

شماره
۴۱۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

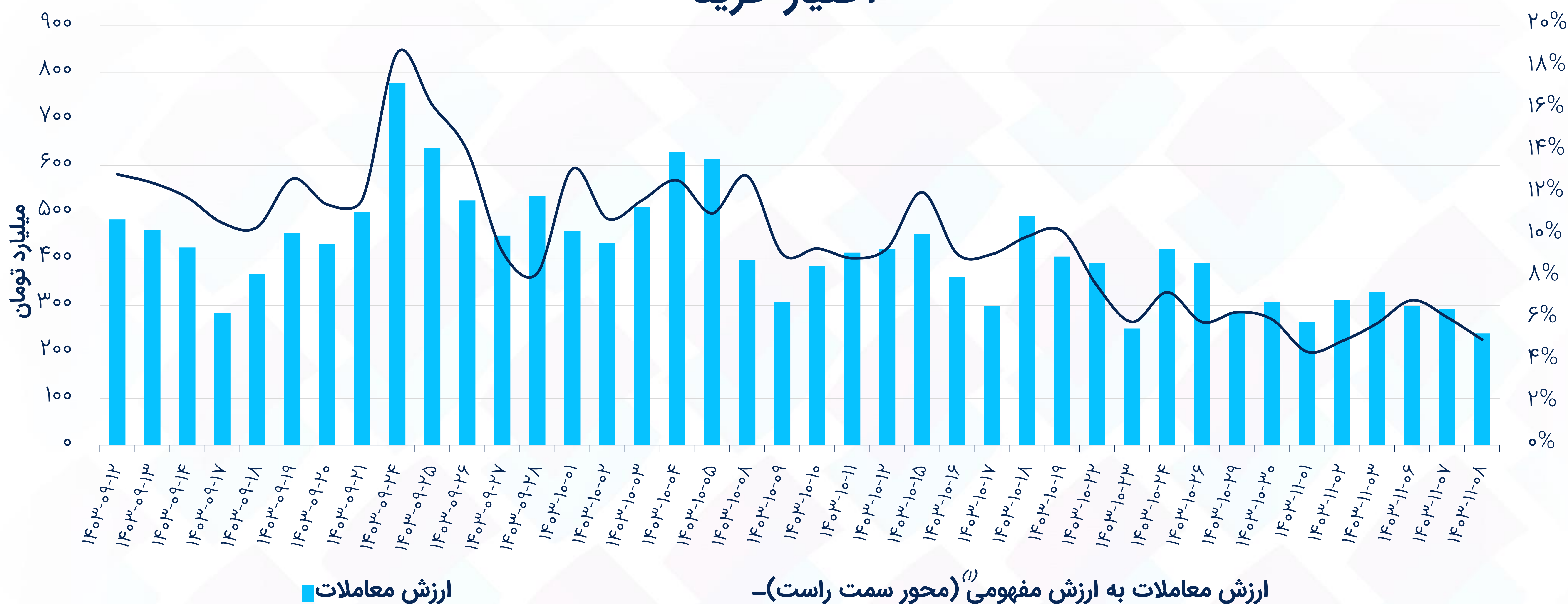




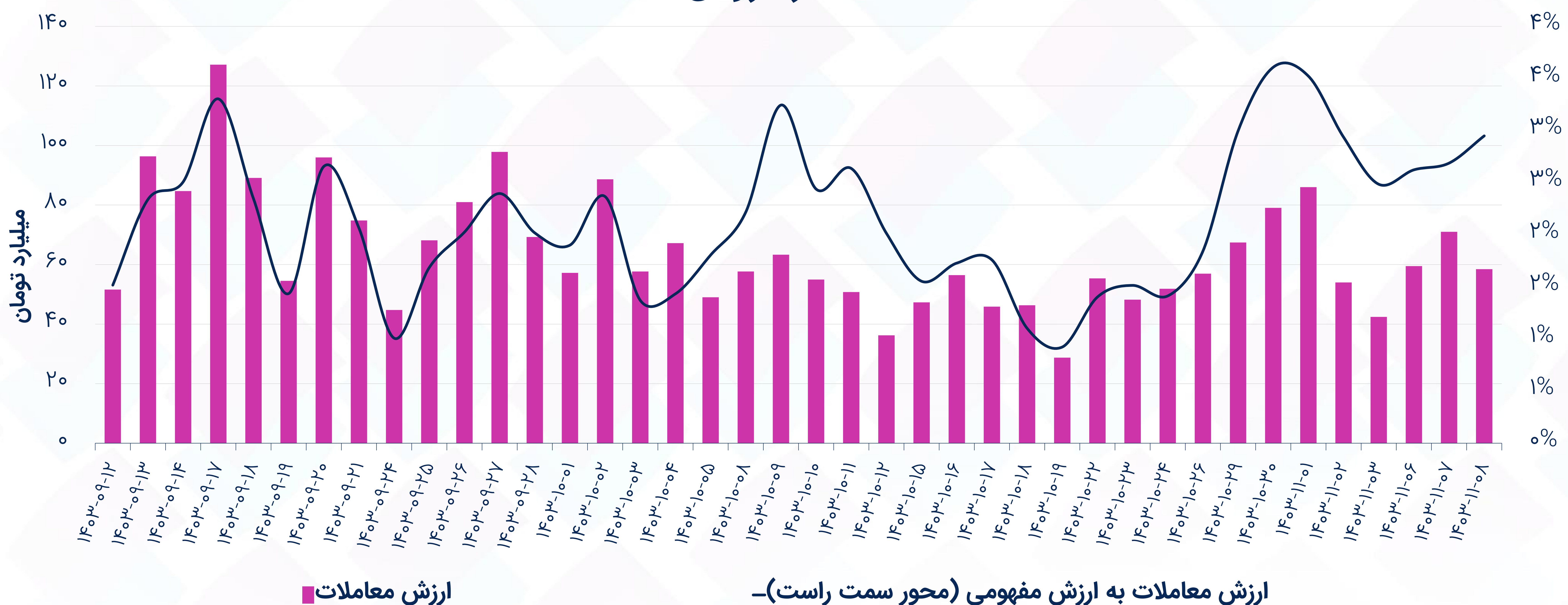
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



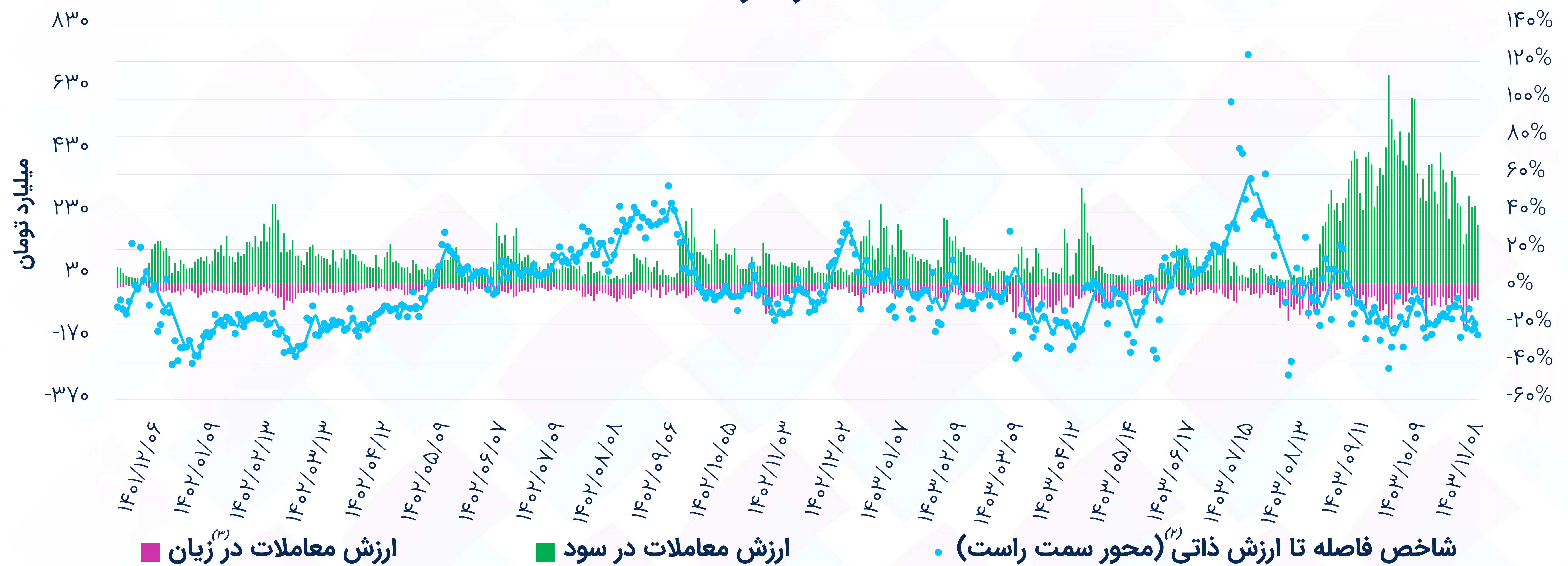
اختیار فروش



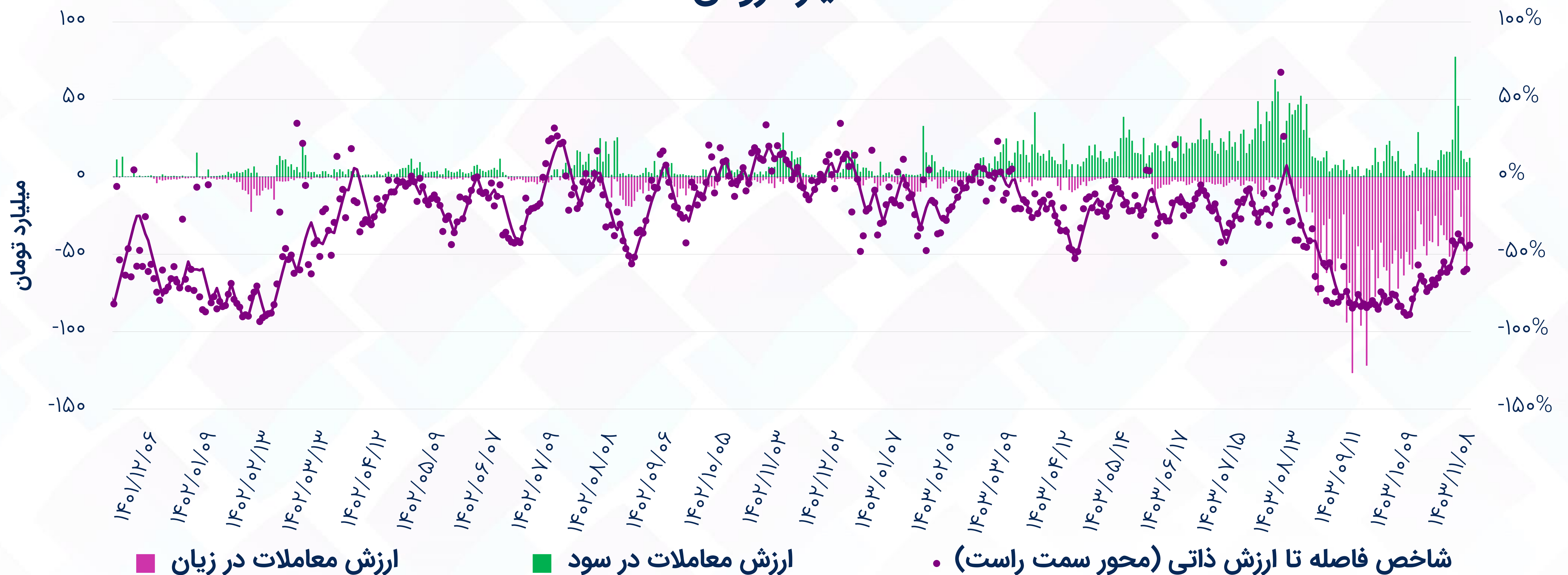
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

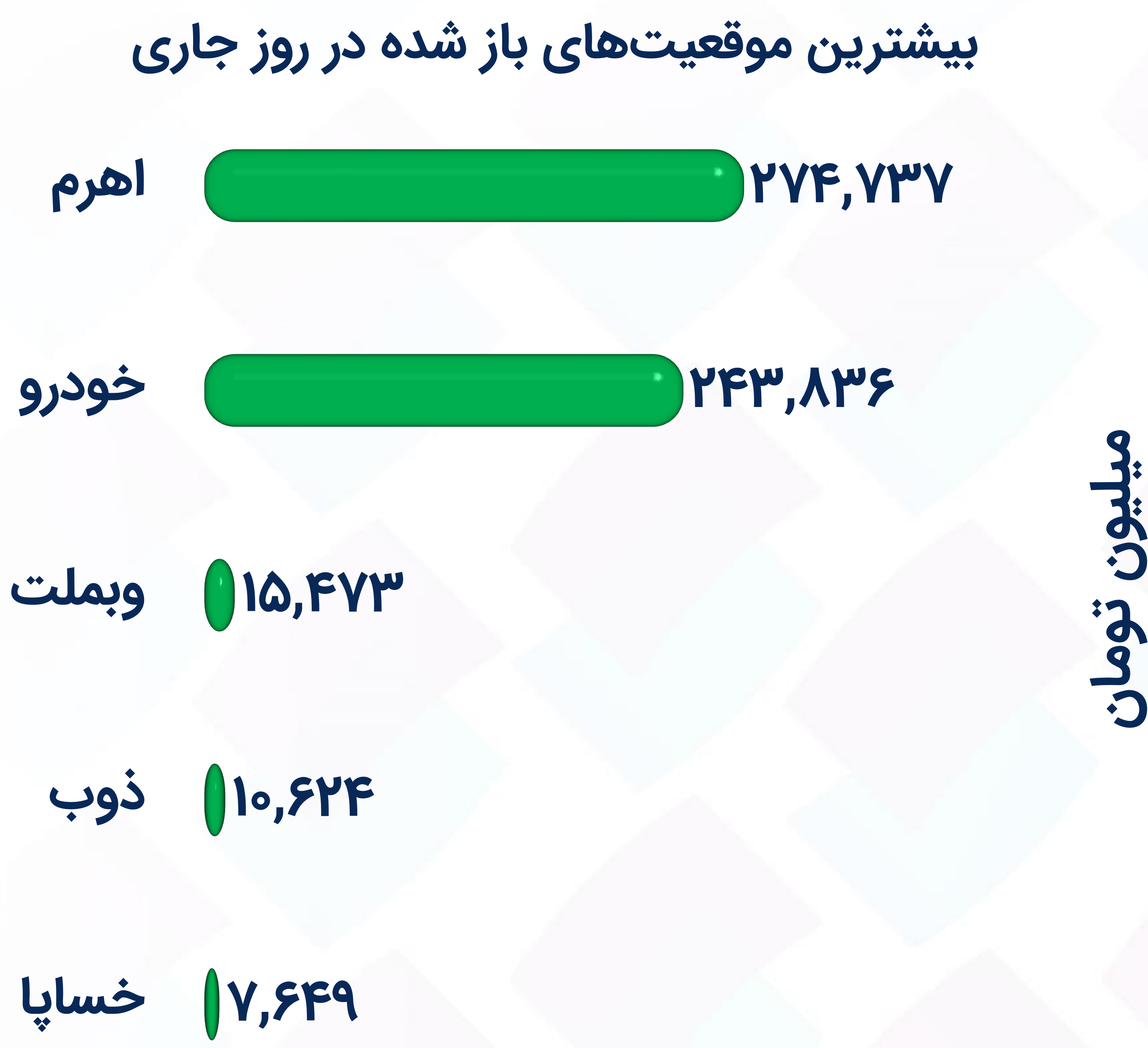
اختیار خرید

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	۳۲	۱۲۳.۴	۲,۳۹۲.۶	۱۱۰.۴	۱۳.۰	(۳۵.۴%)
خودرو	۲۳	۵۷.۴	۱,۰۸۱.۱	۲۹.۵	۲۷.۹	(۲۶.۷%)
شستا	۴۴	۳۹.۹	۱,۰۲۰.۰	۳۲.۶	۷.۳	۰.۴%
ذوب	۲۵	۷.۱	۱۱۰.۴	۵.۰	۲.۱	(۱۶.۵%)
خسپا	۱۳	۳.۰	۳۹.۴	۲.۶	۰.۴	(۱۶.۳%)
توان	۱۵	۲.۹	۱۰.۶	۲.۹	۰.۰	(۱.۷%)
وبملت	۱۹	۲.۴	۷۷.۵	۱.۶	۰.۸	(۲۵.۶%)

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	۴۵,۵۶۷.۲	۱,۲۱۹,۵۴۵.۰	۶,۲۲۳.۲	۳۹,۳۴۴.۰	(۴۱.۹%)
خودرو	۴	۱۰,۲۰۳.۵	۵۵۲,۶۷۴.۷	۴,۶۲۴.۴	۵,۵۷۹.۱	(۵۶.۲%)
شستا	۱۷	۲,۵۹۳.۴	۲۰۲,۹۵۳.۷	۱,۲۰۵.۵	۱,۳۸۷.۹	(۳۶.۲%)
ذوب	۵	۶۷.۳	۴,۰۵۱.۹	۵۴.۸	۱۲.۵	(۳۸.۷%)
وبملت	۳	۲۹.۰	۲,۸۵۰.۵	۱۲.۸	۱۶.۲	(۶۱.۵%)
شپنا	۱	۰.۳	۹۳.۳	۰.۰	۰.۳	(۱۰۰.۰%)
رویین	۱	۰.۲	۶.۴	۰.۰	۰.۲	(۸۷.۷%)

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



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

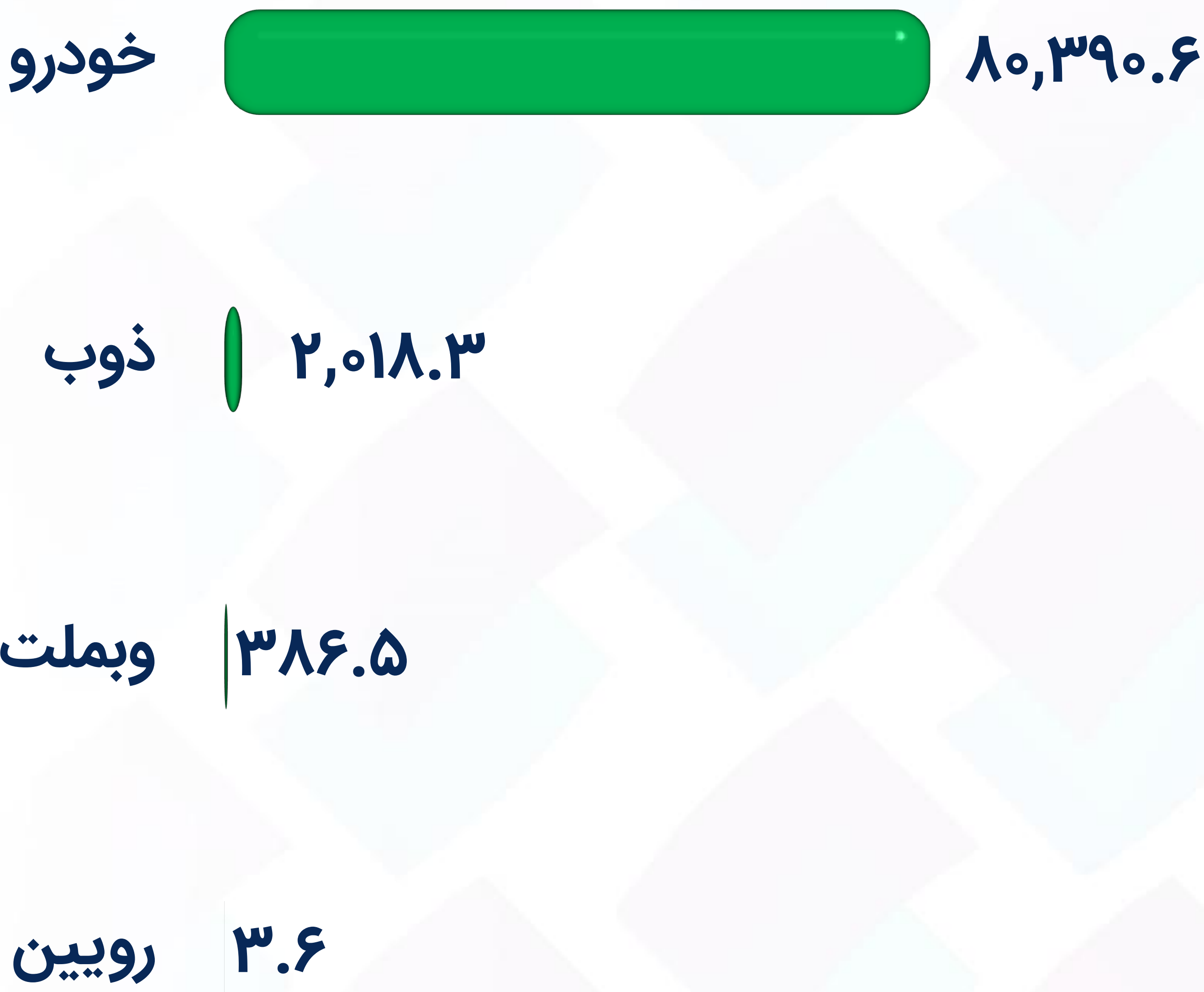
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



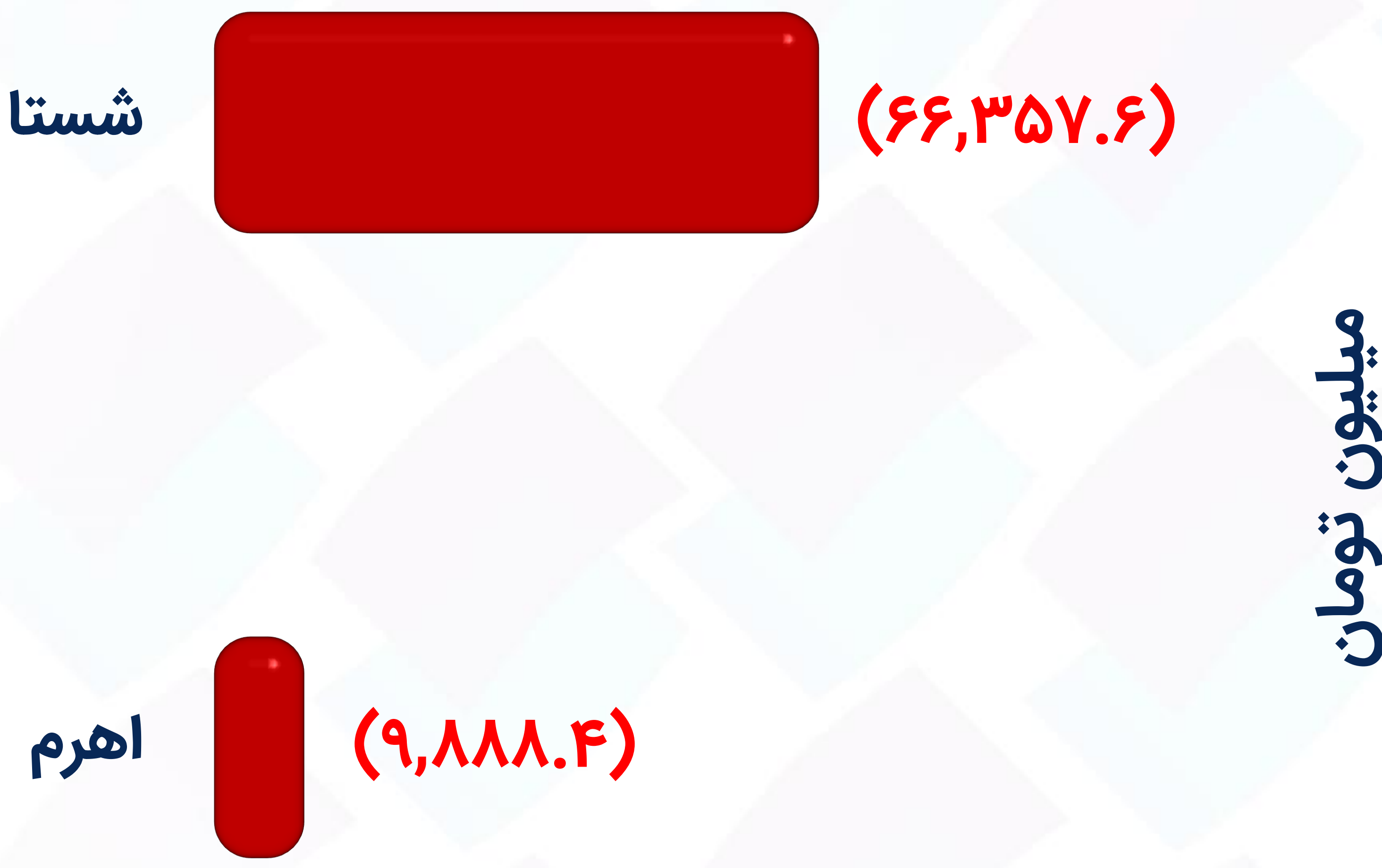
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون 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
ضفر ۲۰	فزر	۲۸,۰۰۰	۹۷	۳.۱	۵,۱۸۷	۴۲,۱۰۰	۳۳,۱۸۷	(۲۱.۲%)	۶.۴	۱.۰۰	۱۶,۳۸۱	۲۱۶%
ضستا ۱۱۲۸	شستا	۱,۳۵۰	۲	۴,۲۵۰.۸	۱۸	۱,۳۶۹	۱,۳۶۸	(۰.۱%)	۷۶.۰	۰.۷۳	۳۱	۷۳%
ضستا ۱۱۲۷	شستا	۱,۲۵۰	۲	۳,۱۷۱.۴	۱۰۰	۱,۳۶۹	۱,۳۵۰	(۱.۴%)	۱۳.۵	۱.۰۰	۱۲۴	۲۴%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۹۰	۴۲.۲	۱,۷۰۵	۷,۱۲۰	۷,۱۱۸	(۰.۰%)	۴.۲	۱.۰۰	۲,۱۱۴	۲۴%
ضبساما ۲۱۶	بساما	۵,۸۲۹	۹۰	۱۵۶.۹	۱,۳۹۹	۷,۱۲۰	۷,۲۲۸	۱.۵%	۵.۲	۱.۰۰	۱,۷۳۰	۲۴%

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	۱۶	۲.۰	۱	۴۸۵	۱,۰۰۱	۱۰۶%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۱۶	۴.۸	۱	۴۸۵	۹۰۱	۸۶%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۲	۵.۰	۱	۱,۳۶۹	۱,۶۵۱	۲۱%	۱,۶۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۱۶	۱۵.۳	۲	۴۸۵	۸۰۲	۶۵%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۱۶	۲۳.۷	۲	۴۸۵	۷۰۲	۴۵%	۳۵۱.۰	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
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۶	۱۹.۶	۷,۵۲۳	۲۶,۰۴۰	۲۶,۴۷۷	۱.۷%	۳.۵	-۱.۰۰	۷,۴۰۶	(۱.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۶	۴,۲۵۷.۱	۳,۸۴۲	۲۶,۰۴۰	۲۶,۱۵۸	۰.۵%	۶.۸	-۰.۹۴	۳,۵۲۳	(۸.۳%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۱۶	۱.۷	۱۲۱	۴۸۵	۴۷۹	(۱.۲%)	۴.۰	-۰.۹۹	۱۰۵	(۱۳.۰%)
طستا ۱۱۲۹	شستا	۱,۴۵۰	۲	۱,۲۰۵.۵	۹۳	۱,۳۶۹	۱,۳۵۷	(۰.۹%)	۱۴.۶	-۰.۹۶	۷۶	(۱۸.۷%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۶	۱,۹۲۲.۶	۲,۲۷۷	۲۶,۰۴۰	۲۵,۷۲۳	(۱.۲%)	۱۱.۳	-۰.۷۵	۱,۷۹۹	(۲۱.۰%)

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 ۱۱۲۵	شستا	۱,۰۵۰	۲	۴.۰	۱	۱,۳۶۹	۱,۰۴۹	(۲۳.۴%)	۱,۰۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۶	۷.۸	۲۵	۲۶,۰۴۰	۱۷,۹۷۵	(۳۱.۰%)	۷۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۶	۲.۴	۳۳	۲۶,۰۴۰	۱۹,۹۶۷	(۲۳.۳%)	۶۰۵.۱	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طستا ۱۱۲۷	شستا	۱,۲۵۰	۲	۲۸.۰	۱	۱,۳۶۹	۱,۲۴۹	(۸.۸%)	۱,۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۳%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۱۶	۱۲.۴	۲	۴۸۵	۳۹۸	(۱۷.۹%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۴%)

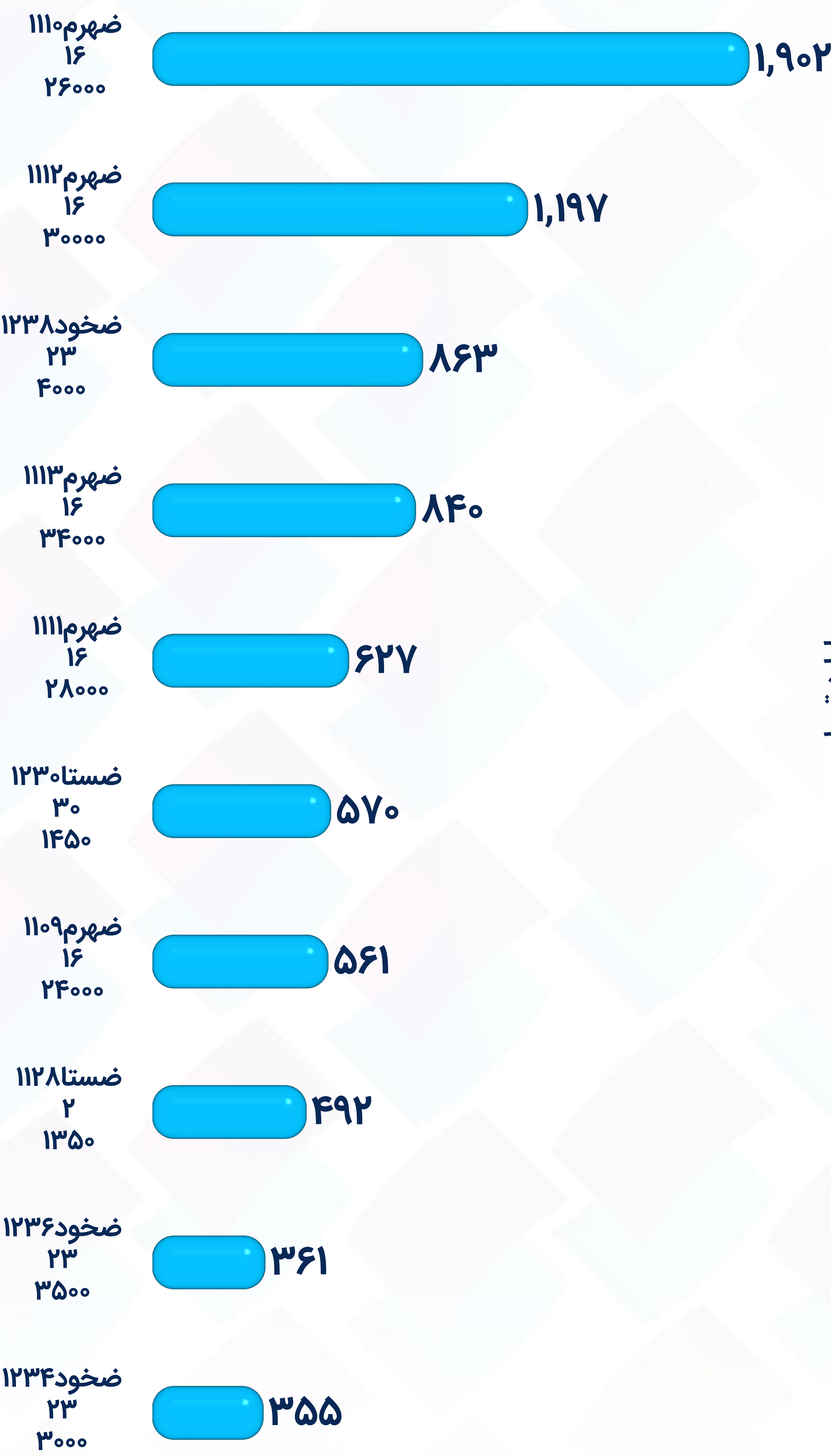
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

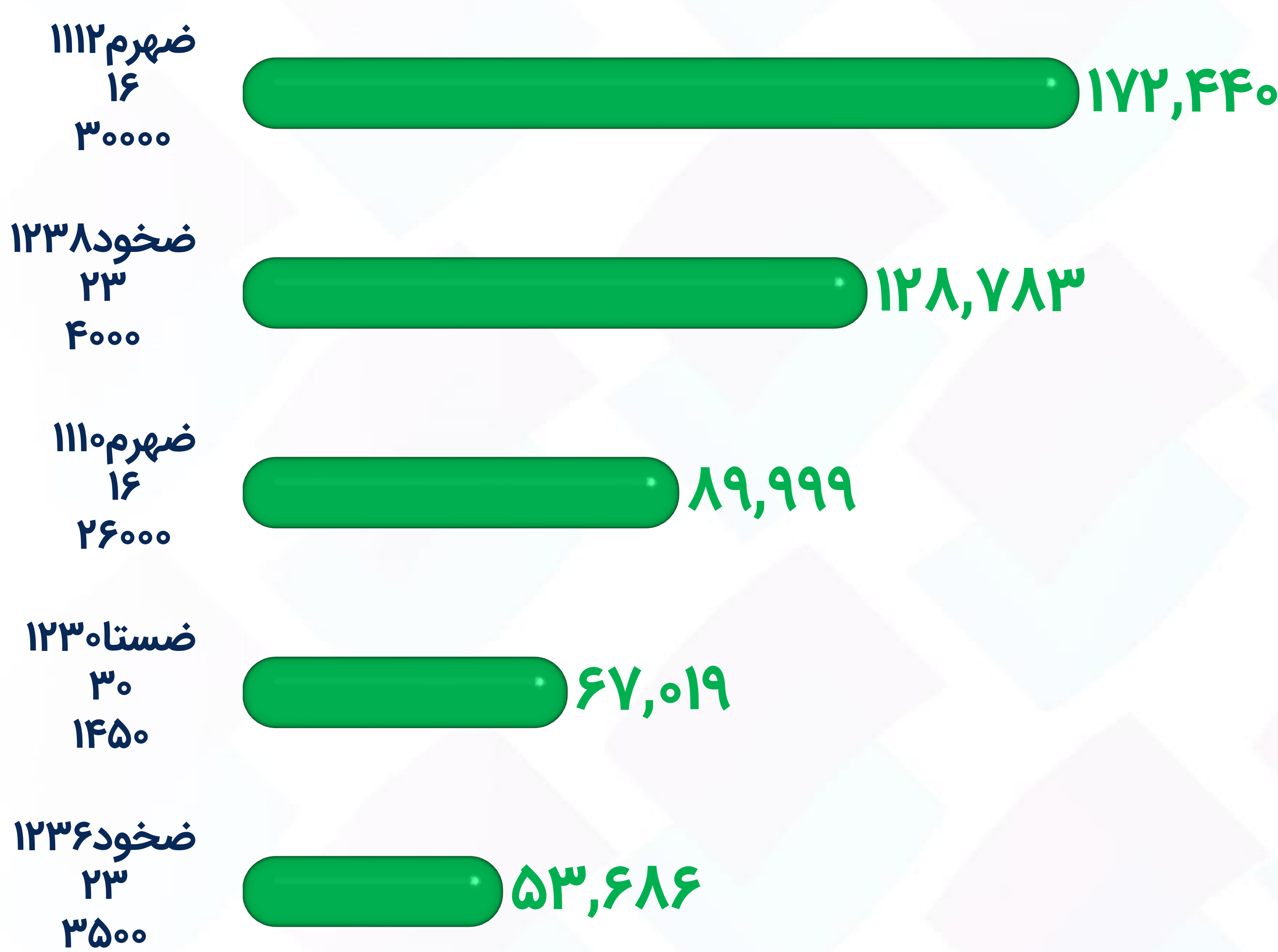
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

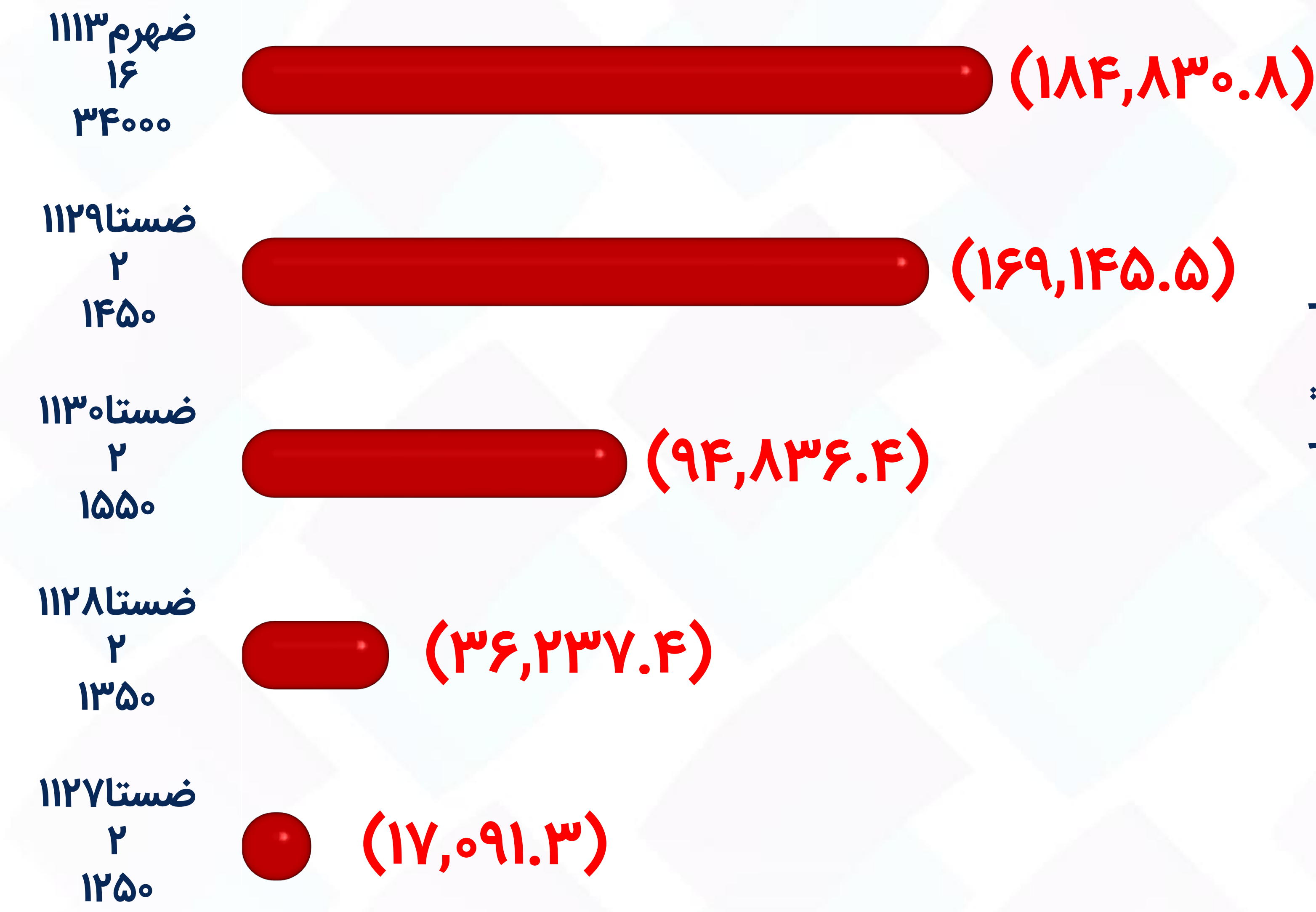
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

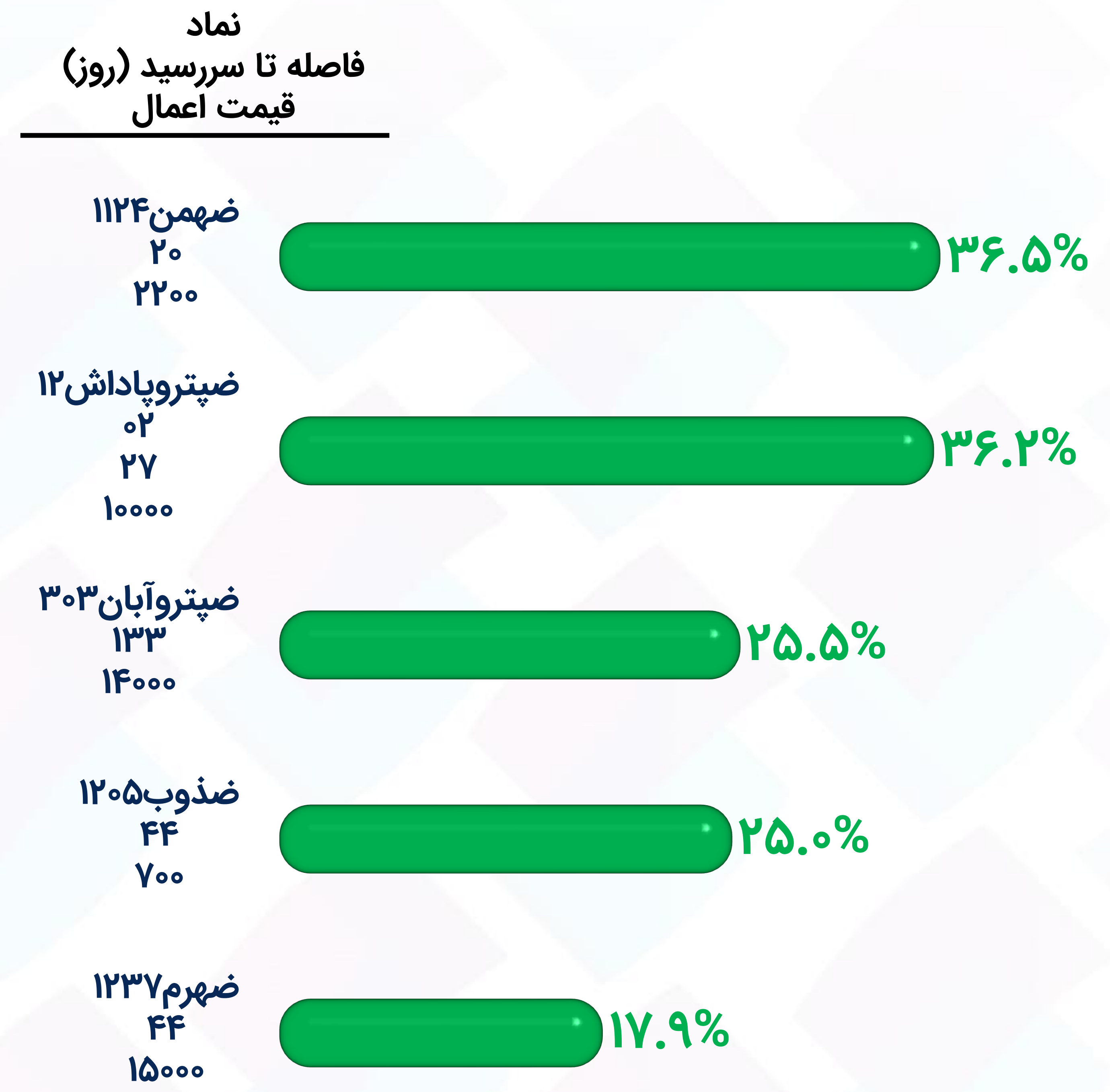
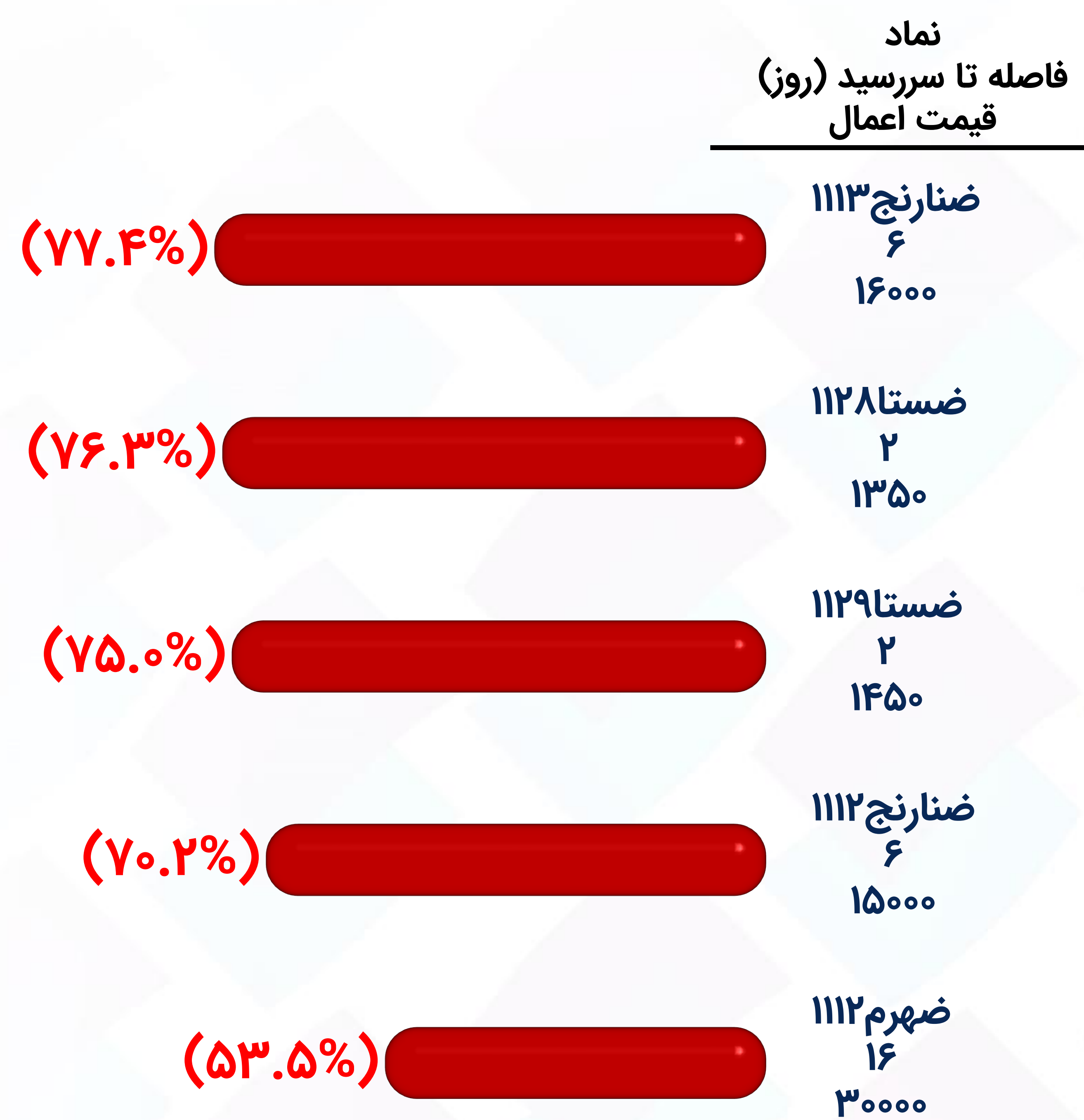
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



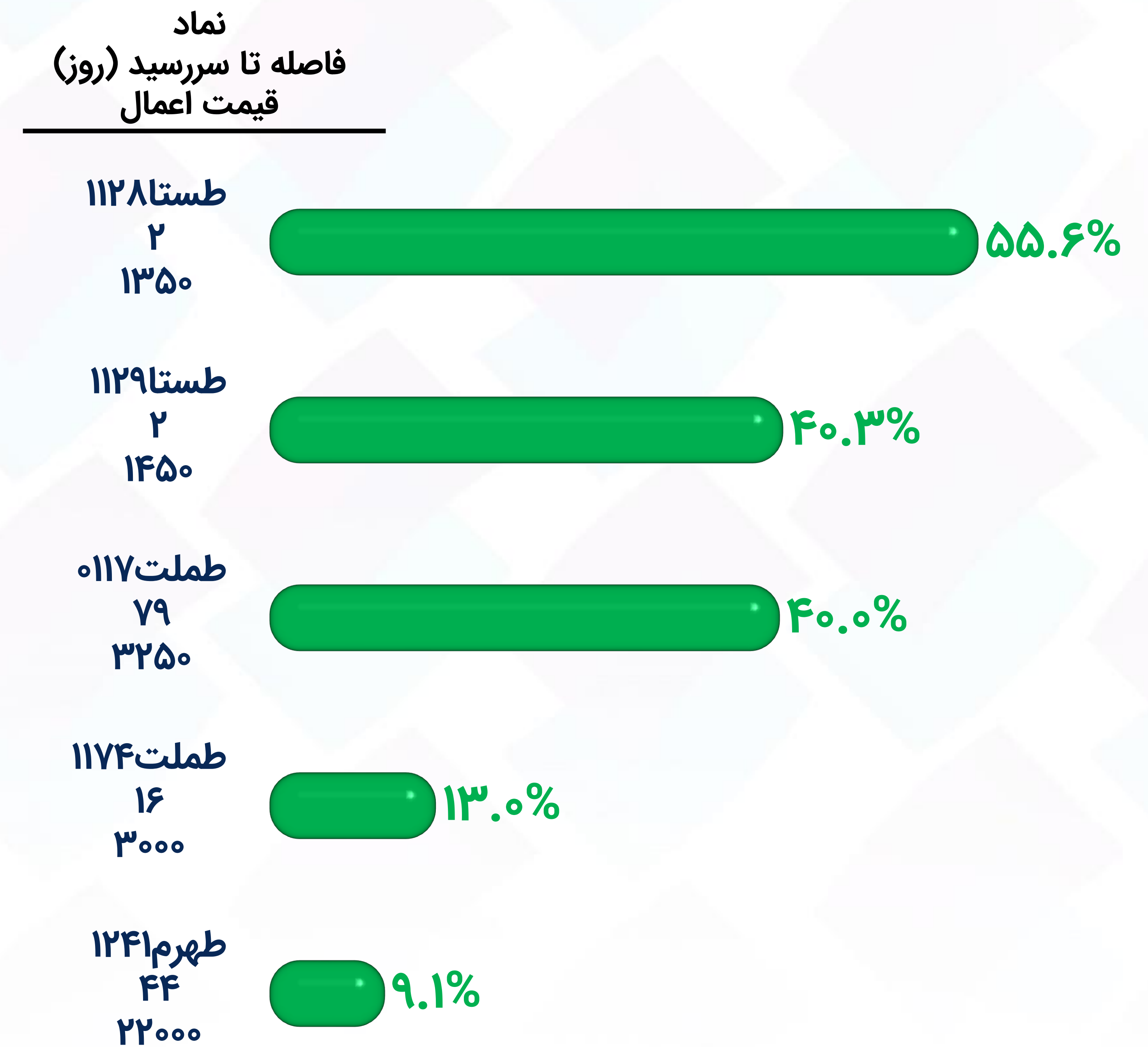
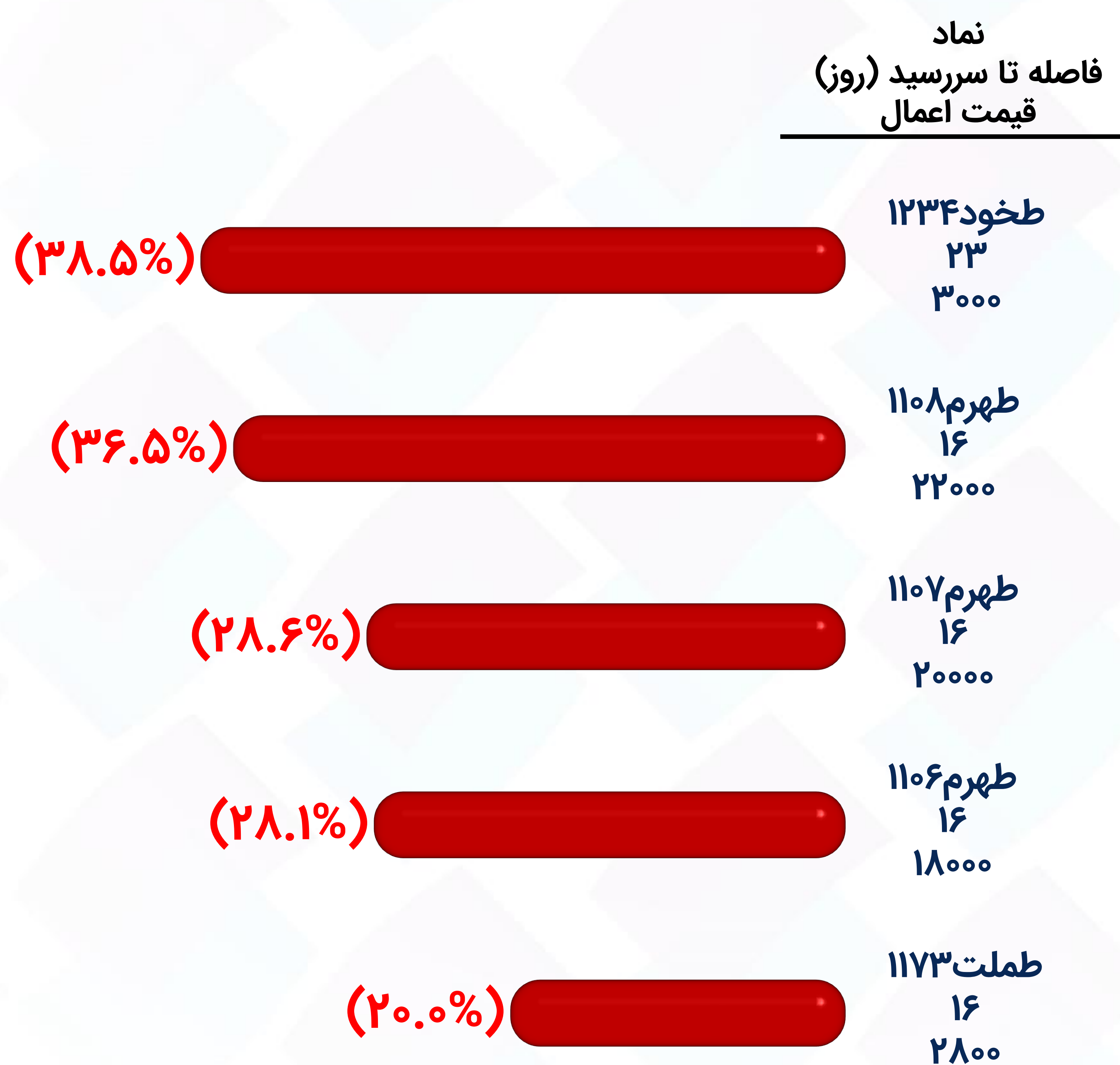
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

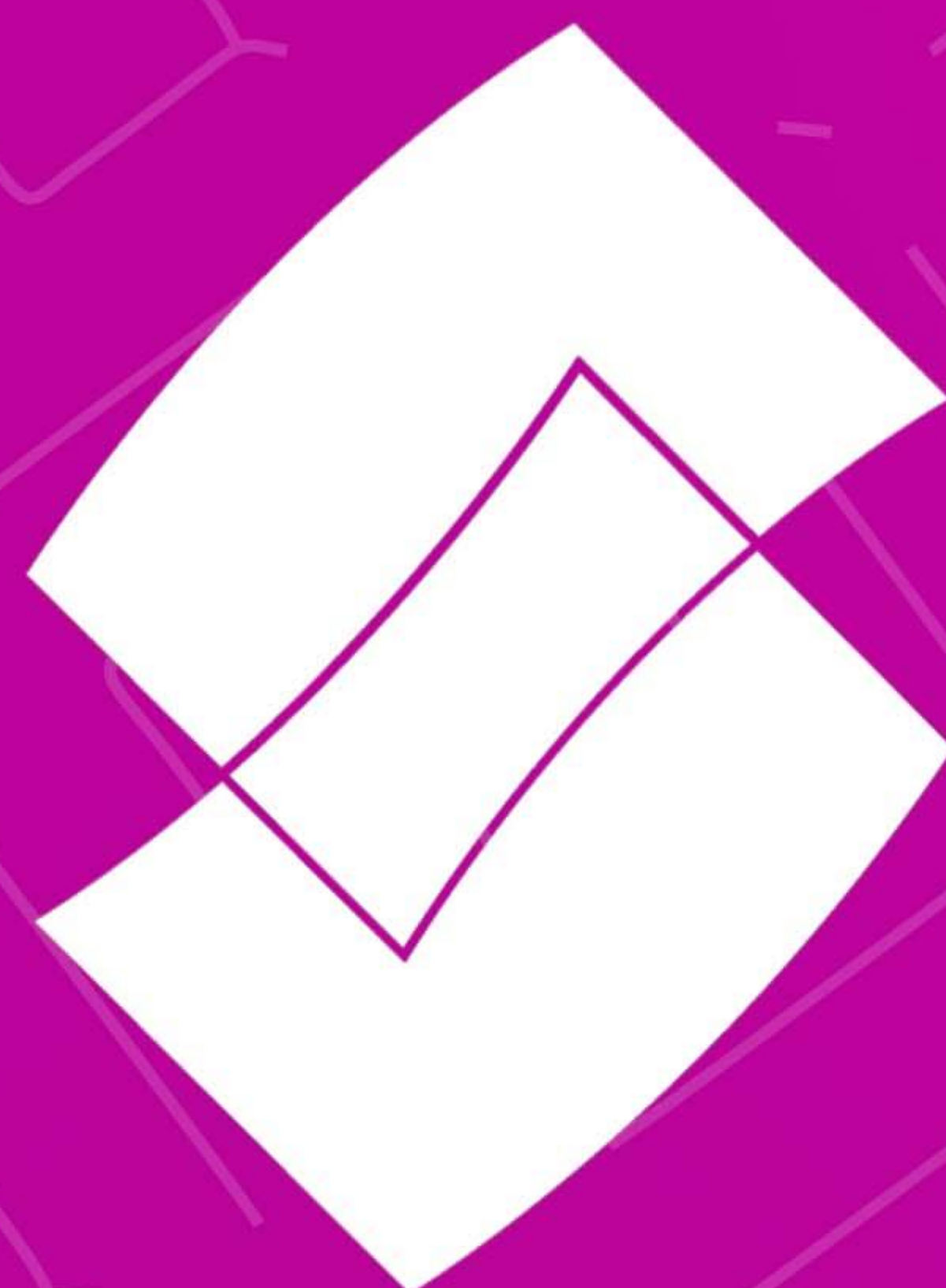
اختیار خرید



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.