

شماره
۴۰۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۹ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

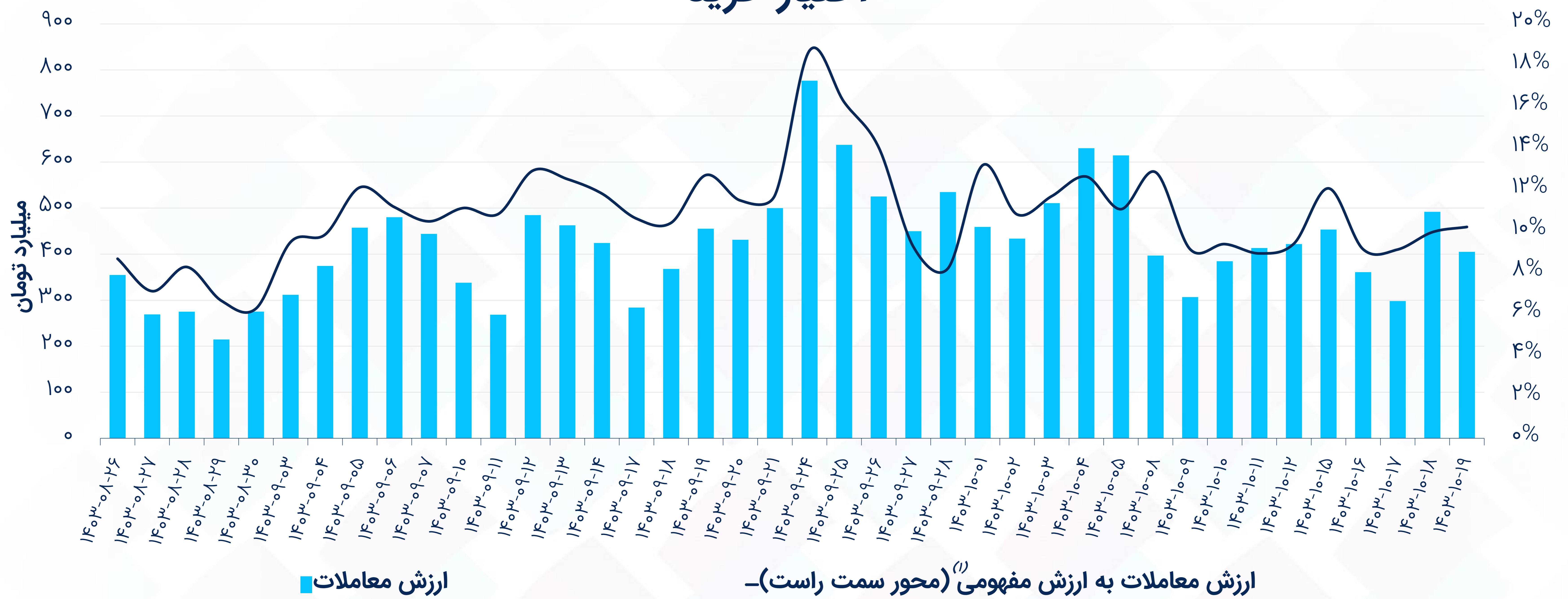




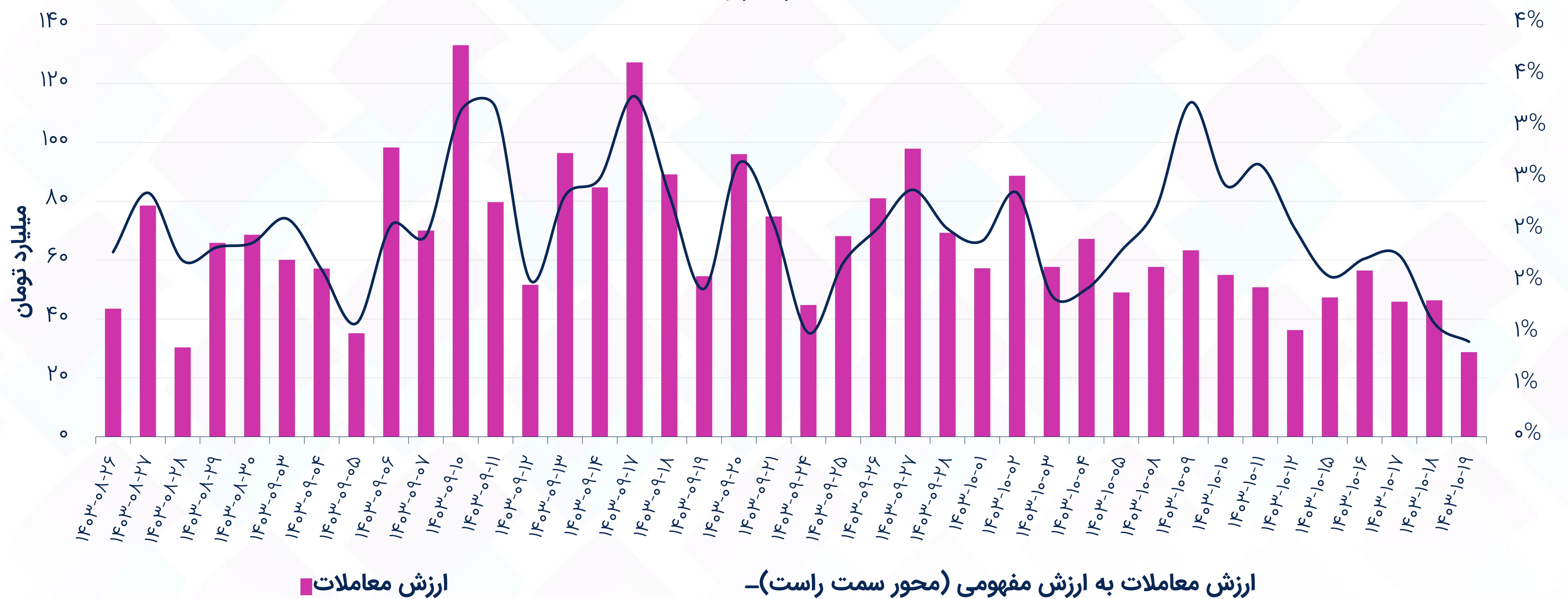
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



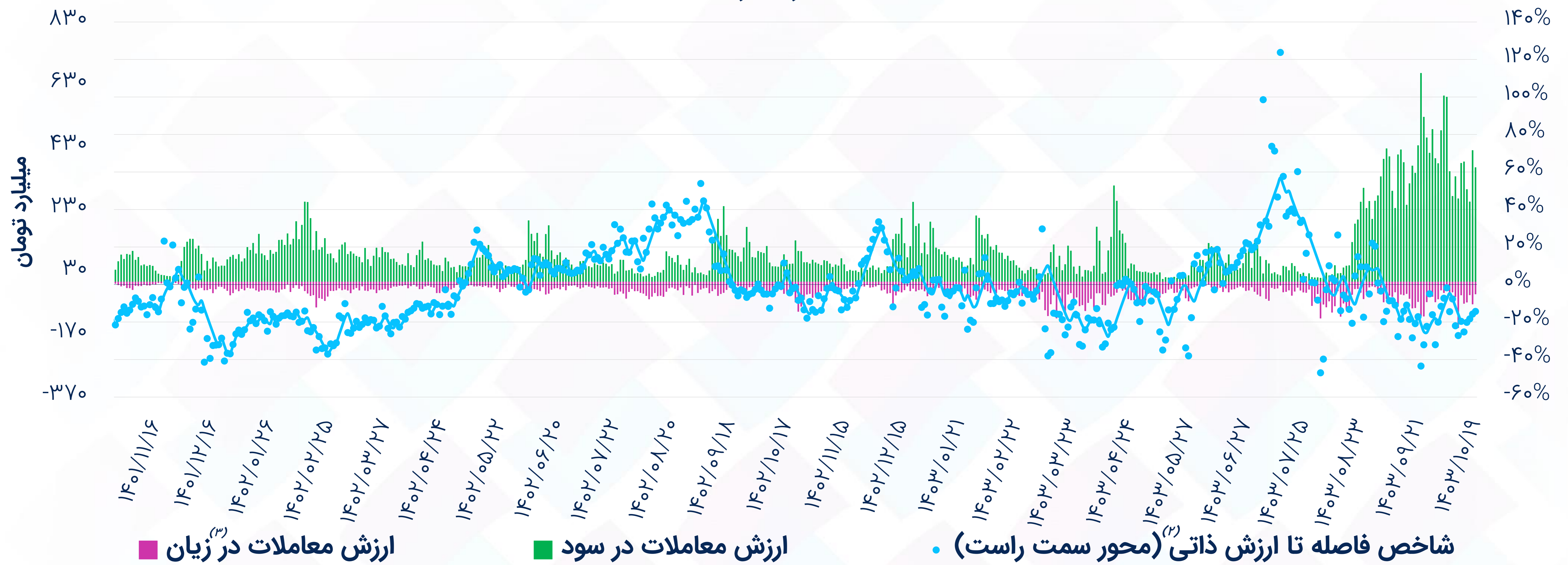
اختیار فروش



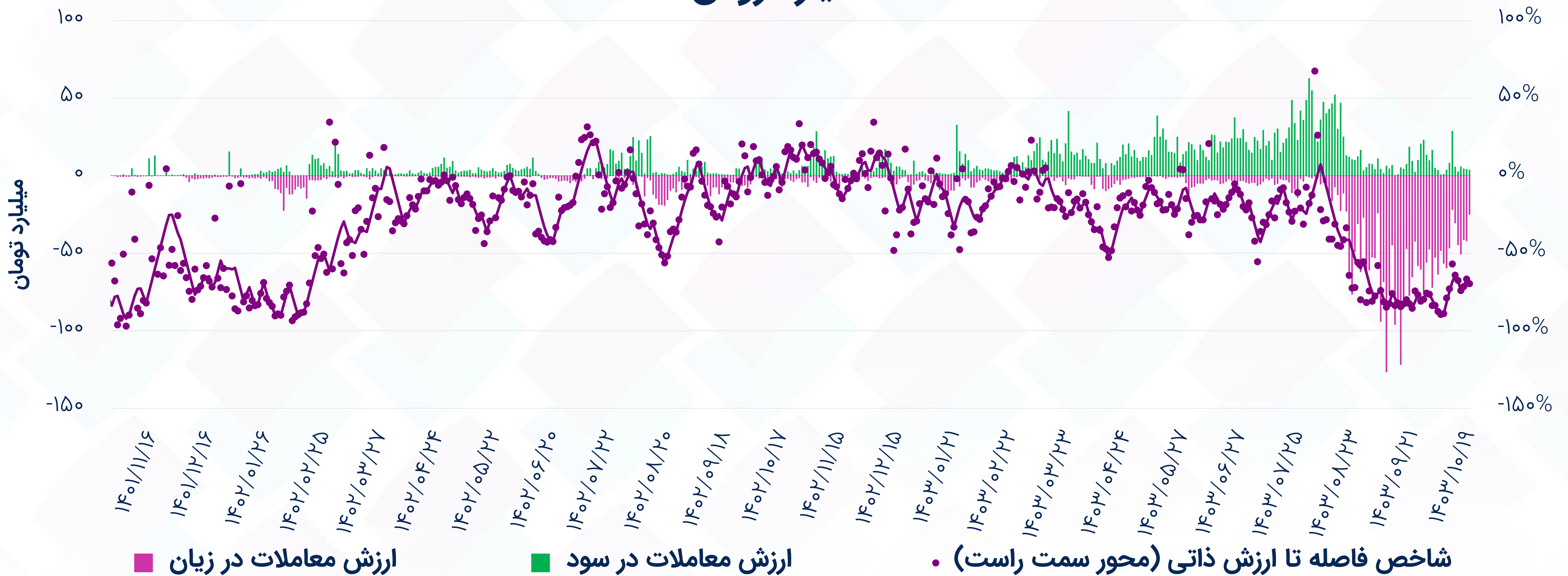
(1) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۴	۲۷۳.۲	۲,۲۹۶.۴	۲۴۷.۶	۲۵.۷	(۱۲.۰%)
شستا	۳۷	۴۹.۱	۵۳۸.۶	۴۰.۷	۸.۴	(۳۱.۴%)
خسپا	۲۲	۳۰.۶	۶۶۰.۵	۲۸.۸	۱.۸	(۱۸.۲%)
ذوب	۱۹	۱۳.۶	۶۸.۲	۱۲.۲	۱.۴	(۱۴.۹%)
وتجارت	۱۳	۱۰.۶	۲۳۳.۰	۱۰.۱	۰.۵	۱۵.۰%
وبملت	۱۴	۸.۰	۷۴.۸	۷.۰	۱.۰	(۲۸.۰%)
پادا	۱	۴.۶	۱۵.۰	۴.۶	۰.۰	(۱.۹%)

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	۲۰	۲۶,۳۲۳.۱	۲,۹۶۹,۴۳۹.۱	۳,۶۸۰.۶	۲۲,۶۴۲.۶	(۶۸.۴%)
شستا	۱۹	۲,۲۰۷.۵	۱۲۹,۸۵۲.۲	۰.۰	۲,۲۰۷.۵	(۸۳.۳%)
وبملت	۲	۹۹.۱	۴,۶۱۱.۹	۰.۰	۹۹.۱	(۸۵.۷%)
ذوب	۴	۹۳.۵	۳,۸۰۹.۸	۷.۱	۸۶.۴	(۸۶.۰%)
رویین	۲	۸.۷	۵,۴۴۲.۸	۰.۰	۸.۷	(۱۰۰.۰%)
توان	۲	۶.۲	۳۰۲.۸	۰.۰	۶.۲	(۸۳.۲%)
فولاد	۱	۴.۱	۷۸۷.۵	۰.۰	۴.۱	(۱۰۰.۰%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



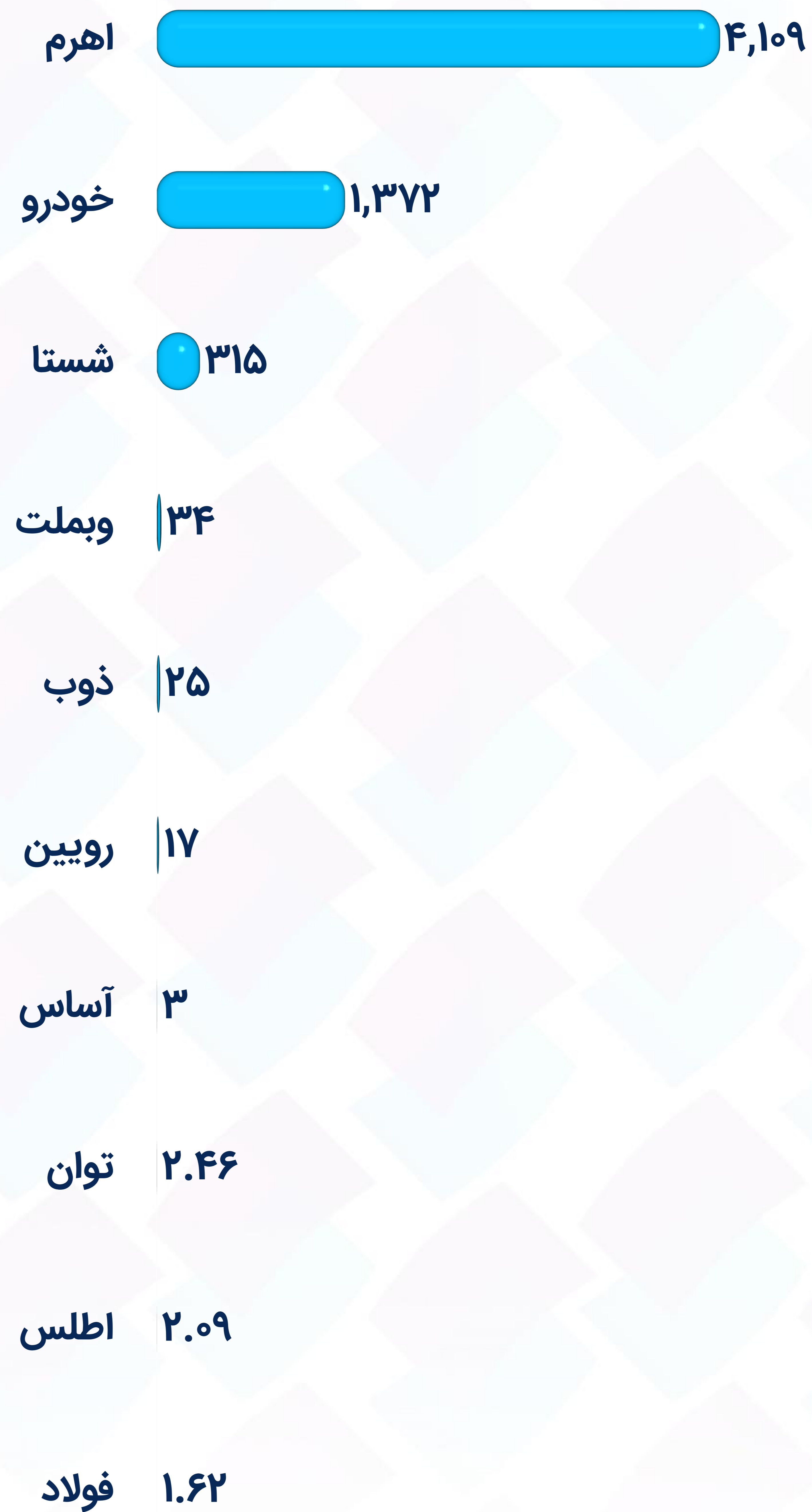
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



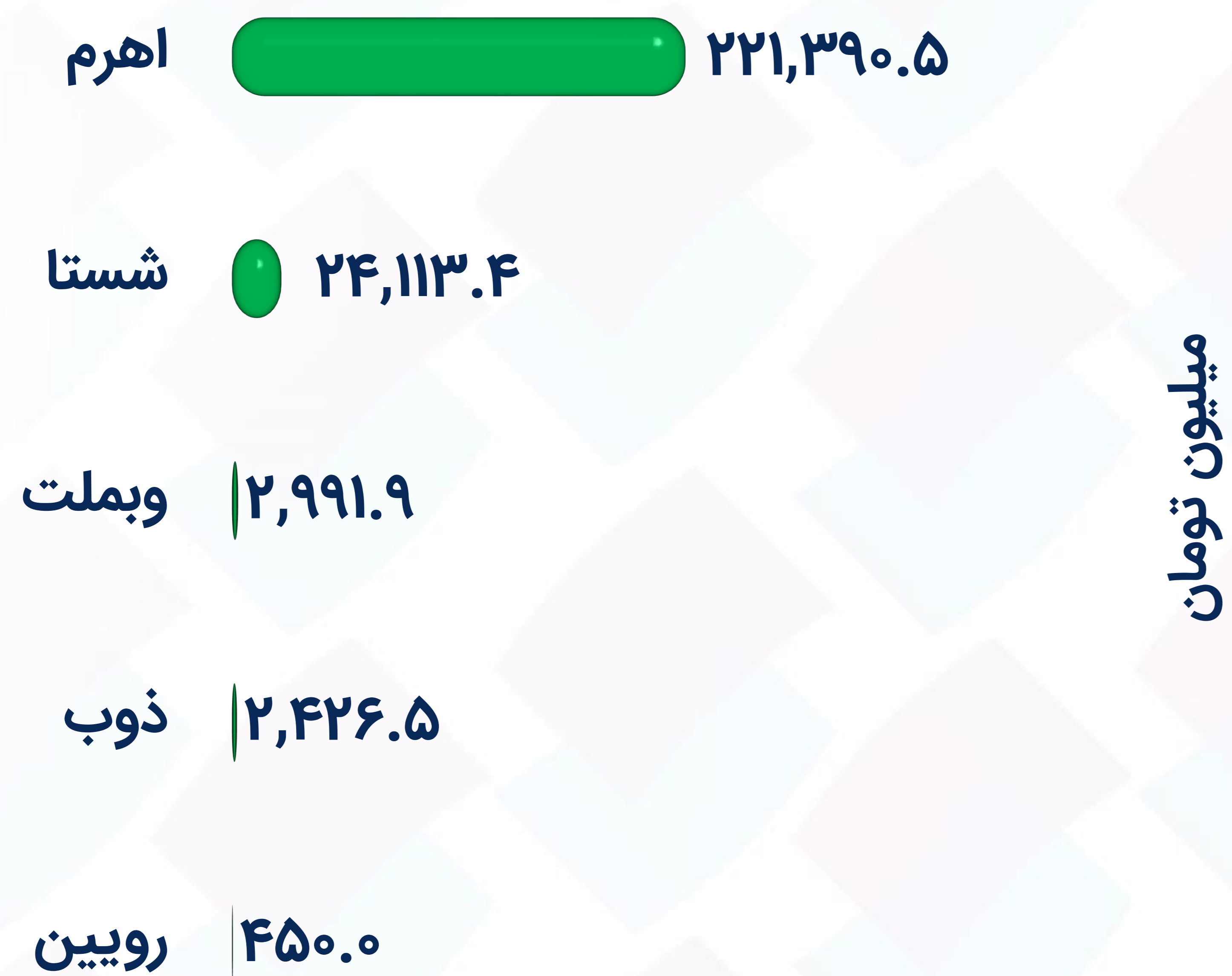
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



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
۶۱%	۸,۰۴۷	۰.۹۹	۵.۰	(۷.۵%)	۲۵,۰۰۰	۲۷,۰۲۰	۵,۰۰۰	۲.۵	۶۰	۲۰,۰۰۰	ضنوان ۱۲۱۸
۲۸%	۶,۸۹۷	۱.۰۰	۹.۳	(۲.۱%)	۵۰,۳۹۳	۵۱,۴۸۷	۵,۳۹۳	۱۰۶.۲	۱۱	۴۵,۰۰۰	ضاساس ۱۰۰۵
۲۴%	۲,۶۷۰	۱.۰۰	۶.۱	(۳.۱%)	۱۳,۱۵۰	۱۳,۵۷۰	۲,۱۵۰	۱۳.۳	۱۱	۱۱,۰۰۰	ضرویین ۱۰۰۵
۲۰%	۱,۶۳۱	۰.۹۹	۵.۰	۳.۰%	۶,۷۷۷	۶,۵۸۰	۱,۳۶۴	۱۱۶.۰	۱۰۹	۵,۴۱۳	ضبساما ۲۱۵
۱۸%	۲,۰۱۰	۱.۰۰	۳.۹	۱.۹%	۶,۷۰۳	۶,۵۸۰	۱,۷۰۷	۷۳.۸	۱۰۹	۴,۹۹۶	ضبساما ۲۱۴

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	۷۸%	۱,۰۰۸	۵۶۶	۸	۸.۳	۳۵	۱,۰۰۰	ضذوب ۱۱۳۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۷۶.۰	۶۱%	۹۱۲	۵۶۶	۱۲	۵.۶	۳۵	۹۰۰	ضذوب ۱۱۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۵۴.۳	۴۴%	۸۱۵	۵۶۶	۱۵	۱۴.۵	۳۵	۸۰۰	ضذوب ۱۱۳۳
(۹۸%)	۱	۰.۰۰	۸۳۰.۳	۱۷%	۳۴,۰۴۱	۲۹,۱۲۰	۴۱	۱۱۴.۲	۷	۳۴,۰۰۰	ضهرم ۱۰۱۴
(۹۷%)	۳	۰.۰۳	۳۸.۵	۲۶%	۳,۸۵۰	۳,۰۵۲	۱۰۰	۲.۵	۳۵	۳,۷۵۰	ضسپا ۱۱۲۹

(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
(۳.۵%)	۴,۰۸۱	-۰.۸۶	۷.۰	۲.۲%	۲۹,۷۷۱	۲۹,۱۲۰	۴,۲۲۹	۲۵۷.۵	۳۵	۳۴,۰۰۰	طهرم ۱۱۱۳
(۱۰.۳%)	۹۹۹	-۰.۶۷	۲۶.۰	(۰.۸%)	۲۸,۸۸۷	۲۹,۱۲۰	۱,۱۱۳	۲۰۶.۶	۷	۳۰,۰۰۰	طهرم ۱۰۱۳
(۴۲.۱%)	۱,۲۵۶	-۰.۴۸	۱۲.۸	(۴.۴%)	۲۷,۸۳۰	۲۹,۱۲۰	۲,۱۷۰	۳,۲۱۶.۵	۳۵	۳۰,۰۰۰	طهرم ۱۱۱۲
(۴۹.۴%)	۳۴	-۰.۵۸	۷.۸	(۶.۰%)	۵۳۲	۵۶۶	۶۸	۷.۱	۳۵	۶۰۰	طذوب ۱۱۳۱
(۵۴.۳%)	۱۴۳	-۰.۱۸	۸۸.۲	(۴.۹%)	۲۷,۶۸۶	۲۹,۱۲۰	۳۱۴	۲,۰۹۶.۰	۷	۲۸,۰۰۰	طهرم ۱۰۱۲

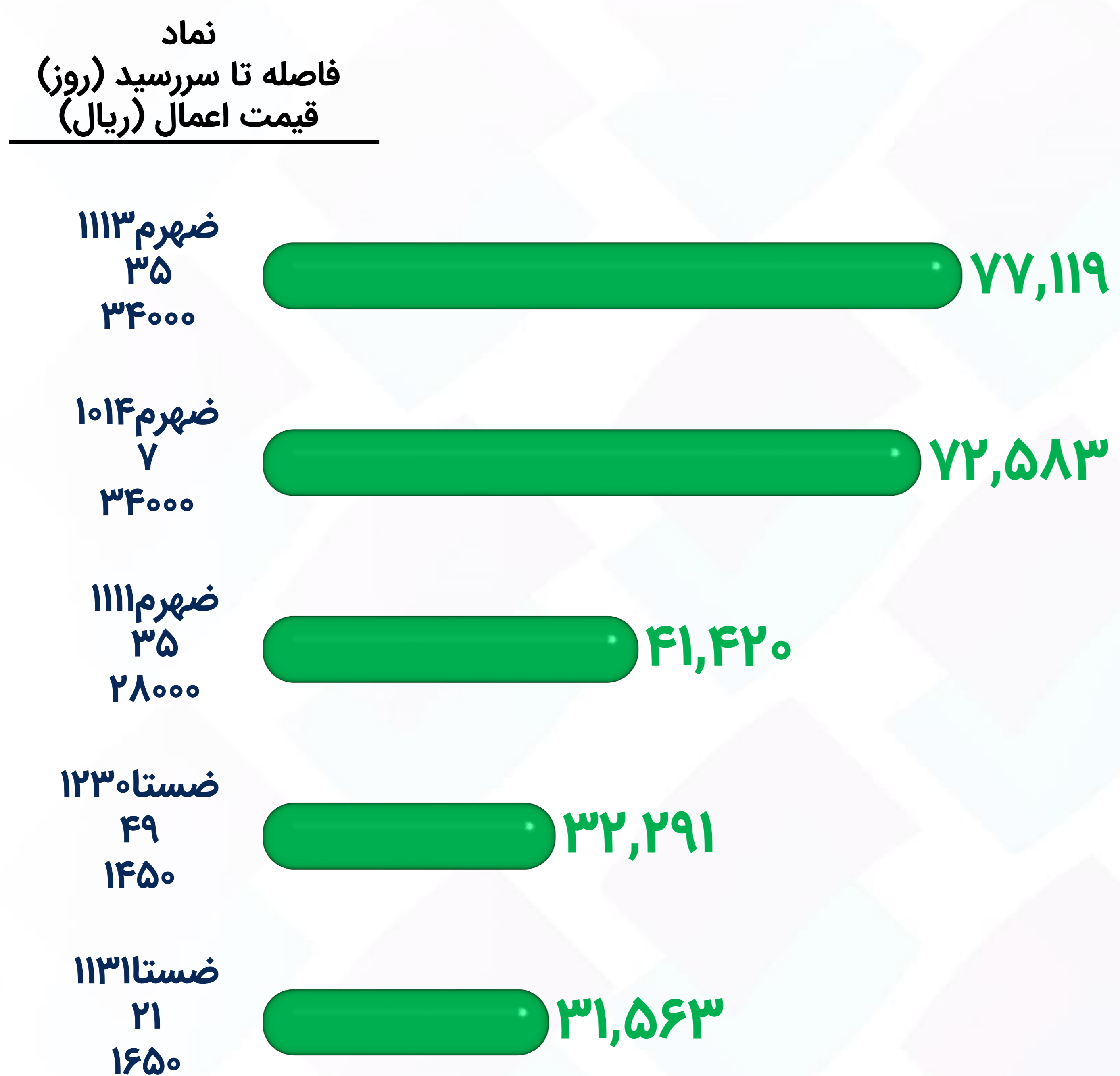
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۲,۶۶۵.۷	(۴۵.۱%)	۱۵,۹۹۴	۲۹,۱۲۰	۶	۴.۰	۷	۱۶,۰۰۰	طهرم ۱۰۰۶
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۳۸۳.۶	(۳۸.۲%)	۱۷,۹۸۷	۲۹,۱۲۰	۱۳	۳۰.۶	۷	۱۸,۰۰۰	طهرم ۱۰۰۷
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۴۲۴.۰	(۴۲.۳%)	۸۴۸	۱,۴۷۰	۲	۴.۰	۲۱	۸۵۰	طستا ۱۱۲۳
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۲۴۹.۰	(۳۱.۴%)	۱۹,۹۸۴	۲۹,۱۲۰	۱۶	۳۹.۵	۷	۲۰,۰۰۰	طهرم ۱۰۰۸
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۳۱۵.۷	(۳۵.۶%)	۹۴۷	۱,۴۷۰	۳	۵.۲	۲۱	۹۵۰	طستا ۱۱۲۴

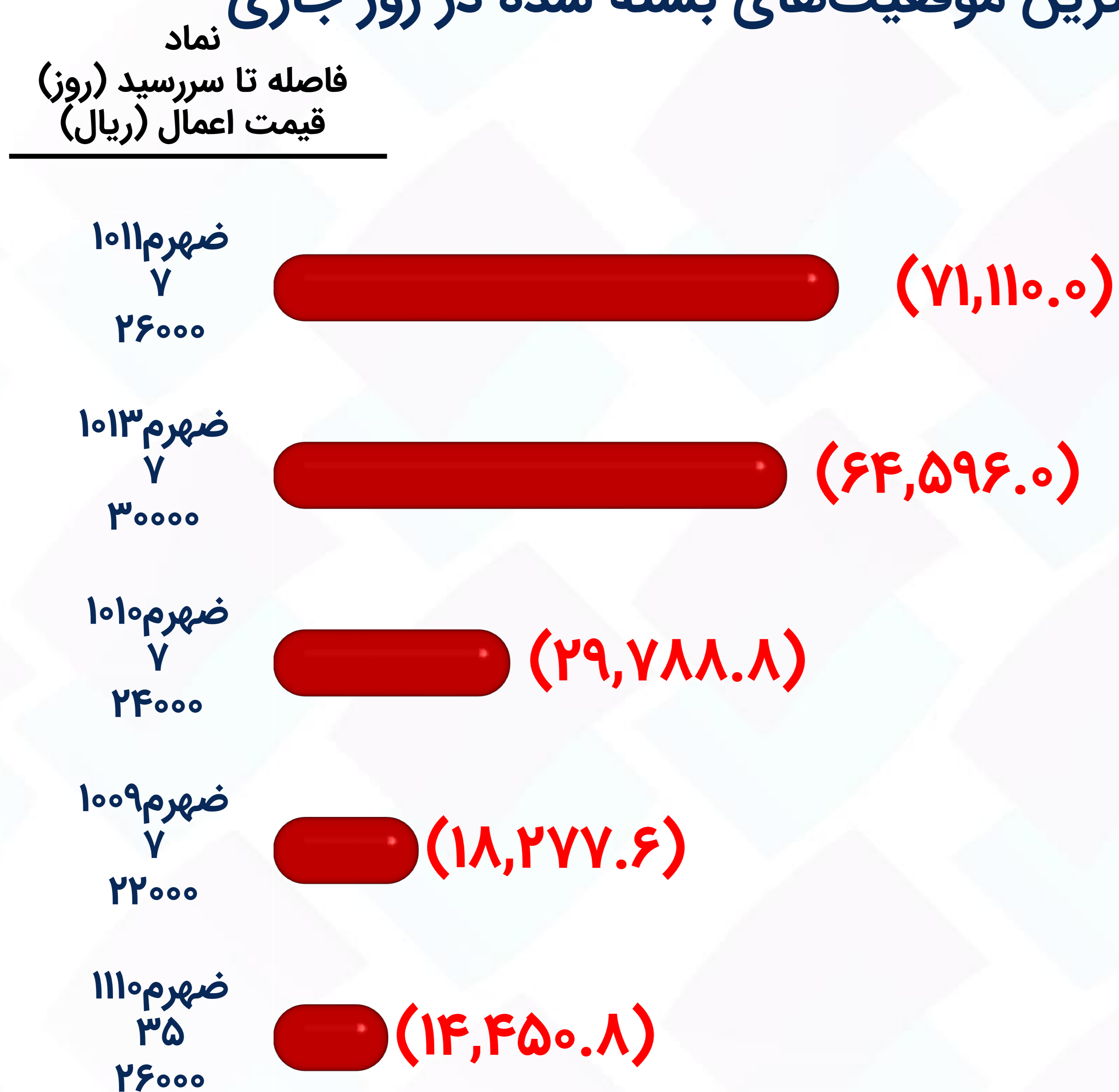
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

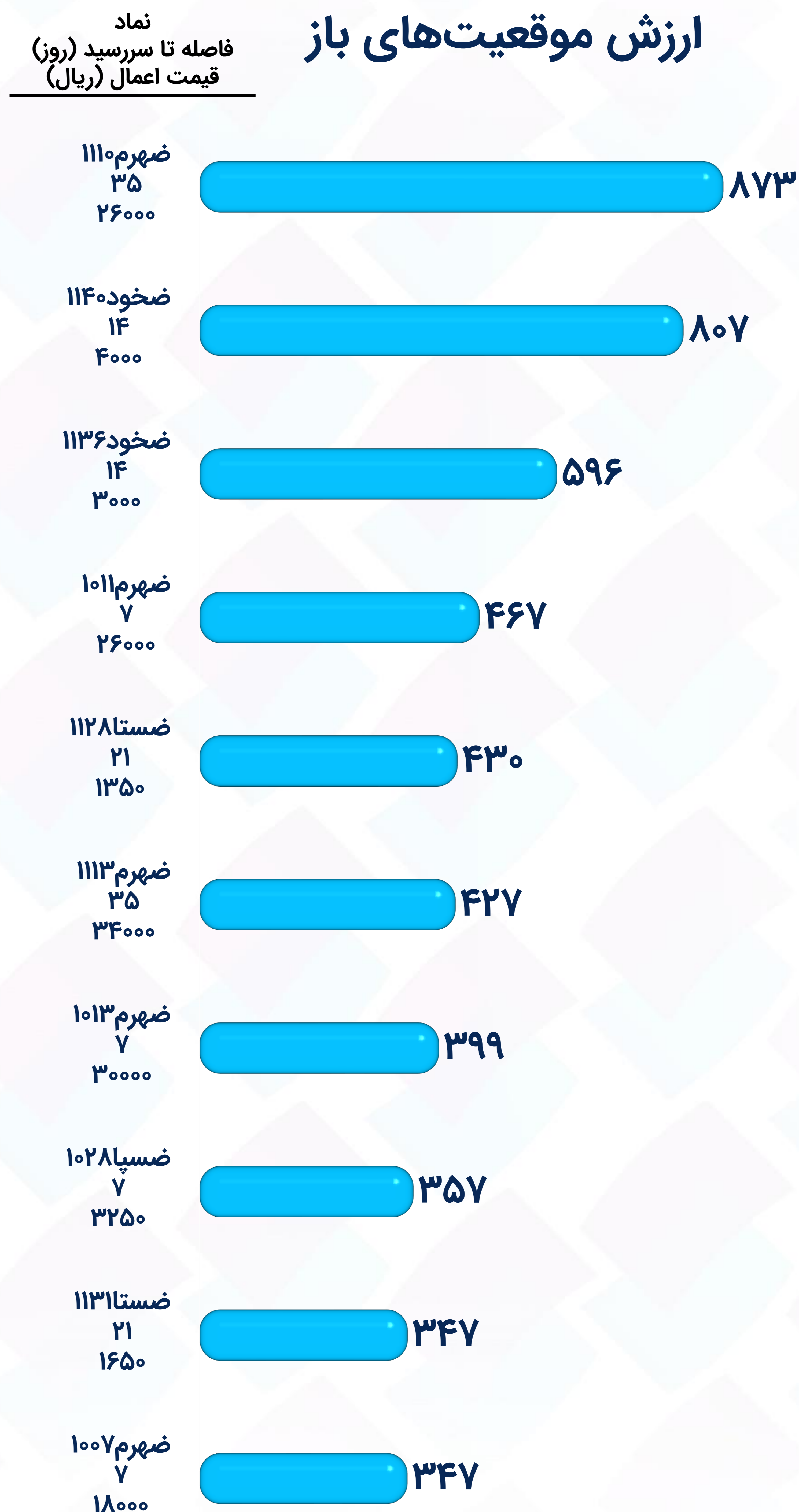
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

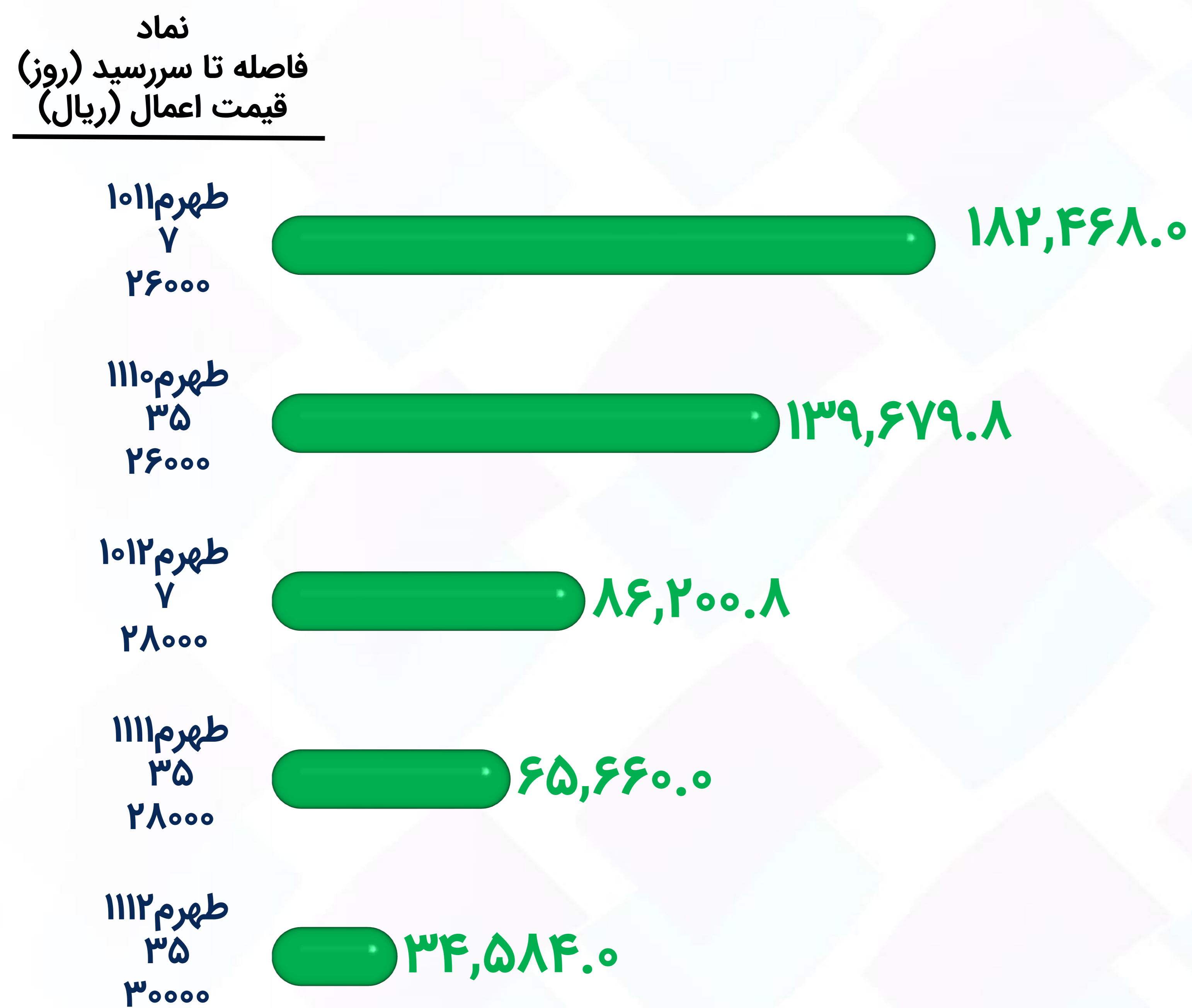


ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

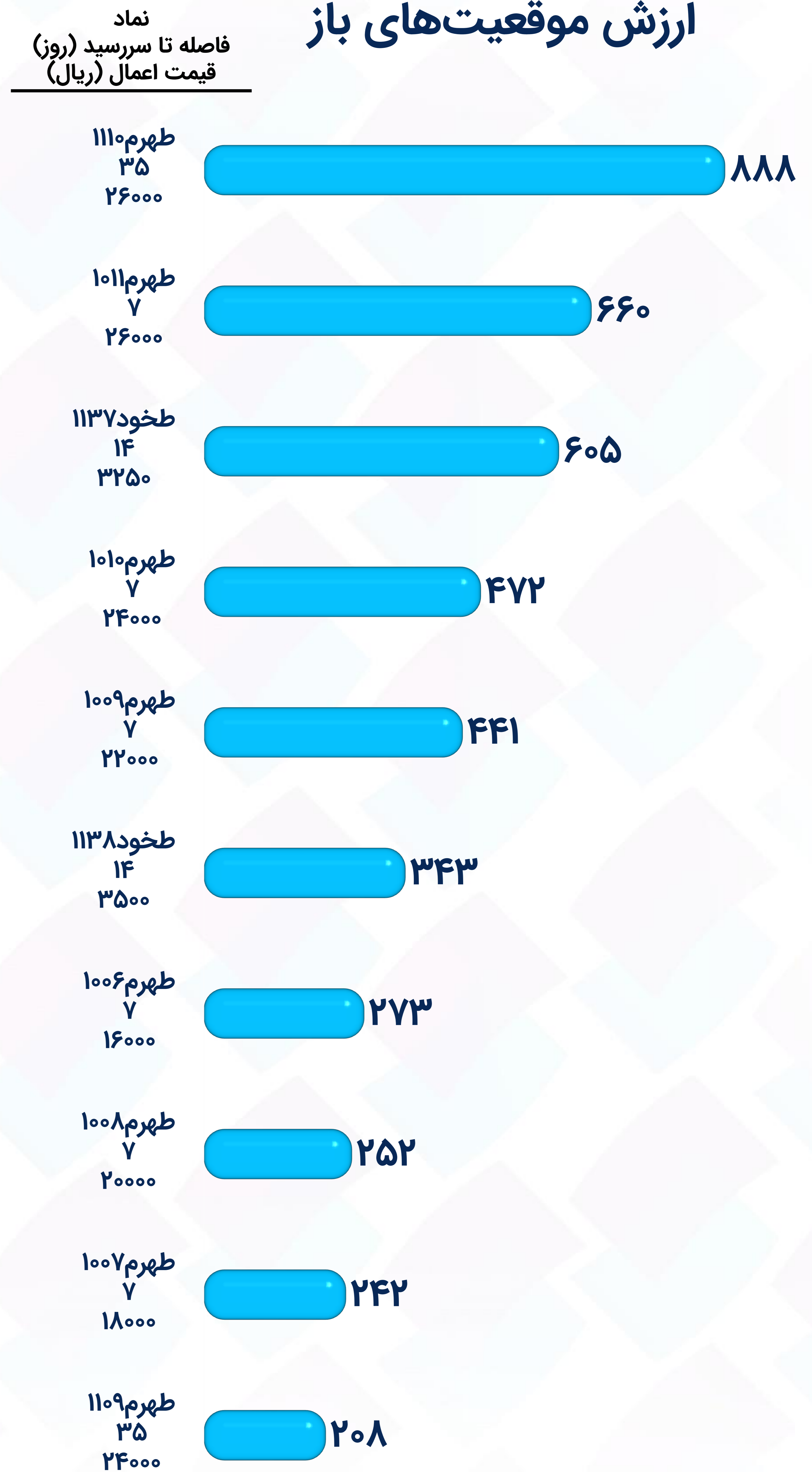
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

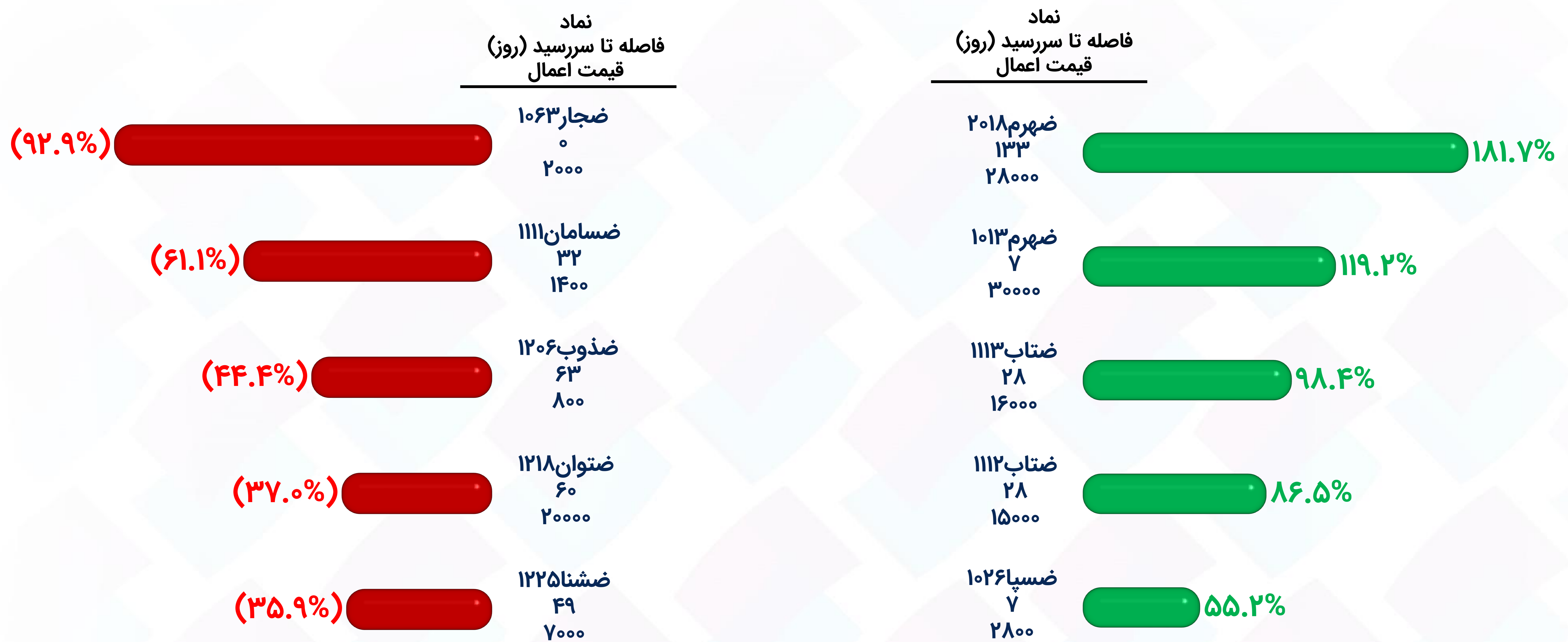


ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

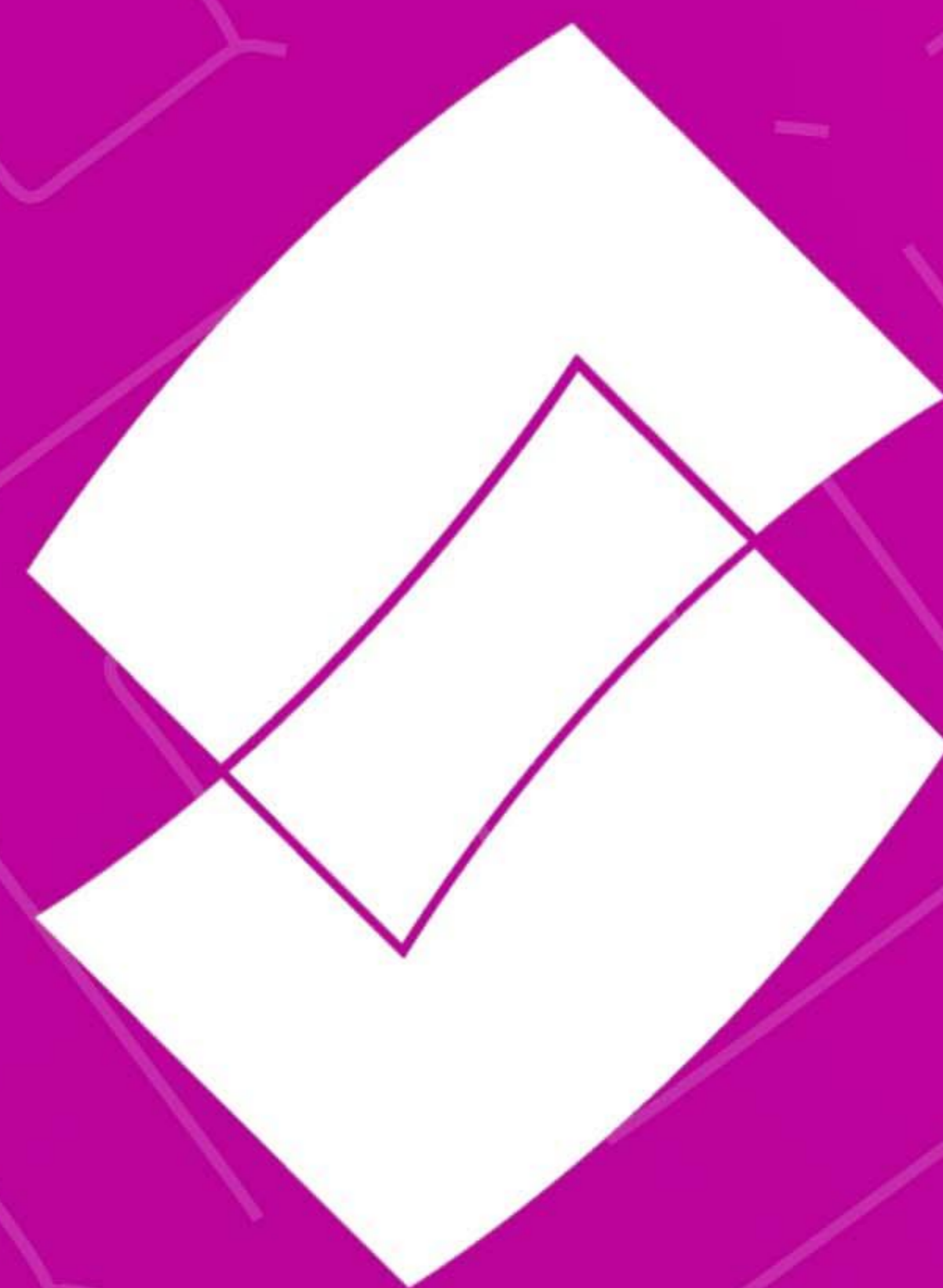
اختیار خرید



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 و امیرحسین بابائی

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.