

شماره
۴۱۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

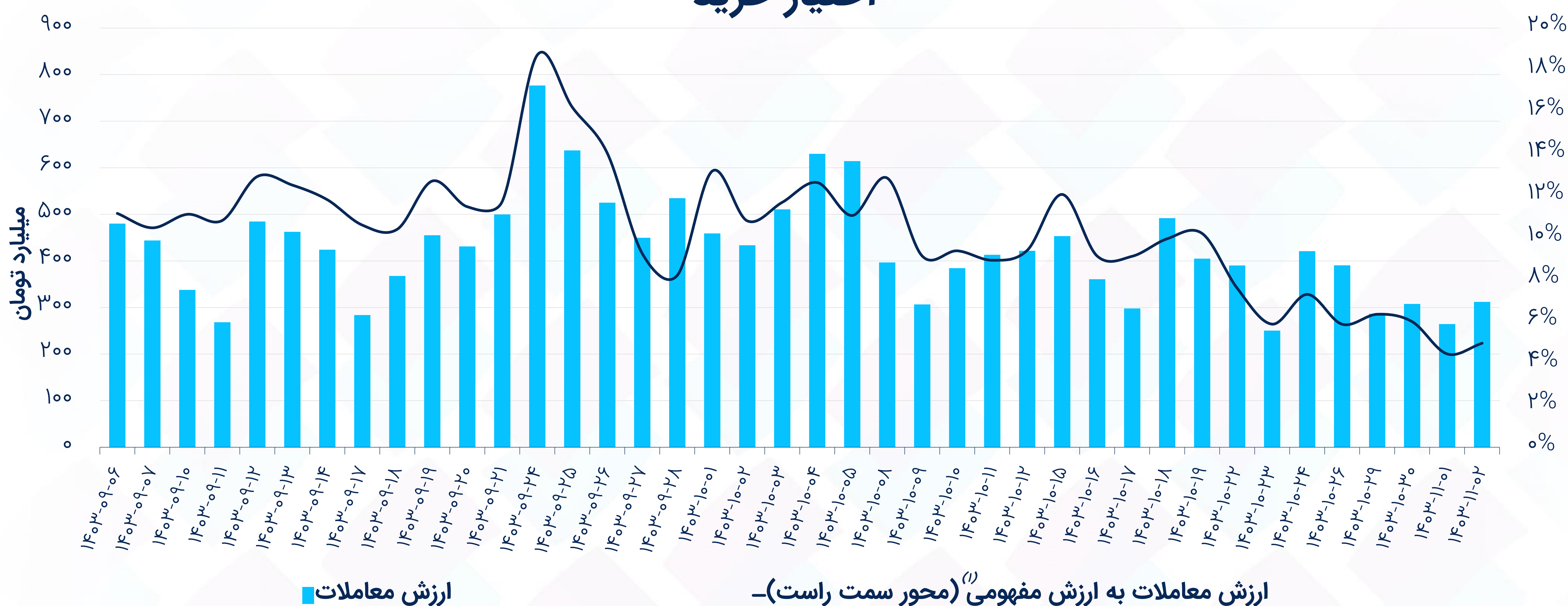




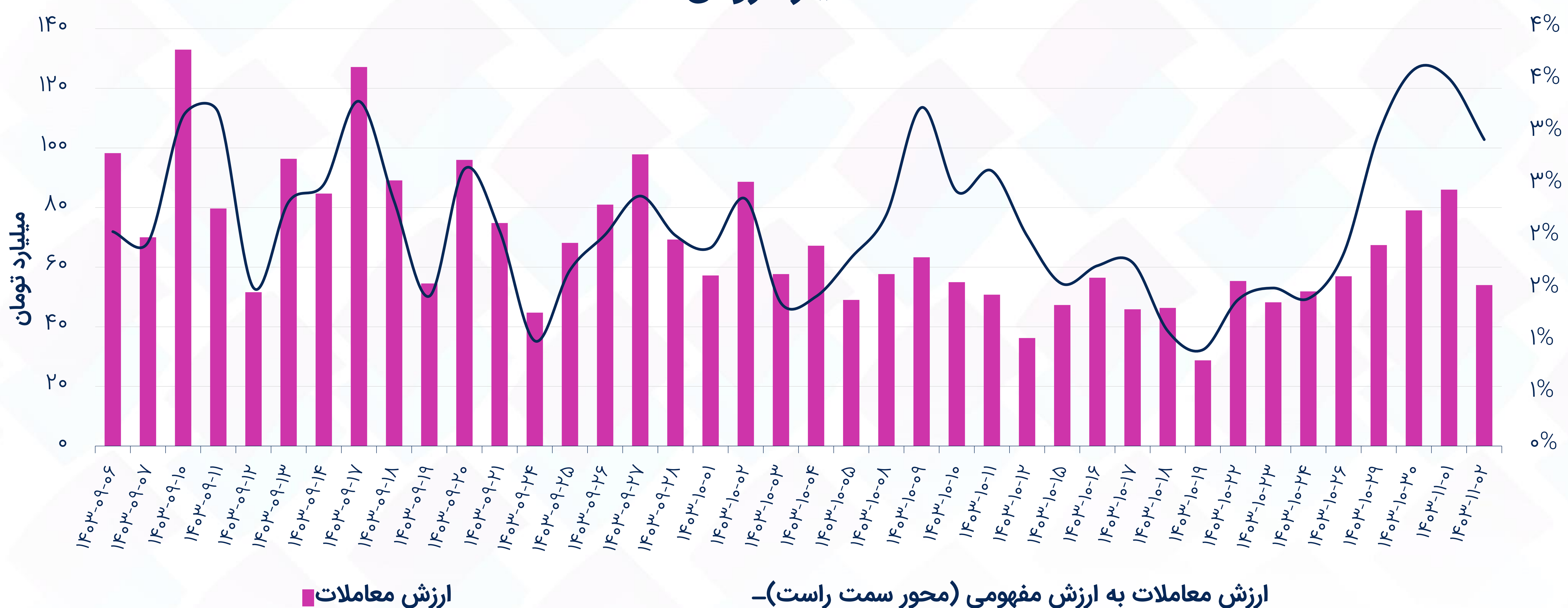
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



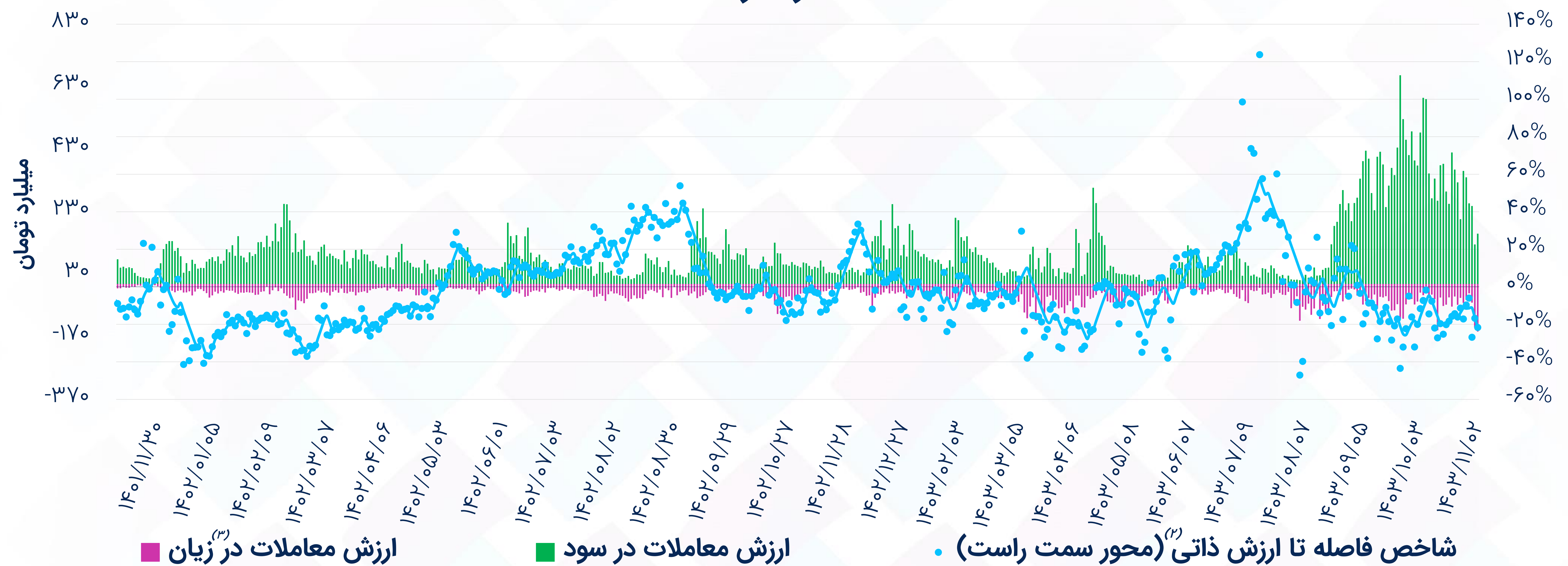
اختیار فروش



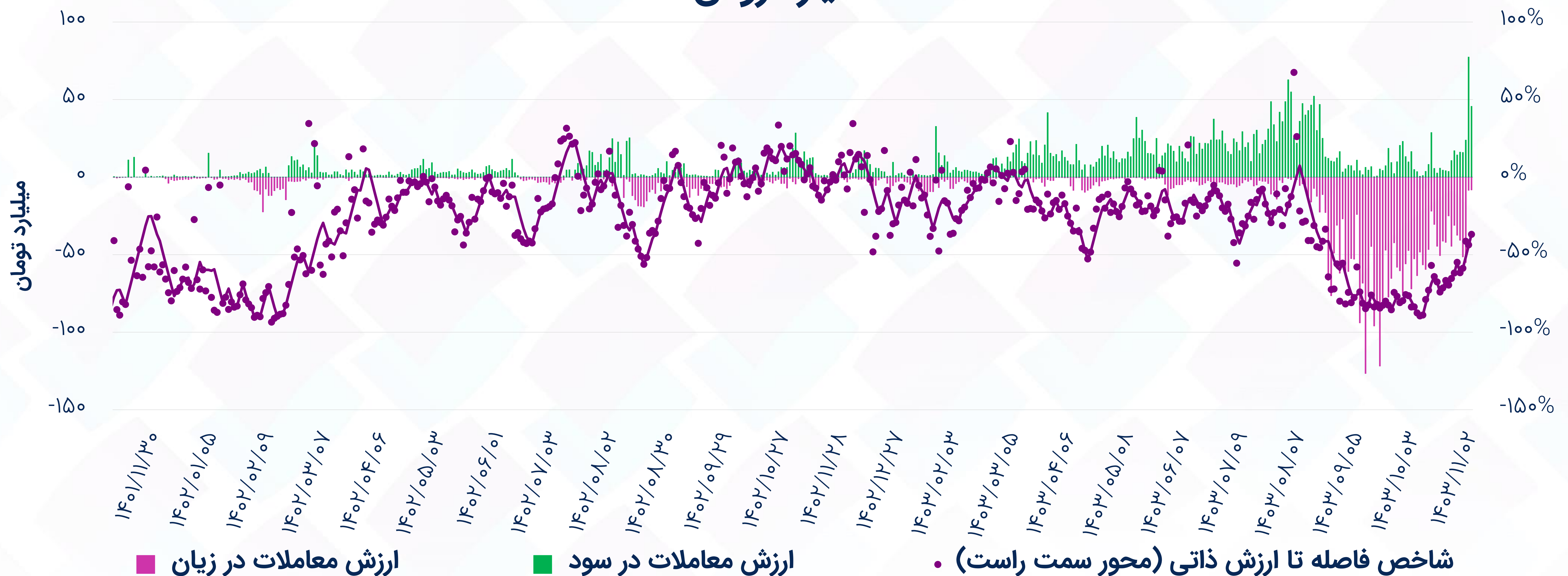
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

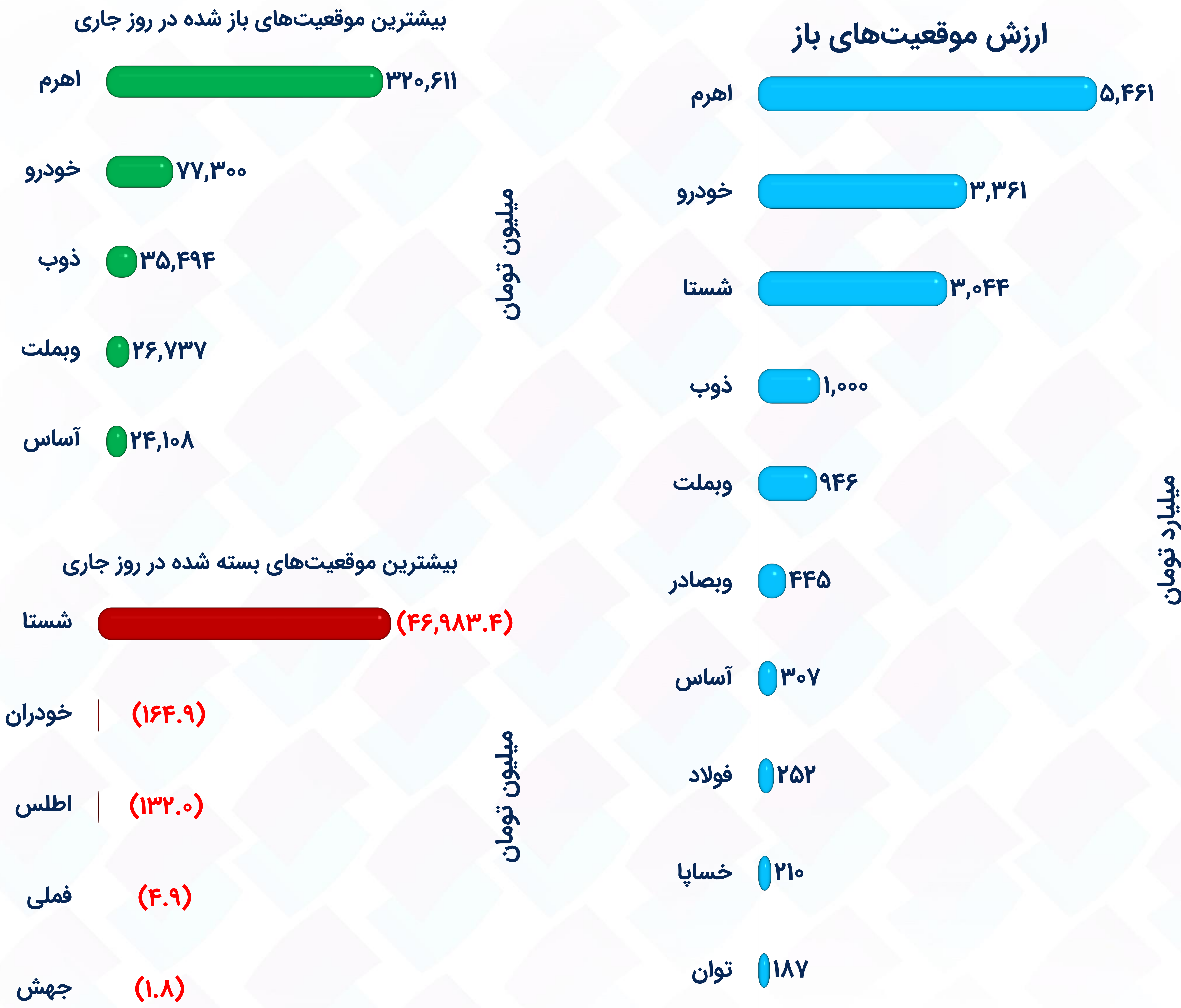
اختیار خرید

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	۲۶	۱۵۶.۶	۲,۳۲۰.۶	۳۱.۸	۱۲۴.۸	(۴۳.۰%)
خودرو	۳۵	۱۰۳.۷	۳,۰۴۵.۸	۹۰.۶	۱۳.۱	۱۲.۸%
شستا	۴۱	۲۲.۵	۶۵۷.۸	۱۴.۹	۷.۶	(۳۱.۳%)
آساس	۸	۸.۲	۳۰.۱	۸.۰	۰.۲	(۱۰.۹%)
ذوب	۱۹	۸.۲	۱۰۹.۲	۳.۴	۴.۸	(۳۶.۳%)
وبملت	۱۷	۵.۰	۶۰.۱	۴.۲	۰.۹	(۲۱.۳%)
توان	۱۷	۲.۶	۸.۵	۲.۶	۰.۱	(۴.۶%)

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	۱۳	۴۱,۱۳۹.۵	۸۸۷,۱۴۹.۱	۳۶,۹۵۳.۵	۴,۱۸۶.۱	(۳۶.۳%)
خودرو	۹	۹,۷۳۰.۲	۷۹۲,۴۲۴.۹	۷,۹۸۲.۸	۱,۷۴۷.۴	(۳۴.۳%)
شستا	۱۵	۲,۸۵۸.۶	۱۴۷,۷۷۱.۷	۶۷۱.۹	۲,۱۸۶.۶	(۵۲.۶%)
وبملت	۳	۱۱۹.۰	۶,۵۳۰.۹	۰.۰	۱۱۹.۰	(۷۷.۳%)
ذوب	۳	۷۹.۰	۲,۲۲۳.۲	۶۸.۵	۱۰.۵	(۴۱.۷%)
توان	۲	۵۴.۴	۱,۴۷۰.۶	۰.۰	۵۴.۴	(۴۲.۵%)
فملی	۲	۱۲.۸	۴۰۴.۳	۱۲.۶	۰.۳	(۷.۱%)

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

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
ضکرومیت ۲۰۰	کرومیت	۷,۵۰۰	۱۱۰	۵۷.۸	۱,۵۰۱	۸,۷۱۰	۹,۰۰۱	۳.۳%	۶.۰	۰.۸۷	۲,۰۵۹	۳۷%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۸۹	۴.۳	۱,۸۵۶	۱۲,۵۳۸	۱۲,۸۵۶	۲.۵%	۶.۹	۰.۹۸	۲,۳۴۶	۲۶%
ضفصبا ۱۱۲۳	فصبا	۴,۴۰۰	۱۲	۳۳.۸	۲۷۲	۴,۶۹۱	۴,۶۷۲	(۰.۴%)	۱۷.۲	۰.۹۵	۳۴۳	۲۶%
ضستا ۲۰۳۵	شستا	۹۰۰	۹۹	۲۱.۴	۴۲۷	۱,۳۵۴	۱,۳۲۷	(۲.۰%)	۳.۱	۱.۰۰	۵۲۸	۲۴%
ضستا ۱۲۲۲	شستا	۶۵۰	۳۶	۴.۶	۶۰۹	۱,۳۵۴	۱,۲۵۹	(۷.۰%)	۲.۱	۱.۰۰	۷۲۶	۱۹%

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	۲۲	۲.۹	۳	۴۸۹	۱,۰۰۳	۱۰۵%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۲	۱۰.۲	۲	۴۸۹	۸۰۲	۶۴%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۸	۶۵.۸	۲	۱,۳۵۴	۱,۶۵۲	۲۲%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۲۹	۱۰۵.۶	۲۹	۳,۴۲۷	۵,۰۲۹	۴۷%	۱۷۳.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۲۲	۱۸۶.۸	۳	۴۸۹	۷۰۳	۴۴%	۲۳۴.۳	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	۲۲	۱۱۹.۷	۷,۱۲۲	۲۵,۵۷۰	۲۶,۸۷۸	۵.۱%	۳.۸	-۱.۰۰	۷,۷۴۲	۸.۷%
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۲	۵,۸۳۷.۱	۴,۱۳۰	۲۵,۵۷۰	۲۵,۸۷۰	۱.۲%	۶.۳	-۰.۹۴	۳,۸۸۰	(۶.۰%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۲۲	۱۵.۳	۱۰۹	۴۸۹	۴۹۱	۰.۴%	۴.۵	-۰.۹۸	۹۹	(۹.۰%)
طستا ۱۱۲۹	شستا	۱,۴۵۰	۸	۶۷۱.۹	۱۰۱	۱,۳۵۴	۱,۳۴۹	(۰.۴%)	۱۳.۴	-۰.۹۲	۸۶	(۱۴.۸%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۲	۲,۹۸۹.۷	۲,۶۵۱	۲۵,۵۷۰	۲۵,۳۴۹	(۰.۹%)	۹.۶	-۰.۷۸	۲,۱۴۲	(۱۹.۲%)

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	۸	۴.۷	۱	۱,۳۵۴	۹۴۹	(۲۹.۹%)	۹۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۸	۸.۰	۲	۱,۳۵۴	۱,۰۴۸	(۲۲.۶%)	۵۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۲	۱۵.۱	۴۷	۲۵,۵۷۰	۱۷,۹۵۳	(۲۹.۸%)	۳۸۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۲	۸.۱	۴۲	۲۵,۵۷۰	۱۹,۹۵۸	(۲۱.۹%)	۴۷۵.۲	۰.۰۰	۱	(۹۸.۴%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۲۲	۱۰.۵	۴	۴۸۹	۳۹۶	(۱۹.۰%)	۹۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۷.۸%)

(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

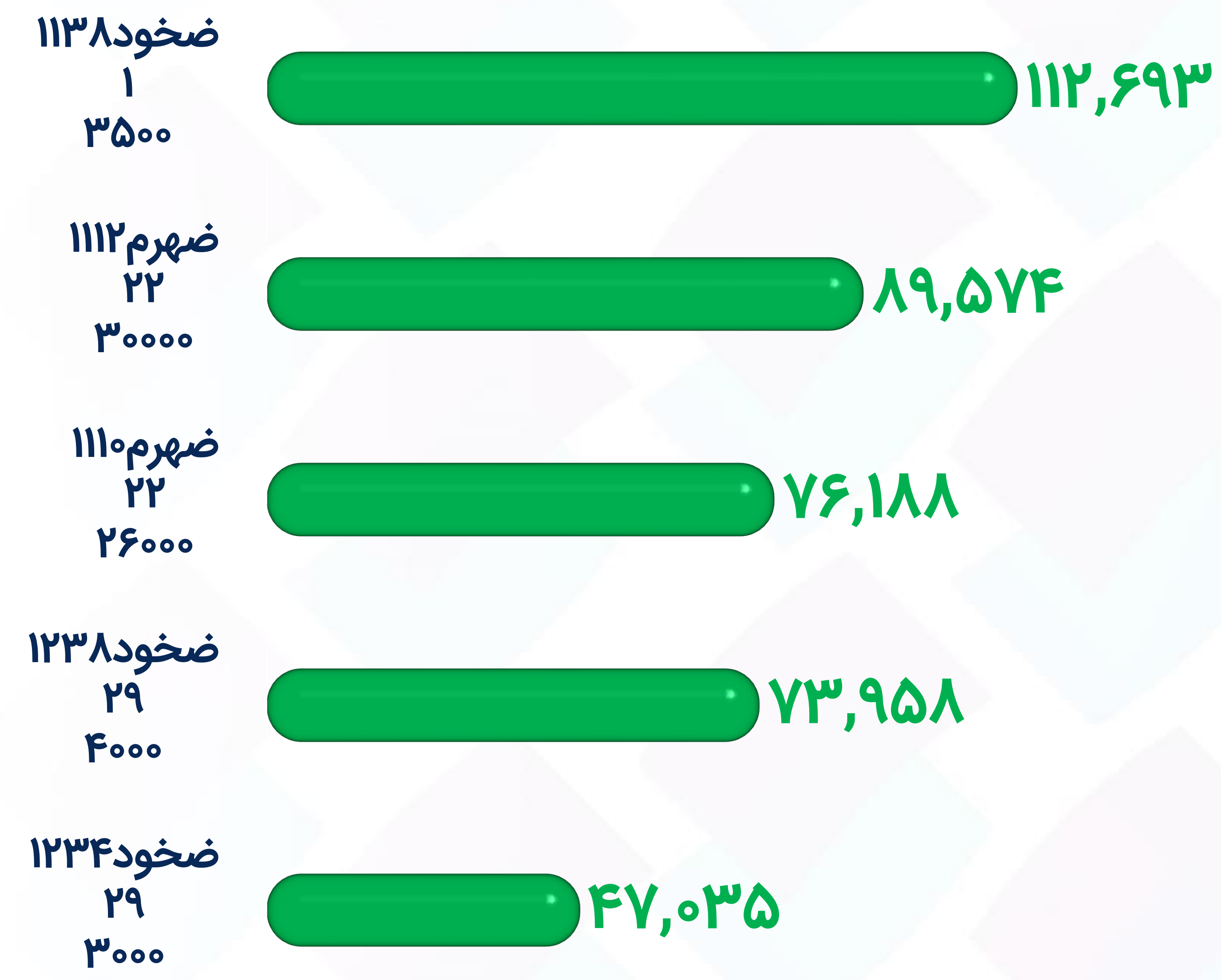
ارزش موقعیت‌های باز

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

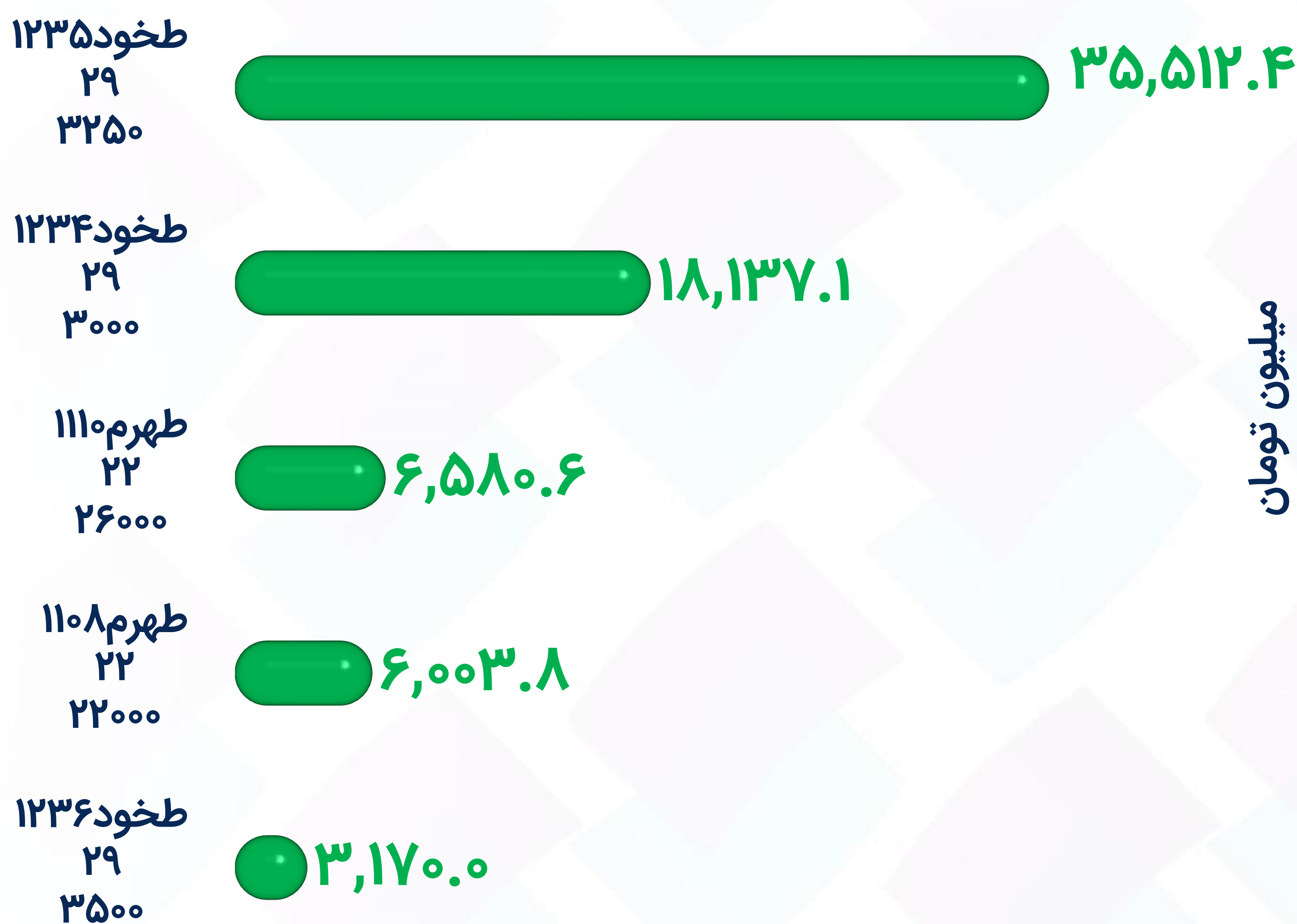
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

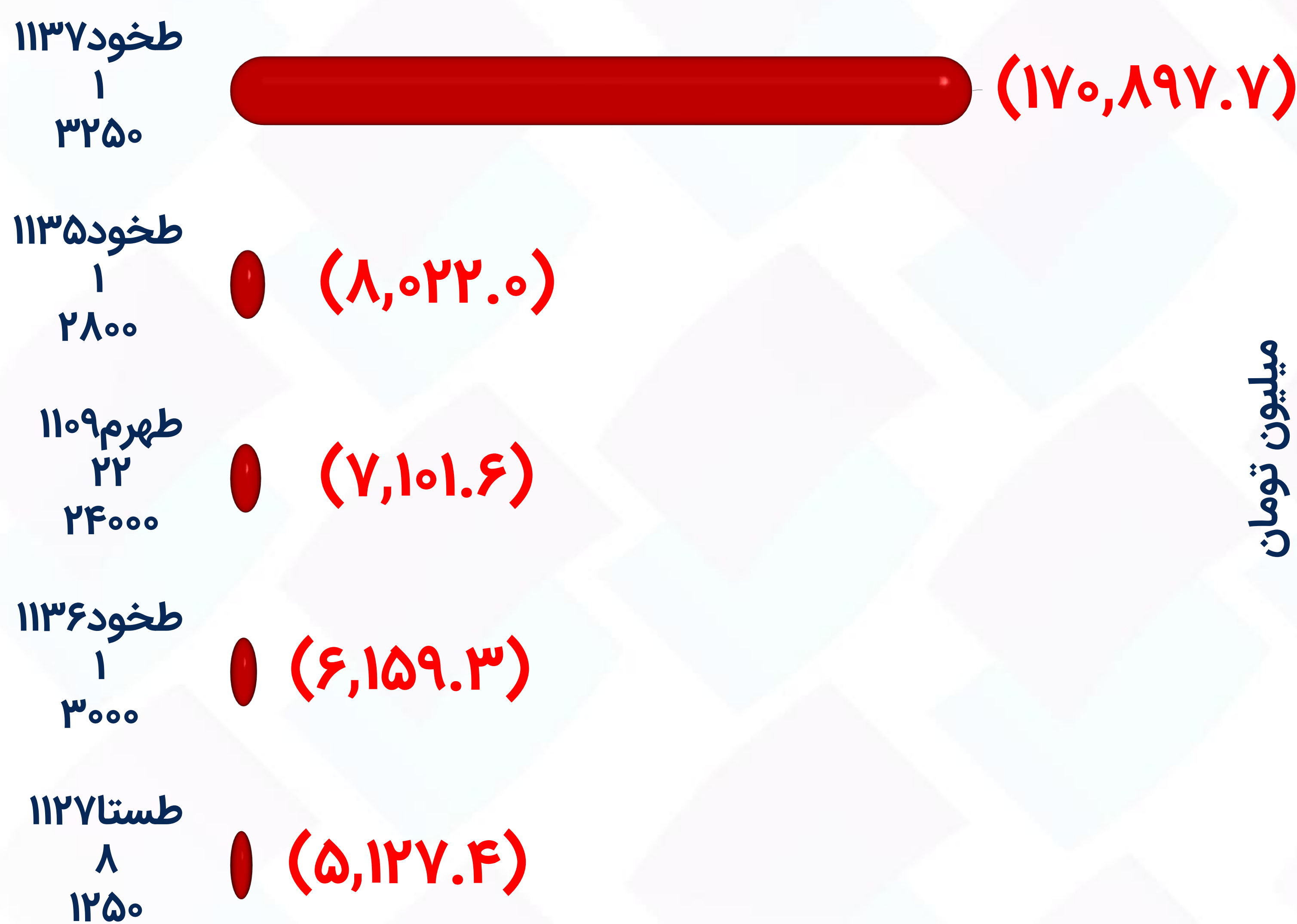
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

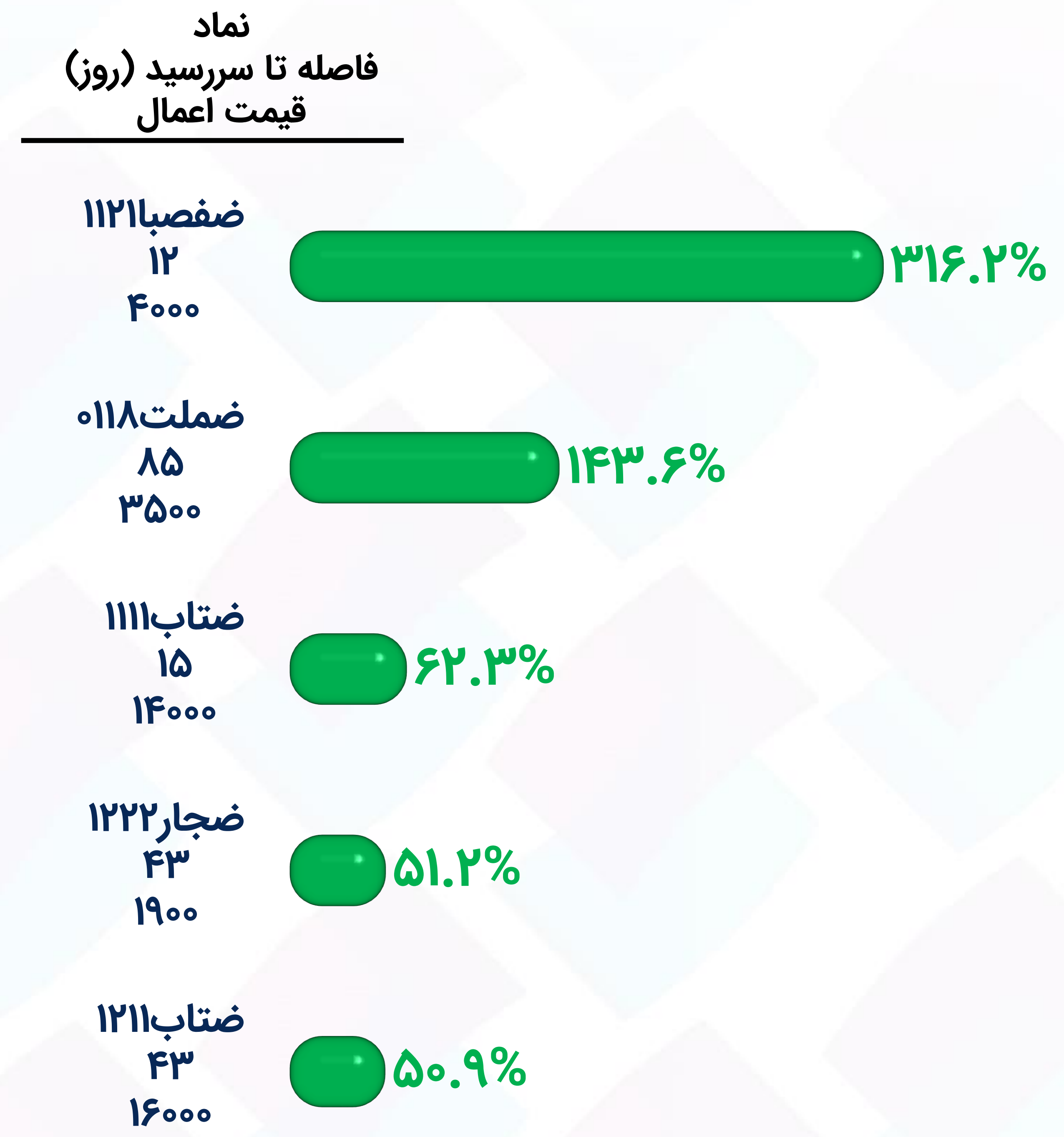
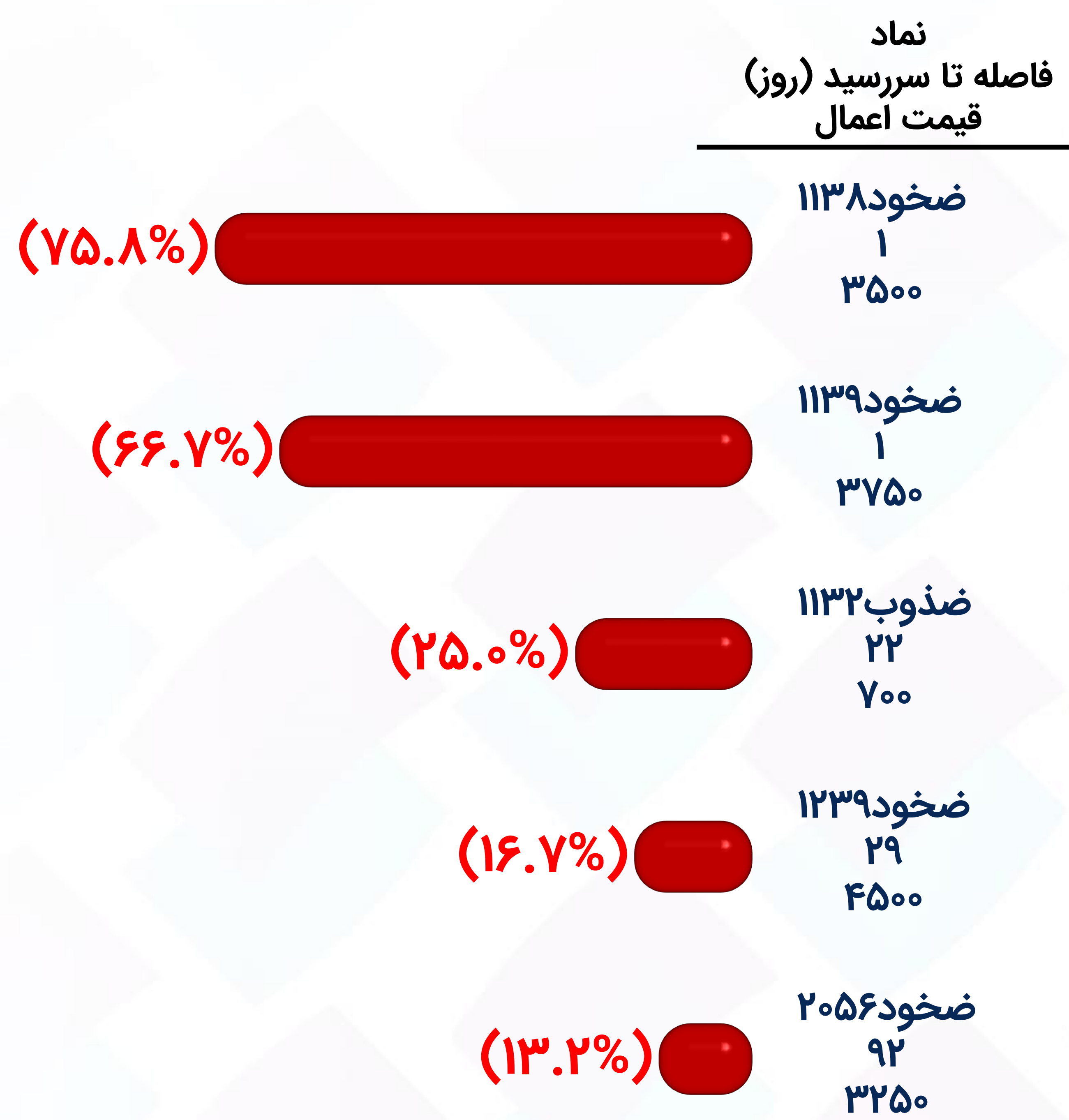
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



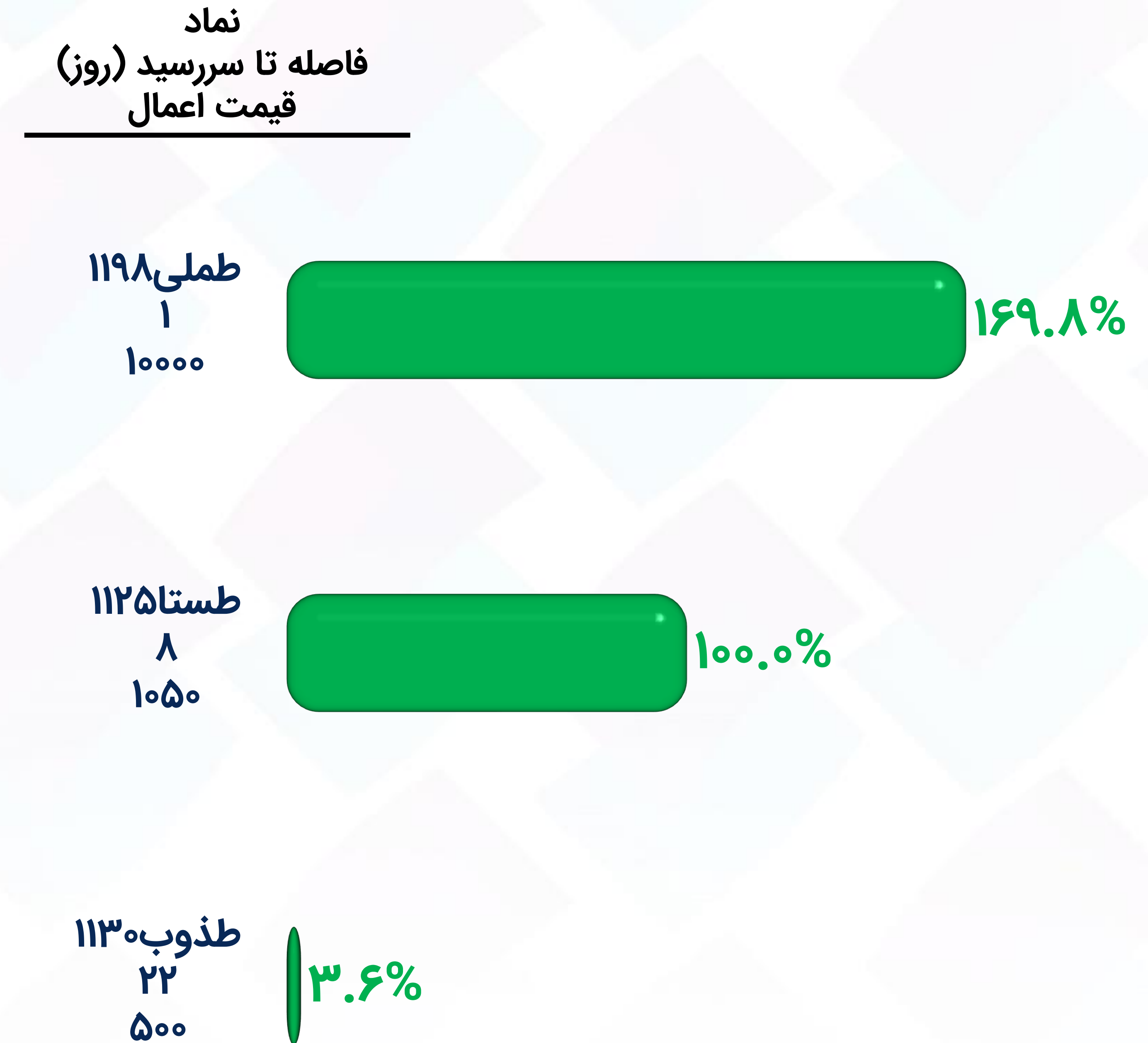
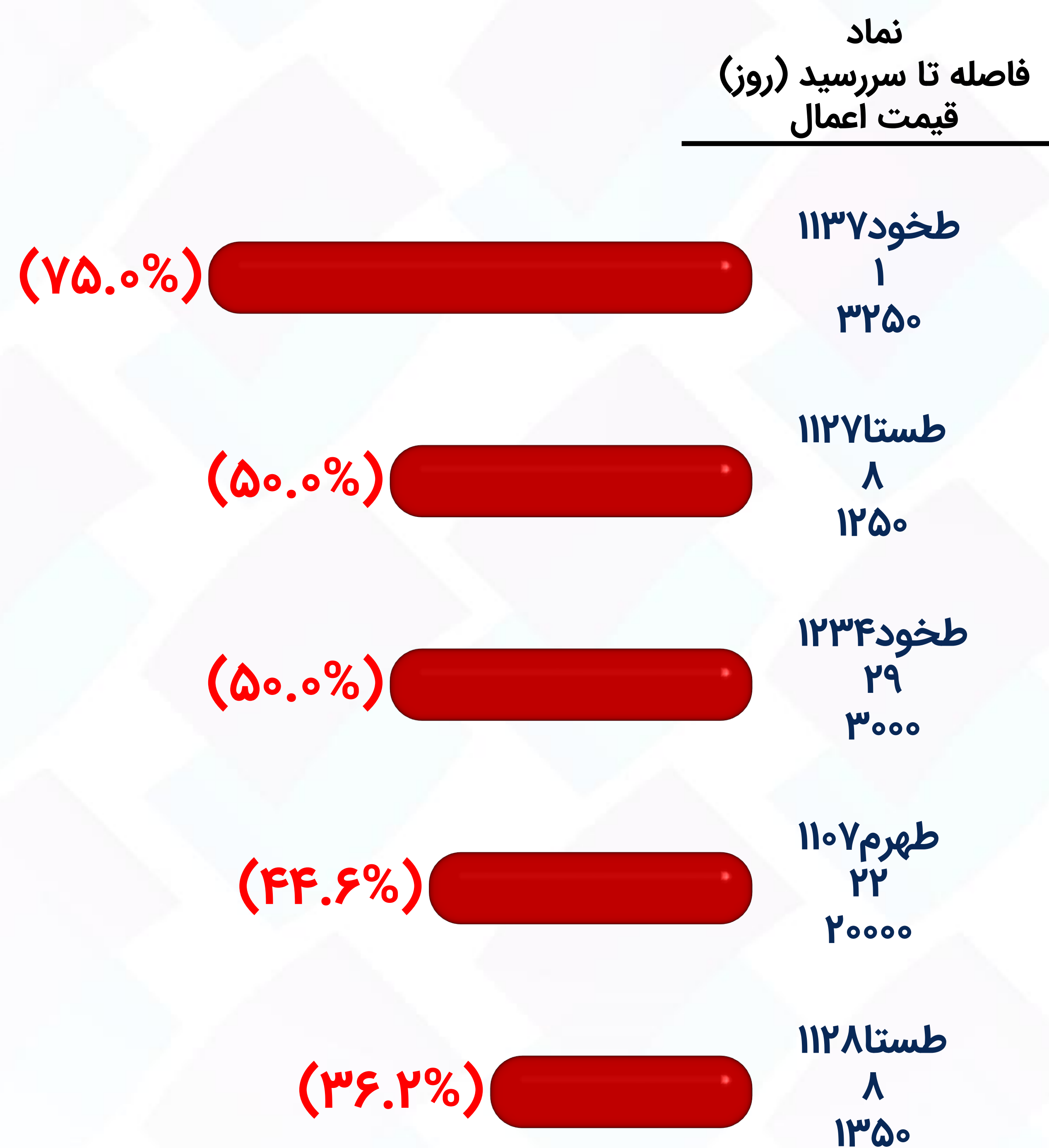
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

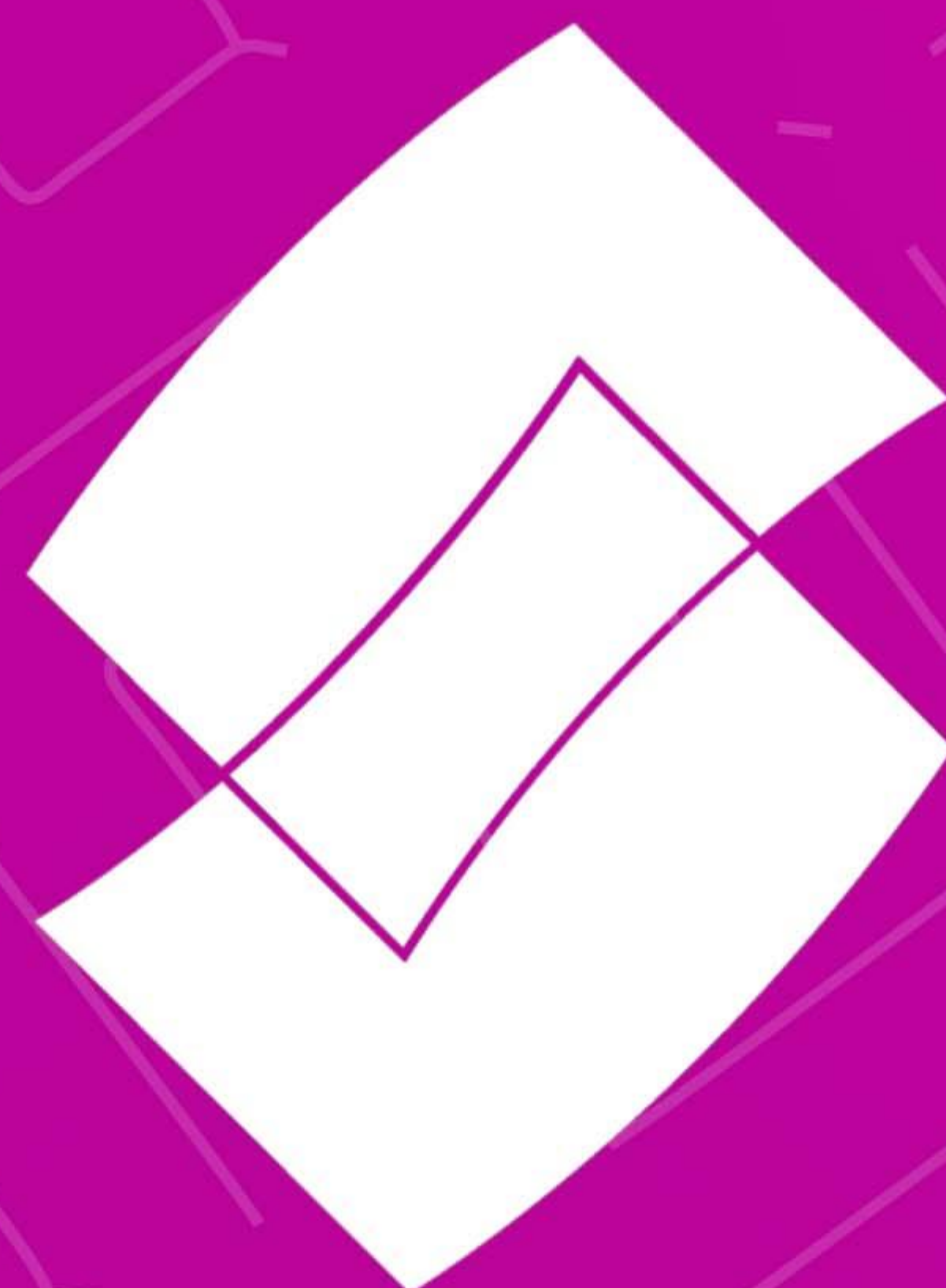
اختیار خرید



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.