

شماره
۴۱۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

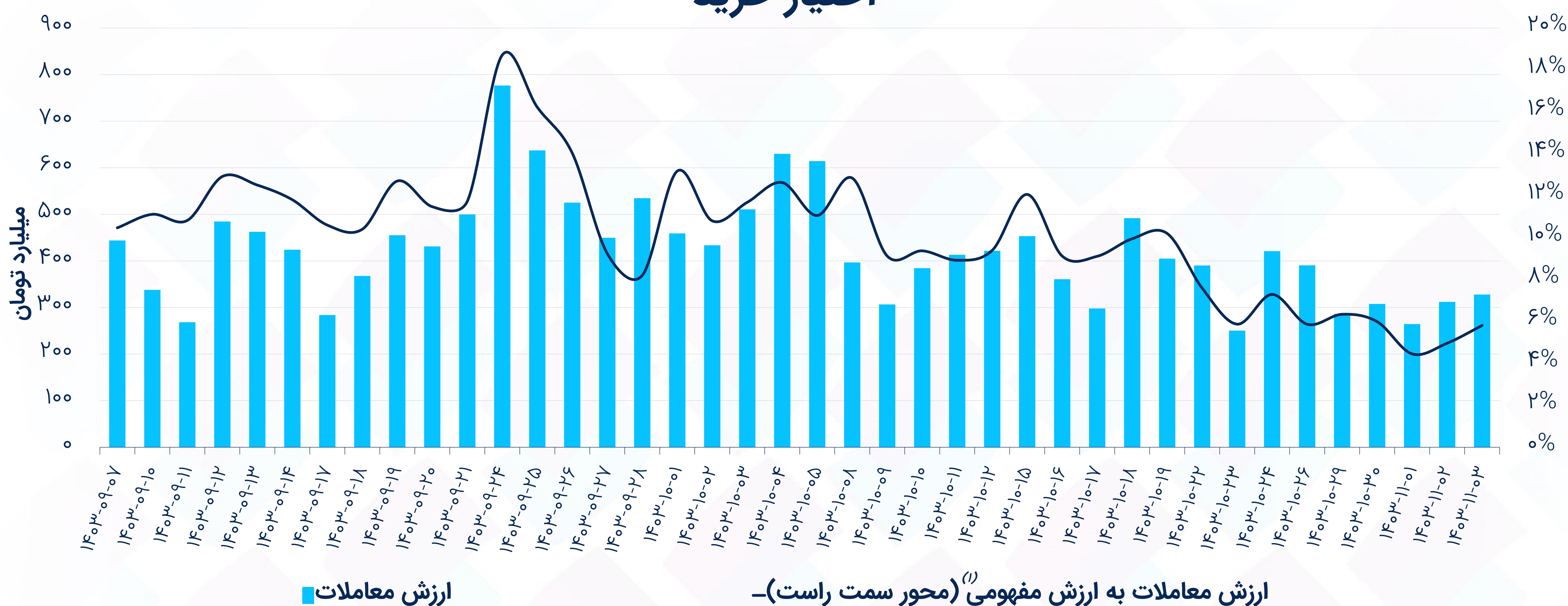




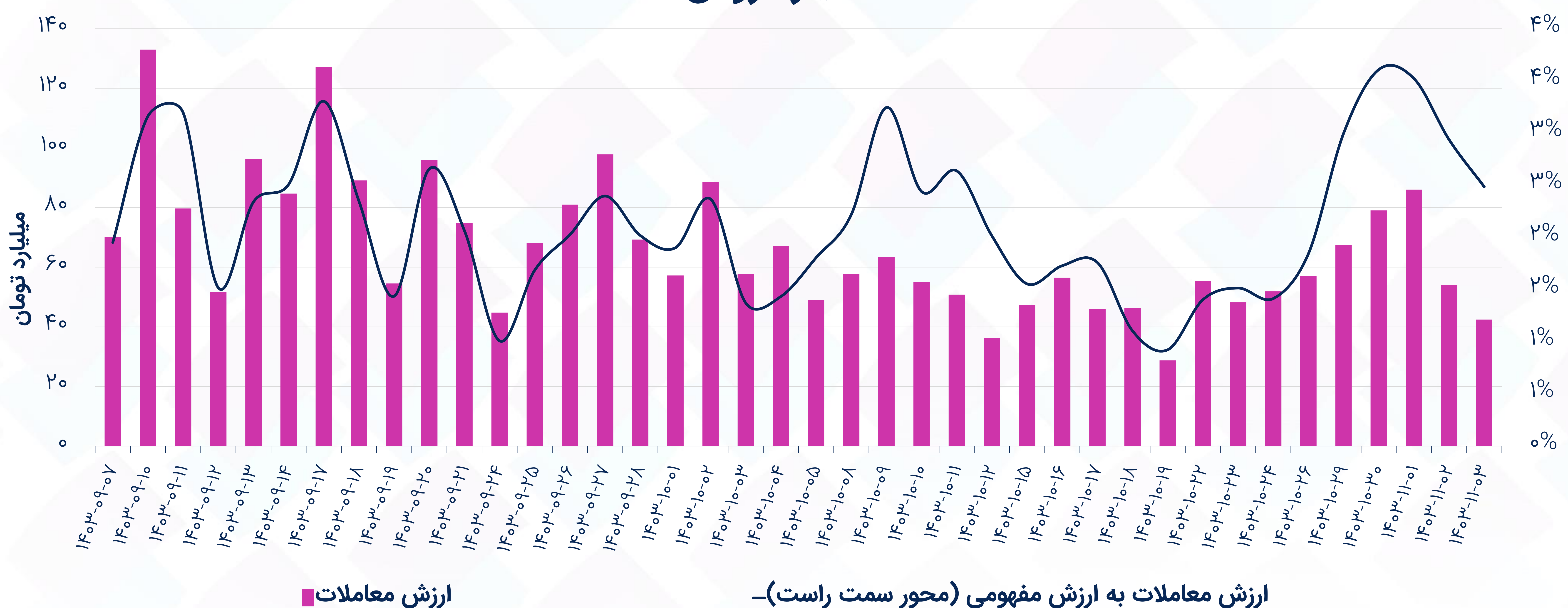
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



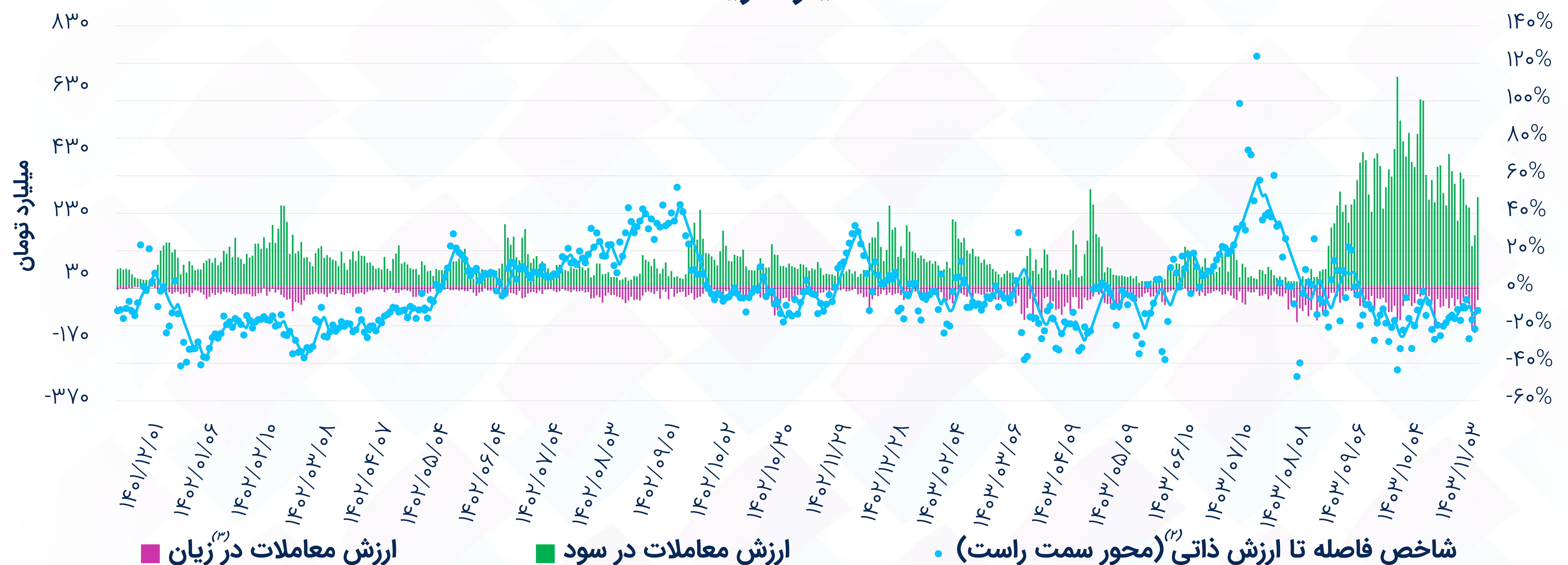
اختیار فروش



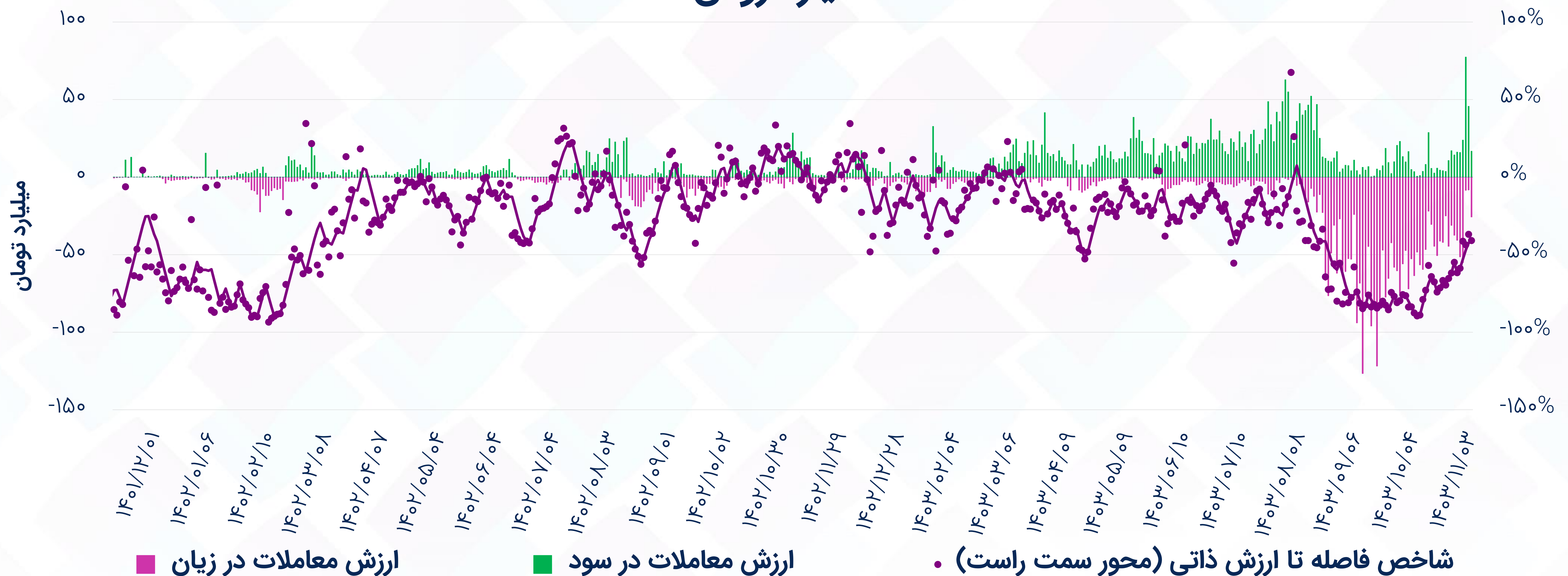
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

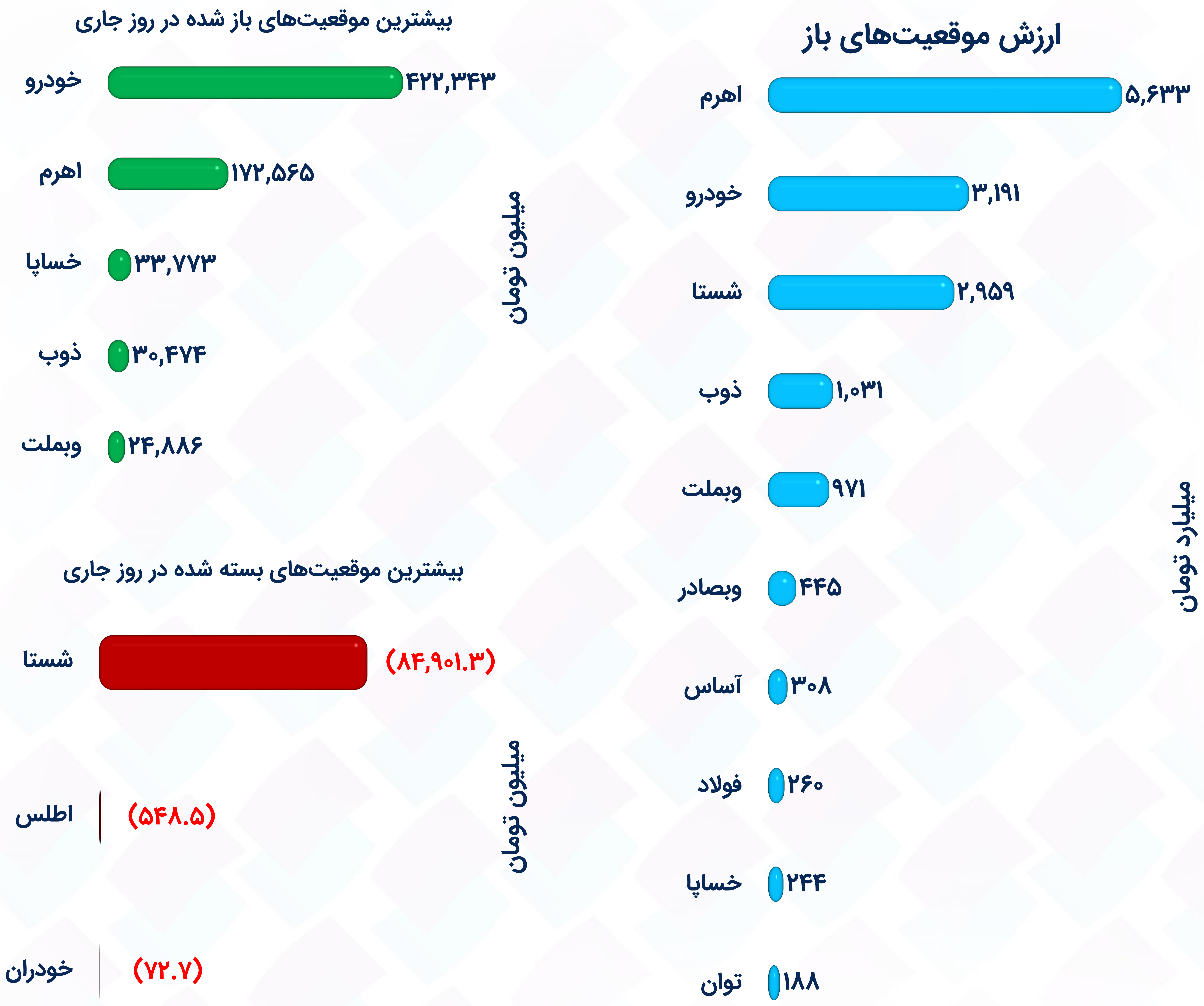
اختیار خرید

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
خودرو	۴۰	۱۵۸.۷	۳,۱۱۱.۶	۱۳۸.۷	۱۹.۹	۱۱.۸%
اهرم	۲۶	۱۱۶.۲	۱,۵۵۸.۹	۱۰۰.۵	۱۵.۷	(۴۰.۲%)
شستا	۴۱	۲۹.۳	۶۵۲.۵	۲۱.۸	۷.۵	(۱۸.۰%)
ذوب	۲۲	۸.۱	۹۸.۹	۷.۱	۱.۰	(۳۱.۲%)
وبملت	۱۷	۵.۵	۹۲.۵	۴.۴	۱.۱	(۲۱.۹%)
خسپا	۱۲	۳.۸	۶۱.۷	۳.۲	۰.۷	(۲۴.۵%)
توان	۱۳	۲.۶	۶.۳	۲.۶	۰.۰	(۵.۱%)

اختیار فروش

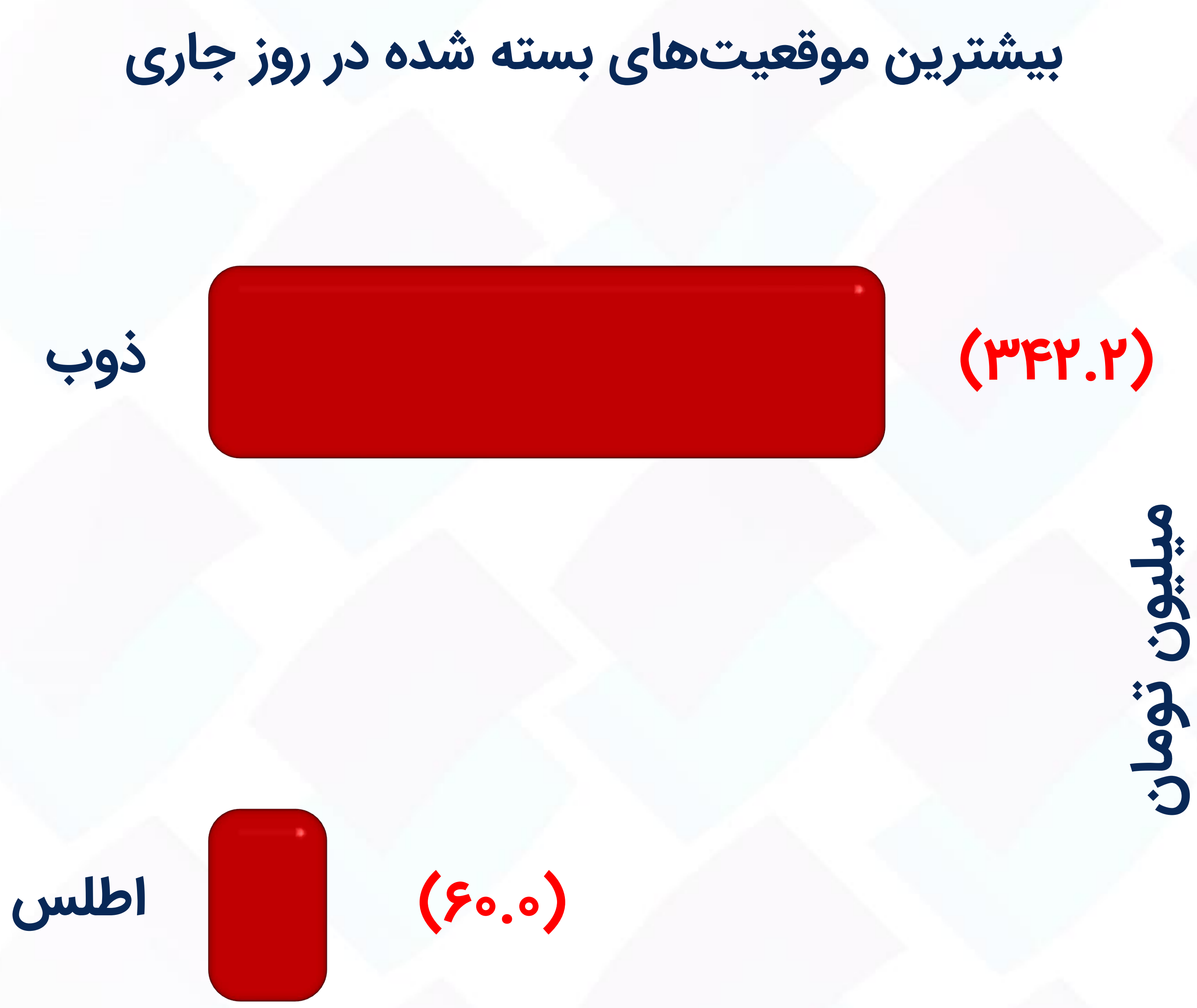
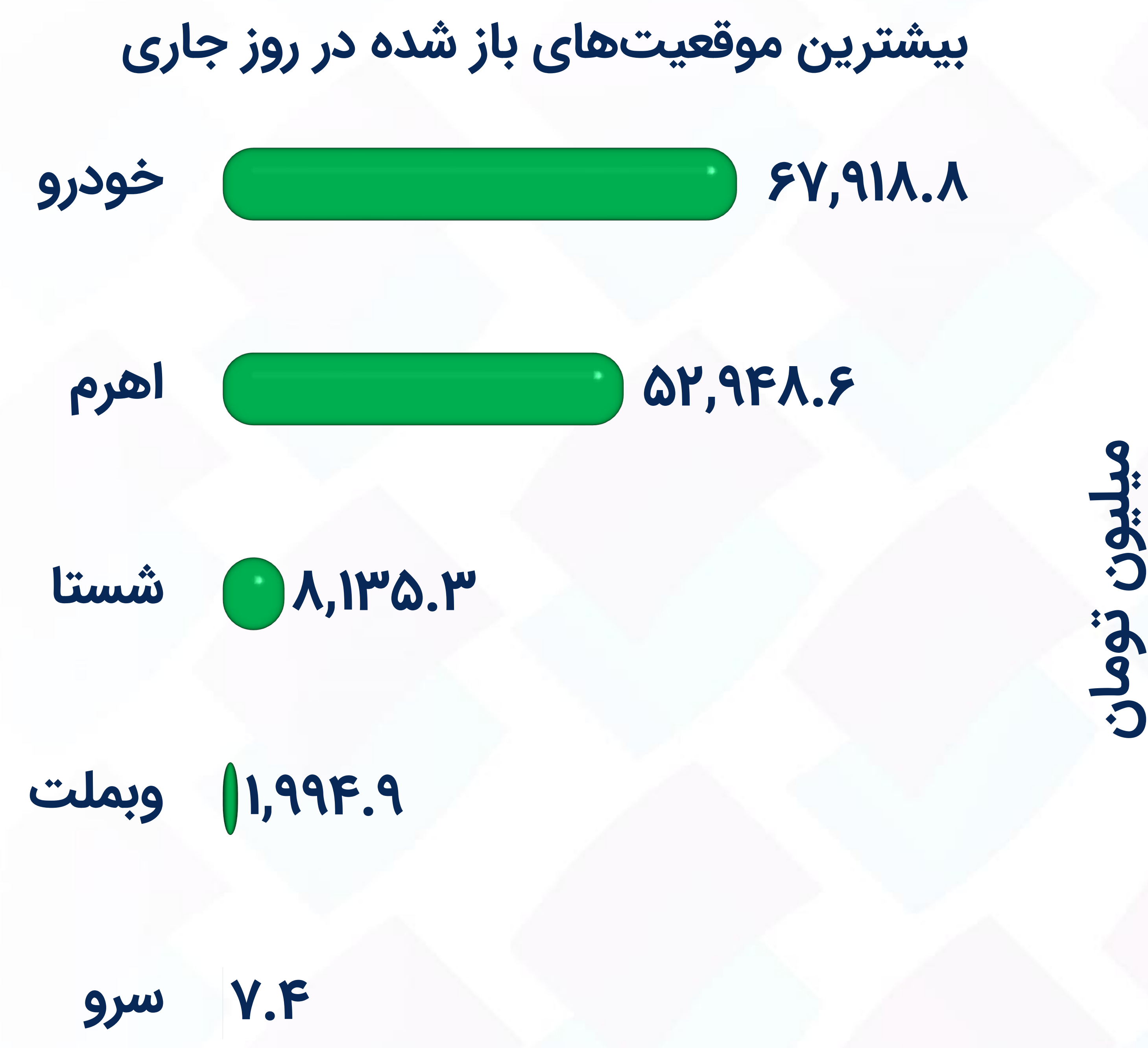
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۱۲	۳۰,۴۹۶.۳	۹۱۴,۳۵۳.۴	۸,۸۷۲.۱	۲۱,۶۲۴.۲	(۳۶.۶%)
خودرو	۱۰	۸,۷۸۸.۳	۵۱۱,۸۱۱.۲	۷,۰۳۴.۲	۱,۷۵۴.۲	(۴۴.۹%)
شستا	۱۴	۳,۰۵۹.۵	۲۷۵,۲۶۸.۸	۸۱۳.۸	۲,۲۴۵.۶	(۷۱.۲%)
ذوب	۳	۵۰.۹	۲,۳۲۸.۴	۰.۱	۵۰.۷	(۵۹.۵%)
وبملت	۳	۳۶.۹	۳,۵۰۹.۵	۰.۰	۳۶.۹	(۸۵.۰%)
اطلس	۱	۰.۳	۷۴.۲	۰.۰	۰.۳	(۵۰.۶%)
توان	۱	۰.۲	۲.۵	۰.۲	۰.۰	(۴۶.۶%)

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



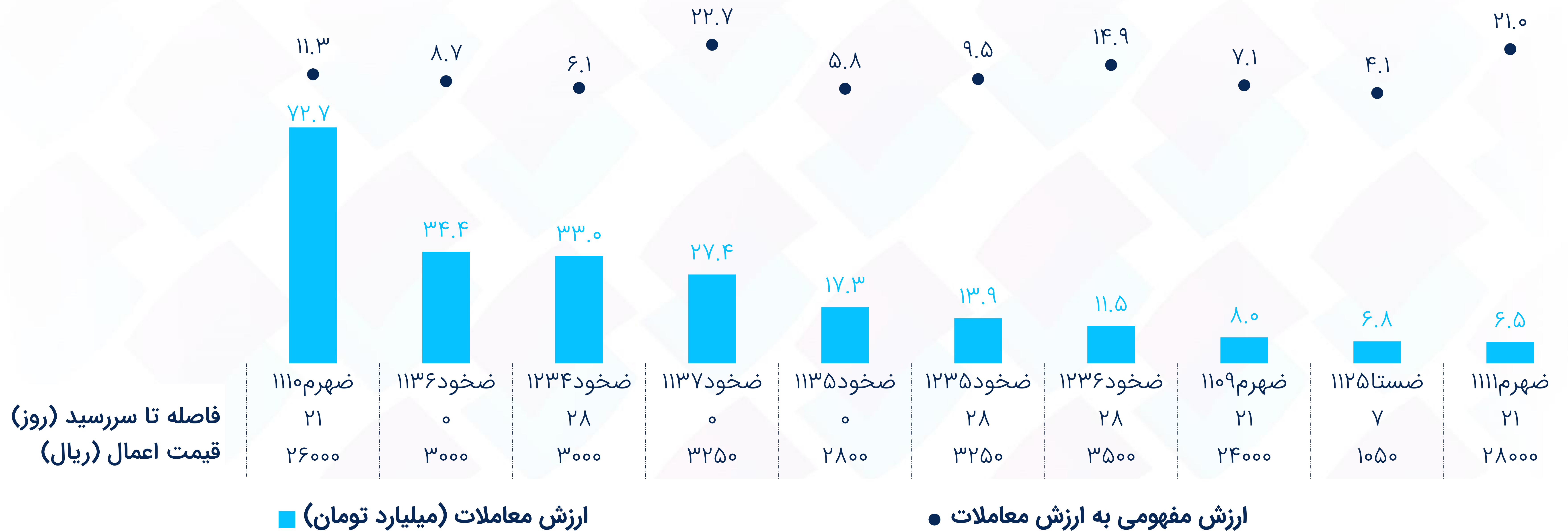
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

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
ضتاب ۱۱۱۱	شتاب	۱۴,۰۰۰	۱۴	۲۳۲.۲	۷۵۴	۱۴,۶۷۰	۱۴,۷۵۴	۰.۶%	۱۹.۶	۰.۸۱	۹۷۷	۳۰%
ضکرومیت ۲۰۰	کرومیت	۷,۵۰۰	۱۰۹	۱۲.۷	۱,۵۶۲	۸,۵۶۰	۹,۰۶۲	۵.۹%	۵.۸	۰.۸۵	۱,۹۱۶	۲۳%
ضفزر ۱۲۰۶	فزر	۴۰,۰۰۰	۳۹	۱.۳	۳,۲۰۰	۴۲,۰۰۰	۴۳,۲۰۰	۲.۹%	۱۳.۵	۰.۸۱	۳,۸۶۴	۲۱%
ضفزر ۱۲۰۸	فزر	۴۴,۰۰۰	۳۹	۸۱.۴	۱,۲۵۰	۴۲,۰۰۰	۴۵,۲۵۰	۷.۷%	۳۶.۲	۰.۴۸	۱,۵۰۱	۲۰%
ضاطلس ۱۱۰۷	اطلس	۶۰,۰۰۰	۴	۳۹.۲	۱,۸۹۵	۶۱,۷۱۲	۶۱,۸۹۵	۰.۳%	۳۲.۷	۰.۸۸	۲,۰۵۸	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
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۲۱	۸.۴	۲	۵۰۳	۱,۰۰۲	۹۹%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۲۱	۱.۱	۳	۵۰۳	۹۰۳	۸۰%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۲۱	۹.۵	۳	۵۰۳	۸۰۳	۶۰%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۷	۶۶.۷	۲	۱,۳۹۴	۱,۶۵۲	۱۹%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۲۸	۱۰۸.۶	۲۳	۳,۴۷۹	۵,۰۲۳	۴۴%	۲۱۸.۴	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	۲۱	۶۸.۴	۶,۵۷۴	۲۶,۳۳۰	۲۷,۴۲۶	۴.۲%	۴.۲	-۱.۰۰	۷,۰۳۴	۷.۰%
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۱	۶,۹۲۱.۰	۳,۳۴۹	۲۶,۳۳۰	۲۶,۶۵۱	۱.۲%	۸.۰	-۰.۹۰	۳,۲۱۲	(۴.۱%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۱	۱,۸۸۲.۴	۱,۹۱۲	۲۶,۳۳۰	۲۶,۰۸۸	(۰.۹%)	۱۳.۶	-۰.۶۸	۱,۵۹۶	(۱۶.۵%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۳,۷۵۰	۲۸	۱.۸	۳۵۱	۳,۴۷۹	۳,۳۹۹	(۲.۳%)	۹.۷	-۰.۶۹	۲۳۵	(۳۳.۱%)
طستا ۱۱۲۹	شستا	۱,۴۵۰	۷	۸۱۳.۸	۸۰	۱,۳۹۴	۱,۳۷۰	(۱.۷%)	۱۷.۱	-۰.۸۰	۵۲	(۳۵.۰%)

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 ۱۱۲۶	شستا	۱,۱۵۰	۷	۱.۱	۲	۱,۳۹۴	۱,۱۴۸	(۱۷.۶%)	۵۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۱	۲۹.۴	۴۴	۲۶,۳۳۰	۱۷,۹۵۶	(۳۱.۸%)	۴۰۸.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۱	۱۰.۶	۵۹	۲۶,۳۳۰	۱۹,۹۴۱	(۲۴.۳%)	۳۳۸.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طستا ۱۱۲۷	شستا	۱,۲۵۰	۷	۳۰۹.۵	۳	۱,۳۹۴	۱,۲۴۷	(۱۰.۵%)	۴۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۵%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۲۱	۸.۶	۳	۵۰۳	۳۹۷	(۲۱.۱%)	۱۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۲%)

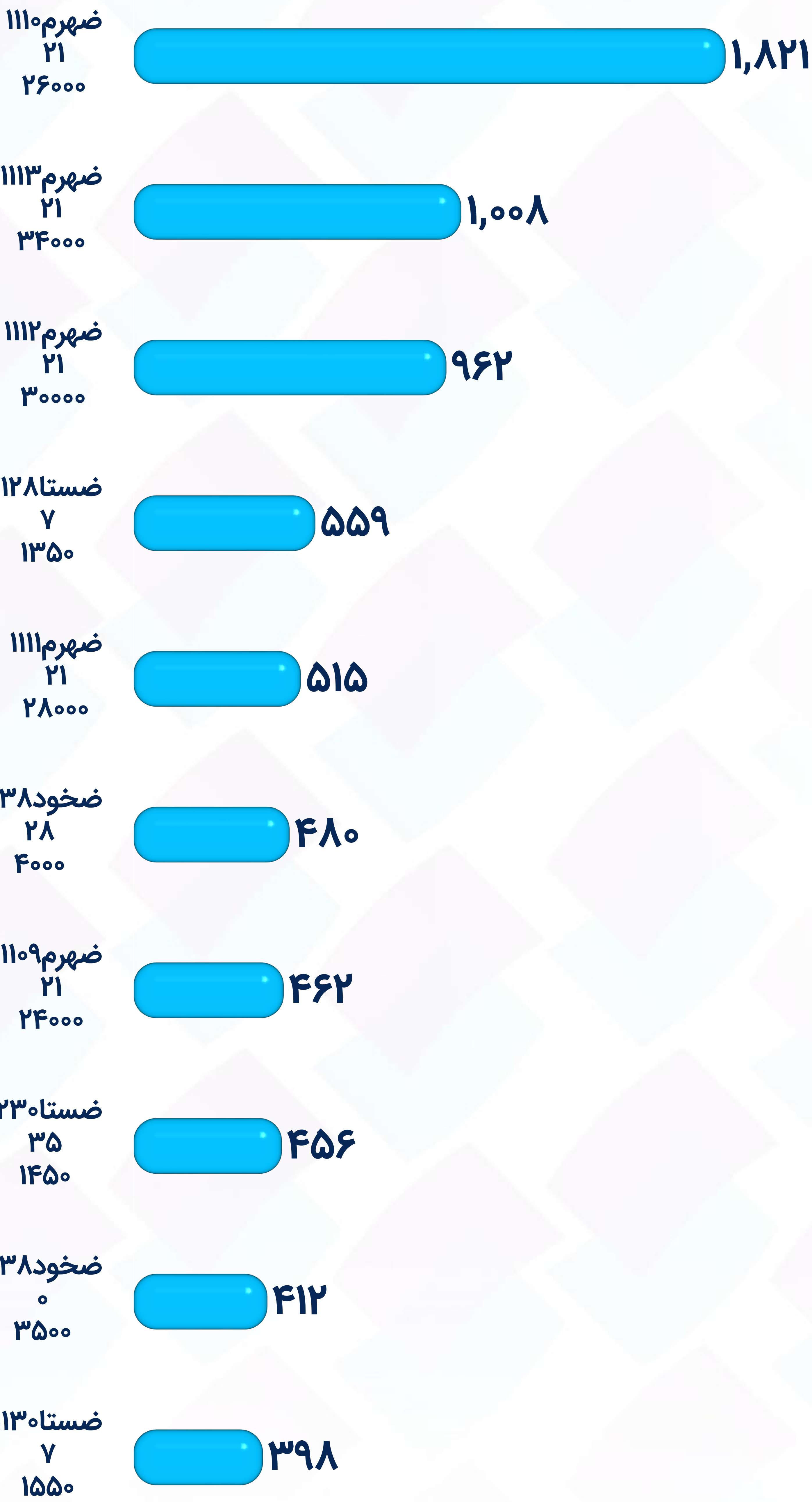
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

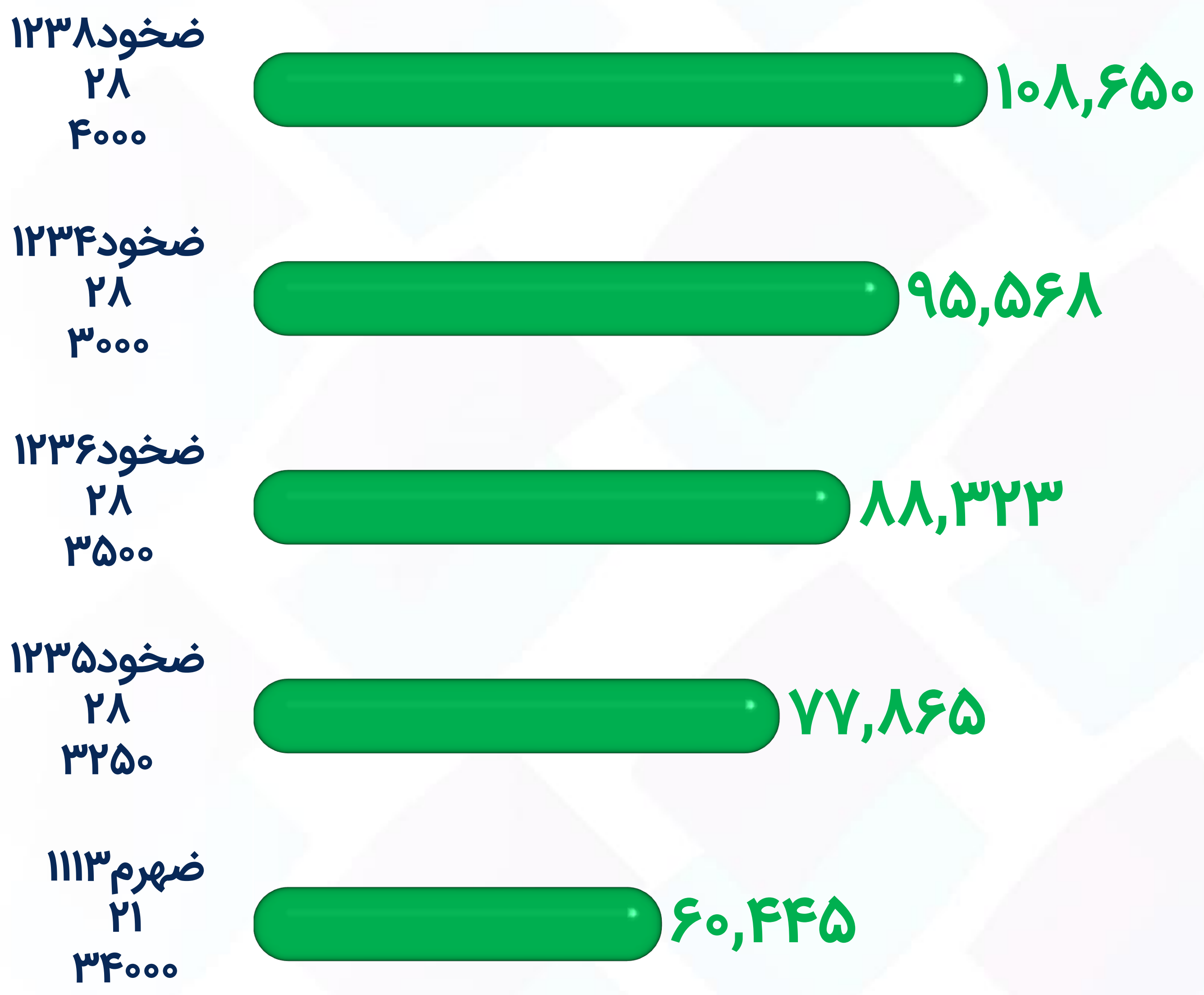
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

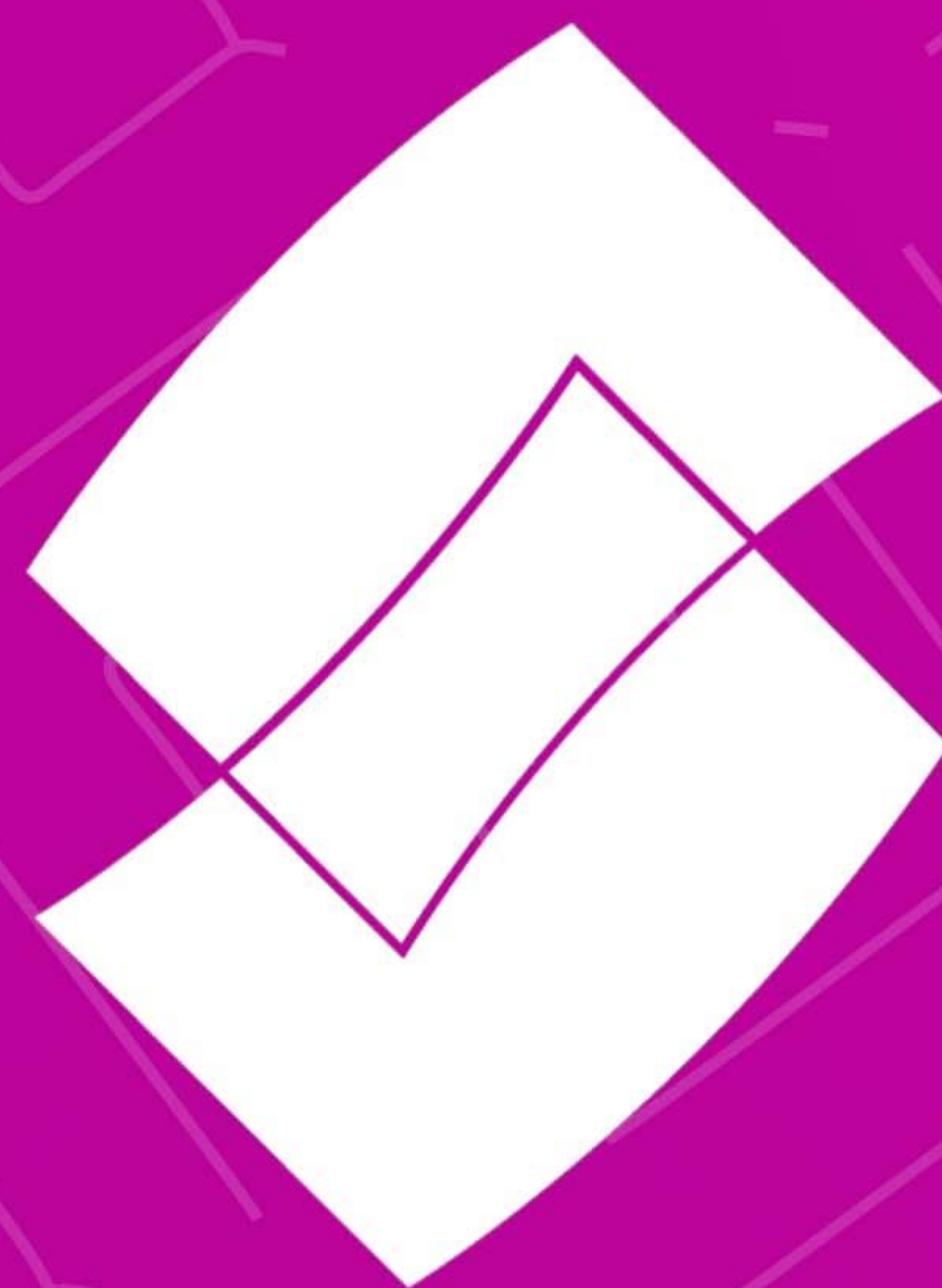
اختیار خرید



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.