

شماره
۴۰۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۹ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

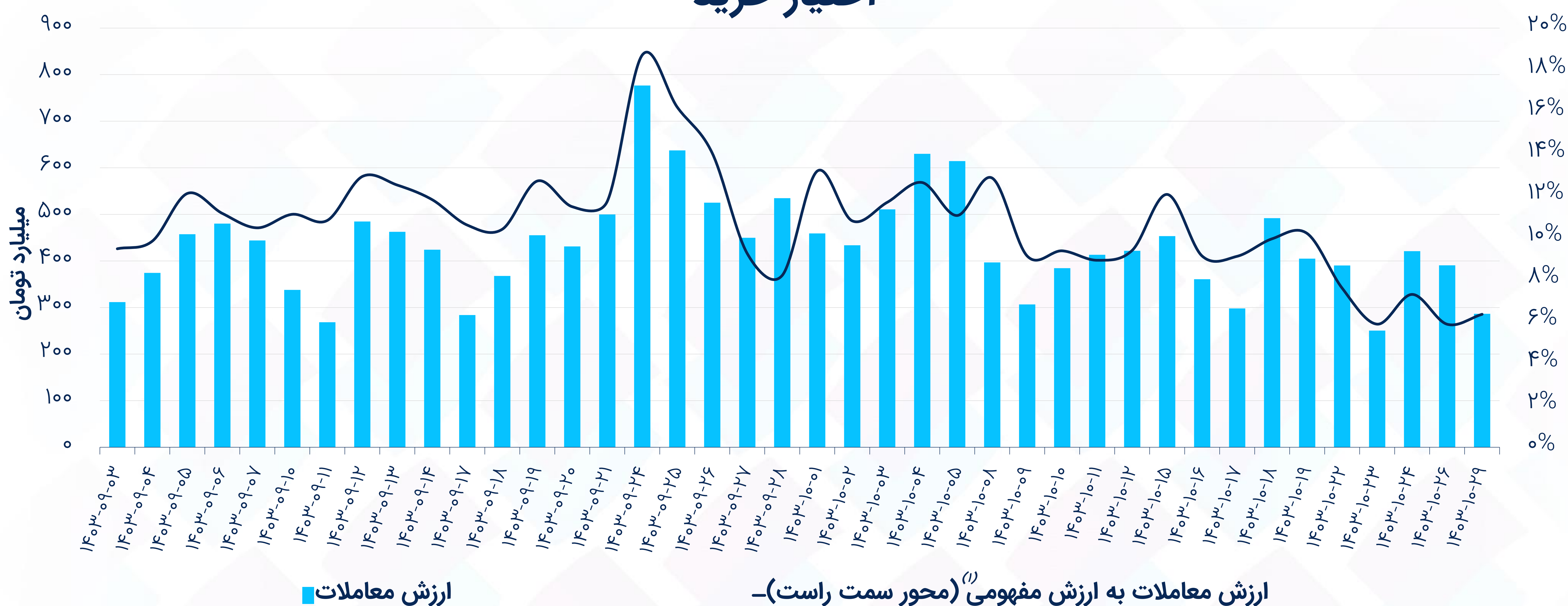




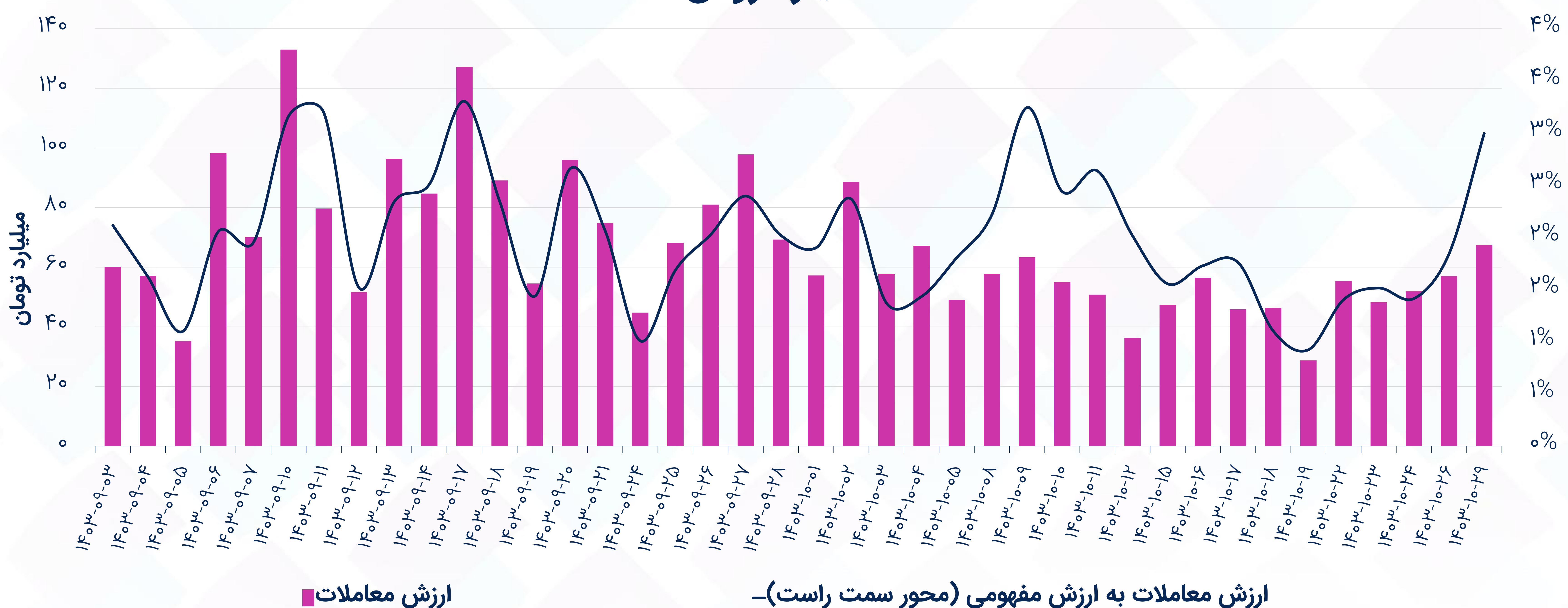
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



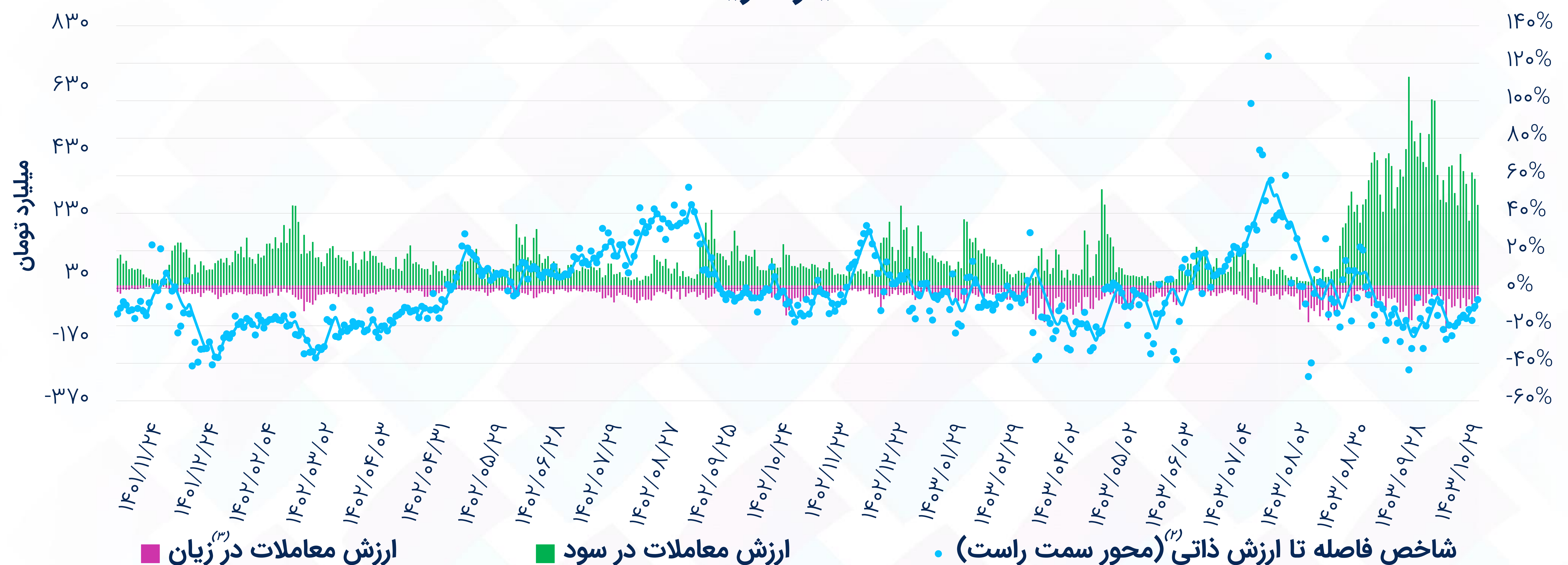
اختیار فروش



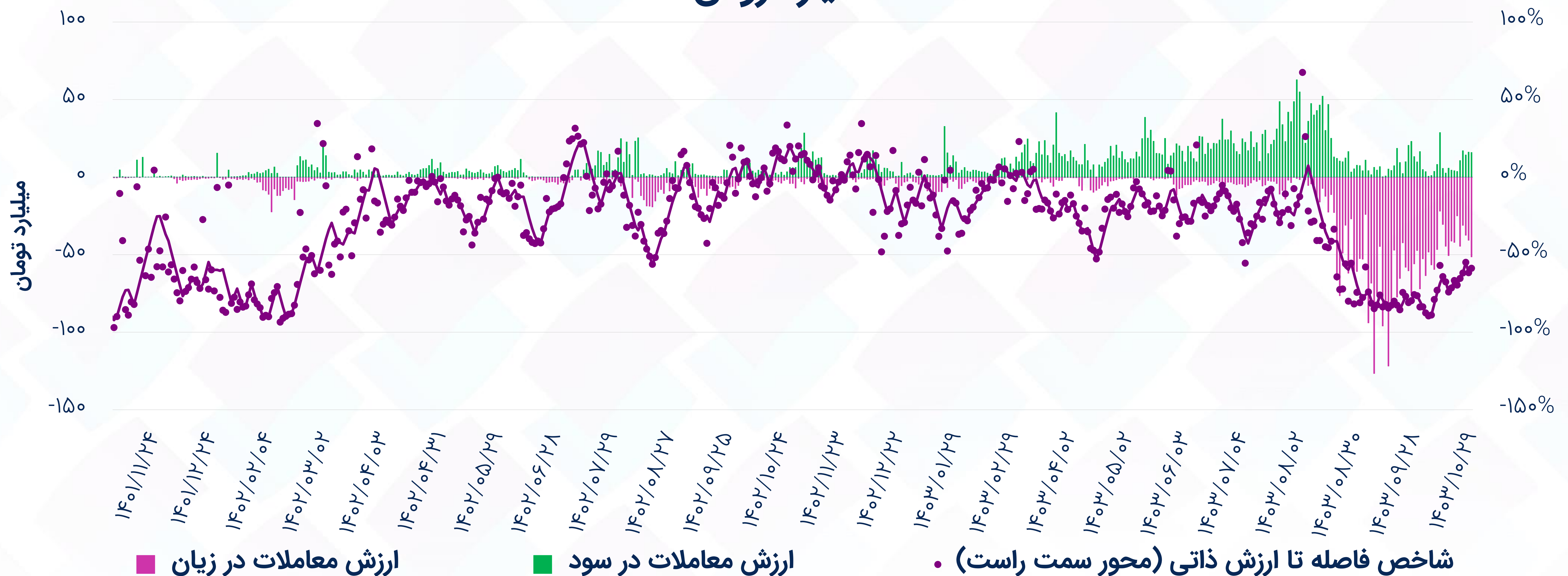
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

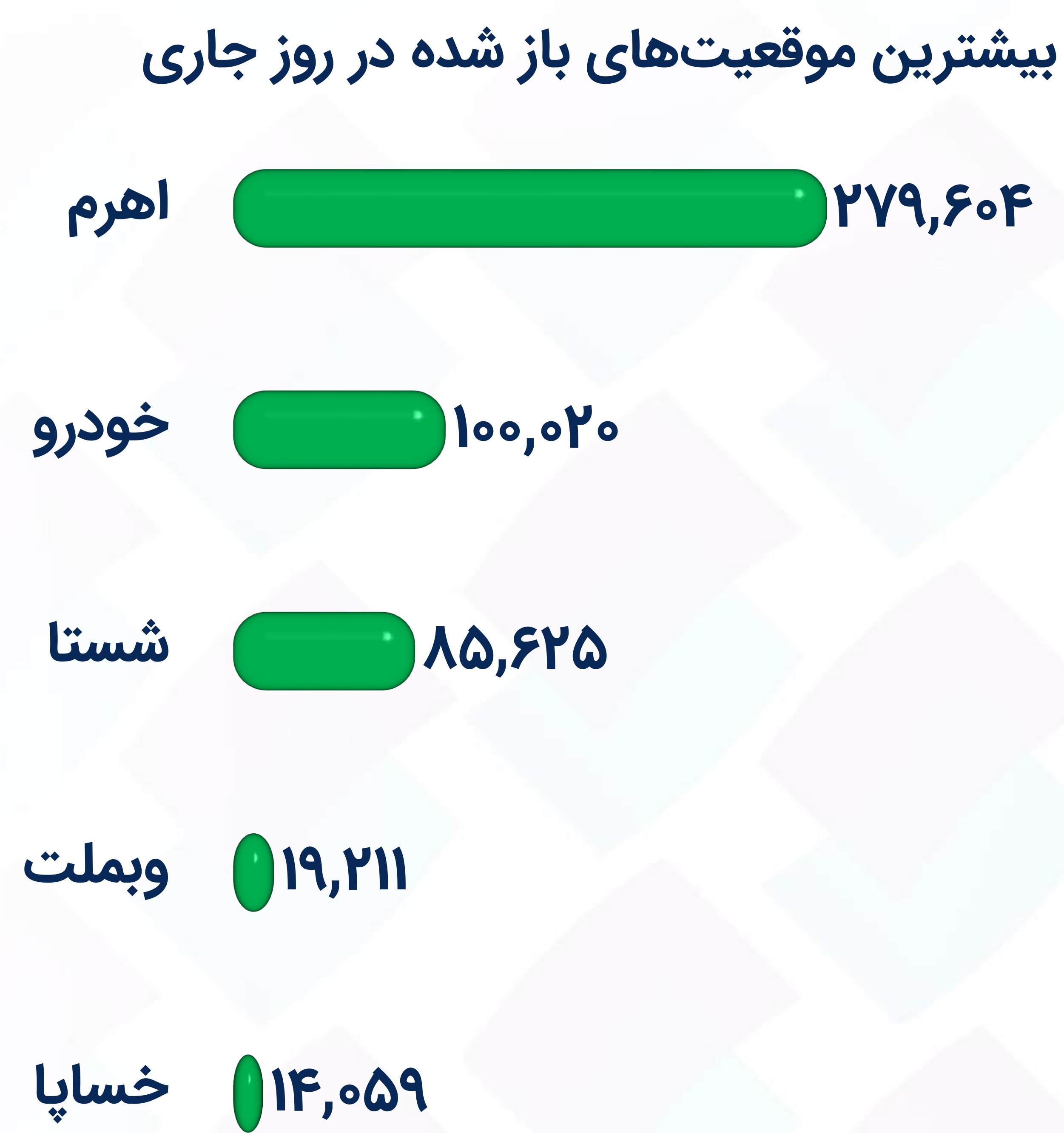
اختیار خرید

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
آساس	۱۰	۱۰۵.۷	۳۳۵.۹	۱۰۵.۷	۰.۰	۱.۲%
اهرم	۲۵	۷۷.۲	۱,۱۴۳.۵	۶۴.۶	۱۲.۷	(۲۳.۰%)
خودرو	۳۷	۶۰.۹	۲,۱۰۲.۶	۵۴.۹	۶.۱	۱۲.۲%
شستا	۴۰	۲۳.۲	۷۳۶.۱	۱۴.۱	۹.۱	(۲۳.۹%)
ذوب	۲۱	۷.۵	۷۴.۲	۶.۸	۰.۷	(۱۲.۵%)
وبملت	۱۹	۳.۶	۴۹.۱	۲.۸	۰.۷	(۲۵.۴%)
خسپا	۱۱	۲.۶	۳۳.۶	۲.۳	۰.۳	(۱۶.۲%)

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	۱۵	۴۱,۵۱۸.۳	۱,۰۴۶,۷۷۷.۱	۷,۷۵۶.۵	۳۳,۷۶۱.۸	(۶۳.۶%)
خودرو	۱۰	۲۰,۷۷۱.۳	۹۴۲,۸۸۴.۵	۶,۶۰۶.۹	۱۴,۱۶۴.۳	(۴۷.۹%)
شستا	۲۰	۴,۷۰۸.۷	۲۲۸,۵۸۲.۷	۱,۵۰۸.۳	۳,۲۰۰.۴	(۶۲.۶%)
وبملت	۲	۲۱۲.۷	۸,۰۲۸.۹	۰.۰	۲۱۲.۷	(۷۷.۳%)
ذوب	۴	۱۳۸.۰	۵,۱۶۲.۳	۳.۰	۱۳۵.۰	(۷۲.۷%)
توان	۲	۴۸.۲	۶۷۳.۷	۳۴.۹	۱۳.۳	(۴۶.۳%)
رویین	۳	۴.۷	۸,۷۴۵.۲	۰.۰	۴.۷	(۱۰۰.۰%)

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



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

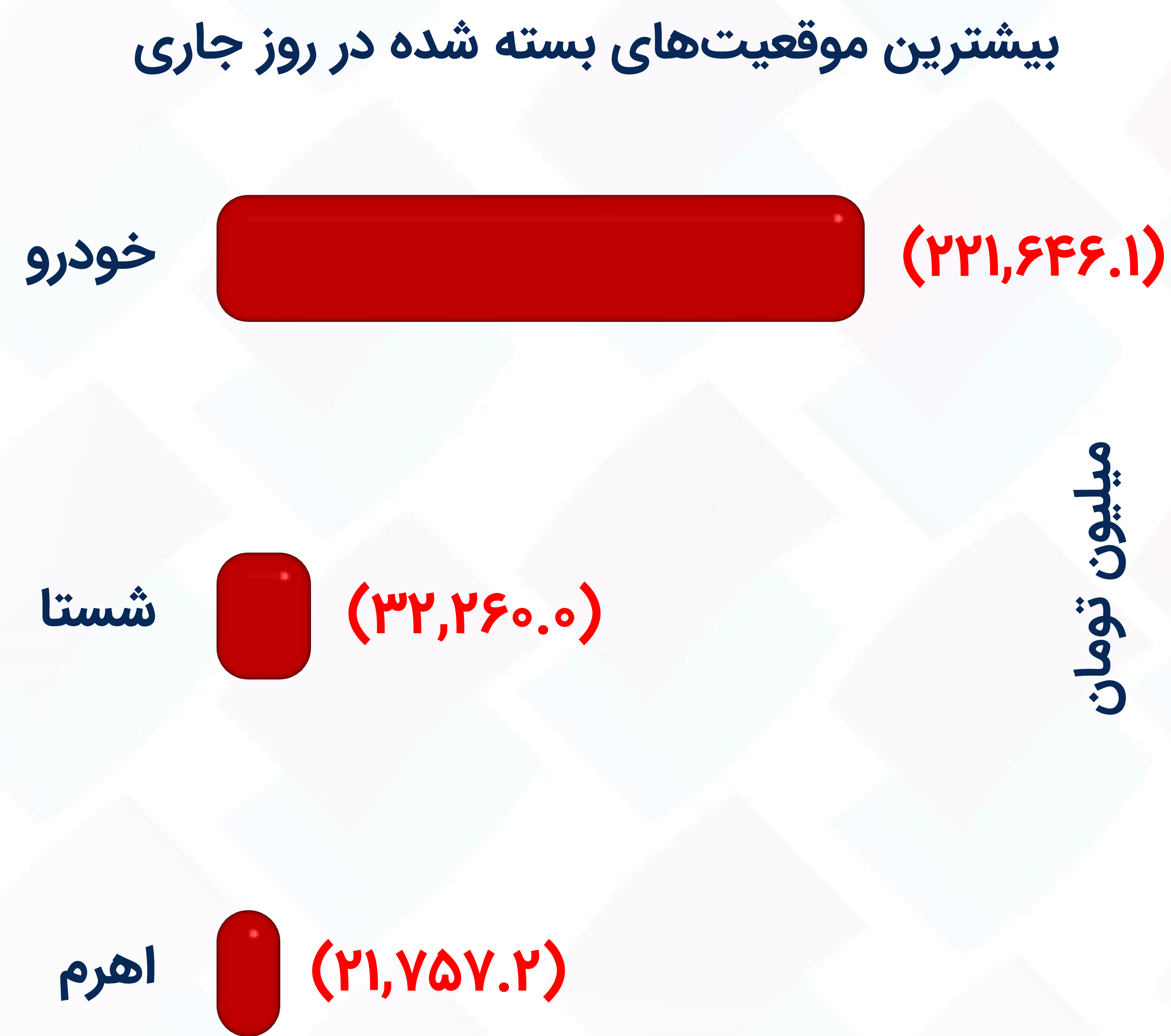
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان



میلیارد تومان



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

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
ضبید۱۲۰۵	بیدار	۱۴,۰۰۰	۴۶	۱۲.۹	۶۵۰	۱۴,۴۷۰	۱۴,۶۵۰	۱.۲%	۲۲.۵	۰.۷۲	۱,۴۸۹	۱۲۹%
ضفر۱۲۰۵	فزر	۳۸,۰۰۰	۴۳	۳۵.۴	۲,۴۵۶	۳۹,۷۵۰	۴۰,۴۵۶	۱.۸%	۱۶.۵	۰.۸۰	۳,۷۶۰	۵۳%
ضتاب۱۱۱۳	شتاب	۱۶,۰۰۰	۱۸	۳.۹	۱۳۷	۱۴,۸۵۰	۱۶,۱۳۷	۸.۷%	۱۱۷.۸	۰.۲۷	۲۰۳	۴۸%
ضخود۱۱۳۸	خودرو	۳,۵۰۰	۴	۱۰,۱۰۵.۵	۶۶	۳,۵۳۲	۳,۵۶۶	۱.۰%	۵۴.۰	۰.۶۴	۹۶	۴۶%
ضتاب۱۲۱۱	شتاب	۱۶,۰۰۰	۴۶	۶۰.۶	۴۳۵	۱۴,۸۵۰	۱۶,۴۳۵	۱۰.۷%	۳۷.۸	۰.۴۳	۵۸۳	۳۴%

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
ضذوب۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۲۵	۱۶.۳	۴	۵۱۶	۱,۰۰۴	۹۵%	۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۲۵	۱۳.۸	۴	۵۱۶	۹۰۴	۷۵%	۲۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۵	۲۵.۹	۴	۵۱۶	۸۰۴	۵۶%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا۱۱۳۱	شتا	۱,۶۵۰	۱۱	۳۳۵.۷	۴	۱,۳۶۲	۱,۶۵۴	۲۱%	۴۱۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۳۲	۴۴.۱	۳۸	۳,۵۳۲	۵,۰۳۸	۴۳%	۱۳۲.۶	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	۲۵	۱۱۳.۶	۶,۸۴۶	۲۶,۸۱۰	۲۷,۱۵۴	۱.۳%	۴.۰	-۰.۹۹	۶,۳۹۹	(۶.۵%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۴	۴۹.۸	۵۲۷	۳,۵۳۲	۳,۴۷۳	(۱.۷%)	۶.۶	-۰.۹۹	۴۴۲	(۱۶.۲%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۴	۶,۵۵۵.۱	۲۷۸	۳,۵۳۲	۳,۴۷۲	(۱.۷%)	۱۲.۵	-۰.۸۷	۲۰۴	(۲۶.۷%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۵	۳,۳۴۹.۶	۳,۹۱۲	۲۶,۸۱۰	۲۶,۰۸۸	(۲.۷%)	۶.۷	-۰.۸۱	۲,۷۳۹	(۳۰.۰%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۲۵	۳.۰	۱۰۵	۵۱۶	۴۹۵	(۴.۱%)	۴.۷	-۰.۸۹	۷۲	(۳۱.۱%)

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
طستا ۱۲۲۲	شستا	۶۵۰	۳۹	۲.۷	۵	۱,۳۶۲	۶۴۵	(۵۲.۶%)	۱۲۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۱۱	۶.۷	۱	۱,۳۶۲	۸۴۹	(۳۷.۷%)	۸۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۱۱	۱۲.۲	۱	۱,۳۶۲	۹۴۹	(۳۰.۳%)	۹۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۲۲۴	شستا	۸۵۰	۳۹	۲.۴	۴	۱,۳۶۲	۸۴۶	(۳۷.۹%)	۲۱۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۱۱	۱۴.۲	۲	۱,۳۶۲	۱,۰۴۸	(۲۳.۱%)	۵۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

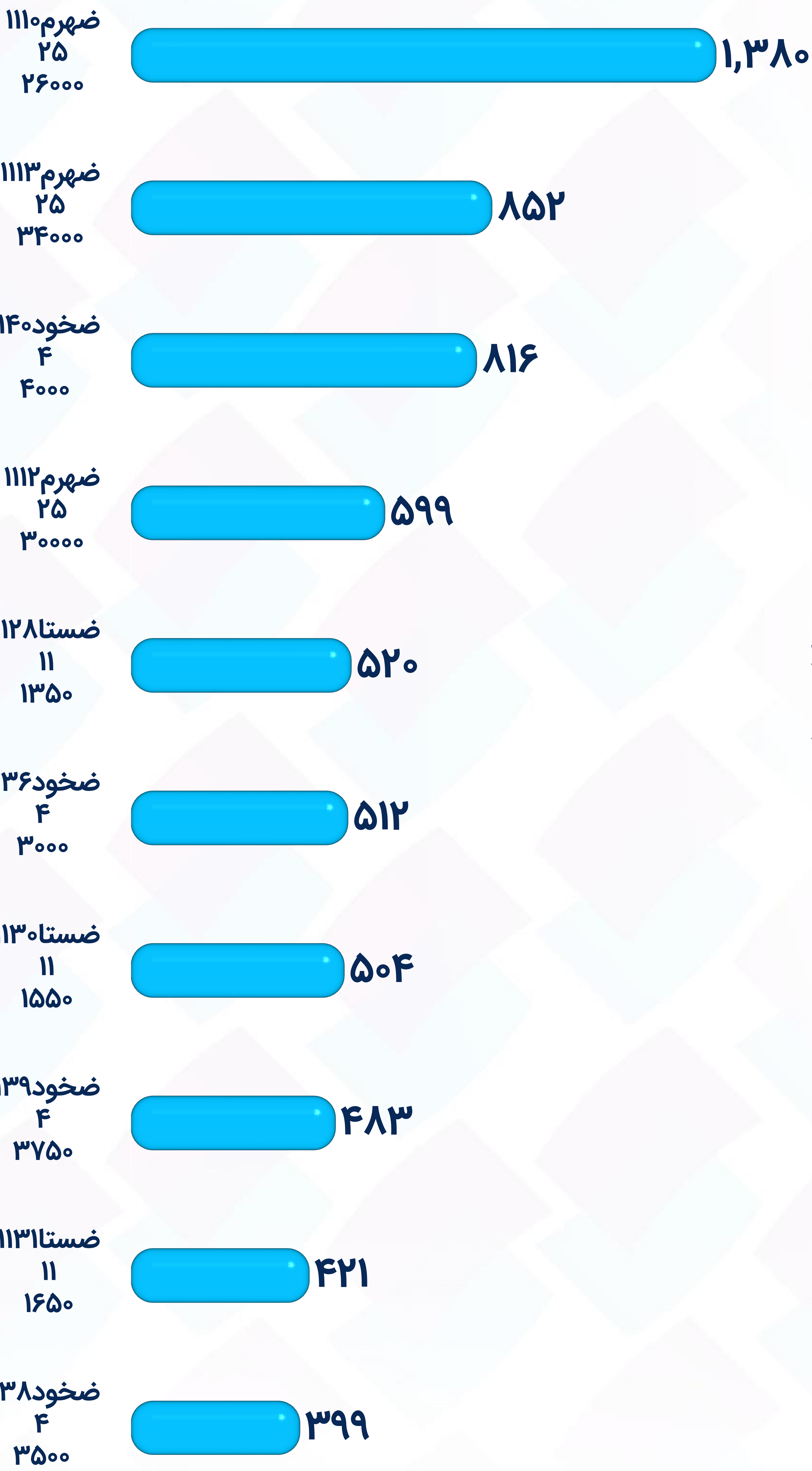
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



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

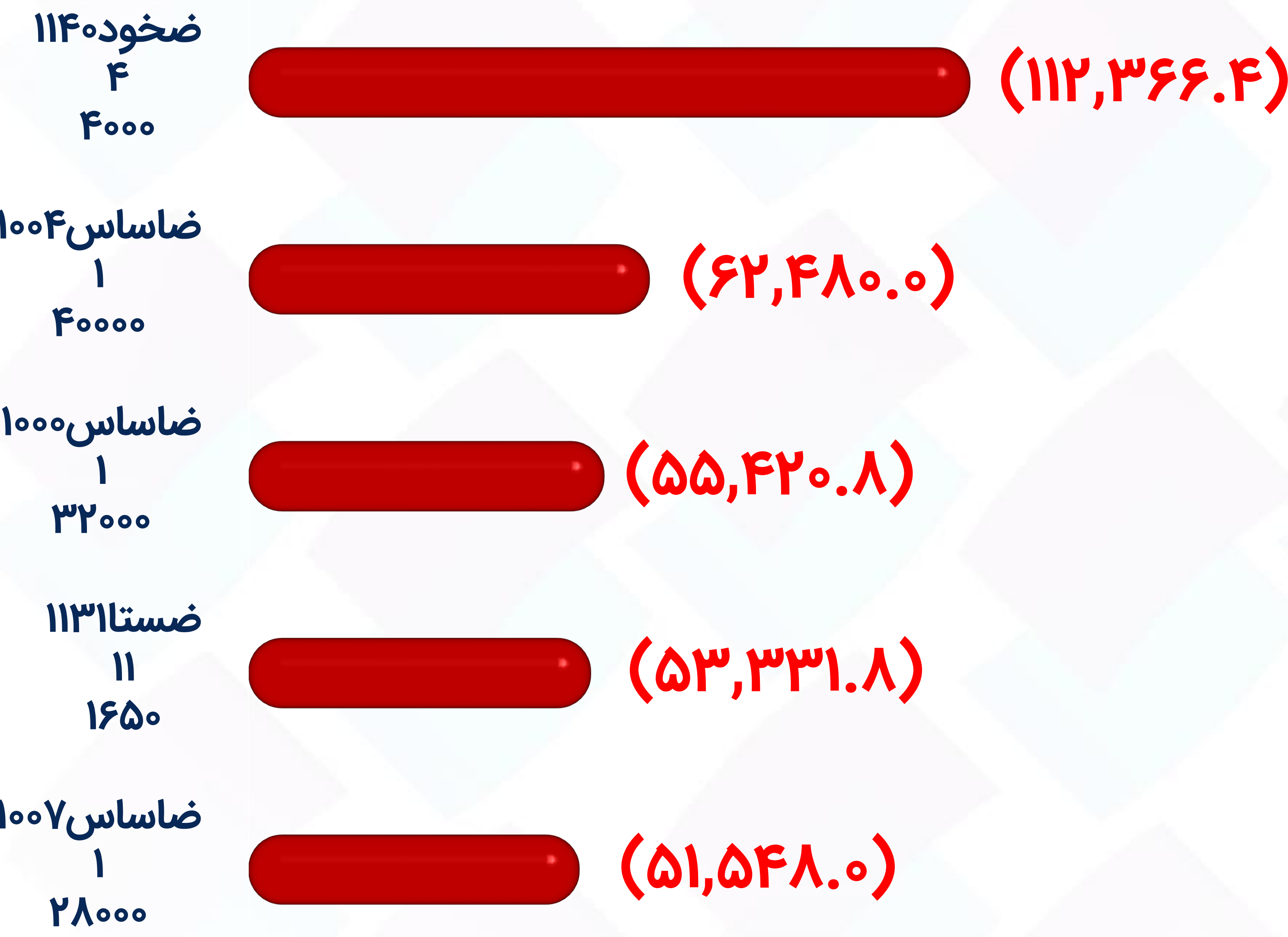
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

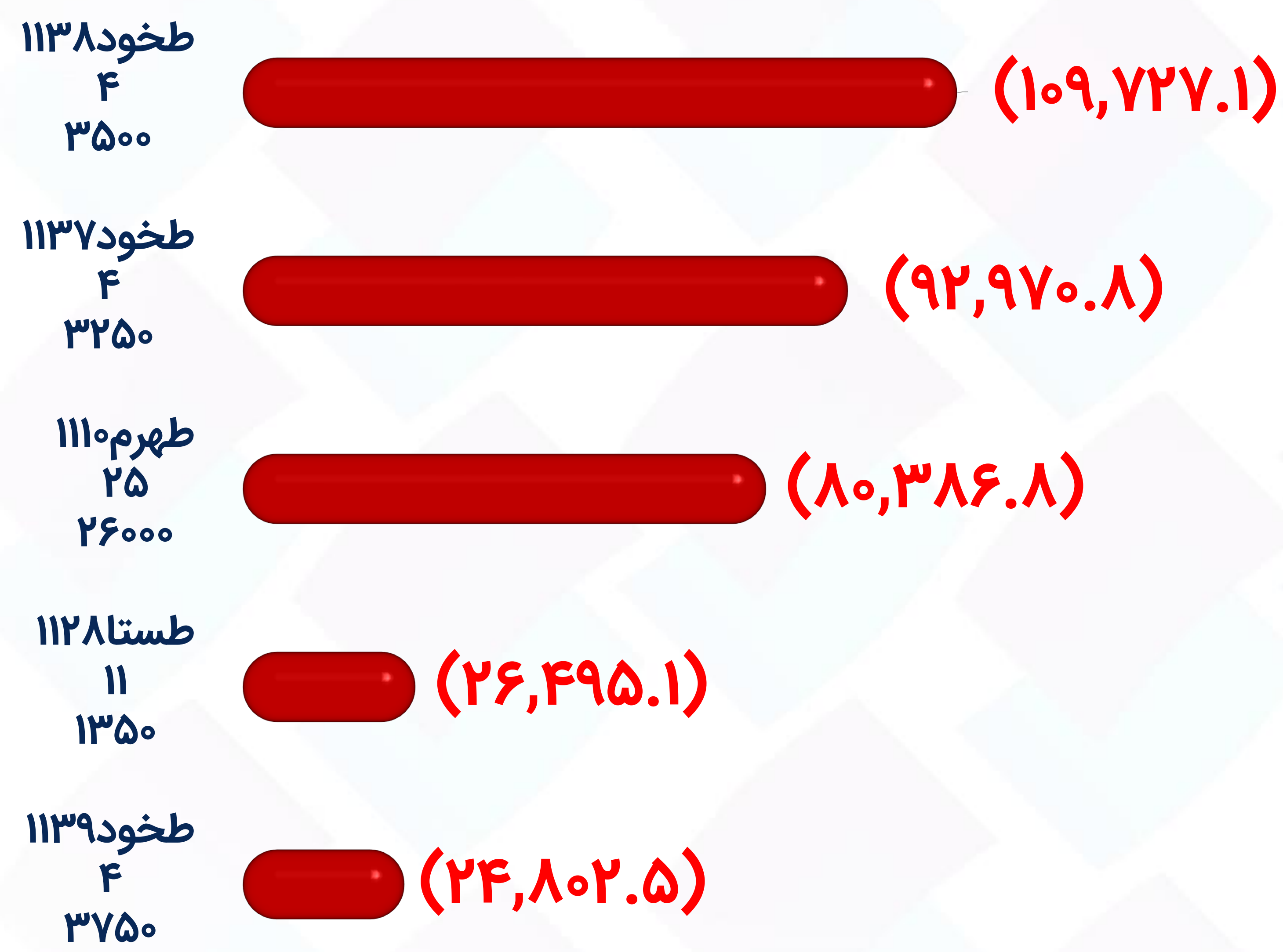
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



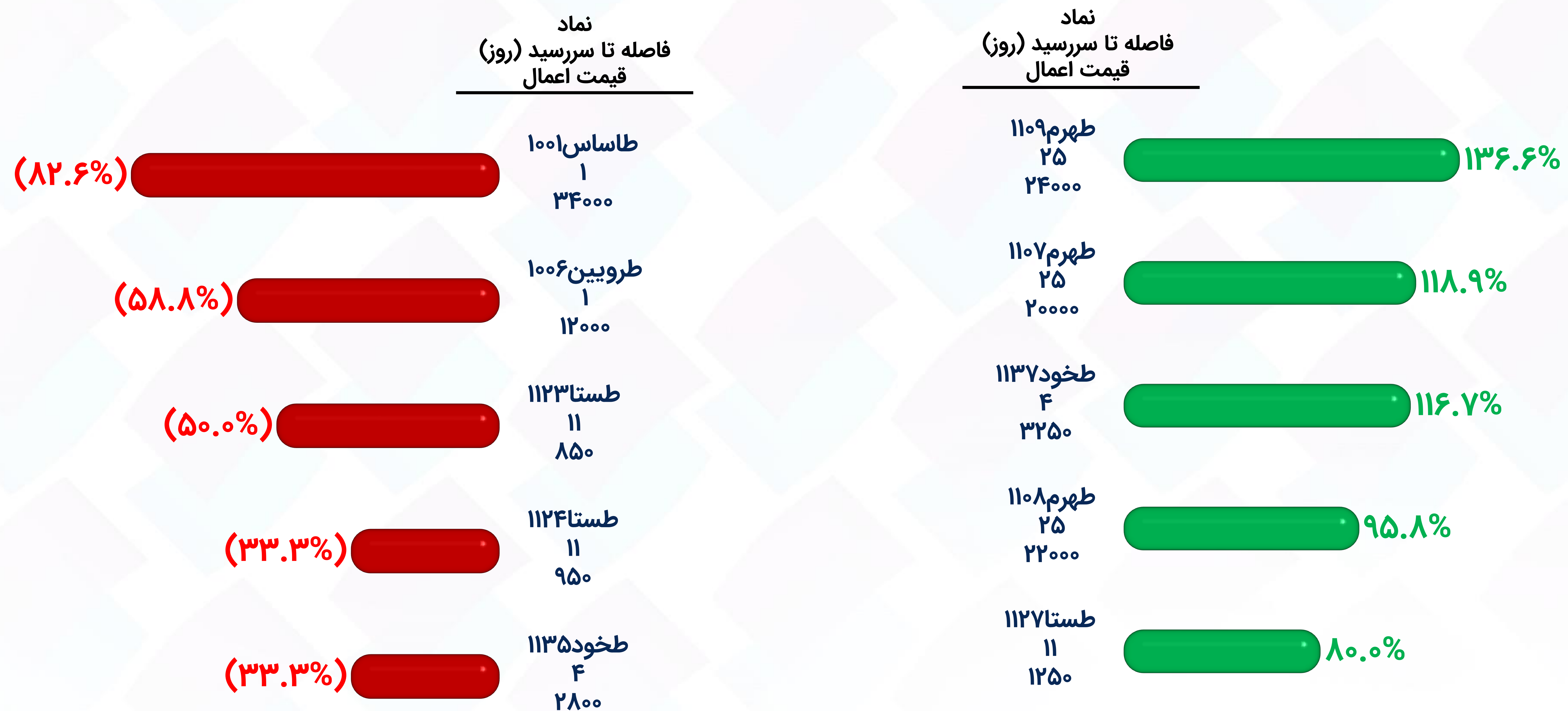
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

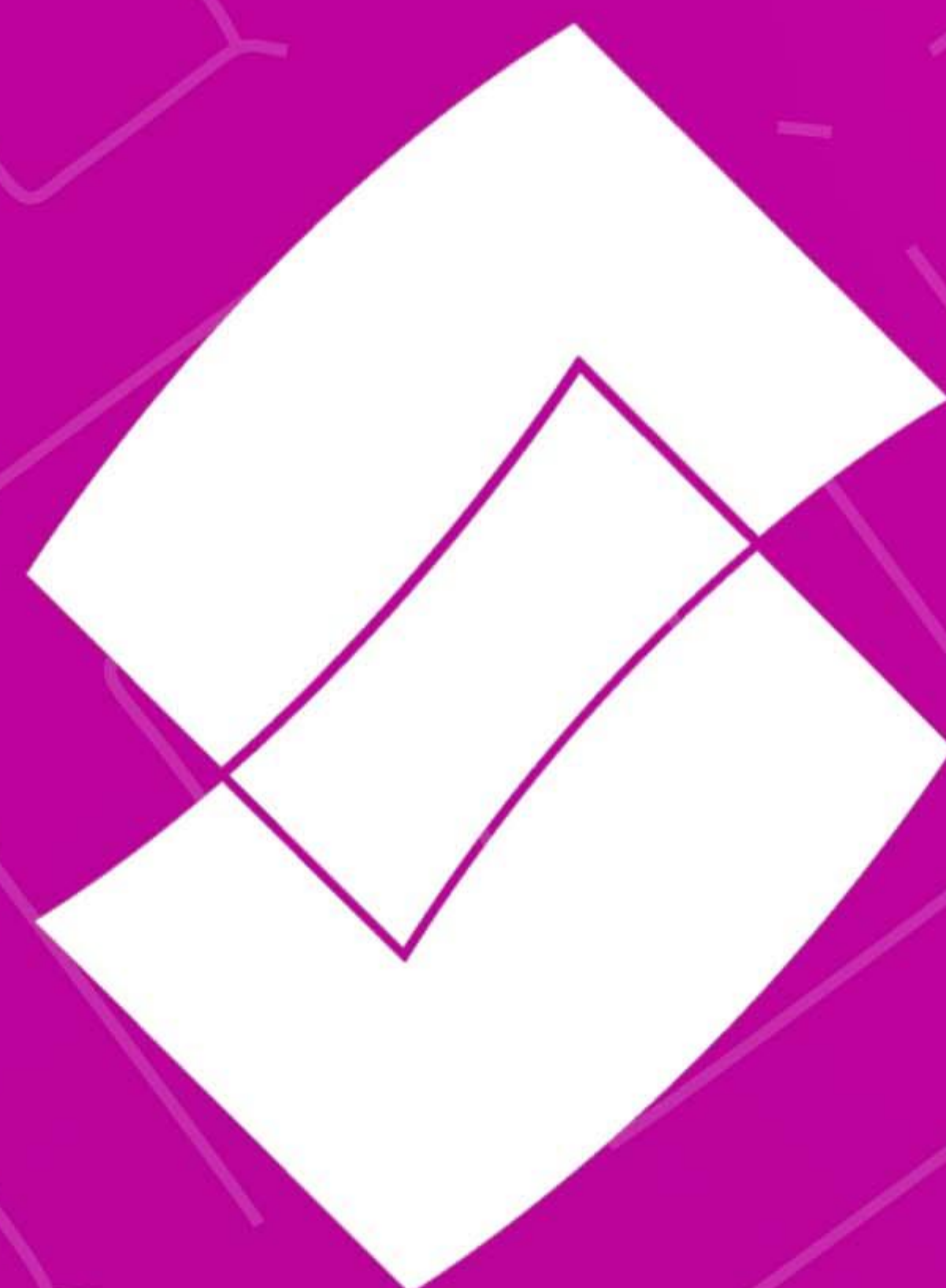
اختیار خرید



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.