

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

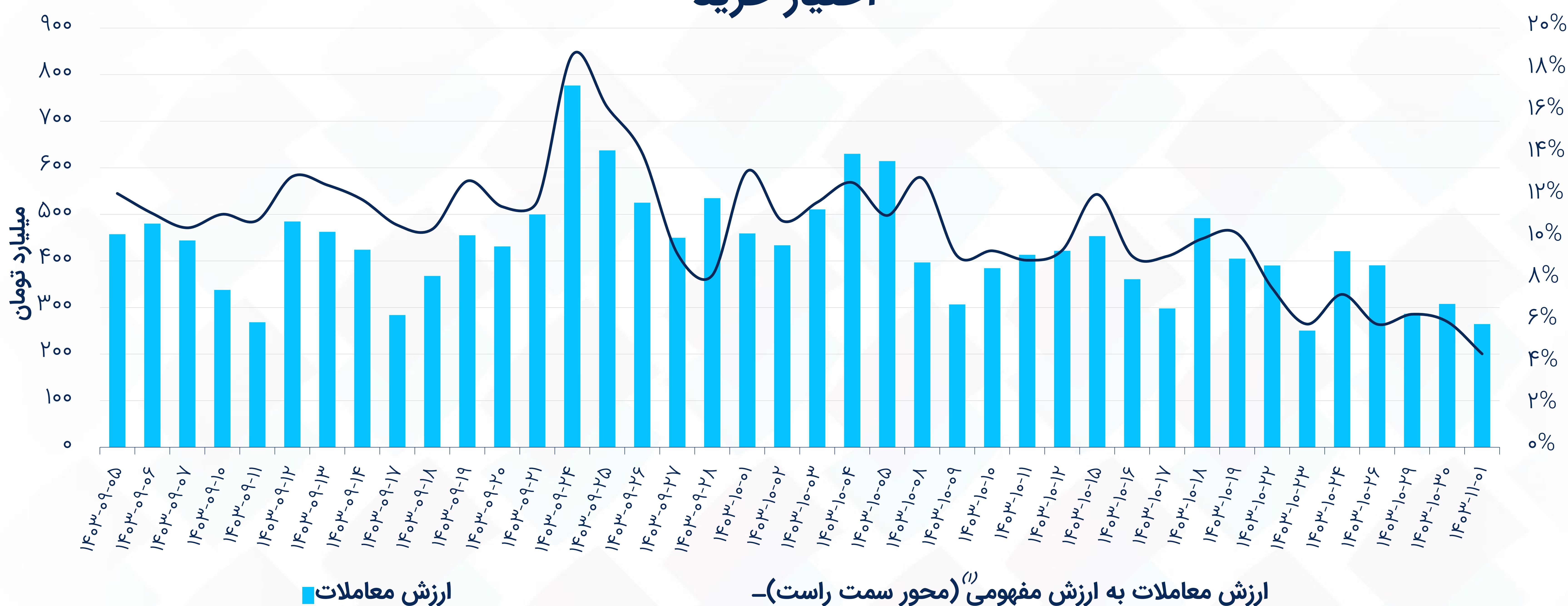




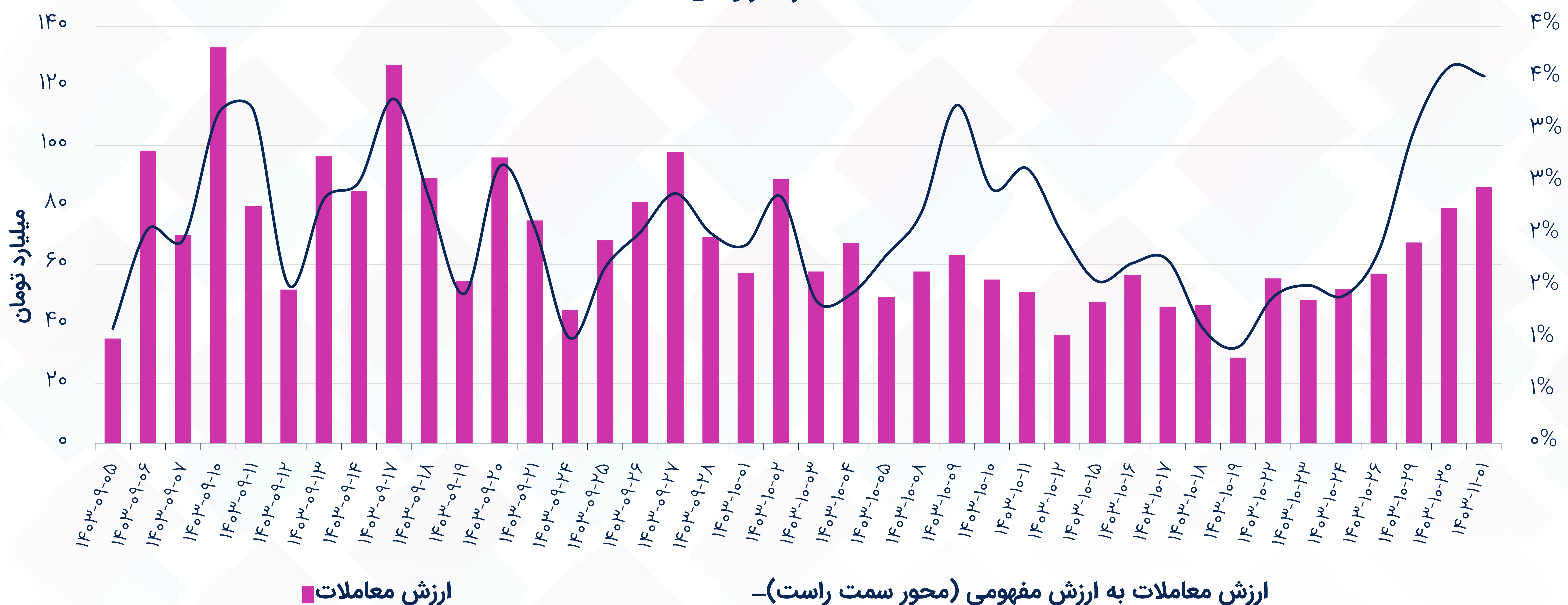
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



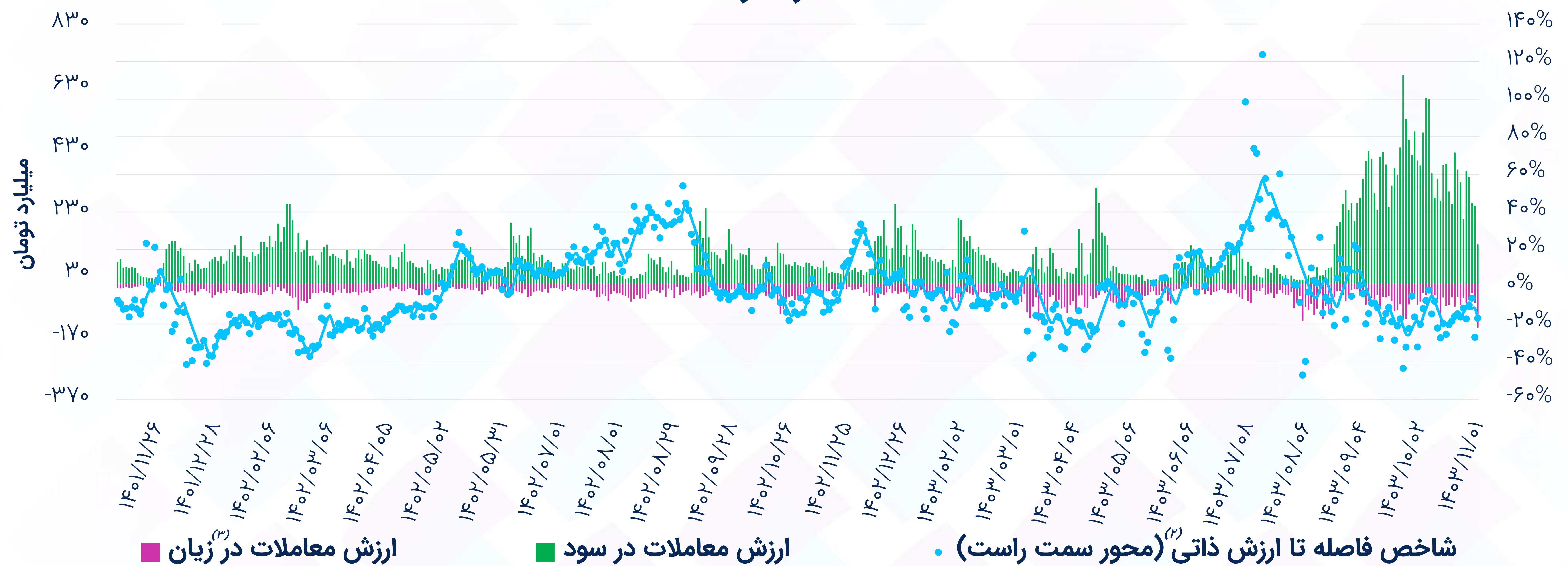
اختیار فروش



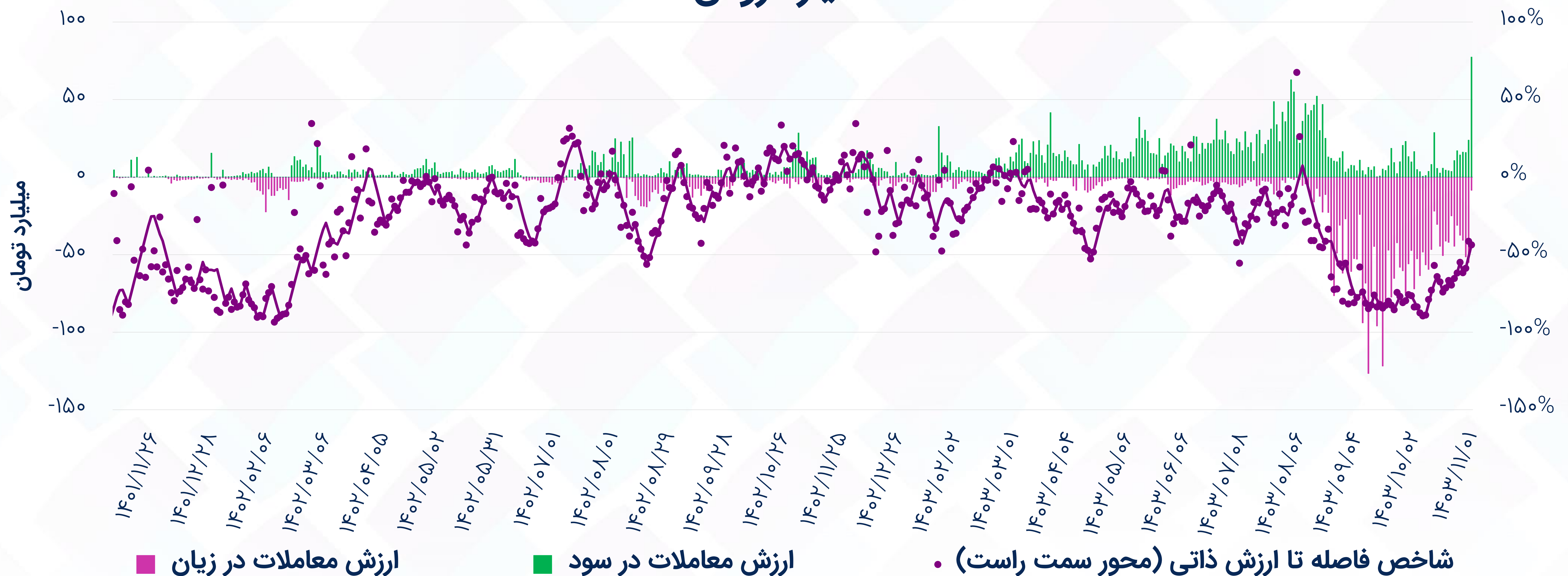
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۱	۱۲۳.۲	۲,۱۳۳.۲	۲۱.۴	۱۰۱.۸	(۳۵.۱%)
خودرو	۴۰	۹۳.۱	۲,۸۱۸.۳	۷۳.۷	۱۹.۳	۱۱.۶%
شستا	۳۹	۱۸.۷	۷۰۰.۵	۷.۳	۱۱.۴	(۳۳.۷%)
ذوب	۲۲	۱۰.۱	۱۲۱.۴	۵.۷	۴.۳	(۲۱.۷%)
وبملت	۱۸	۶.۹	۷۸.۳	۵.۶	۱.۲	(۲۶.۱%)
آساس	۵	۴.۸	۱۶.۴	۴.۸	۰.۰	(۹.۲%)
توان	۱۴	۲.۳	۸.۹	۲.۲	۰.۱	(۱.۱%)

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	۶۰,۸۸۲.۶	۱,۲۸۳,۲۳۹.۸	۵۵,۲۱۷.۹	۵,۶۶۴.۷	(۴۵.۹%)
خودرو	۱۰	۲۰,۸۶۷.۰	۹۶۴,۲۹۲.۲	۱۸,۷۵۴.۰	۲,۱۱۳.۰	(۳۶.۱%)
شستا	۱۴	۳,۹۳۵.۲	۱۸۰,۲۸۴.۷	۳,۳۷۷.۷	۵۵۷.۵	(۵۰.۱%)
وبملت	۲	۱۱۹.۶	۵,۶۳۹.۰	۰.۰	۱۱۹.۶	(۶۱.۰%)
توان	۳	۸۴.۸	۲,۷۰۰.۵	۰.۰	۸۴.۸	(۵۱.۴%)
ذوب	۴	۸۲.۱	۳,۱۹۷.۲	۶۹.۹	۱۲.۲	(۵۳.۳%)
فملی	۲	۱۴.۰	۱,۰۴۵.۳	۱۳.۳	۰.۷	۱۳۴.۹%

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



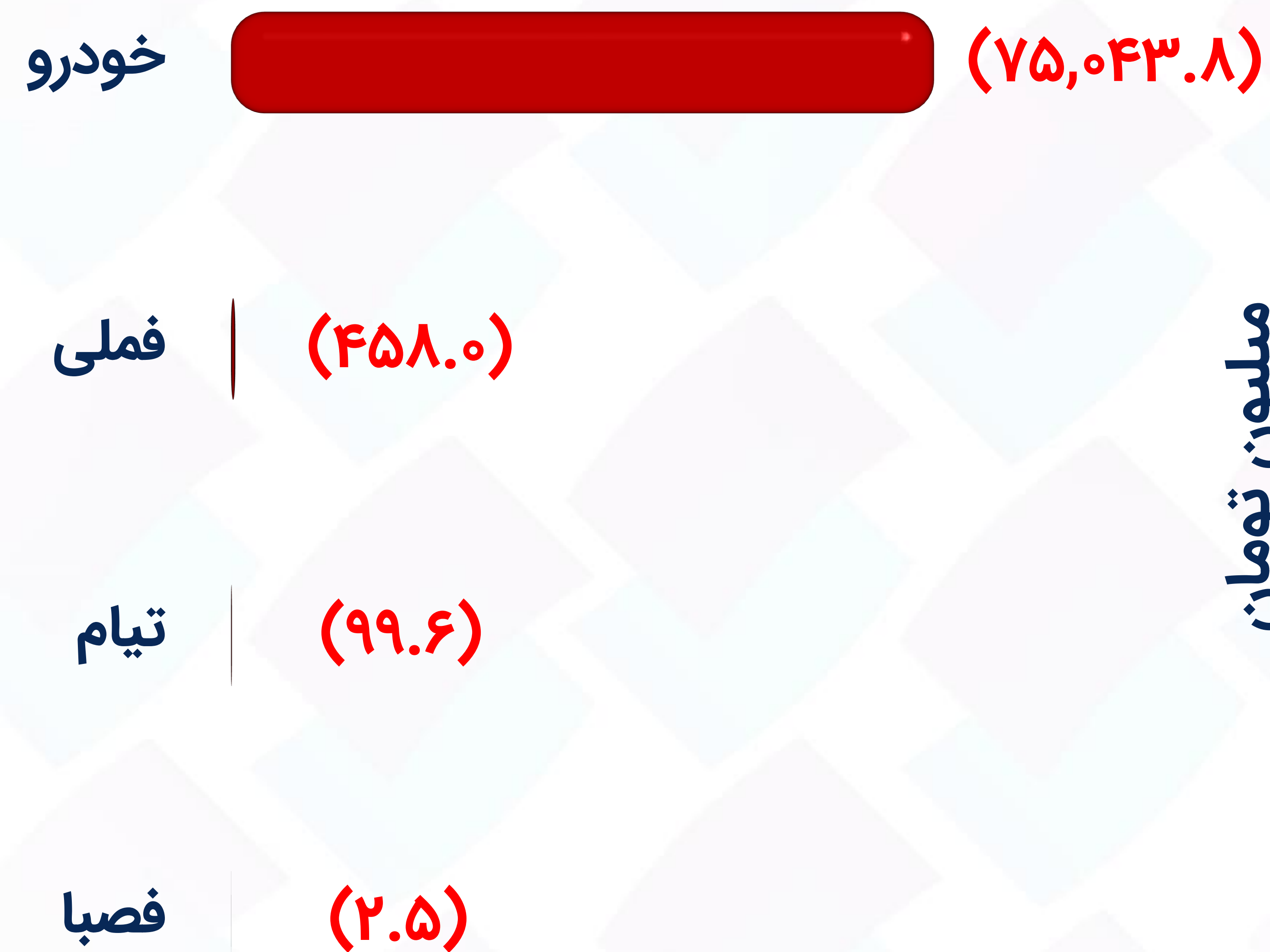
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

(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
ضفصبا ۱۱۲۱	فصبا	۴,۰۰۰	۱۳	۱۷.۹	۱۷۹	۴,۶۸۱	۴,۱۷۹	(۱۰.۷%)	۲۳.۳	۱.۰۰	۷۳۰	۳۰۸%
ضخود ۱۱۳۷	خودرو	۳,۲۵۰	۲	۹,۷۸۰.۴	۱۴۰	۳,۴۵۳	۳,۳۹۰	(۱.۸%)	۲۴.۲	۰.۹۶	۲۱۸	۵۶%
ضتیام ۱۲۰۲	تیام	۱۰,۰۰۰	۵۵	۷.۳	۲,۶۰۰	۱۳,۰۷۶	۱۲,۶۰۰	(۳.۶%)	۴.۸	۱.۰۰	۳,۵۸۲	۳۸%
ضتاب ۱۱۱۱	شتاب	۱۴,۰۰۰	۱۶	۱۵.۲	۶۱۶	۱۴,۴۱۰	۱۴,۶۱۶	۱.۴%	۲۳.۷	۰.۷۳	۸۳۸	۳۶%
ضخود ۱۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۲	۲۵,۶۷۹.۰	۳۶۳	۳,۴۵۳	۳,۳۶۳	(۲.۶%)	۹.۳	۱.۰۰	۴۶۵	۲۸%

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	۲۳	۲.۷	۳	۴۹۶	۱,۰۰۳	۱۰۲%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۲۳	۵.۱	۳	۴۹۶	۹۰۳	۸۲%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۳	۵۴.۹	۳	۴۹۶	۸۰۳	۶۲%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۵۱	۱.۲	۸	۴۹۶	۱,۰۰۸	۱۰۳%	۱۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۹	۱۴۱.۴	۲	۱,۳۴۴	۱,۶۵۲	۲۳%	۸۲۶.۰	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
طلی ۱۱۹۸	فملی	۱۰,۰۰۰	۲	۱۳.۳	۷۳۴	۸,۱۵۰	۹,۲۶۶	۱۳.۷%	۱۲.۶	-۱.۰۰	۱,۸۰۹	۱۴۶.۵%
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۲	۳۲۹.۶	۵۷۱	۳,۴۵۳	۳,۴۲۹	(۰.۷%)	۶.۰	-۱.۰۰	۵۳۱	(۷.۱%)
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۳	۳۸۵.۰	۸,۳۱۵	۲۵,۹۲۰	۲۵,۶۸۵	(۰.۹%)	۳.۱	-۱.۰۰	۷,۳۴۸	(۱۱.۶%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۲۳	۲.۱	۱۱۰	۴۹۶	۴۹۰	(۱.۲%)	۴.۵	-۰.۹۶	۹۲	(۱۶.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۳	۷,۷۹۱.۷	۴,۴۶۰	۲۵,۹۲۰	۲۵,۵۴۰	(۱.۵%)	۵.۷	-۰.۹۱	۳,۵۳۰	(۲۰.۹%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

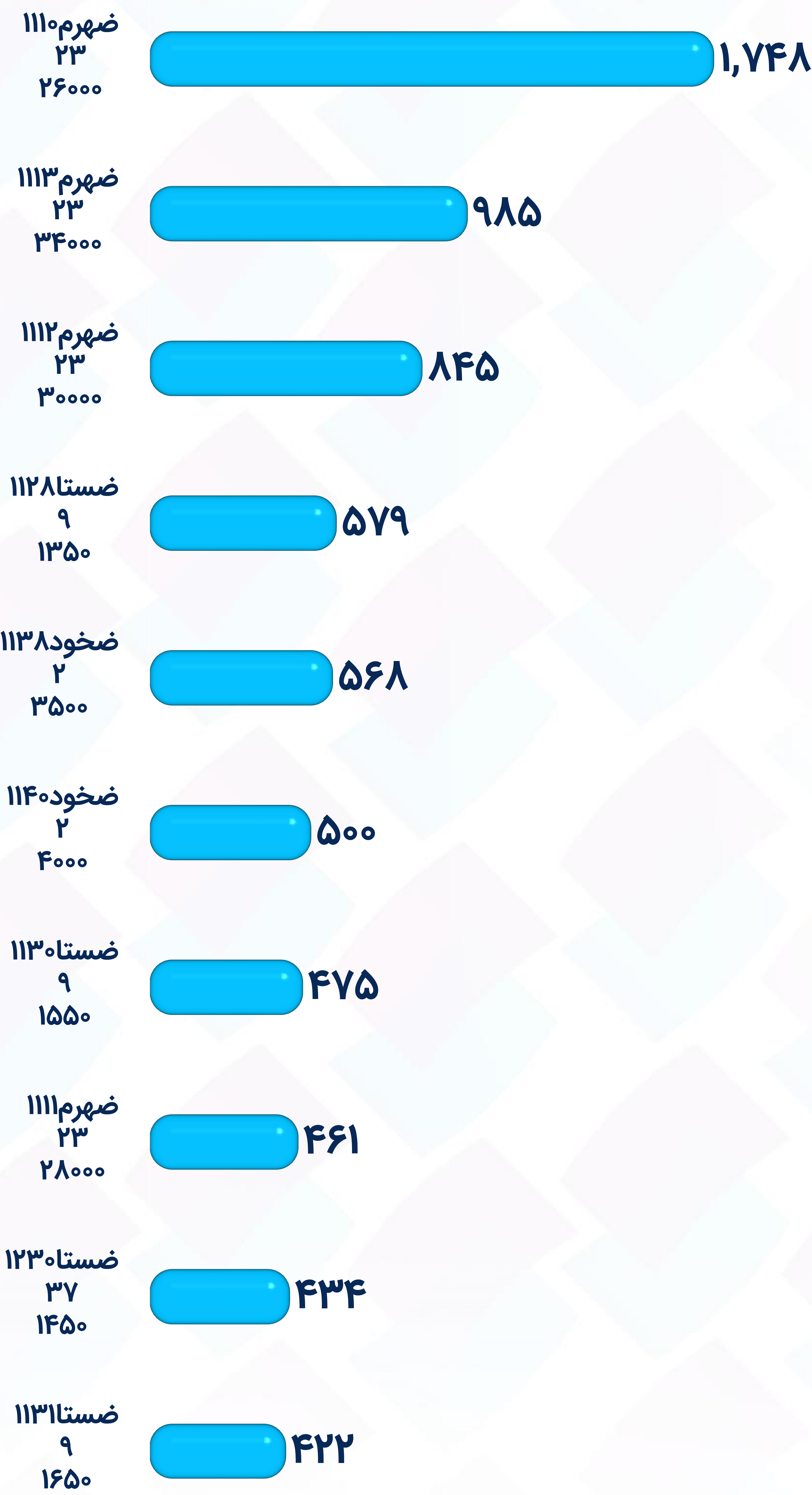
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۱۱۲۴	شستا	۹۵۰	۹	۱.۹	۱	۱,۳۴۴	۹۴۹	(۲۹.۴%)	۹۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۲	۱۴.۲	۱	۳,۴۵۳	۲,۷۹۹	(۱۸.۹%)	۲,۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۹	۷.۳	۱	۱,۳۴۴	۱,۰۴۹	(۲۱.۹%)	۱,۰۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طشنا ۱۲۱۵	شپنا	۳,۰۰۰	۳۷	۲.۱	۲۰	۴,۶۷۰	۲,۹۸۰	(۳۶.۲%)	۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۳	۵۲.۲	۵۲	۲۵,۹۲۰	۱۷,۹۴۸	(۳۰.۸%)	۳۴۵.۲	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

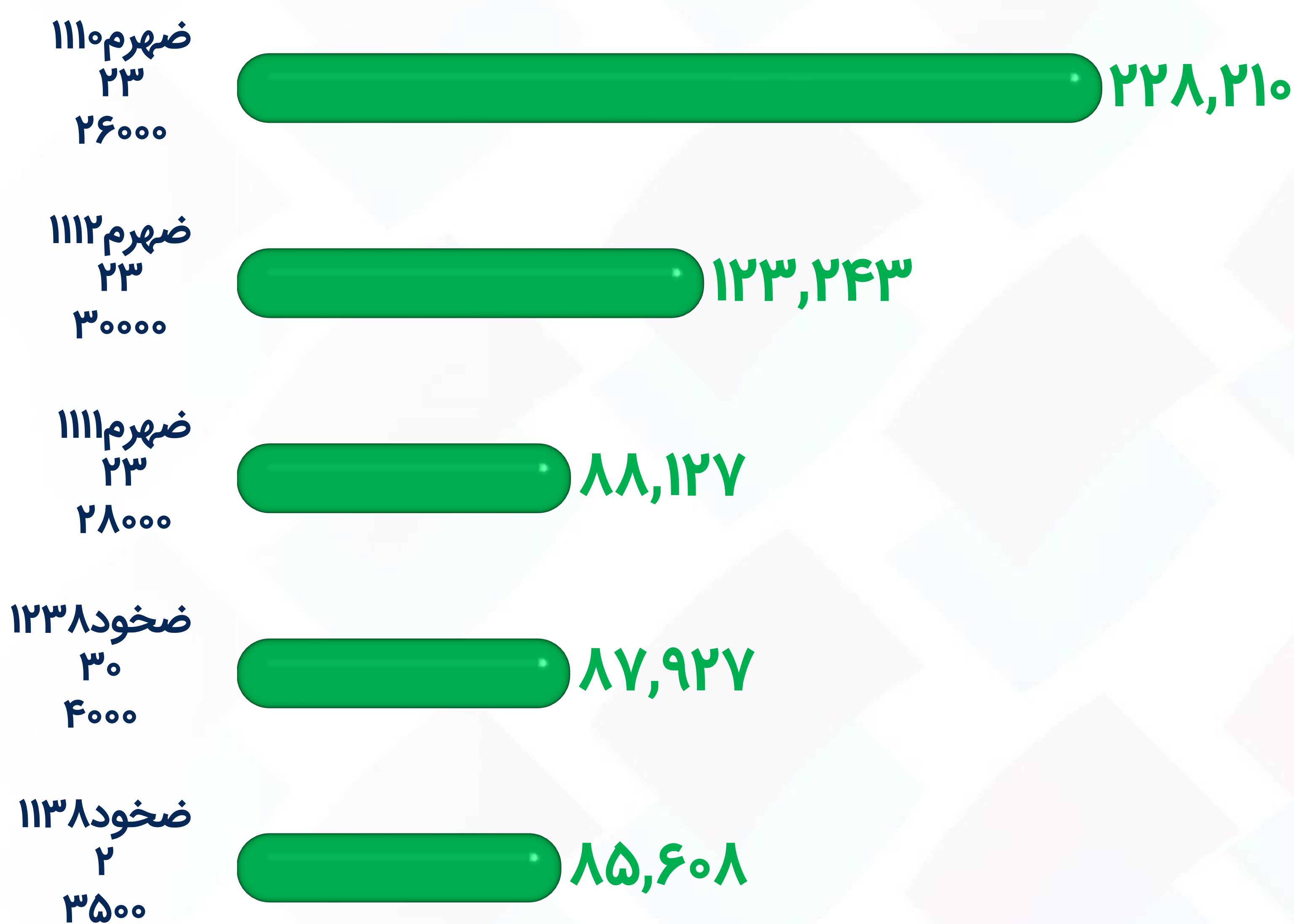
ارزش موقعیت‌های باز

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



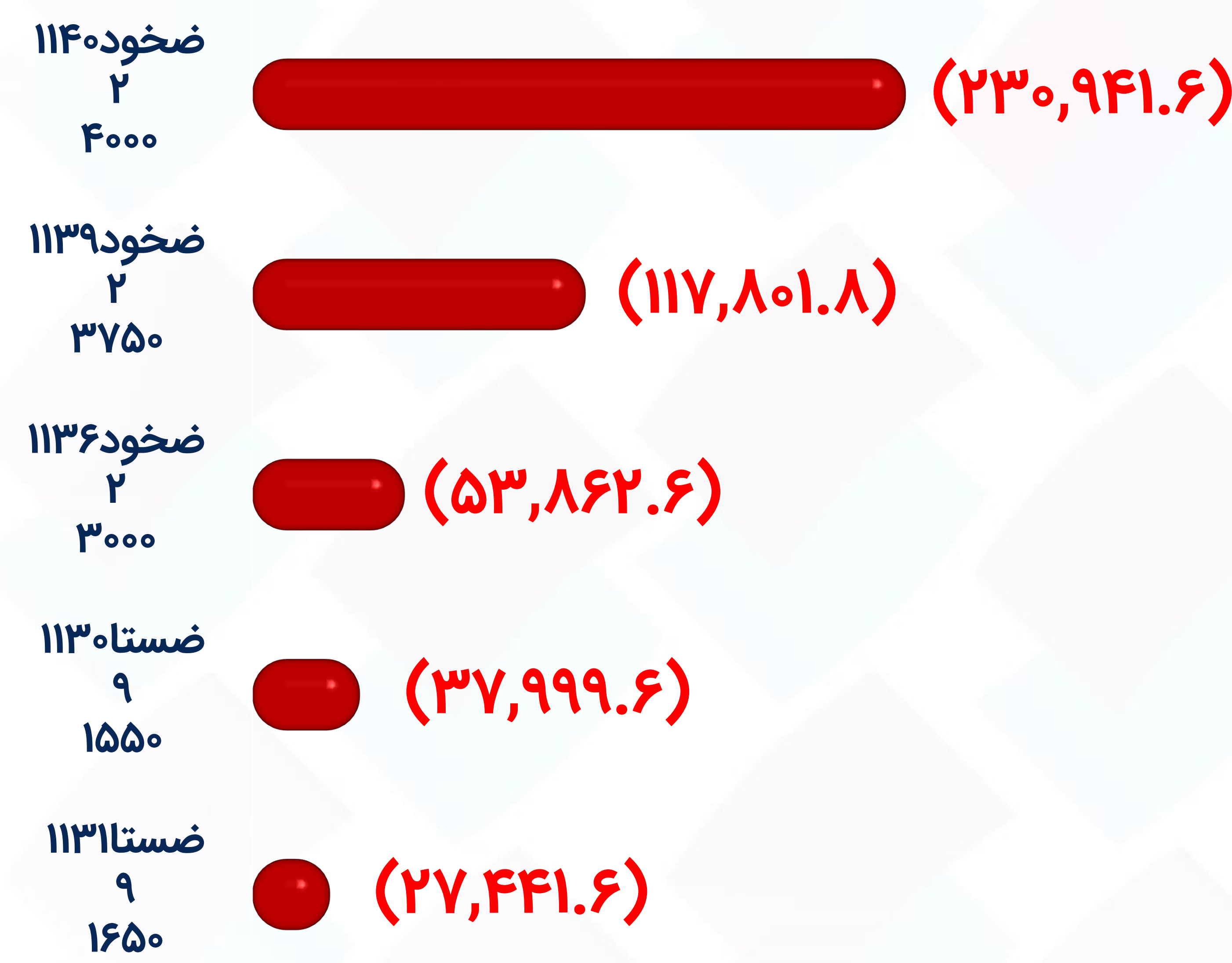
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

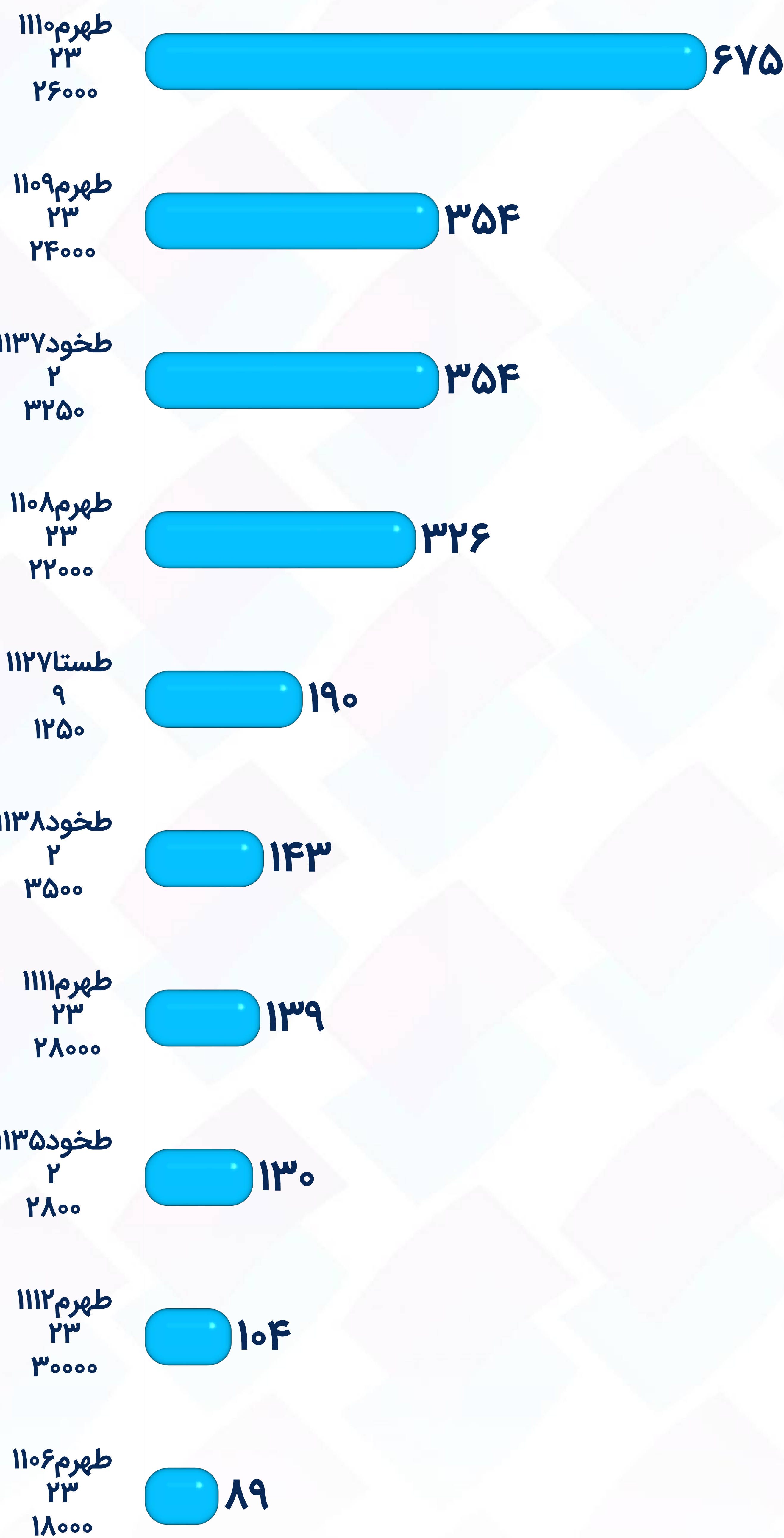
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

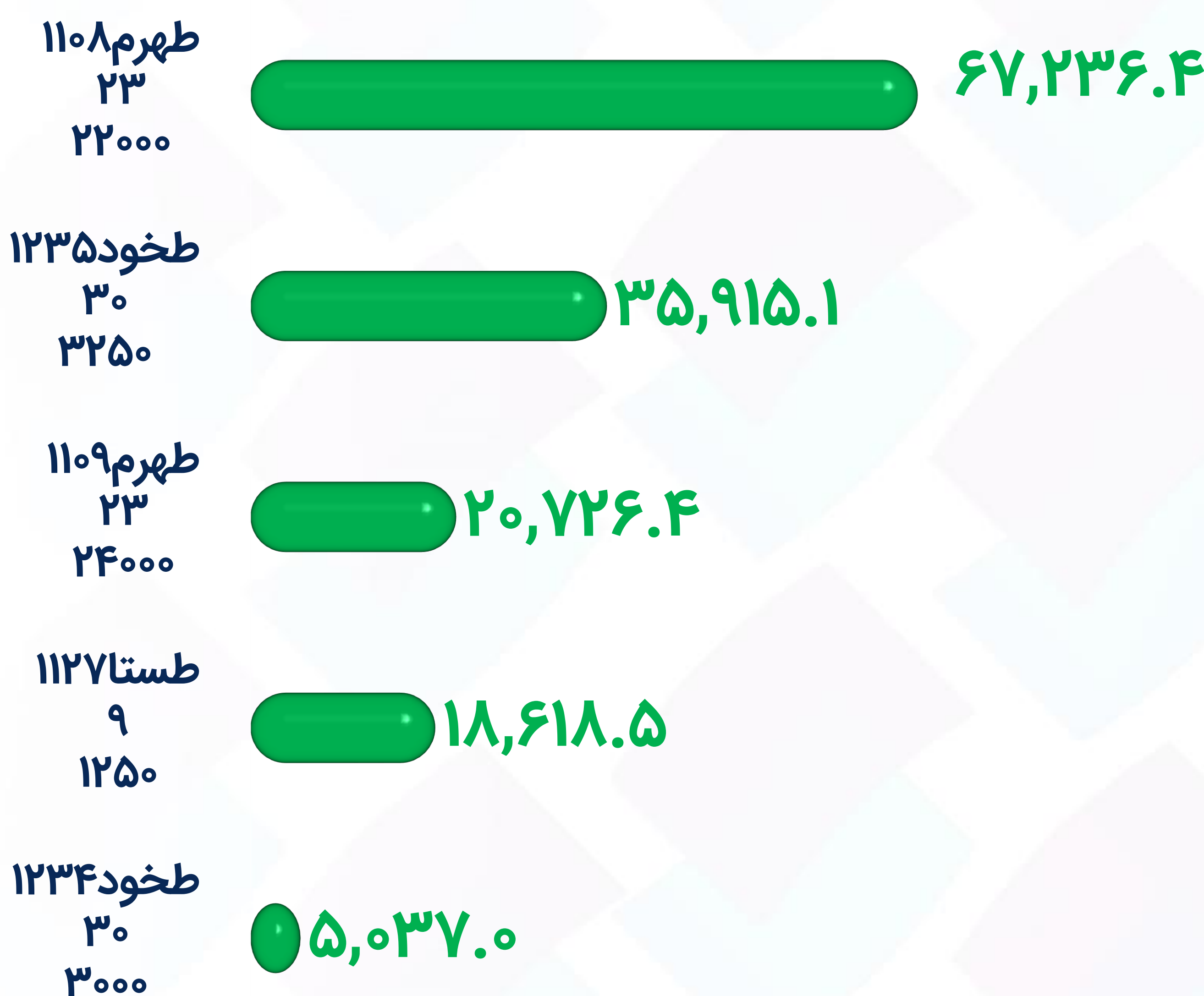
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

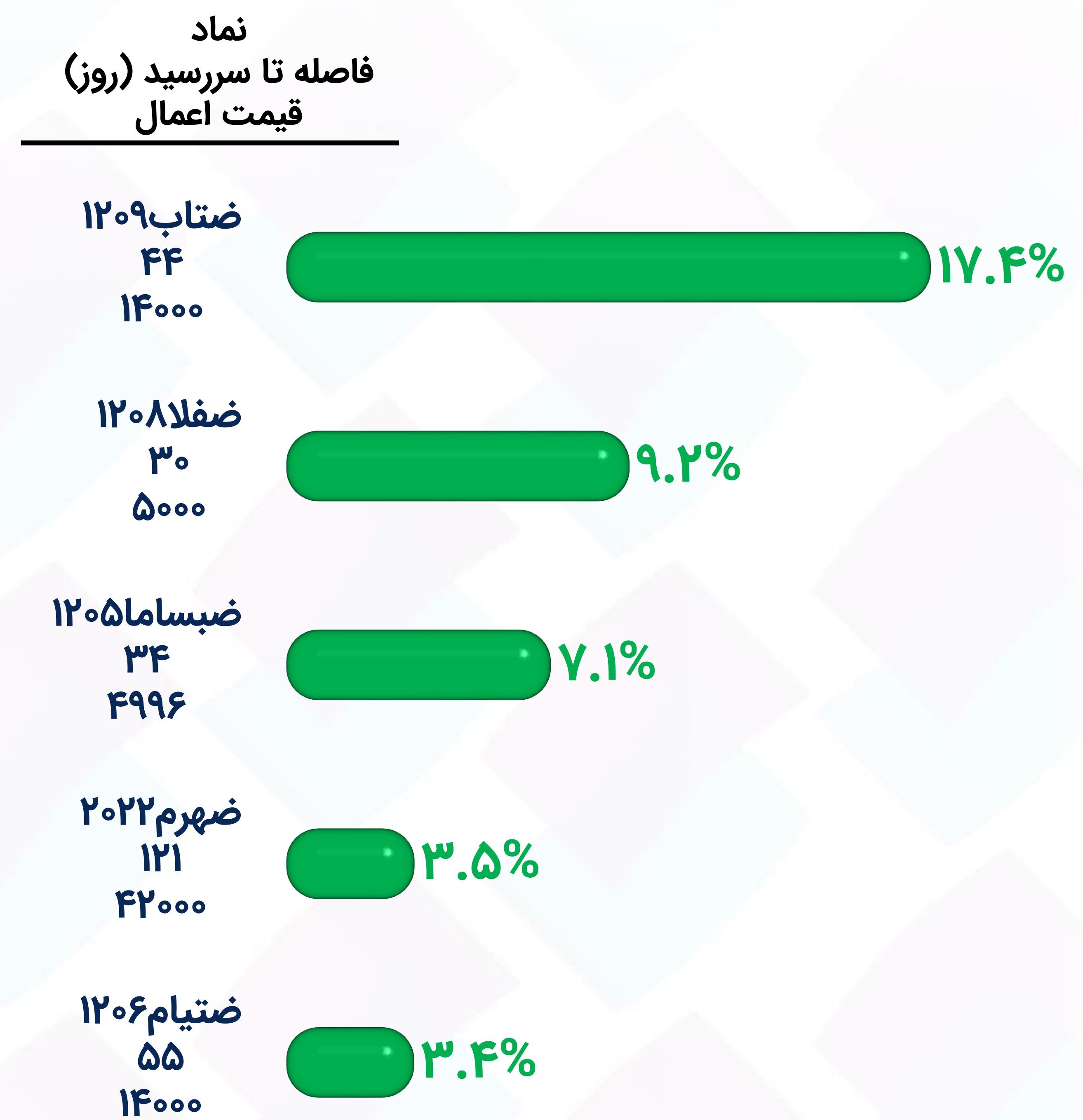
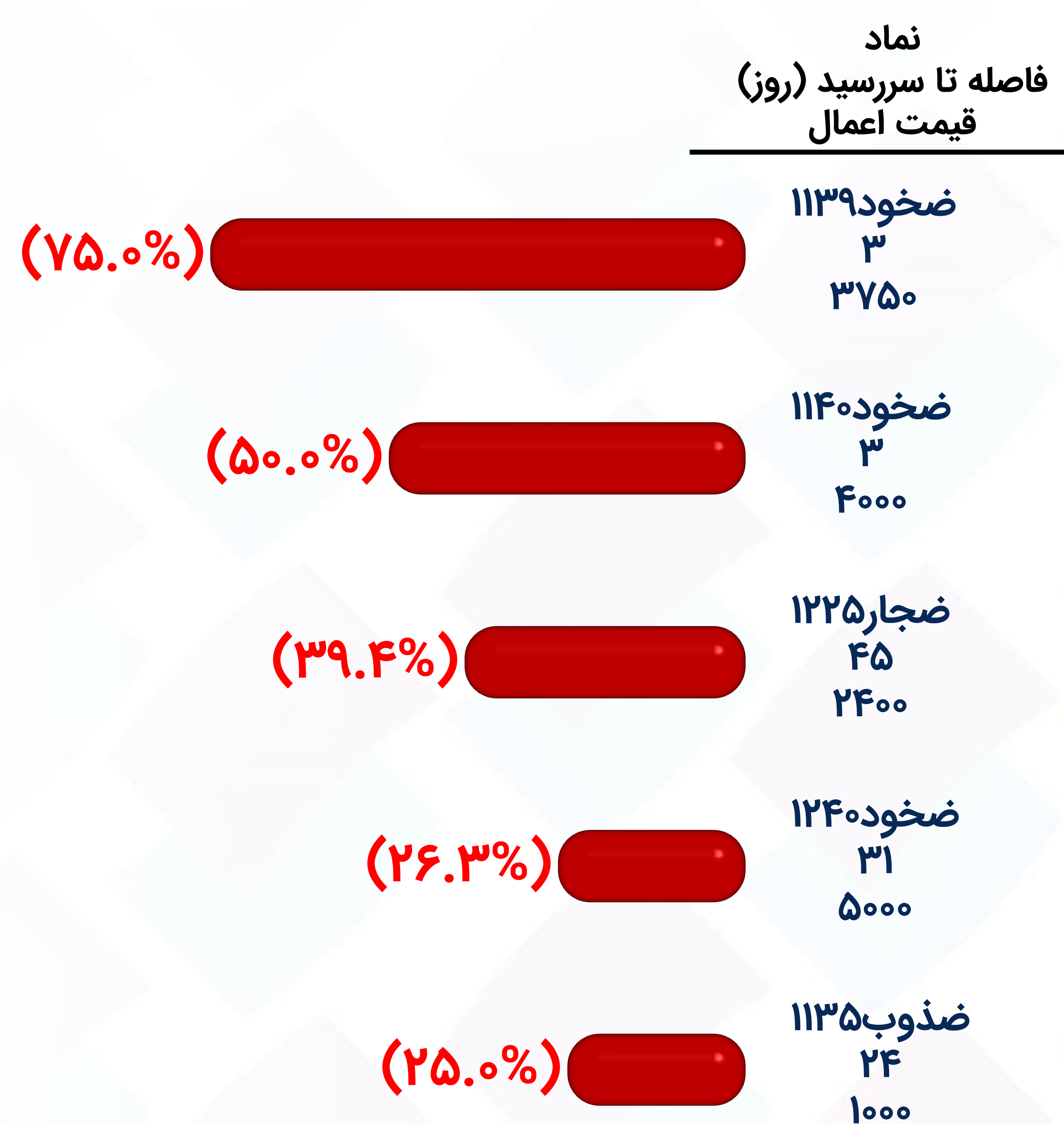
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



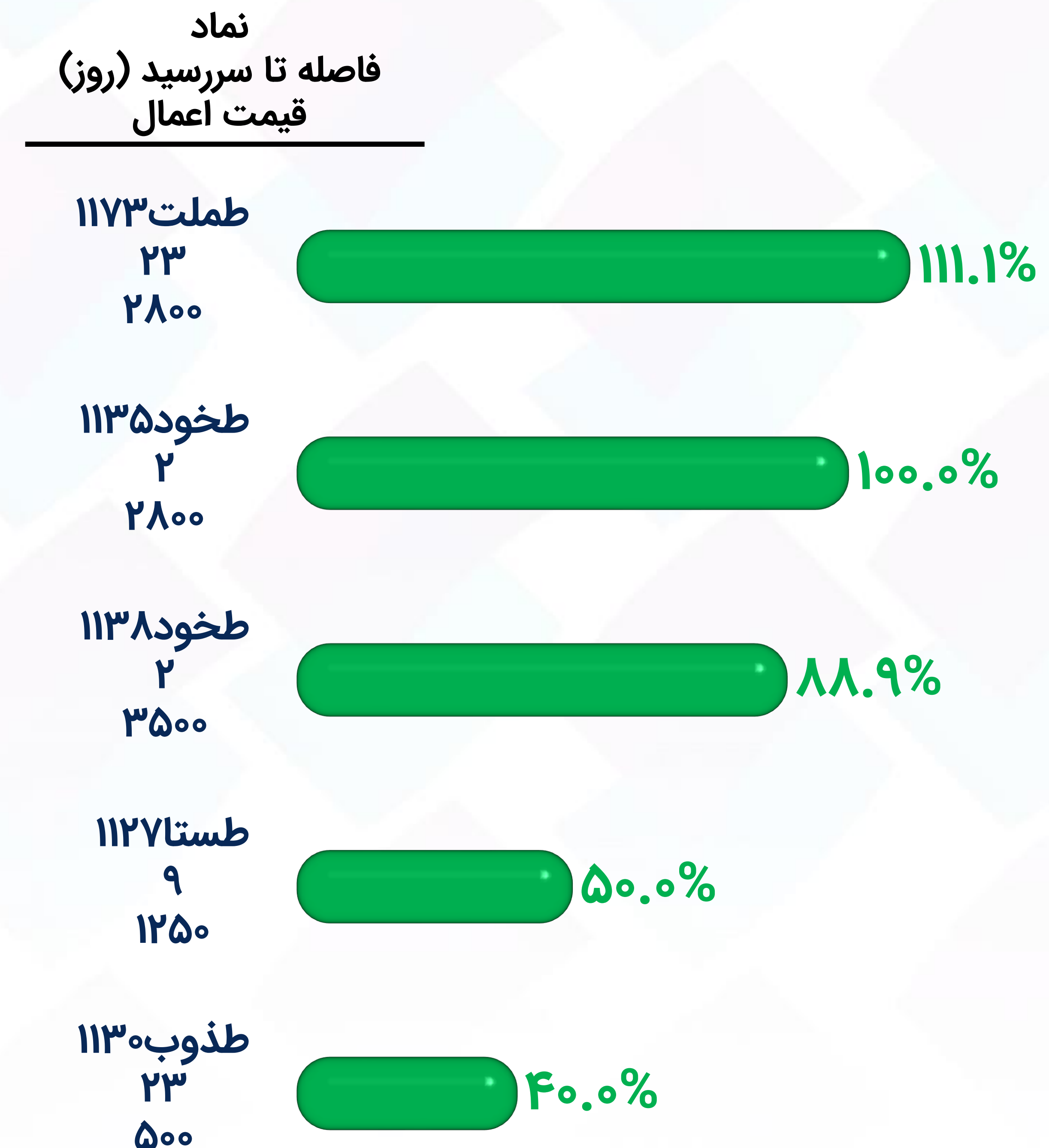
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

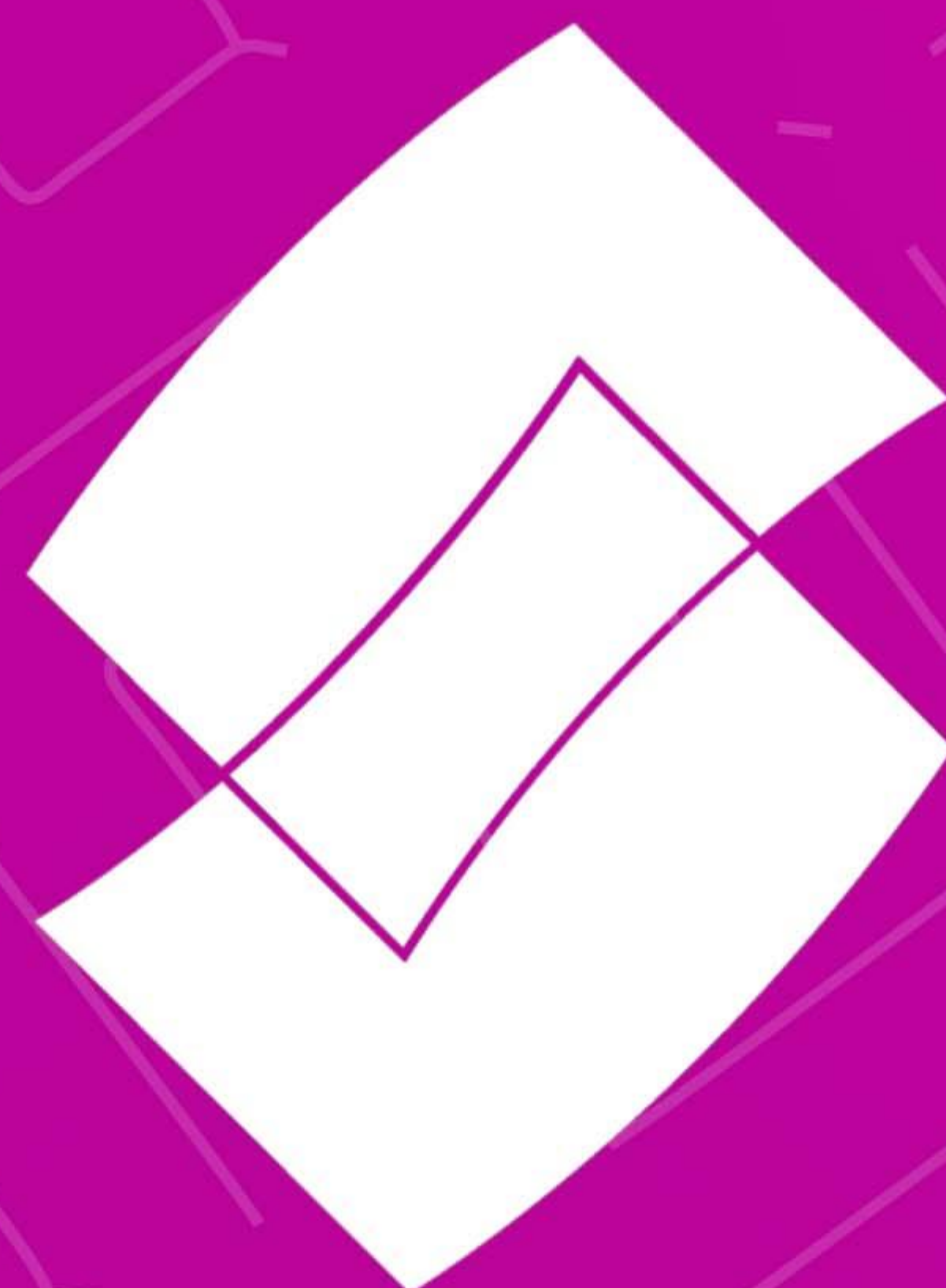
اختیار خرید



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.