

شماره
۴۱۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

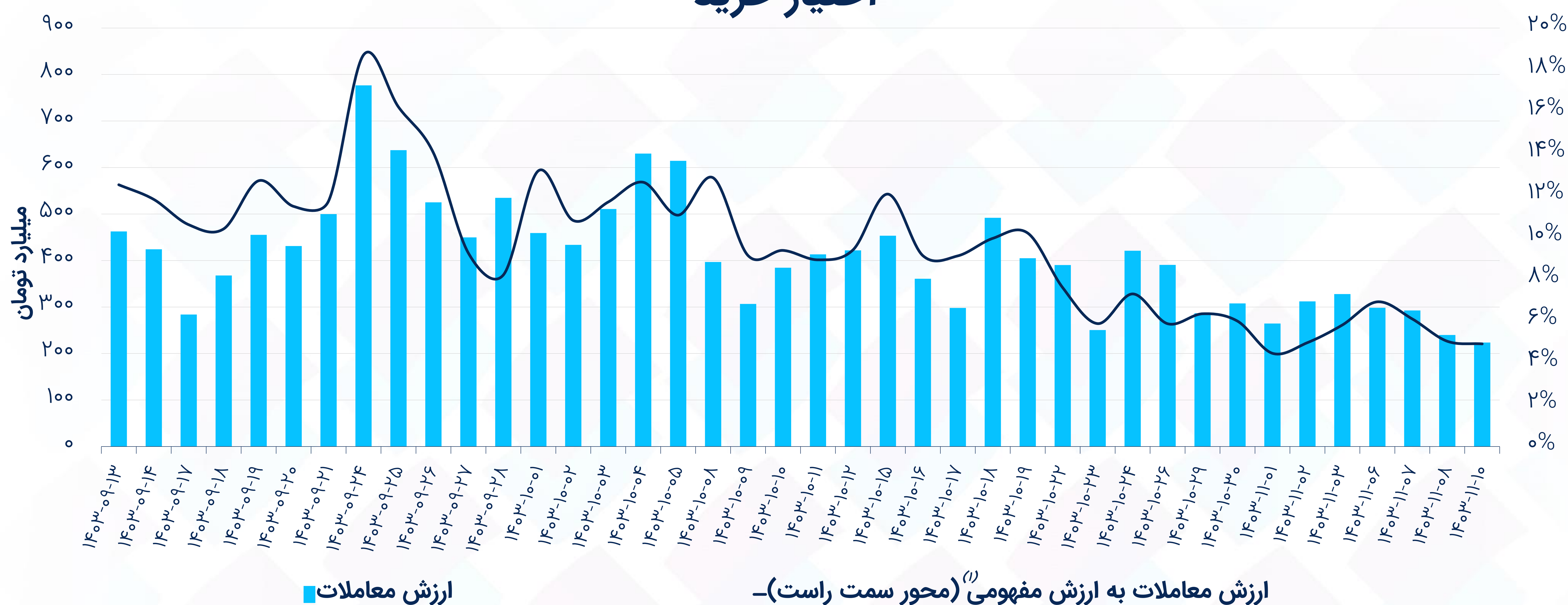




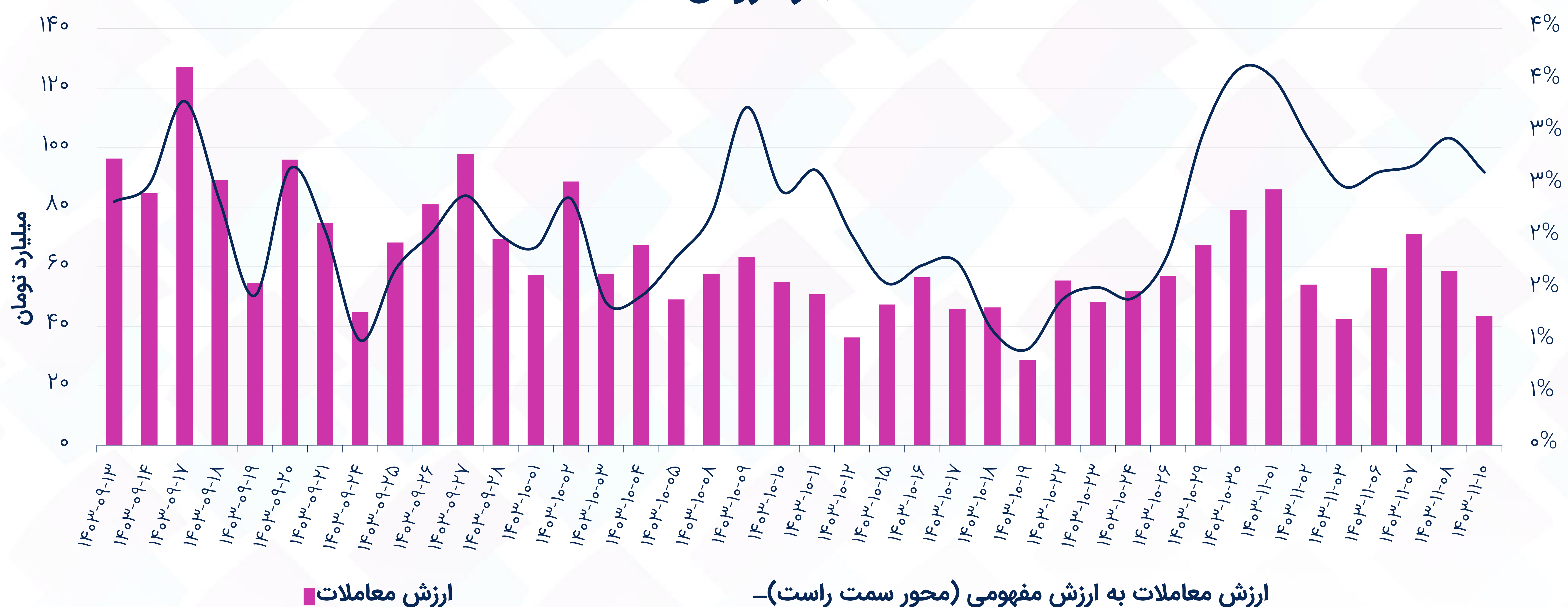
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



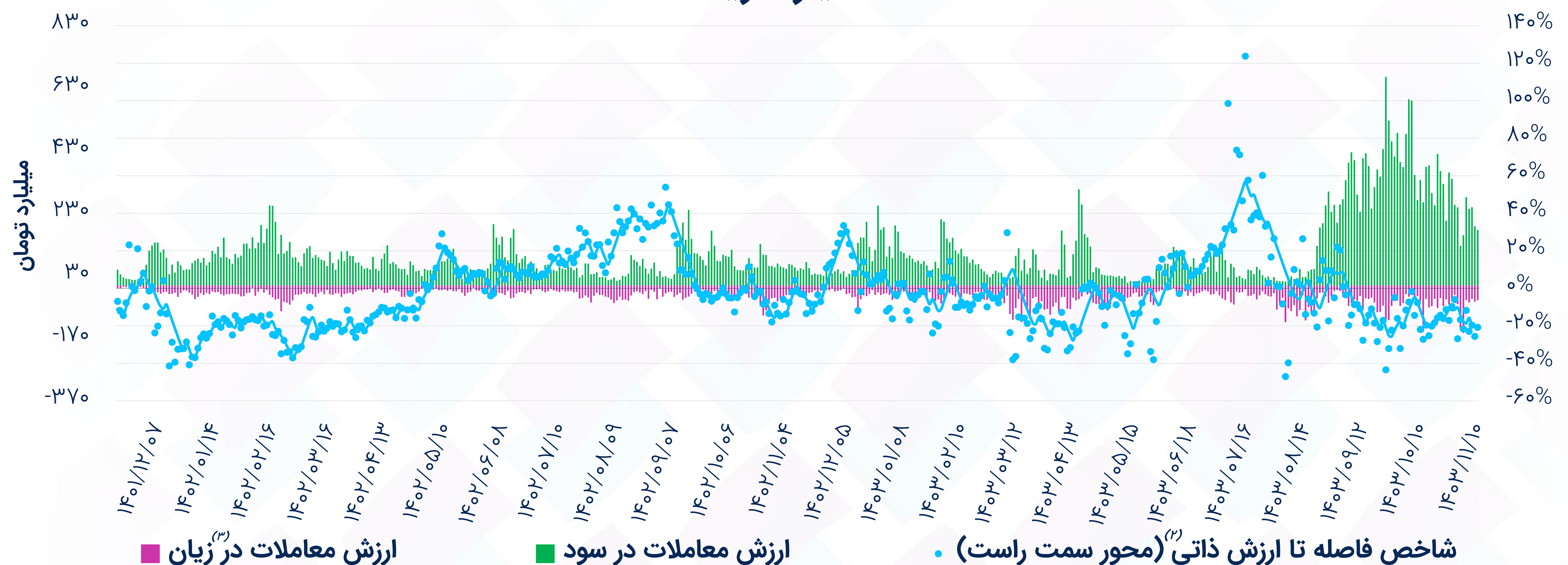
اختیار فروش



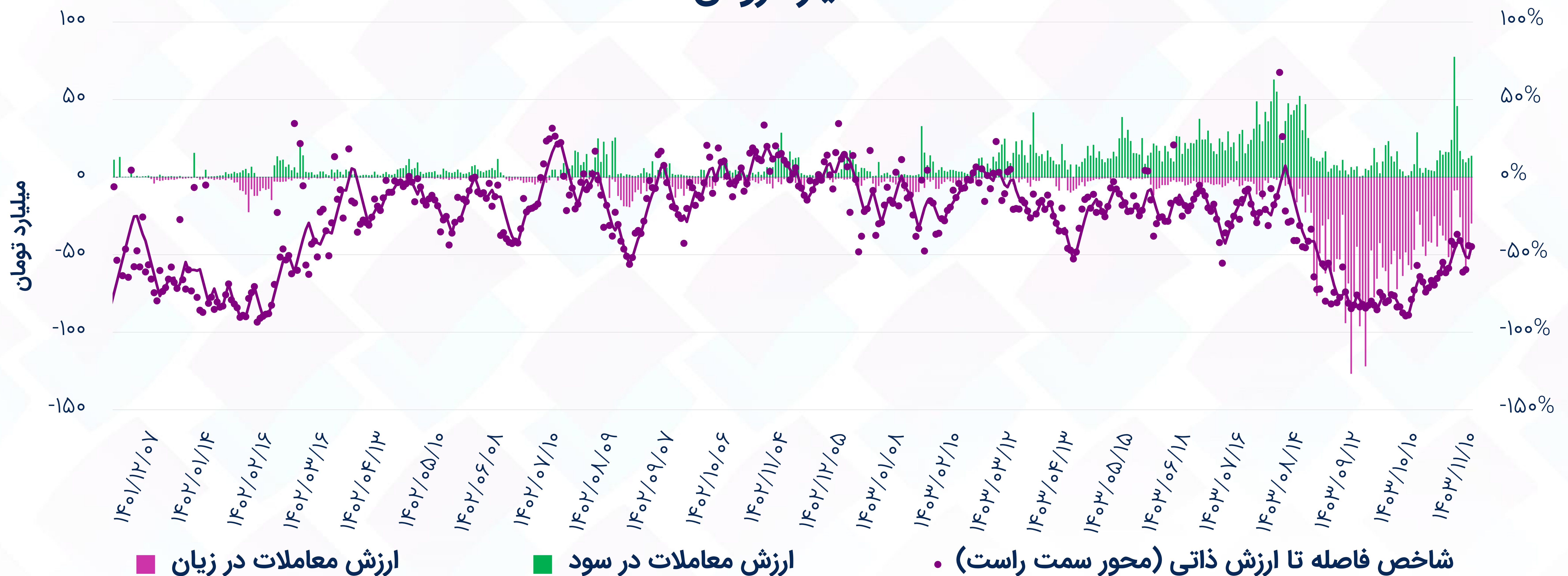
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

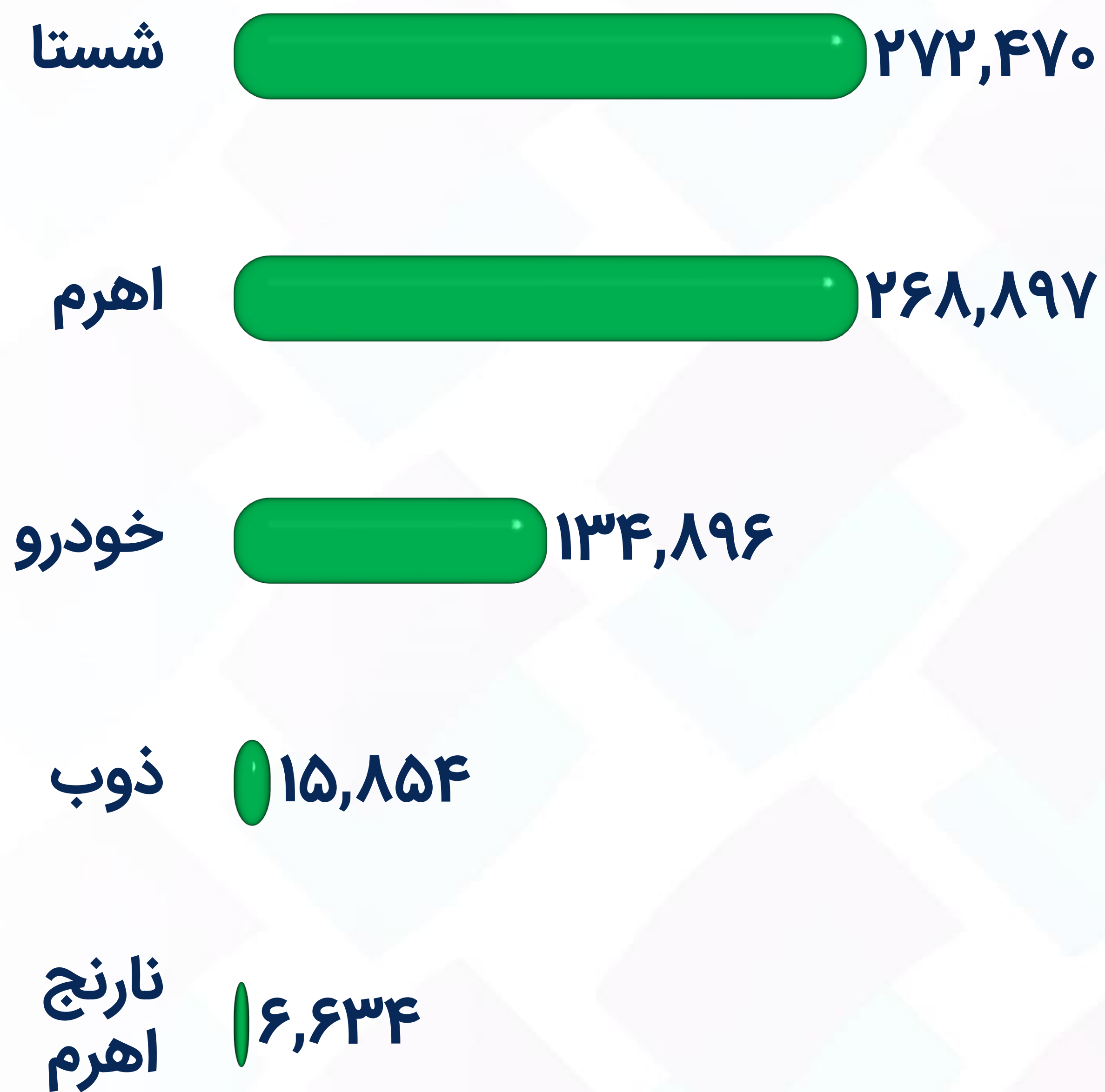
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۳۳	۱۰۳.۲	۲,۱۶۶.۷	۹۱.۶	۱۱.۷	(۳۰.۹%)
شستا	۴۲	۵۷.۸	۱,۲۸۶.۰	۴۳.۵	۱۴.۳	(۳.۳%)
خودرو	۲۷	۳۴.۲	۸۶۱.۴	۱۶.۱	۱۸.۰	(۳۱.۶%)
نارنج اهرم	۱۵	۷.۶	۱۴.۶	۷.۶	۰.۰	۰.۸%
وبملت	۱۶	۶.۶	۸۶.۷	۵.۸	۰.۸	(۸.۲%)
توان	۱۵	۵.۶	۱۵.۰	۵.۶	۰.۰	(۱.۳%)
ذوب	۲۳	۵.۶	۸۴.۲	۳.۵	۲.۱	(۲۰.۶%)

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	۱۲	۳۱,۵۱۰.۷	۱,۰۱۸,۴۶۹.۰	۵,۲۳۸.۸	۲۶,۲۷۱.۹	(۴۶.۳%)
خودرو	۵	۶,۲۴۳.۹	۳۴۵,۰۹۱.۲	۲,۹۵۱.۶	۳,۲۹۲.۴	(۴۲.۹%)
شستا	۱۶	۵,۶۱۴.۹	۲۸۲,۵۲۹.۳	۵,۴۱۲.۲	۲۰۲.۷	(۳۸.۲%)
ذوب	۲	۴۲.۲	۸,۱۴۸.۲	۲۶.۶	۱۵.۶	(۵۴.۰%)
وبملت	۳	۳۰.۲	۲,۹۰۸.۲	۱۷.۲	۱۳.۰	(۵۷.۲%)
فولاد	۲	۷.۳	۴۷.۹	۰.۰	۷.۳	(۹۴.۴%)
شپنا	۱	۰.۳	۱۴۲.۵	۰.۰	۰.۳	(۱۰۰.۰%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



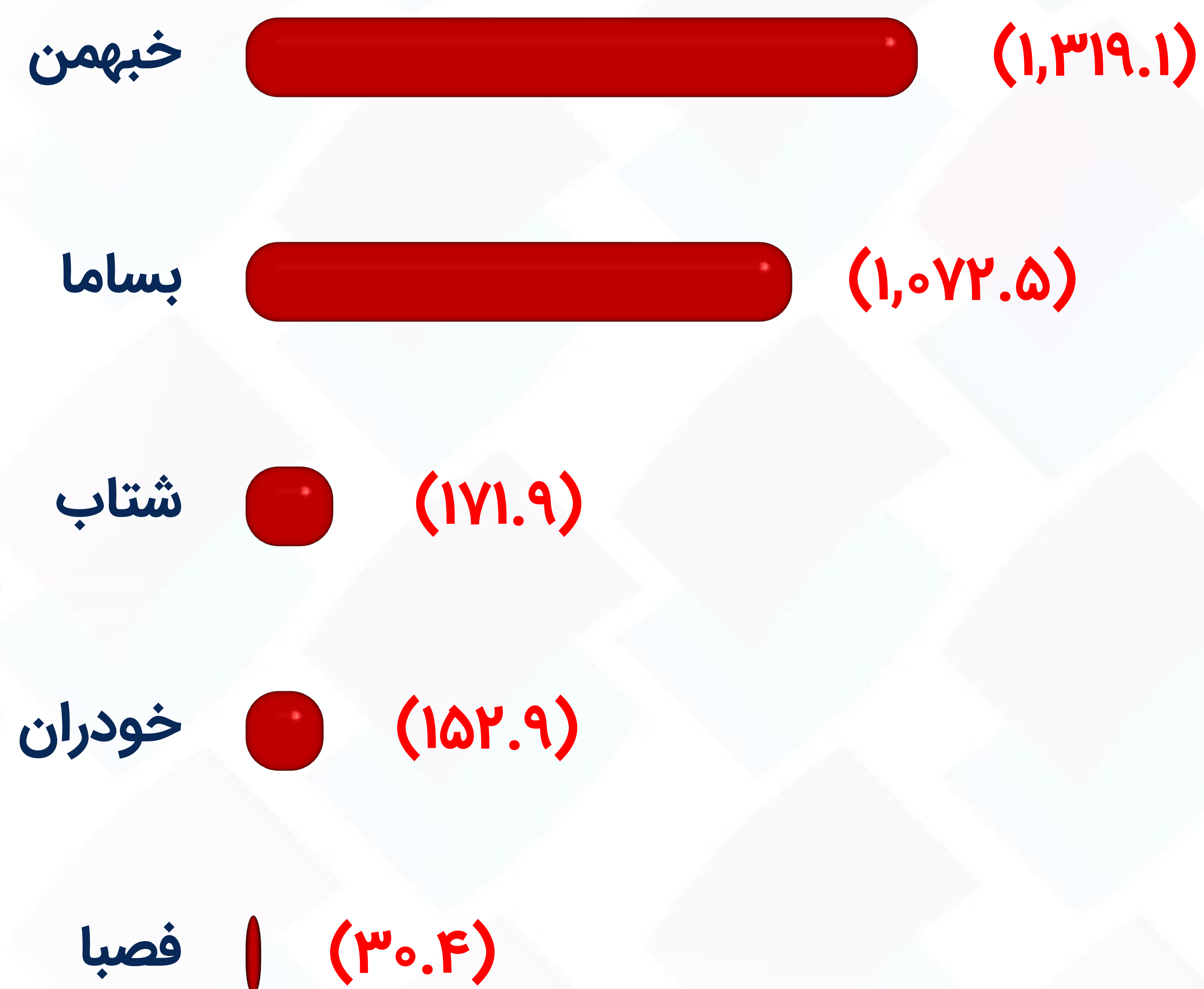
میلیون تومان

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

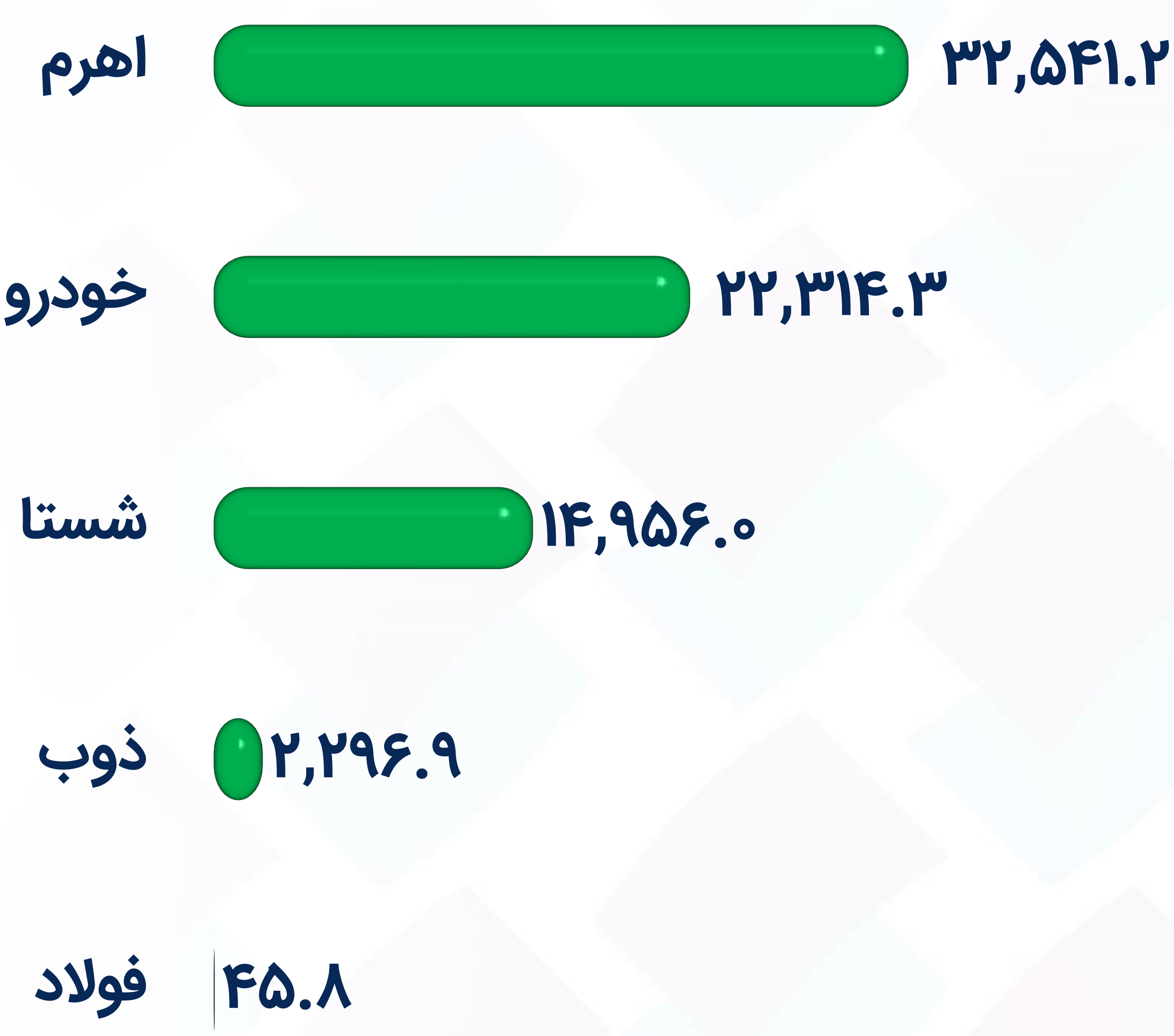
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



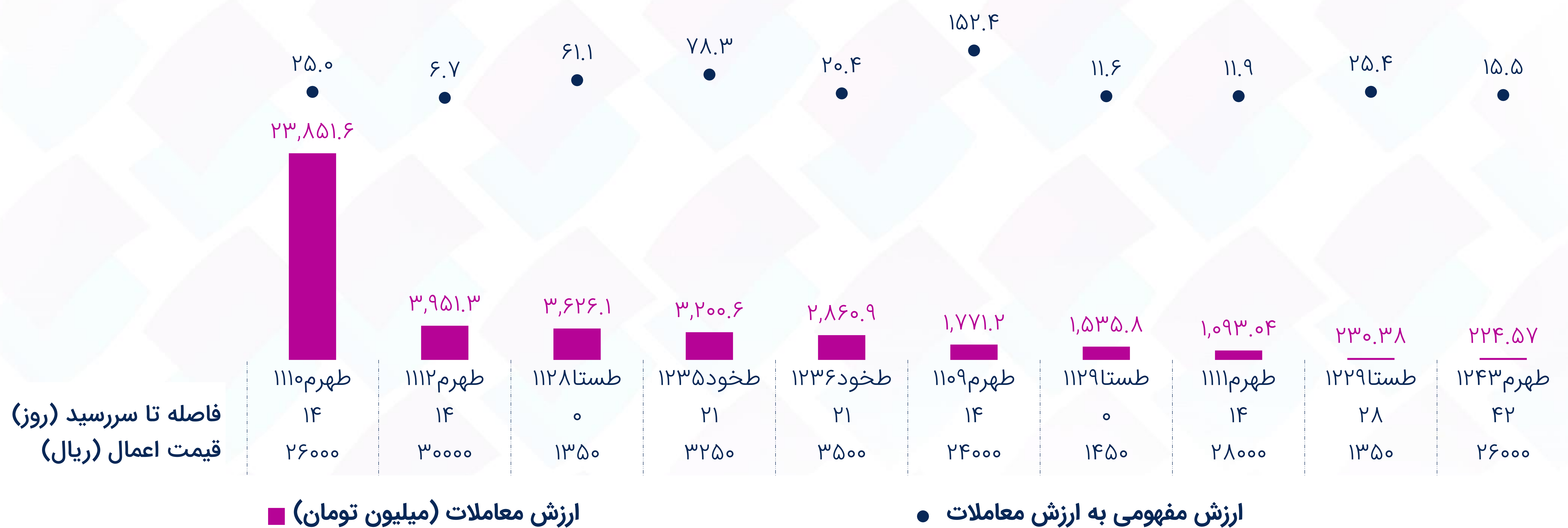
میلیون تومان

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
ضسامان ۲۰۴	سامان	۱,۹۰۰	۱۰۲	۵۲.۵	۱۷۵	۲,۰۳۴	۲,۰۷۵	۲.۰%	۱۱.۹	۰.۸۸	۳۰۵	۷۴%
ضسامان ۲۰۳	سامان	۱,۸۰۰	۱۰۲	۸۴.۱	۲۴۰	۲,۰۳۴	۲,۰۴۰	۰.۳%	۸.۵	۰.۹۴	۳۸۶	۶۱%
ضهمن ۱۱۲۳	خبهمن	۲,۰۰۰	۱۸	۴۳.۳	۱۱۸	۲,۱۴۷	۲,۱۱۸	(۱.۴%)	۱۷.۹	۰.۸۹	۱۸۶	۵۷%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۲۵	۱۳.۶	۸۰۰	۷,۲۰۰	۷,۰۴۶	(۲.۱%)	۸.۸	۱.۰۰	۱,۰۸۹	۳۶%
ضفزر ۲۱	فزر	۴۸,۰۰۰	۹۵	۳۳.۴	۱,۳۰۵	۴۲,۲۵۰	۴۹,۳۰۵	۱۶.۷%	۳۷.۸	۰.۴۰	۱,۷۵۵	۳۵%

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	۱۴	۴.۰	۲	۴۸۸	۱,۰۰۲	۱۰۵%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۱۴	۶.۷	۲	۴۸۸	۸۰۲	۶۴%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۱۴	۱۶.۶	۲	۴۸۸	۷۰۲	۴۴%	۳۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۲۱	۲۹.۴	۹	۳,۴۴۷	۵,۰۰۹	۴۵%	۵۵۶.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴	۳۸۴.۰	۶۱	۲۶,۲۱۰	۳۴,۰۶۱	۳۰%	۵۵۸.۴	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	۱۴	۱۳۷.۱	۷,۴۵۱	۲۶,۲۱۰	۲۶,۵۴۹	۱.۳%	۳.۶	-۱.۰۰	۷,۳۵۷	(۱.۳%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۴	۳,۹۵۱.۳	۳,۸۸۵	۲۶,۲۱۰	۲۶,۱۱۵	(۰.۴%)	۶.۷	-۰.۹۵	۳,۴۴۵	(۱۱.۳%)
طخود ۱۲۳۸	خودرو	۴,۰۰۰	۲۱	۲۰.۲	۵۵۹	۳,۴۴۷	۳,۴۴۱	(۰.۲%)	۶.۲	-۰.۹۴	۴۸۳	(۱۳.۵%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۳,۷۵۰	۲۱	۷۰.۵	۳۳۹	۳,۴۴۷	۳,۴۱۱	(۱.۰%)	۱۰.۱	-۰.۷۸	۲۶۶	(۲۱.۷%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۴	۱,۰۹۳.۰	۲,۲۰۹	۲۶,۲۱۰	۲۵,۷۹۱	(۱.۶%)	۱۱.۷	-۰.۷۶	۱,۶۹۳	(۲۳.۳%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

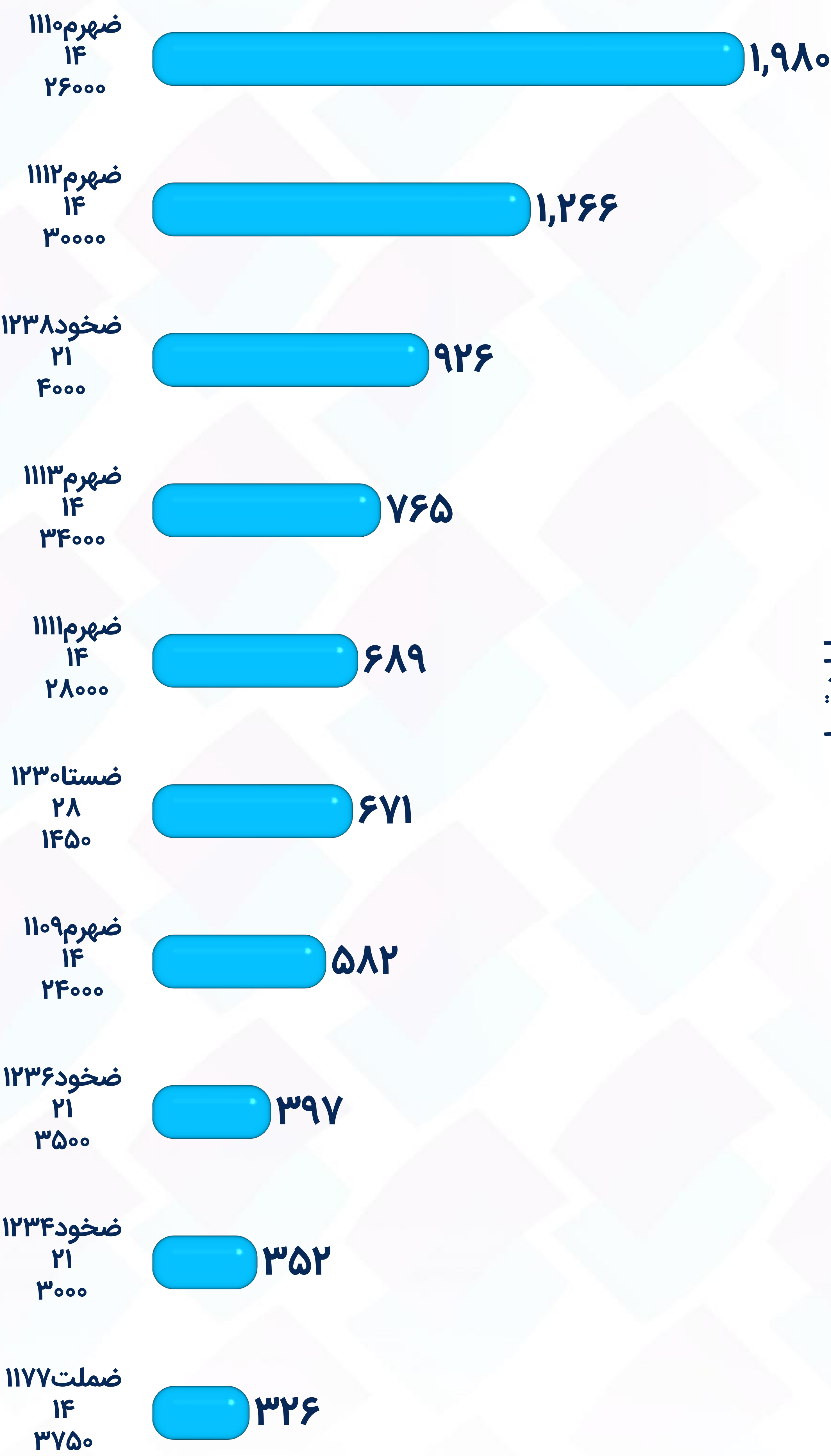
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طستا ۱۲۲۲	شستا	۶۵۰	۲۸	۲.۴	۲	۱,۳۴۴	۶۴۸	(۵۱.۸%)	۳۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۴	۱۶.۰	۱۵	۲۶,۲۱۰	۱۷,۹۸۵	(۳۱.۴%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۲۲۶	شستا	۱,۰۵۰	۲۸	۱.۲	۳	۱,۳۴۴	۱,۰۴۷	(۲۲.۱%)	۳۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۱۴	۱۵.۶	۱	۴۸۸	۳۹۹	(۱۸.۲%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۳%)
طملت ۱۱۷۳	وبملت	۲,۸۰۰	۱۴	۱.۵	۶	۳,۲۳۱	۲,۷۹۴	(۱۳.۵%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۵.۴%)

(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

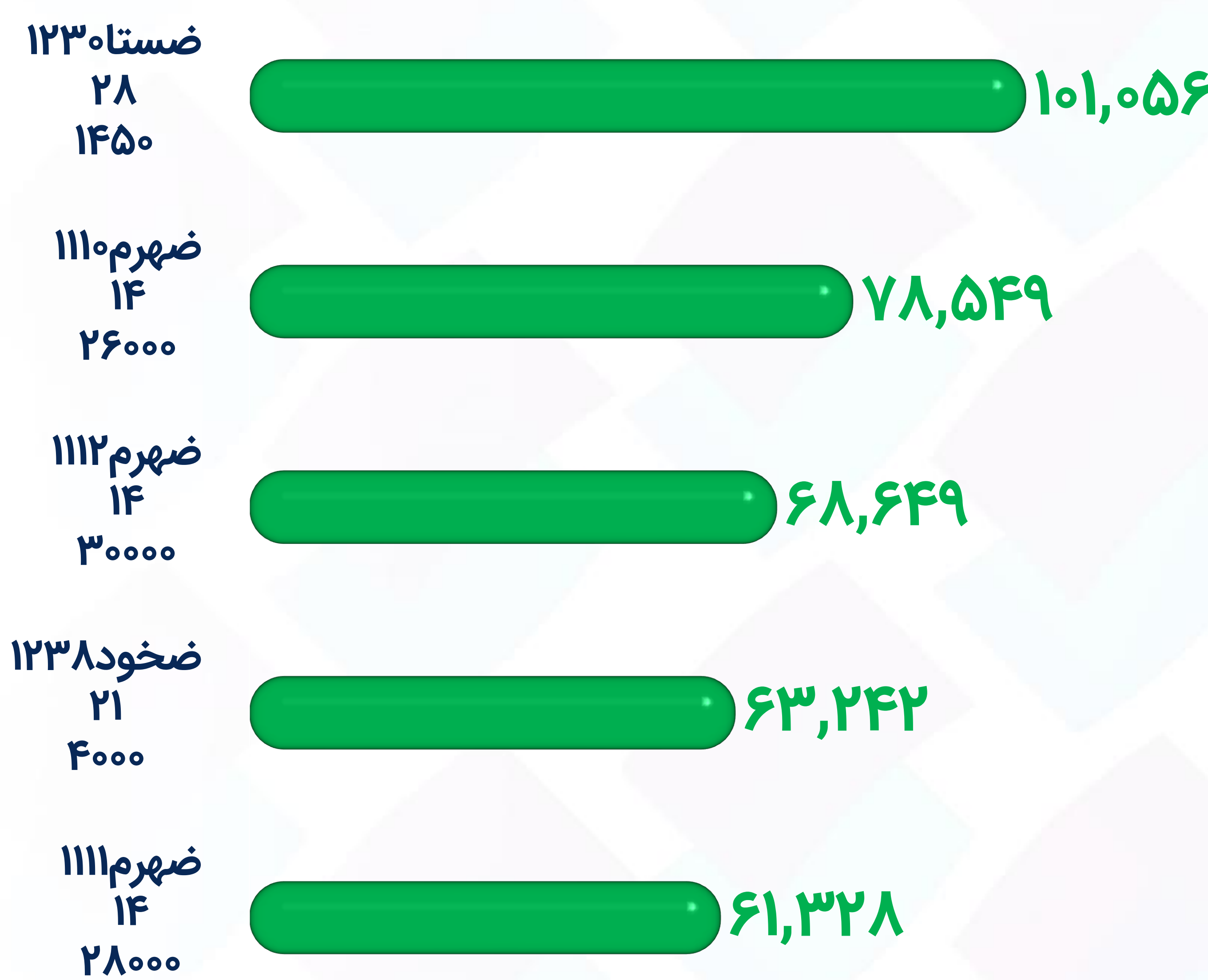
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

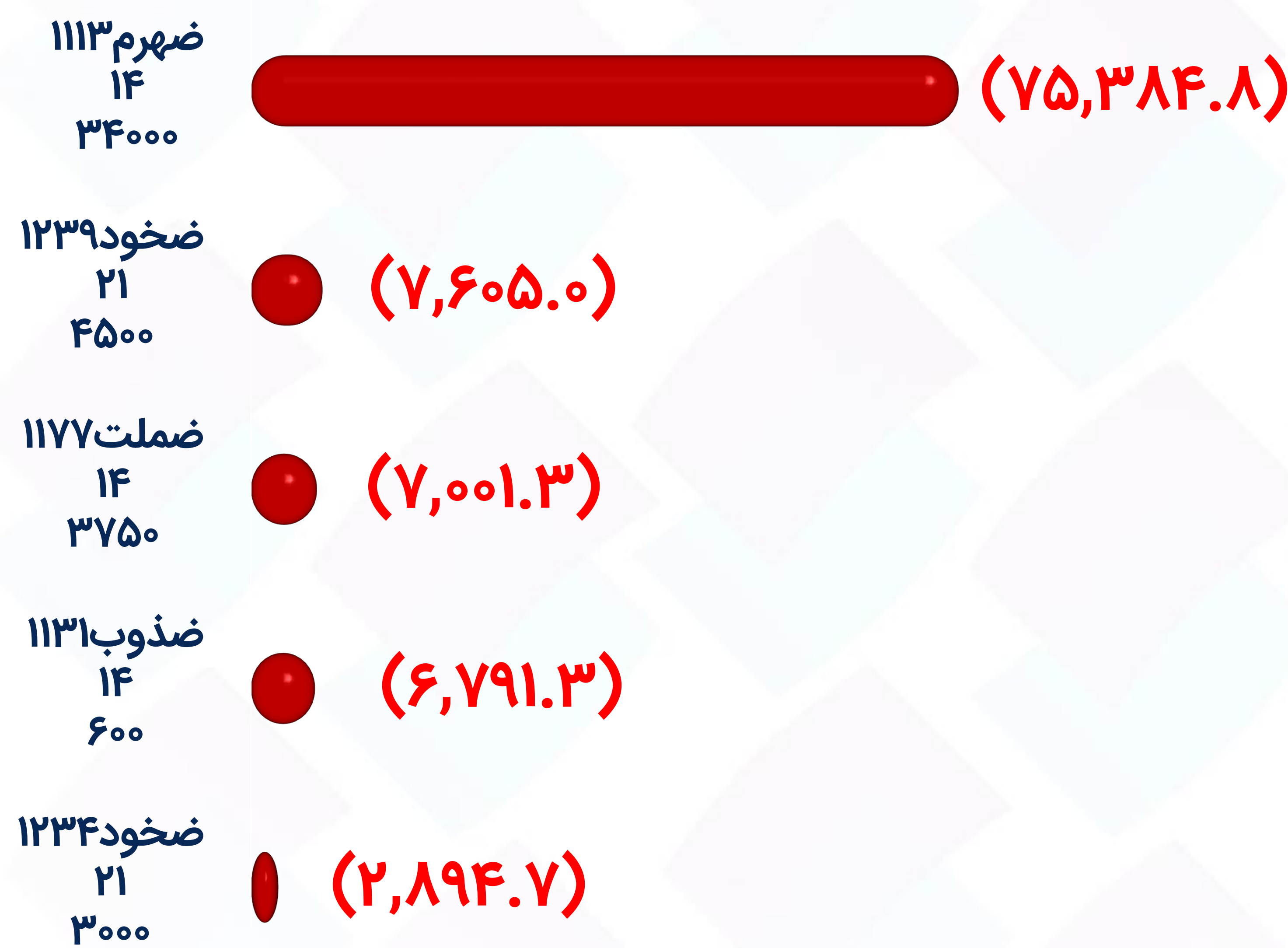
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

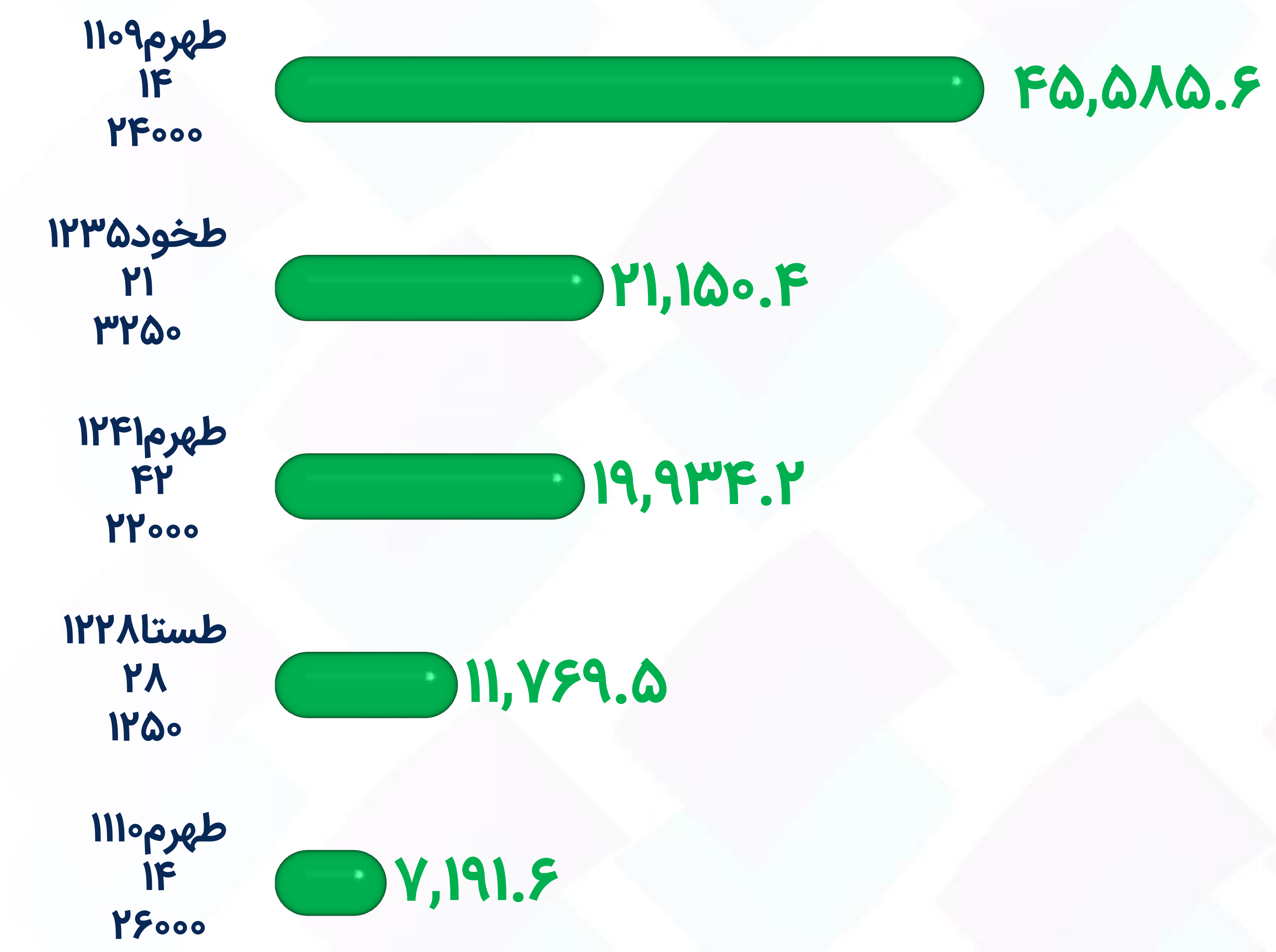
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)



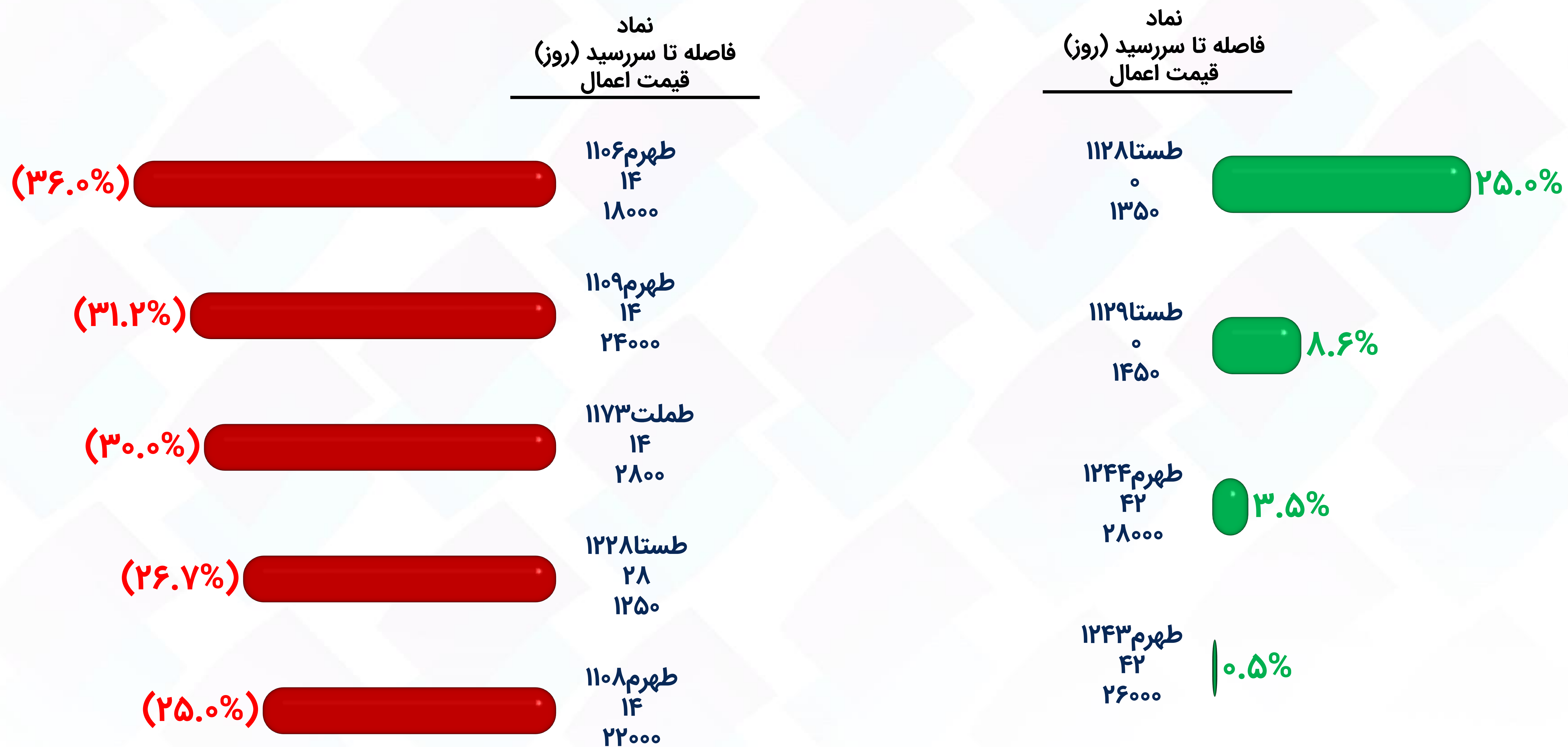
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

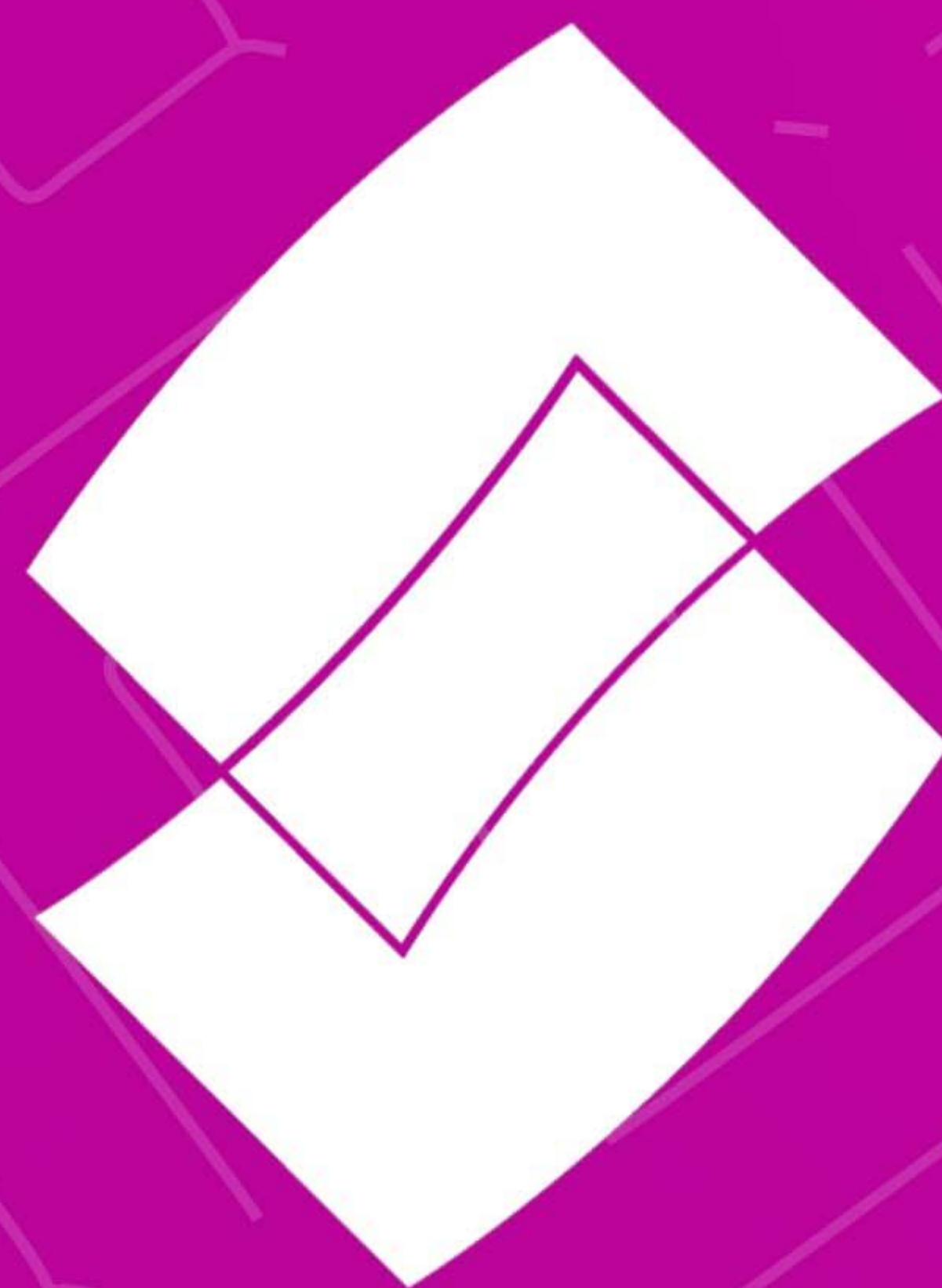
اختیار خرید



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.