

شماره
۴۰۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۶ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

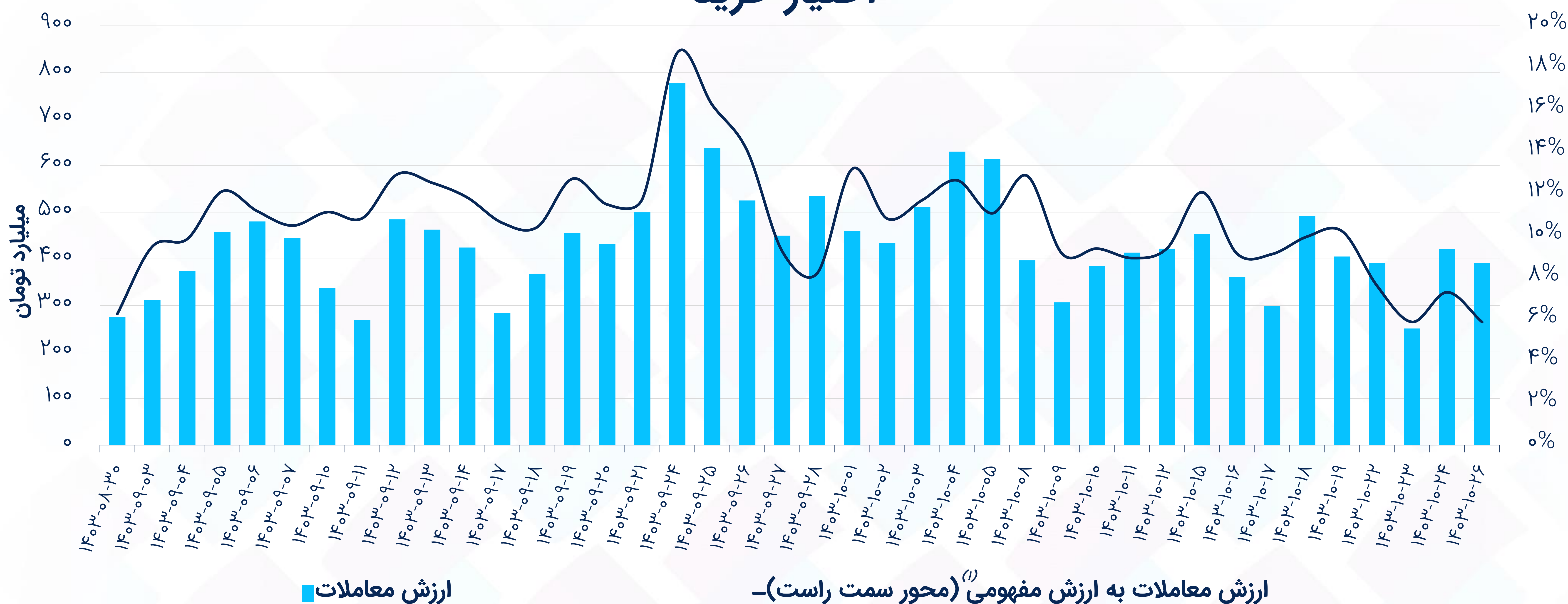




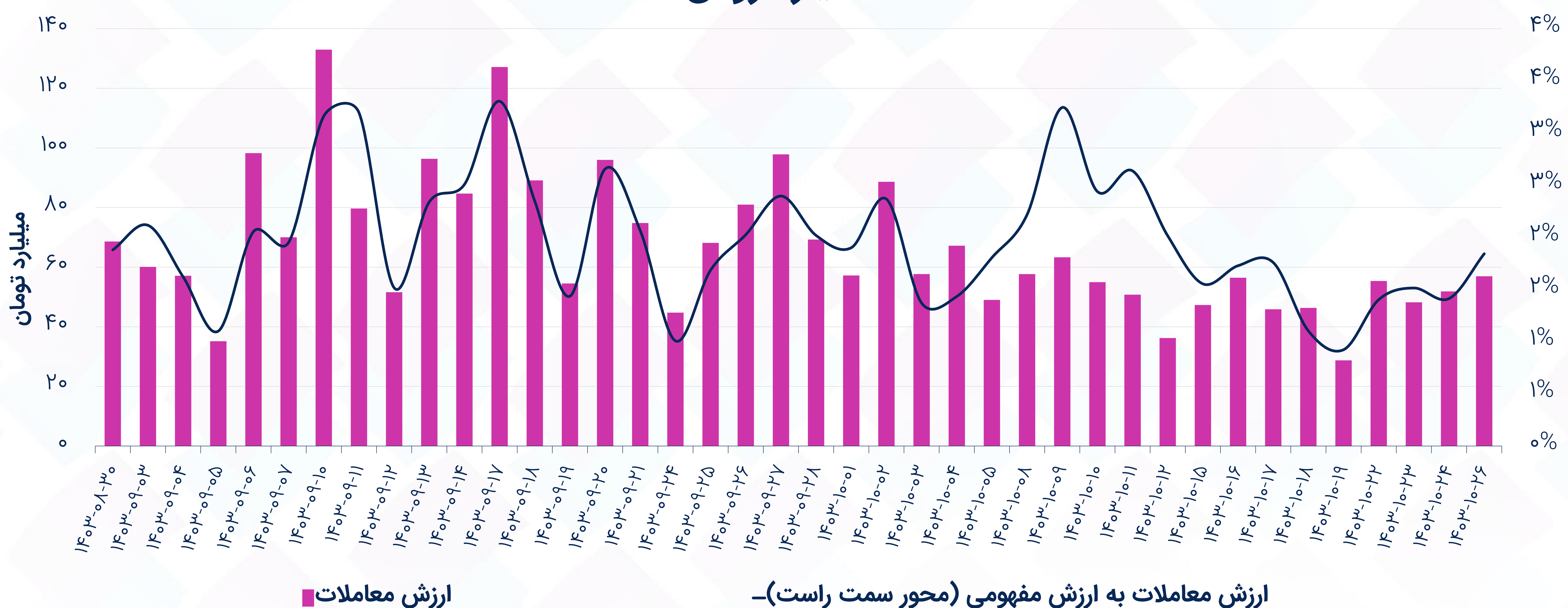
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



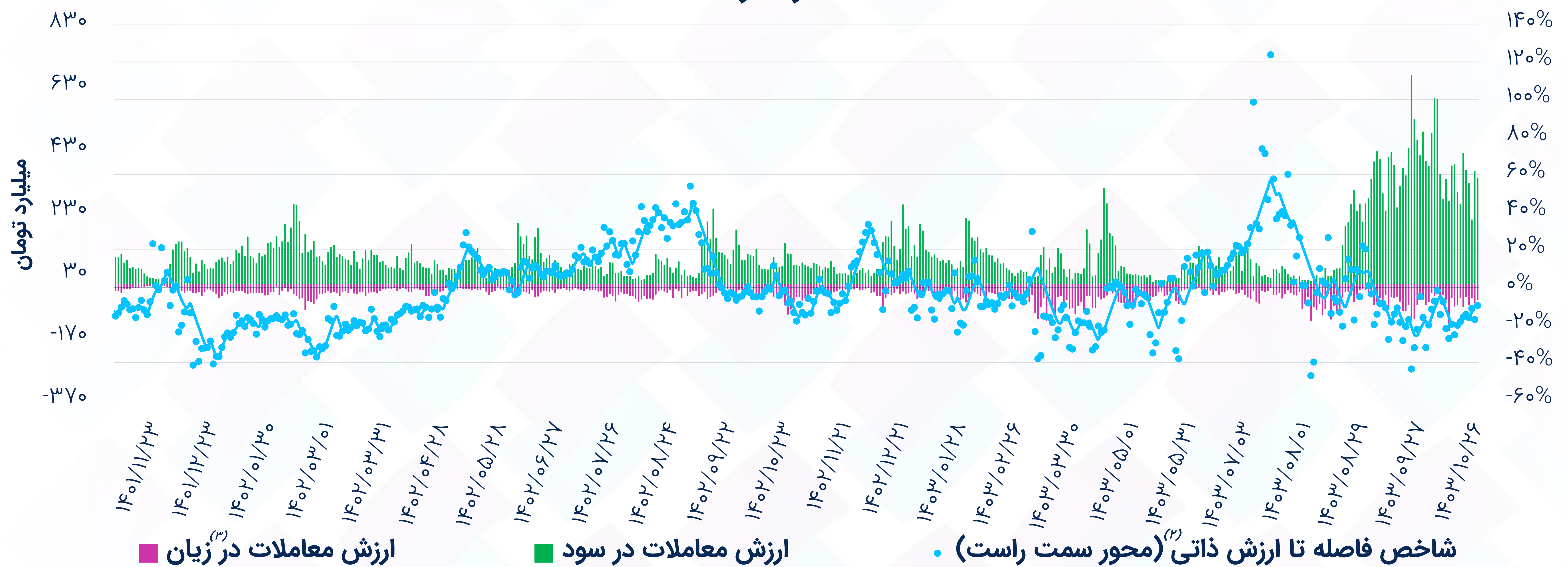
اختیار فروش



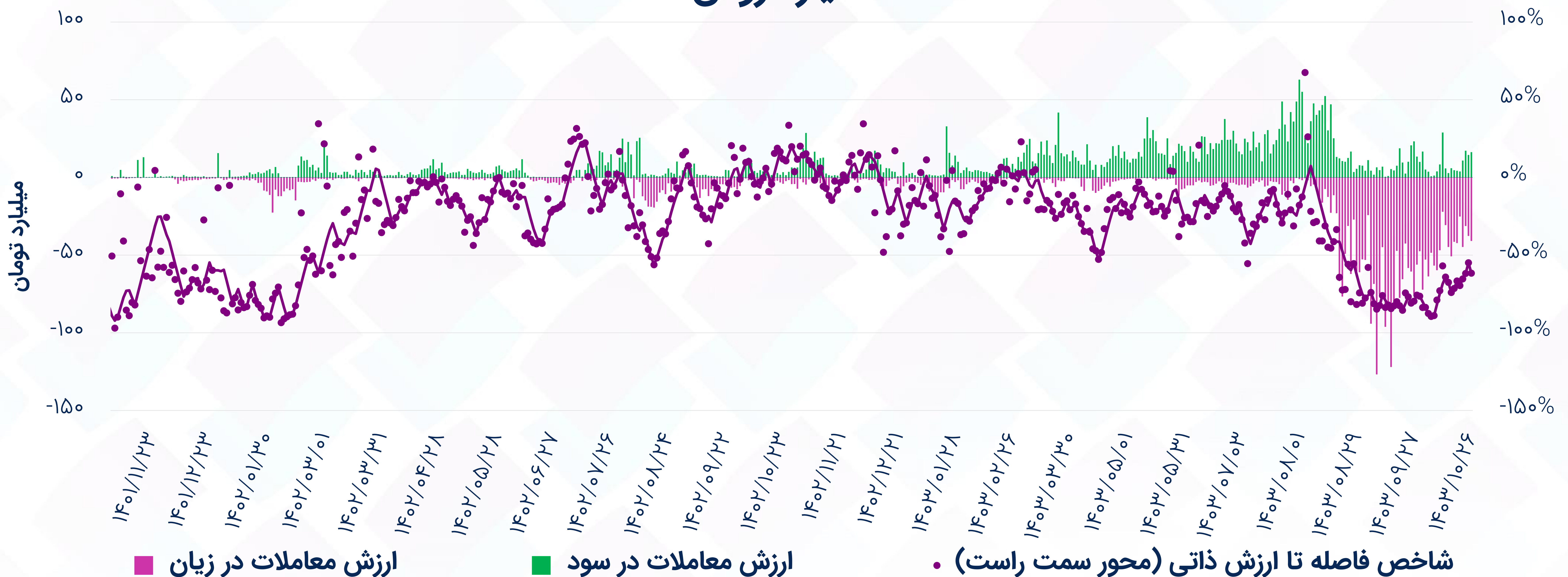
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

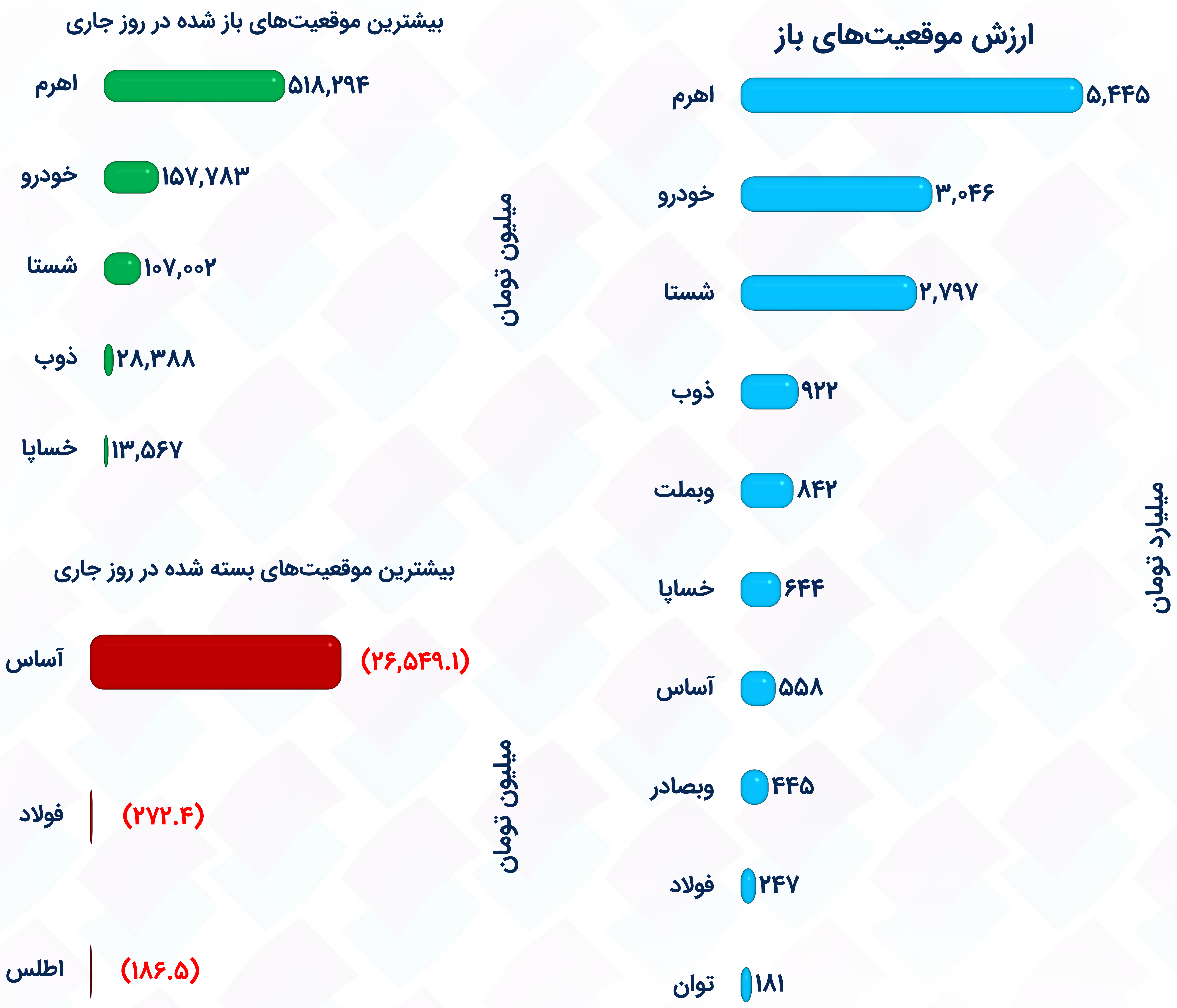
اختیار خرید

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	۴۰	۲۸۴.۴	۴,۰۸۸.۶	۲۵۸.۴	۲۵.۹	(۶.۹%)
خودرو	۳۱	۴۵.۸	۱,۳۹۴.۵	۳۴.۵	۱۱.۳	(۱۶.۰%)
شستا	۳۷	۱۶.۷	۴۲۴.۸	۶.۸	۹.۹	(۵۱.۷%)
آساس	۹	۱۴.۷	۴۲.۲	۱۴.۷	۰.۰	۳.۷%
خسپا	۱۹	۱۱.۳	۵۵۳.۸	۱۰.۱	۱.۲	۸.۵%
ذوب	۲۵	۶.۵	۶۵.۰	۵.۵	۱.۱	(۲۷.۷%)
وبملت	۱۷	۴.۴	۴۳.۷	۳.۸	۰.۶	(۲۳.۳%)

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	۲۱	۴۵,۱۷۵.۰	۲,۳۲۹,۹۷۹.۰	۱۲,۰۴۳.۸	۳۳,۱۳۱.۲	(۶۲.۳%)
خودرو	۱۰	۹,۰۱۵.۰	۶۱۶,۱۴۷.۶	۲,۹۹۱.۹	۶,۰۲۳.۲	(۵۶.۰%)
شستا	۱۸	۲,۳۸۶.۳	۱۲۲,۵۰۸.۴	۱,۱۲۴.۱	۱,۲۶۲.۲	(۶۸.۴%)
ذوب	۵	۱۶۳.۸	۳,۸۸۴.۸	۰.۰	۱۶۳.۸	(۷۴.۲%)
وبملت	۳	۱۵۷.۵	۹,۵۹۱.۹	۰.۰	۱۵۷.۵	(۸۵.۷%)
توان	۱	۳۶.۸	۷۷۹.۲	۰.۰	۳۶.۸	(۷۰.۷%)
آساس	۱	۷.۰	۴,۱۶۳.۸	۰.۰	۷.۰	(۱۰۰.۰%)

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

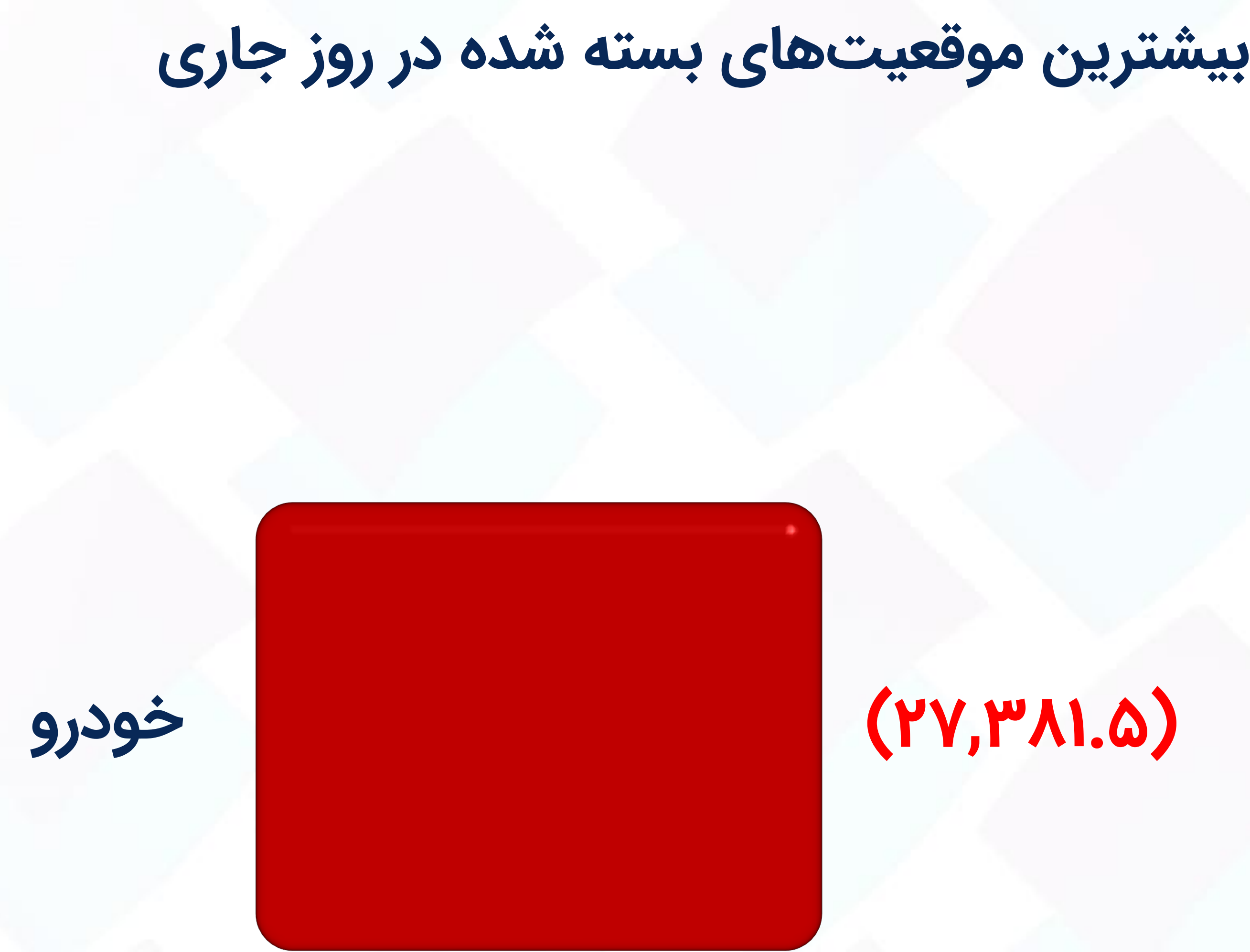


(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

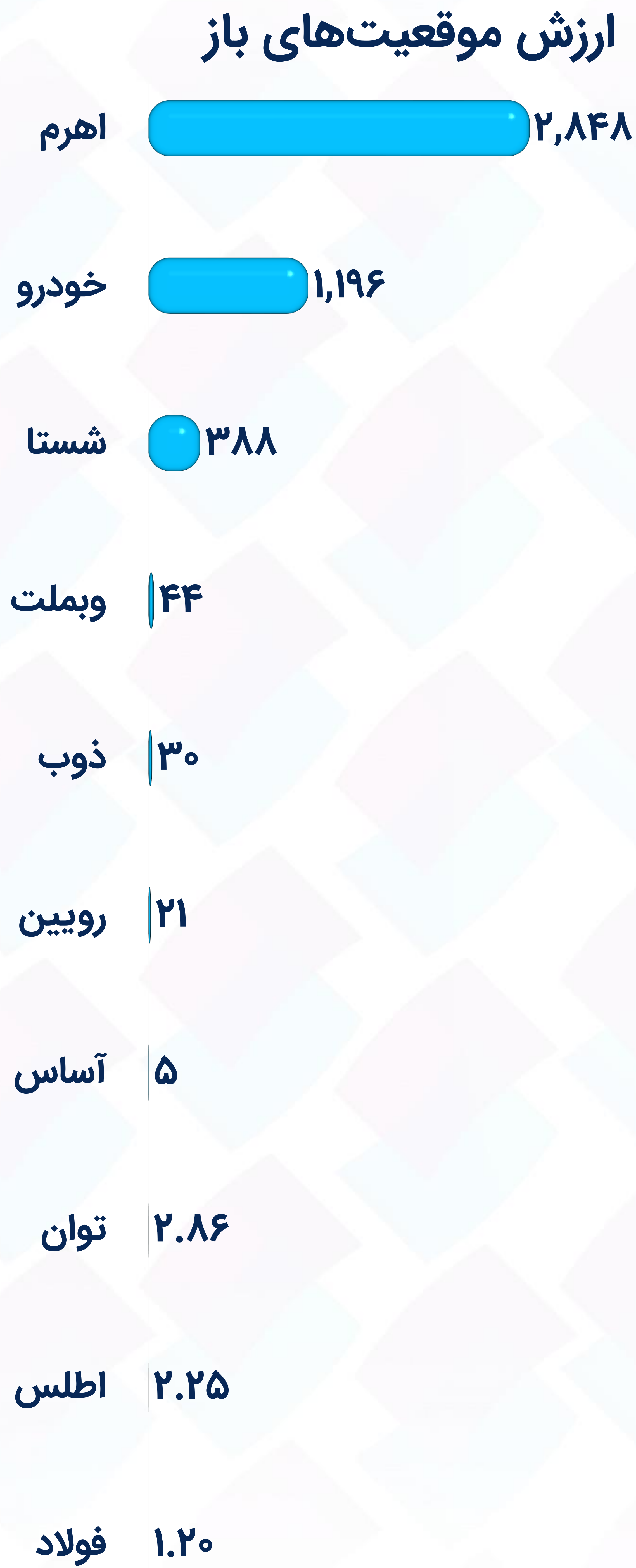
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان



میلیون تومان



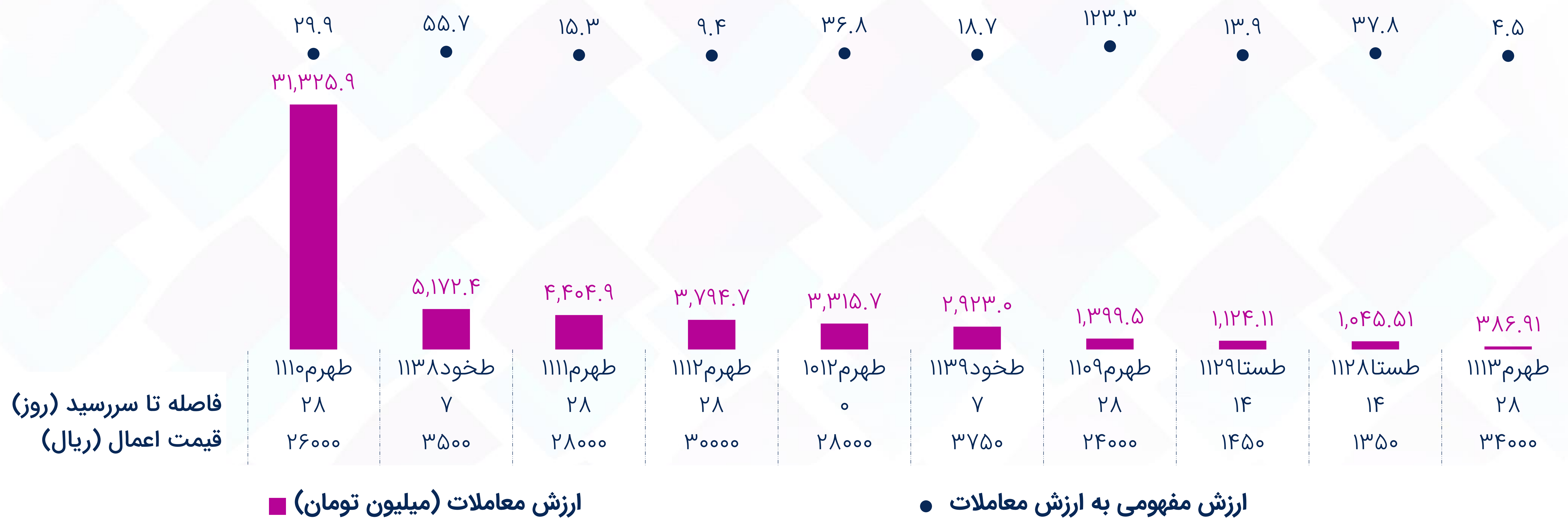
میلیارد تومان

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
ضاساس ۱۰۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۴	۳.۵	۵۱۷	۵۰,۹۳۷	۵۰,۵۱۷	(۰.۸%)	۹۷.۷	۰.۸۱	۱,۲۷۶	۱۴۷%
ضهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۵۶	۷.۶	۳,۰۴۱	۲۷,۶۳۰	۲۵,۰۴۱	(۹.۴%)	۸.۲	۰.۹۸	۶,۷۸۰	۱۲۳%
ضهرم ۱۲۳۵	اهرم	۱۳,۰۰۰	۵۶	۱۸.۷	۱۲,۴۹۶	۲۷,۶۳۰	۲۵,۴۹۶	(۷.۷%)	۲.۰	۱.۰۰	۱۵,۲۹۲	۲۲%
ضخود ۱۱۳۰	خودرو	۱,۹۰۰	۷	۴.۴	۱,۴۲۵	۳,۶۱۹	۳,۳۲۵	(۸.۱%)	۲.۳	۱.۰۰	۱,۷۳۴	۲۲%
ضفرز ۱۲۰۴	فرز	۳۶,۰۰۰	۴۶	۶۵.۶	۵,۵۶۲	۴۰,۸۵۰	۴۱,۵۶۲	۱.۷%	۷.۵	۰.۹۴	۶,۴۳۷	۱۶%

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
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۲۸	۹.۲	۳	۵۳۰	۱,۰۰۳	۸۹%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۲۸	۳.۵	۳	۵۳۰	۹۰۳	۷۰%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۸	۴۳.۲	۴	۵۳۰	۸۰۴	۵۲%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضملی ۱۱۹۸	فملی	۱۰,۰۰۰	۷	۱.۷	۸۳	۸,۵۹۰	۱۰,۰۸۳	۱۷%	۱۲۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۳۵	۱۵۶.۲	۶۷	۳,۶۱۹	۵,۰۶۷	۴۰%	۷۵.۶	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 ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۸	۳۸۶.۹	۶,۱۳۲	۲۷,۶۳۰	۲۷,۸۶۸	۰.۹%	۴.۵	-۰.۹۶	۵,۵۵۳	(۹.۴%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۷	۶۷.۴	۴۱۲	۳,۶۱۹	۳,۵۸۸	(۰.۹%)	۸.۷	-۰.۹۶	۳۵۲	(۱۴.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۸	۳,۷۹۴.۷	۲,۹۵۱	۲۷,۶۳۰	۲۷,۰۴۹	(۲.۱%)	۹.۲	-۰.۷۰	۲,۱۰۷	(۲۸.۶%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۷	۲,۹۲۳.۰	۱۹۴	۳,۶۱۹	۳,۵۵۶	(۱.۷%)	۱۸.۳	-۰.۷۰	۱۳۶	(۳۰.۰%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۳,۷۵۰	۳۵	۱.۵	۲۲۴	۳,۶۱۹	۳,۵۲۶	(۲.۶%)	۱۵.۷	-۰.۴۹	۱۵۴	(۳۱.۳%)

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
طرویین ۱۰۰۴	رویین	۱۰,۰۰۰	۴	۱.۰	۱۰	۱۳,۴۷۹	۹,۹۹۰	(۲۵.۹%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۱۴	۱.۹	۲	۱,۳۹۹	۸۴۸	(۳۹.۴%)	۴۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طاساس ۱۰۰۱	آساس	۳۴,۰۰۰	۴	۷.۰	۸۶	۵۰,۹۳۷	۳۳,۹۱۴	(۳۳.۴%)	۳۹۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۱۴	۱۶.۷	۳	۱,۳۹۹	۹۴۷	(۳۲.۳%)	۳۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۱۴	۱۰.۳	۲	۱,۳۹۹	۱,۰۴۸	(۲۵.۱%)	۵۲۴.۰	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

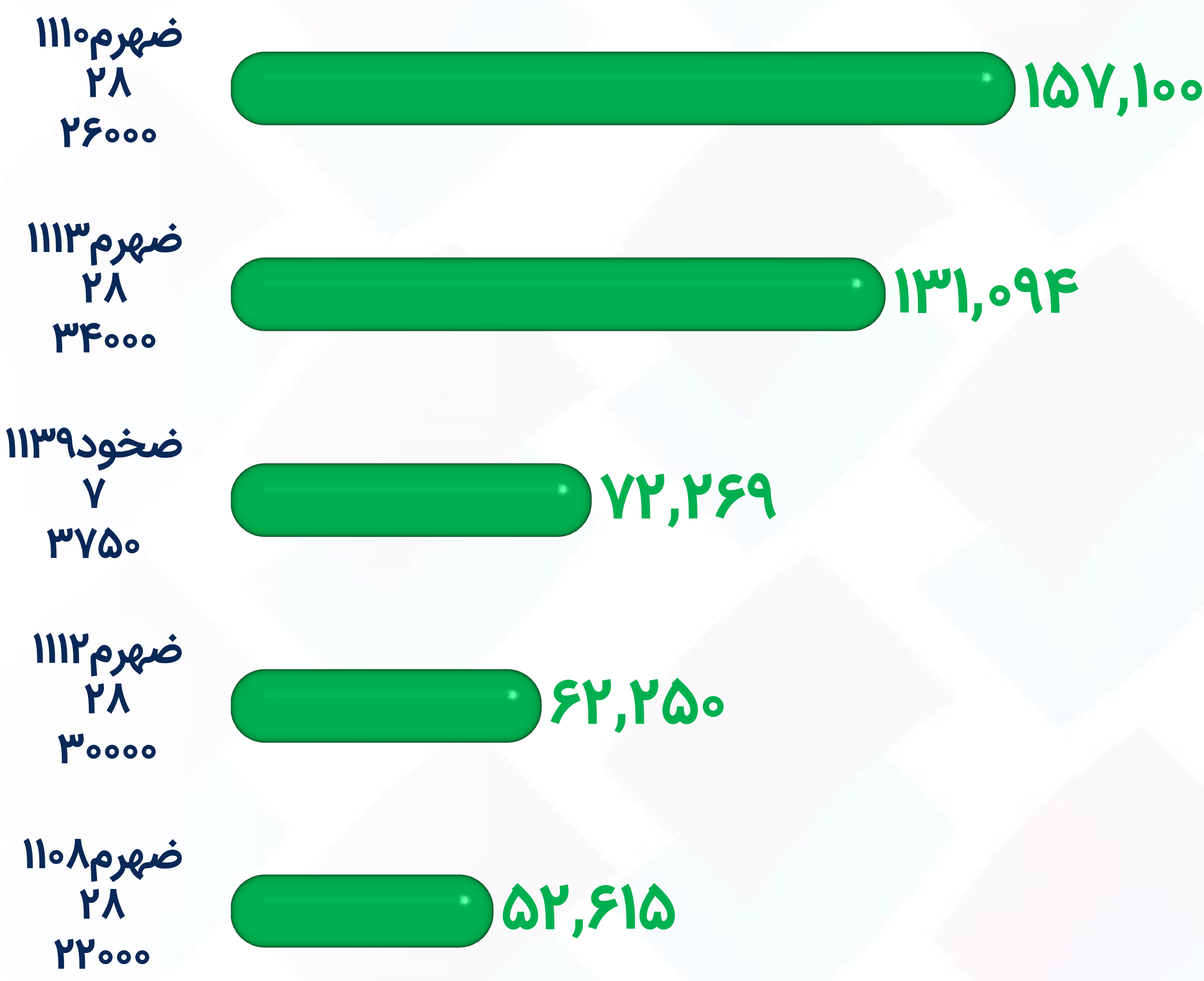
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

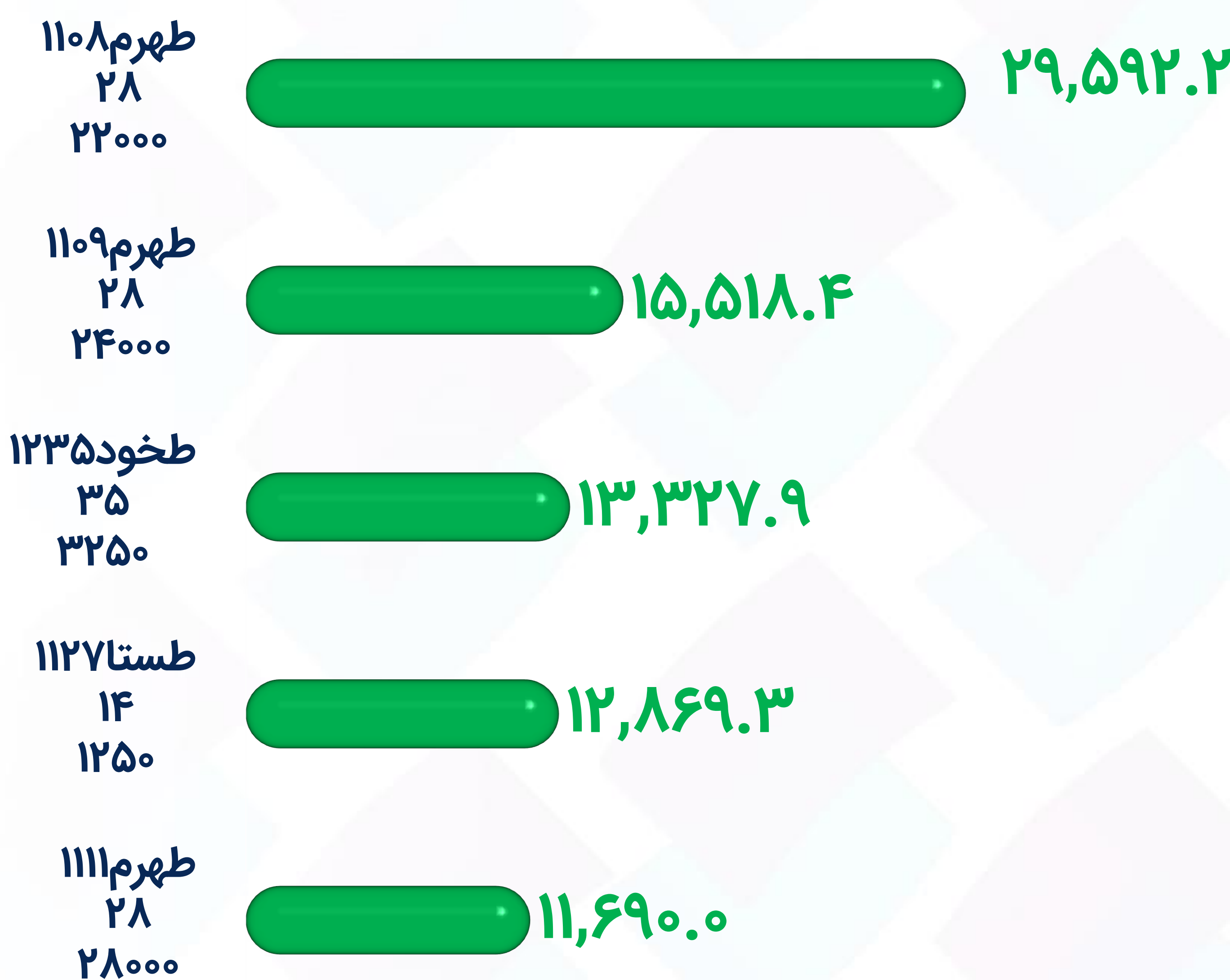
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

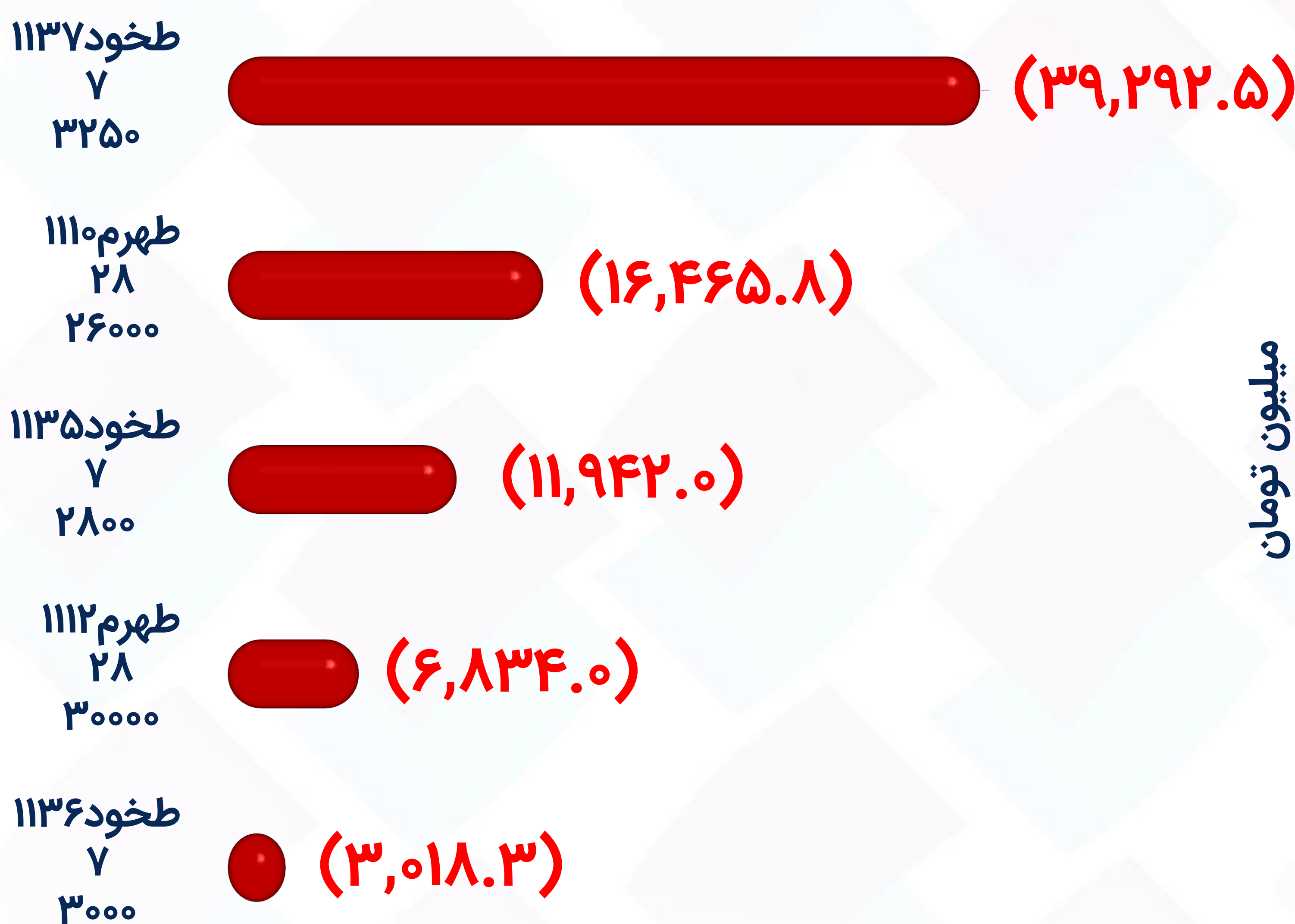
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

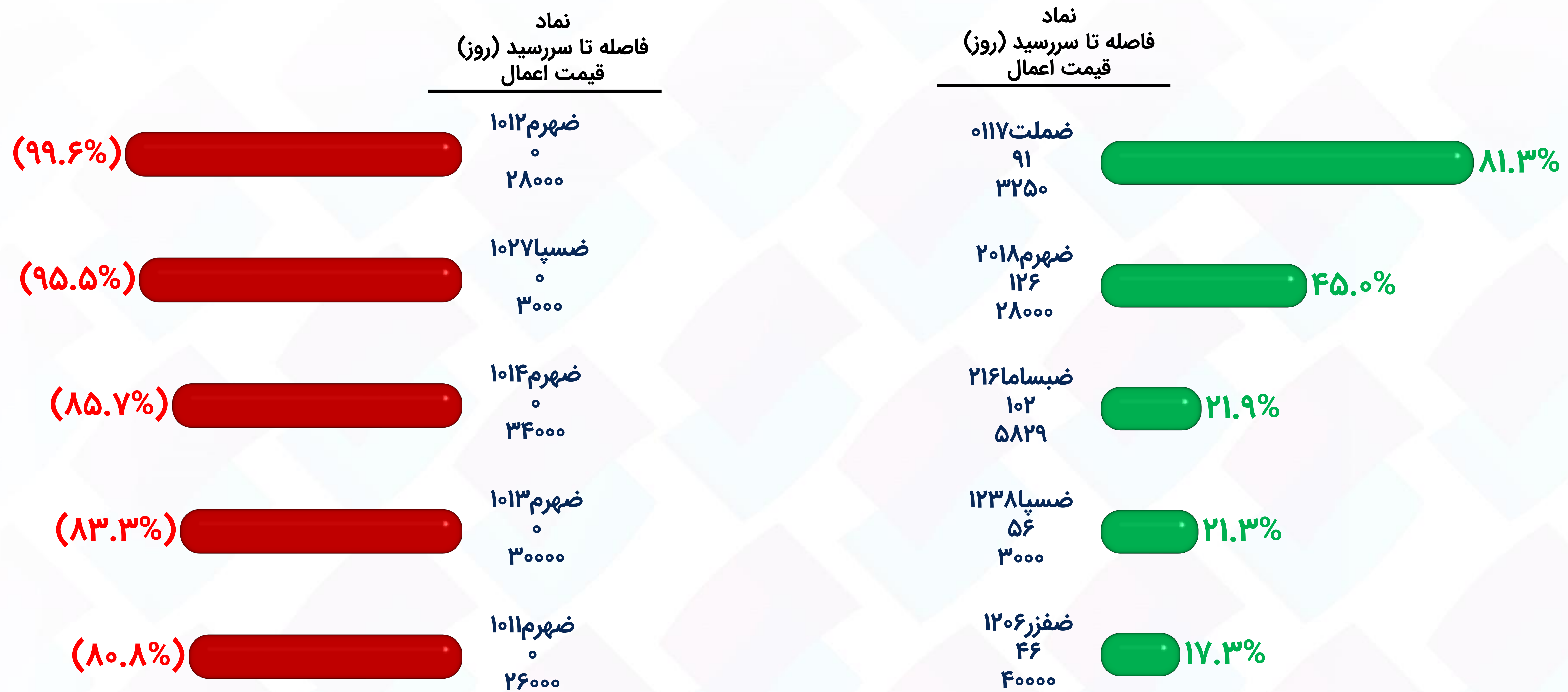
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



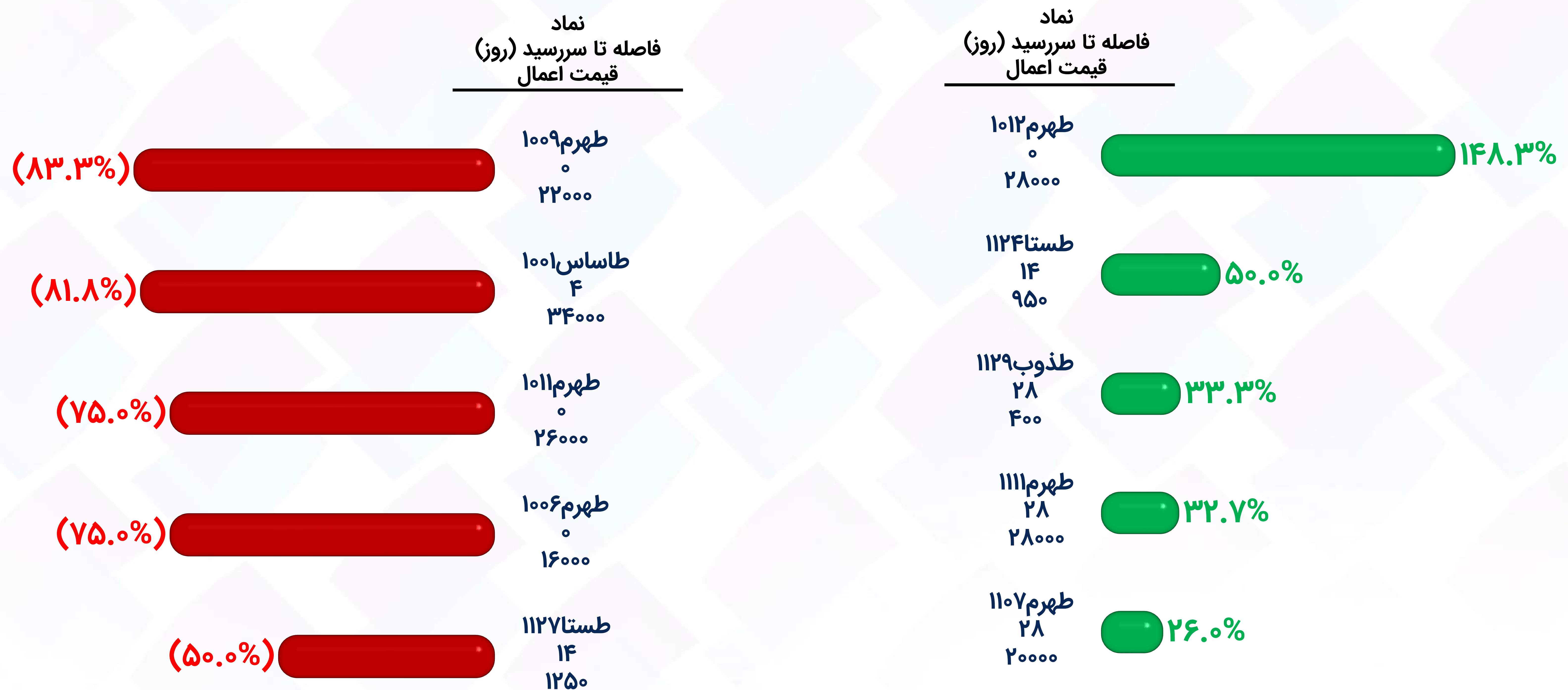
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

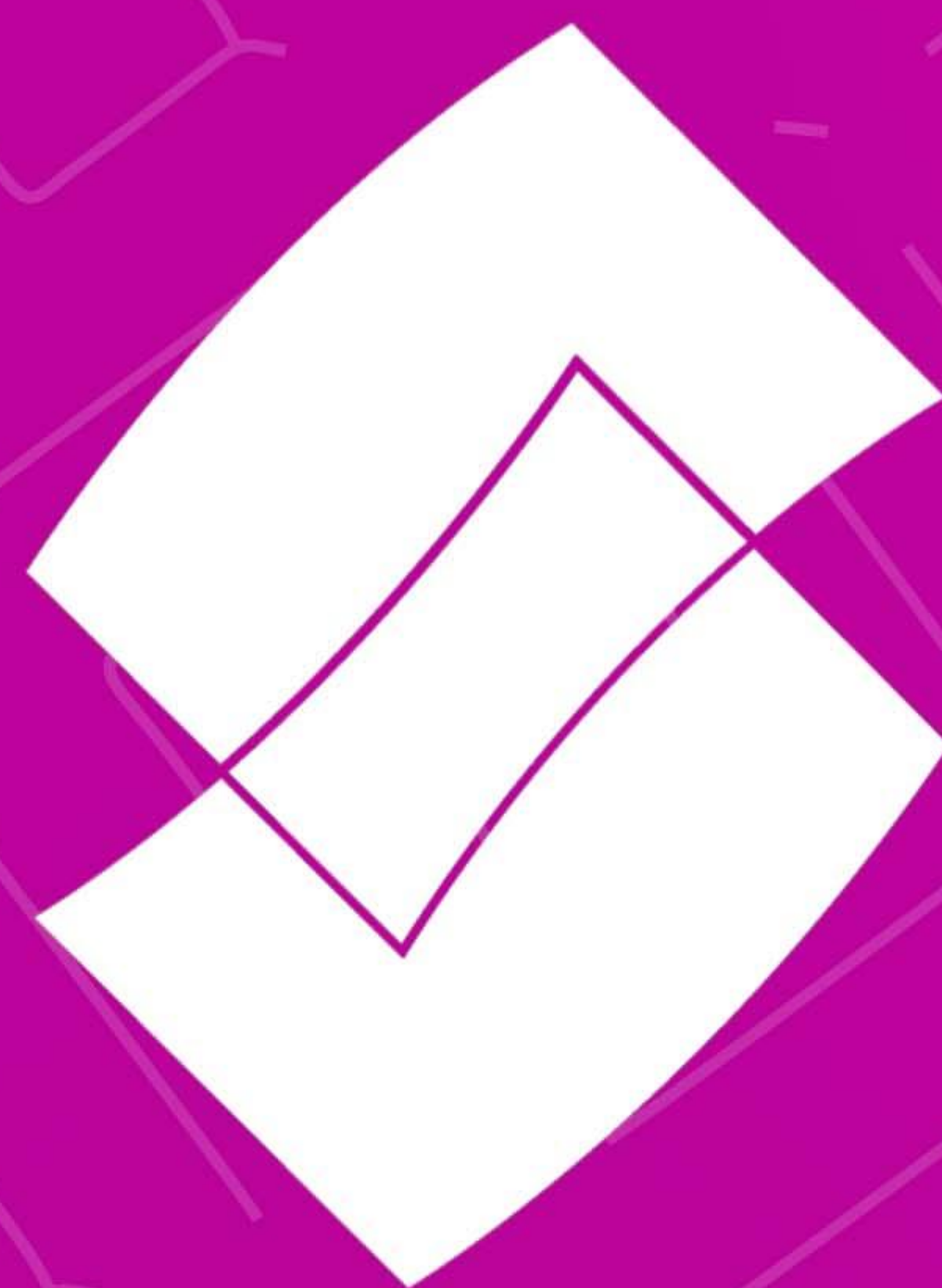
اختیار خرید



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.