

شماره
۴۰۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۲ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

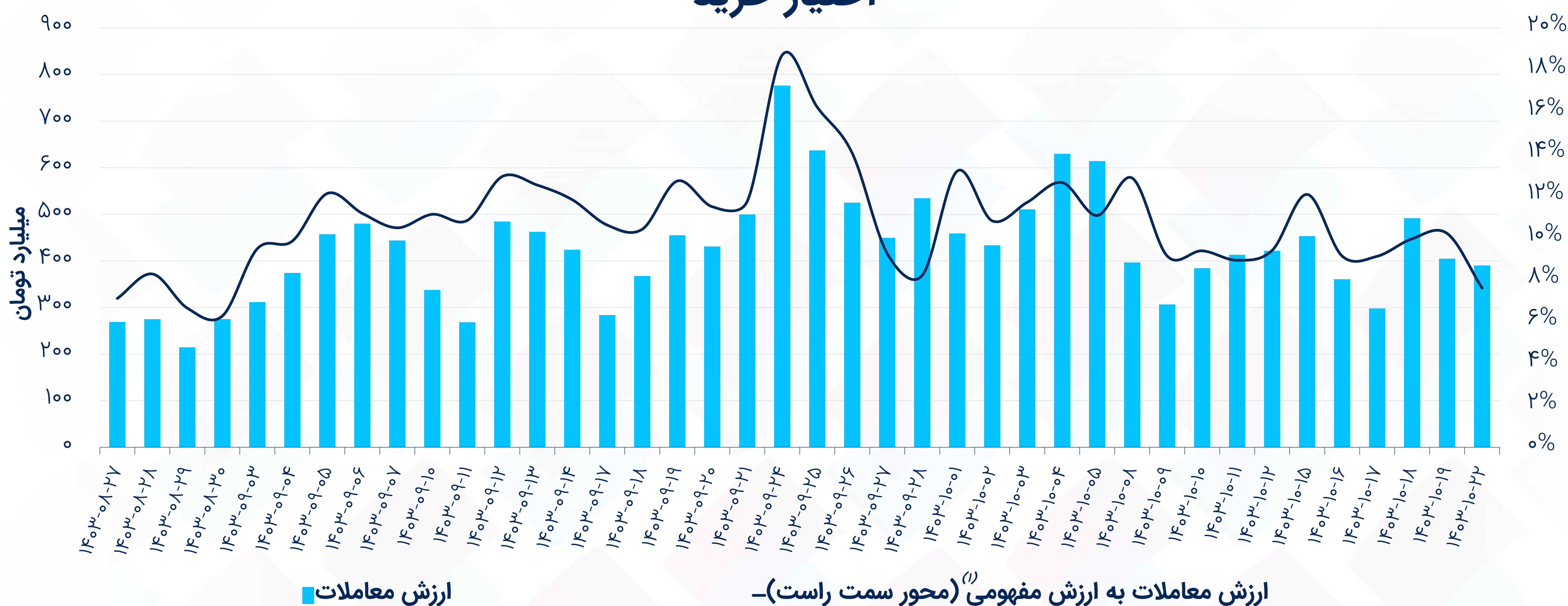




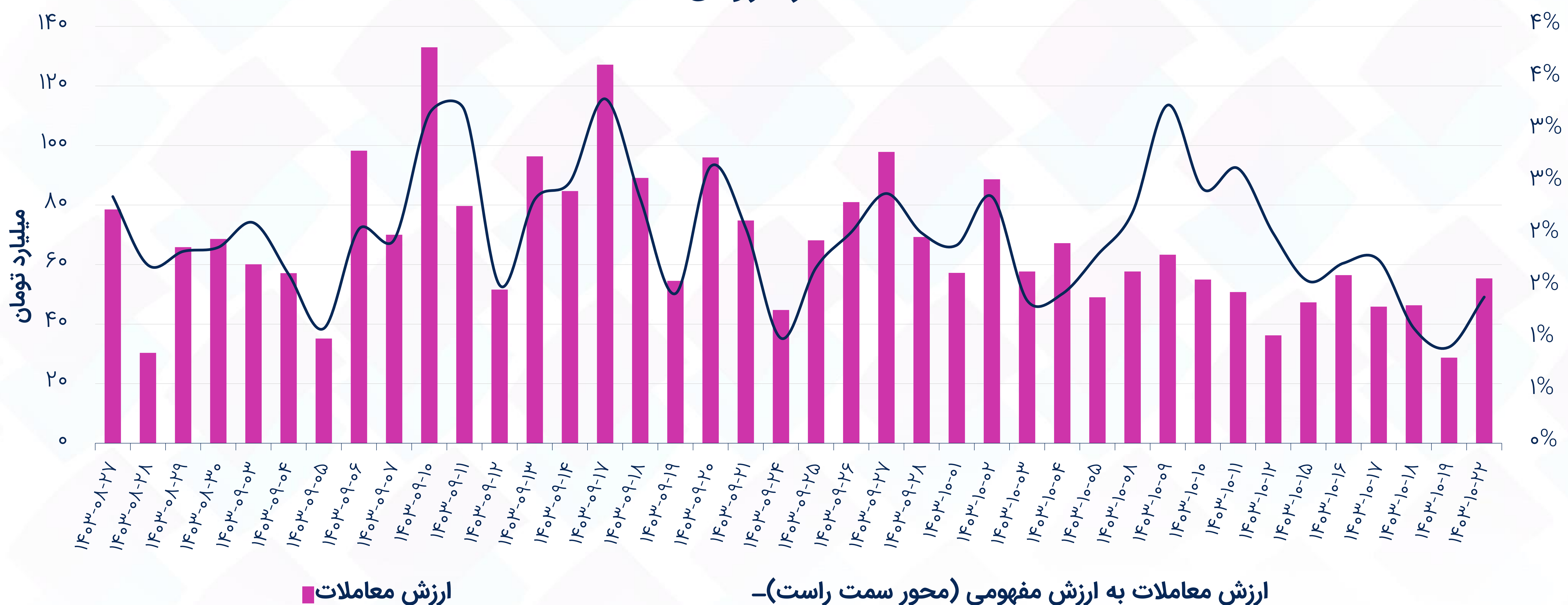
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



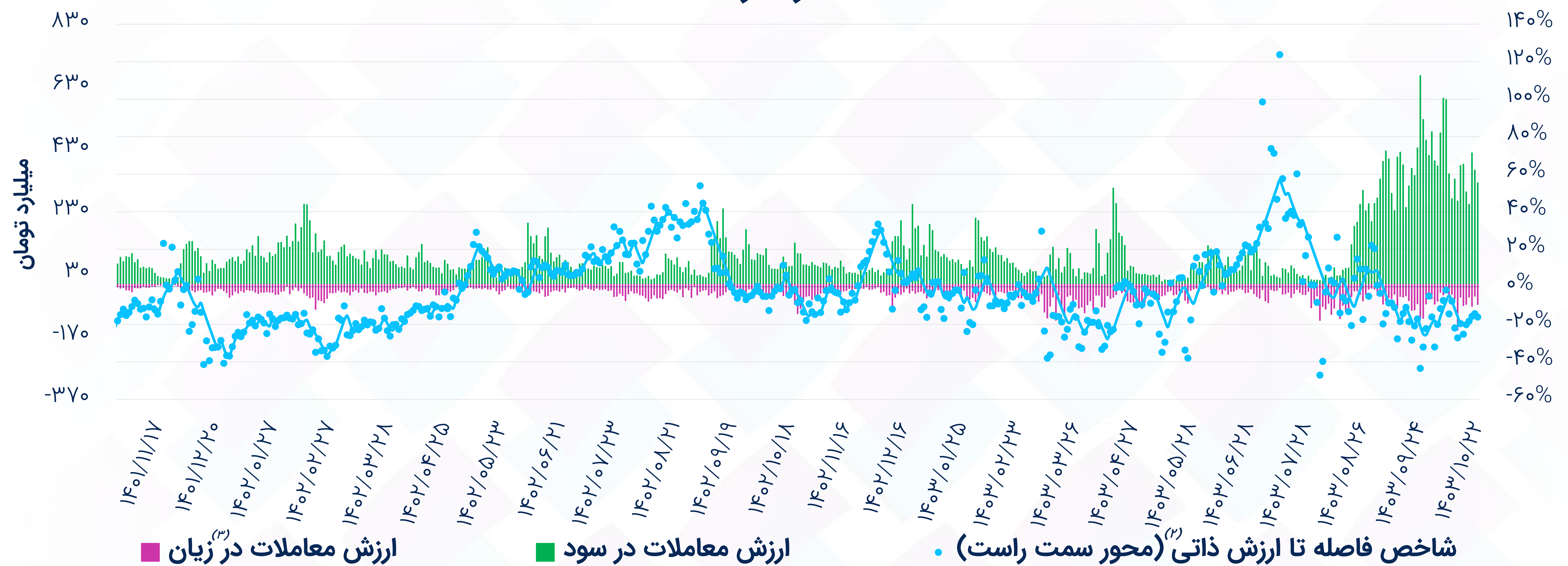
اختیار فروش



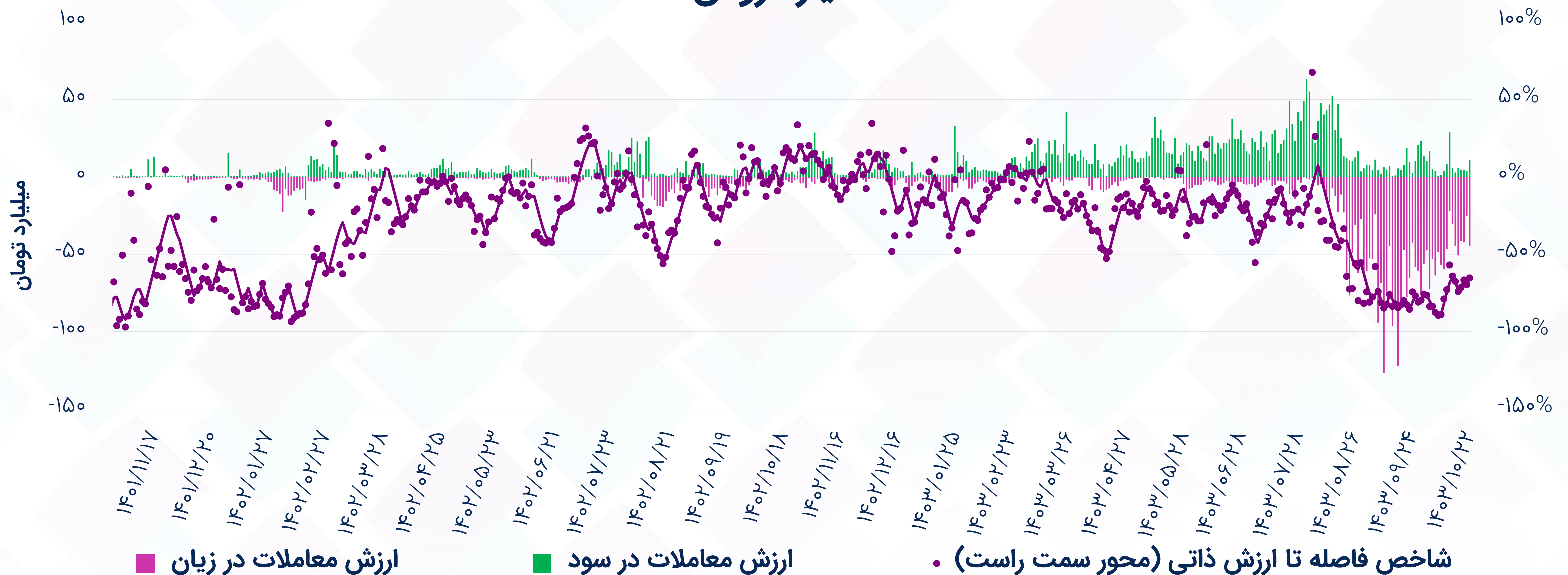
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

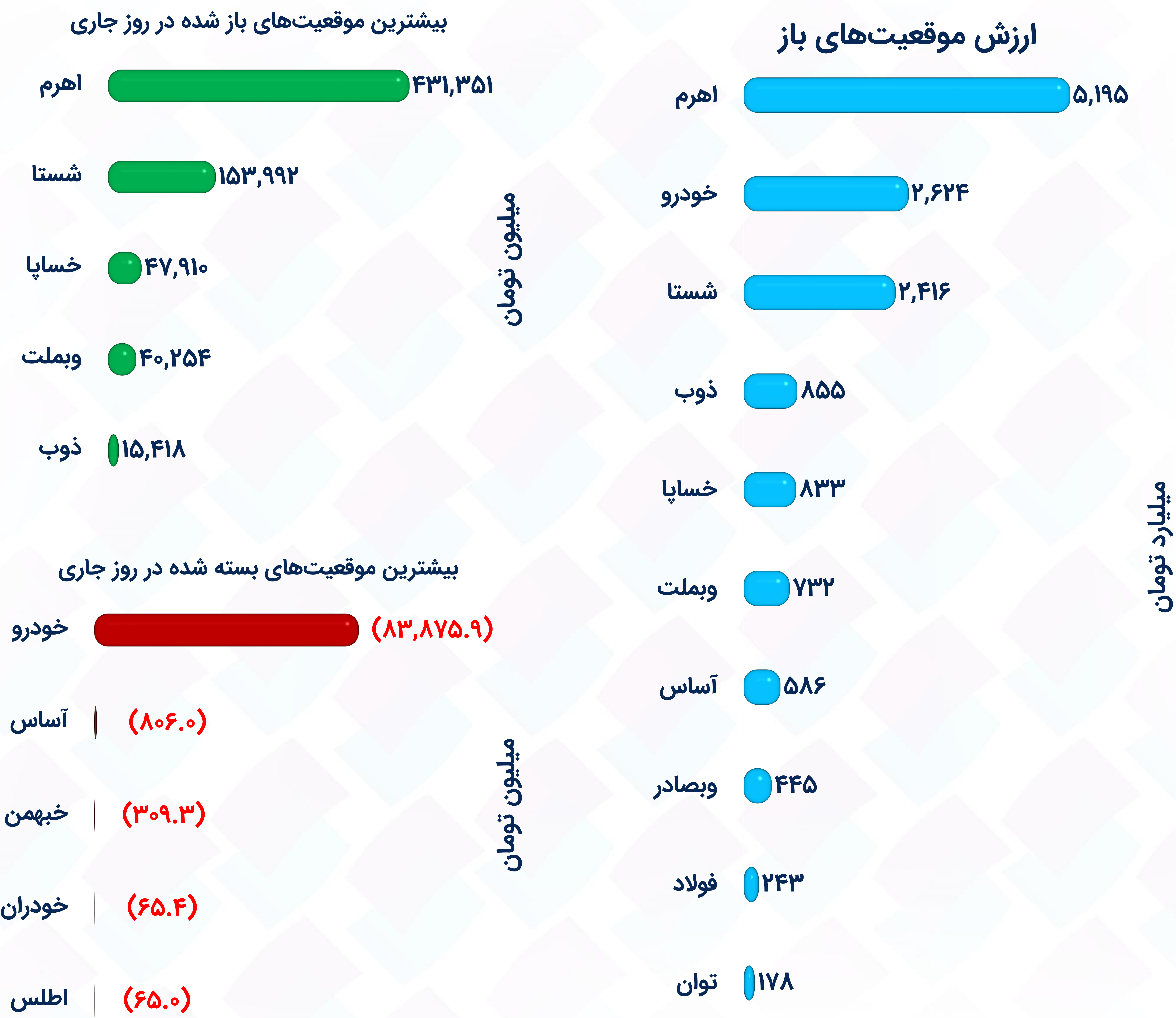
اختیار خرید

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	۲۴۶.۳	۲,۶۶۷.۱	۲۱۴.۲	۳۲.۱	(۱۲.۳%)
خودرو	۲۸	۴۱.۴	۷۵۵.۶	۳۲.۳	۹.۱	(۸.۰%)
شستا	۴۰	۳۶.۸	۴۹۵.۴	۱۹.۵	۱۷.۲	(۳۹.۶%)
خسپا	۱۷	۳۲.۵	۹۹۳.۸	۲۹.۹	۲.۵	(۲۵.۴%)
ذوب	۲۴	۱۳.۱	۷۳.۹	۱۱.۶	۱.۵	(۱۸.۹%)
وبملت	۱۶	۶.۹	۷۰.۵	۴.۸	۲.۱	(۳۳.۷%)
توان	۱۶	۳.۴	۸.۴	۳.۴	۰.۰	۰.۴%

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	۲۱	۴۴,۴۶۵.۸	۳,۳۶۳,۷۴۵.۳	۸,۶۴۷.۸	۳۵,۸۱۷.۹	(۶۵.۳%)
خودرو	۹	۷,۵۸۷.۷	۴۴۷,۰۳۴.۳	۳۲۱.۲	۷,۲۶۶.۵	(۶۲.۰%)
شستا	۱۹	۳,۰۹۹.۴	۱۲۷,۶۳۲.۱	۱,۷۷۱.۲	۱,۳۲۸.۲	(۷۲.۵%)
وبملت	۲	۱۱۸.۲	۴,۲۰۳.۴	۰.۰	۱۱۸.۲	(۷۹.۳%)
ذوب	۴	۸۹.۰	۳,۱۰۳.۱	۰.۱	۸۸.۹	(۸۶.۶%)
توان	۳	۶.۸	۱۷۰.۴	۰.۰	۶.۸	(۶۴.۵%)
فولاد	۱	۲.۸	۵۶۱.۰	۰.۰	۲.۸	(۹۹.۹%)

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

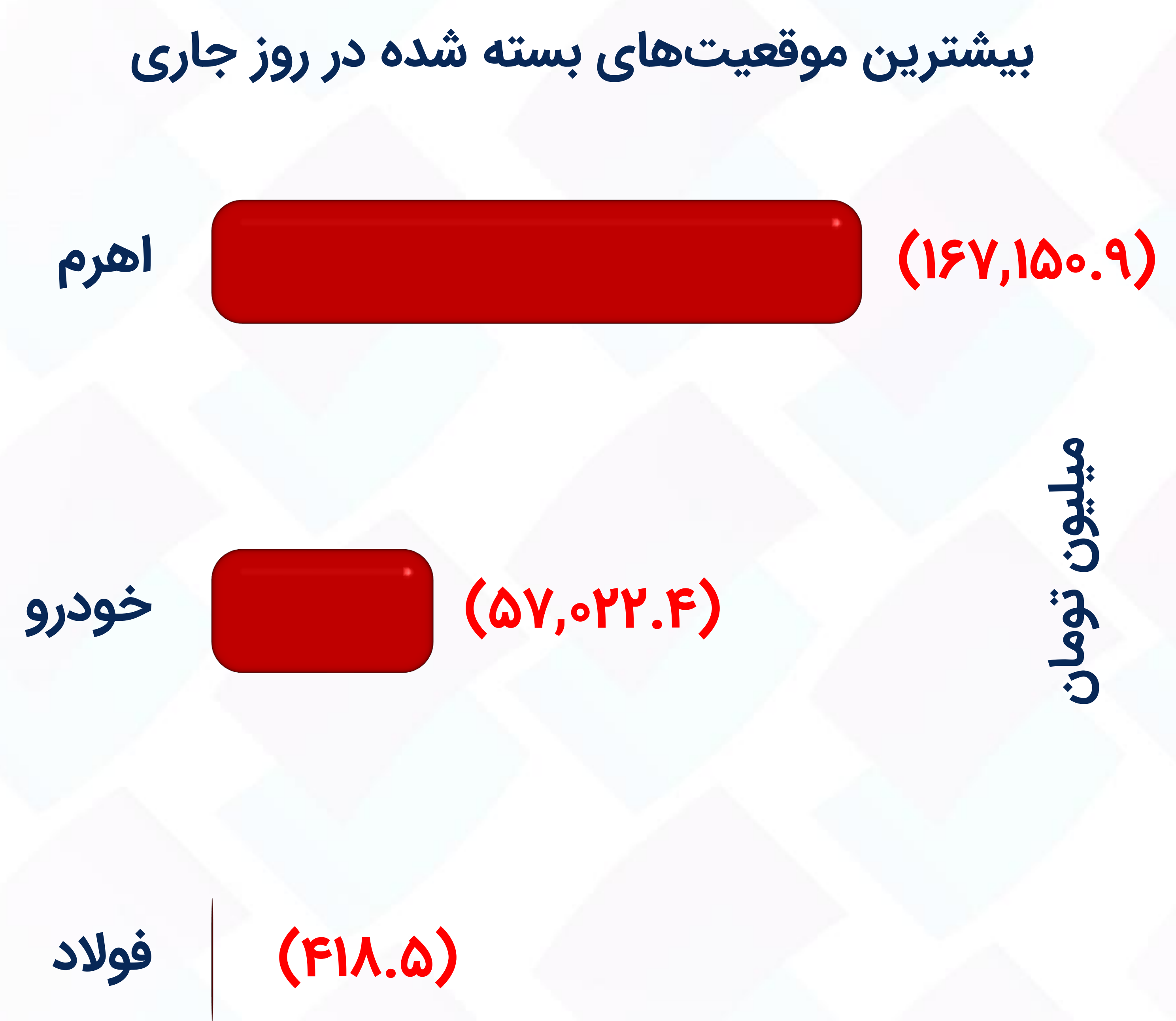


(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



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
ضرویین ۱۰۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۸	۳۶.۱	۱,۷۶۹	۱۳,۴۰۱	۱۲,۷۶۹	(۴.۷%)	۷.۲	۱.۰۰	۲,۴۸۸	۴۱%
ضفر ۲۱۰	فزر	۴۸,۰۰۰	۱۱۳	۱۷.۱	۹۰۵	۳۹,۶۰۰	۴۸,۹۰۵	۲۳.۵%	۵۴.۰	۰.۳۱	۱,۲۵۱	۳۸%
ضهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۴	۱۵,۳۲۱.۳	۲,۳۲۴	۲۸,۷۴۰	۲۸,۳۲۴	(۱.۴%)	۱۲.۲	۰.۹۹	۲,۸۸۱	۲۴%
ضرویین ۱۰۰۴	رویین	۱۰,۰۰۰	۸	۳.۲	۲,۸۹۴	۱۳,۴۰۱	۱۲,۸۹۴	(۳.۸%)	۴.۵	۱.۰۰	۳,۴۸۰	۲۰%
ضهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۴	۶,۹۷۲.۷	۹۰۶	۲۸,۷۴۰	۲۸,۹۰۶	۰.۶%	۳۱.۹	۰.۷۶	۱,۰۷۲	۱۸%

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
ضسپا ۱۰۳۰	خسپا	۳,۷۵۰	۴	۱.۴	۱۲	۳,۰۴۹	۳,۷۶۲	۲۳%	۳۱۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۳۲	۳۷.۴	۷	۵۵۲	۱,۰۰۷	۸۲%	۱۴۳.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۳۲	۲۶.۸	۱۰	۵۵۲	۹۱۰	۶۵%	۹۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۳۲	۳۱.۰	۹	۵۵۲	۸۰۹	۴۷%	۸۹.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۳۹.۸	۲۱	۲۸,۷۴۰	۳۴,۰۲۱	۱۸%	۱,۶۲۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)

(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	۴	۱.۷	۵,۶۲۲	۲۸,۷۴۰	۲۸,۳۷۸	(۱.۳%)	۵.۰	-۱.۰۰	۵,۰۸۱	(۹.۶%)
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۲	۲۸۴.۵	۵,۴۸۱	۲۸,۷۴۰	۲۸,۵۱۹	(۰.۸%)	۵.۲	-۰.۹۰	۴,۴۳۰	(۱۹.۲%)
طهرم ۱۰۱۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴	۱۴۶.۰	۱,۶۴۵	۲۸,۷۴۰	۲۸,۳۵۵	(۱.۳%)	۱۷.۲	-۰.۷۹	۱,۲۵۲	(۲۳.۹%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۱	۳۲۱.۲	۳۴۶	۳,۷۵۲	۳,۶۵۴	(۲.۶%)	۱۰.۶	-۰.۷۹	۲۲۸	(۳۴.۱%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۲	۸,۲۱۵.۷	۲,۳۸۰	۲۸,۷۴۰	۲۷,۶۲۰	(۳.۹%)	۱۱.۶	-۰.۵۳	۱,۴۳۳	(۳۹.۸%)

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	۴	۳۷.۶	۱۰	۲۸,۷۴۰	۱۵,۹۹۰	(۴۴.۴%)	۱,۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۴	۷.۱	۹	۲۸,۷۴۰	۱۴,۹۹۱	(۴۷.۸%)	۱,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۴	۱.۲	۷	۲۸,۷۴۰	۱۳,۹۹۳	(۵۱.۳%)	۱,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۱۸	۱.۷	۲	۱,۴۳۹	۸۴۸	(۴۱.۱%)	۴۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۲۲۲	شستا	۶۵۰	۴۶	۳.۰	۶	۱,۴۳۹	۶۴۴	(۵۵.۲%)	۱۰۷.۳	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

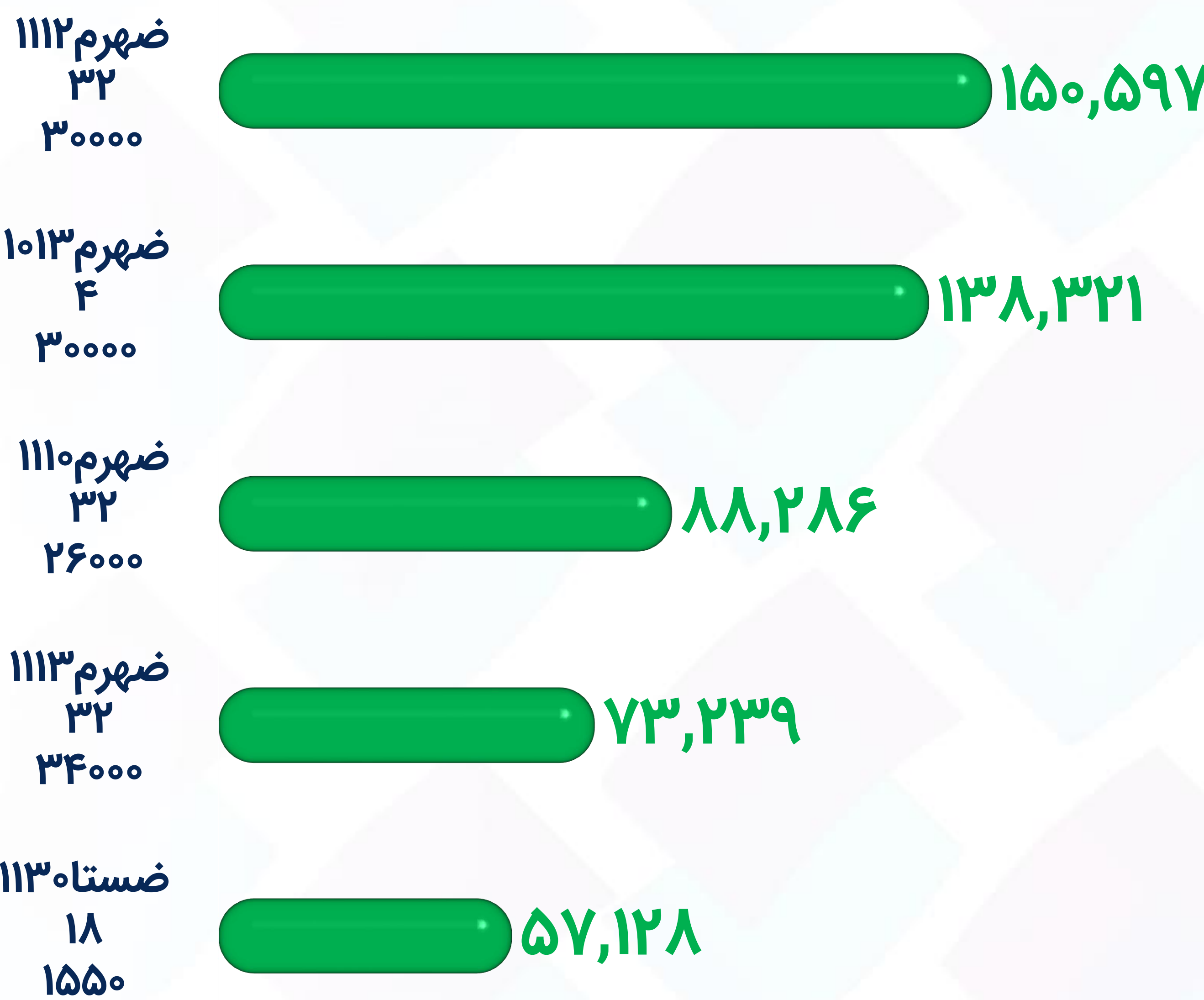
ارزش موقعیت‌های باز

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

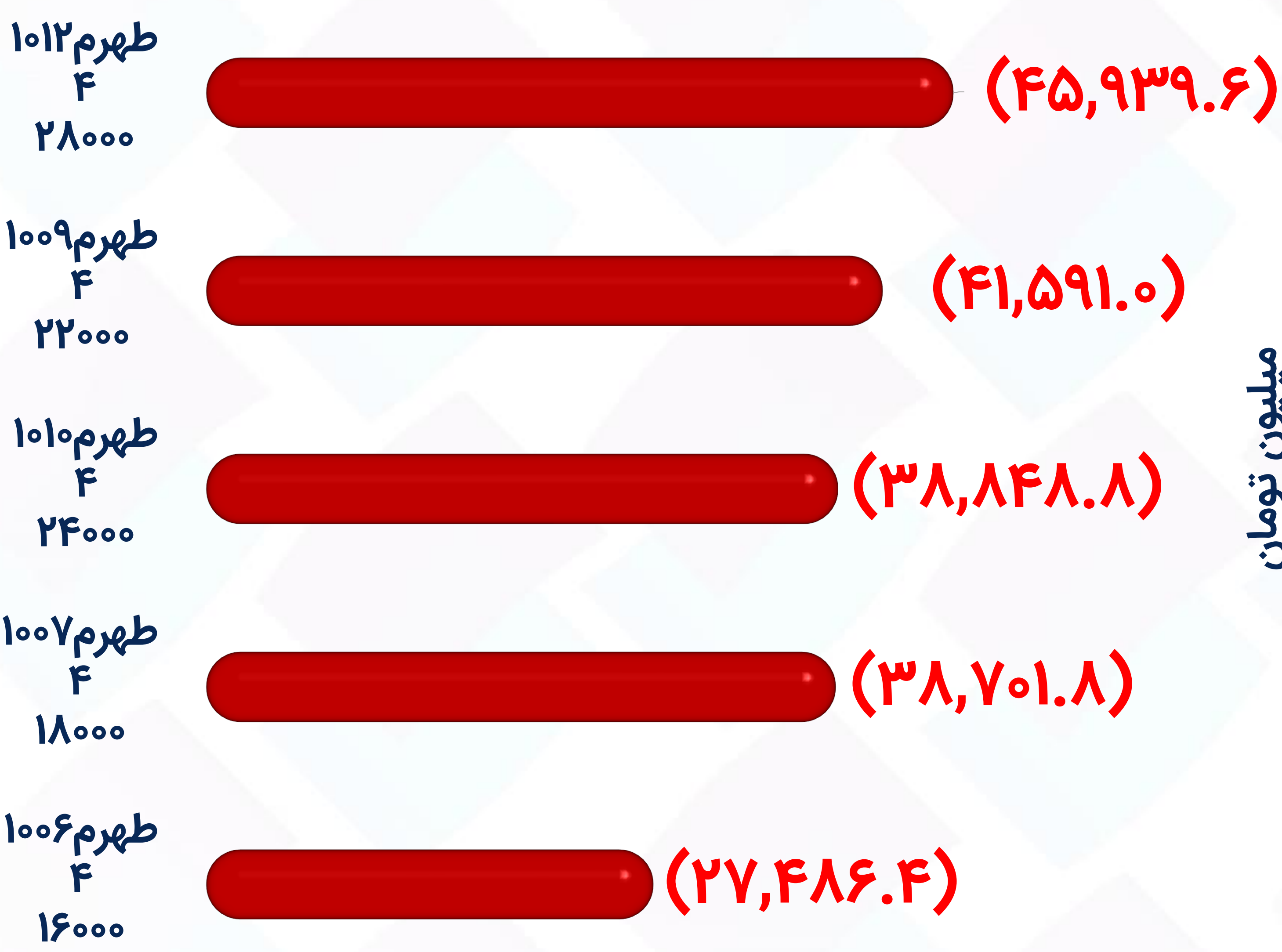
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

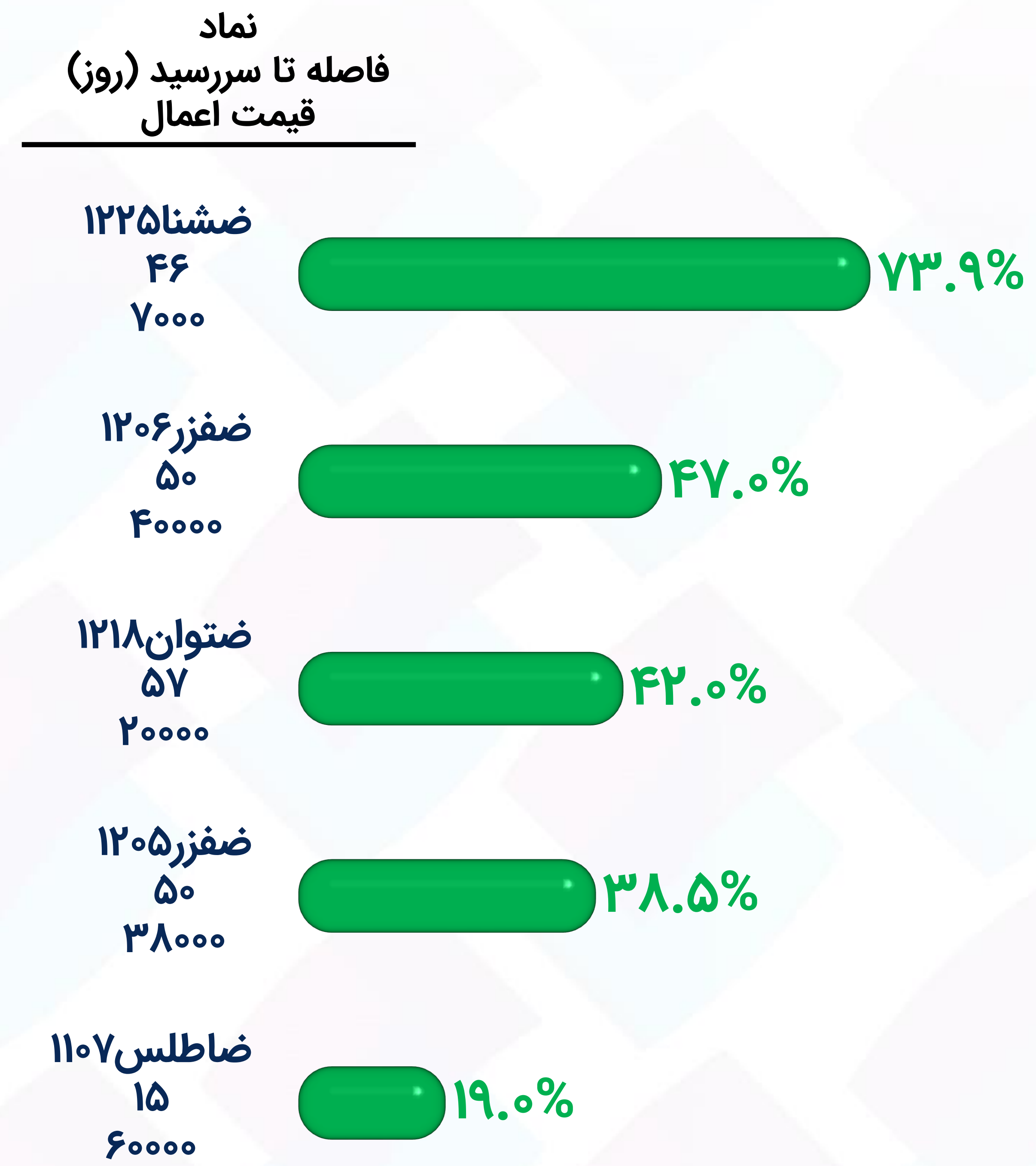
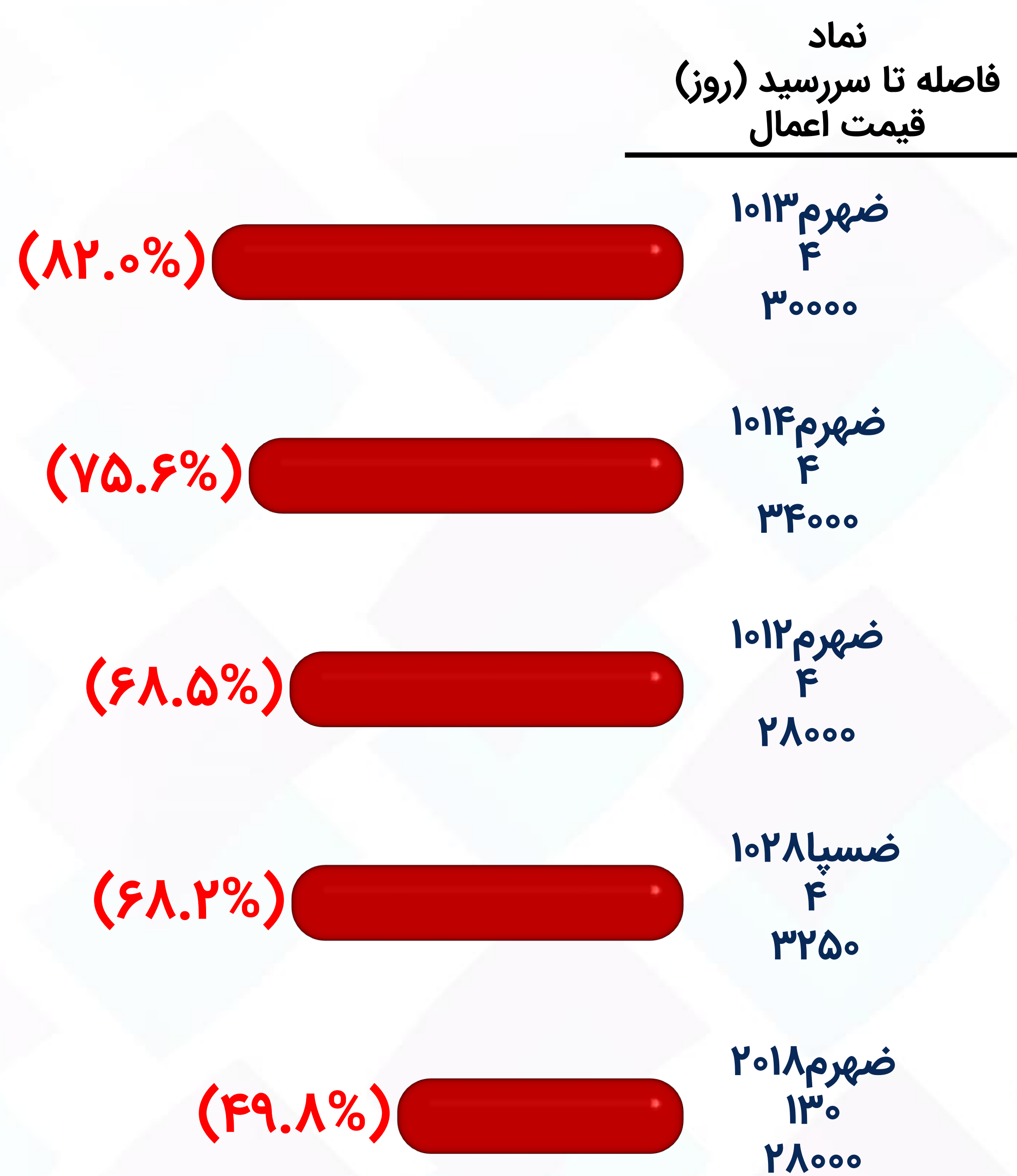
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



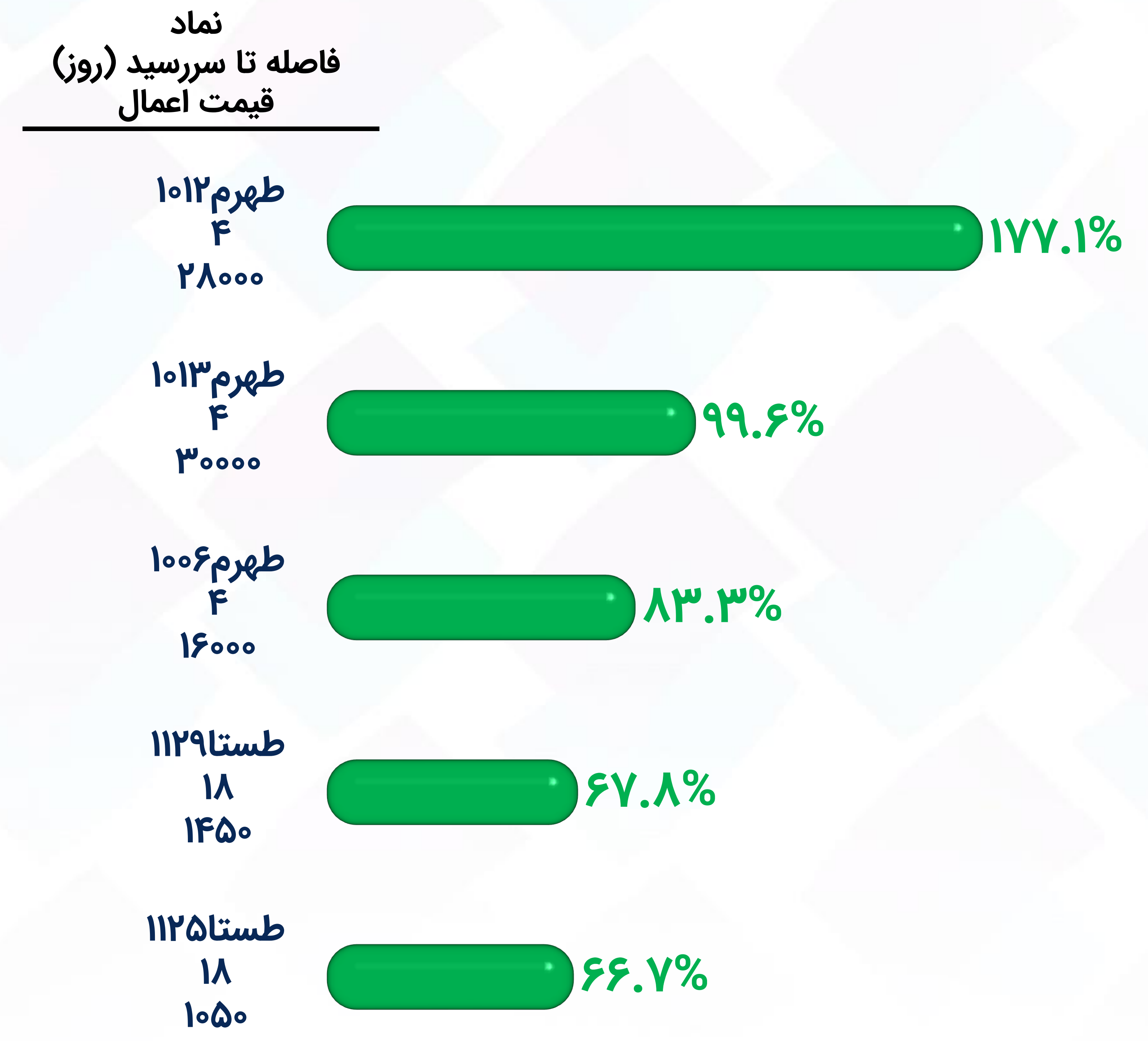
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

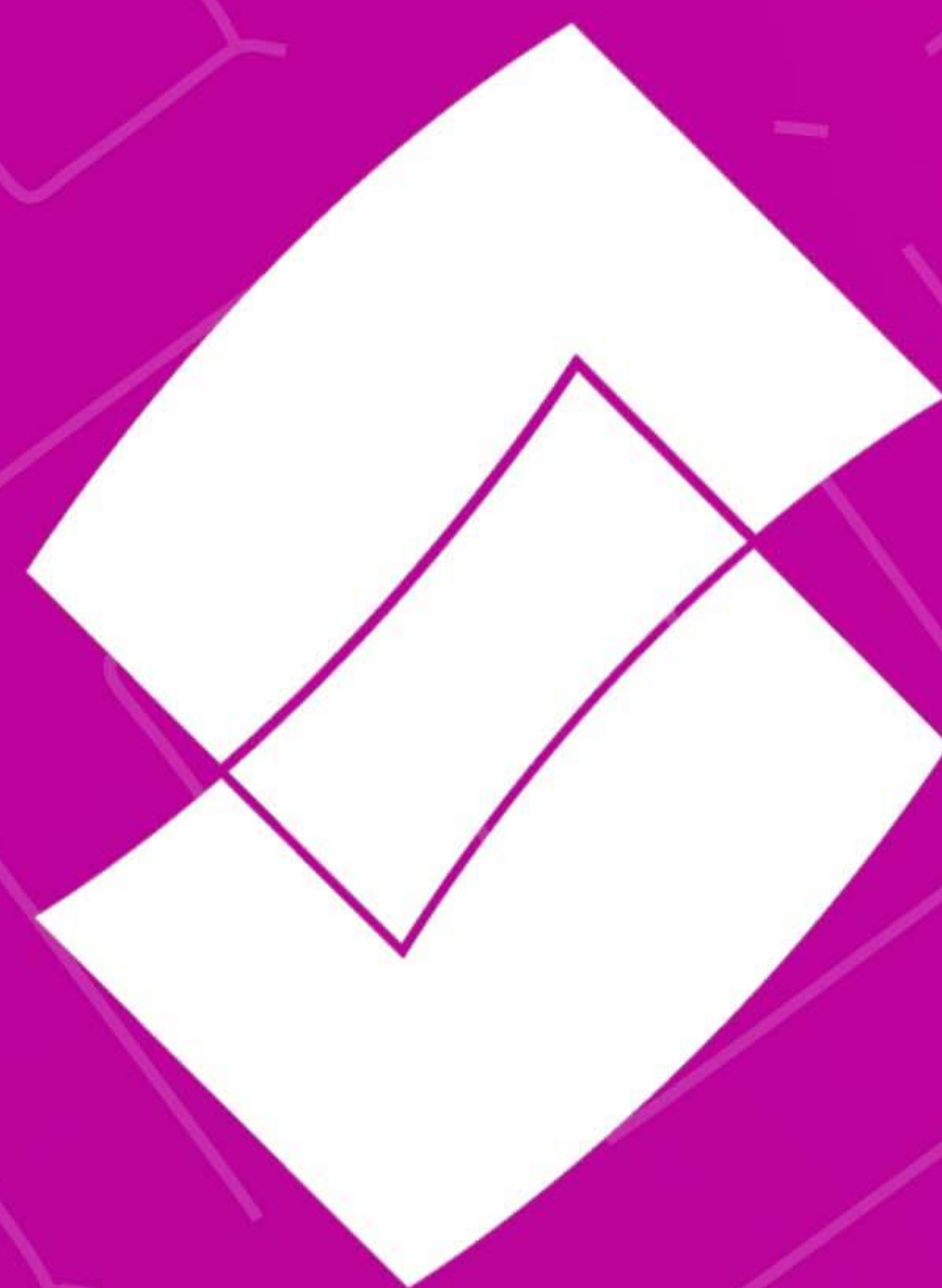
اختیار خرید



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 و امیرحسین بابائی

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.