

شماره
۴۰۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

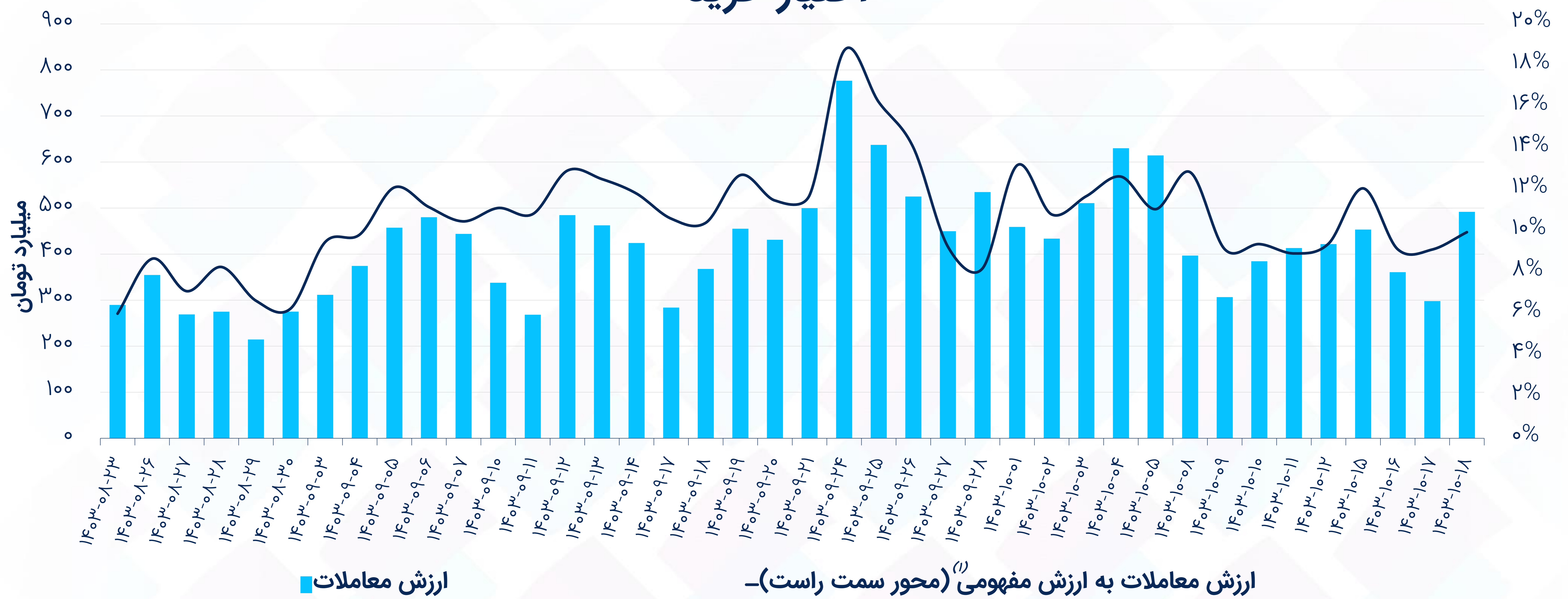




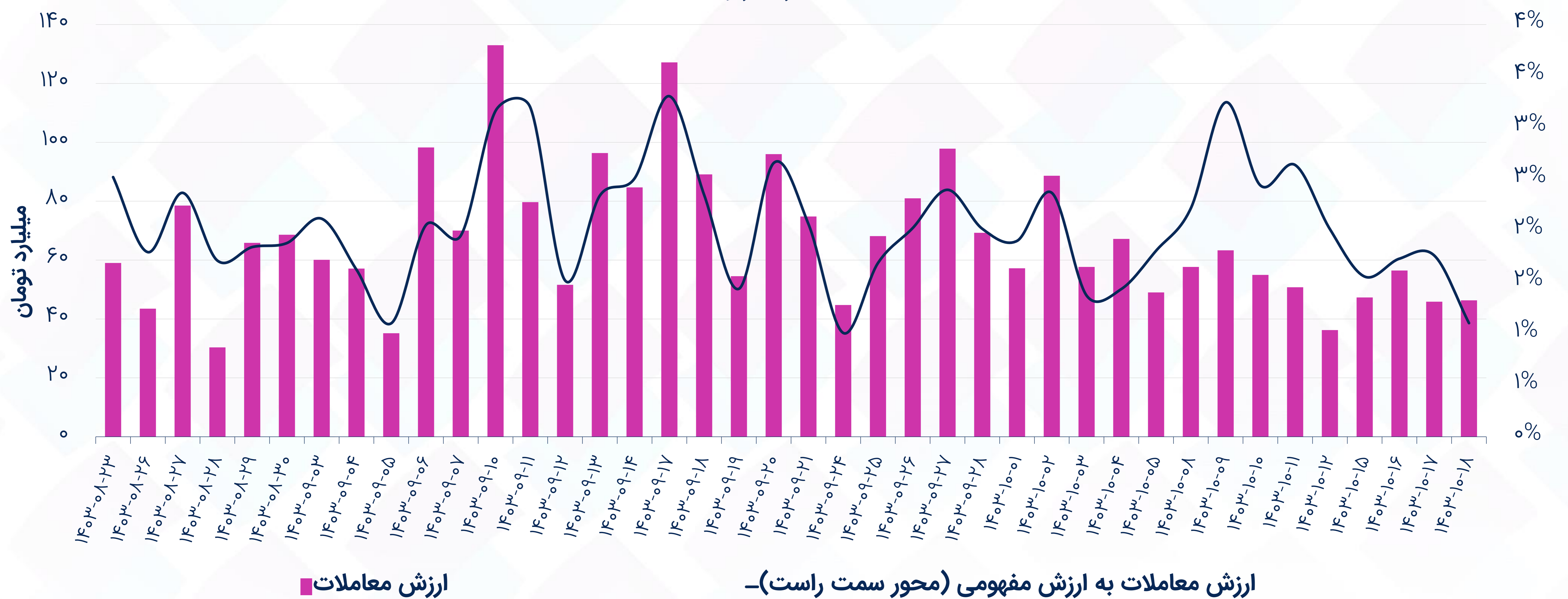
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



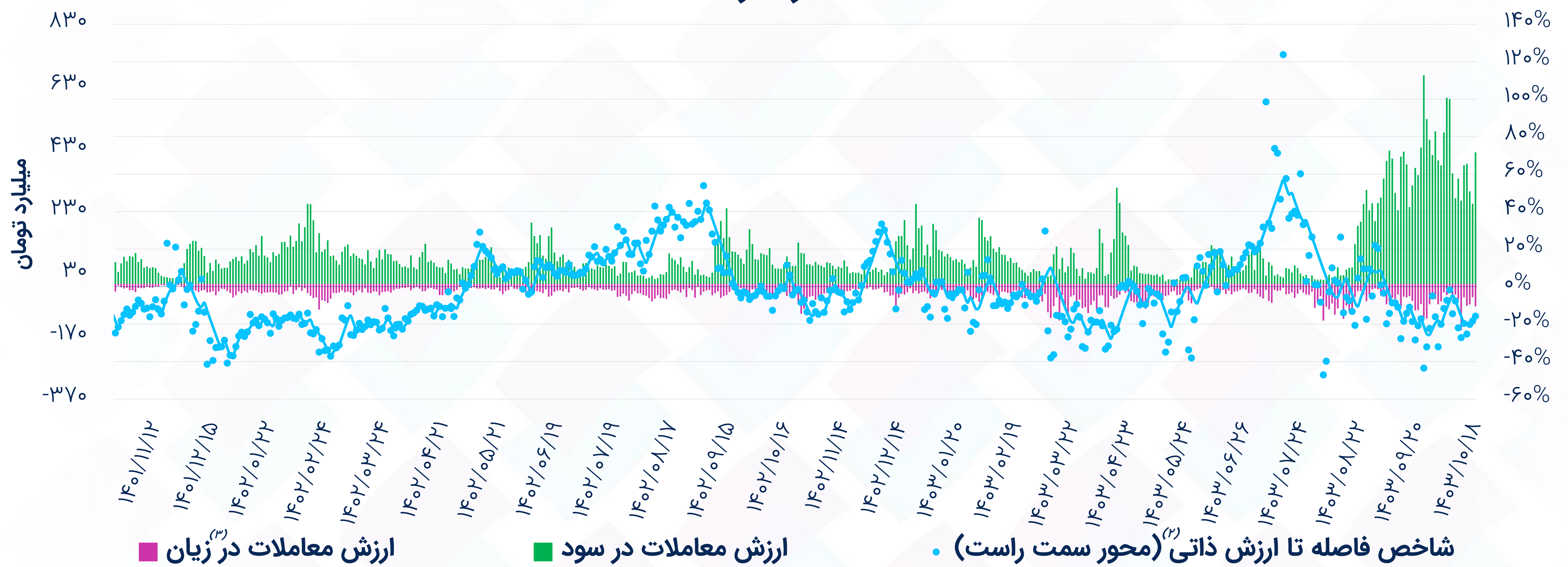
اختیار فروش



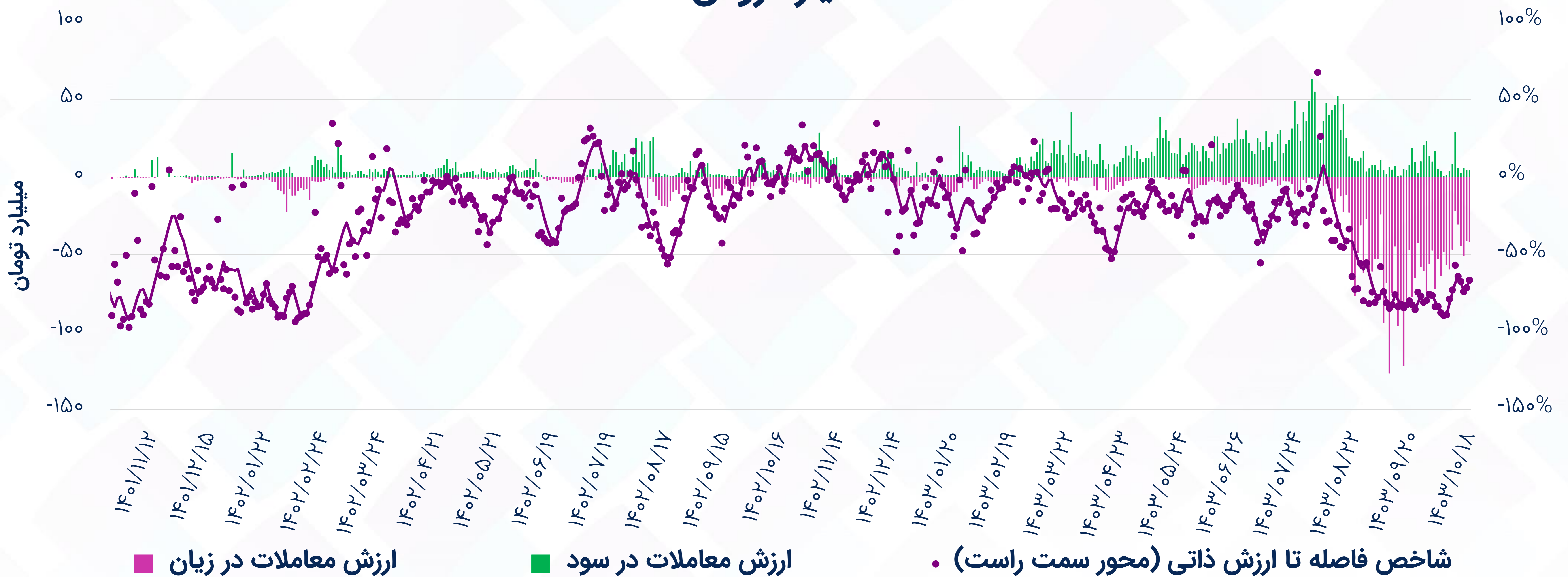
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

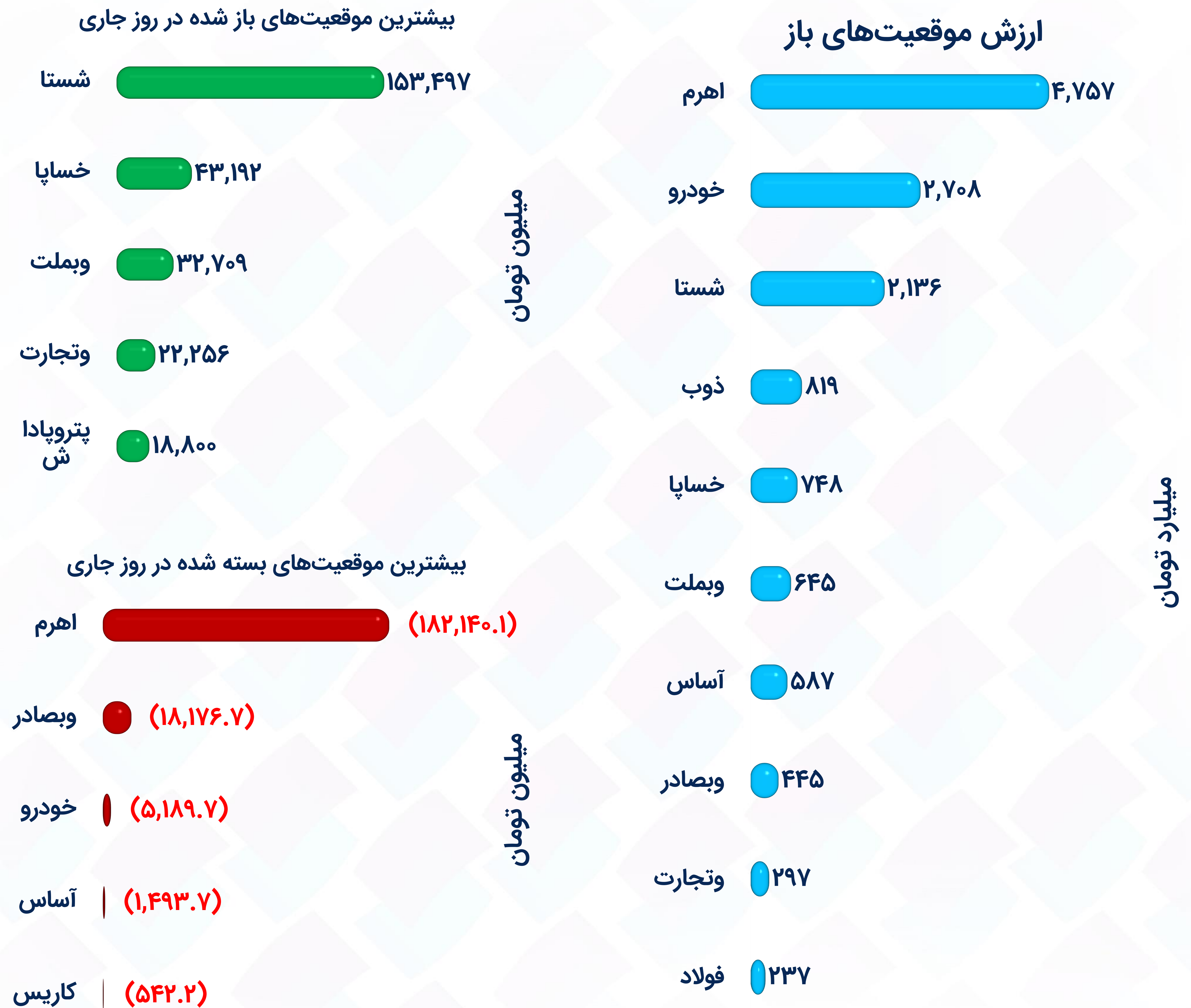
اختیار خرید

| 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 | ۴۲ | ۲۵۲.۱ | ۲,۰۷۱.۳ | ۲۳۶.۰ | ۱۶.۱ | (۱۲.۴%) |
| خودرو | ۳۳ | ۱۲۵.۵ | ۱,۶۶۶.۶ | ۹۳.۱ | ۳۲.۵ | (۱۸.۷%) |
| شستا | ۳۹ | ۴۴.۵ | ۴۸۱.۳ | ۲۹.۵ | ۱۵.۰ | (۳۴.۴%) |
| ذوب | ۲۴ | ۱۵.۲ | ۷۱.۲ | ۱۳.۹ | ۱.۳ | (۱۳.۴%) |
| آساس | ۱۱ | ۱۳.۲ | ۳۴.۲ | ۱۳.۲ | ۰.۰ | (۰.۴%) |
| پتروپاداش | ۱ | ۱۰.۳ | ۳۸.۰ | ۱۰.۳ | ۰.۰ | (۲.۱%) |
| خسپا | ۱۵ | ۷.۱ | ۳۰۲.۶ | ۲.۳ | ۴.۸ | (۳۶.۶%) |

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 | ۱۸ | ۳۳,۷۸۷.۵ | ۲,۹۳۵,۴۴۱.۱ | ۳,۷۴۰.۹ | ۳۰,۰۴۶.۶ | (۶۶.۳%) |
| خودرو | ۸ | ۱۰,۴۷۳.۴ | ۱,۱۳۳,۵۵۸.۱ | ۲۰۳.۱ | ۱۰,۲۷۰.۳ | (۶۴.۶%) |
| شستا | ۱۸ | ۱,۹۳۹.۶ | ۱۲۶,۲۱۴.۴ | ۲۳۵.۸ | ۱,۷۰۳.۸ | (۸۳.۲%) |
| توان | ۲ | ۷۲.۳ | ۱,۹۳۰.۳ | ۰.۰ | ۷۲.۳ | (۶۲.۸%) |
| ذوب | ۴ | ۳۵.۹ | ۱,۲۷۶.۳ | ۲.۲ | ۳۳.۷ | (۸۴.۳%) |
| خودران | ۱ | ۹.۰ | ۱۱۲.۴ | ۰.۰ | ۹.۰ | (۶۱.۱%) |
| وبملت | ۱ | ۶.۶ | ۳۰۵.۸ | ۰.۰ | ۶.۶ | (۸۱.۳%) |

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 موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۲۰,۸۸۴.۷

شستا ۲۷,۵۰۴.۵

توان ۱,۰۲۴.۴

رویین ۵۹۶.۵

فولاد ۴۰۸.۳

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۳,۸۸۸

خودرو ۱,۳۷۲

شستا ۲۹۱

وبملت ۳۱

ذوب ۲۳

رویین ۱۷

آساس ۳

توان ۲.۳۹

اطلس ۲.۰۹

فولاد ۱.۲۵

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۶۰,۰۶۱.۳)

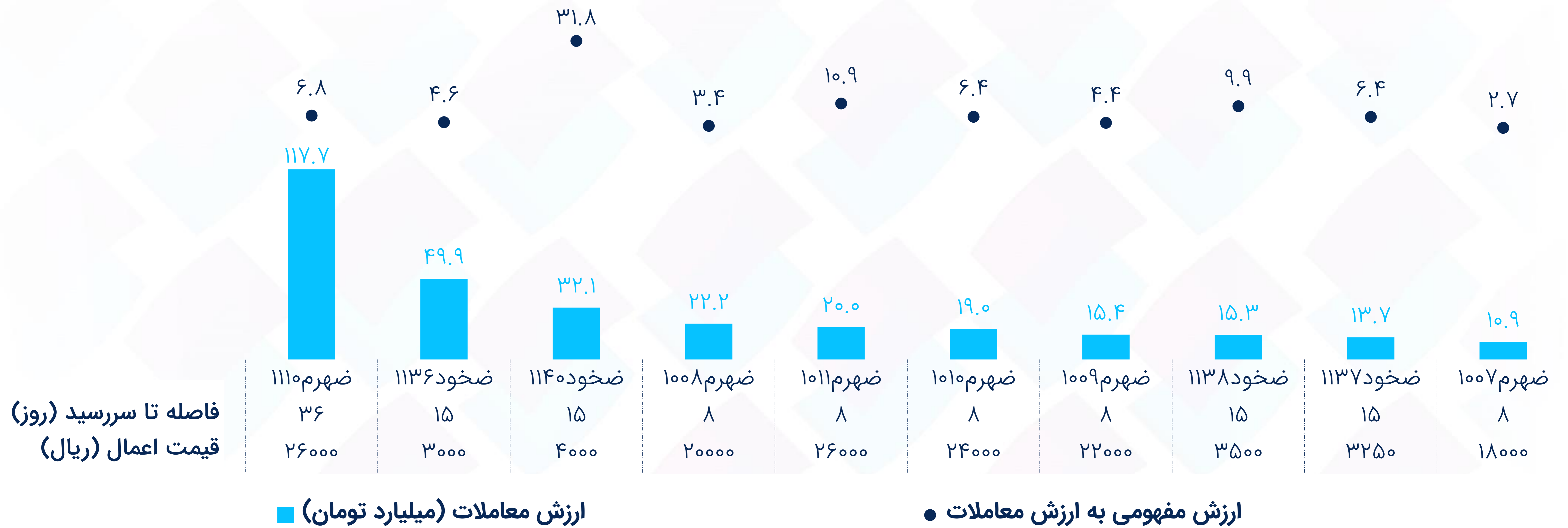
خسپا (۱.۳)

وتجارت (۰.۰)

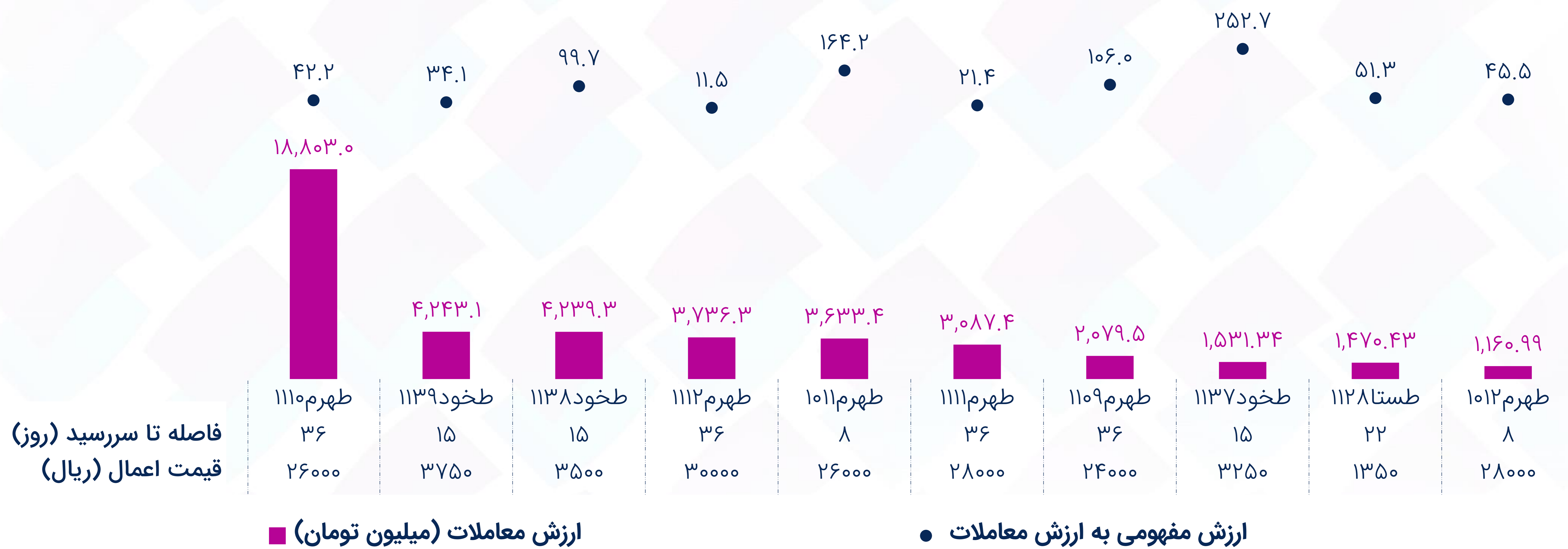
میلیون تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بلک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بلک شولز

| 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 |
|--------------------|----------------------|------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|-------------|
| ۱۰۱% | ۵۰۳ | ۱.۰۰ | ۷.۴ | (۱۰.۰%) | ۱,۸۵۱ | ۲,۰۵۷ | ۲۵۱ | ۲.۵ | ۳۳ | ۱,۶۰۰ | ضسامان ۱۱۱۳ |
| ۵۴% | ۶۱۷ | ۰.۸۷ | ۱۶.۶ | ۱.۲% | ۶,۶۴۶ | ۶,۵۷۰ | ۴۰۰ | ۵.۶ | ۴۷ | ۶,۲۴۶ | ضبساما ۱۲۰۸ |
| ۳۴% | ۱۱,۵۸۳ | ۰.۹۸ | ۶.۱ | ۳.۶% | ۵۲,۶۷۶ | ۵۰,۸۵۴ | ۸,۶۷۶ | ۱.۷ | ۱۳۱ | ۴۴,۰۰۰ | ضاساس ۲۰۷ |
| ۲۶% | ۱,۶۳۶ | ۰.۹۹ | ۵.۲ | ۲.۲% | ۶,۷۱۳ | ۶,۵۷۰ | ۱,۳۰۰ | ۱۰.۹ | ۱۱۰ | ۵,۴۱۳ | ضبساما ۲۱۵ |
| ۲۳% | ۴,۳۸۲ | ۰.۷۷ | ۸.۹ | ۱۱.۱% | ۳۱,۵۵۰ | ۲۸,۴۰۰ | ۳,۵۵۰ | ۱۷.۸ | ۱۳۴ | ۲۸,۰۰۰ | ضهرم ۲۰۱۸ |

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 | ۰.۰۰ | ۱۲۶.۰ | ۷۹% | ۱,۰۰۸ | ۵۶۴ | ۸ | ۱۴.۷ | ۳۶ | ۱,۰۰۰ | ضذوب ۱۱۳۵ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۹۱.۰ | ۶۱% | ۹۱۰ | ۵۶۴ | ۱۰ | ۱.۷ | ۳۶ | ۹۰۰ | ضذوب ۱۱۳۴ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۸.۱ | ۴۴% | ۸۱۴ | ۵۶۴ | ۱۴ | ۱۱۱.۸ | ۳۶ | ۸۰۰ | ضذوب ۱۱۳۳ |
| (۹۹%) | ۰ | ۰.۰۱ | ۱۲۸.۳ | ۲۷% | ۲,۸۲۲ | ۲,۲۲۰ | ۲۲ | ۱۴۶.۲ | ۲۹ | ۲,۸۰۰ | ضصاد ۱۱۶۰ |
| (۹۸%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۱,۱۷۳.۴ | ۲۰% | ۳۴,۰۲۹ | ۲۸,۴۰۰ | ۲۹ | ۶.۰ | ۸ | ۳۴,۰۰۰ | ضهرم ۱۰۱۴ |

(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

| 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 ۱۱۱۳ | اهرم | ۳۶ | ۱.۲ | ۶,۰۰۰ | ۲۸,۴۰۰ | ۲۸,۰۰۰ | (۱.۴%) | ۴.۷ | -۰.۹۰ | ۴,۶۷۱ | (۲۲.۱%) |
| طخود ۱۱۴۰ | خودرو | ۱۵ | ۲۰۳.۱ | ۲۶۶ | ۳,۷۹۰ | ۳,۷۳۴ | (۱.۵%) | ۱۴.۰ | -۰.۷۰ | ۱۹۹ | (۲۵.۱%) |
| طهرم ۱۱۱۲ | اهرم | ۳۶ | ۳,۷۳۶.۳ | ۲,۴۶۳ | ۲۸,۴۰۰ | ۲۷,۵۳۷ | (۳.۰%) | ۱۱.۲ | -۰.۵۶ | ۱,۶۲۲ | (۳۴.۲%) |
| طهرم ۱۰۱۴ | اهرم | ۸ | ۳.۴ | ۸,۳۷۵ | ۲۸,۴۰۰ | ۲۵,۶۲۵ | (۹.۸%) | ۳.۱ | -۱.۰۰ | ۵,۳۳۰ | (۳۶.۴%) |
| طهرم ۱۰۱۲ | اهرم | ۸ | ۱,۱۶۱.۰ | ۶۲۴ | ۲۸,۴۰۰ | ۲۷,۳۷۶ | (۳.۶%) | ۴۳.۹ | -۰.۳۳ | ۳۵۷ | (۴۲.۷%) |

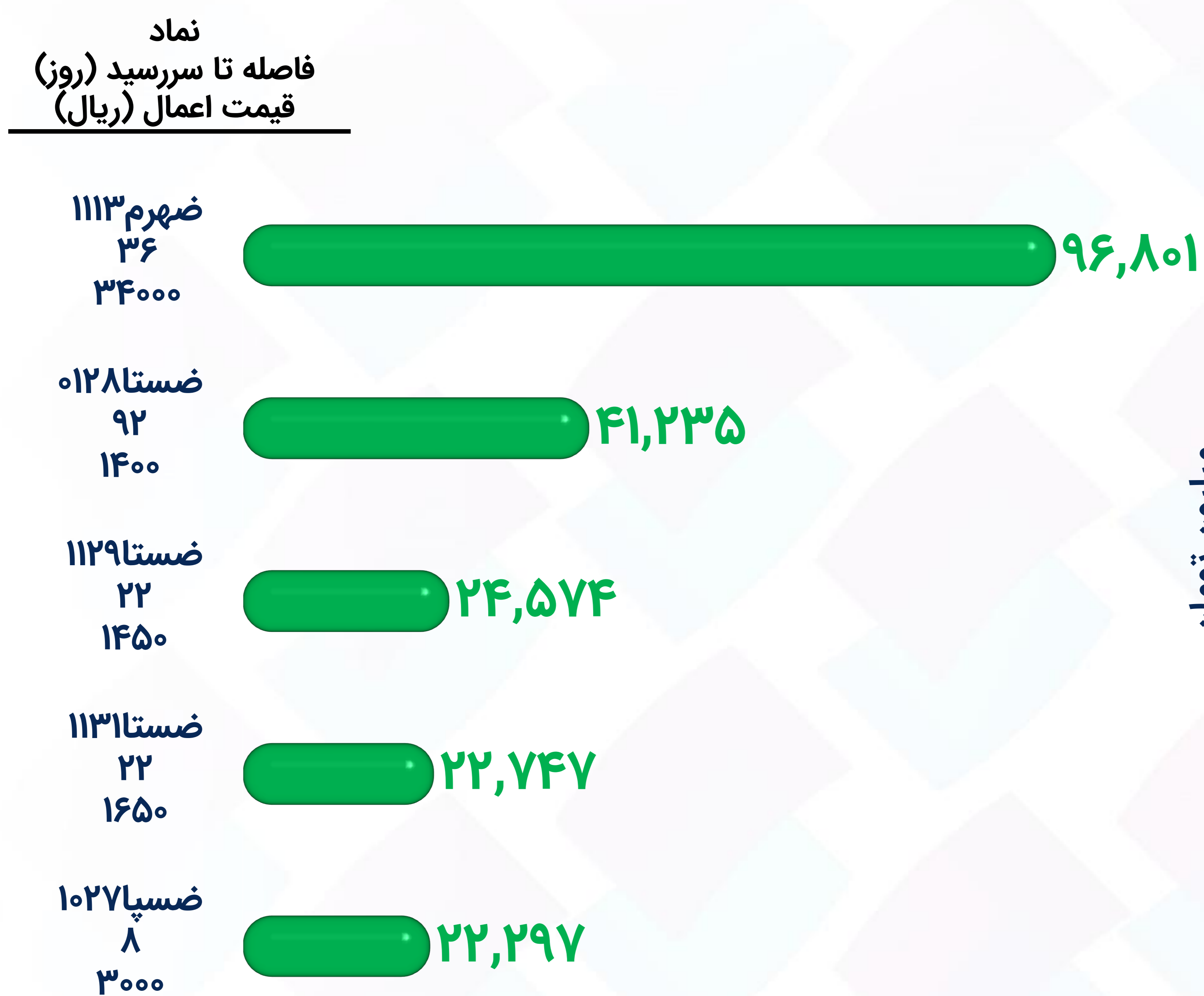
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

| 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 ۱۰۰۵ | اهرم | ۸ | ۳.۳ | ۷ | ۲۸,۴۰۰ | ۱۴,۹۹۳ | (۴۷.۲%) | ۲,۱۴۱.۹ | ۰.۰۰ | ۰ | (۱۰۰.۰%) |
| طستا ۱۱۲۳ | شستا | ۲۲ | ۱.۶ | ۲ | ۱,۴۳۷ | ۸۴۸ | (۴۱.۰%) | ۴۲۴.۰ | ۰.۰۰ | ۰ | (۱۰۰.۰%) |
| طهرم ۱۰۰۶ | اهرم | ۸ | ۳۸.۴ | ۸ | ۲۸,۴۰۰ | ۱۵,۹۹۲ | (۴۳.۷%) | ۱,۹۹۹.۰ | ۰.۰۰ | ۰ | (۱۰۰.۰%) |
| طهرم ۱۰۰۷ | اهرم | ۸ | ۴۲.۹ | ۲۱ | ۲۸,۴۰۰ | ۱۷,۹۷۹ | (۳۶.۷%) | ۸۵۶.۱ | ۰.۰۰ | ۰ | (۱۰۰.۰%) |
| طستا ۱۱۲۴ | شستا | ۲۲ | ۴.۲ | ۳ | ۱,۴۳۷ | ۹۴۷ | (۳۴.۱%) | ۳۱۵.۷ | ۰.۰۰ | ۰ | (۱۰۰.۰%) |

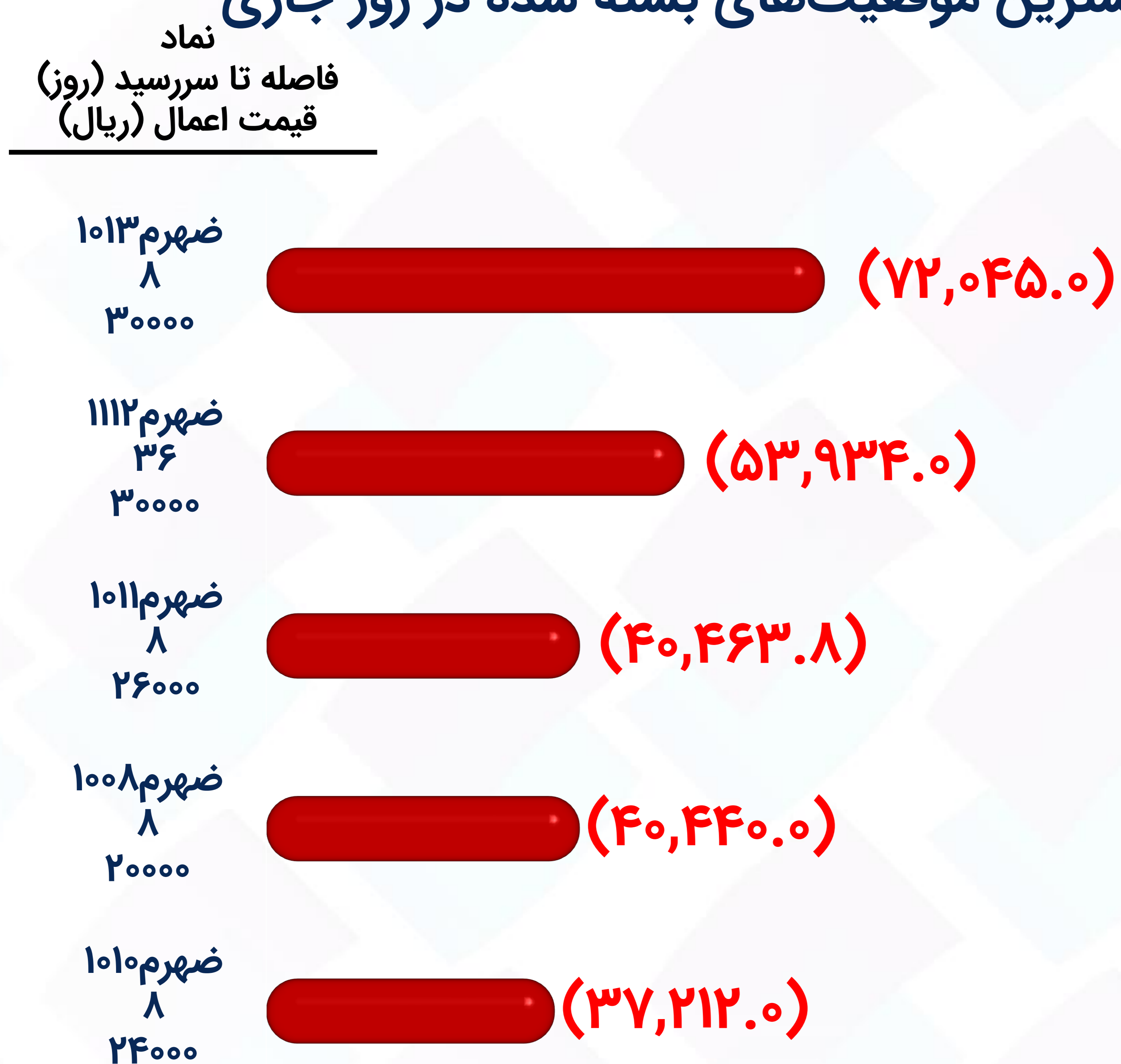
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

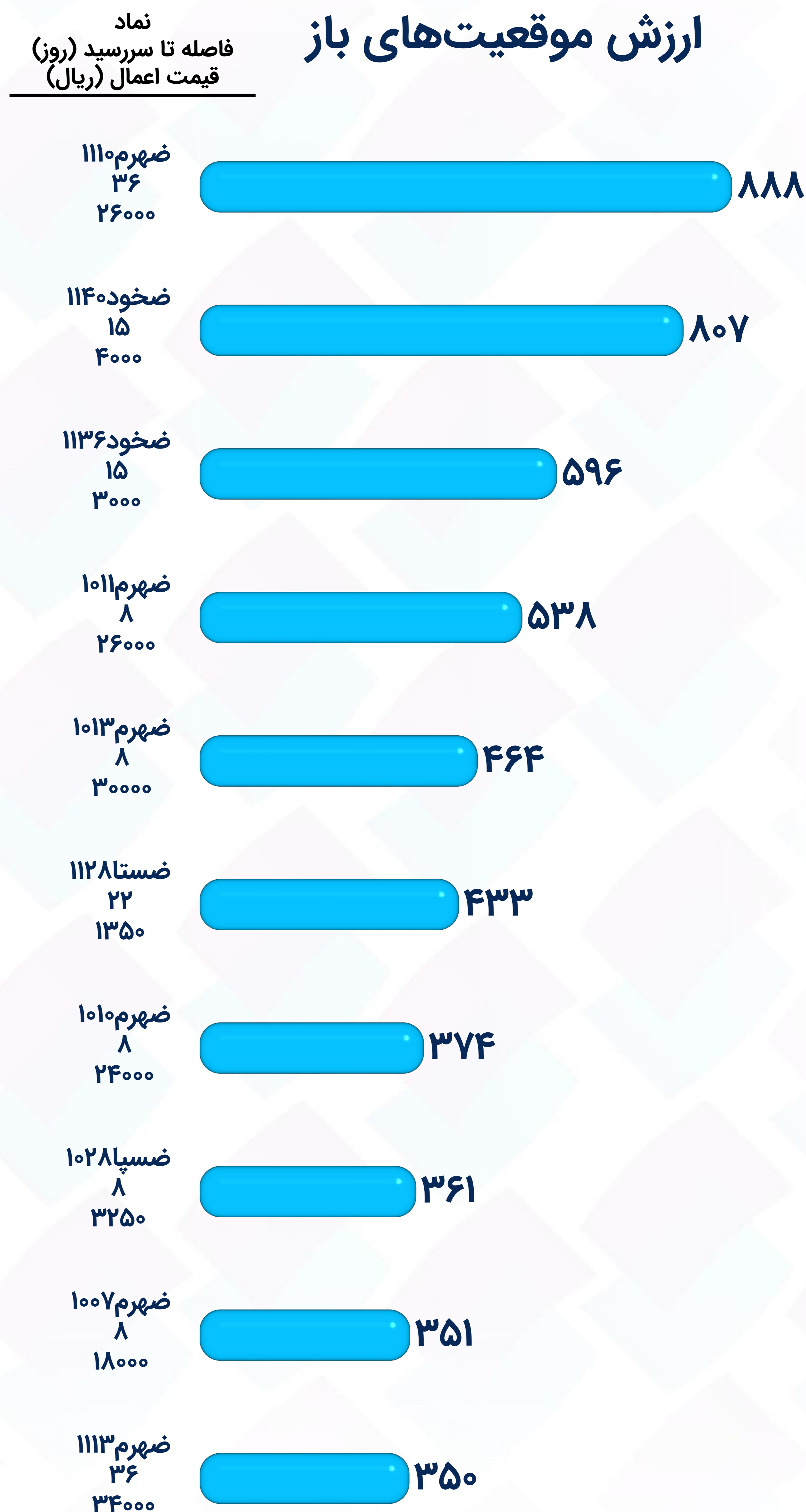
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز

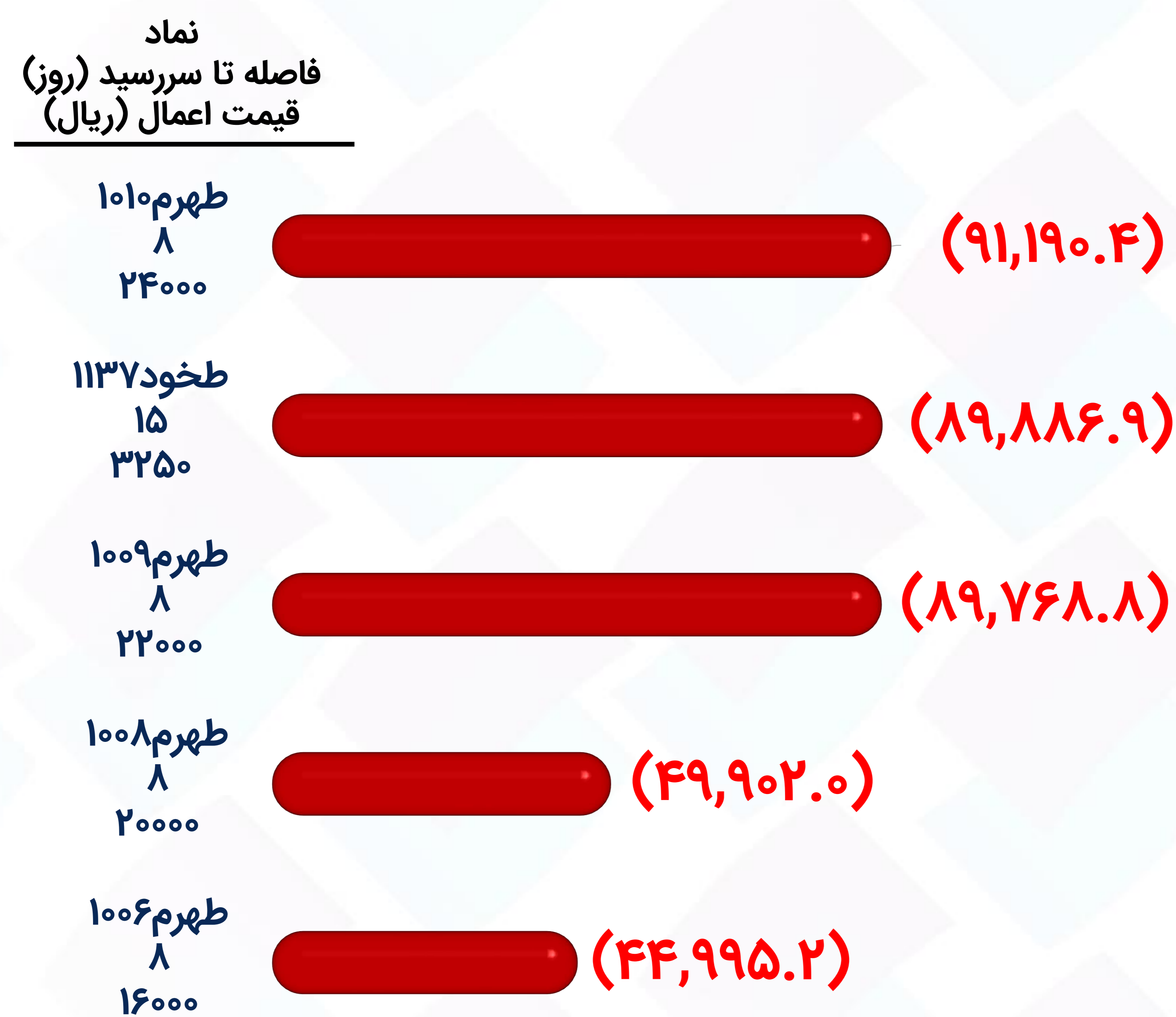


موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

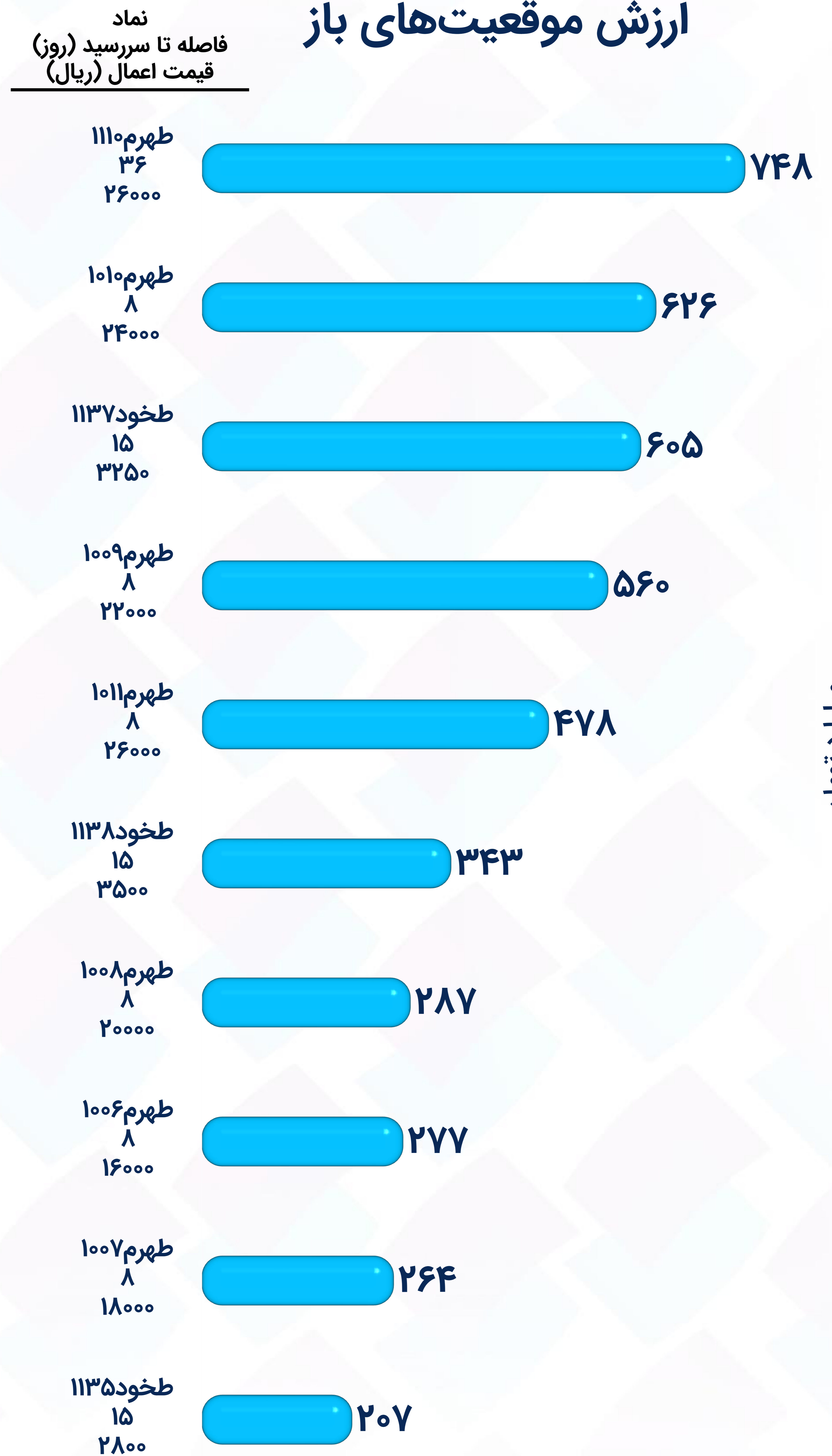
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

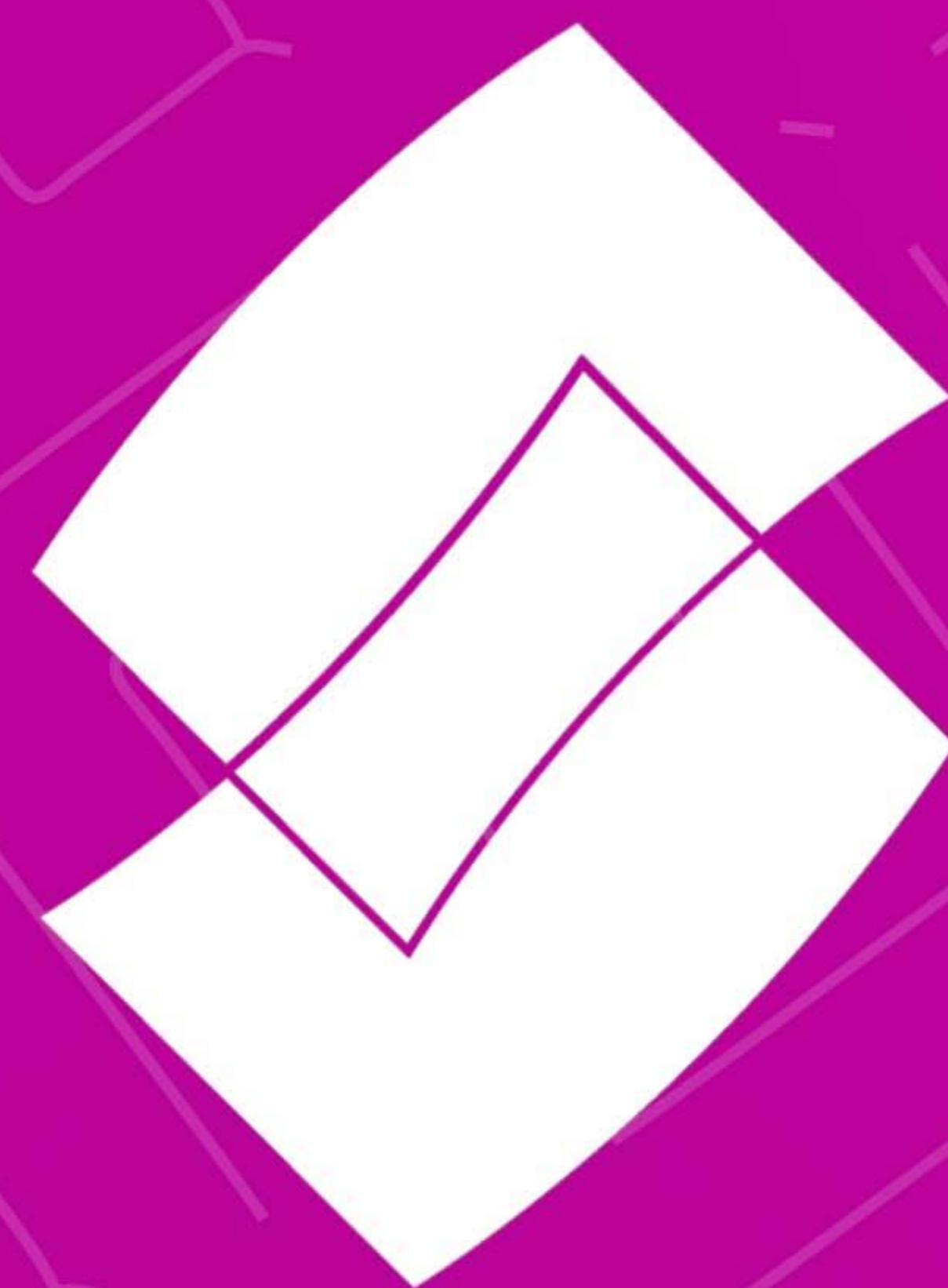
اختیار خرید



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