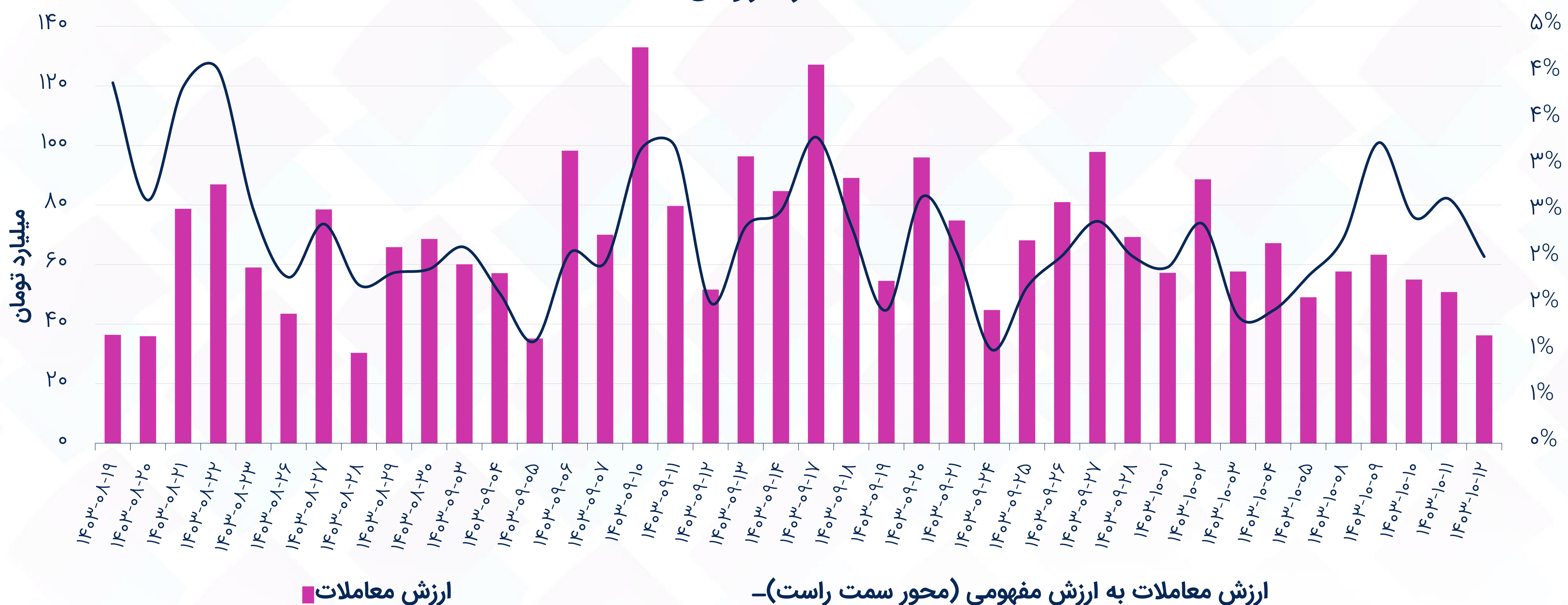
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



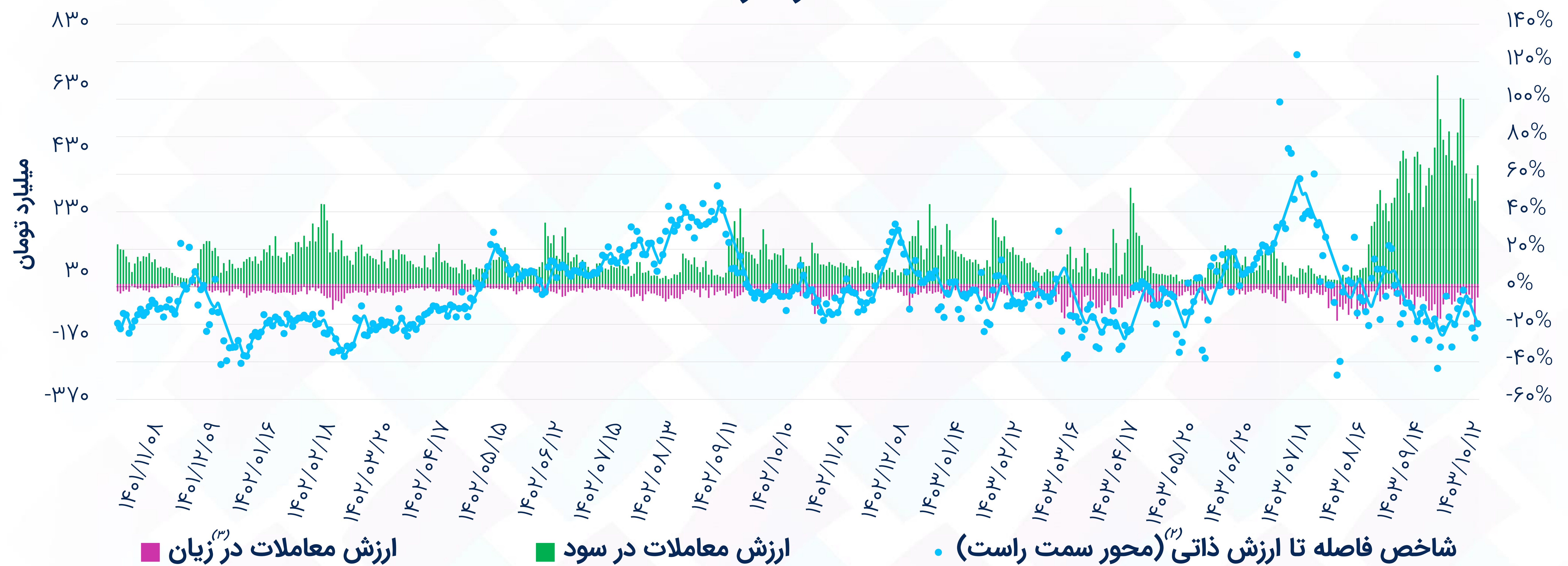
اختیار فروش



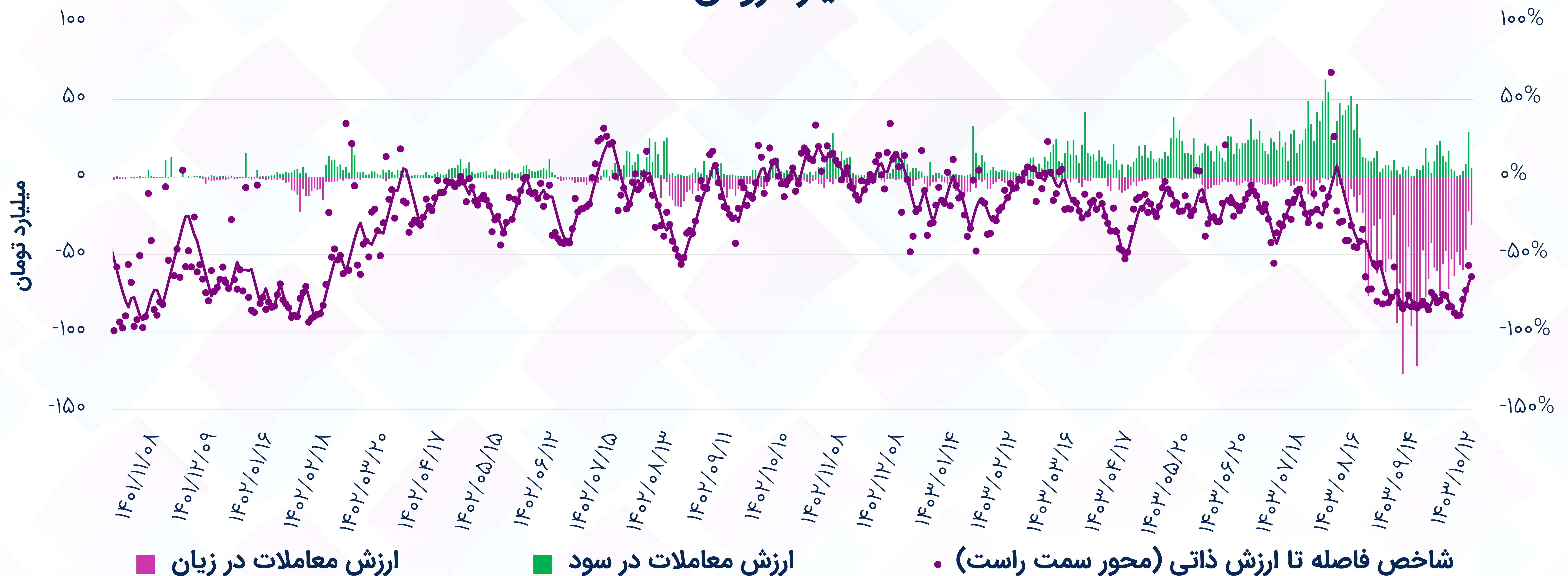
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

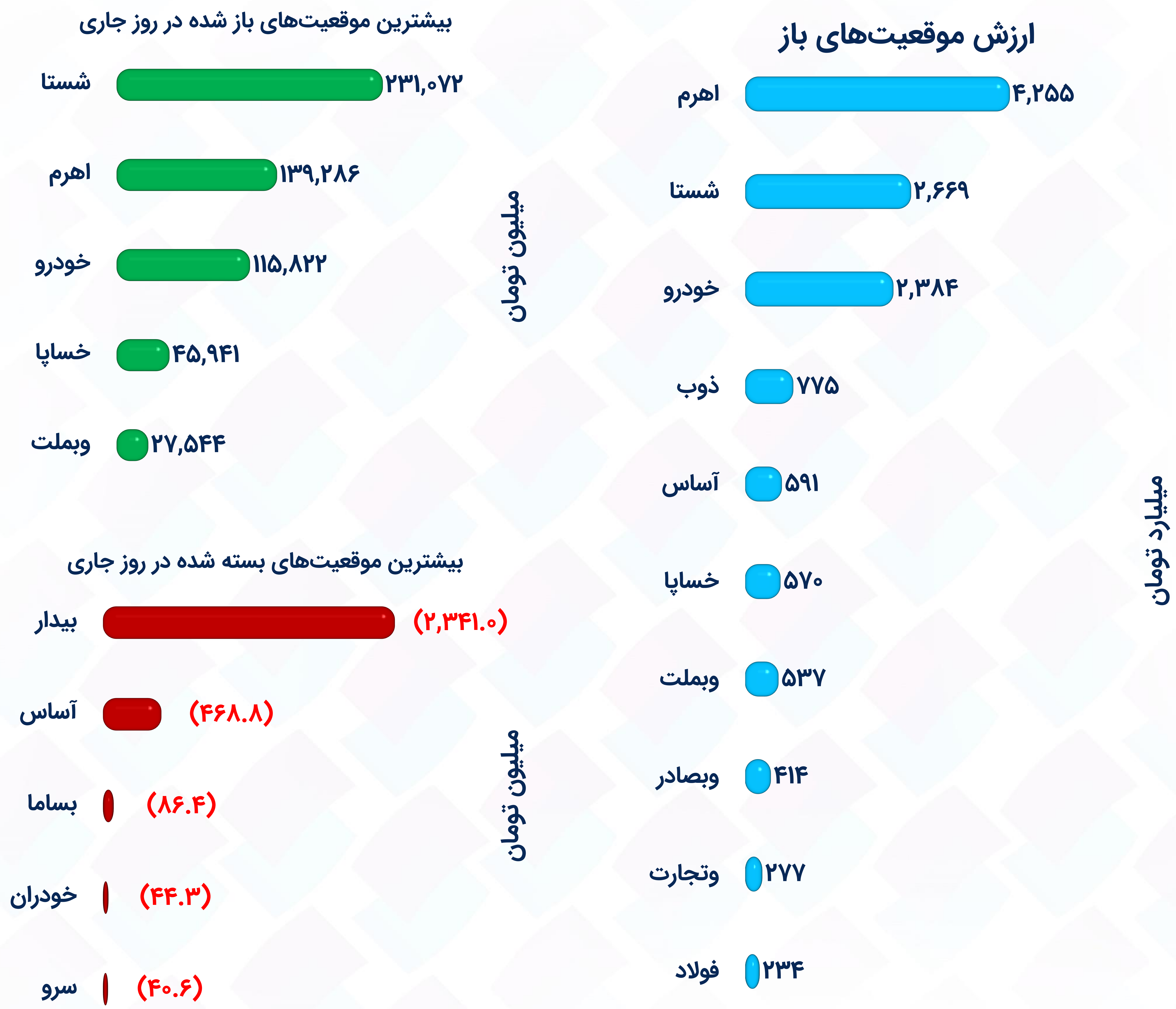
اختیار خرید

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	۱۲۶.۹	۱,۲۴۷.۰	۱۲۰.۹	۶.۱	(۳۹.۳%)
خودرو	۲۶	۱۱۹.۶	۱,۲۲۳.۸	۹۹.۳	۲۰.۲	(۲۱.۴%)
شستا	۴۰	۱۰۰.۸	۱,۴۸۰.۶	۹۰.۲	۱۰.۷	(۲.۳%)
ذوب	۲۰	۱۳.۱	۵۶.۳	۱۲.۳	۰.۸	(۹.۴%)
شپنا	۱۲	۱۱.۱	۱۱۱.۴	۱۰.۹	۰.۳	۲۷.۵%
شتاب	۱۷	۱۰.۸	۳۰.۵	۱۰.۸	۰.۰	۲.۱%
جهش	۱۸	۱۰.۳	۳۹.۴	۱۰.۳	۰.۰	(۱.۷%)

اختیار فروش

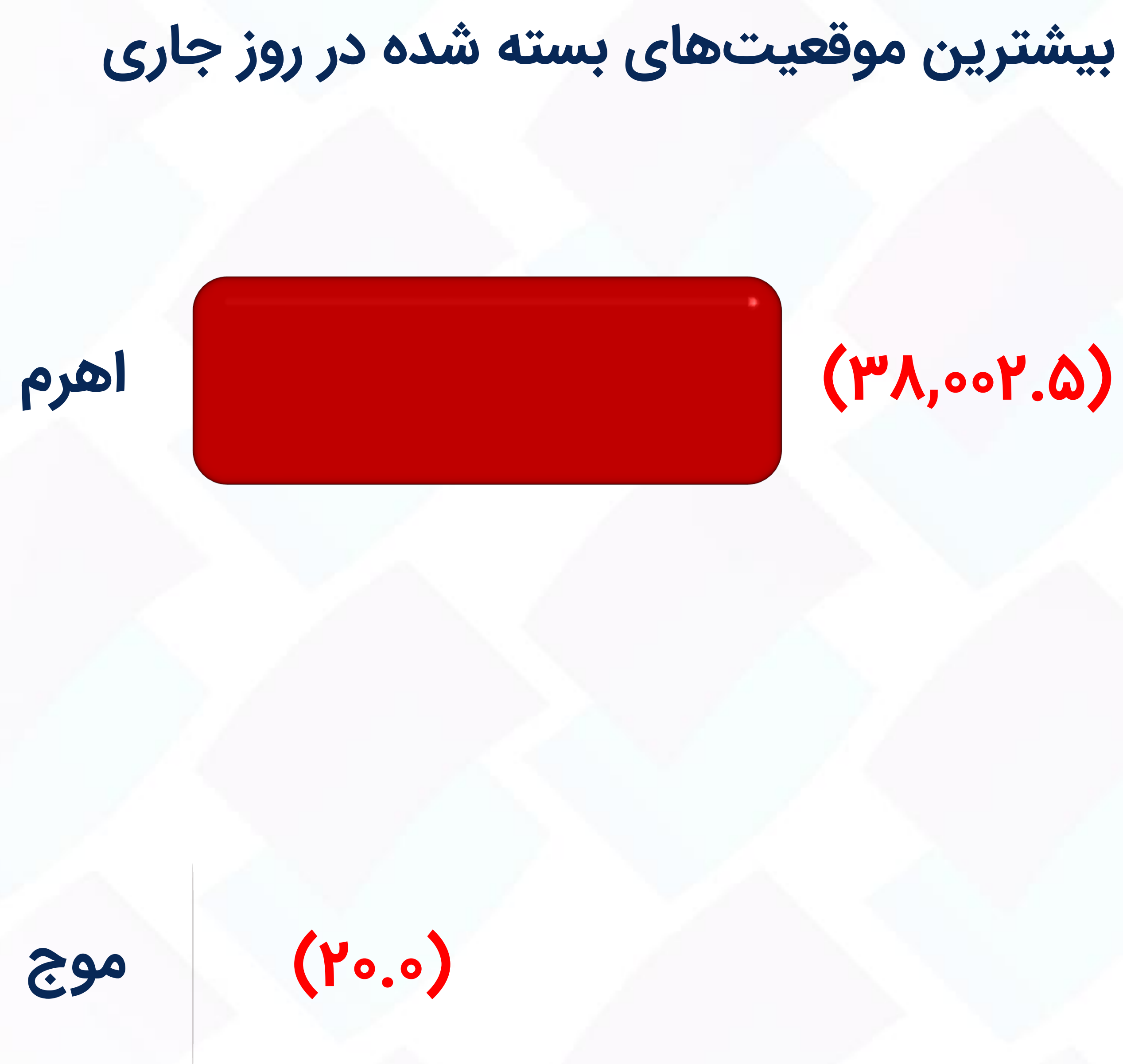
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۱۶	۱۶,۸۰۸.۶	۱,۰۱۹,۸۹۸.۴	۶۸۳.۴	۱۶,۱۲۵.۲	(۶۱.۲%)
خودرو	۶	۱۴,۵۰۹.۶	۵۵۹,۳۵۱.۵	۹۲۰.۳	۱۳,۵۸۹.۲	(۷۸.۳%)
شستا	۲۰	۴,۷۳۴.۴	۲۱۳,۷۲۵.۲	۴,۰۴۷.۶	۶۸۶.۹	(۳۰.۴%)
وبملت	۱	۹۰.۷	۲,۸۷۳.۷	۰.۰	۹۰.۷	(۸۱.۲%)
ذوب	۴	۷۸.۰	۱,۶۴۸.۴	۱۰.۶	۶۷.۴	(۸۳.۲%)
رویین	۲	۱۳.۶	۹۳۸.۹	۰.۰	۱۳.۶	(۹۶.۱%)
توان	۲	۴.۷	۶۶.۲	۰.۰	۴.۷	(۶۲.۵%)

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



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 ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۱۶	۱۶۷.۲	۱,۱۰۳	۶,۲۷۰	۶,۵۱۶	۳.۹%	۵.۹	۰.۹۷	۱,۳۶۰	۲۳%
ضاساس ۱۰۰۵	آساس	۴۵,۰۰۰	۱۸	۵۵.۴	۳,۲۳۷	۴۸,۰۶۳	۴۸,۲۳۷	۰.۴%	۱۴.۹	۰.۹۵	۳,۸۱۷	۱۸%
ضفرز ۱۲۰۵	فرز	۳۸,۰۰۰	۶۰	۹۵.۲	۱,۹۱۶	۳۶,۸۰۰	۳۹,۹۱۶	۸.۵%	۲۰.۸	۰.۵۹	۲,۲۲۴	۱۶%
ضبساما ۲۱۶	بساما	۵,۸۲۹	۱۱۶	۴۶.۲	۸۸۷	۶,۲۷۰	۶,۷۱۶	۷.۱%	۷.۶	۰.۹۱	۱,۰۱۱	۱۴%
ضشنا ۱۲۱۶	شنا	۳,۲۵۰	۵۶	۵۹.۲	۱,۸۱۷	۵,۱۵۰	۵,۰۶۷	(۱.۶%)	۲.۸	۱.۰۰	۲,۰۵۷	۱۳%

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	۱۴	۱.۷	۱	۵۵۰	۱,۰۰۱	۸۲%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۲	۱۱.۳	۱۰	۵۵۰	۱,۰۱۰	۸۴%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۲	۲۰.۴	۱۲	۵۵۰	۹۱۲	۶۶%	۷۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴	۷.۵	۹۹	۲۶,۰۵۰	۳۴,۰۹۹	۳۱%	۳۴۴.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۴۲	۵۶.۵	۱۹	۵۵۰	۸۱۹	۴۹%	۴۳.۱	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	۱۴	۶۴۸.۳	۲,۰۴۹	۲۶,۰۵۰	۲۵,۹۵۱	(۰.۴%)	۱۲.۷	-۰.۷۹	۱,۸۰۲	(۱۲.۰%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۲	۳۱.۰	۴,۰۸۴	۲۶,۰۵۰	۲۵,۹۱۶	(۰.۵%)	۶.۳	-۰.۷۹	۳,۲۱۱	(۲۱.۴%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۴۲	۴.۱	۲,۷۰۰	۲۶,۰۵۰	۲۵,۳۰۰	(۲.۹%)	۹.۴	-۰.۶۰	۱,۷۸۳	(۳۳.۹%)
طهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۱۴	۲,۲۷۲.۱	۸۹۶	۲۶,۰۵۰	۲۵,۱۰۴	(۳.۶%)	۲۸.۰	-۰.۴۰	۵۵۴	(۳۸.۱%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۲۱	۹۲۰.۳	۳۲۷	۳,۶۱۹	۳,۴۲۳	(۵.۴%)	۱۰.۵	-۰.۵۶	۱۴۹	(۵۴.۴%)

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 ۱۱۲۰	شستا	۵۵۰	۲۸	۱.۳	۲	۱,۴۰۶	۵۴۸	(۶۱.۰%)	۲۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۴	۹.۱	۱۱	۲۶,۰۵۰	۱۳,۹۸۹	(۴۶.۳%)	۱,۲۷۱.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۴	۱.۵	۱۸	۲۶,۰۵۰	۱۴,۹۸۲	(۴۲.۵%)	۸۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۲۸	۱۱.۴	۴	۱,۴۰۶	۸۴۶	(۳۹.۸%)	۲۱۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۶	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۴	۳۹.۵	۲۷	۲۶,۰۵۰	۱۵,۹۷۳	(۳۸.۷%)	۵۹۱.۶	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

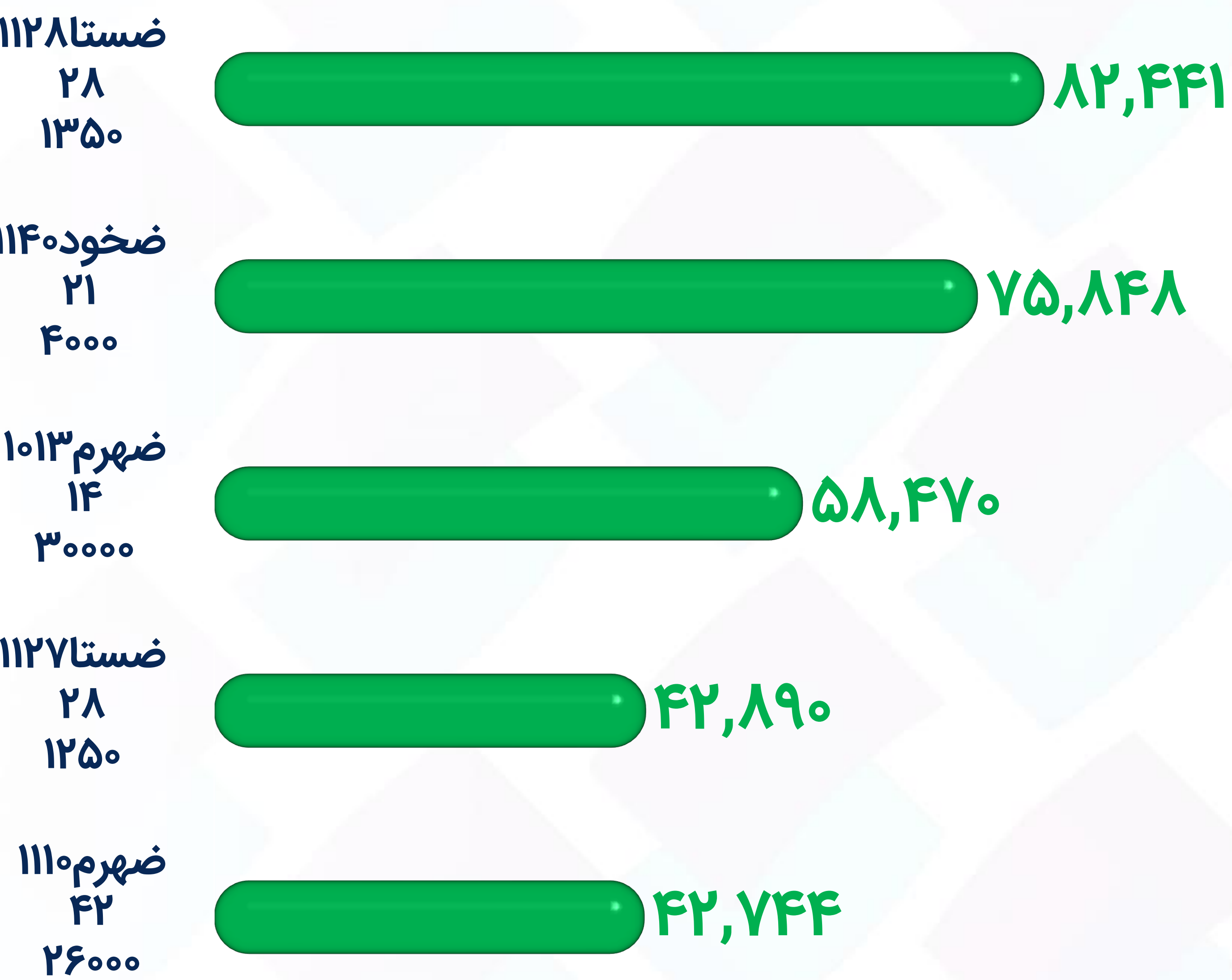
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

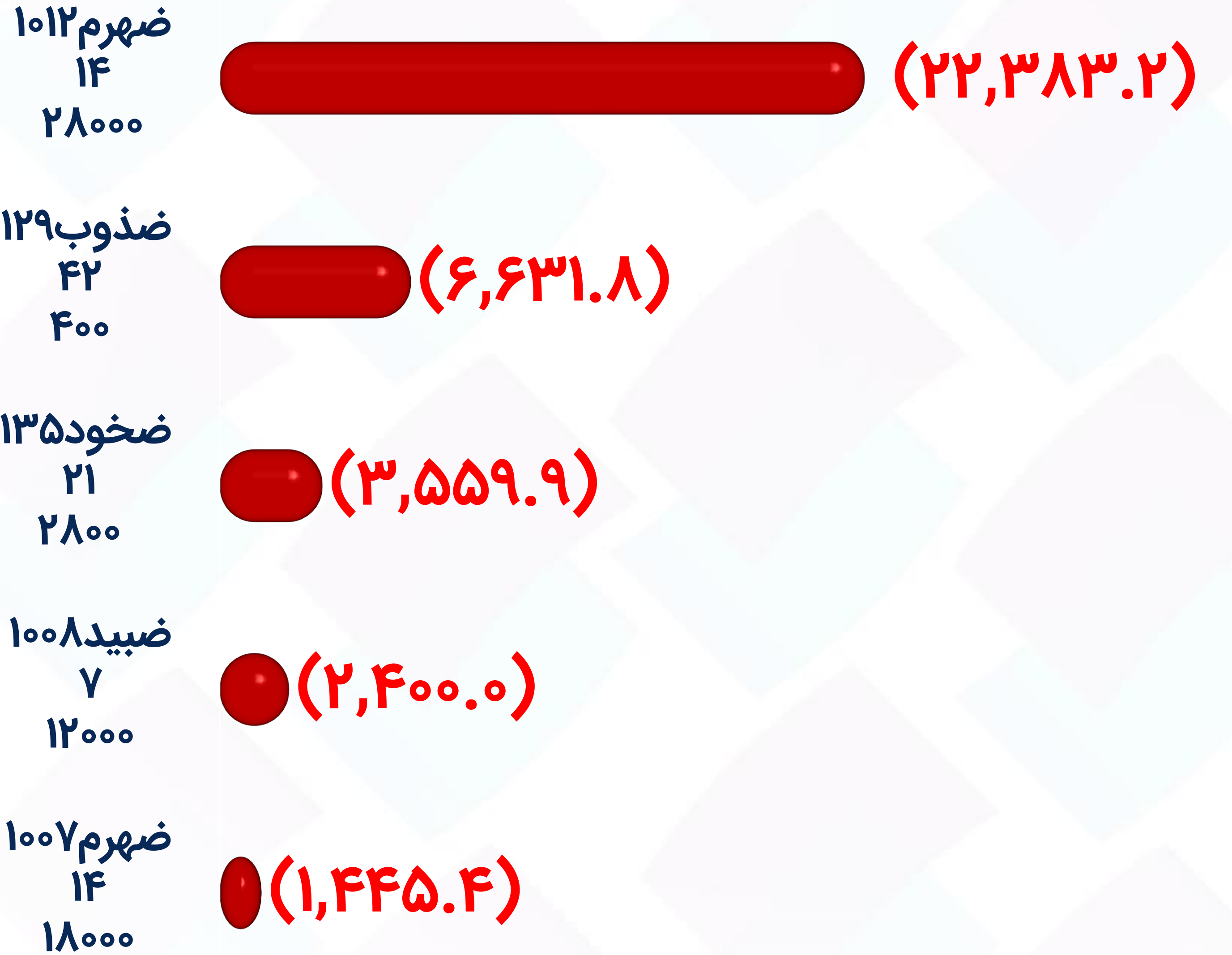
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

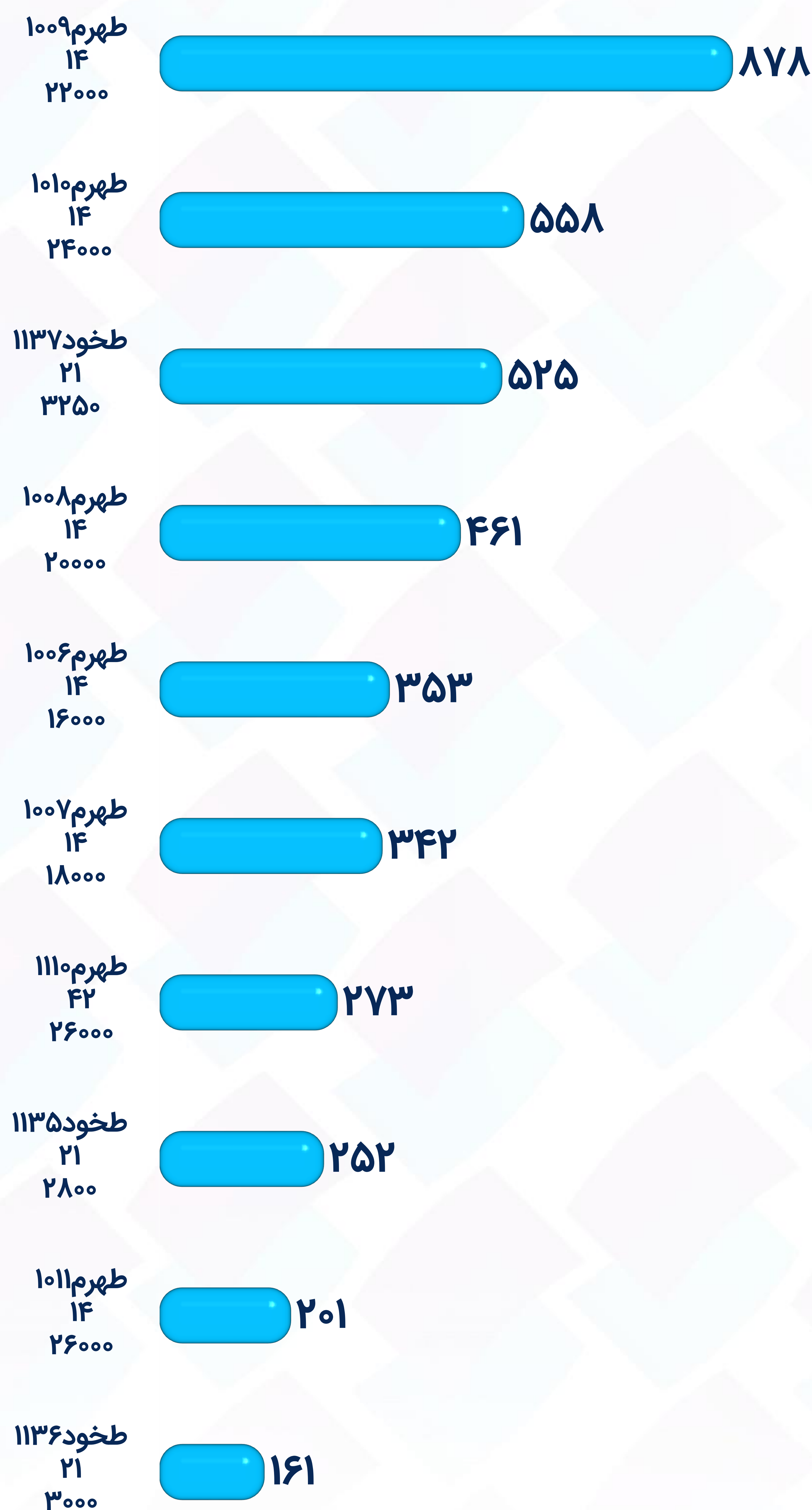


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

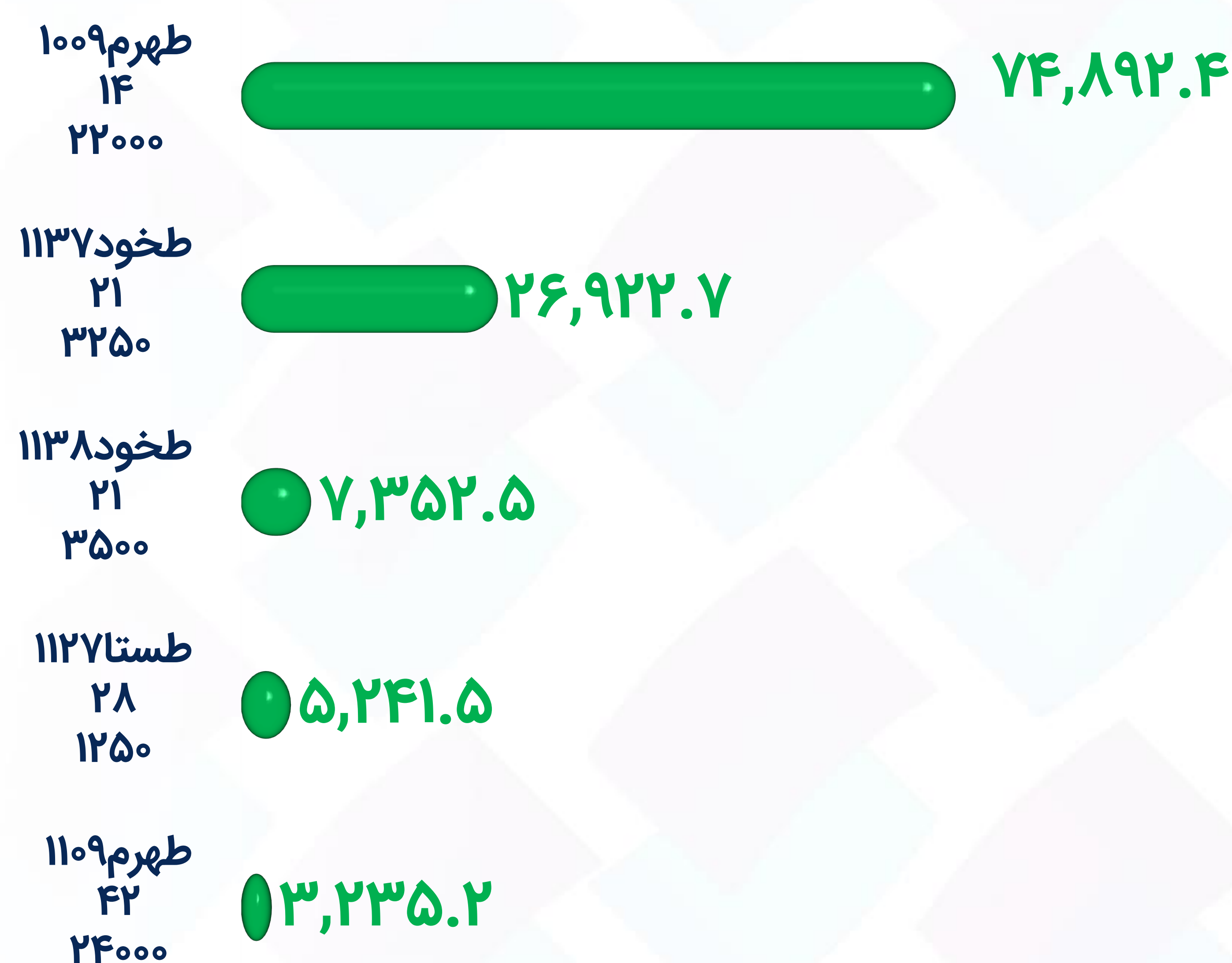
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)



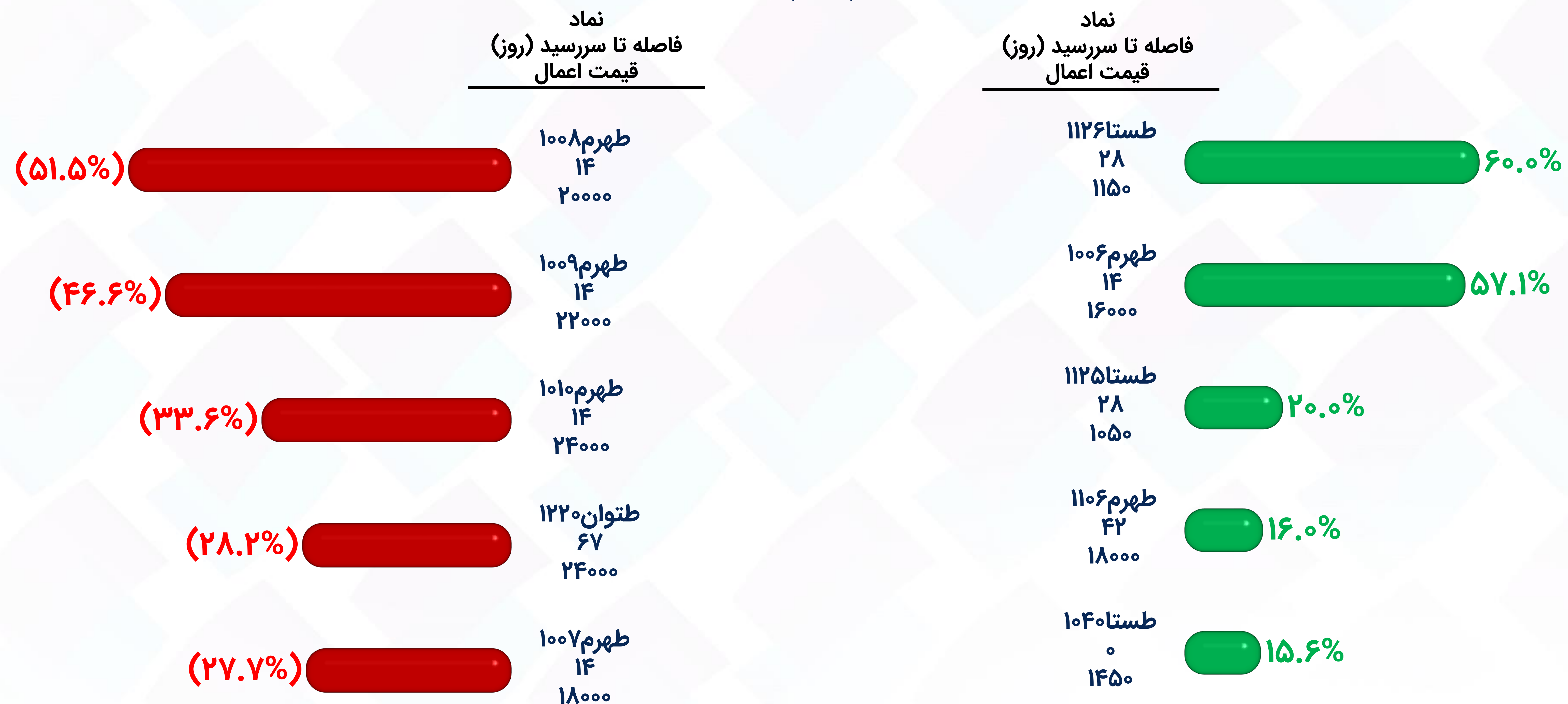
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

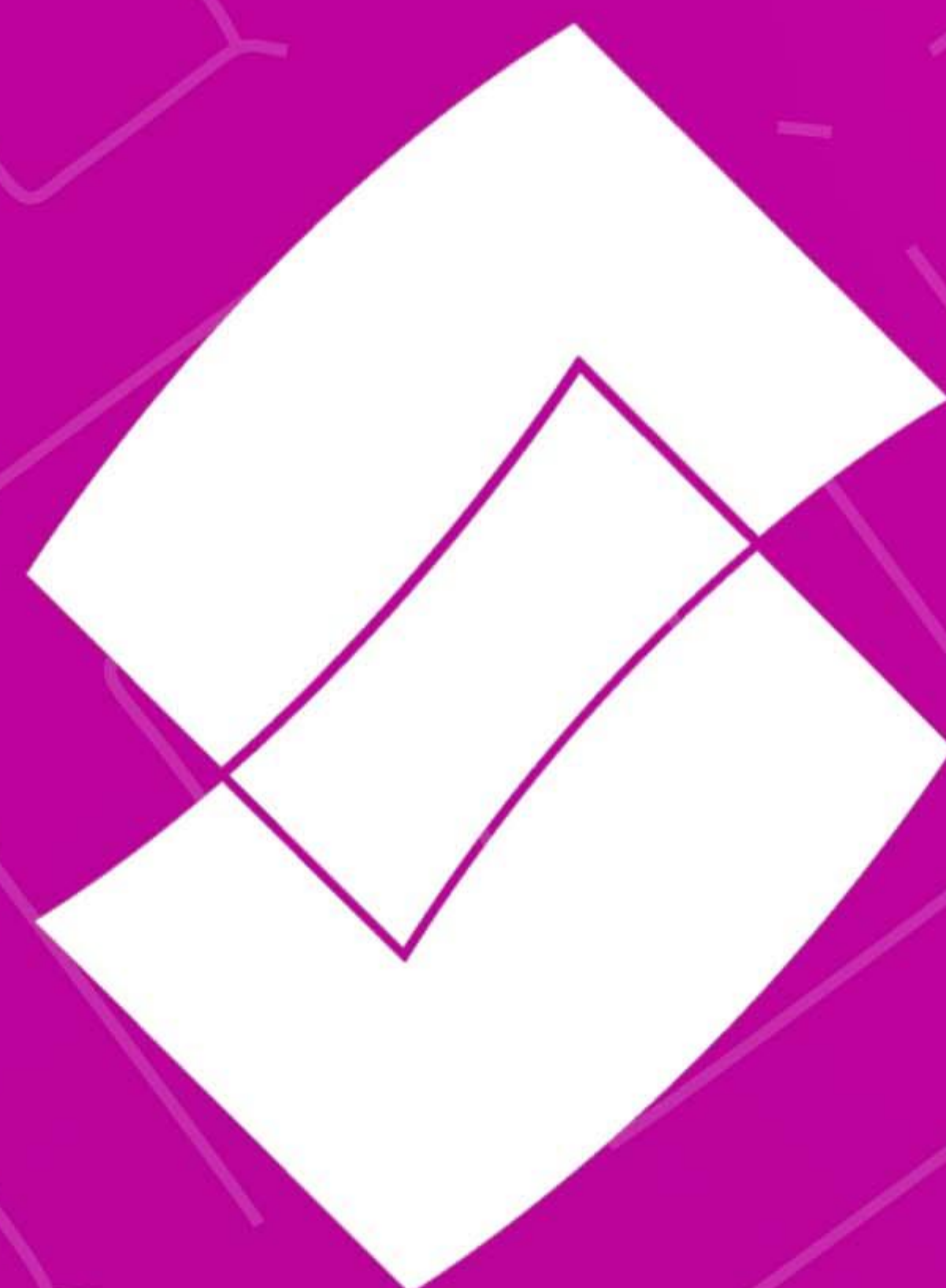
اختیار خرید



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.