

شماره
۴۱۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

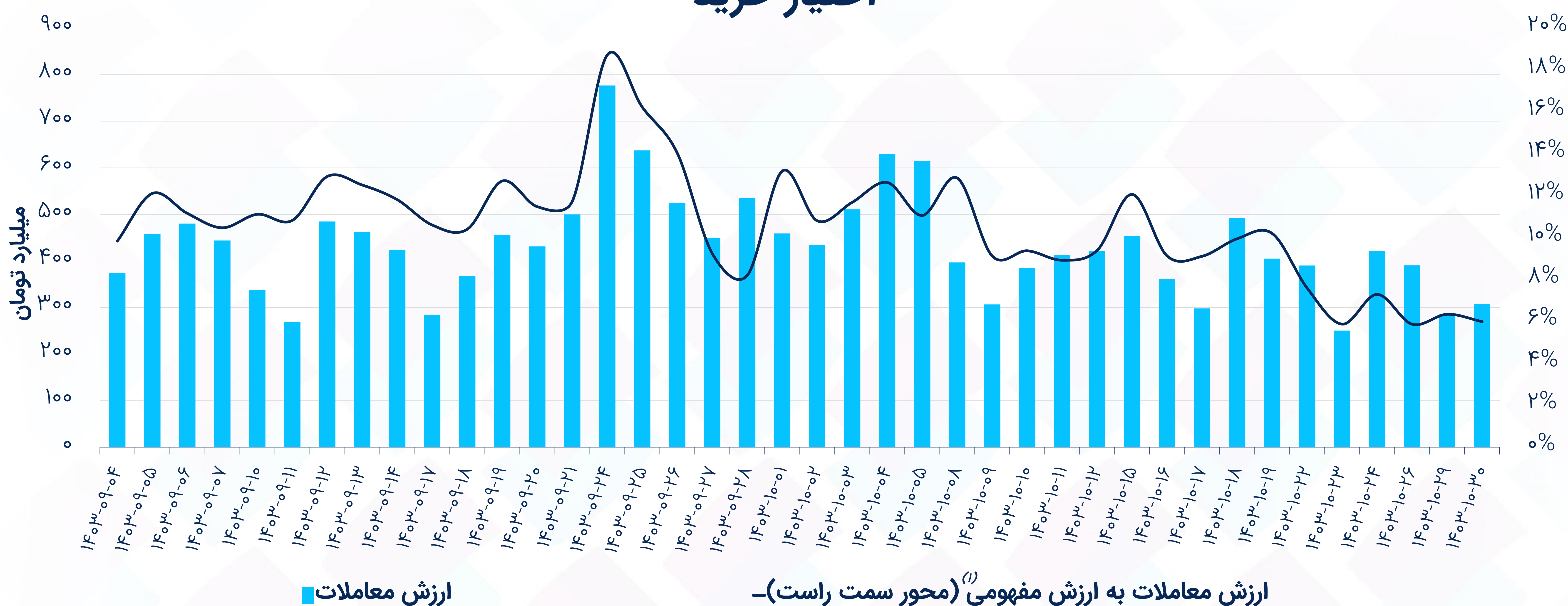




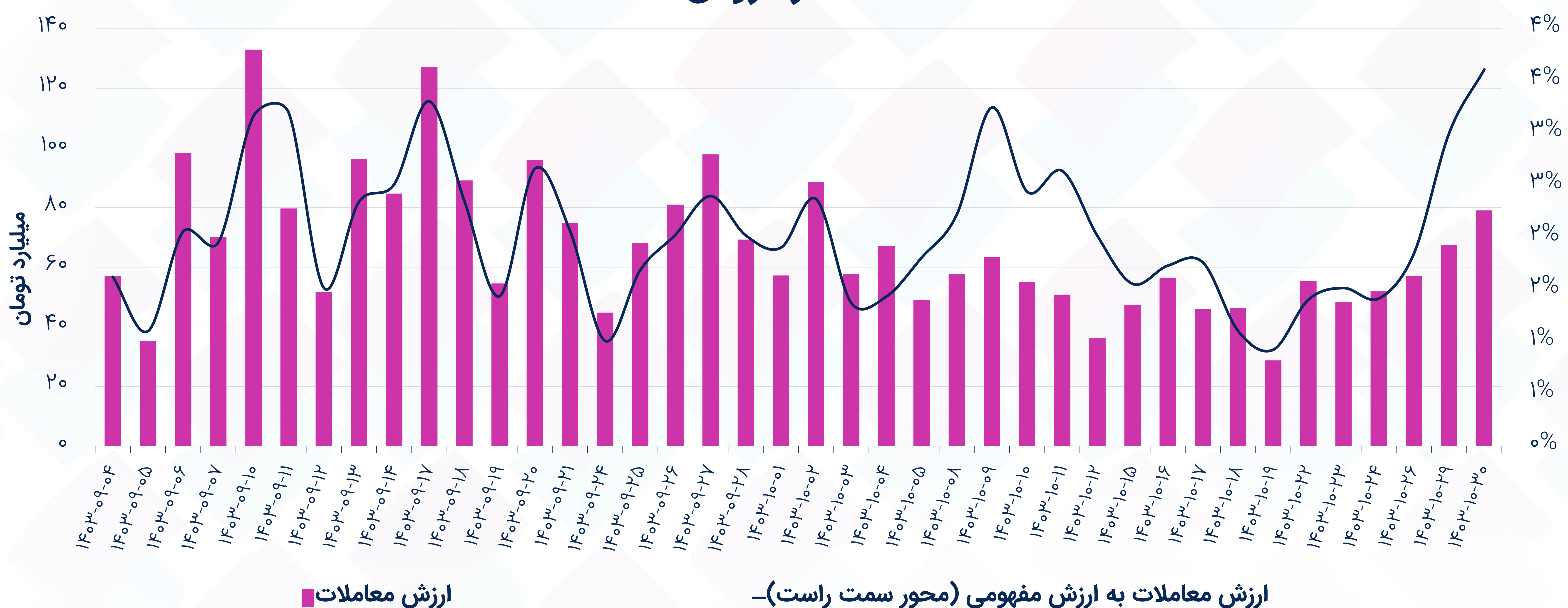
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



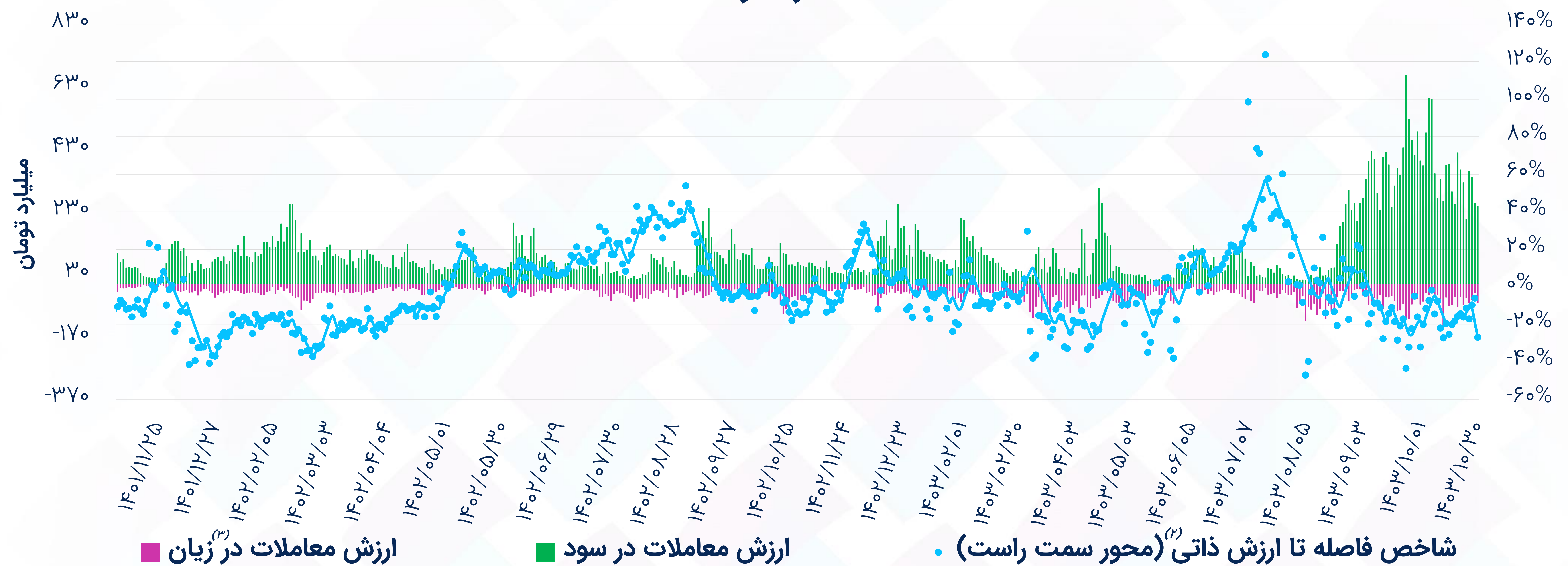
اختیار فروش



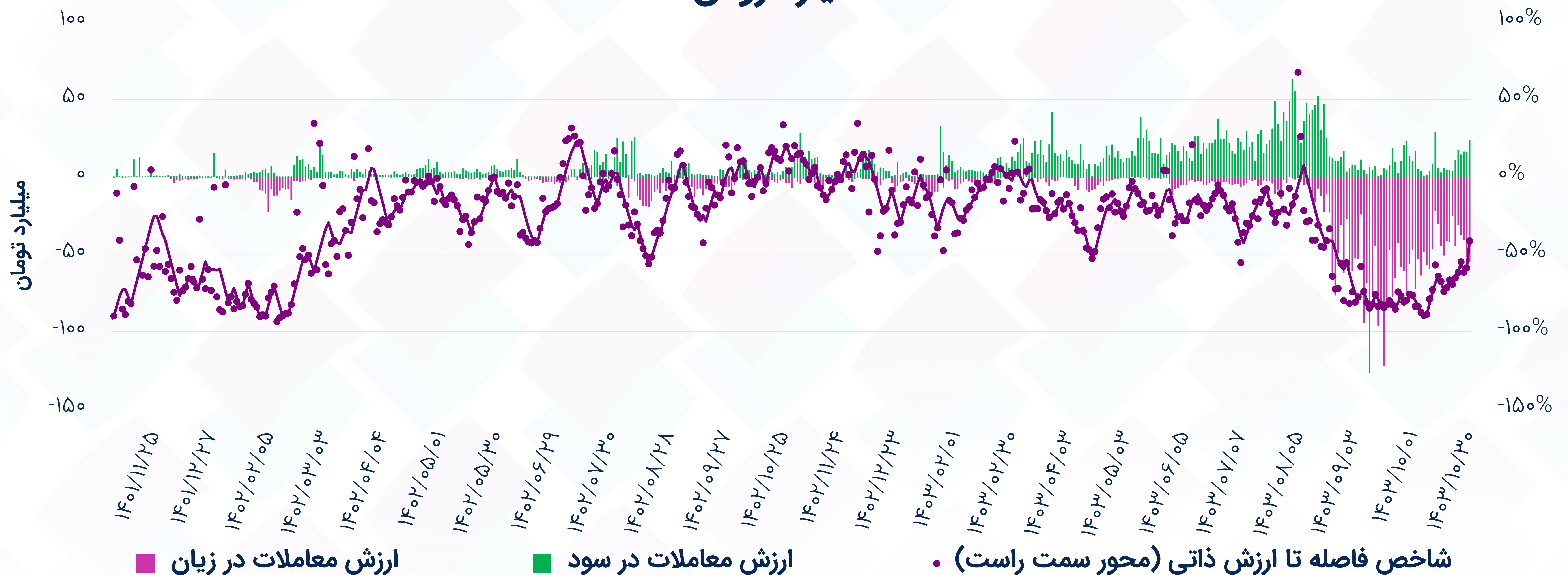
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

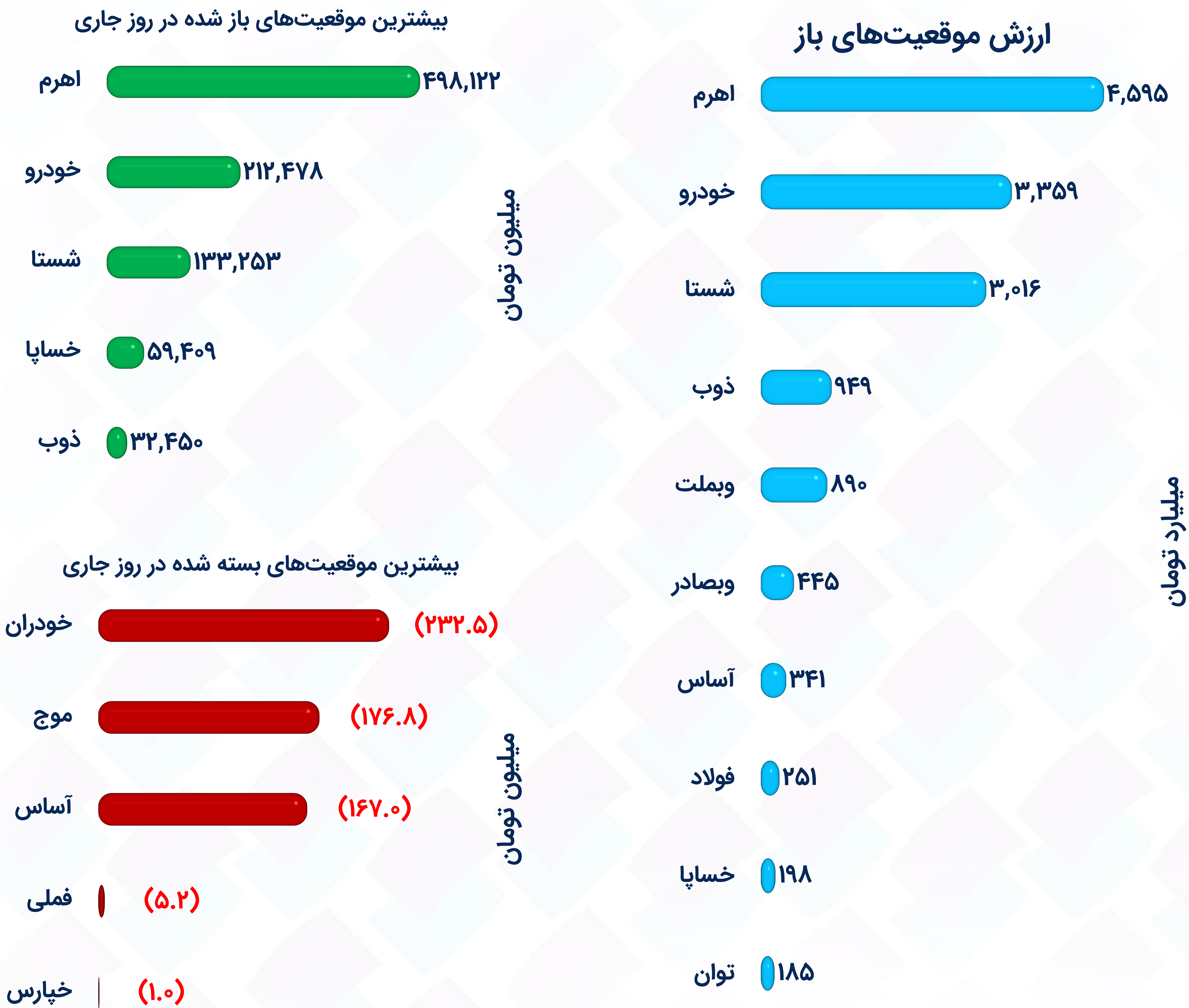
اختیار خرید

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	۲۵	۱۵۵.۹	۱,۹۷۱.۵	۱۳۳.۹	۲۲.۰	(۴۲.۲%)
خودرو	۳۸	۸۵.۳	۲,۲۲۷.۶	۶۳.۷	۲۱.۵	(۴.۸%)
شستا	۳۹	۲۳.۴	۵۴۶.۸	۱۴.۱	۹.۲	(۲۵.۵%)
روبین	۹	۹.۵	۳۹.۲	۹.۵	۰.۰	۸.۲%
ذوب	۲۱	۹.۰	۸۷.۹	۷.۹	۱.۰	(۲۸.۱%)
خسپا	۱۶	۶.۰	۱۰۴.۷	۳.۲	۲.۸	(۲۷.۳%)
آساس	۱۲	۵.۳	۲۲.۴	۵.۳	۰.۰	۲.۴%

اختیار فروش

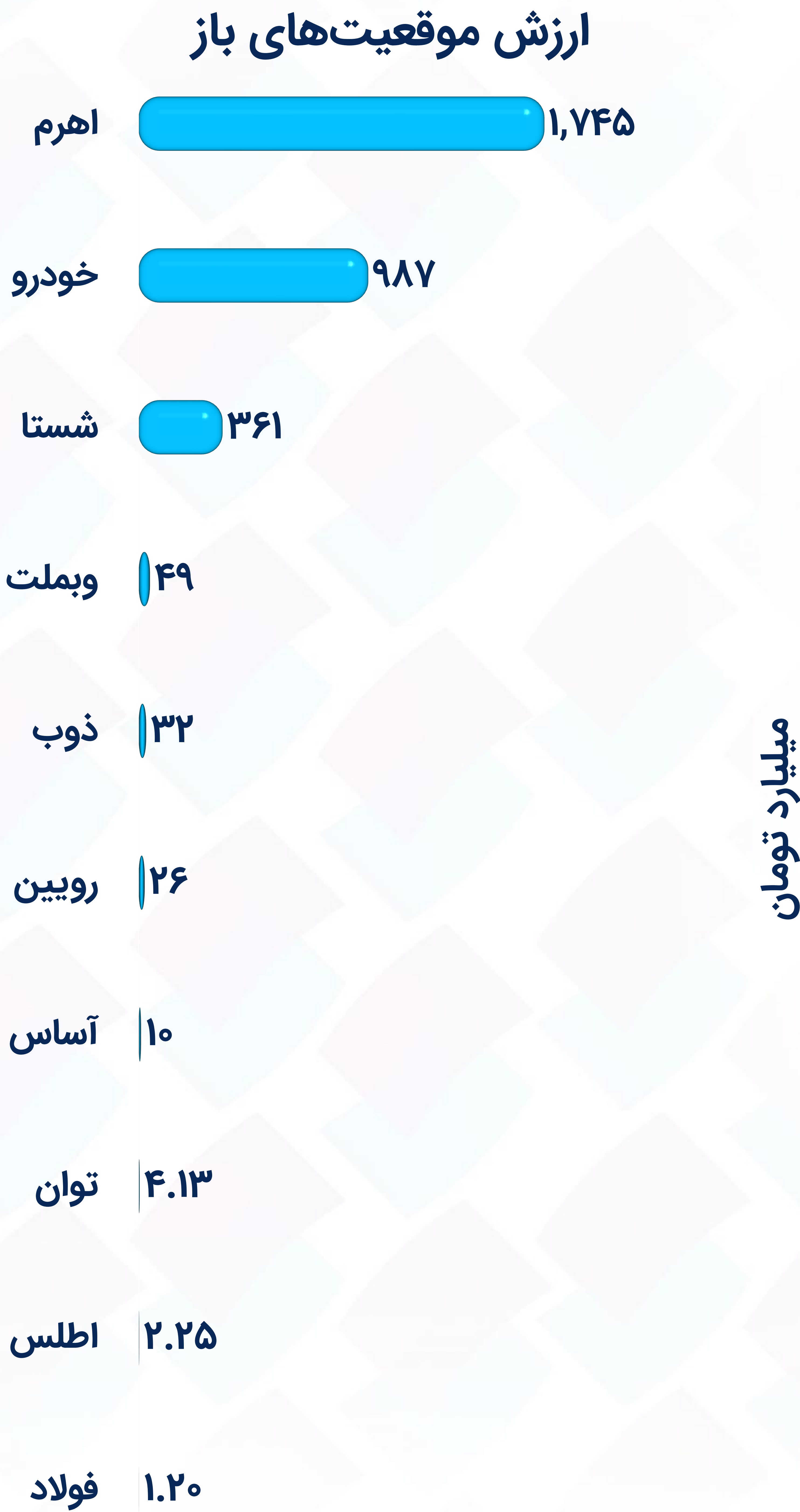
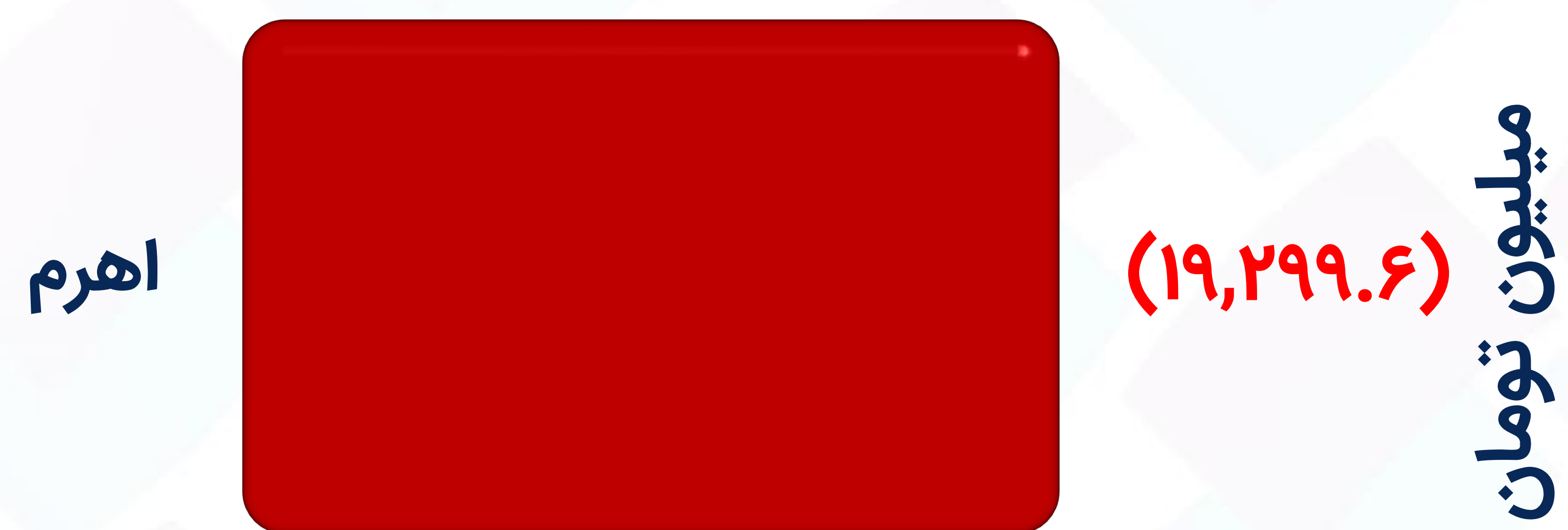
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۱۲	۶۴,۵۹۴.۲	۱,۴۲۷,۴۸۰.۲	۱۲,۹۲۲.۲	۵۱,۶۷۲.۰	(۴۲.۸%)
خودرو	۱۰	۱۰,۷۹۵.۲	۵۹۵,۱۷۶.۰	۹,۷۳۳.۹	۱,۰۶۱.۲	(۲۷.۷%)
شستا	۱۸	۳,۳۴۱.۲	۱۵۲,۱۸۵.۶	۱,۲۱۷.۹	۲,۱۲۳.۳	(۵۵.۹%)
وبملت	۳	۱۷۷.۸	۸,۷۵۹.۶	۰.۰	۱۷۷.۸	(۷۱.۵%)
توان	۲	۷۸.۴	۱,۲۴۰.۶	۳۴.۵	۴۳.۹	(۴۲.۵%)
ذوب	۵	۵۸.۰	۳,۰۰۷.۷	۴.۲	۵۳.۸	(۶۲.۸%)
اطلس	۲	۰.۴	۱۲.۱	۰.۰	۰.۴	(۷۰.۶%)

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 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
ضموج ۱۲۰۹	موج	۱۴,۰۰۰	۴۹	۶.۰	۶,۰۰۰	۲۴,۲۵۵	۲۰,۰۰۰	(۱۷.۵%)	۳.۳	۱.۰۰	۱۰,۸۷۵	۸۱%
ضبساما ۱۲۰۵	بساما	۴,۹۹۶	۳۵	۴۹.۵	۱,۵۰۳	۶,۷۲۰	۶,۴۹۹	(۳.۳%)	۴.۳	۱.۰۰	۱,۸۸۱	۲۵%
ضفر ۱۲۰۸	فرز	۴۴,۰۰۰	۴۲	۱۲.۳	۸۵۷	۴۰,۵۰۰	۴۴,۸۵۷	۱۰.۸%	۵۲.۳	۰.۳۶	۱,۰۱۷	۱۹%
ضتیام ۱۲۰۵	تیام	۱۳,۰۰۰	۵۶	۳۰.۶	۸۷۴	۱۳,۱۹۳	۱۳,۸۷۴	۵.۲%	۱۵.۹	۰.۷۷	۱,۰۳۴	۱۸%
ضستا ۱۱۲۷	شستا	۱,۲۵۰	۱۰	۳,۳۸۹.۶	۱۱۷	۱,۳۷۲	۱,۳۶۷	(۰.۴%)	۱۱.۷	۰.۹۹	۱۳۶	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	۲۴	۲.۵	۳	۵۰۷	۱,۰۰۳	۹۸%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۲۴	۴.۷	۴	۵۰۷	۹۰۴	۷۸%	۲۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۴	۶۰.۹	۴	۵۰۷	۸۰۴	۵۹%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۱۰	۲۲۴.۹	۵	۱,۳۷۲	۱,۶۵۵	۲۱%	۳۳۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۳۱	۲۹۳.۳	۳۹	۳,۴۶۹	۵,۰۳۹	۴۵%	۱۲۹.۲	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	۲۴	۱۶۷.۸	۶,۷۹۵	۲۶,۱۳۰	۲۷,۲۰۵	۴.۱%	۴.۰	-۰.۹۹	۷,۱۱۲	۴.۷%
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۳	۵۳۴.۴	۵۲۴	۳,۴۶۹	۳,۴۷۶	۰.۲%	۶.۶	-۱.۰۰	۵۱۰	(۲.۷%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۴	۷,۸۷۷.۷	۳,۸۲۰	۲۶,۱۳۰	۲۶,۱۸۰	۰.۲%	۶.۹	-۰.۸۸	۳,۳۳۲	(۱۲.۸%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۳	۲,۱۷۶.۹	۳۰۴	۳,۴۶۹	۳,۴۴۶	(۰.۷%)	۱۱.۳	-۰.۹۶	۲۶۴	(۱۳.۳%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۳,۷۵۰	۳۱	۱.۴	۳۱۹	۳,۴۶۹	۳,۴۳۱	(۱.۱%)	۱۰.۸	-۰.۶۷	۲۴۲	(۲۴.۲%)

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 ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۱۰	۱.۲	۲	۱,۳۷۲	۹۴۸	(۳۰.۹%)	۴۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۱۰	۱.۰	۲	۱,۳۷۲	۱,۰۴۸	(۲۳.۶%)	۵۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۳	۱۱.۲	۱	۳,۴۶۹	۲,۷۹۹	(۱۹.۳%)	۲,۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۴	۶۴.۱	۴۹	۲۶,۱۳۰	۱۷,۹۵۱	(۳۱.۳%)	۳۶۶.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۳	۶.۳	۲	۳,۴۶۹	۲,۹۹۸	(۱۳.۶%)	۱,۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)

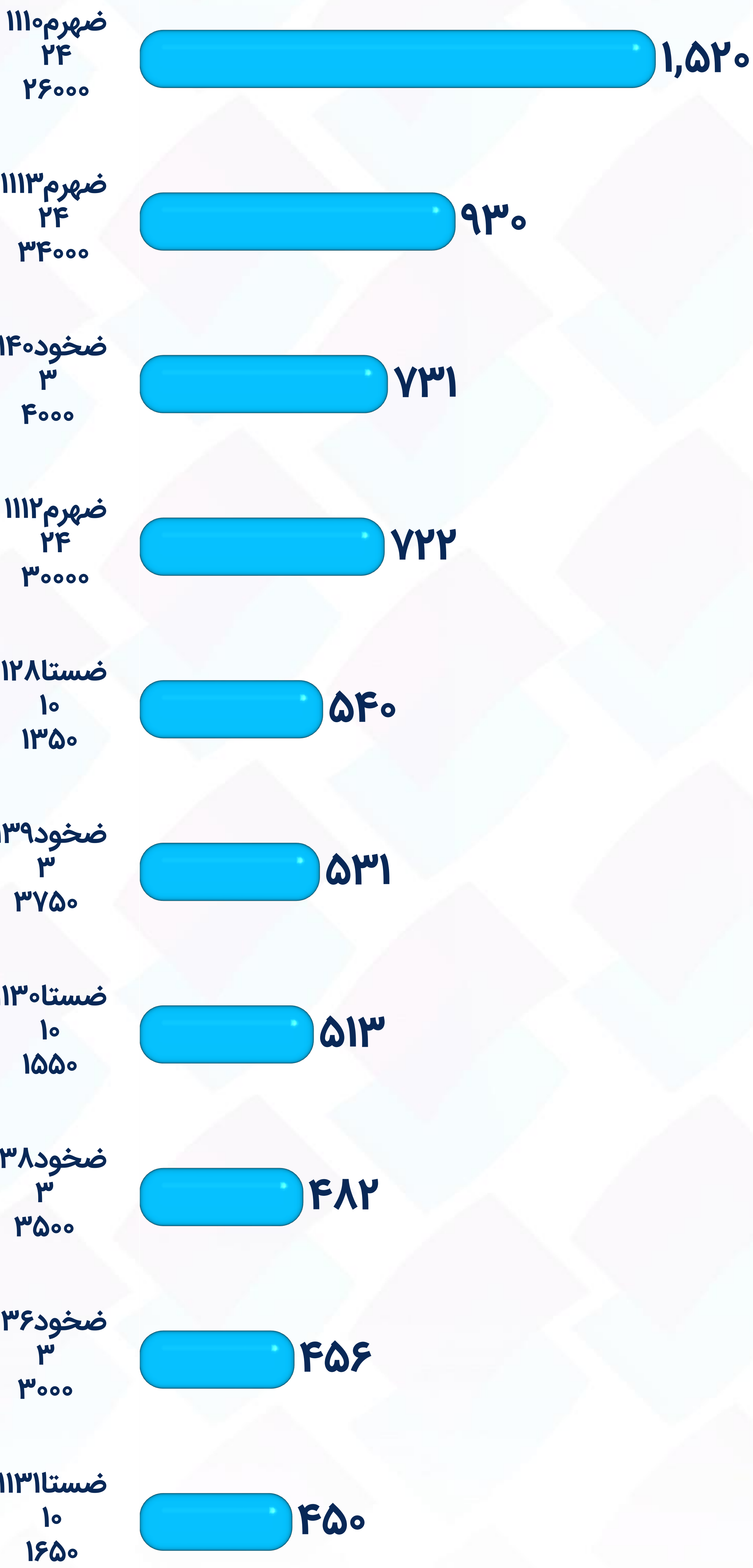
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



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)

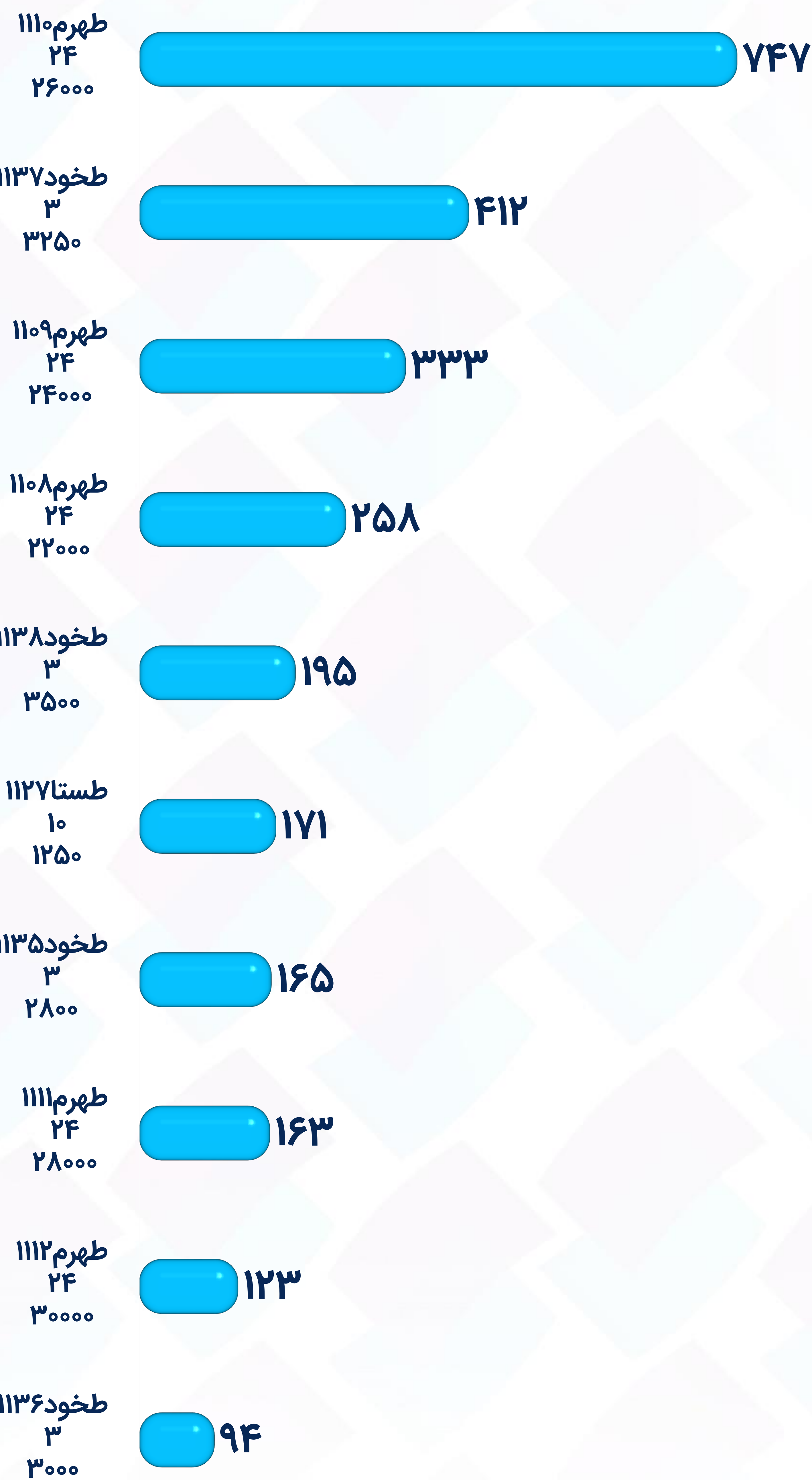


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

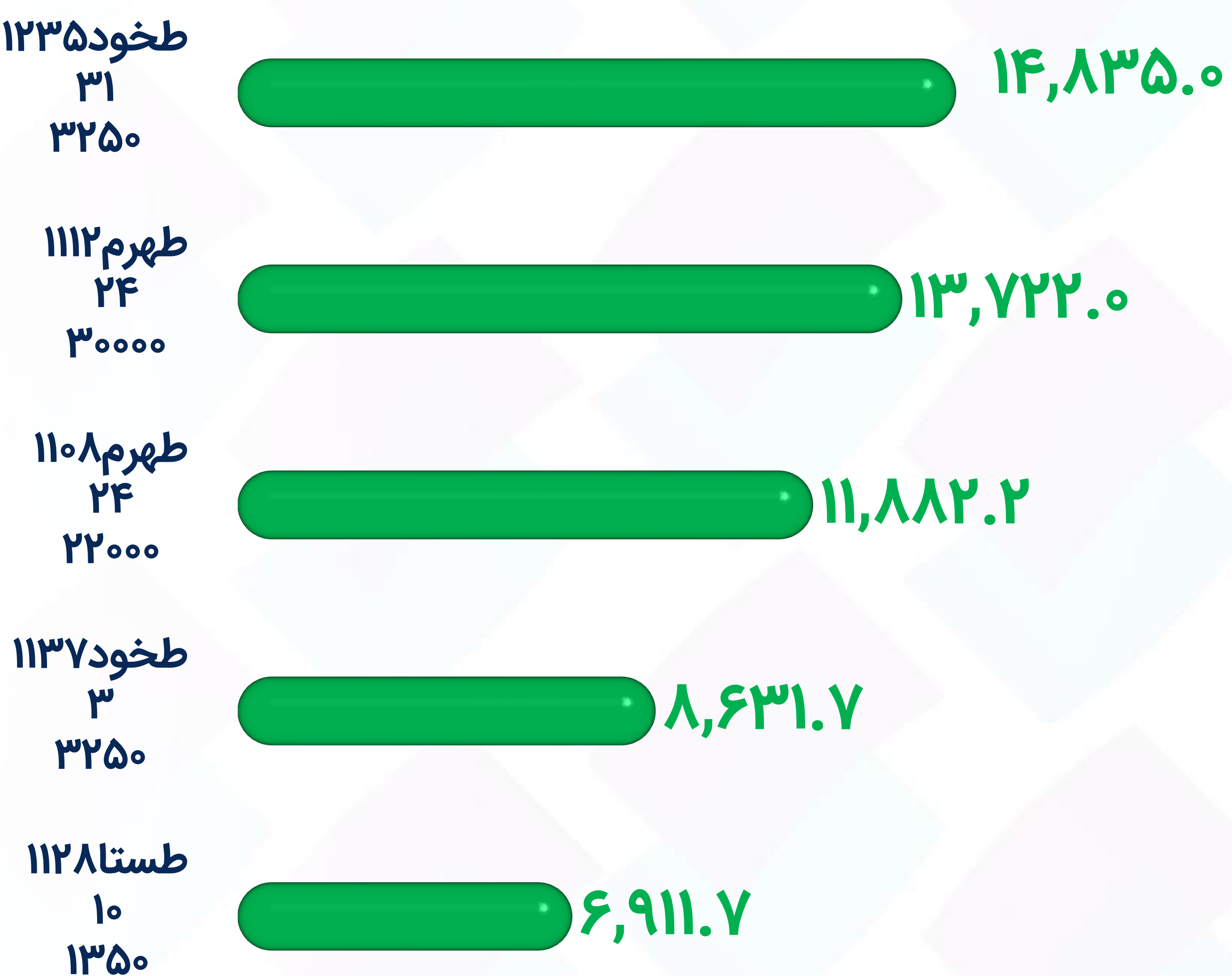
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

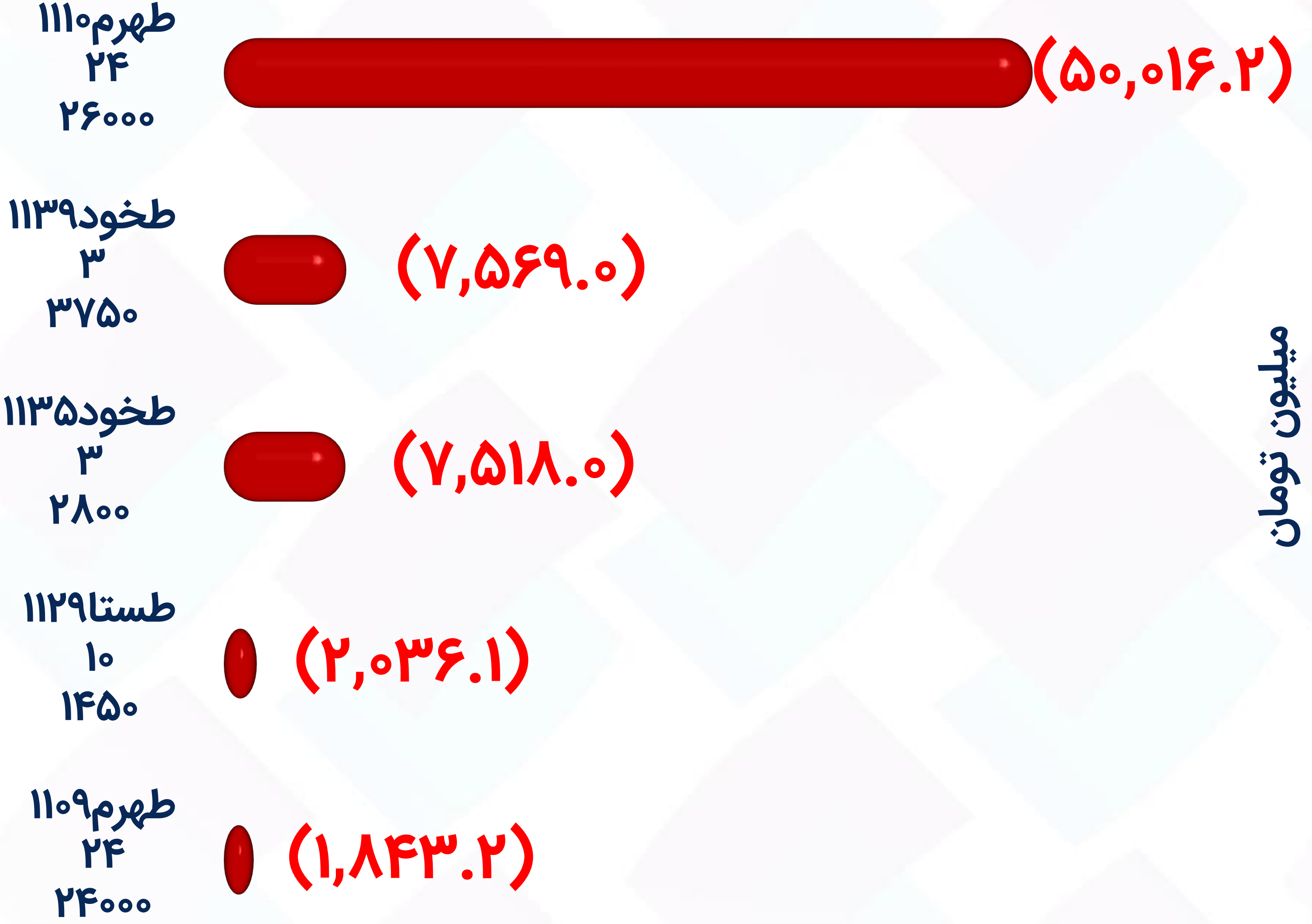
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

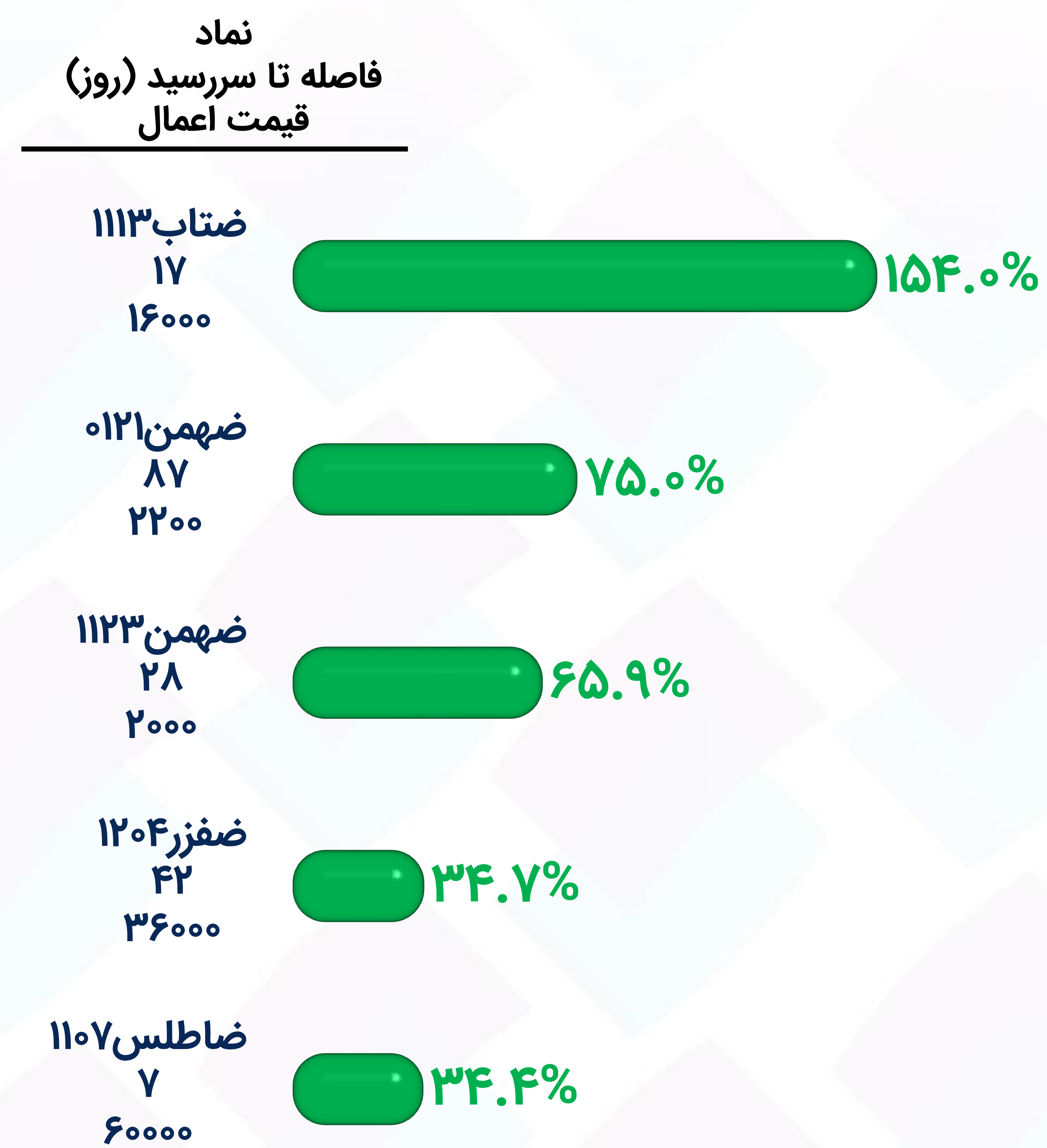
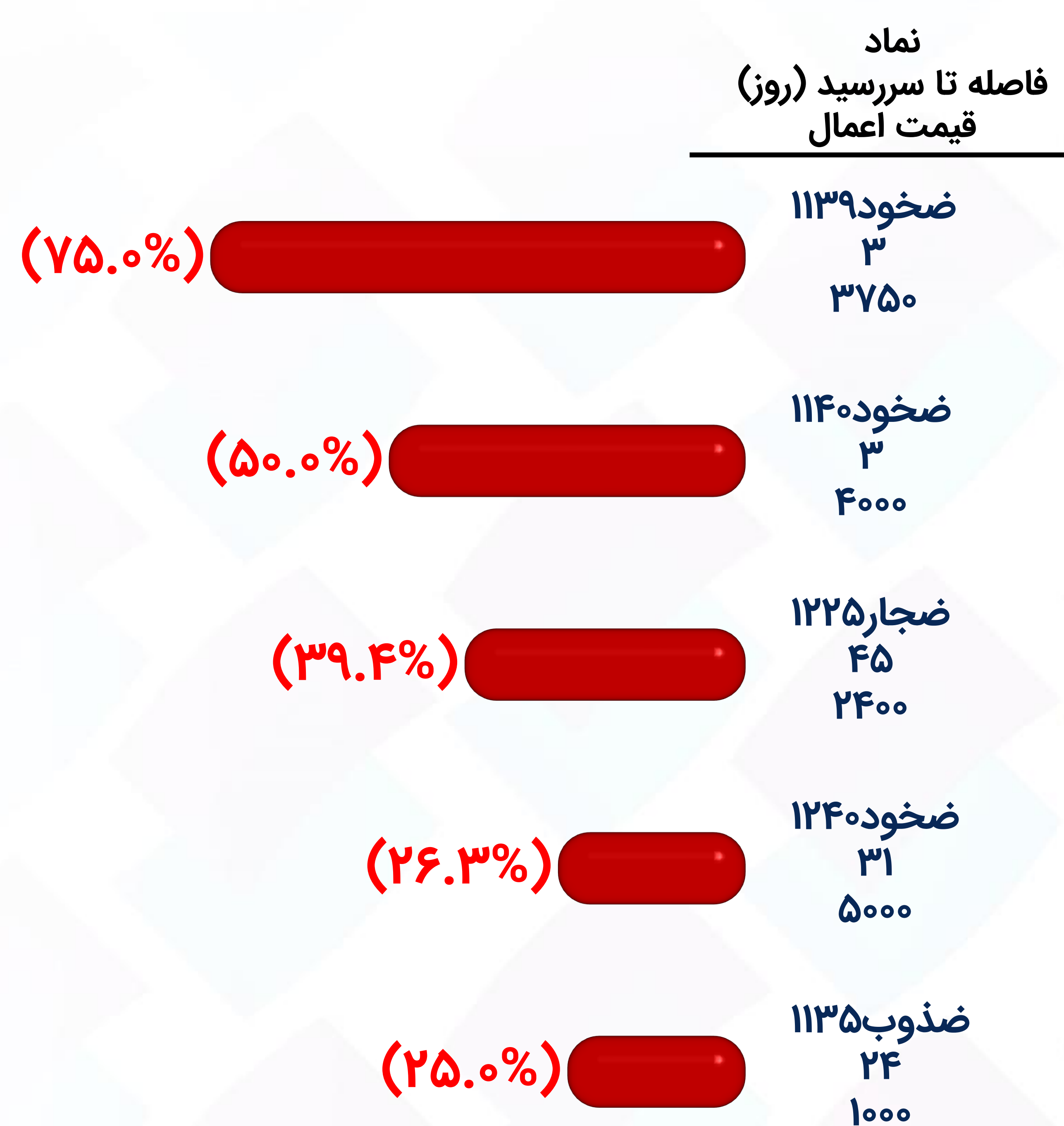
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



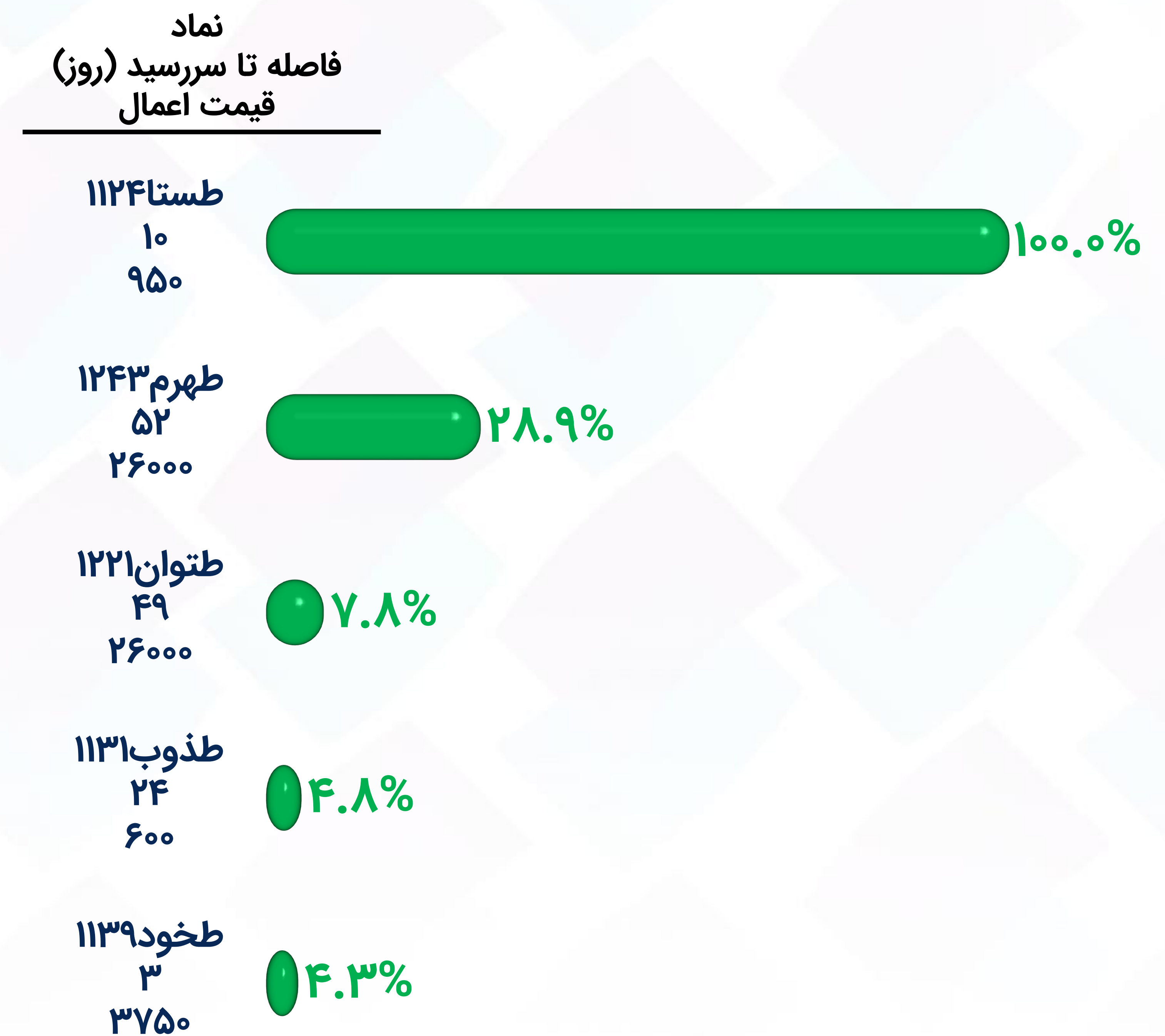
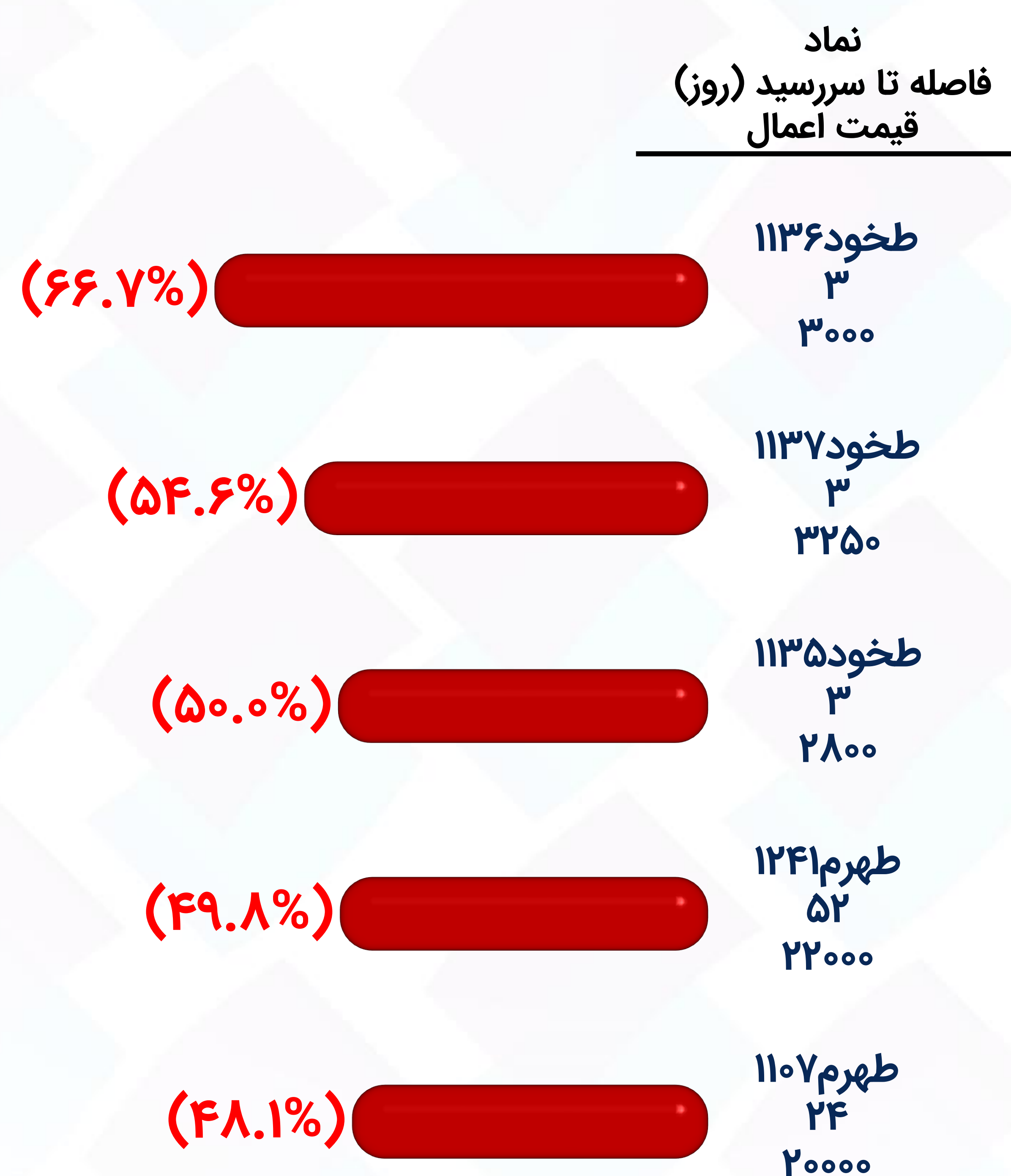
میلیون تومان

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.