

شماره
۴۰۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۵ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





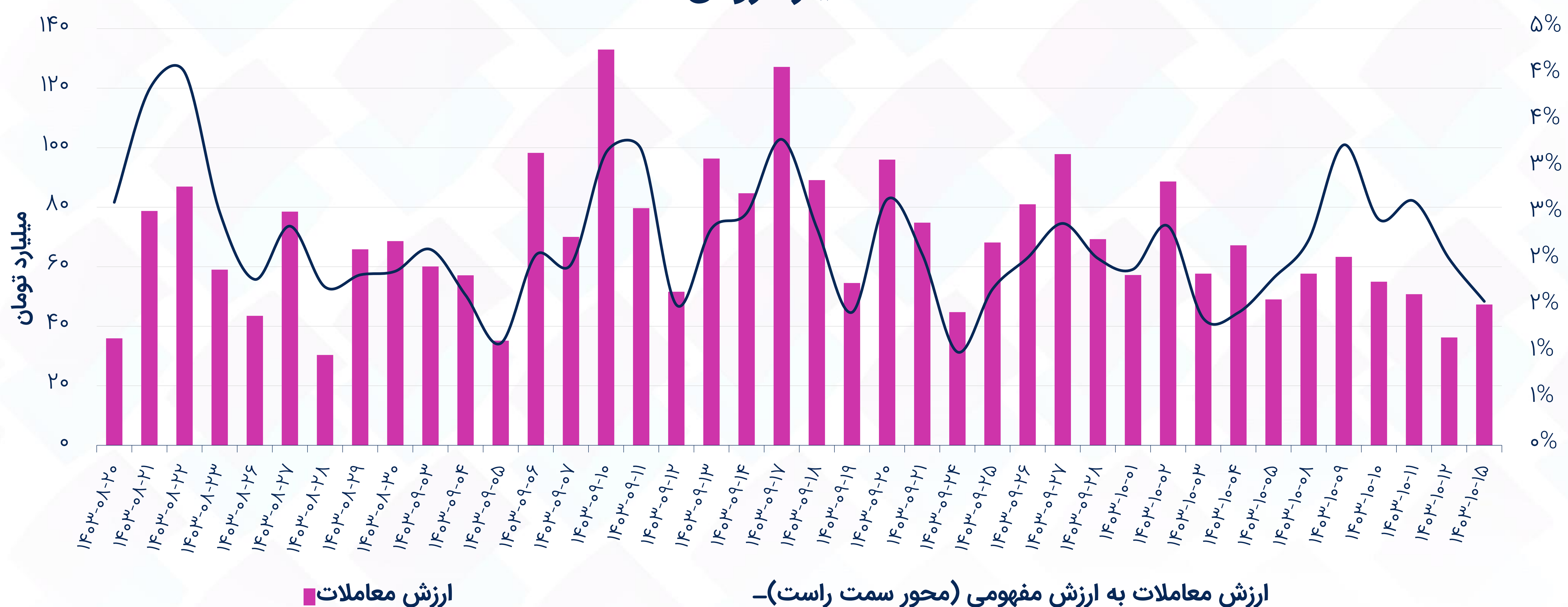
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



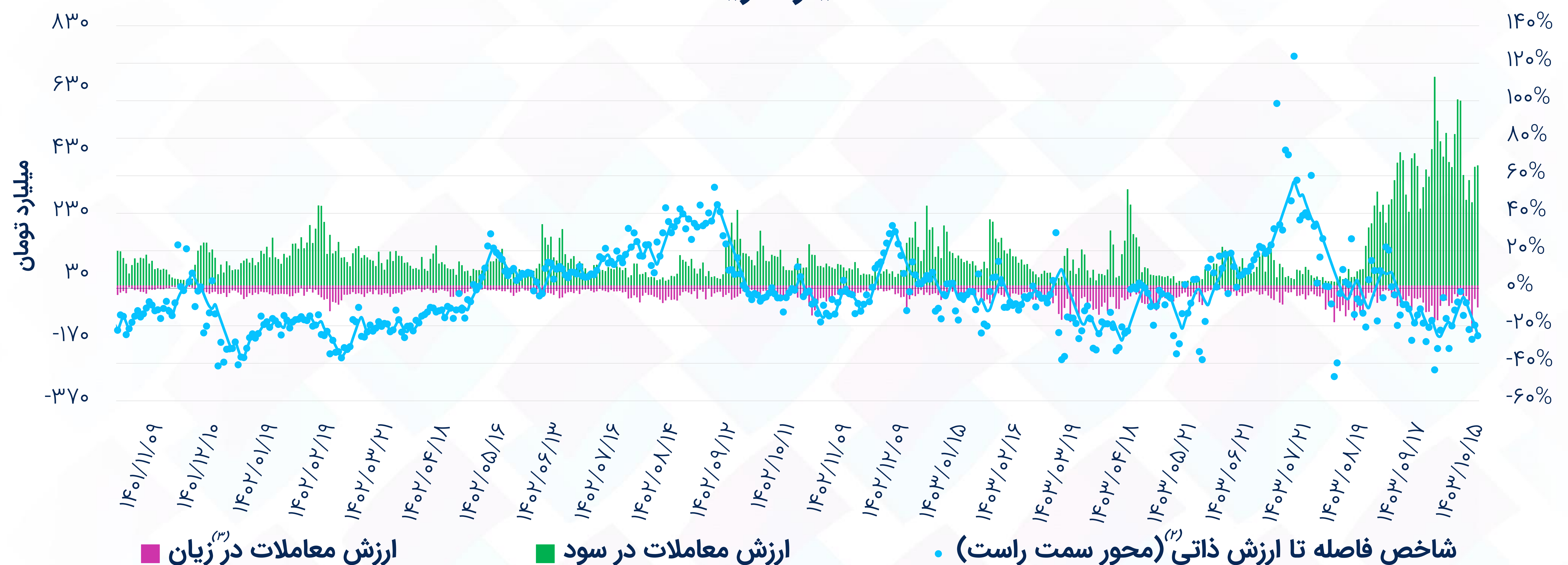
اختیار فروش



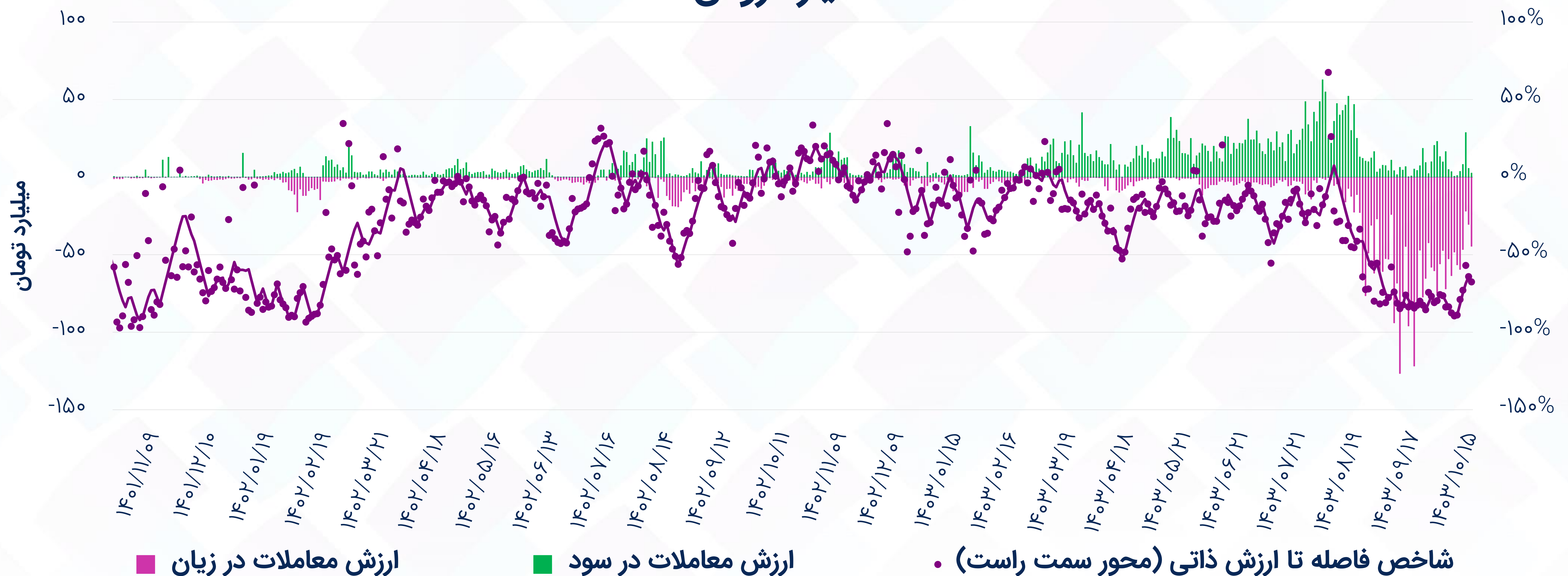
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

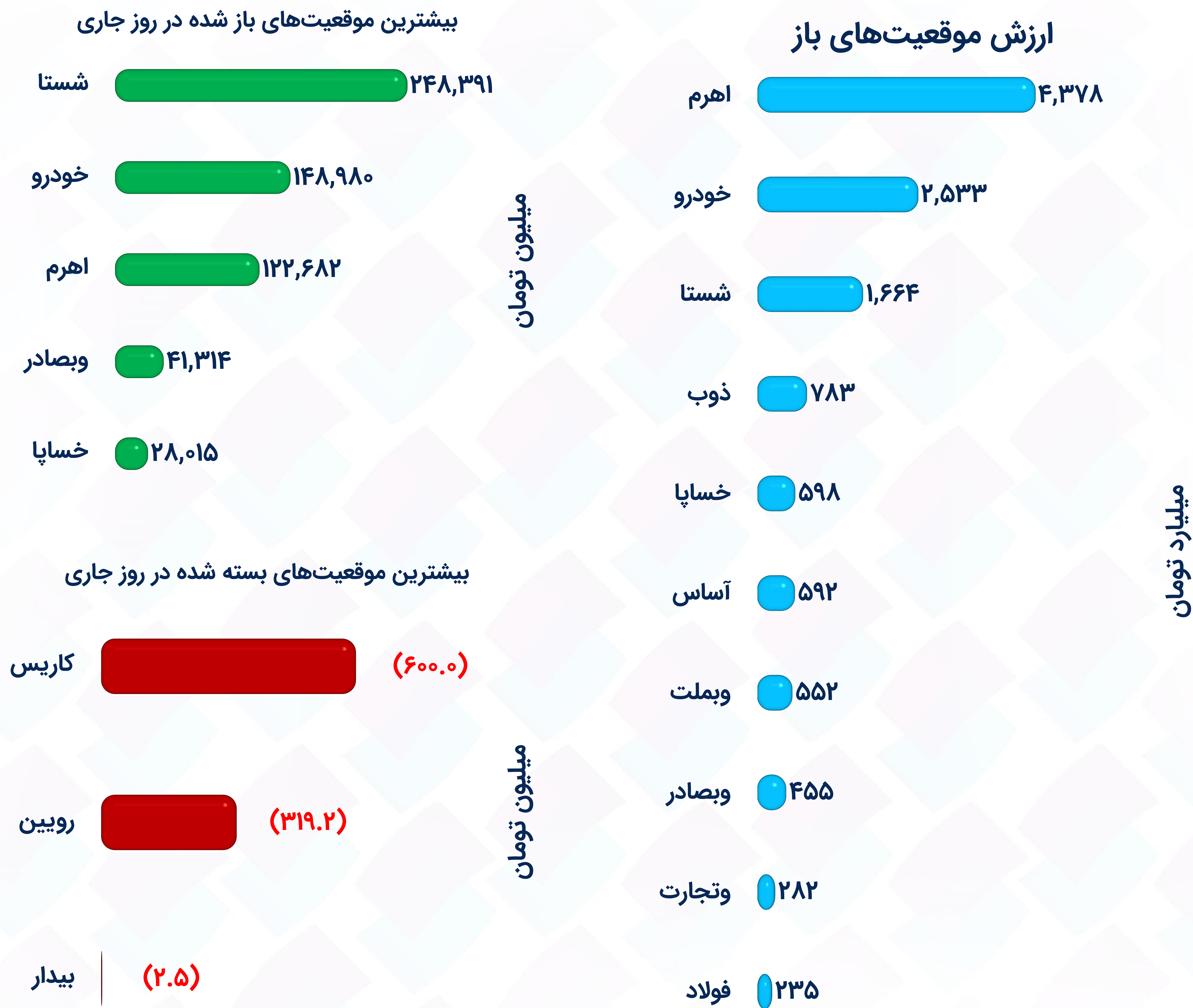
اختیار خرید

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	۴۰	۱۵۸.۱	۱,۱۵۳.۶	۱۴۶.۳	۱۱.۷	(۳۴.۲%)
خودرو	۲۹	۱۴۰.۸	۱,۴۱۱.۹	۱۱۴.۳	۲۶.۵	(۱۷.۶%)
شستا	۳۰	۶۶.۷	۶۱۹.۳	۴۴.۶	۲۲.۰	(۳۵.۷%)
آساس	۱۰	۲۸.۶	۷۹.۳	۲۸.۴	۰.۲	(۰.۱%)
ذوب	۲۱	۱۵.۷	۷۱.۰	۱۴.۴	۱.۳	(۱۰.۹%)
وبملت	۱۳	۱۰.۸	۵۵.۱	۱۰.۲	۰.۶	(۲۱.۷%)
وبصادر	۹	۶.۶	۹۲.۷	۲.۶	۴.۰	(۴۸.۶%)

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	۱۹	۳۱,۱۲۸.۳	۲,۱۲۲,۵۳۲.۱	۸۷۱.۲	۳۰,۲۵۷.۰	(۵۹.۳%)
خودرو	۸	۱۴,۸۷۱.۹	۸۲۹,۳۹۷.۷	۱,۷۱۵.۹	۱۳,۱۵۶.۱	(۸۲.۸%)
شستا	۱۷	۸۷۰.۰	۷۲,۷۹۳.۵	۴۴.۸	۸۲۵.۲	(۹۲.۴%)
رویین	۱	۲۲۶.۵	۴,۰۳۰.۹	۰.۰	۲۲۶.۵	(۹۷.۱%)
وبملت	۲	۱۱۹.۰	۵,۴۲۸.۶	۰.۰	۱۱۹.۰	(۸۶.۸%)
ذوب	۴	۵۱.۱	۱,۹۱۰.۲	۱۷.۶	۳۳.۵	(۸۲.۸%)
اطلس	۱	۲۲.۰	۶۰۷.۷	۰.۰	۲۲.۰	(۶۸.۴%)

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

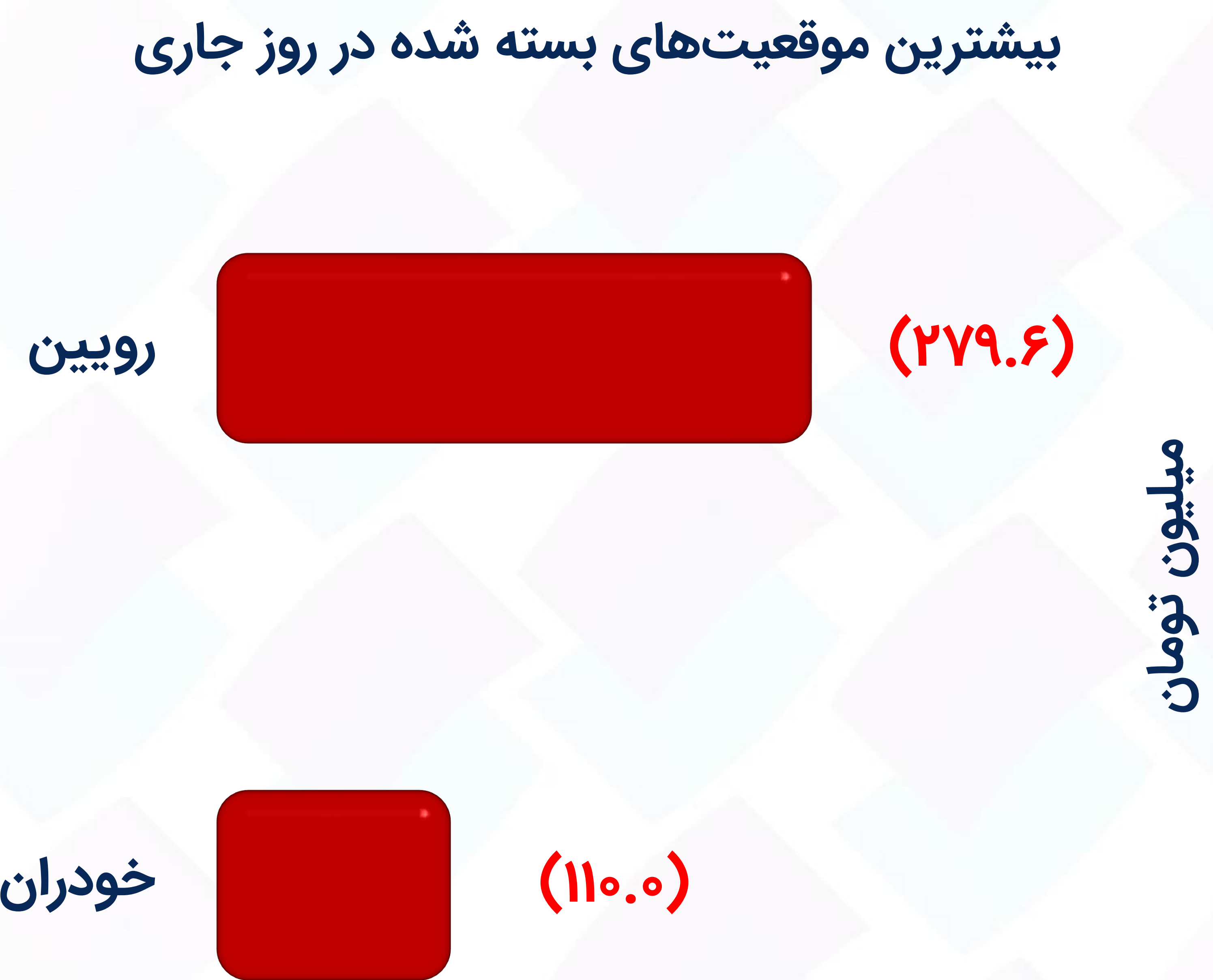


(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

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
ضخود ۲۰۵۶	خودرو	۳,۲۵۰	۱۰۹	۱۸.۲	۱۸۲	۳,۷۰۷	۳,۴۳۲	(۷.۴%)	۱۸.۹	۰.۹۲	۷۷۴	۳۲۵%
ضهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۰۲	۶.۳	۷,۰۰۰	۲۶,۸۳۰	۲۷,۰۰۰	۰.۶%	۳.۹	۰.۹۹	۸,۵۱۹	۲۲%
ضبساما ۲۱۶	بساما	۵,۸۲۹	۱۱۳	۳۷۳.۱	۹۳۳	۶,۳۱۰	۶,۷۶۲	۷.۲%	۷.۲	۰.۹۲	۱,۰۴۹	۱۲%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۱۳	۳۹.۴	۱,۲۶۱	۶,۳۱۰	۶,۶۷۴	۵.۸%	۵.۳	۰.۹۷	۱,۴۰۲	۱۱%
ضرویین ۱۰۰۲	رویین	۹,۰۰۰	۱۵	۶۹.۲	۴,۰۰۰	۱۳,۲۷۹	۱۳,۰۰۰	(۲.۱%)	۳.۳	۱.۰۰	۴,۴۱۰	۱۰%

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	۱۱	۲.۳	۲	۵۶۶	۱,۰۰۲	۷۷%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۳۹	۲۲.۷	۹	۵۶۶	۱,۰۰۹	۷۸%	۱۱۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۳۹	۸.۹	۱۲	۵۶۶	۹۱۲	۶۱%	۷۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۱	۲۳.۹	۶۵	۲۶,۸۳۰	۳۴,۰۶۵	۲۷%	۵۲۴.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۳۹	۴۷.۸	۱۸	۵۶۶	۸۱۸	۴۵%	۴۵.۴	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 ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۱	۵.۱	۴,۲۵۷	۲۶,۸۳۰	۲۹,۷۴۳	۱۰.۹%	۷.۰	-۱.۰۰	۶,۷۶۴	۵۸.۹%
طهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۱	۲۲۳.۵	۱,۳۲۷	۲۶,۸۳۰	۲۶,۶۷۳	(۰.۶%)	۲۰.۱	-۰.۶۶	۱,۲۲۵	(۷.۷%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۹	۶۲۰.۱	۳,۱۵۲	۲۶,۸۳۰	۲۶,۸۴۸	۰.۱%	۸.۵	-۰.۷۲	۲,۶۱۵	(۱۷.۰%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۸	۹.۵	۴۰۴	۳,۷۰۷	۳,۵۹۶	(۳.۰%)	۸.۹	-۰.۷۶	۲۵۹	(۳۵.۹%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۹	۲۲.۶	۲,۱۰۹	۲۶,۸۳۰	۲۵,۸۹۱	(۳.۵%)	۱۲.۳	-۰.۵۰	۱,۳۴۵	(۳۶.۲%)

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
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۱	۲۷.۰	۱۱	۲۶,۸۳۰	۱۳,۹۸۹	(۴۷.۹%)	۱,۲۷۱.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۰	شستا	۵۵۰	۲۵	۴.۹	۲	۱,۴۴۴	۵۴۸	(۶۲.۰%)	۲۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۱	۶.۳	۲۵	۲۶,۸۳۰	۱۴,۹۷۵	(۴۴.۲%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۲۵	۱۲.۹	۳	۱,۴۴۴	۸۴۷	(۴۱.۳%)	۲۸۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۶	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۱	۱۰۷.۲	۲۸	۲۶,۸۳۰	۱۵,۹۷۲	(۴۰.۵%)	۵۷۰.۴	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

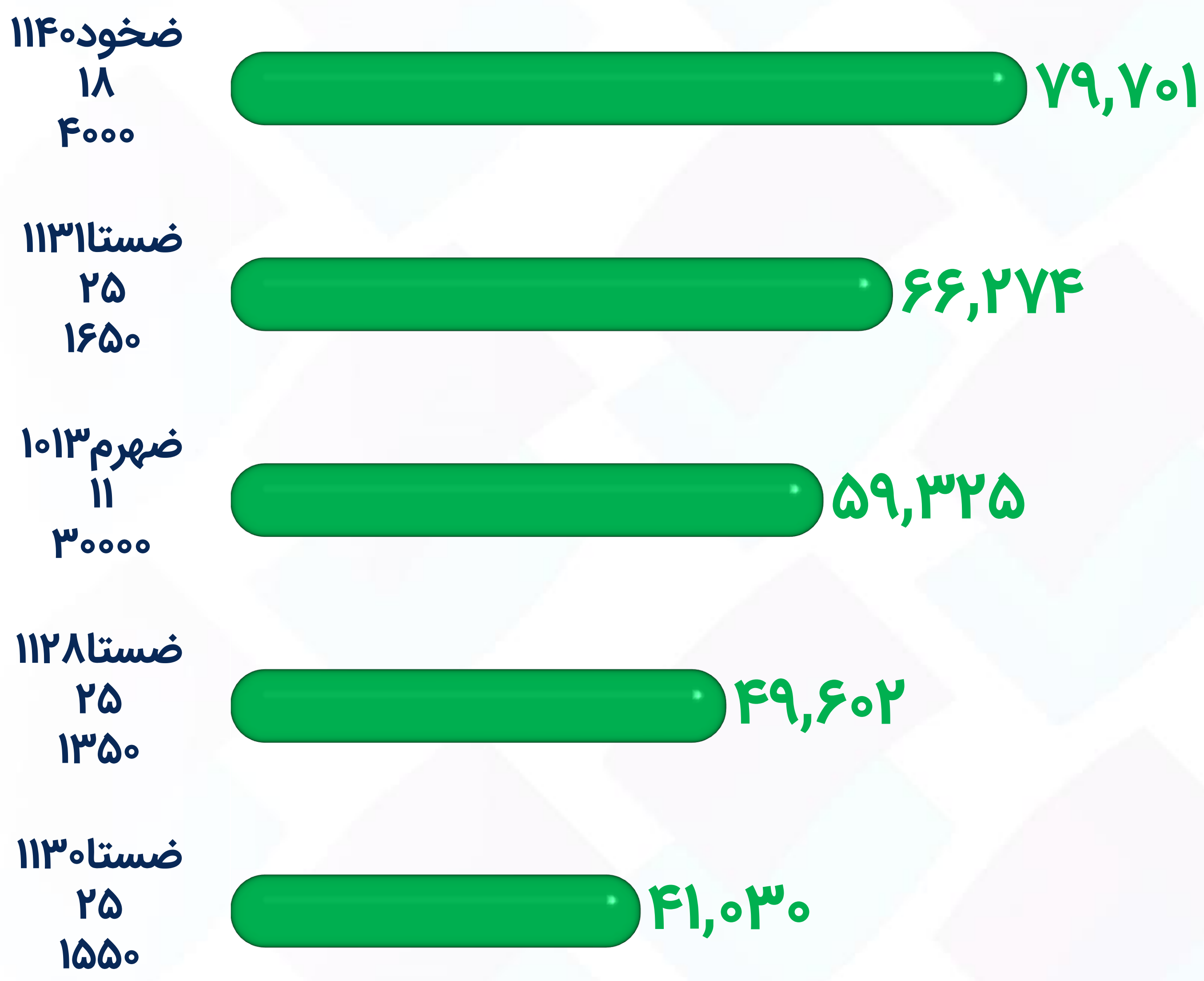
ارزش موقعیت‌های باز

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



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

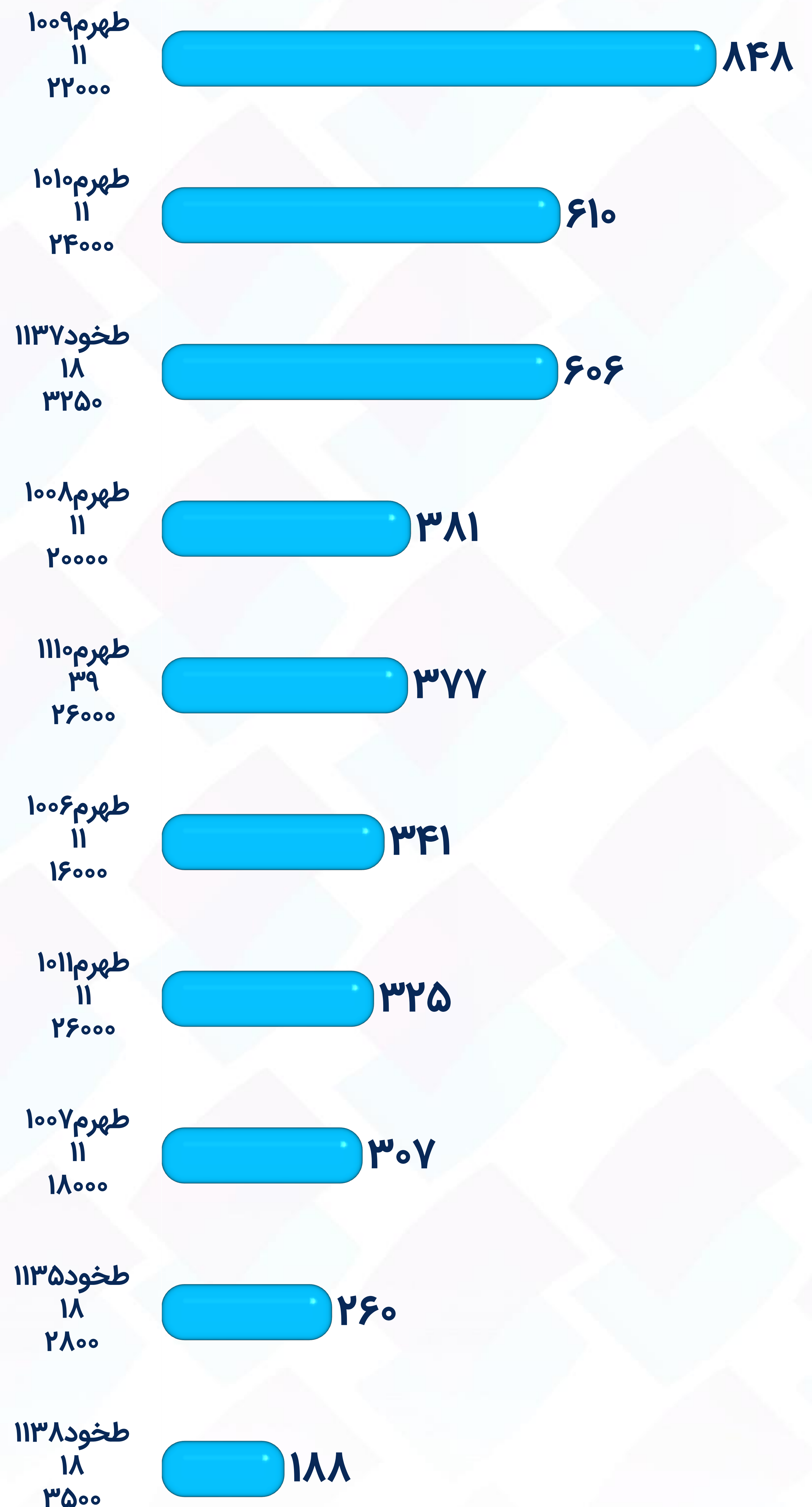
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

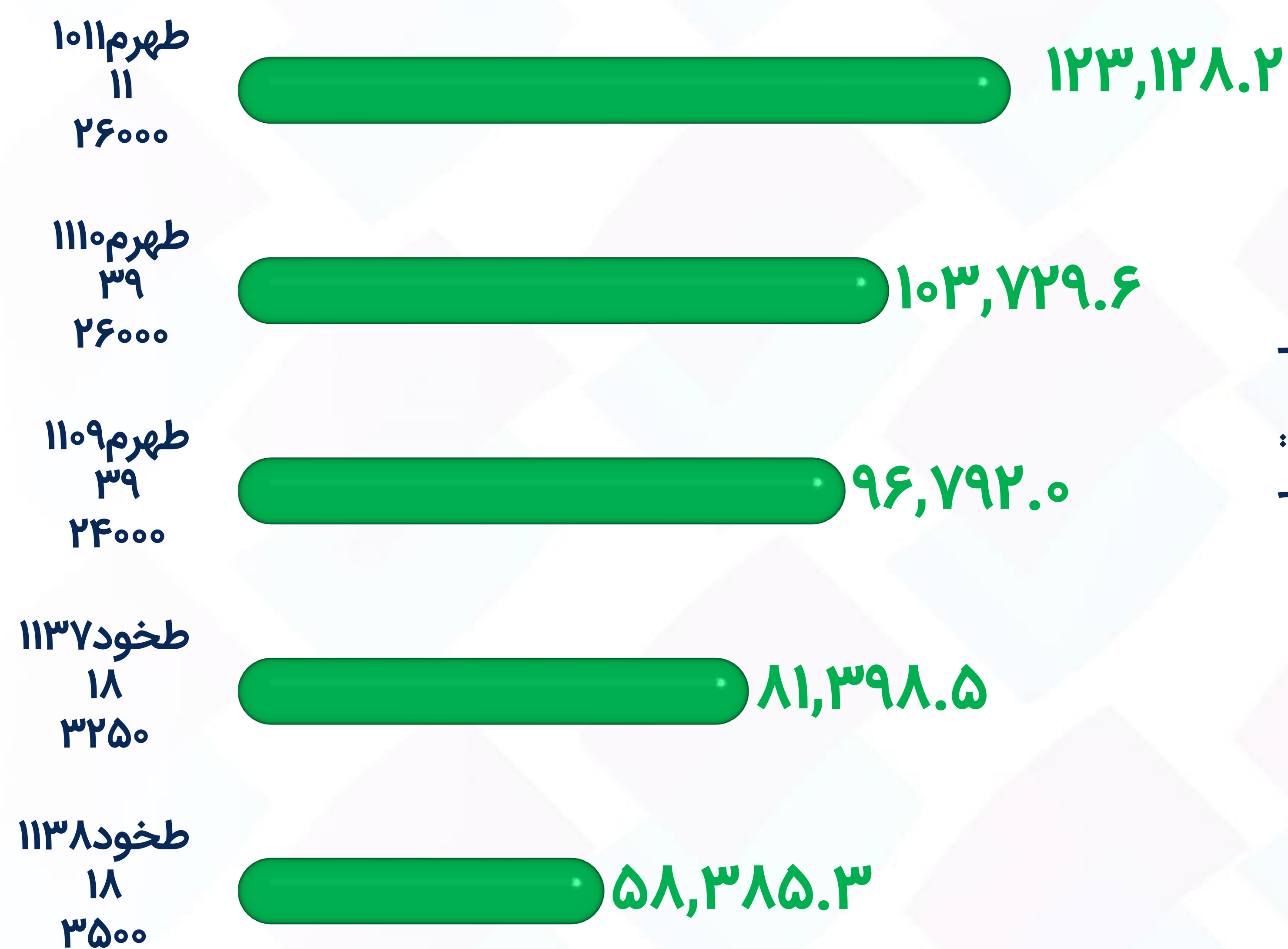
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

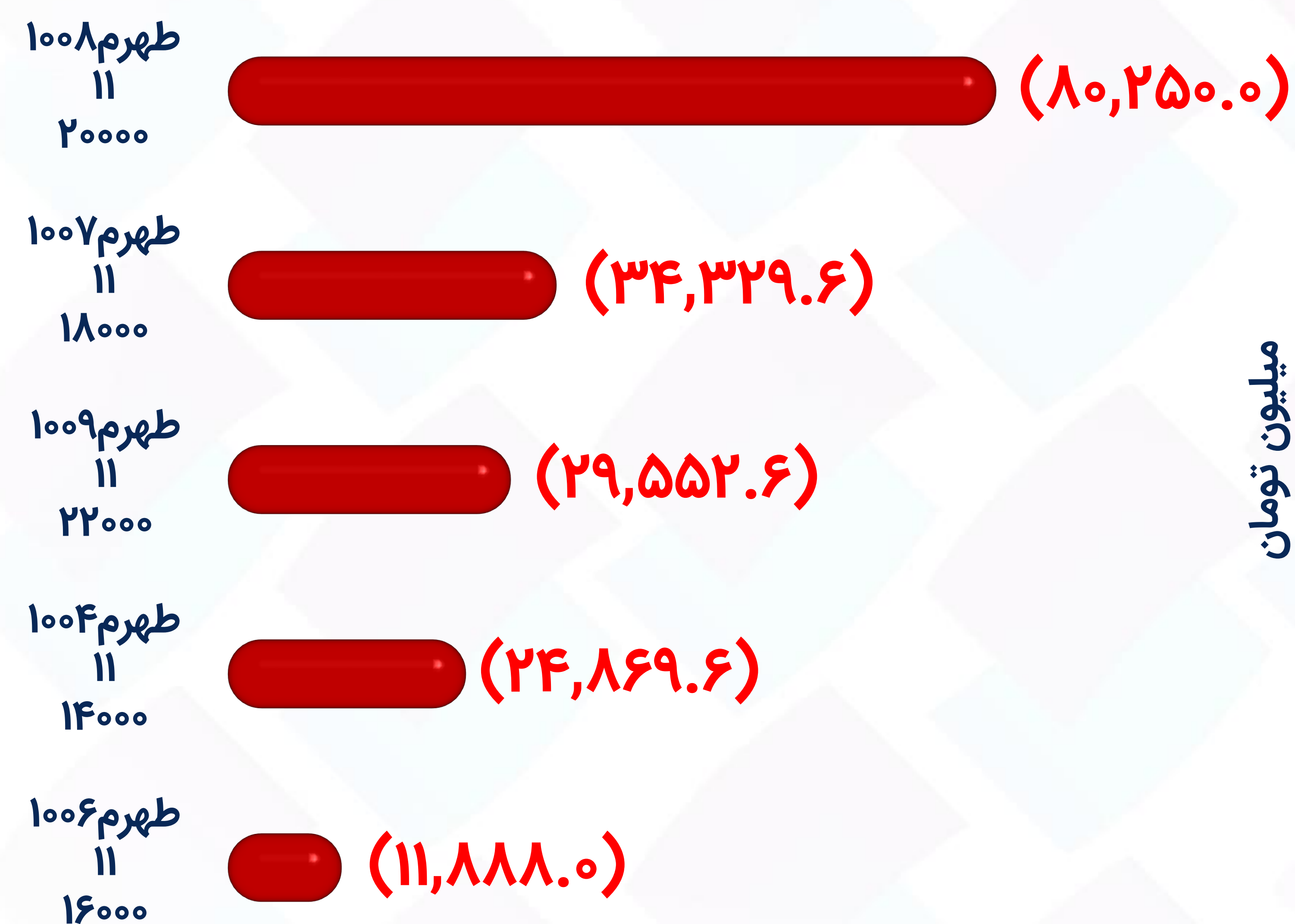
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

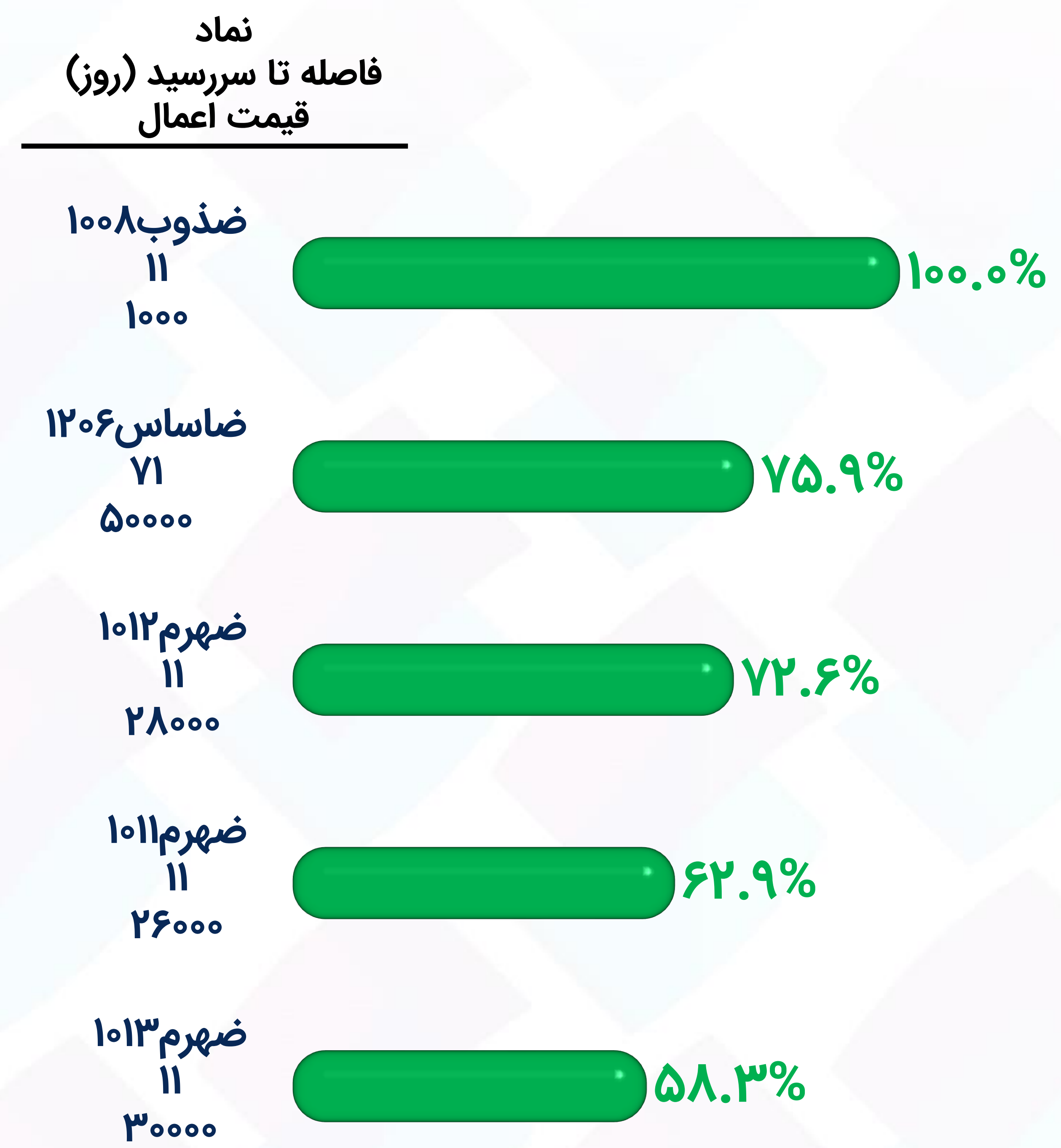
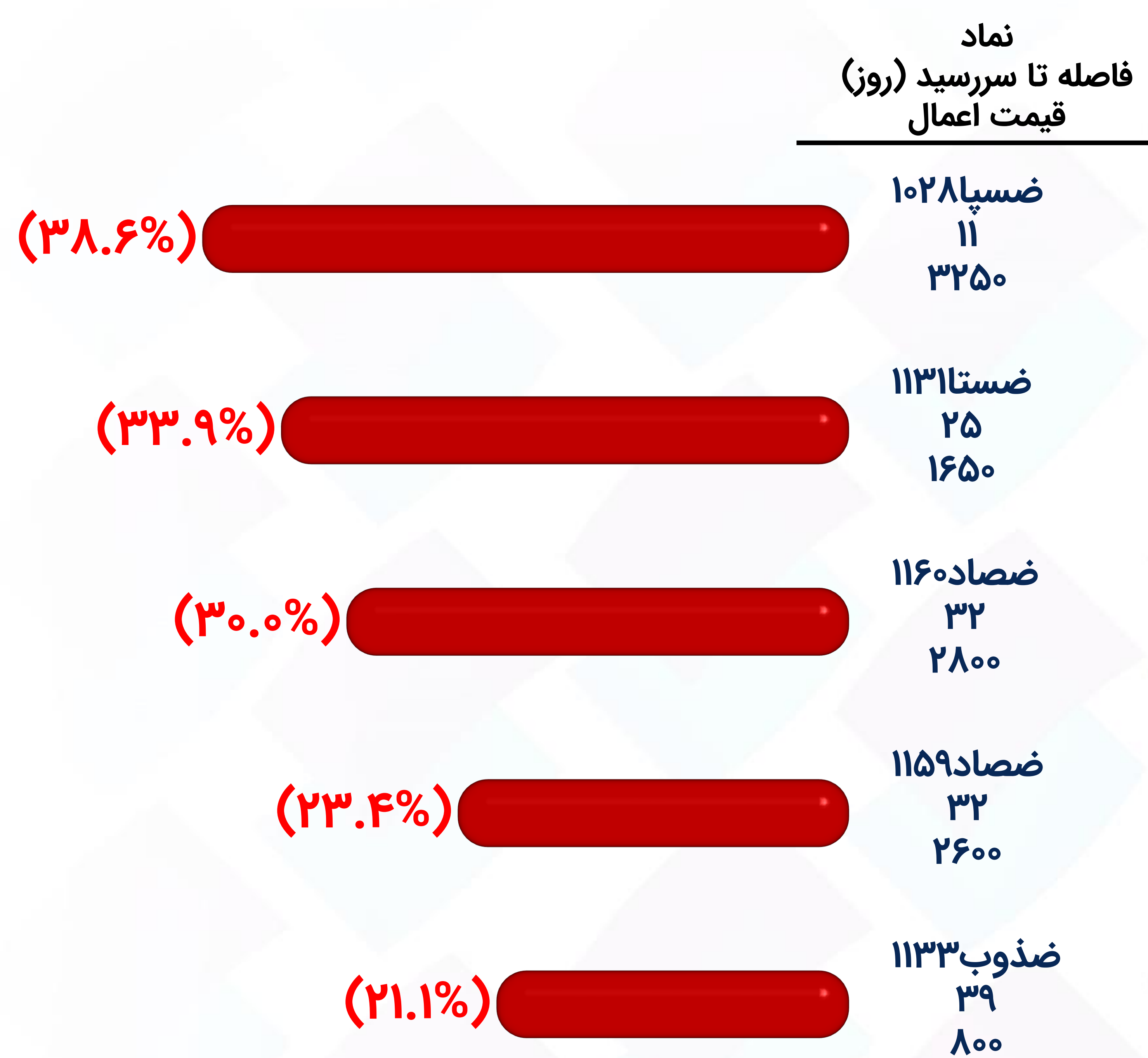
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



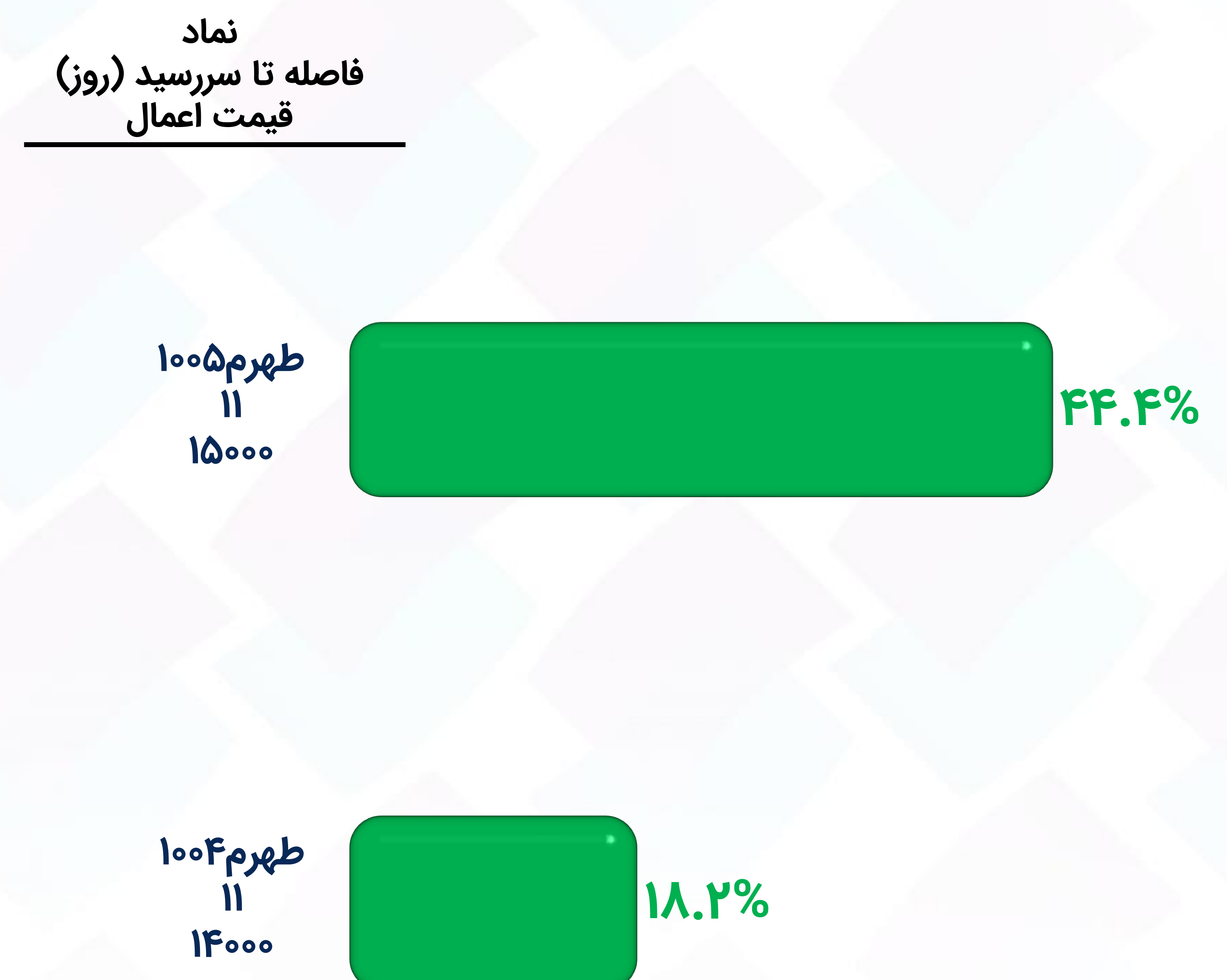
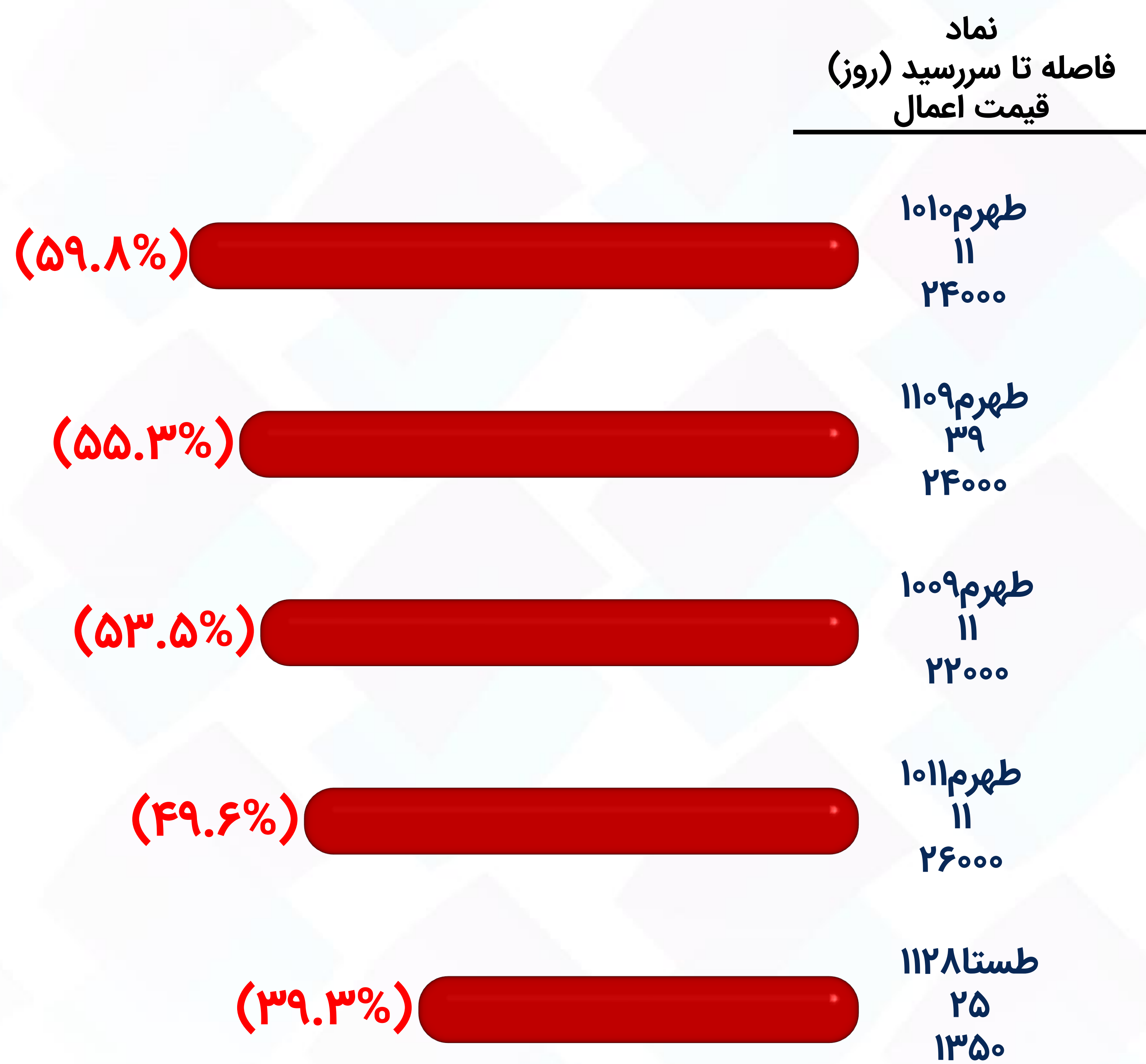
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

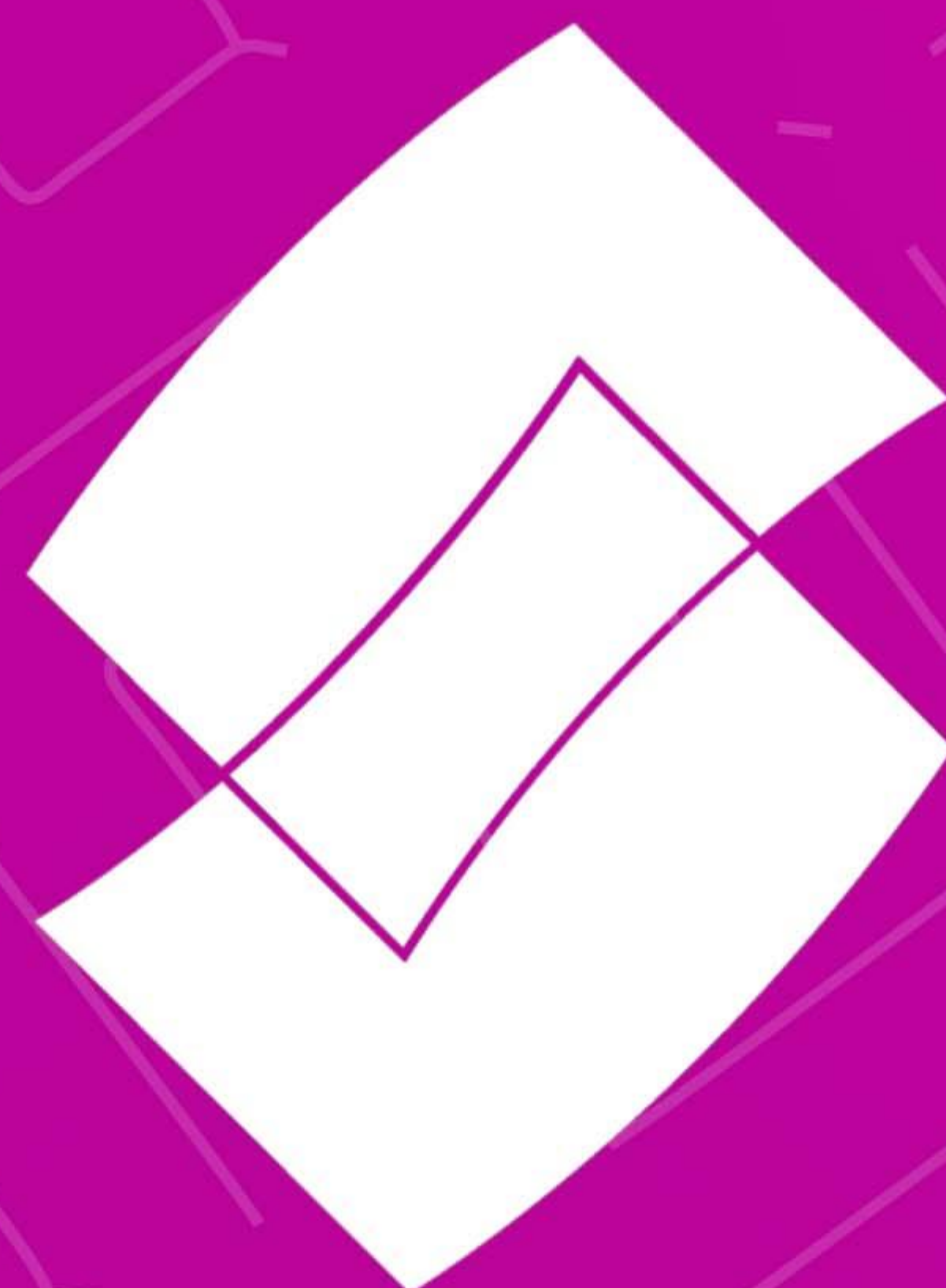
اختیار خرید



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.