

شماره
۴۰۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۶ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





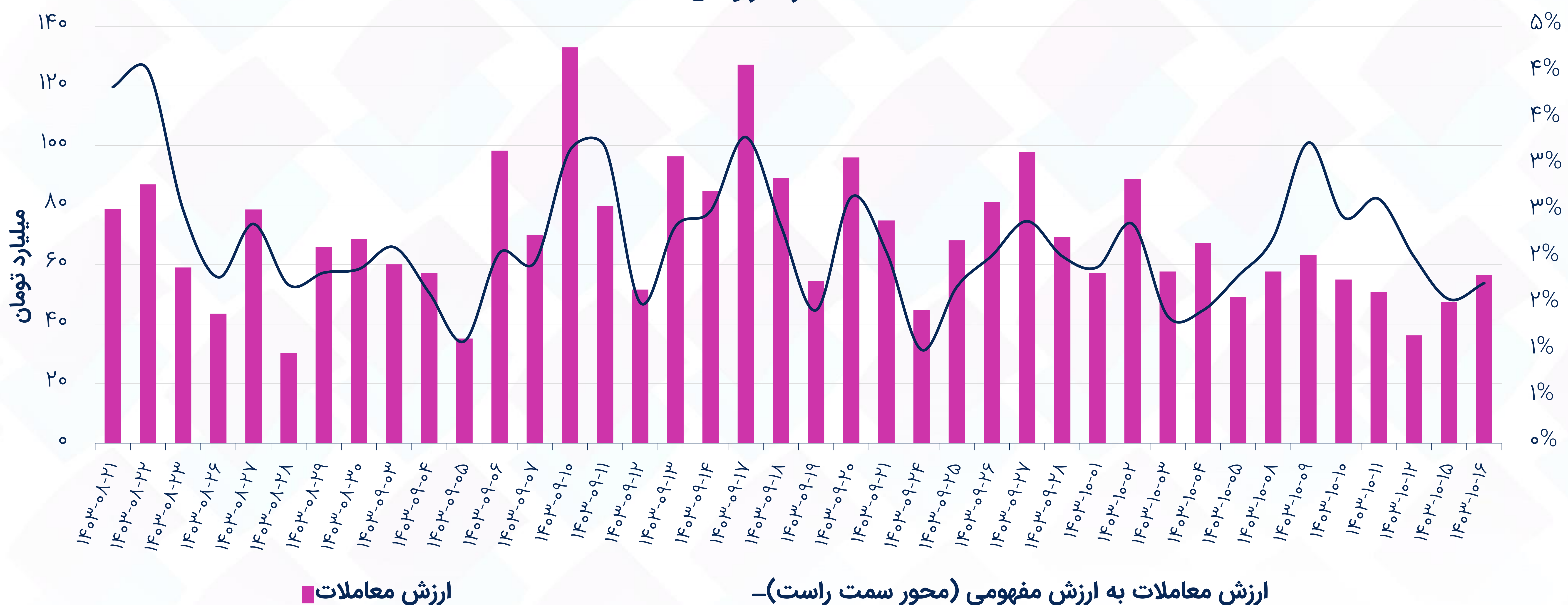
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



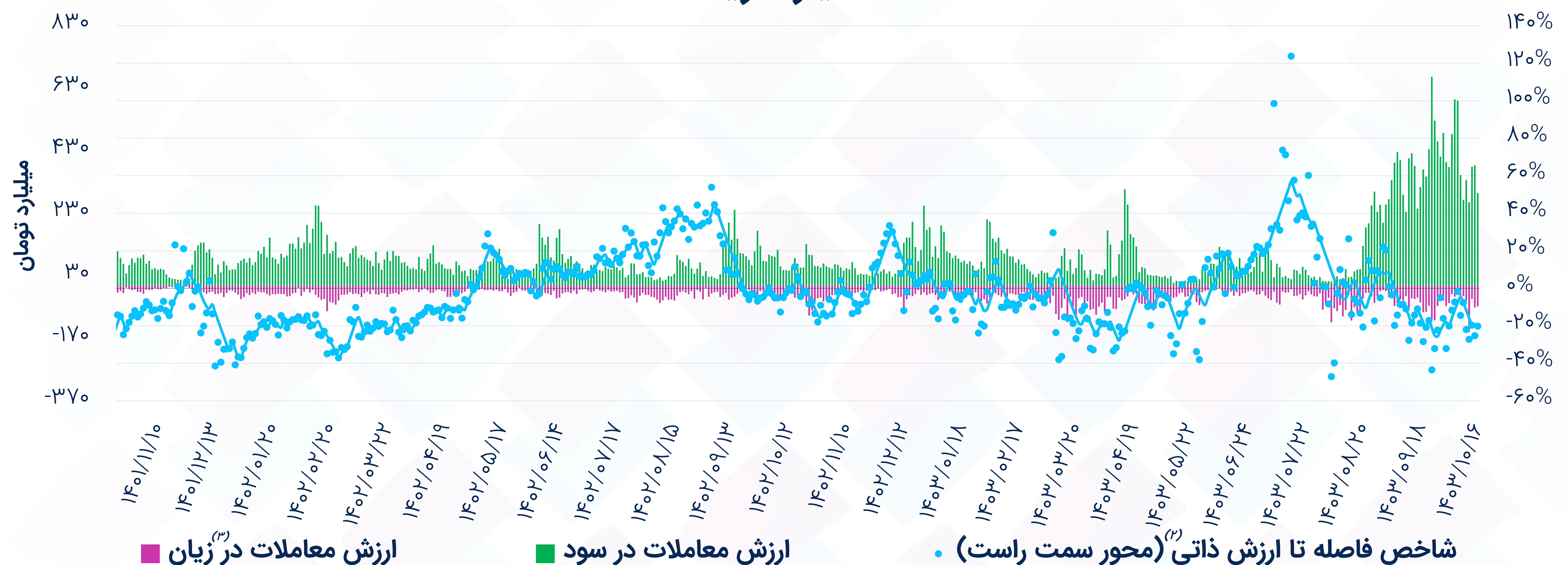
اختیار فروش



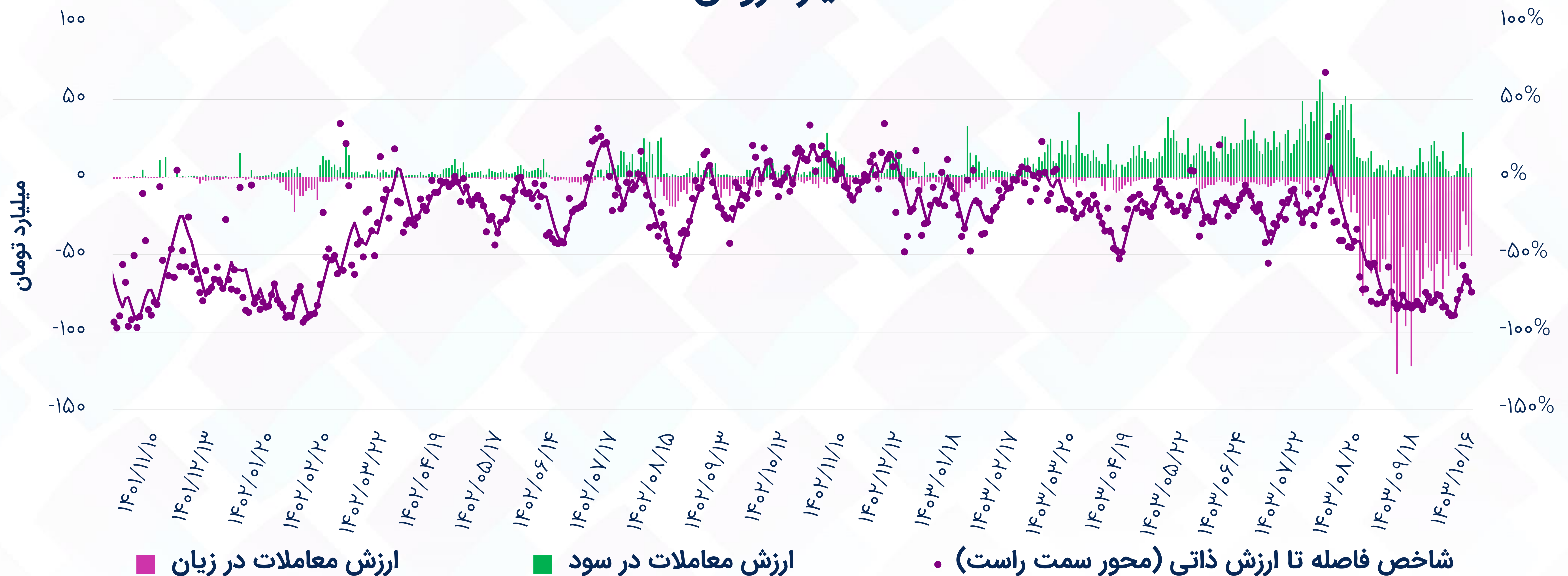
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

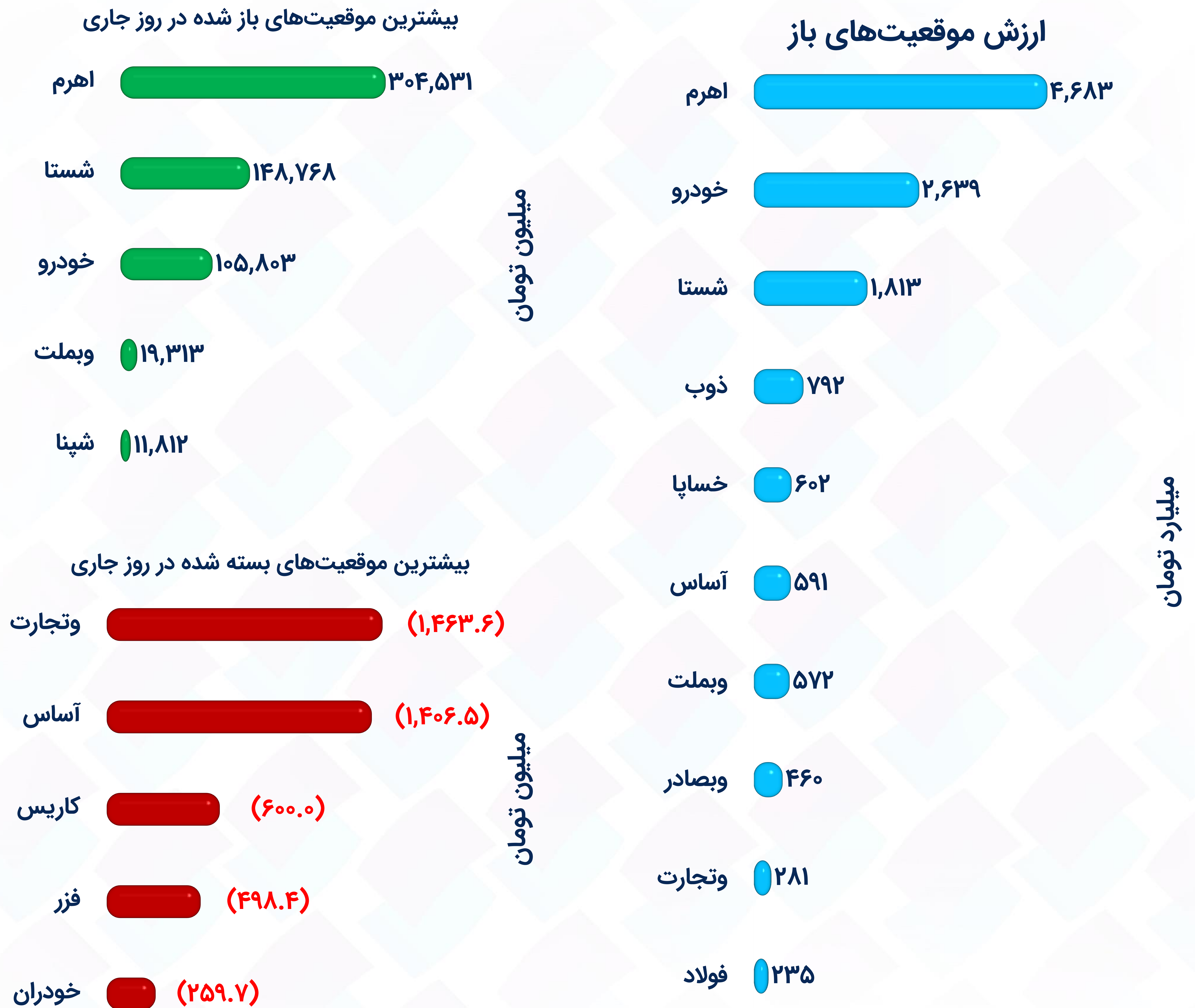
اختیار خرید

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	۳۷	۱۵۸.۳	۱,۴۲۳.۷	۱۴۵.۲	۱۳.۱	(۲۳.۲%)
خودرو	۲۷	۱۱۹.۲	۱,۵۹۶.۶	۸۴.۸	۳۴.۴	(۱۴.۹%)
شستا	۳۱	۳۰.۲	۳۶۸.۴	۱۸.۷	۱۱.۶	(۳۸.۵%)
آساس	۹	۱۱.۳	۳۲.۹	۱۱.۳	۰.۰	(۰.۸%)
ذوب	۱۹	۱۰.۲	۵۳.۰	۹.۳	۰.۹	(۱۲.۰%)
موج	۱۸	۵.۸	۲۰.۸	۵.۸	۰.۰	(۲.۲%)
خسپا	۱۴	۴.۷	۱۹۸.۶	۱.۴	۳.۳	(۴۸.۱%)

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	۳۴,۹۹۰.۳	۱,۹۵۳,۵۳۳.۸	۲,۲۹۴.۱	۳۲,۶۹۶.۲	(۶۹.۸%)
خودرو	۸	۱۹,۹۲۸.۱	۱,۲۱۹,۷۹۶.۳	۳,۳۴۸.۲	۱۶,۵۷۹.۹	(۸۰.۸%)
شستا	۱۳	۱,۳۲۲.۹	۸۳,۹۷۲.۶	۱۳۵.۳	۱,۱۸۷.۶	(۸۵.۶%)
وبملت	۲	۸۰.۱	۳,۳۶۴.۴	۰.۰	۸۰.۱	(۸۶.۸%)
ذوب	۳	۷۹.۲	۳,۱۶۰.۸	۲۰.۷	۵۸.۵	(۸۳.۲%)
توان	۱	۳۵.۹	۷۹۷.۶	۰.۰	۳۵.۹	(۶۸.۶%)
رویین	۳	۲۲.۰	۵۲۹.۲	۰.۰	۲۲.۰	(۹۹.۹%)

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
ضسپا ۱۱۲۲	خسپا	۲,۲۰۰	۳۸	۴۷.۲	۳۹۲	۲,۹۳۳	۲,۵۹۲	(۱۱.۶%)	۶.۶	۱.۰۰	۸۱۰	۱۰۷%
ضجار ۱۰۶۲	وتجارت	۱,۹۰۰	۳	۱۶۵.۲	۸۸	۲,۰۱۷	۱,۹۸۸	(۱.۴%)	۲۲.۶	۰.۹۵	۱۲۹	۴۷%
ضجار ۱۰۶۱	وتجارت	۱,۸۰۰	۳	۲۳۴.۷	۱۵۶	۲,۰۱۷	۱,۹۵۶	(۳.۰%)	۱۲.۵	۱.۰۰	۲۲۷	۴۵%
ضبید ۱۰۰۹	بیدار	۱۳,۰۰۰	۳	۷.۵	۱,۵۰۴	۱۴,۹۴۰	۱۴,۵۰۴	(۲.۹%)	۹.۶	۱.۰۰	۲,۰۱۲	۳۴%
ضجار ۱۰۶۳	وتجارت	۲,۰۰۰	۳	۳۷۱.۸	۳۶	۲,۰۱۷	۲,۰۳۶	۰.۹%	۵۶.۶	۰.۶۴	۴۸	۳۳%

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	۱۰	۲.۳	۲	۵۶۱	۱,۰۰۲	۷۹%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۳۸	۳۰.۱	۷	۵۶۱	۱,۰۰۷	۸۰%	۱۴۳.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۳۸	۲۴.۷	۱۱	۵۶۱	۹۱۱	۶۲%	۸۲.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۳۸	۸۸.۴	۱۳	۵۶۱	۸۱۳	۴۵%	۶۲.۵	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۰	۴.۵	۴۷	۲۷,۵۶۰	۳۴,۰۴۷	۲۴%	۷۲۴.۴	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	۱۰	۷۳۸.۳	۱,۱۳۲	۲۷,۵۶۰	۲۶,۸۶۸	(۲.۵%)	۲۳.۷	-۰.۵۲	۷۷۱	(۳۱.۹%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۸	۶۲۳.۶	۳,۱۷۲	۲۷,۵۶۰	۲۶,۸۲۸	(۲.۷%)	۸.۵	-۰.۶۴	۲,۱۰۳	(۳۳.۷%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۷	۴.۵	۳۵۷	۳,۷۴۸	۳,۶۴۳	(۲.۸%)	۱۰.۲	-۰.۷۲	۲۲۸	(۳۶.۳%)
طهرم ۱۰۱۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۰	۶.۴	۳,۵۵۷	۲۷,۵۶۰	۲۶,۴۴۳	(۴.۱%)	۷.۴	-۰.۸۷	۲,۲۲۳	(۳۷.۵%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۸	۹۲۵.۸	۱,۹۴۷	۲۷,۵۶۰	۲۶,۰۵۳	(۵.۵%)	۱۳.۴	-۰.۴۱	۹۹۶	(۴۸.۸%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

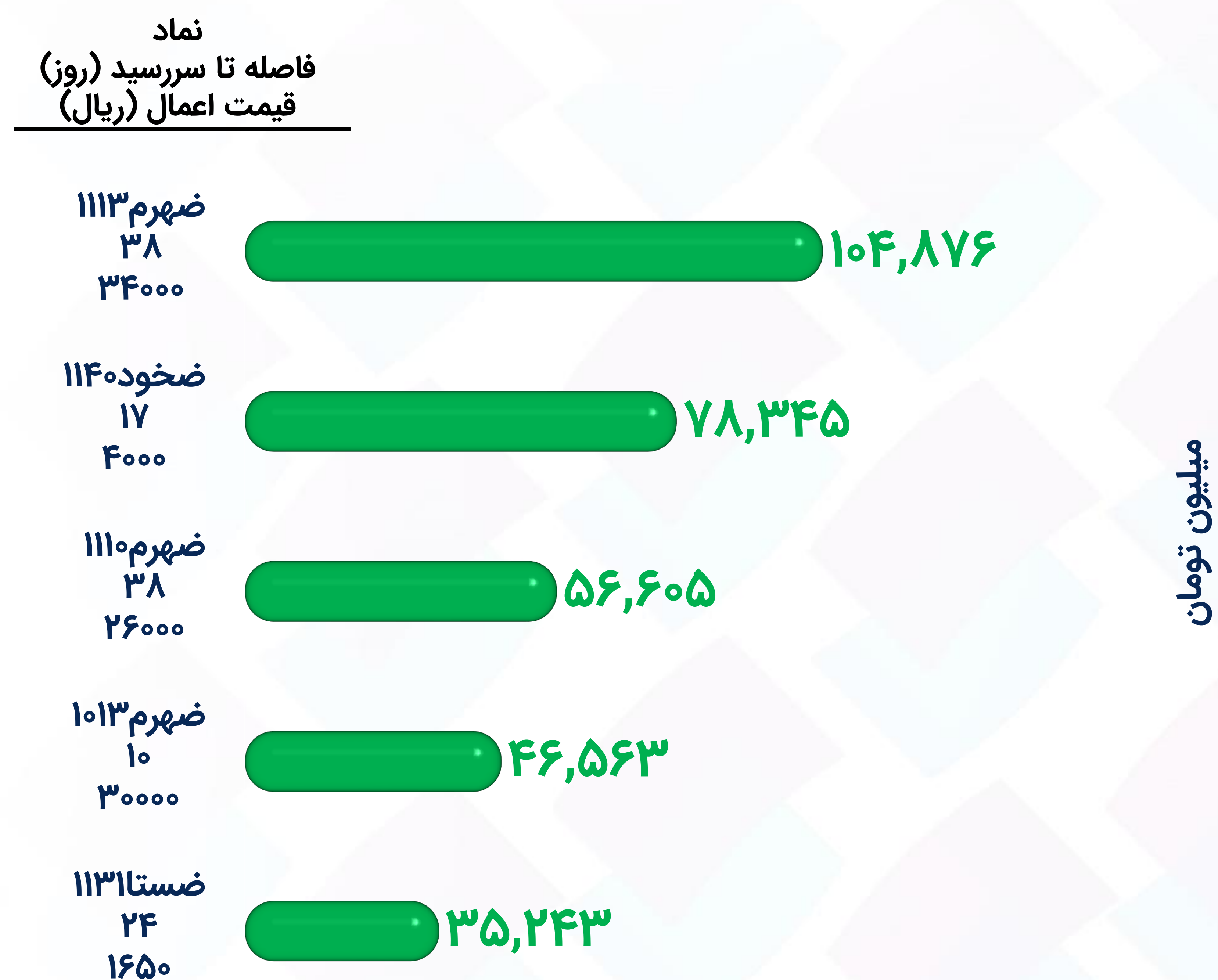
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۱۰۰۶	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۰	۲۵.۸	۲۱	۲۷,۵۶۰	۱۵,۹۷۹	(۴۲.۰%)	۷۶۰.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۰	۱۰.۲	۱۲	۲۷,۵۶۰	۱۳,۹۸۸	(۴۹.۲%)	۱,۱۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۰	۲.۵	۲۰	۲۷,۵۶۰	۱۴,۹۸۰	(۴۵.۶%)	۷۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۲۴	۱۱.۱	۳	۱,۴۱۸	۸۴۷	(۴۰.۳%)	۲۸۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۰	۸۷.۷	۲۸	۲۷,۵۶۰	۱۷,۹۷۲	(۳۴.۸%)	۶۴۱.۹	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

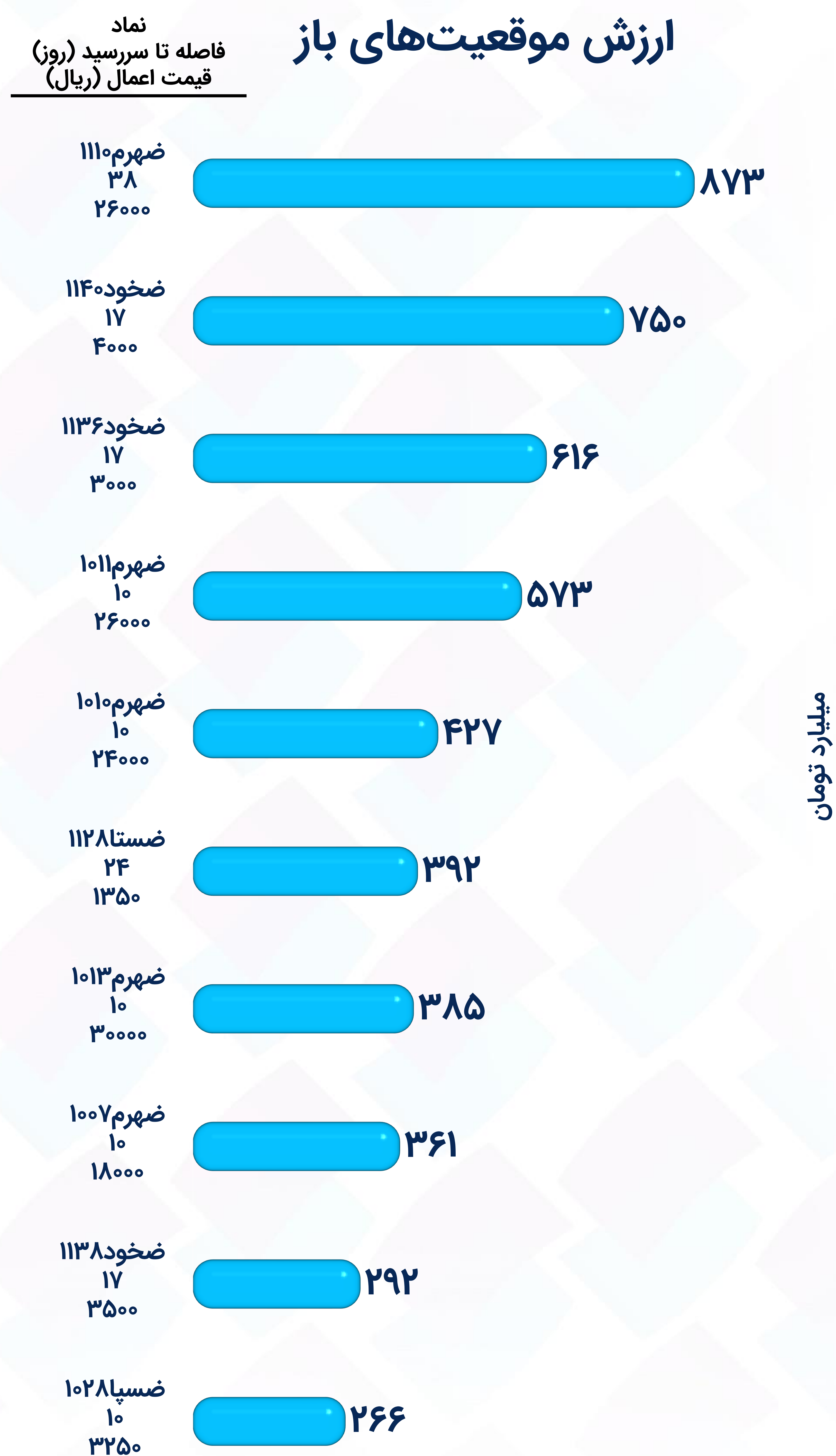
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



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)



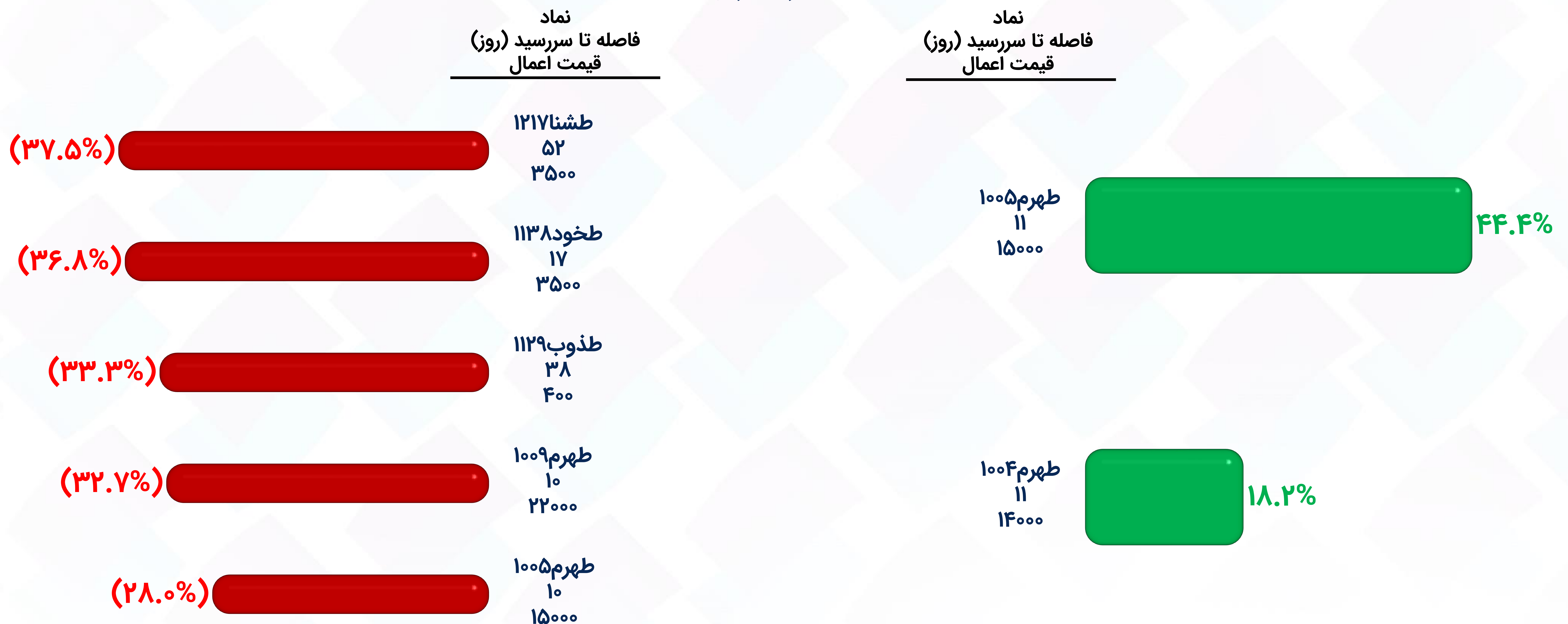
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

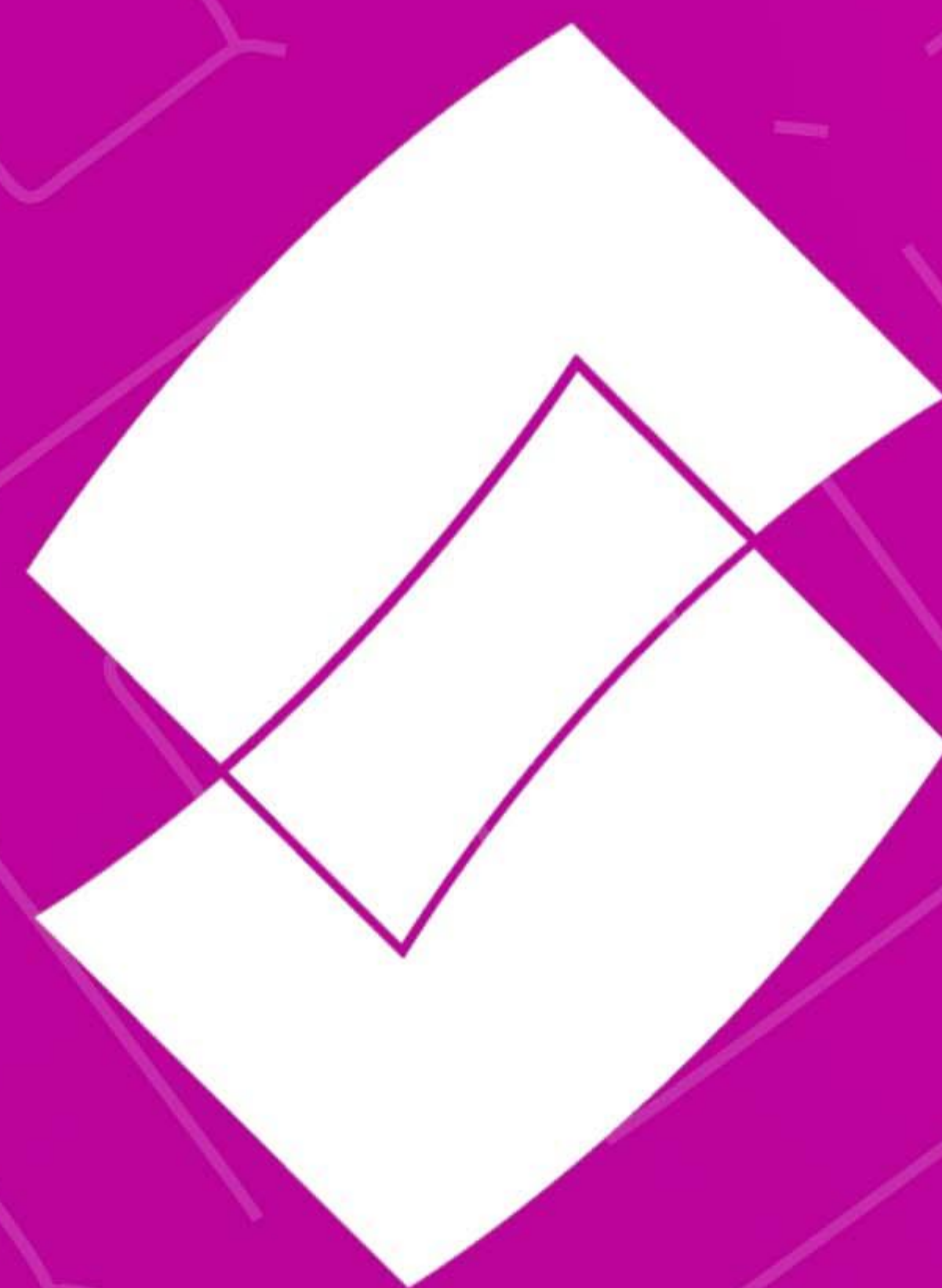
اختیار خرید



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.