

شماره
۴۰۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۴ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

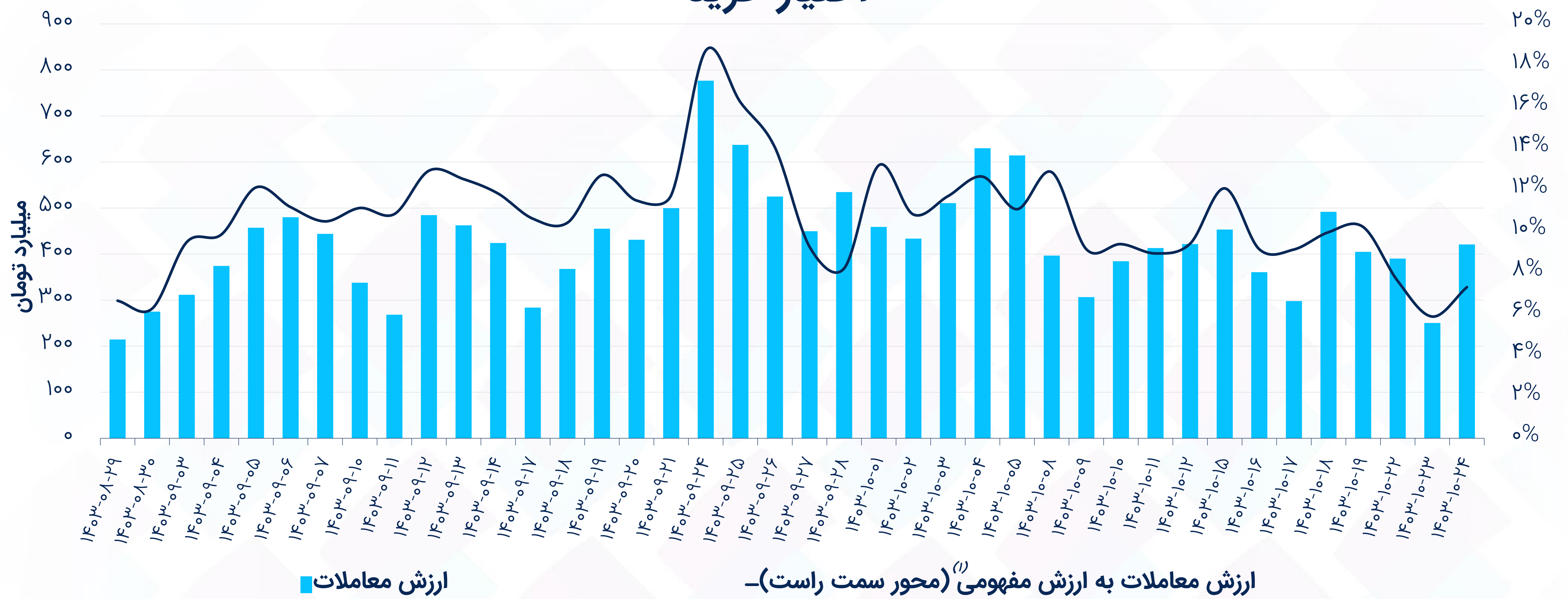




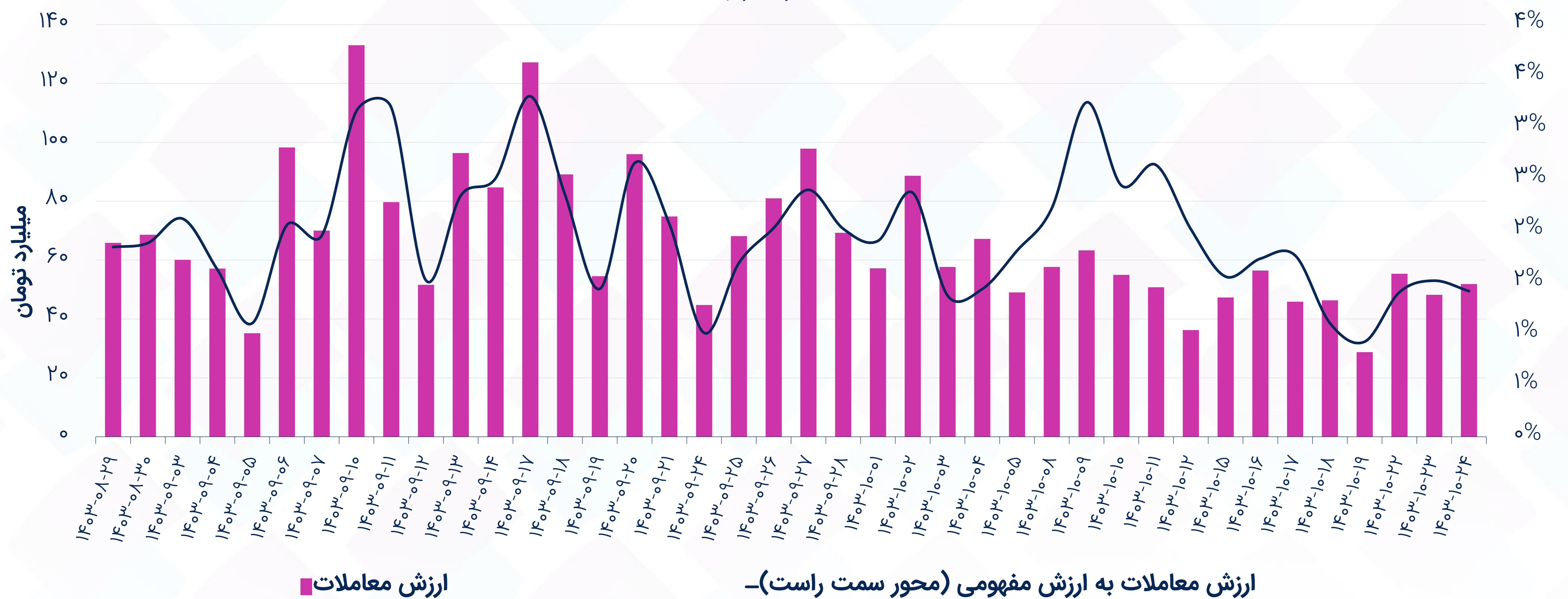
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



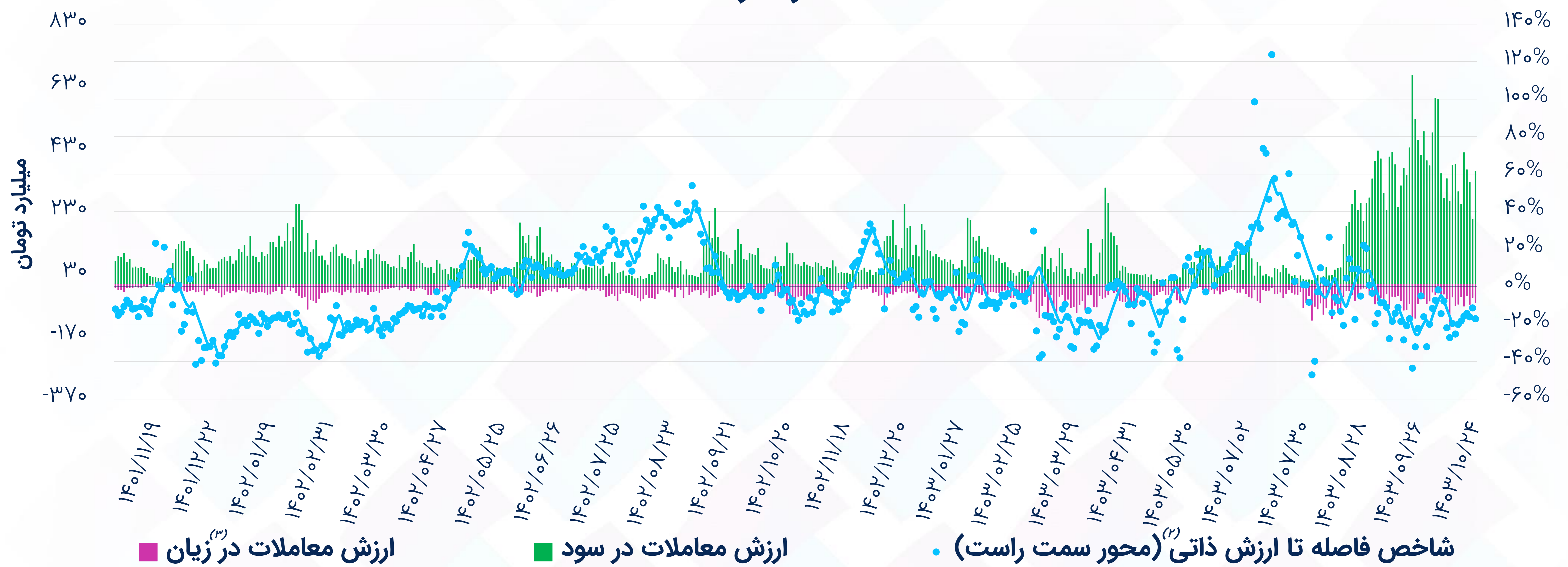
اختیار فروش



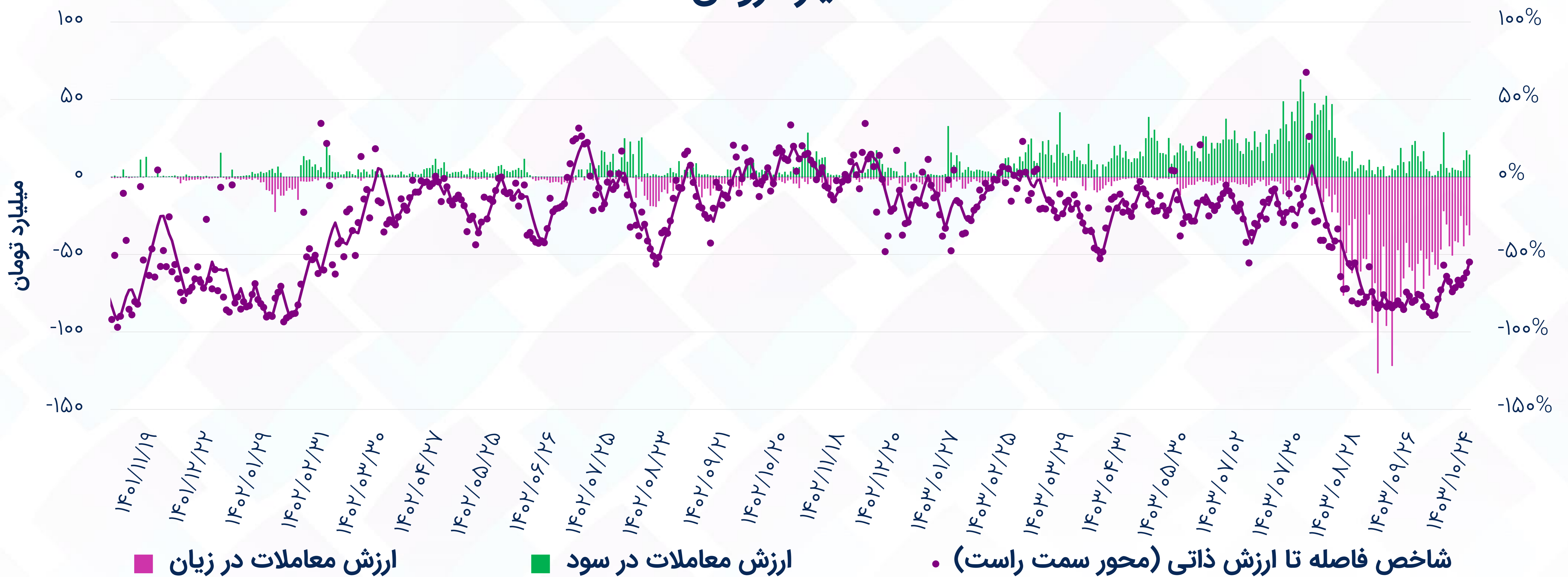
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

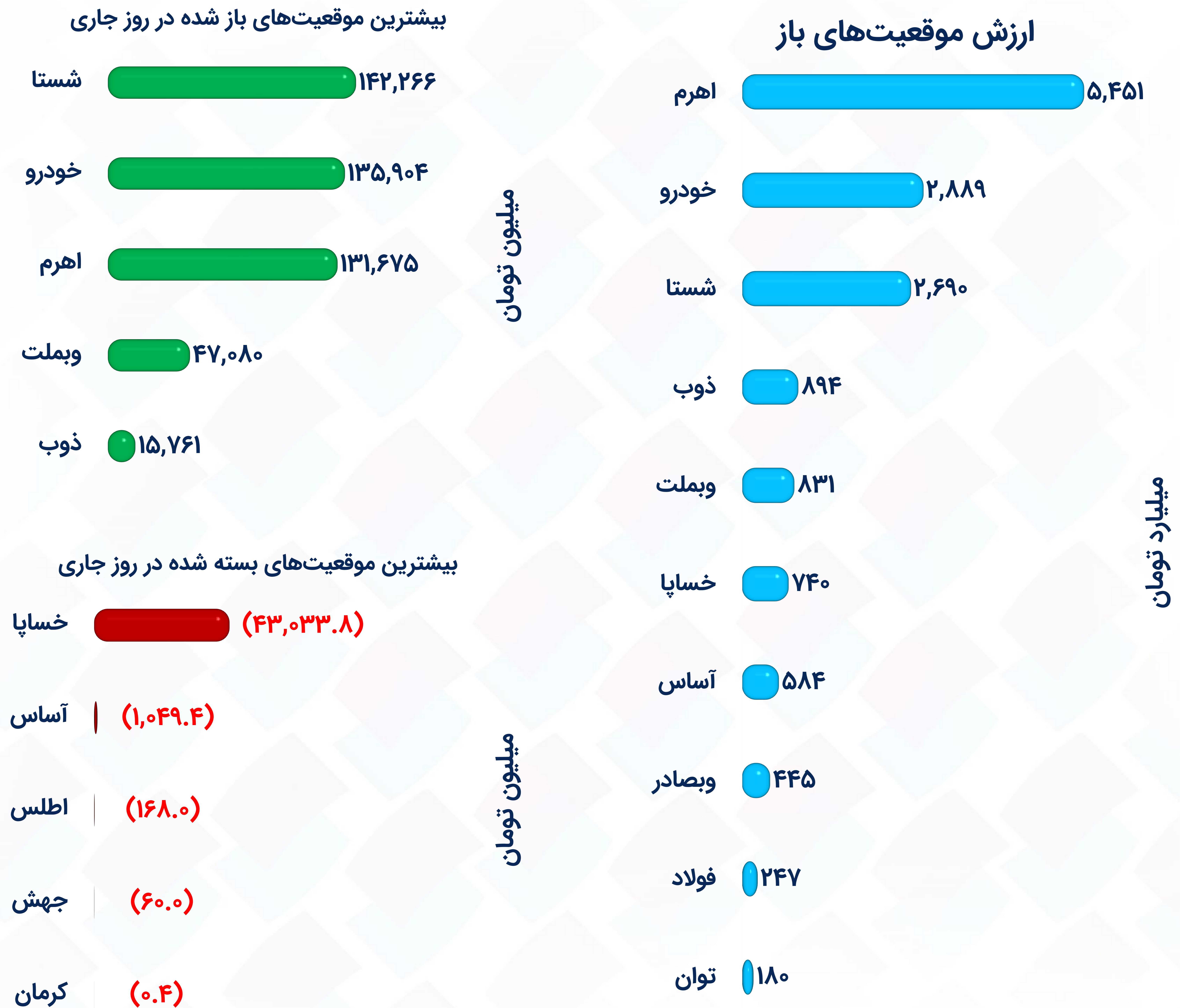
اختیار خرید

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	۲۹۹.۳	۳,۲۲۲.۷	۲۷۴.۱	۲۵.۱	(۱۵.۷%)
خودرو	۳۰	۵۷.۰	۱,۴۵۸.۹	۴۱.۶	۱۵.۳	(۱۶.۹%)
شستا	۳۷	۲۴.۰	۴۲۵.۶	۱۱.۷	۱۲.۳	(۴۵.۵%)
خسپا	۲۴	۱۳.۶	۴۴۷.۶	۱۰.۵	۳.۱	۵.۲%
وبملت	۱۹	۷.۵	۹۳.۰	۴.۵	۳.۰	(۳۶.۳%)
ذوب	۲۴	۷.۵	۵۰.۰	۶.۷	۰.۸	(۲۲.۶%)
توان	۱۴	۳.۷	۱۰.۸	۳.۶	۰.۱	۱.۳%

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	۲۲	۳۹,۳۳۰.۶	۲,۸۵۰,۲۱۱.۵	۱۰,۴۲۳.۰	۲۸,۹۰۷.۶	(۵۲.۹%)
خودرو	۹	۱۰,۱۸۶.۱	۷۰۳,۵۹۶.۰	۳,۱۱۸.۲	۷,۰۶۷.۹	(۵۸.۱%)
شستا	۱۷	۲,۱۸۷.۸	۱۰۷,۲۸۸.۷	۷۷۵.۴	۱,۴۱۲.۴	(۷۴.۲%)
وبملت	۴	۸۸.۱	۴,۲۲۰.۷	۰.۰	۸۸.۱	(۷۶.۶%)
ذوب	۵	۴۵.۵	۲,۳۴۱.۱	۰.۵	۴۵.۰	(۸۰.۳%)
اطلس	۲	۲۰.۲	۷۱۶.۶	۰.۰	۲۰.۲	(۸۲.۸%)
آساس	۱	۲.۲	۵۰۶.۷	۰.۰	۲.۲	(۱۰۰.۰%)

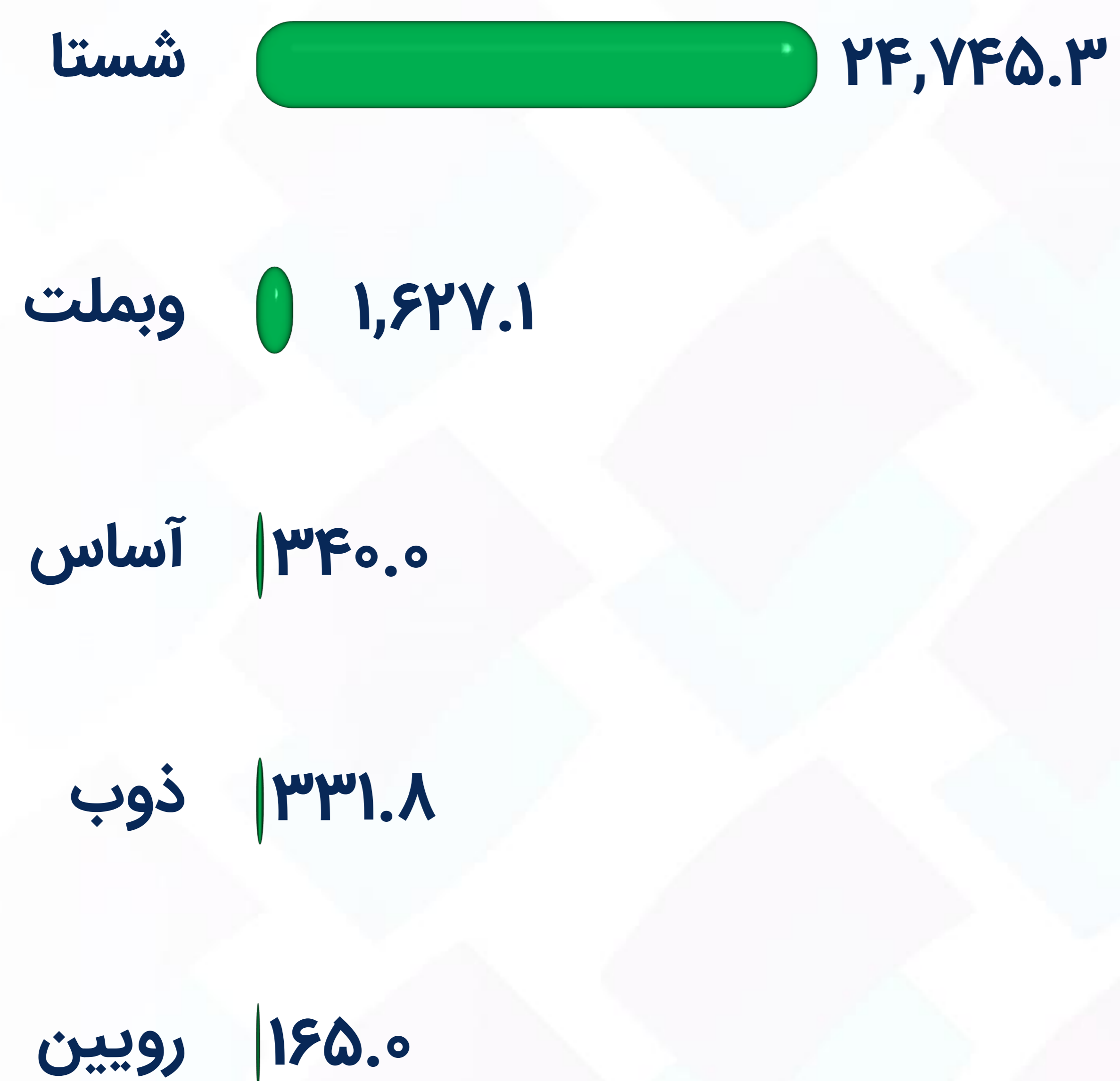
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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



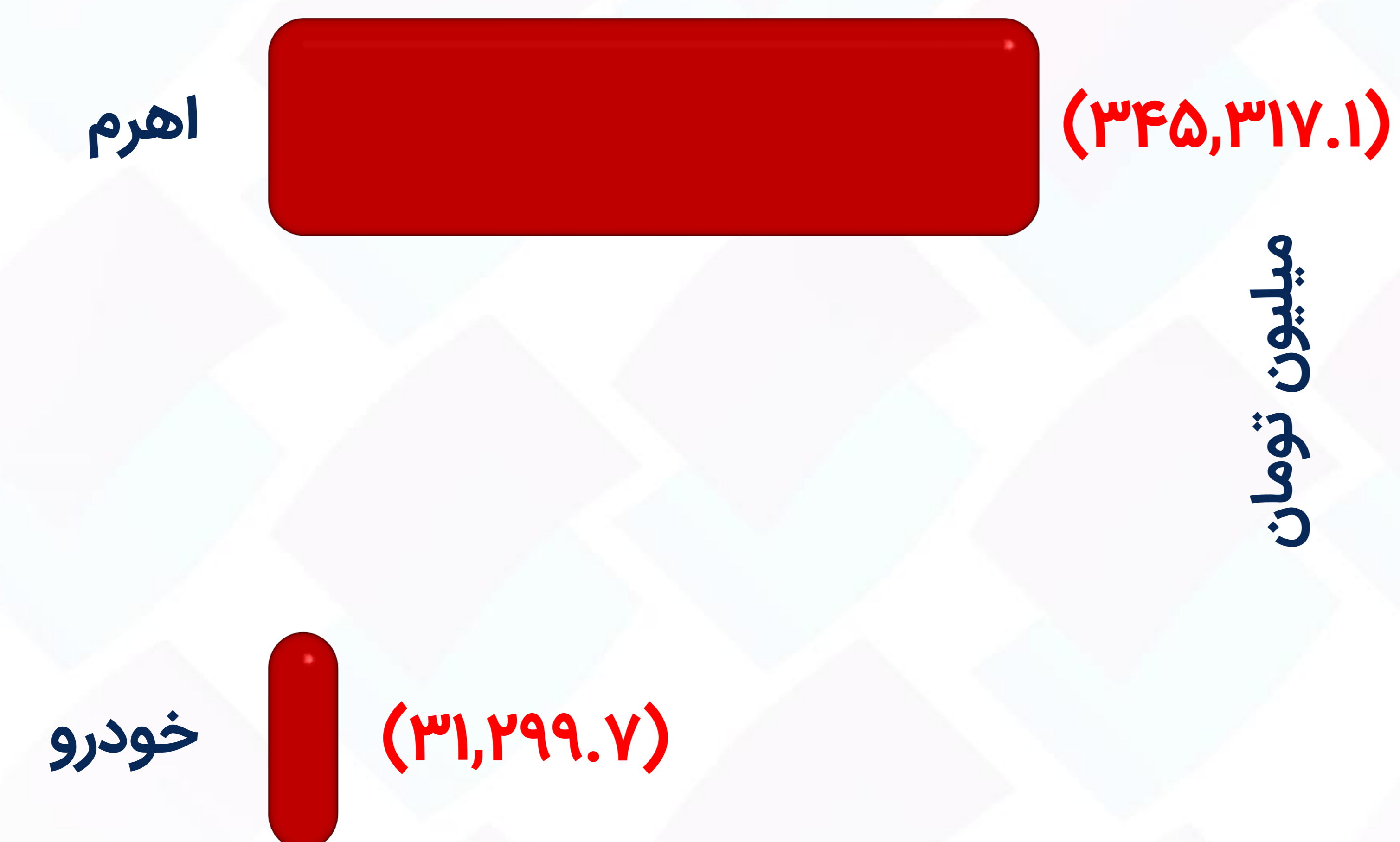
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

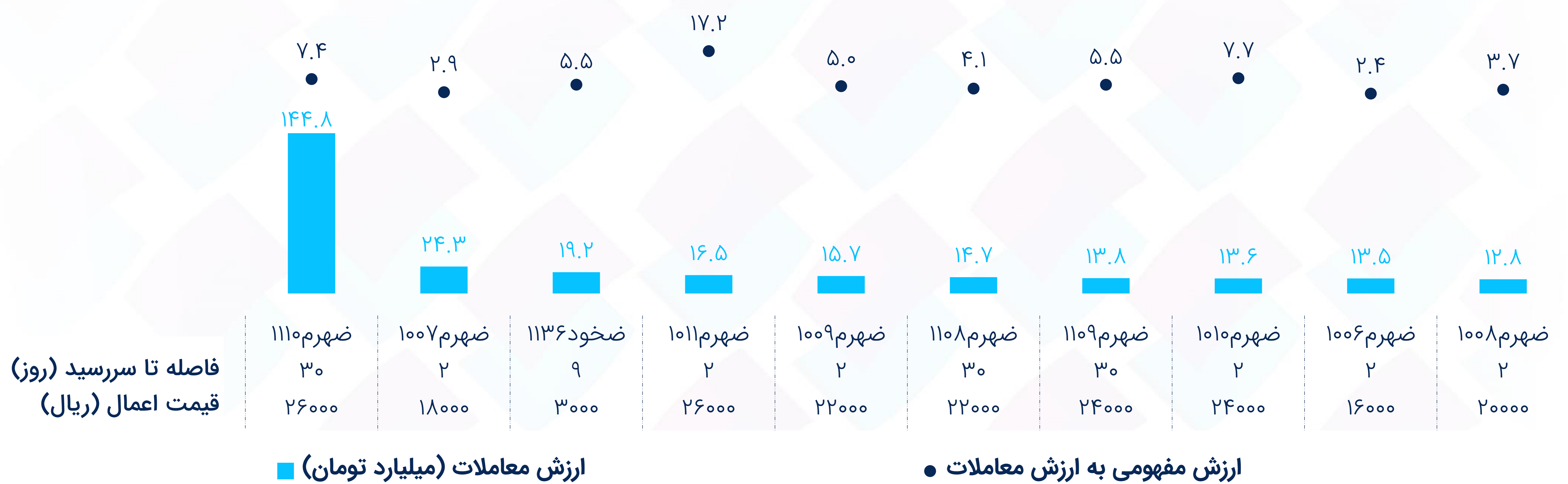


میلیون تومان



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
۹۲%	۱۲	۰.۰۳	۵,۰۰۱.۰	۸.۳%	۳۰,۰۰۶	۲۷,۷۰۰	۶	۷۲.۷	۲	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۳
۶۴%	۱,۲۹۱	۰.۷۳	۶۴.۶	۰.۲%	۵۰,۷۸۶	۵۰,۶۷۳	۷۸۶	۷۱.۱	۶	۵۰,۰۰۰	آساس ۱۰۰۶
۴۵%	۳۴۸	۰.۴۴	۱۱۷.۷	۱.۹%	۲۸,۲۴۰	۲۷,۷۰۰	۲۴۰	۵,۳۱۲.۷	۲	۲۸,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۲
۴۴%	۳۲	۰.۴۴	۱۳۷.۴	۱.۷%	۳,۰۲۲	۲,۹۷۲	۲۲	۱,۹۷۲.۶	۲	۳,۰۰۰	خسپا ۱۰۲۷
۲۹%	۱۵,۳۹۹	۱.۰۰	۲.۱	(۱۰.۰%)	۲۴,۹۳۴	۲۷,۷۰۰	۱۱,۹۳۴	۱۷.۹	۵۸	۱۳,۰۰۰	اهرم ۱۲۳۵

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	۲۵۱.۰	۸۷%	۱,۰۰۴	۵۳۸	۴	۲۷.۱	۳۰	۱,۰۰۰	ذوب ۱۱۳۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴,۸۵۸.۱	۲۳%	۳۴,۰۰۷	۲۷,۷۰۰	۷	۷.۴	۲	۳۴,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۸۱.۰	۶۸%	۹۰۵	۵۳۸	۵	۲۲.۲	۳۰	۹۰۰	ذوب ۱۱۳۴
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۰۱.۰	۵۰%	۸۰۸	۵۳۸	۸	۳۹.۵	۳۰	۸۰۰	ذوب ۱۱۳۳
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۶۴۳.۹	۲۴%	۴,۵۰۷	۳,۶۴۵	۷	۲.۰	۹	۴,۵۰۰	خودرو ۱۱۴۱

(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
۵۳.۵%	۱۸	-۰.۰۴	۲,۱۶۵.۷	(۶.۲%)	۲۵,۹۸۸	۲۷,۷۰۰	۱۲	۲۸۱.۸	۲	۲۶,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۱
۱.۳%	۵۳۵	-۰.۵۶	۵۲.۰	(۰.۸%)	۲۷,۴۷۲	۲۷,۷۰۰	۵۲۸	۲,۶۴۲.۶	۲	۲۸,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۲
(۲.۳%)	۲,۱۹۱	-۰.۹۷	۱۲.۴	۰.۲%	۲۷,۷۵۷	۲۷,۷۰۰	۲,۲۴۳	۷۶.۹	۲	۳۰,۰۰۰	اهرم ۱۰۱۳
(۱۰.۵%)	۵,۴۰۹	-۰.۹۵	۴.۶	۰.۹%	۲۷,۹۵۶	۲۷,۷۰۰	۶,۰۴۴	۲۶۶.۵	۳۰	۳۴,۰۰۰	اهرم ۱۱۱۳
(۱۱.۲%)	۳۲۱	-۰.۹۱	۱۰.۱	(۰.۲%)	۳,۶۳۹	۳,۶۴۵	۳۶۱	۱۵۰.۵	۹	۴,۰۰۰	خودرو ۱۱۴۰

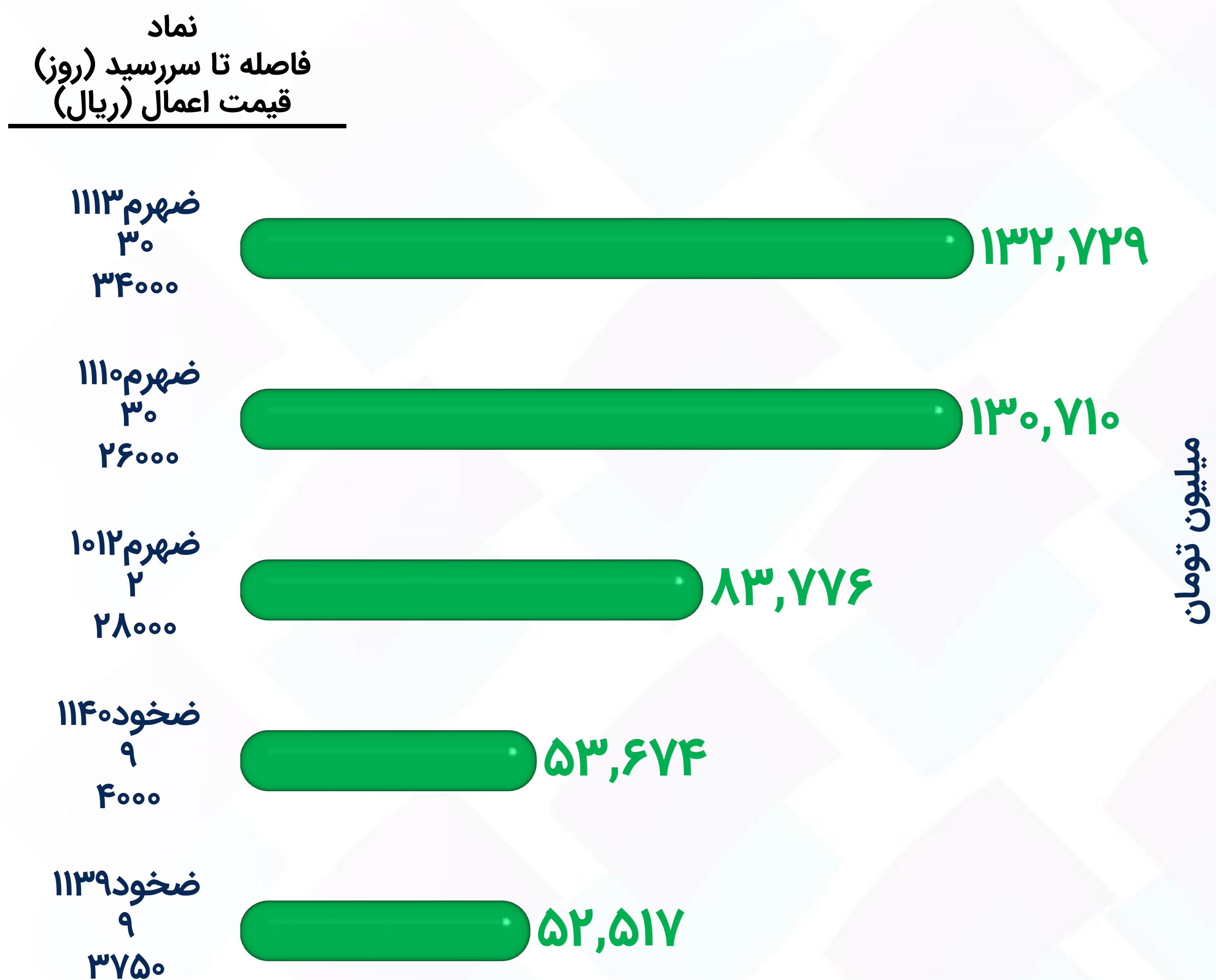
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۵,۹۹۹.۰	(۳۵.۰%)	۱۷,۹۹۷	۲۷,۷۰۰	۳	۱۰.۶	۲	۱۸,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۷
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۳,۹۹۹.۰	(۴۲.۳%)	۱۵,۹۹۶	۲۷,۷۰۰	۴	۲۷.۹	۲	۱۶,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۶
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۱۰۷.۳	(۵۴.۳%)	۶۴۴	۱,۴۰۹	۶	۳.۳	۴۴	۶۵۰	شستا ۱۲۲۲
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۱۵۳.۵	(۳۳.۳%)	۳۳,۷۸۰	۵۰,۶۷۳	۲۲۰	۲.۲	۶	۳۴,۰۰۰	طاساس ۱۰۰
(۱۰۰.۰%)	۰	۰.۰۰	۴,۹۹۹.۰	(۲۷.۸%)	۱۹,۹۹۶	۲۷,۷۰۰	۴	۱۲.۷	۲	۲۰,۰۰۰	اهرم ۱۰۰۸

(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

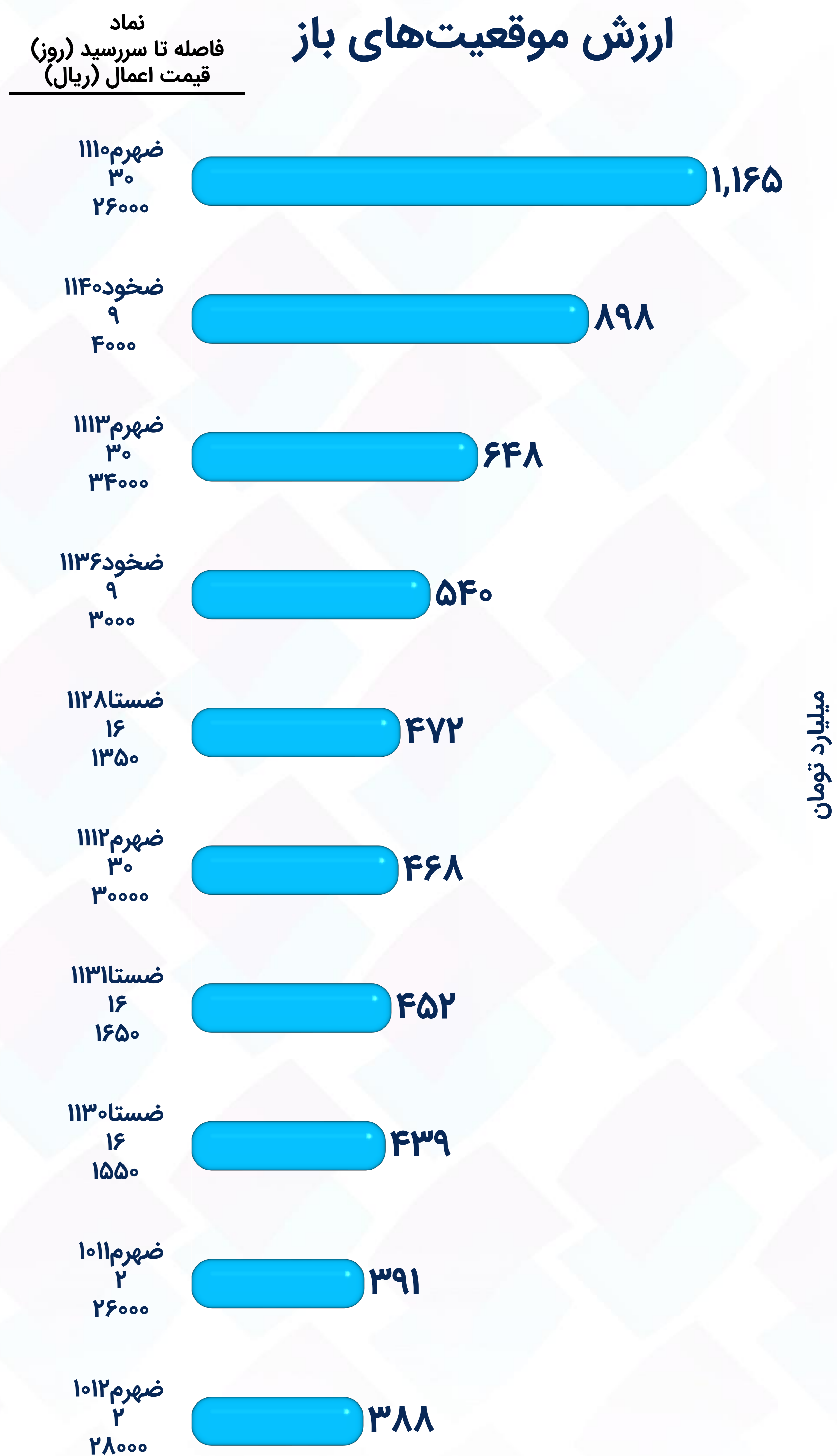
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

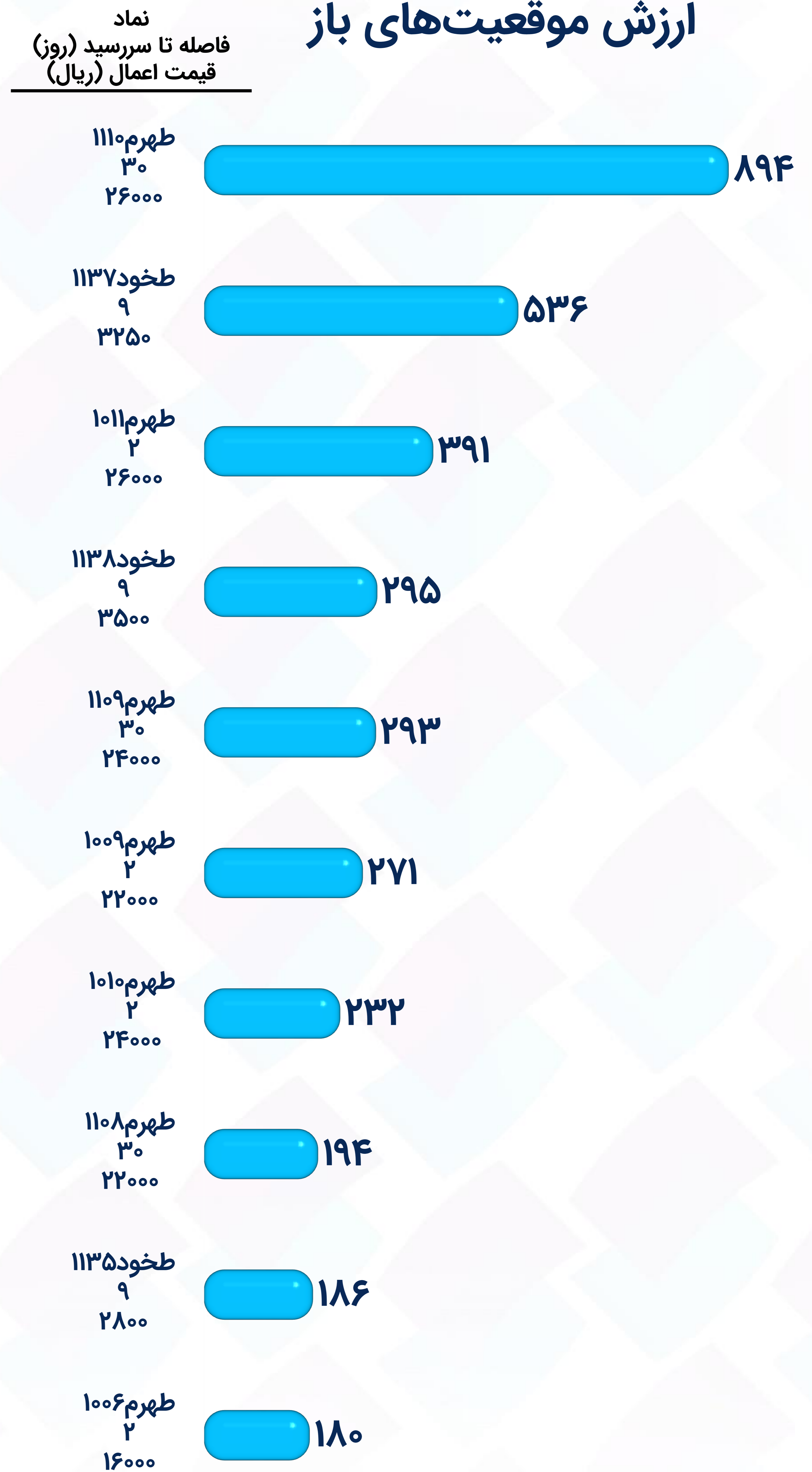
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

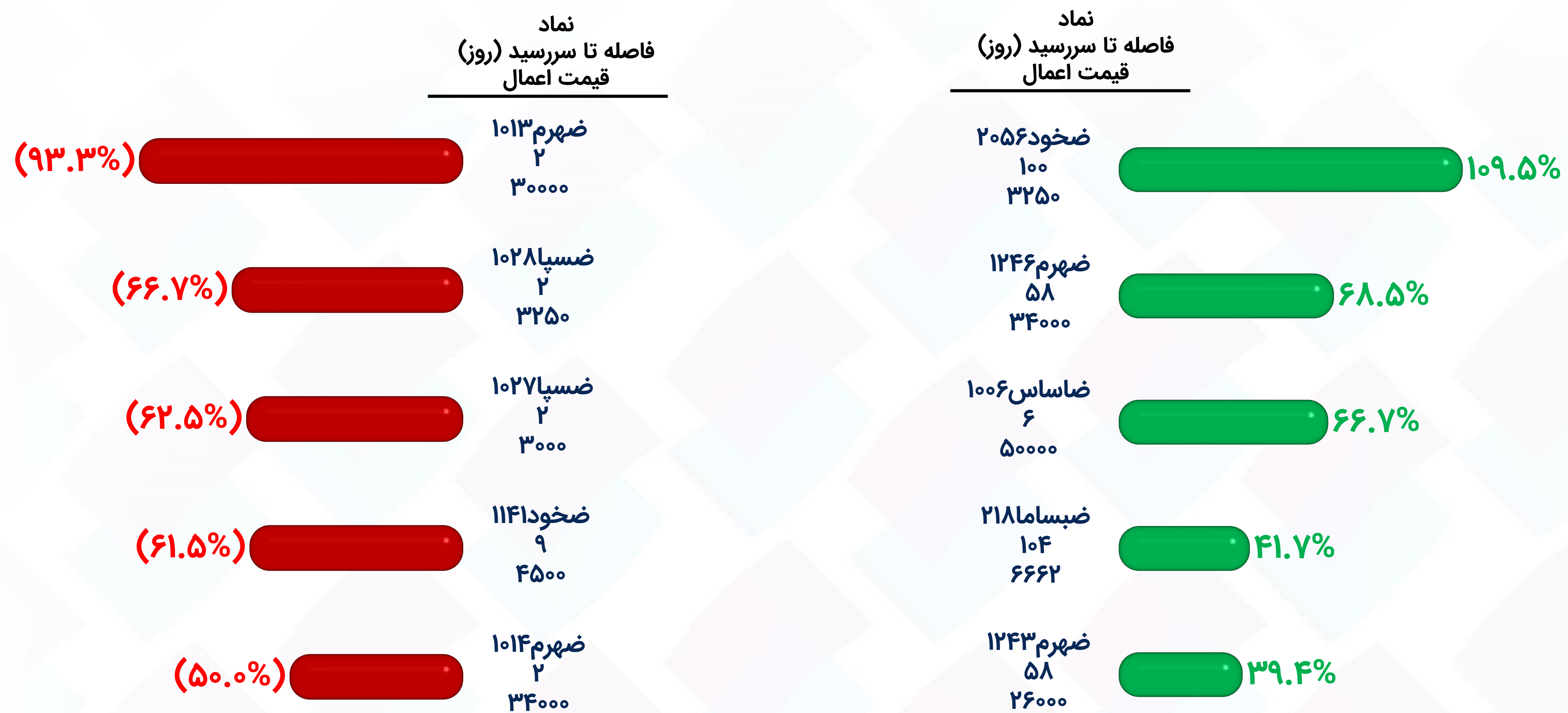


ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

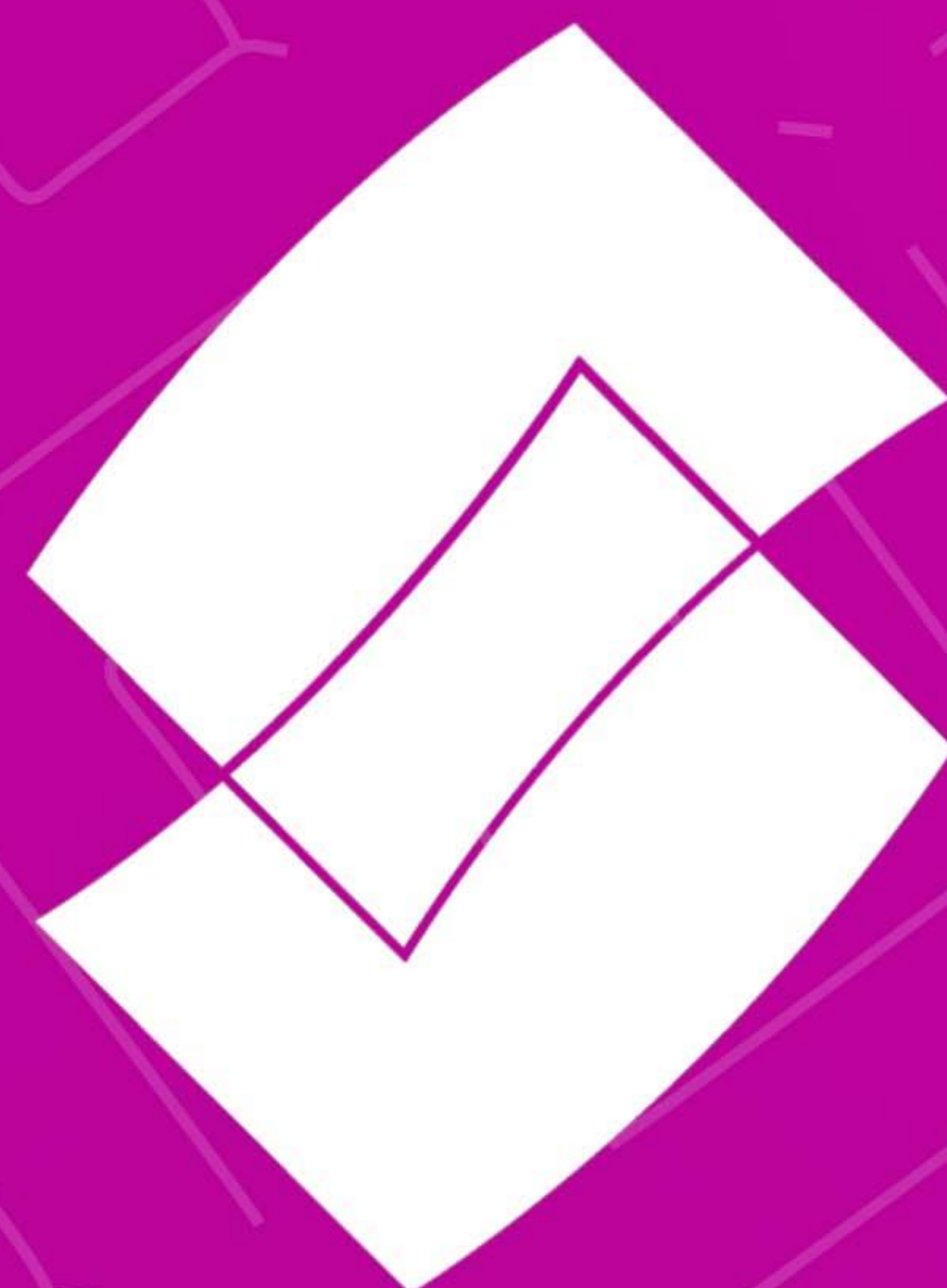
اختیار خرید



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.