

شماره
۴۱۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

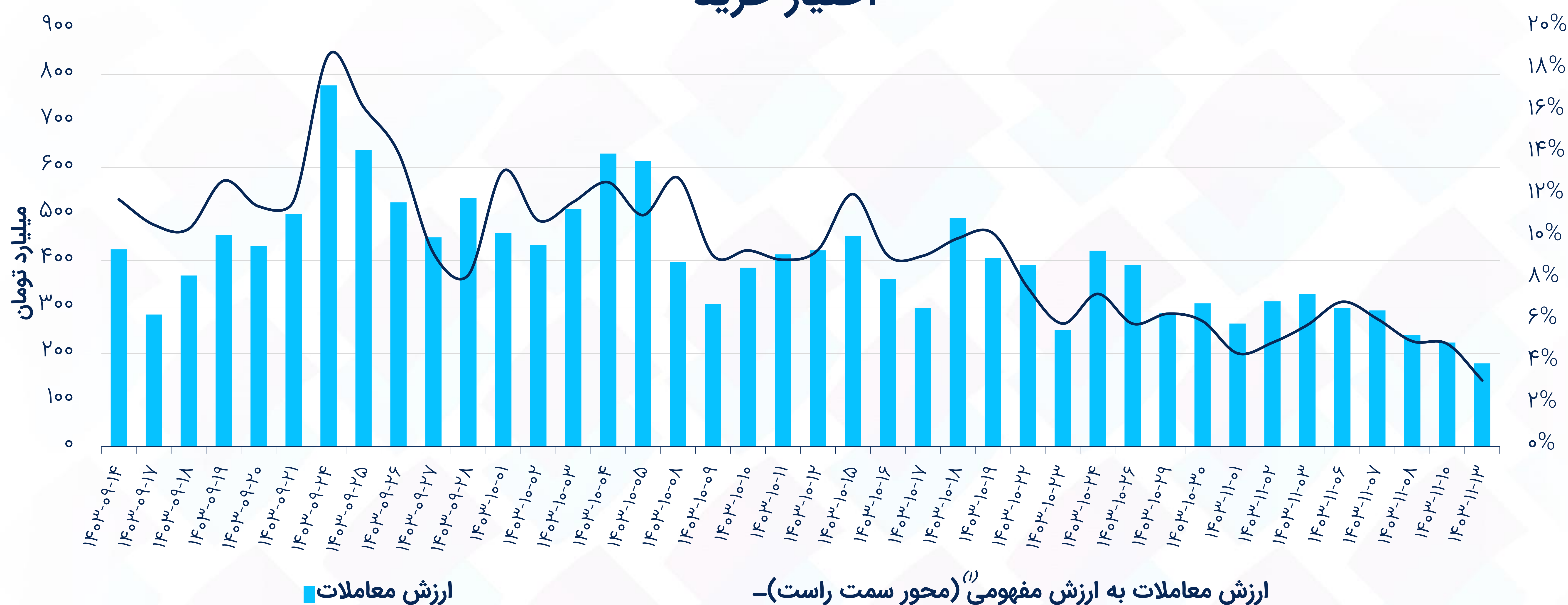




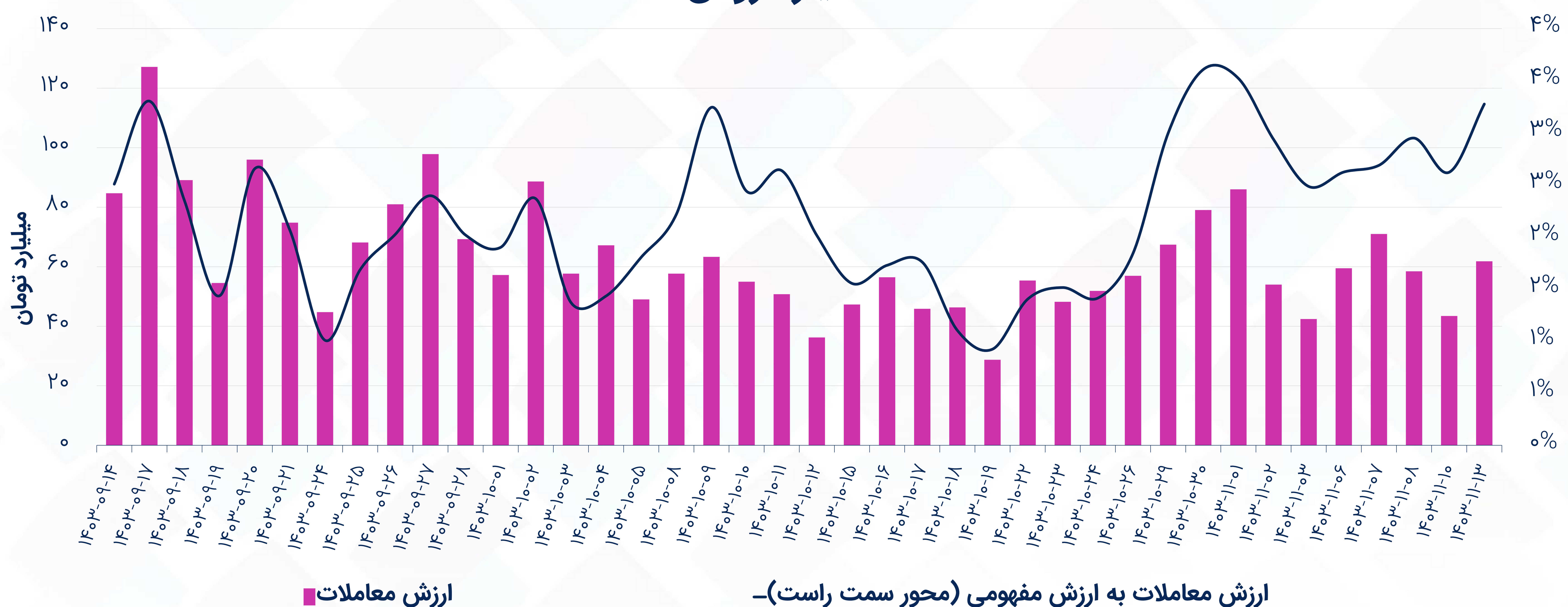
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



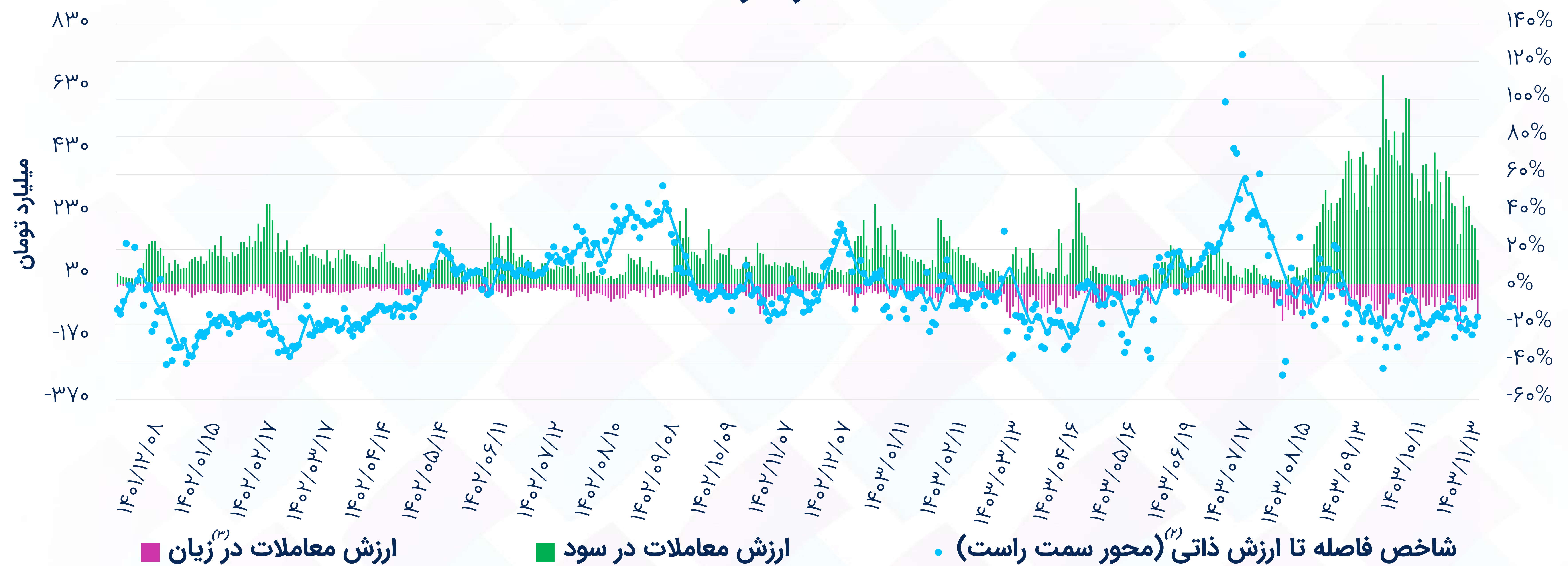
اختیار فروش



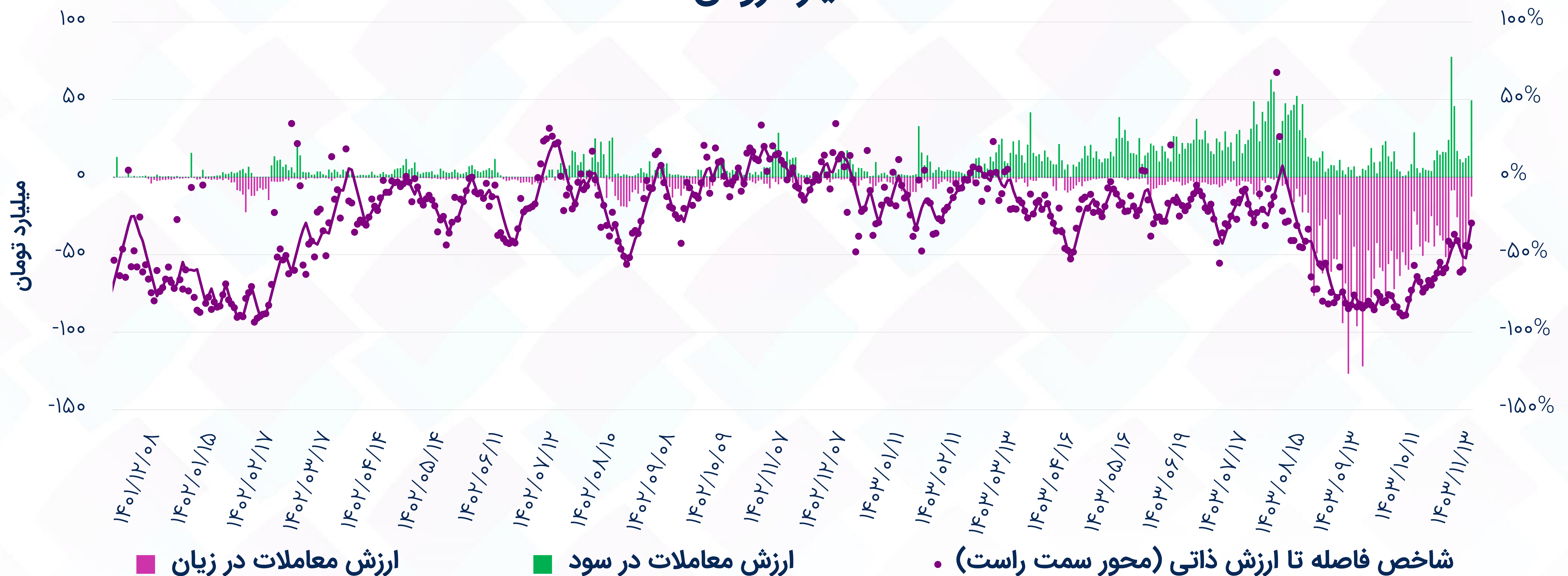
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

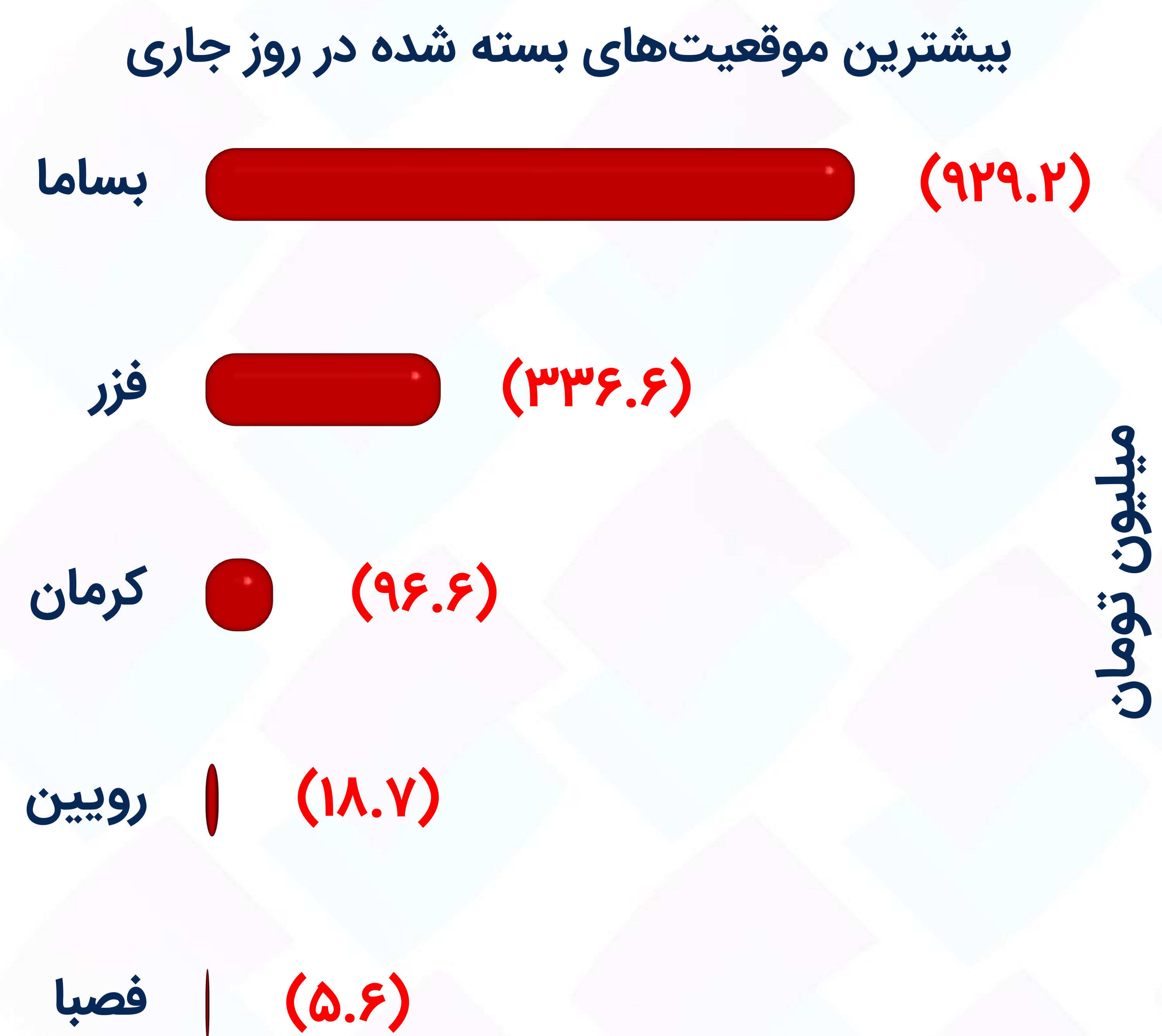
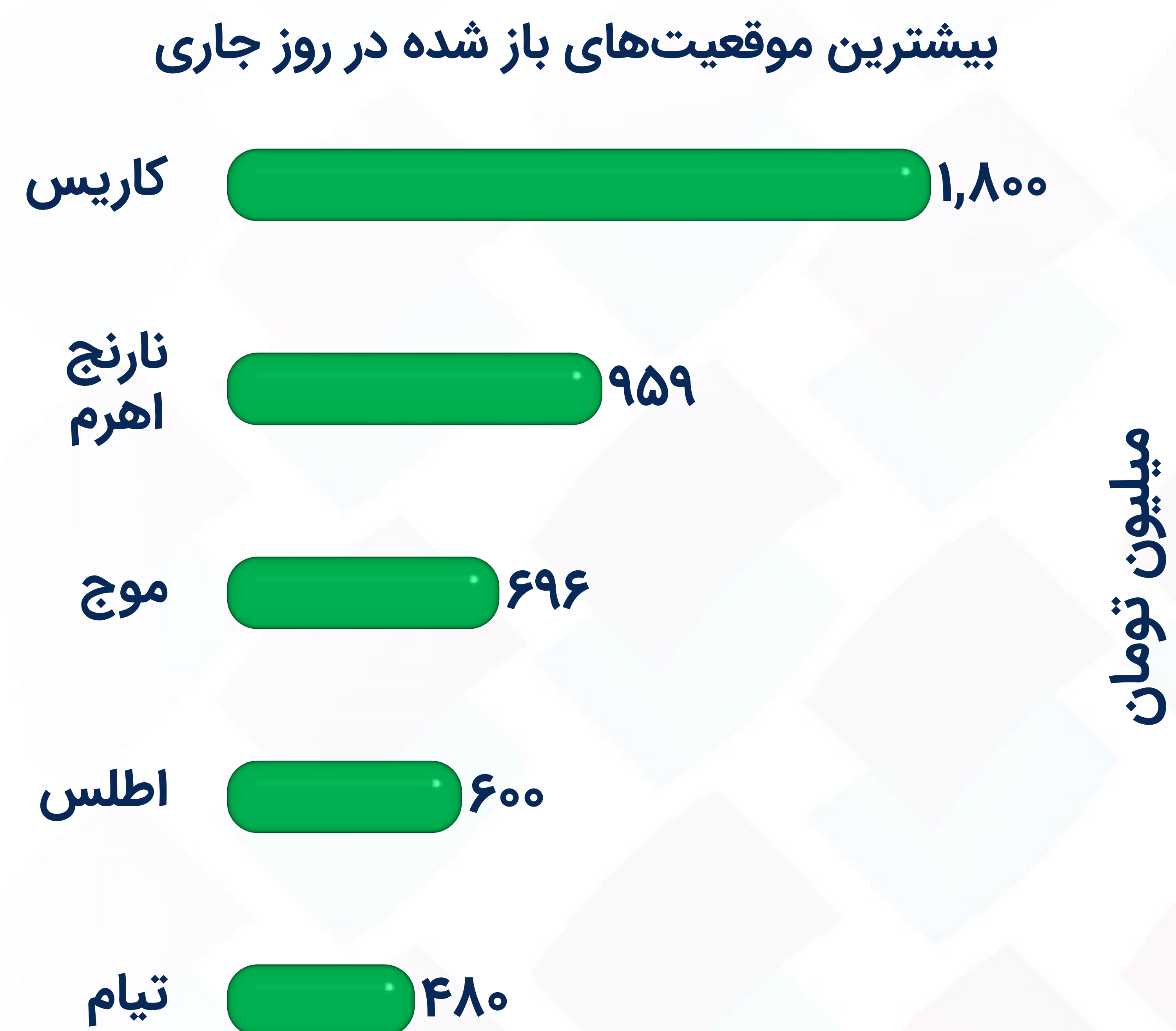
اختیار خرید

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	۴۳	۹۵.۳	۳,۴۶۵.۳	۲۴.۴	۷۰.۹	(۱۸.۶%)
خودرو	۲۹	۳۴.۲	۱,۲۰۳.۰	۱۸.۸	۱۵.۴	(۱۴.۳%)
شستا	۳۱	۱۷.۹	۵۱۳.۱	۶.۸	۱۱.۲	(۲۹.۲%)
وبملت	۲۱	۱۱.۱	۱۶۵.۷	۹.۸	۱.۲	(۳.۹%)
ذوب	۲۶	۸.۴	۱۸۳.۱	۵.۶	۲.۸	(۱۱.۳%)
توان	۱۸	۴.۲	۱۲.۶	۴.۲	۰.۱	۰.۰%
خسپا	۱۹	۲.۵	۵۳.۷	۱.۶	۰.۹	۵.۷%

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	۴۷,۵۹۱.۶	۱,۲۱۴,۲۲۶.۲	۴۳,۳۰۷.۰	۴,۲۸۴.۷	(۲۸.۹%)
خودرو	۵	۱۲,۶۴۴.۶	۵۷۹,۶۸۵.۲	۵,۳۲۵.۶	۷,۳۱۸.۹	(۳۰.۸%)
شستا	۱۱	۱,۴۲۰.۶	۷۸,۴۴۸.۹	۶۱۴.۳	۸۰۶.۳	(۴۵.۱%)
وبملت	۳	۹۴.۶	۹,۵۲۱.۸	۴۳.۲	۵۱.۴	(۴۹.۴%)
ذوب	۴	۴۶.۳	۳,۹۲۸.۵	۳۹.۳	۷.۰	(۲۹.۱%)
توان	۴	۲۵.۸	۳۸۹.۴	۲۲.۲	۳.۶	۲۷.۶%
نارنج اهرم	۲	۴.۶	۱۷۳.۷	۴.۶	۰.۰	(۱۶.۹%)

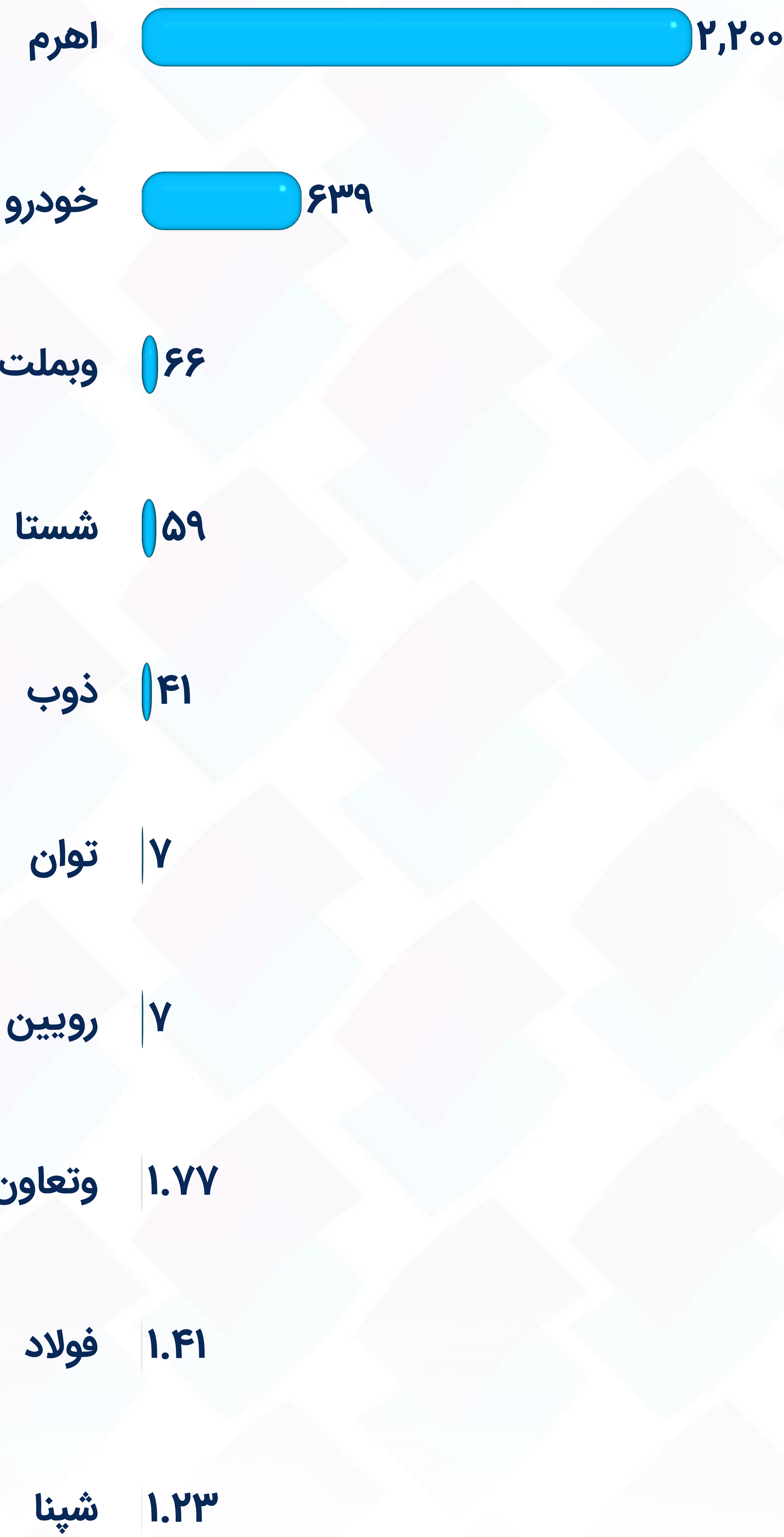
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

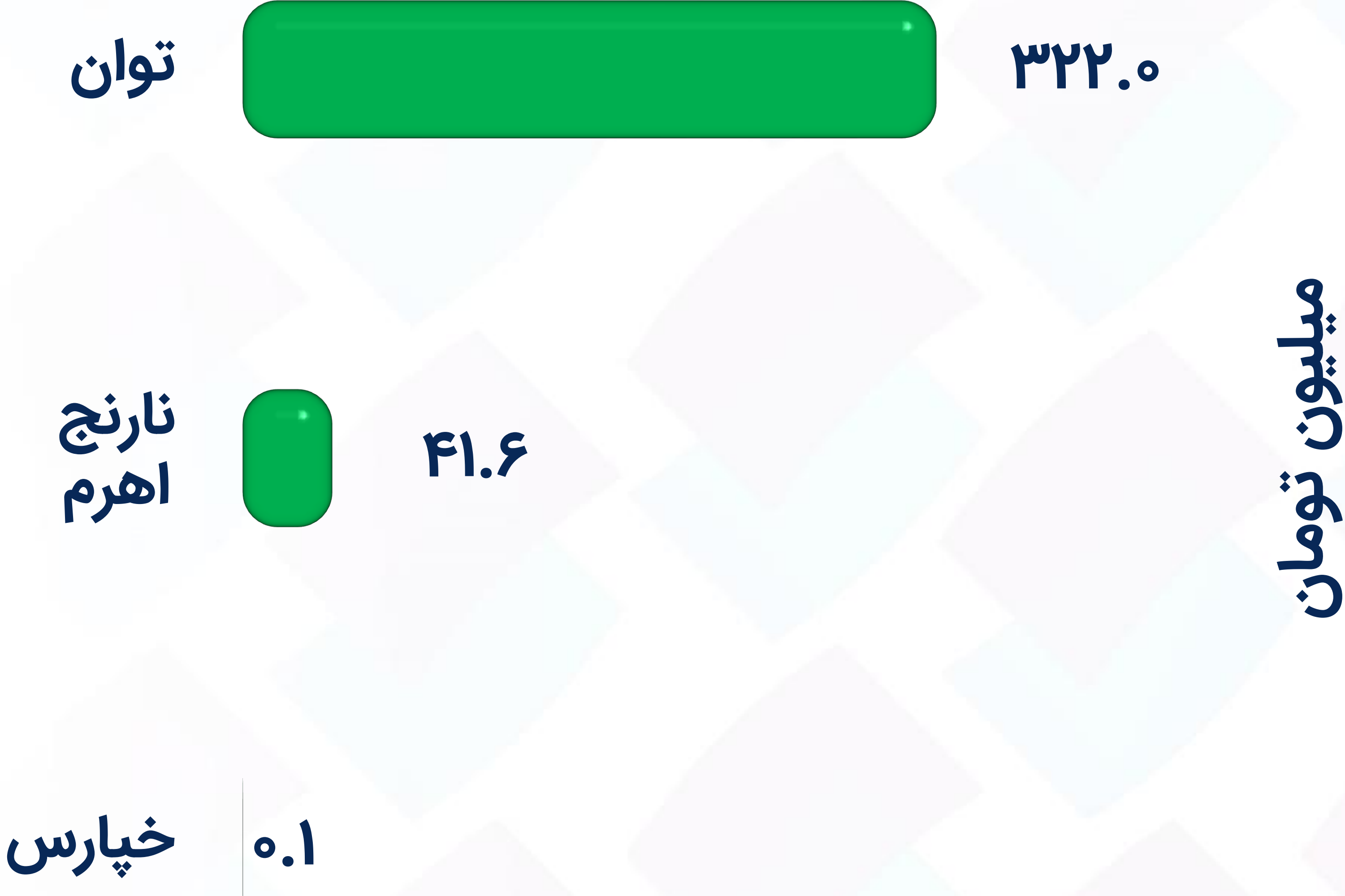
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



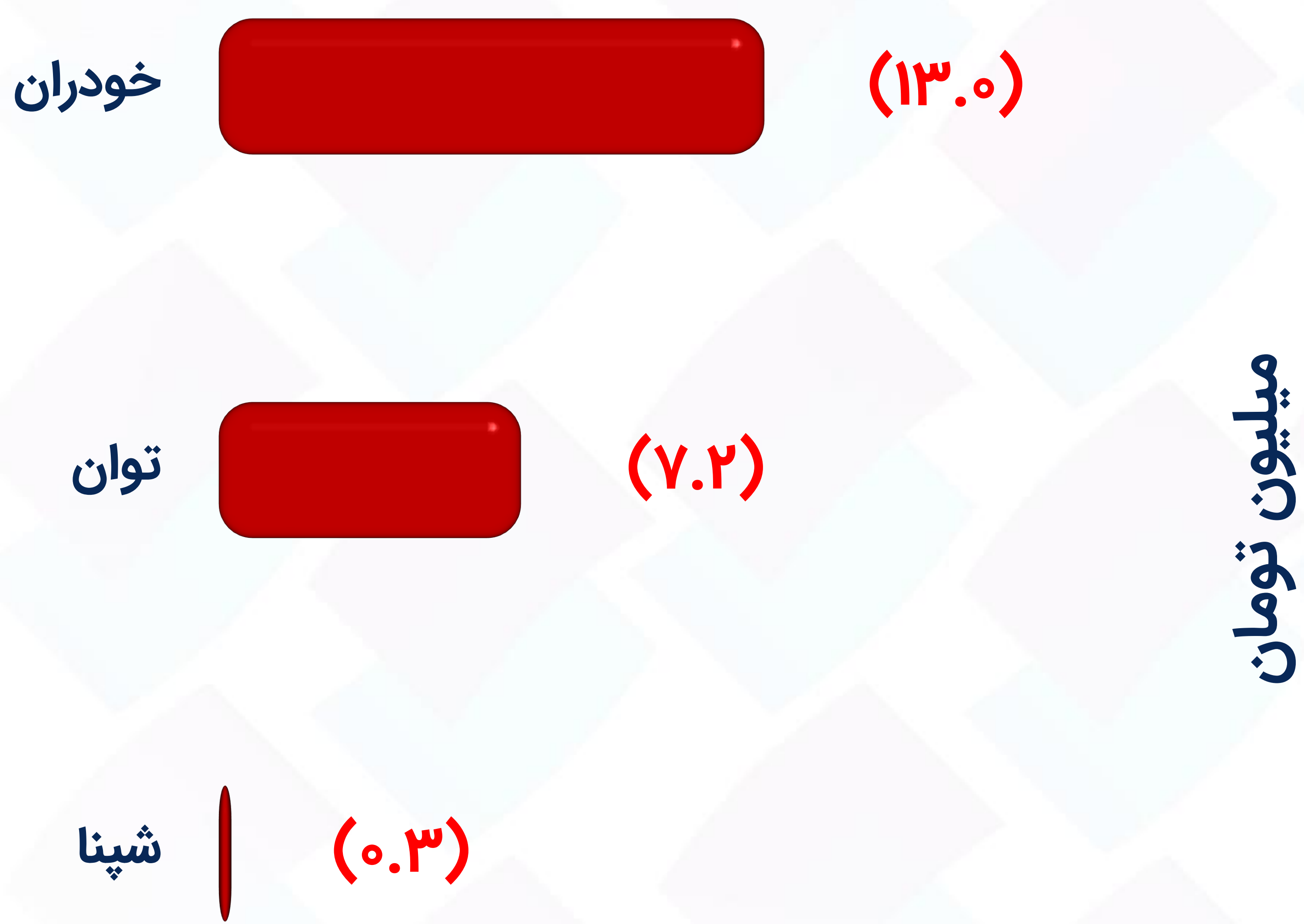
میلیارد تومان

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
ضسامان ۲۰۵	سامان	۲,۰۰۰	۹۹	۵.۰	۱۰۰	۱,۹۸۹	۲,۱۰۰	۵.۶%	۲۱.۰	۰.۷۴	۲۰۱	۱۰۱%
ضشنا ۱۲۱۹	شنا	۴,۰۰۰	۲۵	۳.۸	۴۲۵	۴,۶۱۰	۴,۴۲۵	(۴.۰%)	۱۰.۴	۰.۹۷	۷۱۷	۶۹%
ضموج ۱۱۰۵	موج	۲۴,۰۰۰	۸	۴.۲	۱۲۴	۲۲,۵۷۴	۲۴,۱۲۴	۶.۹%	۱۹۴.۵	۰.۲۳	۲۰۵	۶۵%
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۲۲	۱۶.۸	۳۰۰	۷,۳۱۰	۷,۳۷۸	۰.۹%	۲۴.۶	۰.۸۳	۴۲۲	۴۱%
ضپتروپاداش ۱۲۰۲	پتروپاداش	۱۰,۰۰۰	۲۲	۴۰۷.۴	۲,۸۱۰	۱۳,۷۲۷	۱۲,۸۱۰	(۶.۷%)	۴.۶	۱.۰۰	۳,۹۴۱	۴۰%

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 ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۱۱	۵.۲	۱	۴۷۵	۹۰۱	۹۰%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۱۱	۱.۴	۱	۴۷۵	۱,۰۰۱	۱۱۱%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۱۱	۲۲.۰	۱	۴۷۵	۸۰۱	۶۹%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۱۱	۶.۰	۱	۴۷۵	۷۰۱	۴۸%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۱۸	۱۱.۴	۶	۳,۳۶۷	۵,۰۰۶	۴۹%	۸۳۴.۳	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
طتوان ۱۲۲۳	توان	۳۰,۰۰۰	۳۶	۱۰.۰	۲,۵۰۰	۲۴,۴۸۸	۲۷,۵۰۰	۱۲.۳%	۱۱.۰	-۰.۹۲	۴,۵۸۳	۸۳.۳%
طتوان ۱۲۲۲	توان	۲۸,۰۰۰	۳۶	۱۲.۲	۲,۸۴۴	۲۴,۴۸۸	۲۵,۱۵۶	۲.۷%	۸.۸	-۰.۷۸	۲,۸۸۱	۱.۳%
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۱	۶۶.۵	۸,۲۱۰	۲۵,۴۷۰	۲۵,۷۹۰	۱.۳%	۳.۱	-۱.۰۰	۸,۱۱۹	(۱.۱%)
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۱۱	۱.۳	۱۲۰	۴۷۵	۴۸۰	۱.۱%	۴.۰	-۱.۰۰	۱۱۸	(۱.۹%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۱	۴,۸۷۴.۶	۴,۴۸۴	۲۵,۴۷۰	۲۵,۵۱۶	۰.۲%	۵.۷	-۰.۹۹	۴,۱۷۶	(۶.۹%)

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
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۱	۷.۴	۱۸	۲۵,۴۷۰	۱۷,۹۸۲	(۲۹.۴%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۱	۴.۷	۳۲	۲۵,۴۷۰	۱۹,۹۶۸	(۲۱.۶%)	۶۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طفلا ۱۲۰۷	فولاد	۴,۵۰۰	۱۸	۱.۸	۲۱	۵,۵۴۰	۴,۴۷۹	(۱۹.۲%)	۲۱۳.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۱۱	۷.۰	۱	۴۷۵	۳۹۹	(۱۶.۰%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۶.۴%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۲۵	۳.۱	۸	۱,۳۱۱	۱,۱۴۲	(۱۲.۹%)	۱۴۲.۸	-۰.۰۲	۱	(۹۲.۴%)

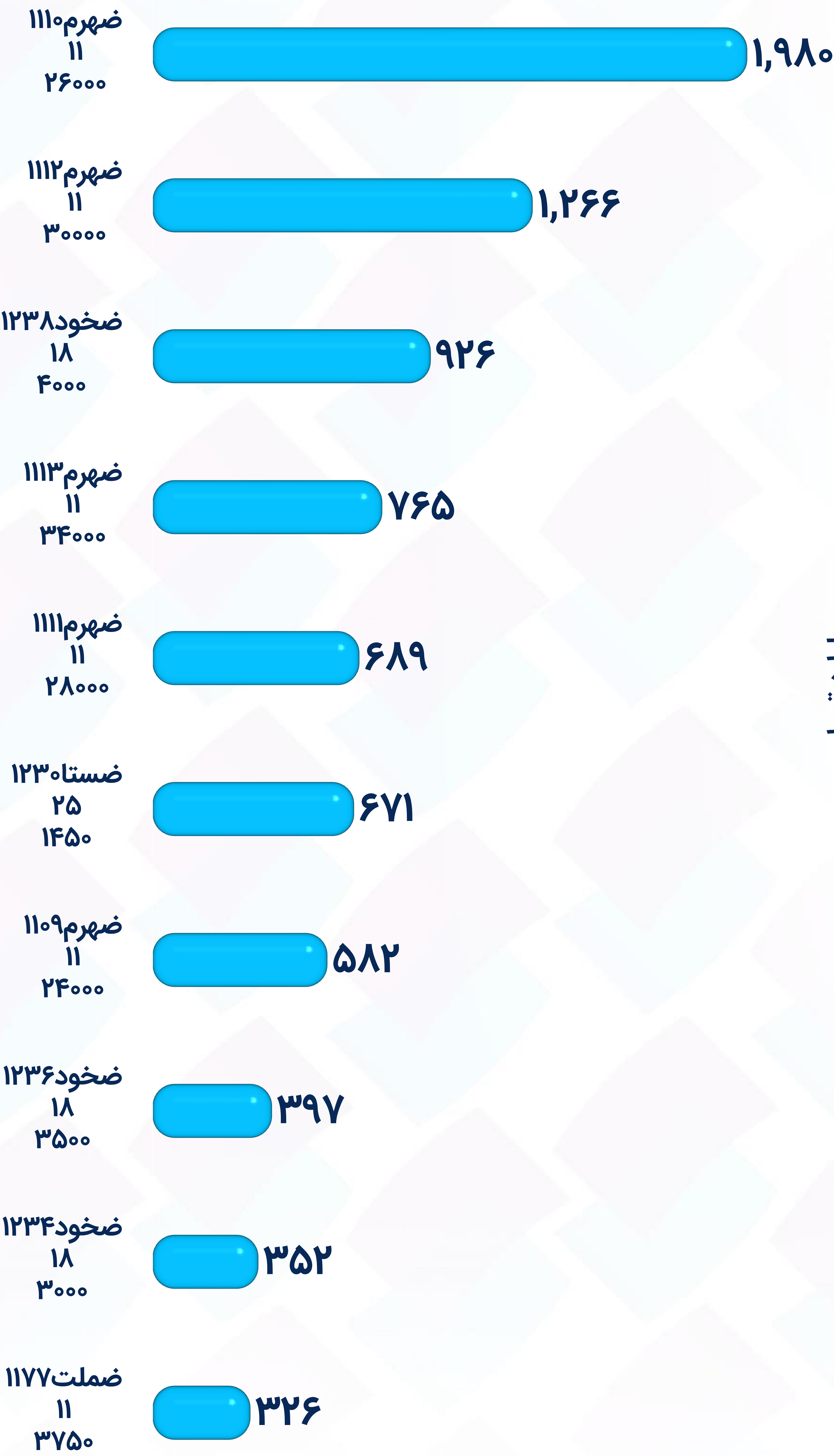
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



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

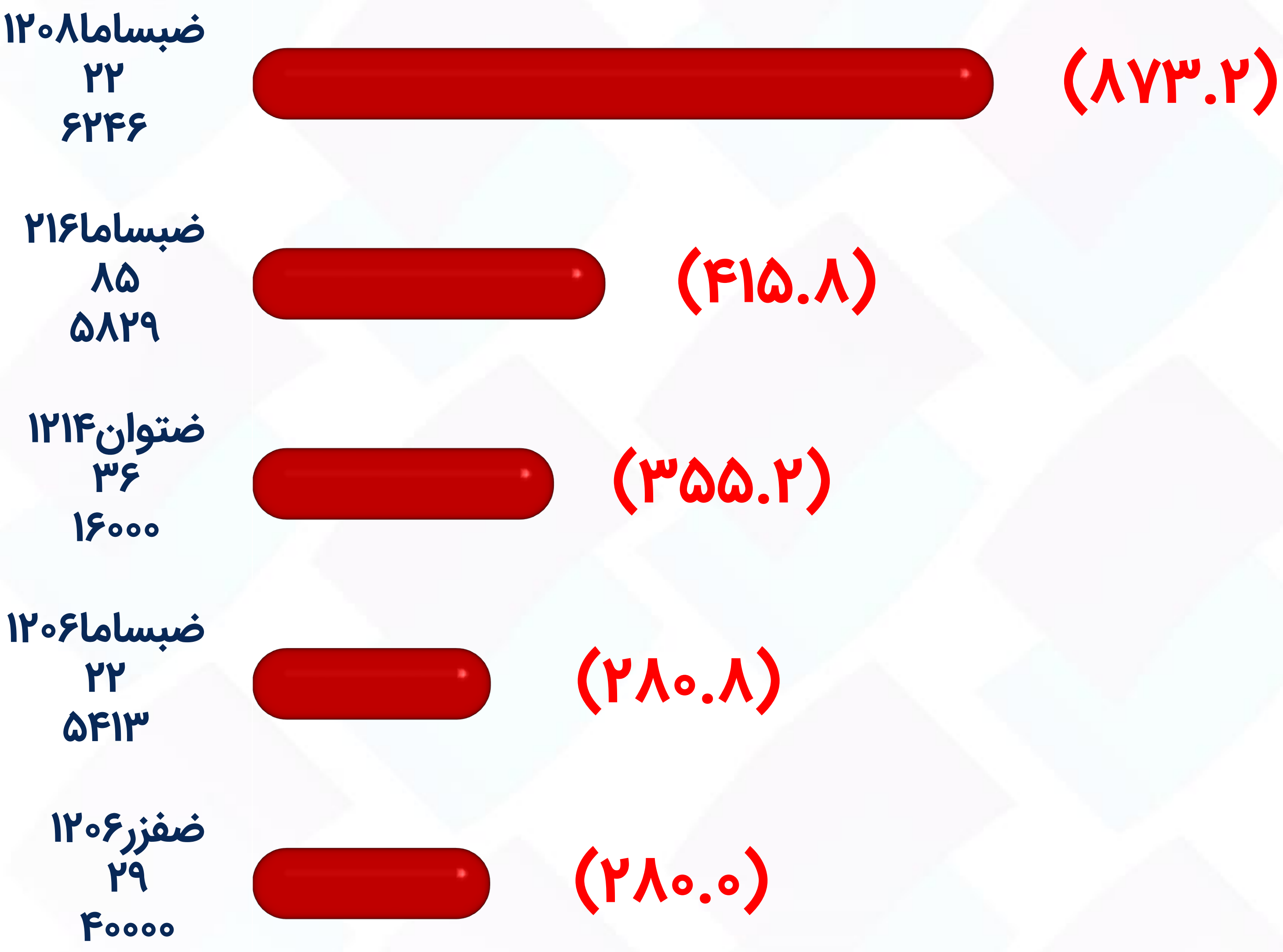
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

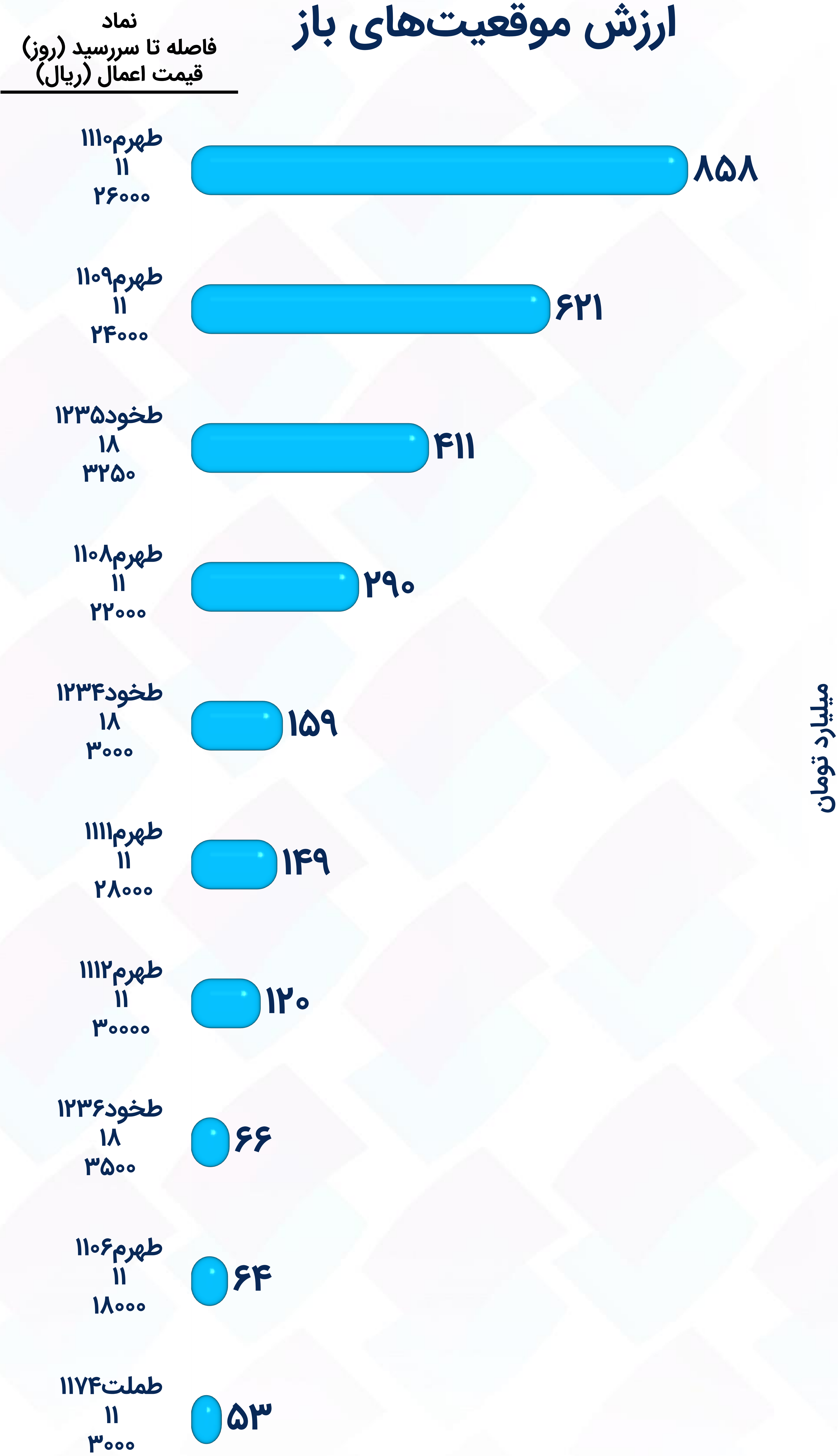
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

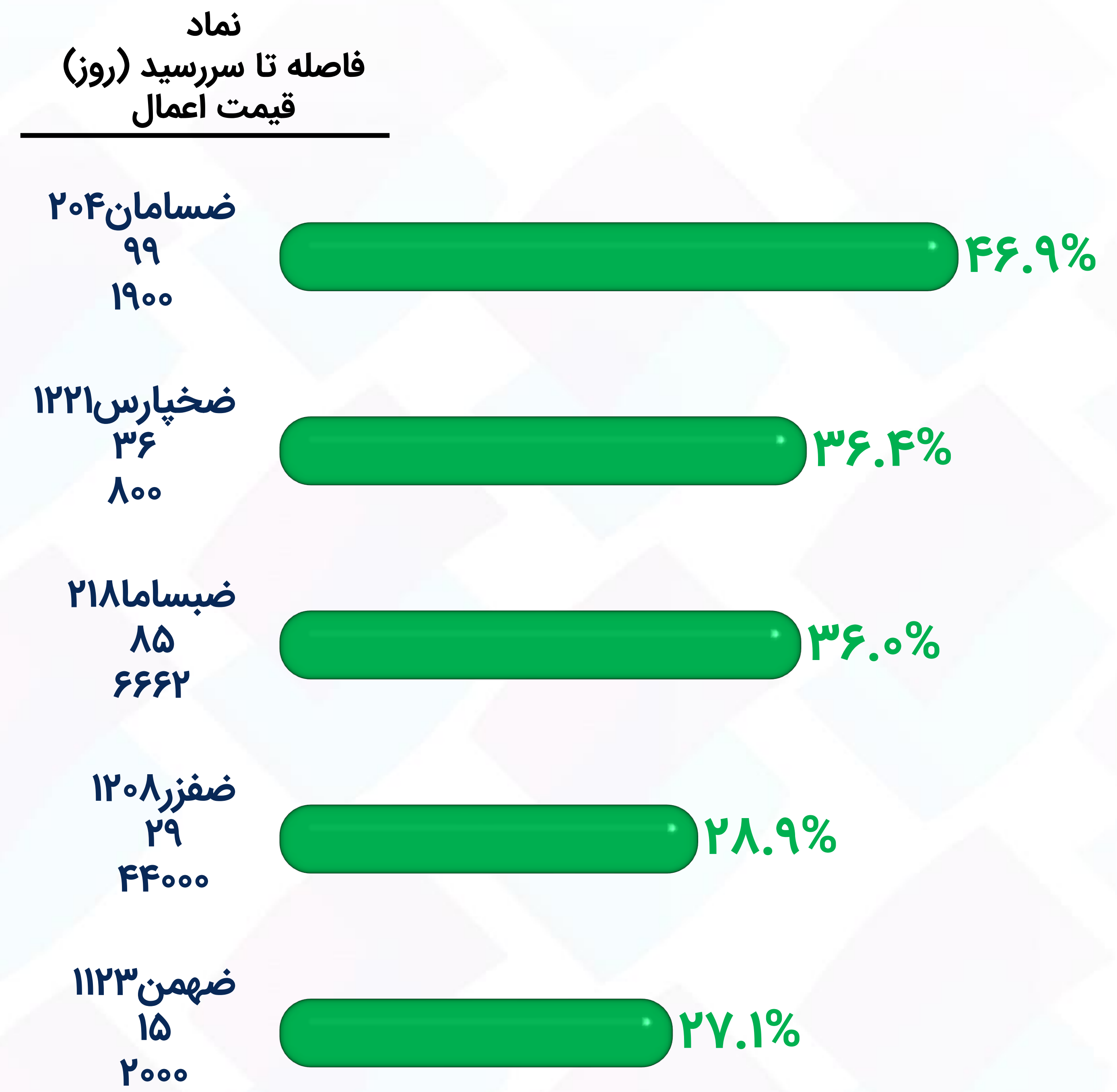
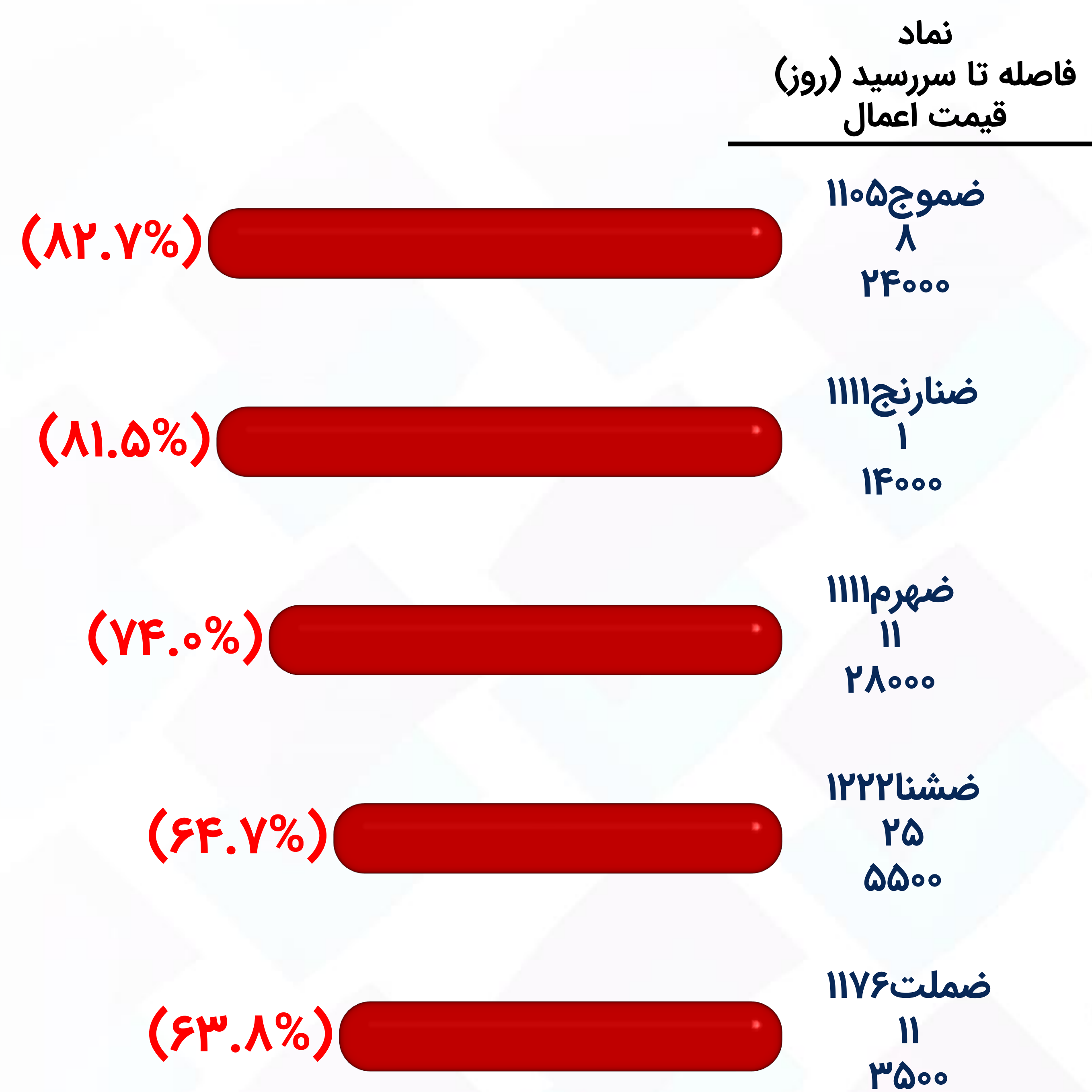


بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

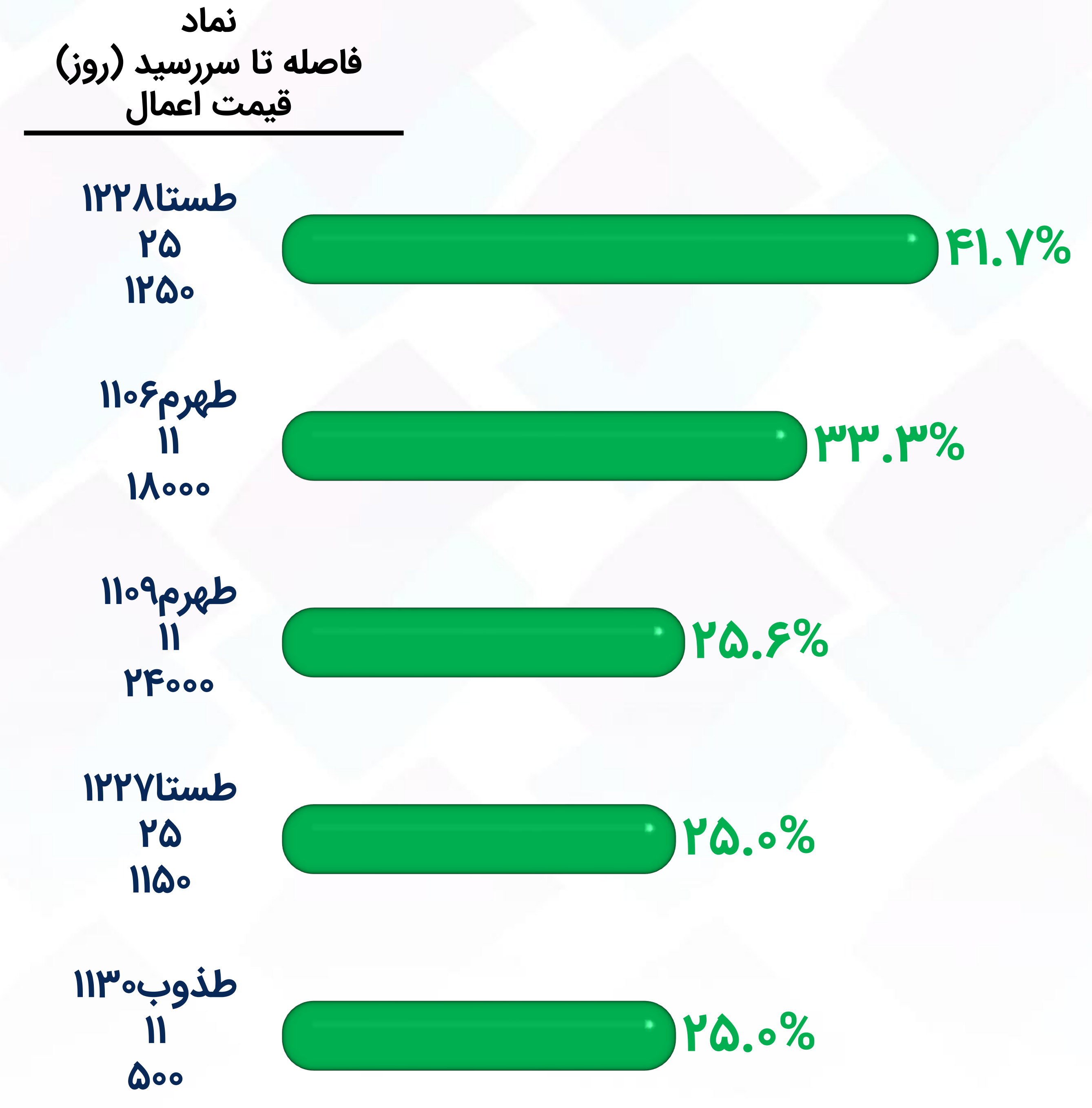
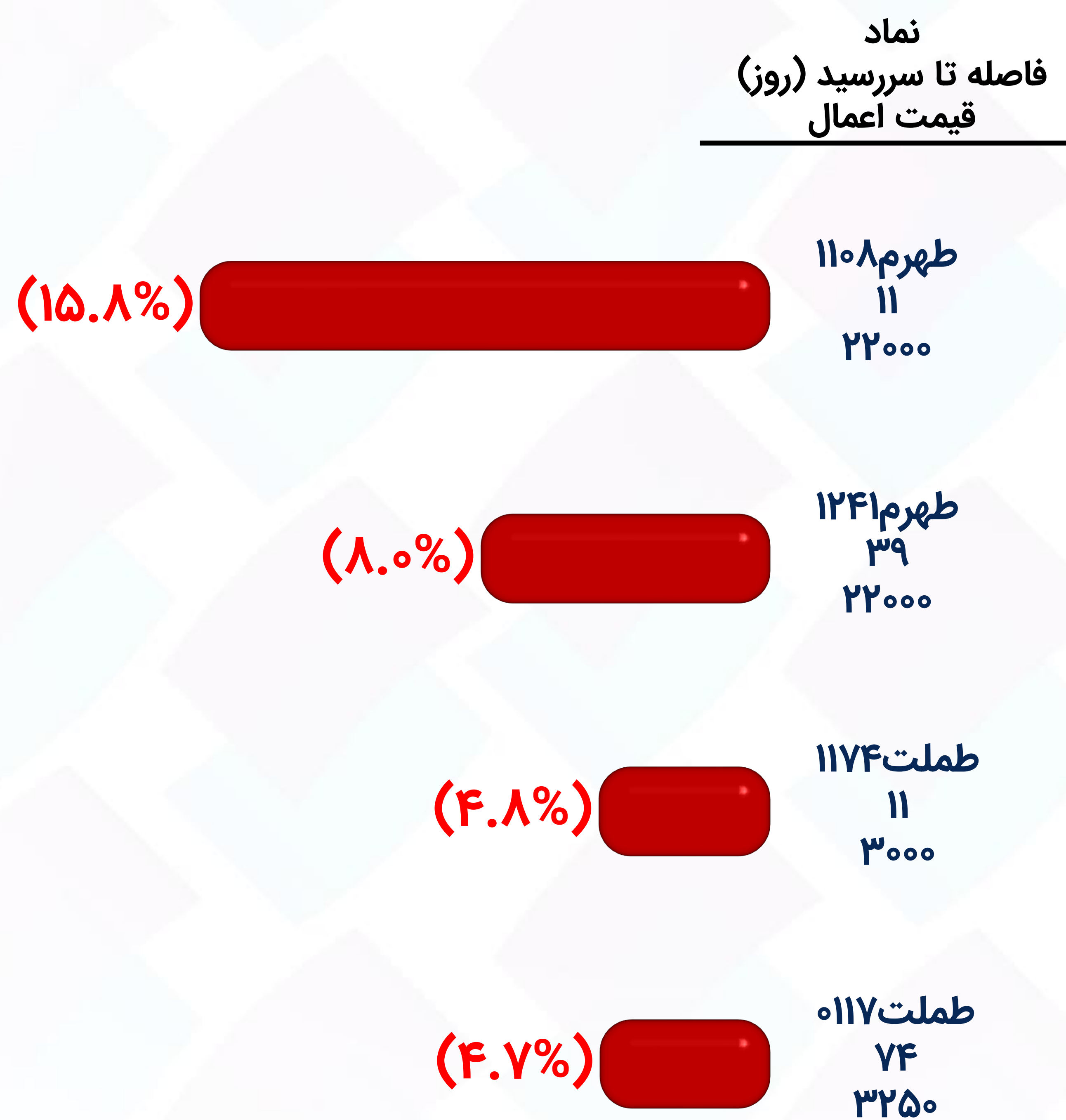


بیشترین تغییرات قیمت (۱)

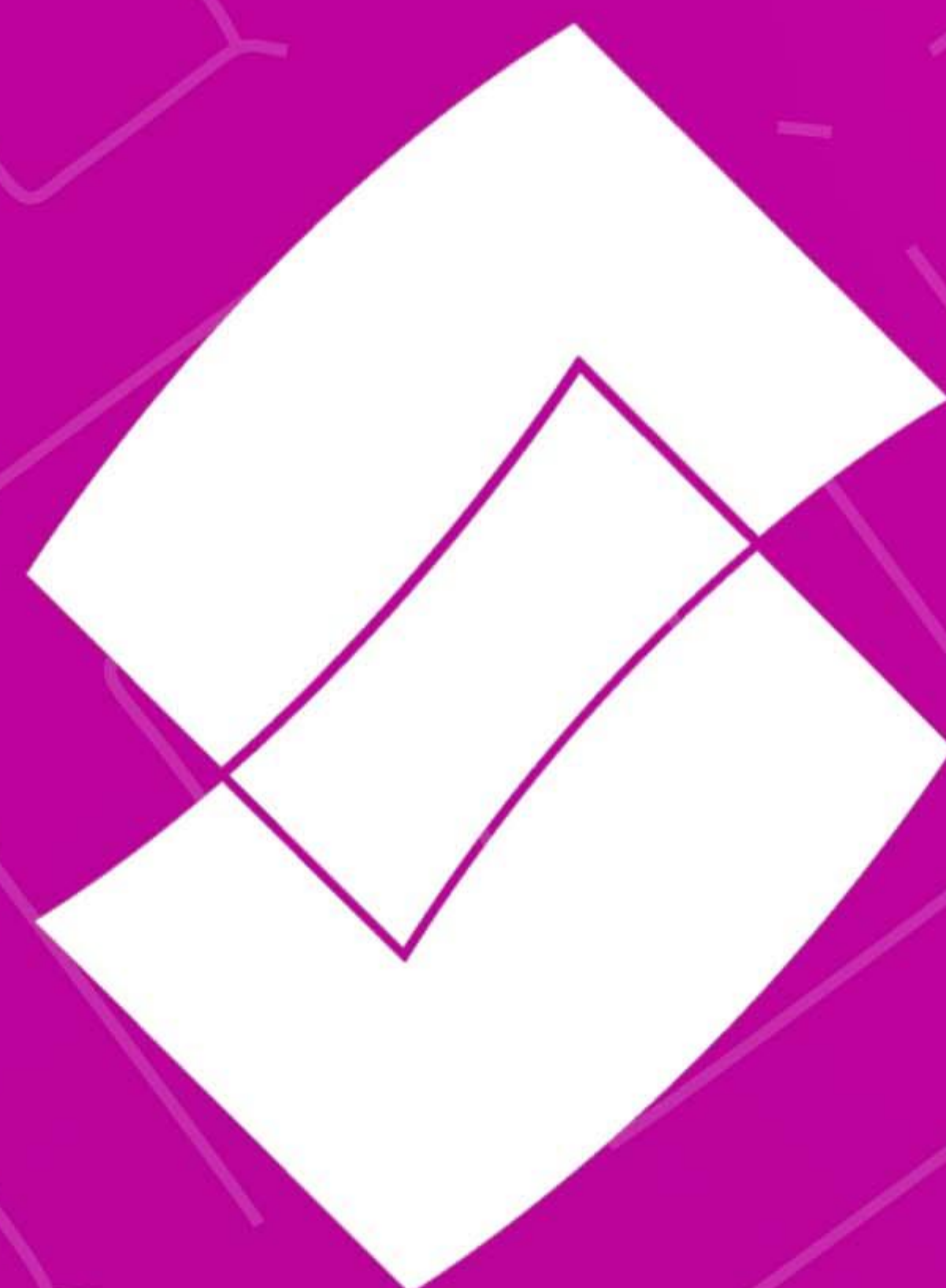
اختیار خرید



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.