

شماره
۴۰۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

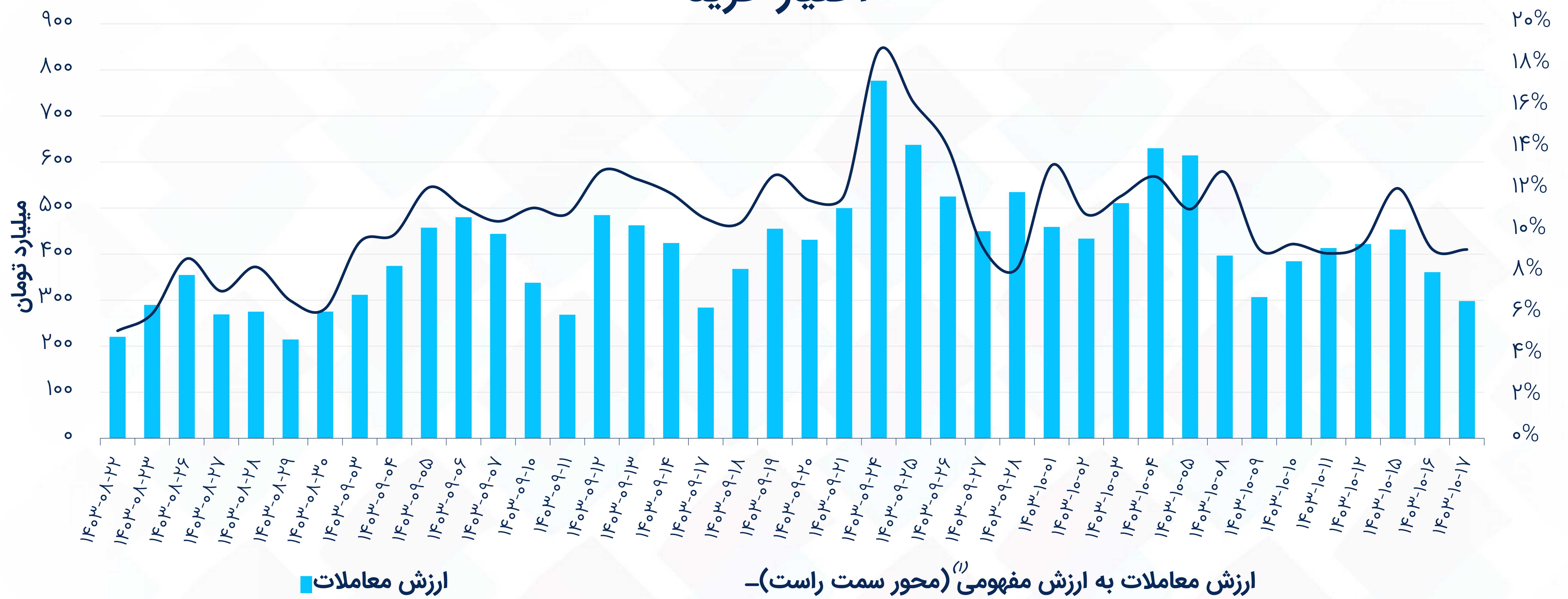




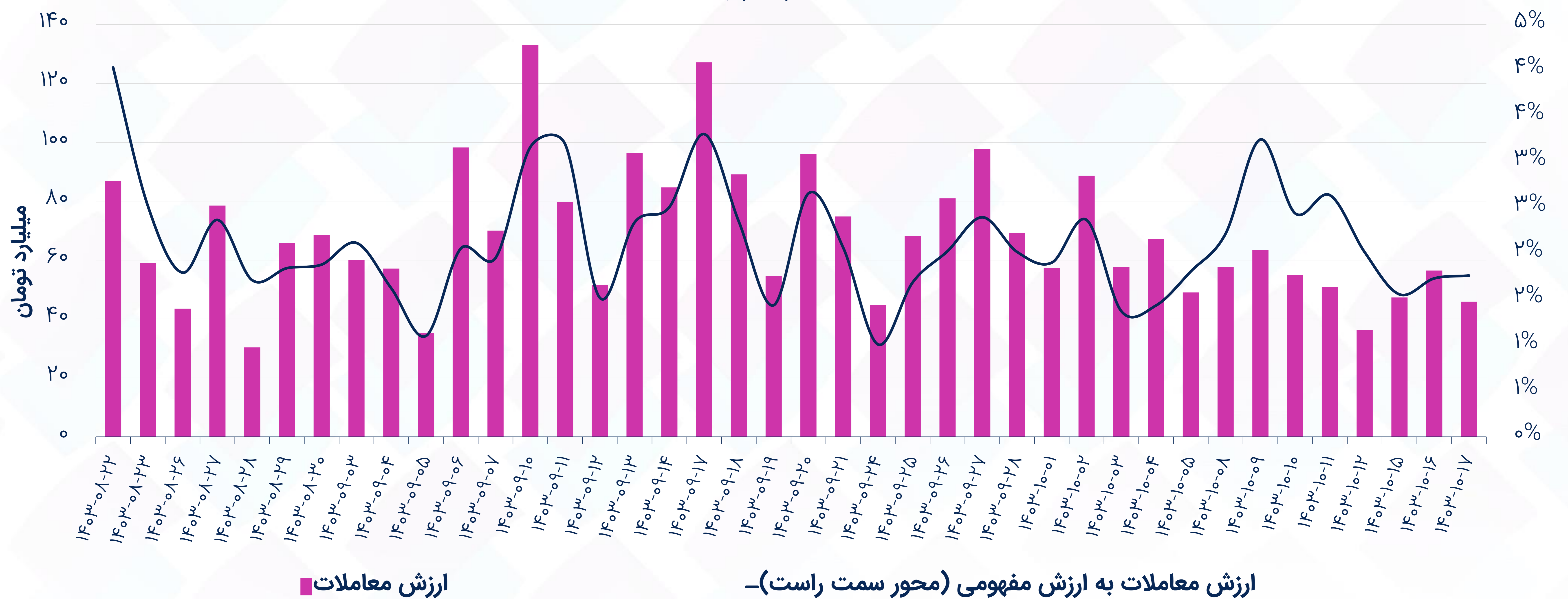
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



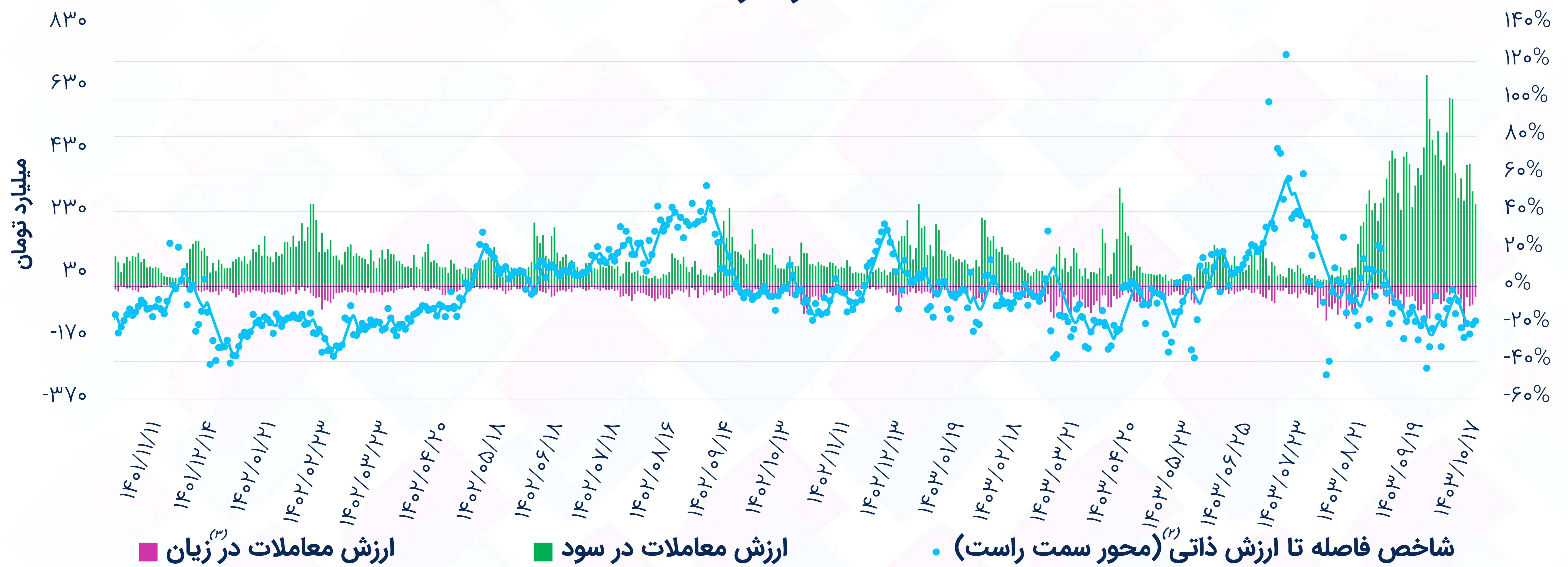
اختیار فروش



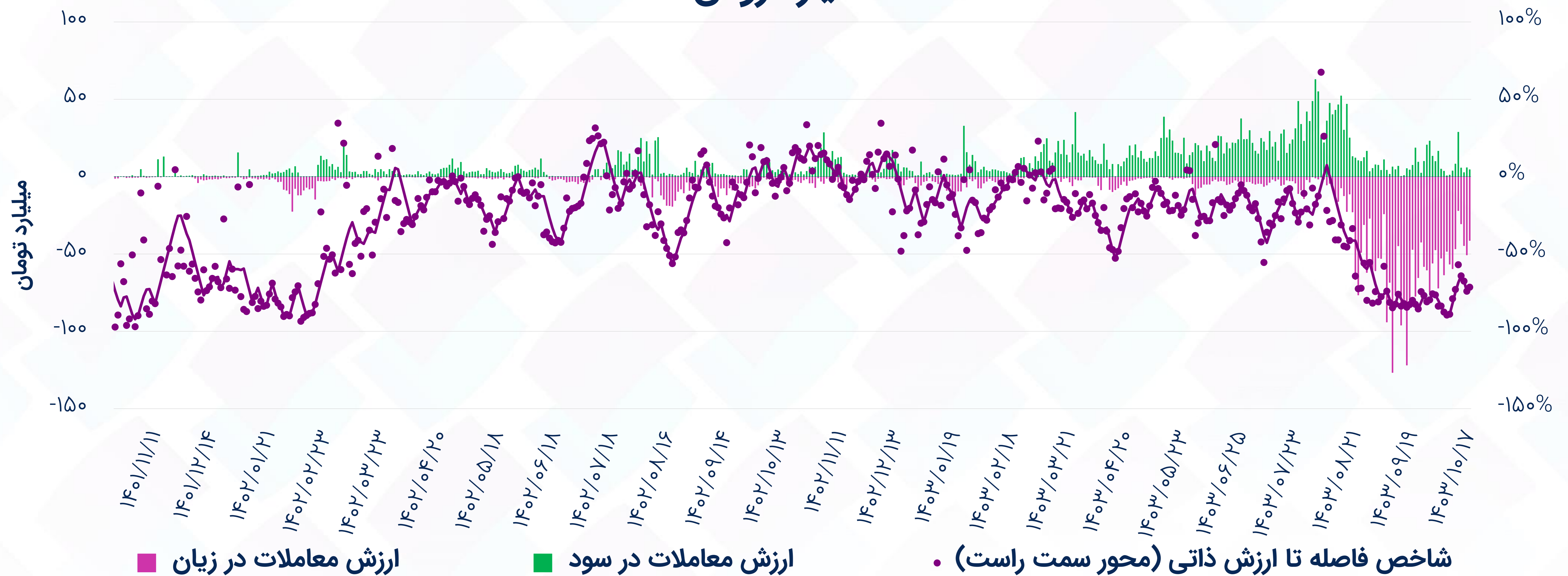
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

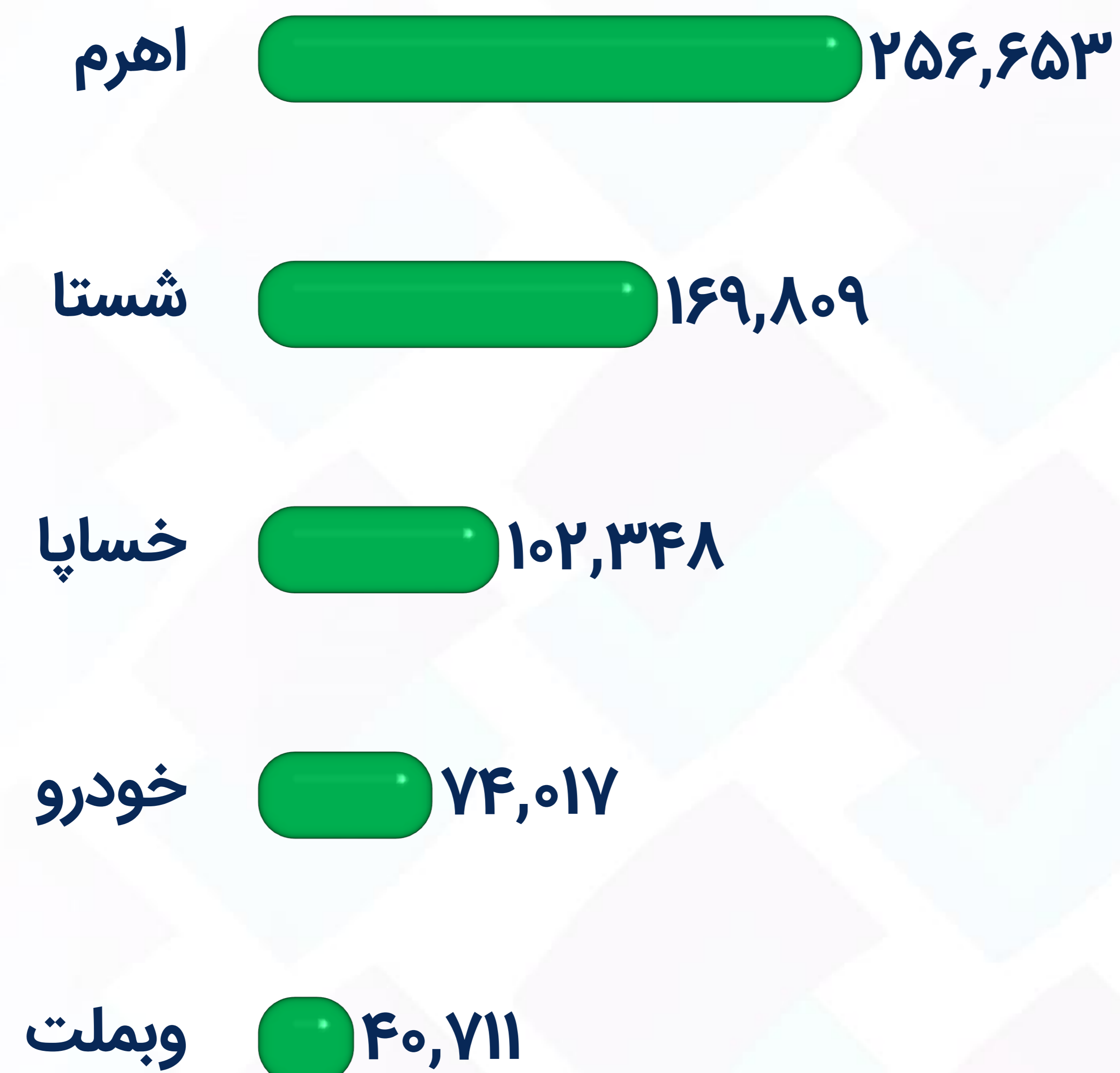
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۳۹	۱۶۵.۰	۱,۵۸۰.۹	۱۵۳.۸	۱۱.۲	(۱۷.۲%)
خودرو	۲۵	۵۱.۹	۶۷۸.۰	۳۸.۱	۱۳.۸	(۱۵.۴%)
شستا	۳۲	۲۹.۵	۴۲۰.۹	۱۸.۲	۱۱.۳	(۴۰.۶%)
ذوب	۲۰	۱۱.۰	۶۰.۶	۹.۹	۱.۰	(۱۵.۸%)
پادا	۱	۷.۱	۲۴.۹	۷.۱	۰.۰	(۲.۱%)
وبملت	۱۳	۶.۲	۵۰.۹	۴.۸	۱.۴	(۲۴.۳%)
خسپا	۱۱	۴.۹	۲۴۳.۹	۱.۷	۳.۱	(۵۱.۴%)

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	۳۶,۳۵۲.۰	۱,۹۹۰,۳۵۱.۱	۳,۱۰۶.۹	۳۳,۲۴۵.۱	(۶۹.۸%)
خودرو	۸	۷,۵۰۷.۸	۵۱۹,۱۸۳.۵	۱,۱۴۳.۱	۶,۳۶۴.۸	(۷۷.۴%)
شستا	۱۹	۱,۸۹۴.۲	۹۳,۸۵۸.۳	۲۳۹.۶	۱,۶۵۴.۶	(۸۱.۵%)
ذوب	۴	۴۸.۶	۱,۲۶۳.۰	۲۶.۵	۲۲.۱	(۶۳.۵%)
توان	۲	۱۹.۰	۳۱۵.۳	۱۱.۷	۷.۳	(۵۴.۴%)
خودران	۱	۱۳.۱	۲۲۱.۰	۰.۰	۱۳.۱	(۴۷.۸%)
وبملت	۲	۱۰.۶	۷۷۰.۰	۰.۰	۱۰.۶	(۸۸.۳%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۶۴,۳۷۷.۷

اهرم ۳۳,۲۵۳.۴

شستا ۱۷,۶۴۲.۶

رویین ۶۷۵.۶

وبملت ۴۸۰.۵

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۳,۷۶۷

خودرو ۱,۴۳۲

شستا ۲۶۴

وبملت ۳۱

ذوب ۲۳

رویین ۱۶

آساس ۳

اطلس ۲.۰۹

توان ۱.۳۶

خودران ۰.۹۴

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

ذوب

(۳۹.۸)

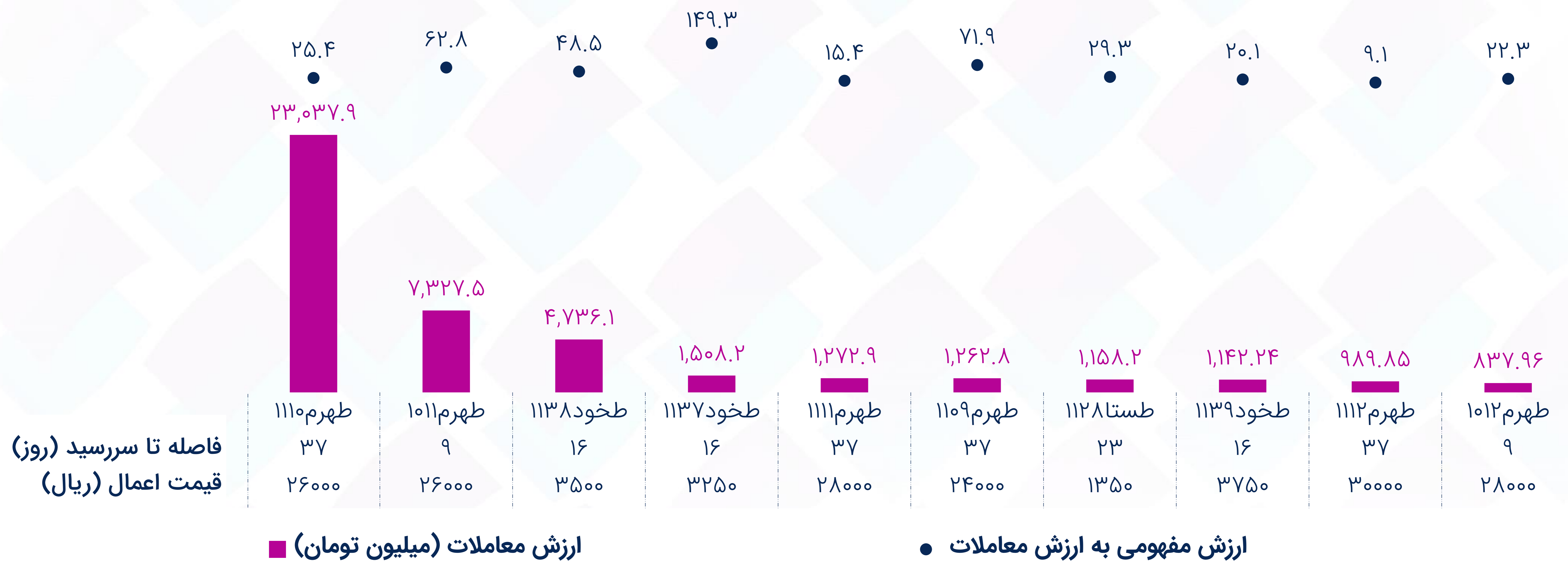
میلیون تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۵۷%	۱۹	۰.۴۰	۱۶۷.۷	۲.۰%	۲,۰۱۲	۱,۹۷۳	۱۲	۲۲۶.۳	۲	۲,۰۰۰	ضجارج ۱۰۶۳
۴۷%	۲,۲۰۵	۱.۰۰	۴.۰	(۴.۷%)	۶,۰۸۲	۶,۳۸۰	۱,۵۰۲	۳۸.۲	۱۱۱	۴,۵۸۰	ضبساما ۲۱۳
۴۰%	۸۴	۰.۸۹	۳۲.۷	(۰.۷%)	۱,۹۶۰	۱,۹۷۳	۶۰	۴۵۱.۱	۲	۱,۹۰۰	ضجارج ۱۰۶۲
۲۸%	۸,۳۵۵	۱.۰۰	۲.۰	(۱۰.۴%)	۱۳,۰۱۰	۱۴,۵۲۰	۶,۵۱۰	۹.۸	۵۸	۶,۵۰۰	ضتاب ۱۲۰
۲۶%	۷,۸۸۱	۱.۰۰	۲.۱	(۸.۷%)	۱۳,۲۵۰	۱۴,۵۲۰	۶,۲۵۰	۸.۸	۵۸	۷,۰۰۰	ضتاب ۱۲۰۱

گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۶۷.۷	۸۳%	۱,۰۰۶	۵۴۹	۶	۲۵.۷	۳۷	۱,۰۰۰	ضذوب ۱۱۳۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۹۱.۰	۶۶%	۹۱۰	۵۴۹	۱۰	۲.۲	۳۷	۹۰۰	ضذوب ۱۱۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۶۷.۷	۴۸%	۸۱۲	۵۴۹	۱۲	۴۲.۹	۳۷	۸۰۰	ضذوب ۱۱۳۳
(۹۹%)	۰	۰.۰۰	۱,۲۶۰.۳	۲۳%	۳۴,۰۲۷	۲۷,۶۲۰	۲۷	۳.۴	۹	۳۴,۰۰۰	ضهرم ۱۰۱۴
(۹۹%)	۰	۰.۰۱	۹۴.۳	۲۸%	۲,۸۳۰	۲,۲۱۰	۳۰	۷۲.۲	۳۰	۲,۸۰۰	ضصاد ۱۱۶۰

(۱) سر به سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
 (۲) فاصله تا سر به سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سر به سر)
 (۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سر به سر
 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

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۴.۱%)	۶,۰۶۷	-۱.۰۰	۳.۸	(۲.۵%)	۲۶,۹۳۴	۲۷,۶۲۰	۷,۰۶۶	۴.۲	۹	۳۴,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۴
(۲۰.۴%)	۲,۱۹۴	-۰.۸۸	۹.۹	(۱.۴%)	۲۷,۲۴۴	۲۷,۶۲۰	۲,۷۵۶	۱.۹	۹	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۳
(۳۰.۷%)	۲,۰۹۸	-۰.۶۵	۸.۹	(۲.۳%)	۲۶,۹۷۲	۲۷,۶۲۰	۳,۰۲۸	۹۸۹.۸	۳۷	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۱۱۲
(۴۱.۷%)	۷۲۳	-۰.۵۲	۲۱.۶	(۳.۱%)	۲۶,۷۶۰	۲۷,۶۲۰	۱,۲۴۰	۸۳۸.۰	۹	۲۸,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۲
(۴۴.۷%)	۴۵	-۰.۶۶	۶.۴	(۵.۵%)	۵۱۹	۵۴۹	۸۱	۲۶.۵	۳۷	۶۰۰	ذوب ۱۱۳۱

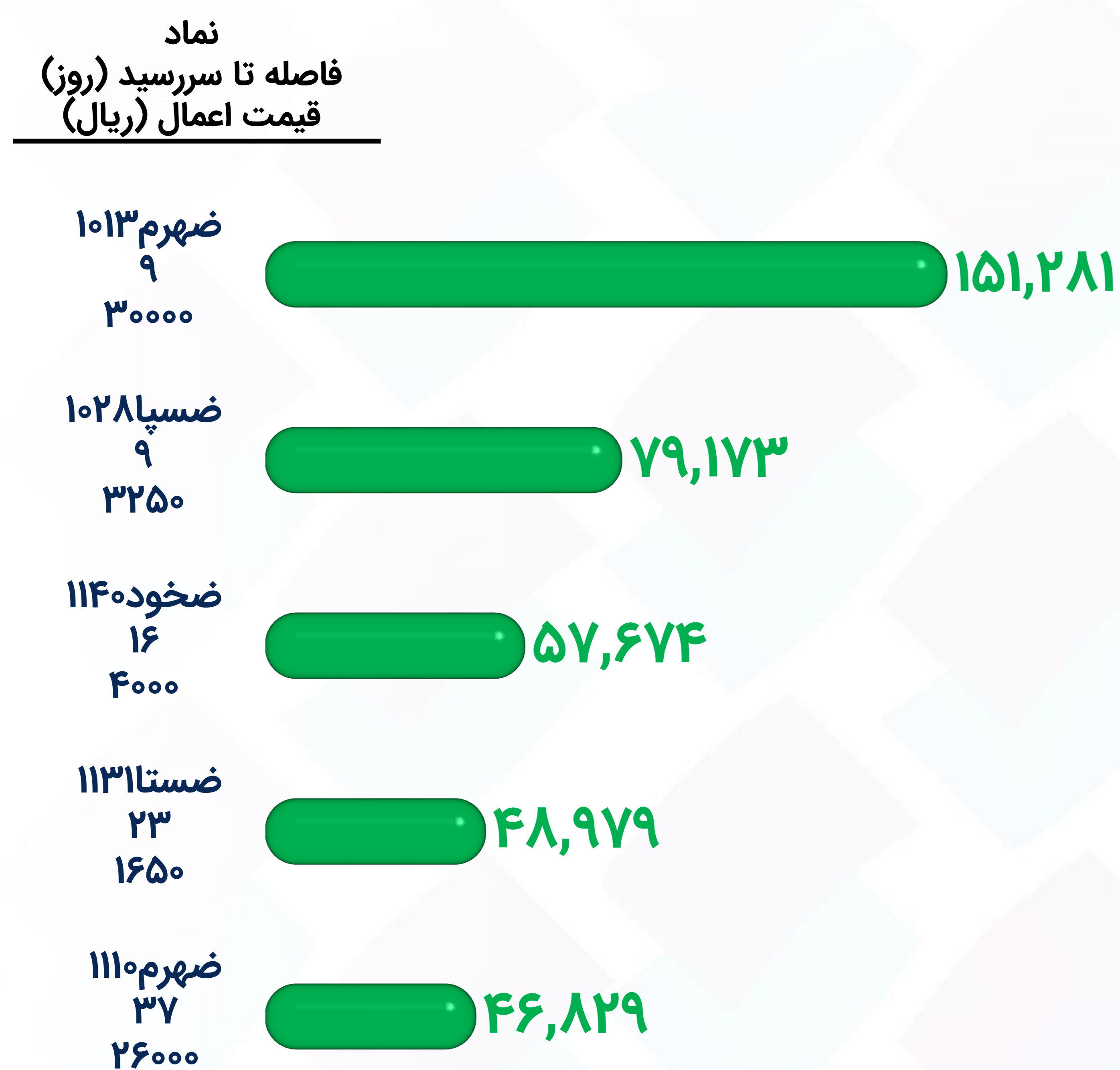
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۷۴۹.۰	(۴۹.۳%)	۱۳,۹۹۲	۲۷,۶۲۰	۸	۲.۰	۹	۱۴,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۴
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۹۳۶.۵	(۴۵.۷%)	۱۴,۹۸۴	۲۷,۶۲۰	۱۶	۲.۹	۹	۱۵,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۵
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۷۲۶.۳	(۴۲.۲%)	۱۵,۹۷۸	۲۷,۶۲۰	۲۲	۳۲.۹	۹	۱۶,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۶
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۲۸۲.۳	(۳۹.۷%)	۸۴۷	۱,۴۰۴	۳	۳.۵	۲۳	۸۵۰	شستا ۱۱۲۳
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۷۱۹.۰	(۳۴.۹%)	۱۷,۹۷۵	۲۷,۶۲۰	۲۵	۴۷.۹	۹	۱۸,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۷

(۱) سر به سر: 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

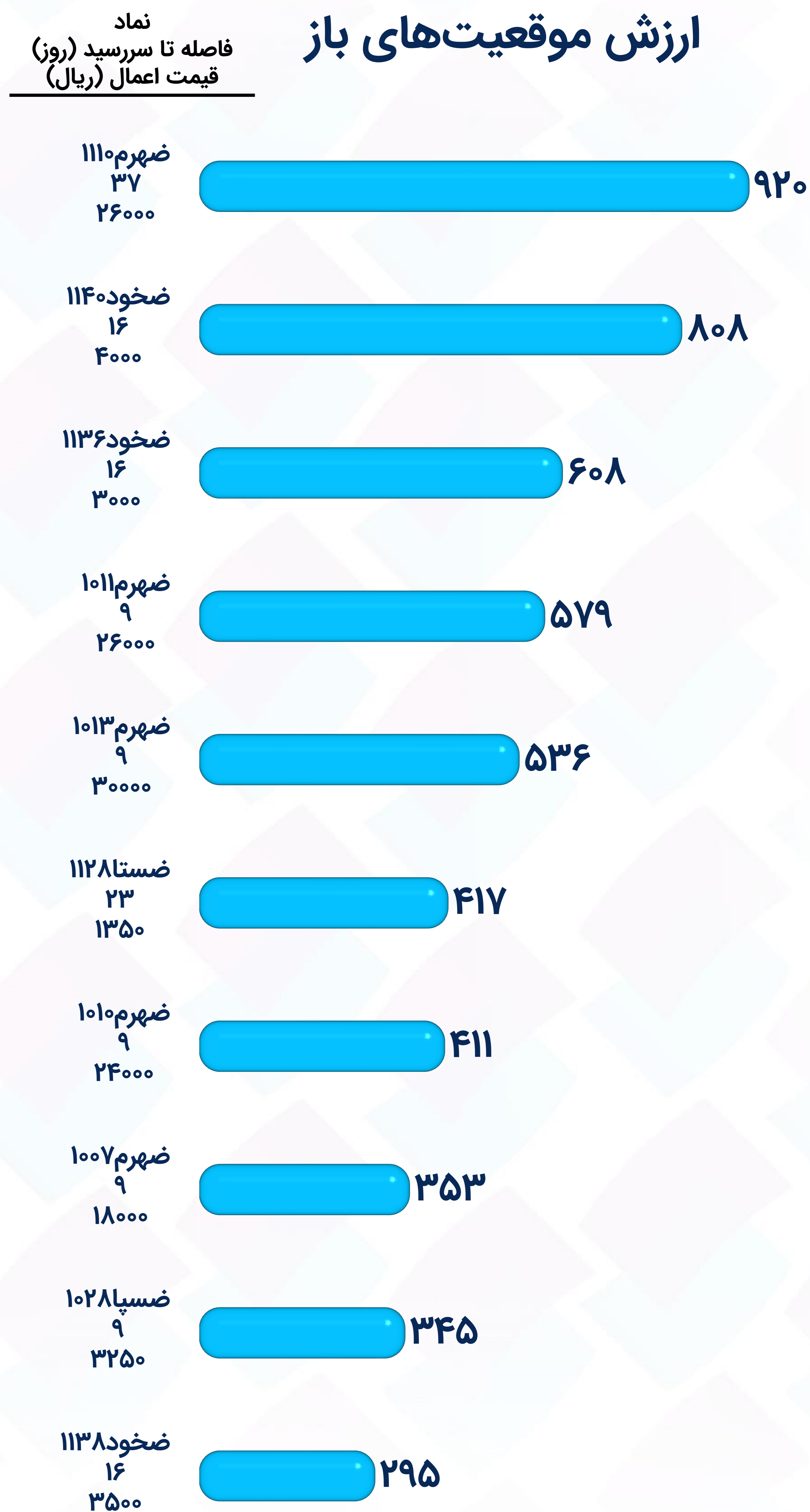
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

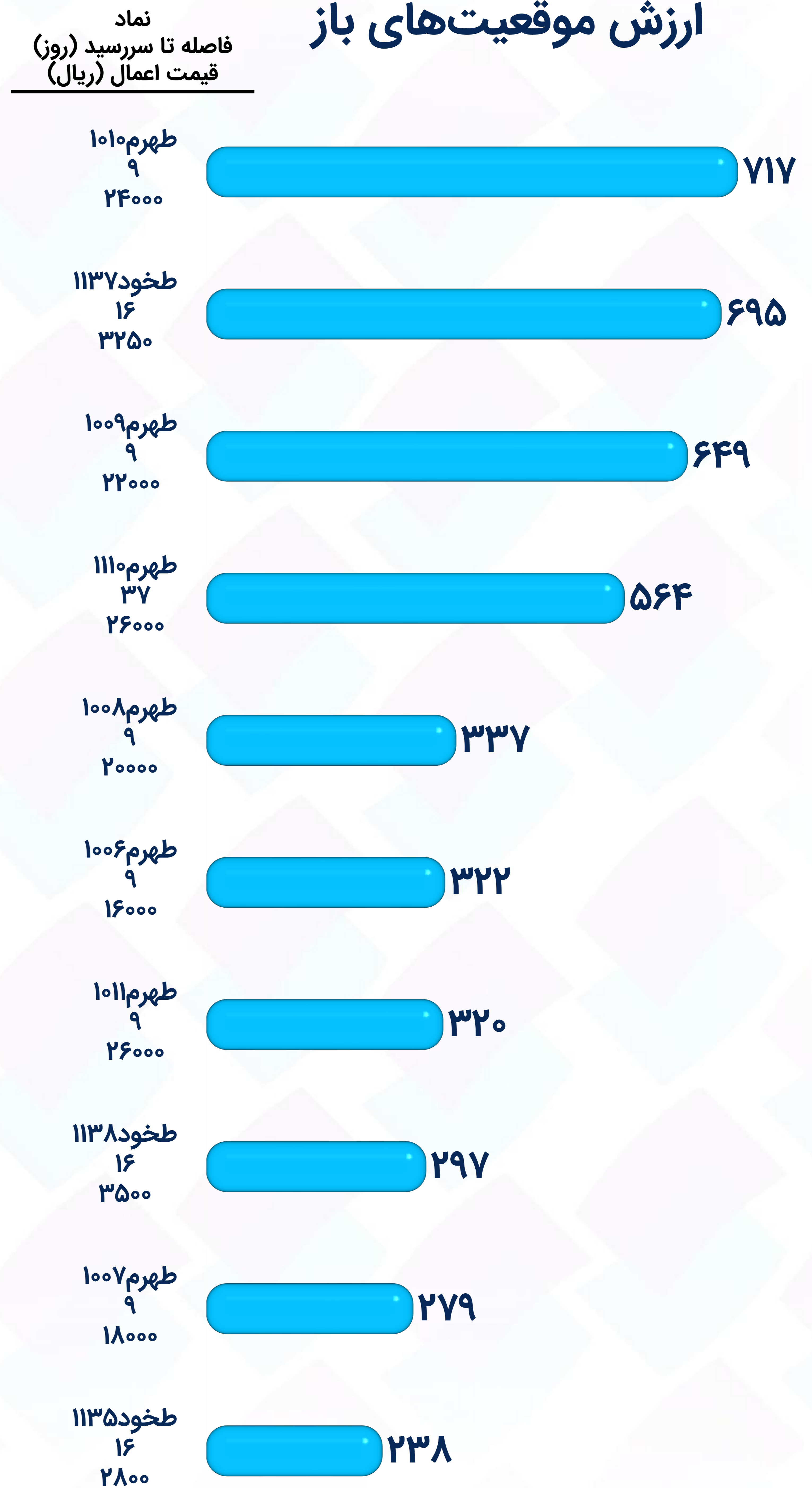
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

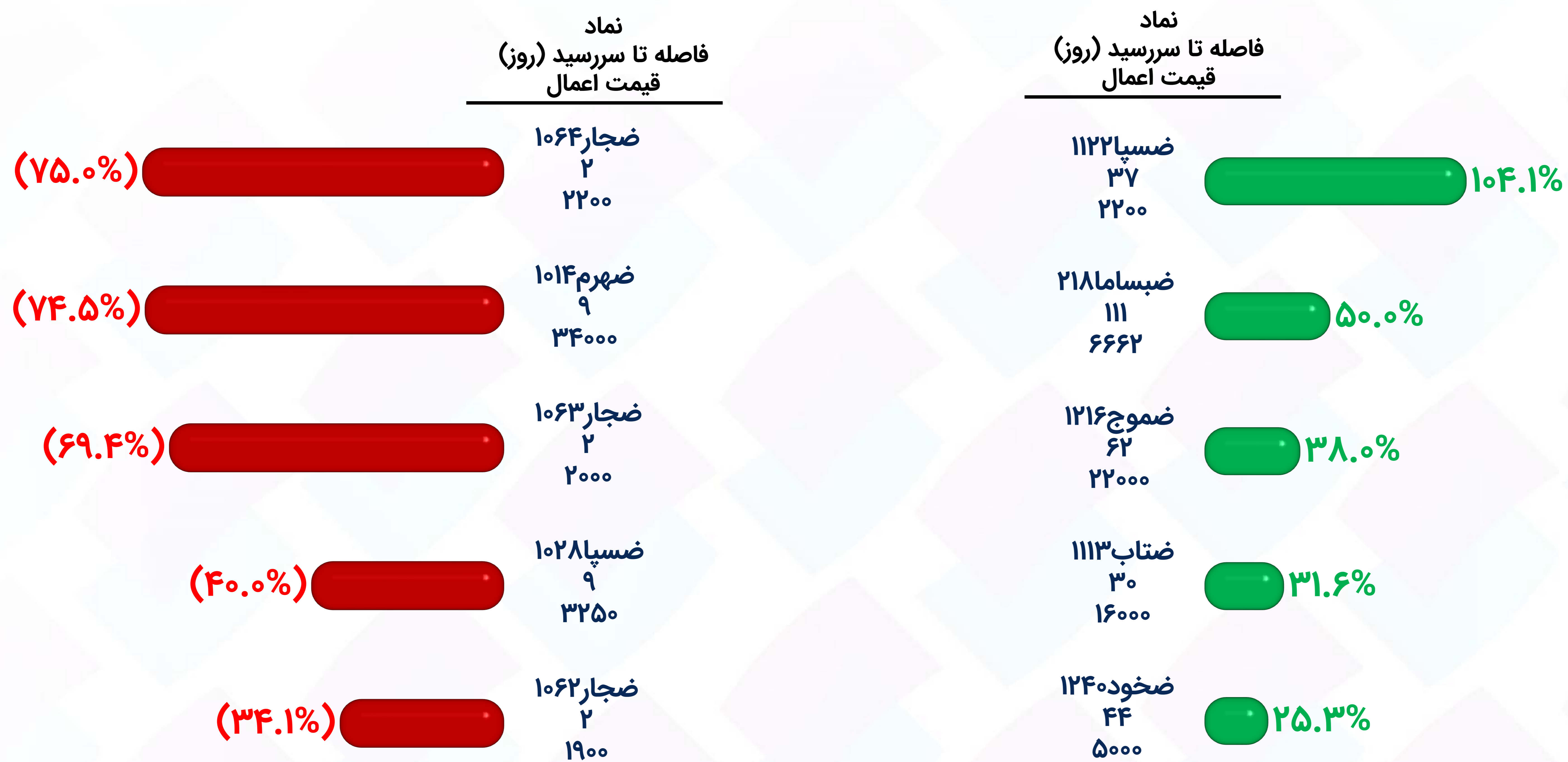


ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

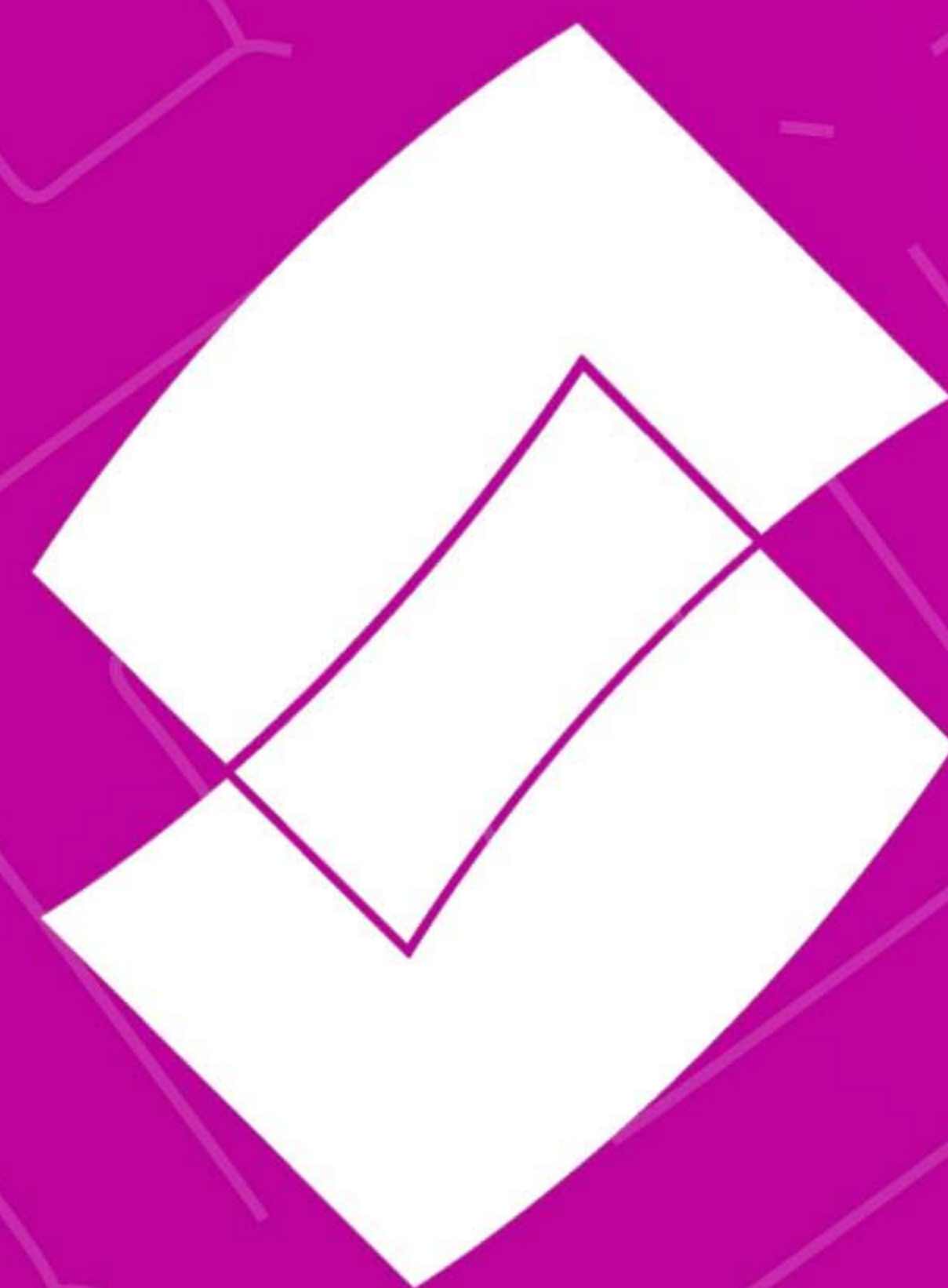
اختیار خرید



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 اخذ تصمیمات مالی و
سرمایه گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.