

شماره
۴۱۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۴ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

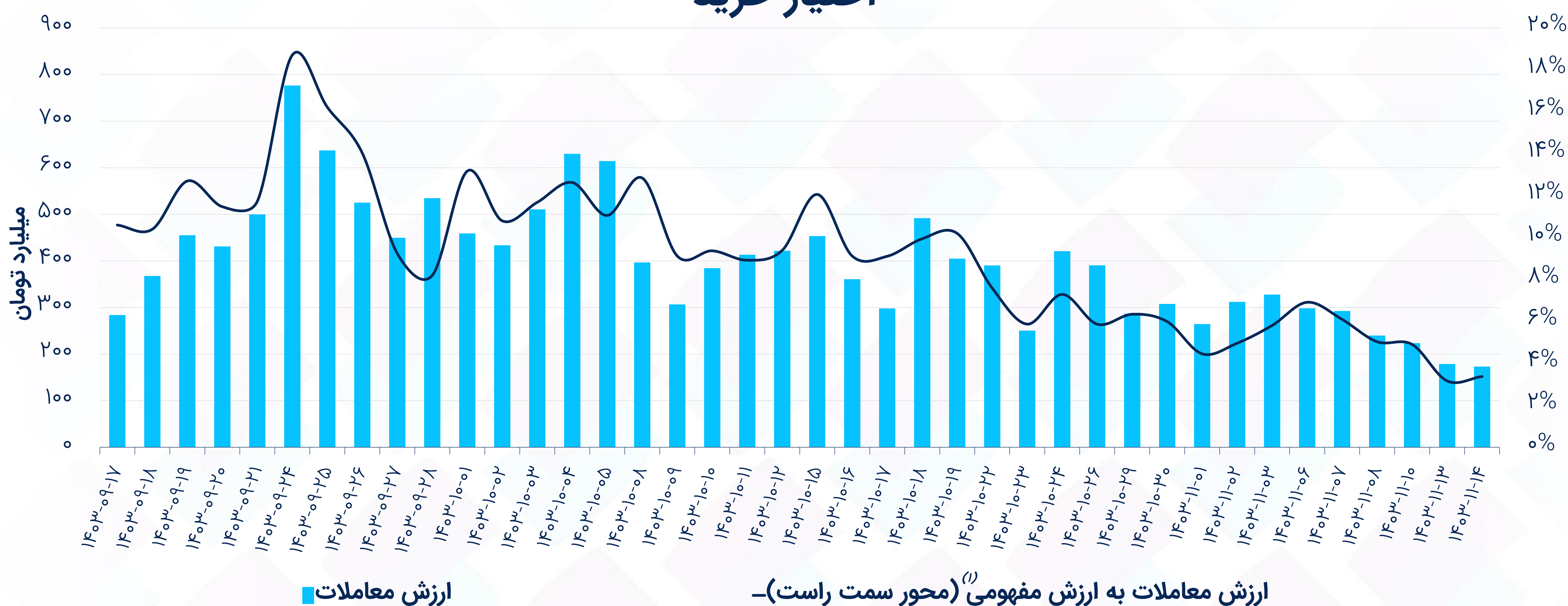




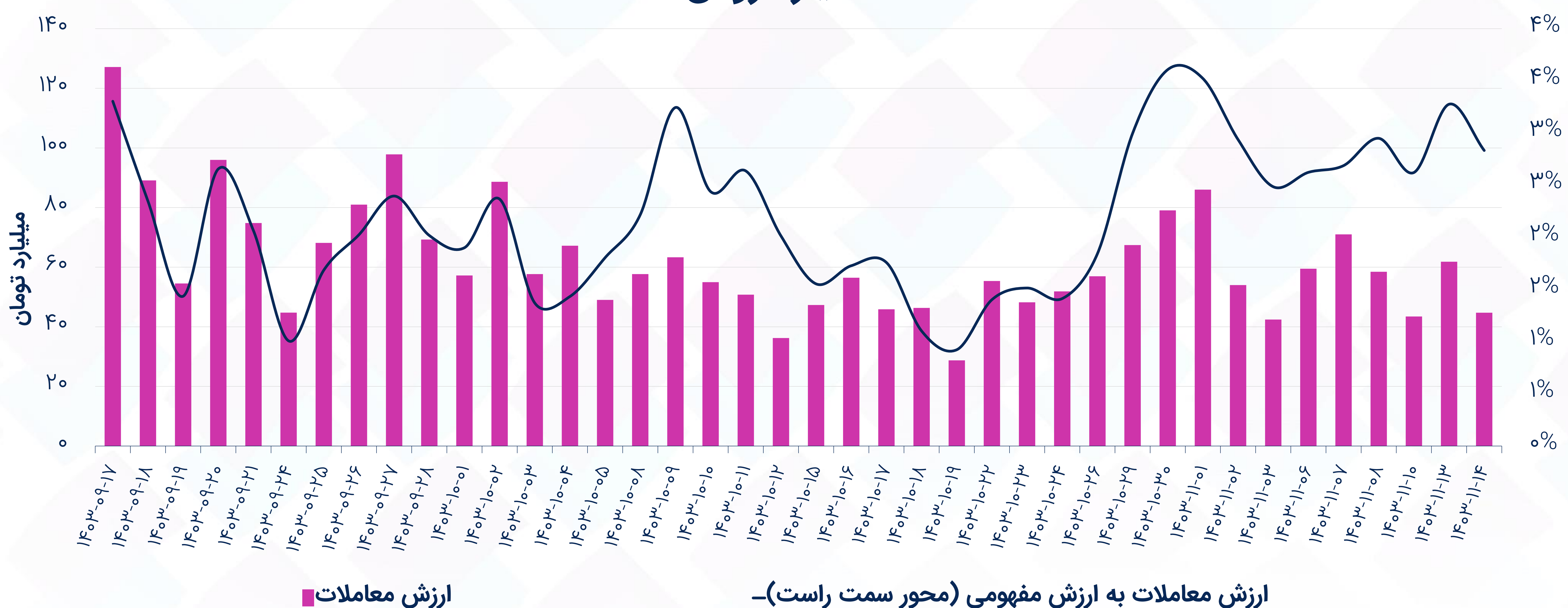
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



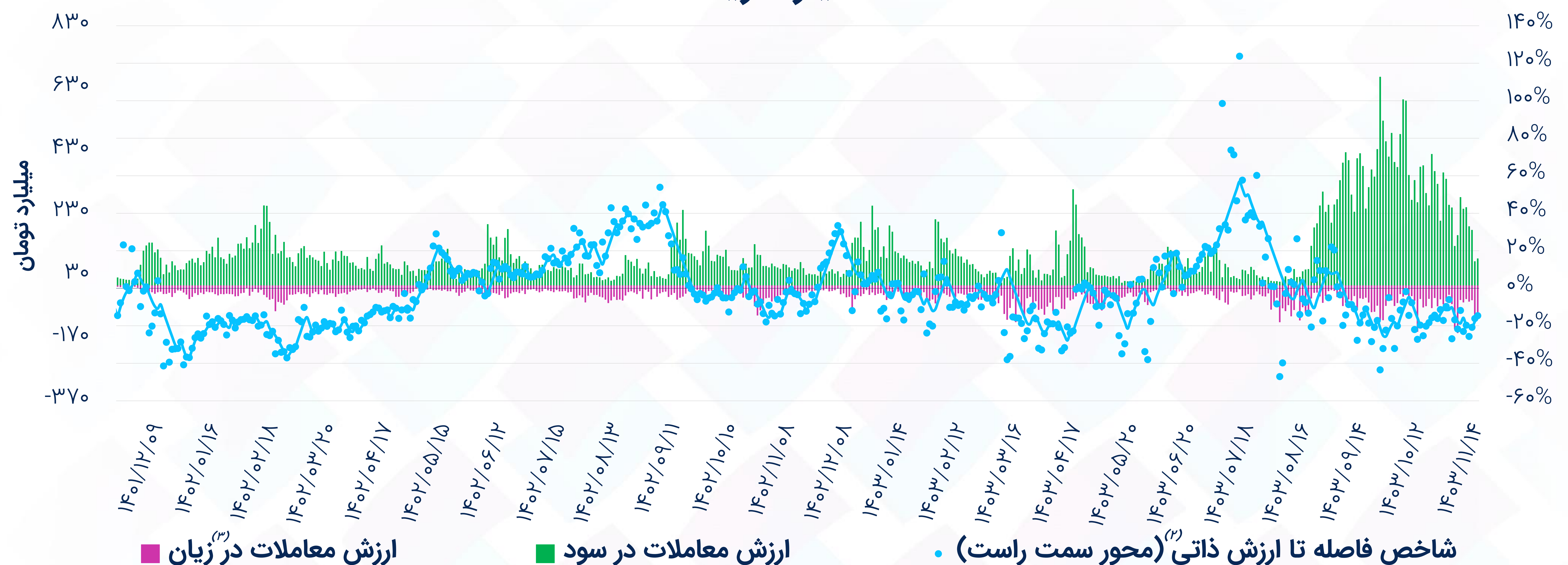
اختیار فروش



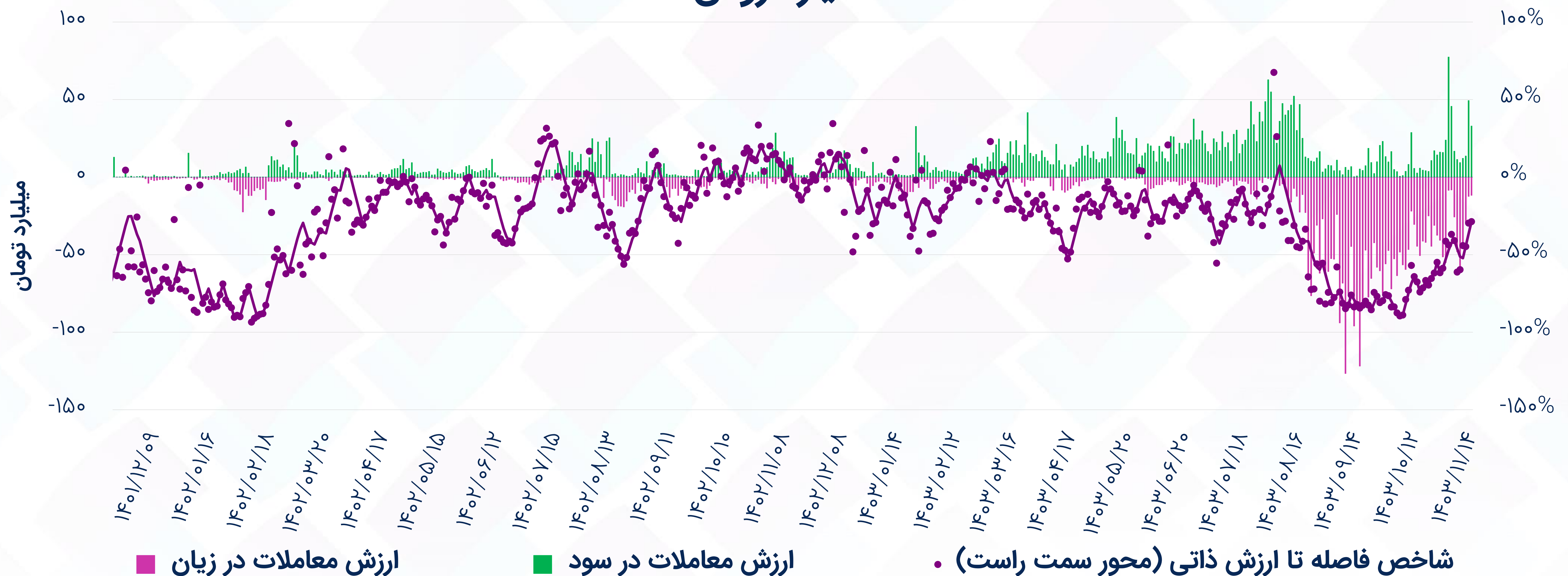
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

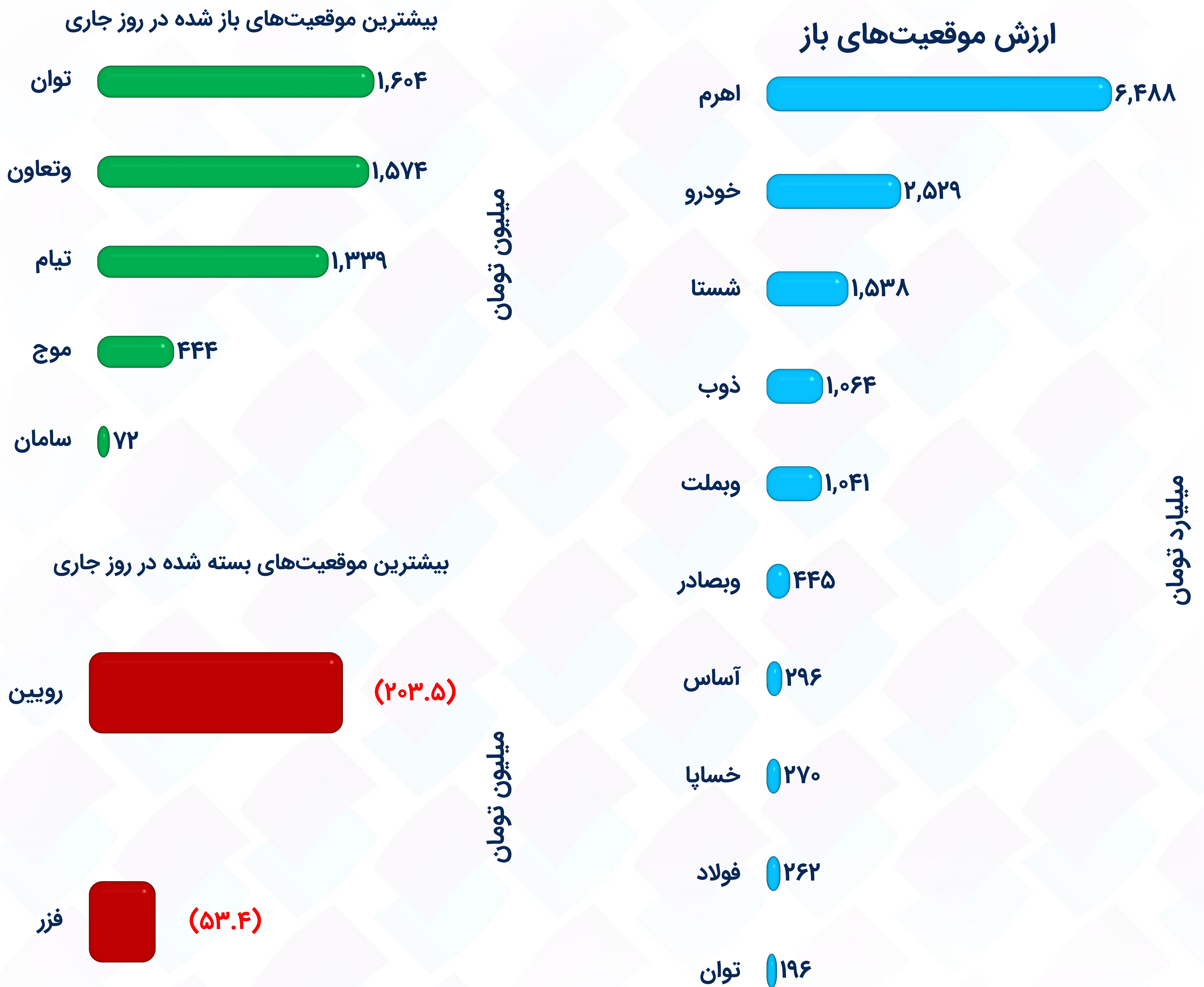
اختیار خرید

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	۳۸	۱۰۵.۲	۳,۳۶۸.۸	۳۸.۹	۶۶.۳	(۲۱.۱%)
خودرو	۳۱	۳۱.۰	۹۰۰.۸	۲۱.۷	۹.۳	۳.۷%
شستا	۳۳	۱۶.۱	۵۱۰.۵	۶.۴	۹.۷	(۲۴.۸%)
وبملت	۱۹	۶.۳	۹۹.۱	۵.۷	۰.۶	(۴.۴%)
ذوب	۲۵	۶.۱	۱۳۹.۷	۴.۵	۱.۶	(۷.۸%)
توان	۱۸	۲.۸	۹.۰	۲.۸	۰.۱	(۳.۰%)
فصبا	۱۰	۱.۶	۱۵.۲	۱.۶	۰.۰	۳۰.۵%

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	۱۴	۳۶,۰۹۶.۸	۱,۱۲۵,۳۵۴.۸	۲۹,۴۷۴.۹	۶,۶۲۱.۹	(۲۶.۱%)
خودرو	۵	۶,۶۶۹.۳	۳۳۲,۲۷۰.۲	۲,۷۹۱.۸	۳,۸۷۷.۴	(۳۵.۶%)
شستا	۷	۱,۵۰۶.۳	۹۹,۰۶۴.۲	۳۲۰.۷	۱,۱۸۵.۷	(۶۱.۴%)
ذوب	۳	۲۵۹.۵	۹,۴۷۶.۸	۲۴۷.۱	۱۲.۴	(۱۹.۵%)
وبملت	۴	۸۲.۱	۱۰,۸۱۶.۶	۲۱.۷	۶۰.۵	(۵۱.۶%)
توان	۳	۶۰.۱	۴۰۹.۰	۵۵.۵	۴.۶	(۲.۶%)
خسپا	۱	۳۱.۰	۵۶۳.۸	۳۱.۰	۰.۰	(۰.۸%)

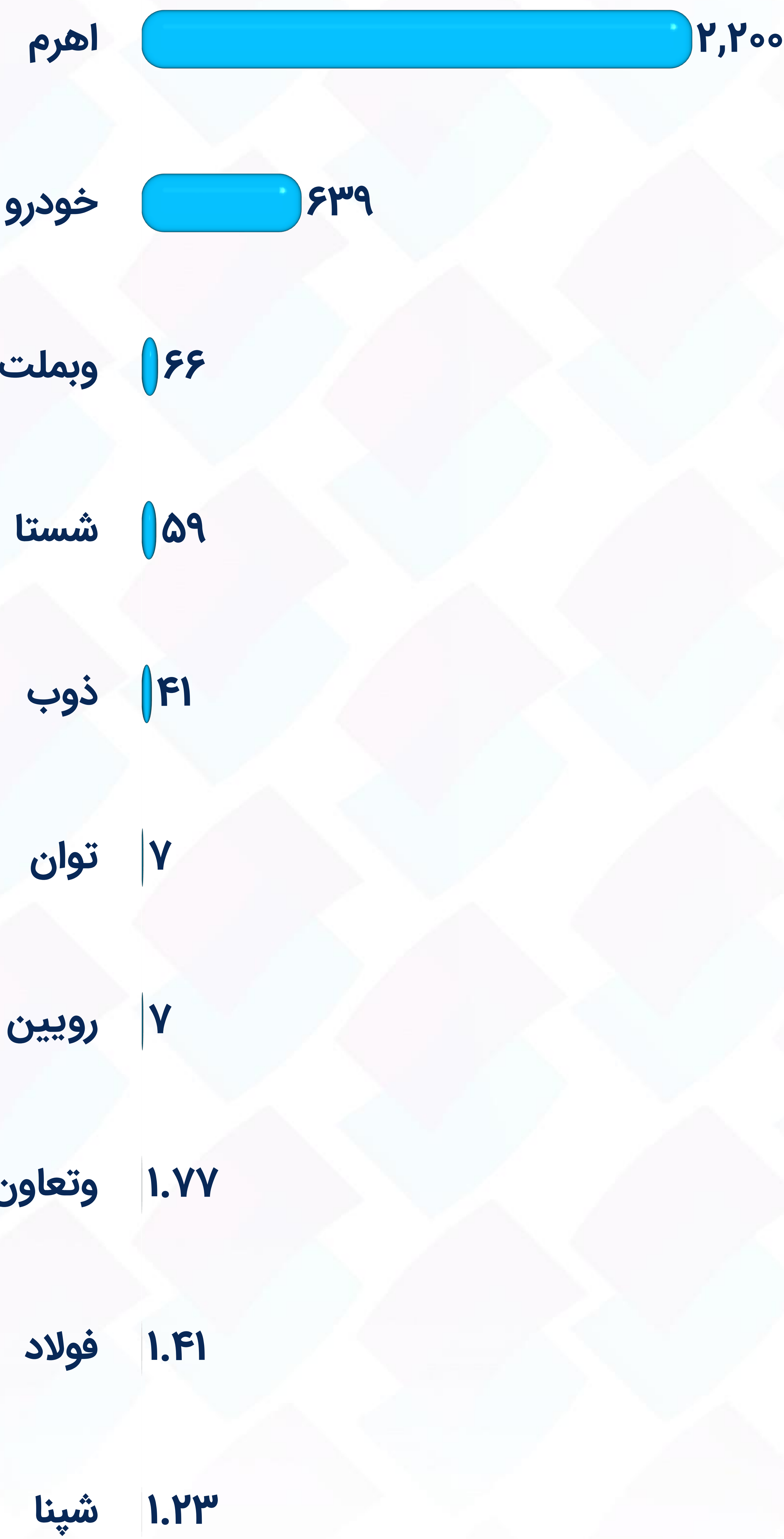
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

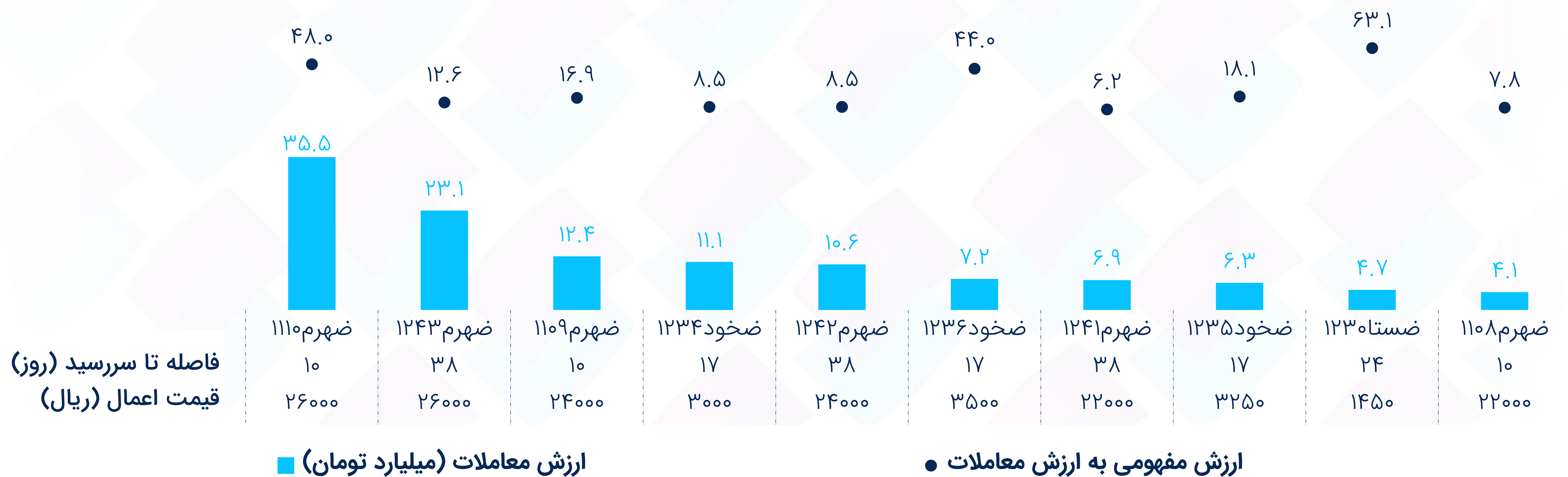


بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



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
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۲۱	۱.۱	۱۱۵	۷,۳۶۰	۷,۱۹۳	(۲.۳%)	۶۲.۵	۰.۸۶	۴۵۴	۲۹۵%
ضهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۰۸	۶.۵	۴۳۰	۲۵,۱۳۰	۳۰,۴۳۰	۲۱.۱%	۷۰.۸	۰.۳۷	۱,۱۲۷	۱۶۲%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۲۱	۹.۱	۵۵۶	۷,۳۶۰	۷,۲۱۸	(۱.۹%)	۱۳.۰	۰.۹۸	۸۳۴	۵۰%
ضسپا ۱۱۲۵	خسپا	۲,۸۰۰	۱۰	۴۵۱.۹	۶۴	۲,۸۱۹	۲,۸۶۴	۱.۶%	۴۴.۸	۰.۶۴	۸۸	۳۸%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۲۱	۱۰۱.۱	۹۰۳	۷,۳۶۰	۷,۱۴۹	(۲.۹%)	۷.۹	۱.۰۰	۱,۲۴۰	۳۷%

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	۱۰	۱.۶	۱	۴۷۲	۹۰۱	۹۱%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۱۰	۵.۴	۱	۴۷۲	۱,۰۰۱	۱۱۲%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۱۰	۲.۷	۱	۴۷۲	۸۰۱	۷۰%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۱۰	۲۱.۸	۱	۴۷۲	۷۰۱	۴۹%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۱۷	۶.۳	۴	۳,۳۸۷	۵,۰۰۴	۴۸%	۱,۲۵۱.۰	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 ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۸	۳۵.۰	۳,۵۰۱	۲۵,۱۳۰	۲۶,۴۹۹	۵.۴%	۷.۶	-۰.۸۶	۳,۹۵۵	۱۳.۰%
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۱۰	۱.۳	۱۱۵	۴۷۲	۴۸۵	۲.۸%	۴.۲	-۱.۰۰	۱۲۲	۵.۷%
طتوان ۱۲۲۳	توان	۳۰,۰۰۰	۳۵	۵۳.۵	۴,۸۶۴	۲۴,۱۹۷	۲۵,۱۳۶	۳.۹%	۵.۲	-۰.۹۴	۴,۸۷۹	۰.۳%
طسپا ۱۲۳۸	خسپا	۳,۰۰۰	۳۸	۳۱.۰	۱۵۵	۲,۸۱۹	۲,۸۴۵	۰.۹%	۱۸.۴	-۰.۵۷	۱۵۴	(۰.۸%)
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۰	۳۳.۶	۸,۶۱۵	۲۵,۱۳۰	۲۵,۳۸۵	۱.۰%	۲.۹	-۱.۰۰	۸,۵۰۳	(۱.۳%)

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
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۰	۱۹.۶	۱۹	۲۵,۱۳۰	۱۷,۹۸۱	(۲۸.۴%)	۹۴۶.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۰	۳.۴	۲۲	۲۵,۱۳۰	۱۹,۹۷۸	(۲۰.۵%)	۹۰۸.۱	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۱۰	۱۲.۴	۱	۴۷۲	۳۹۹	(۱۵.۵%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۱%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۲۴	۵.۱	۶	۱,۳۲۵	۱,۱۴۴	(۱۳.۷%)	۱۹۰.۷	-۰.۰۱	۰	(۹۴.۰%)
طملت ۱۱۷۳	وبملت	۲,۸۰۰	۱۰	۱.۴	۴	۳,۱۶۷	۲,۷۹۶	(۱۱.۷%)	۶۹۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۱.۲%)

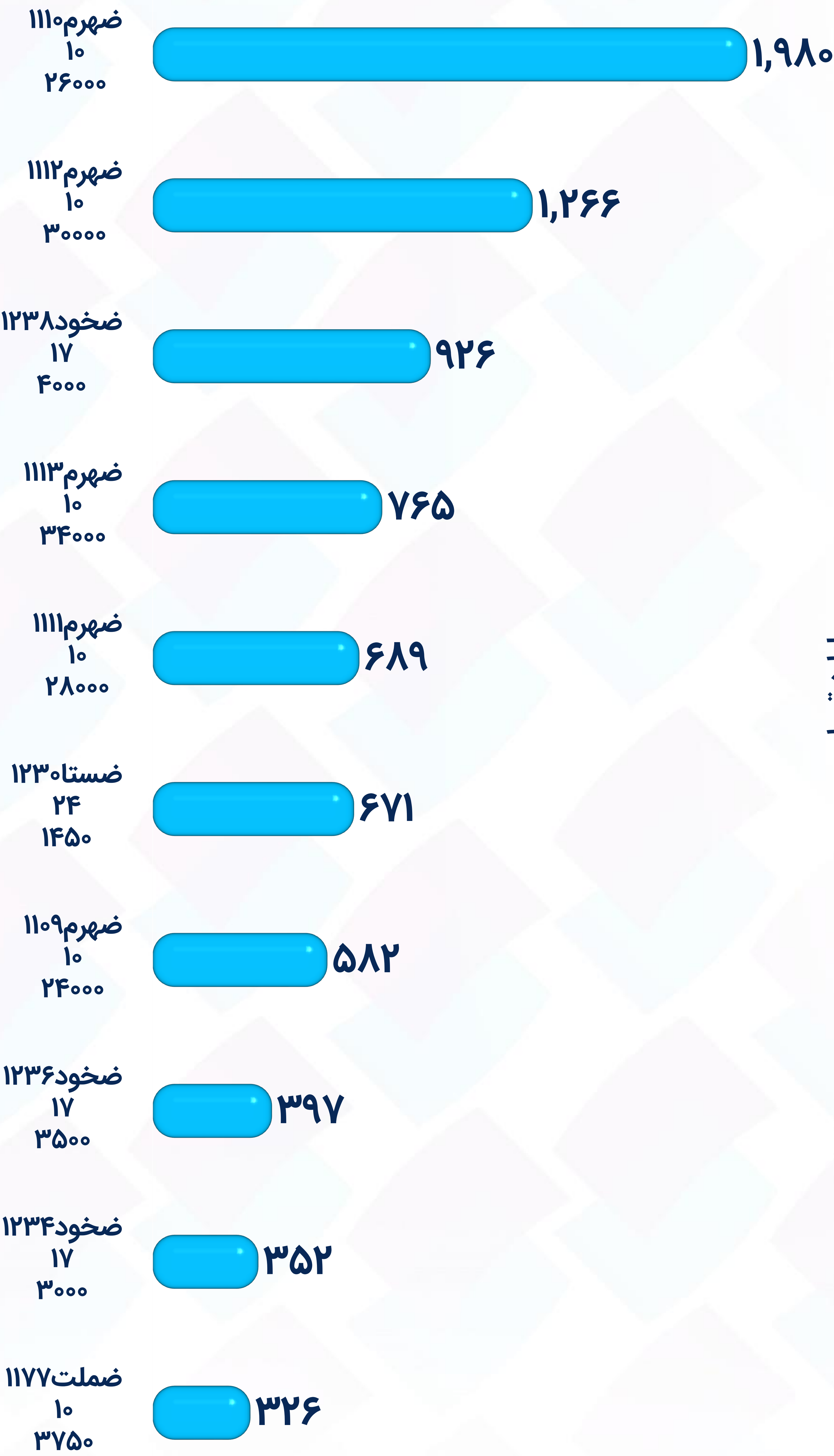
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

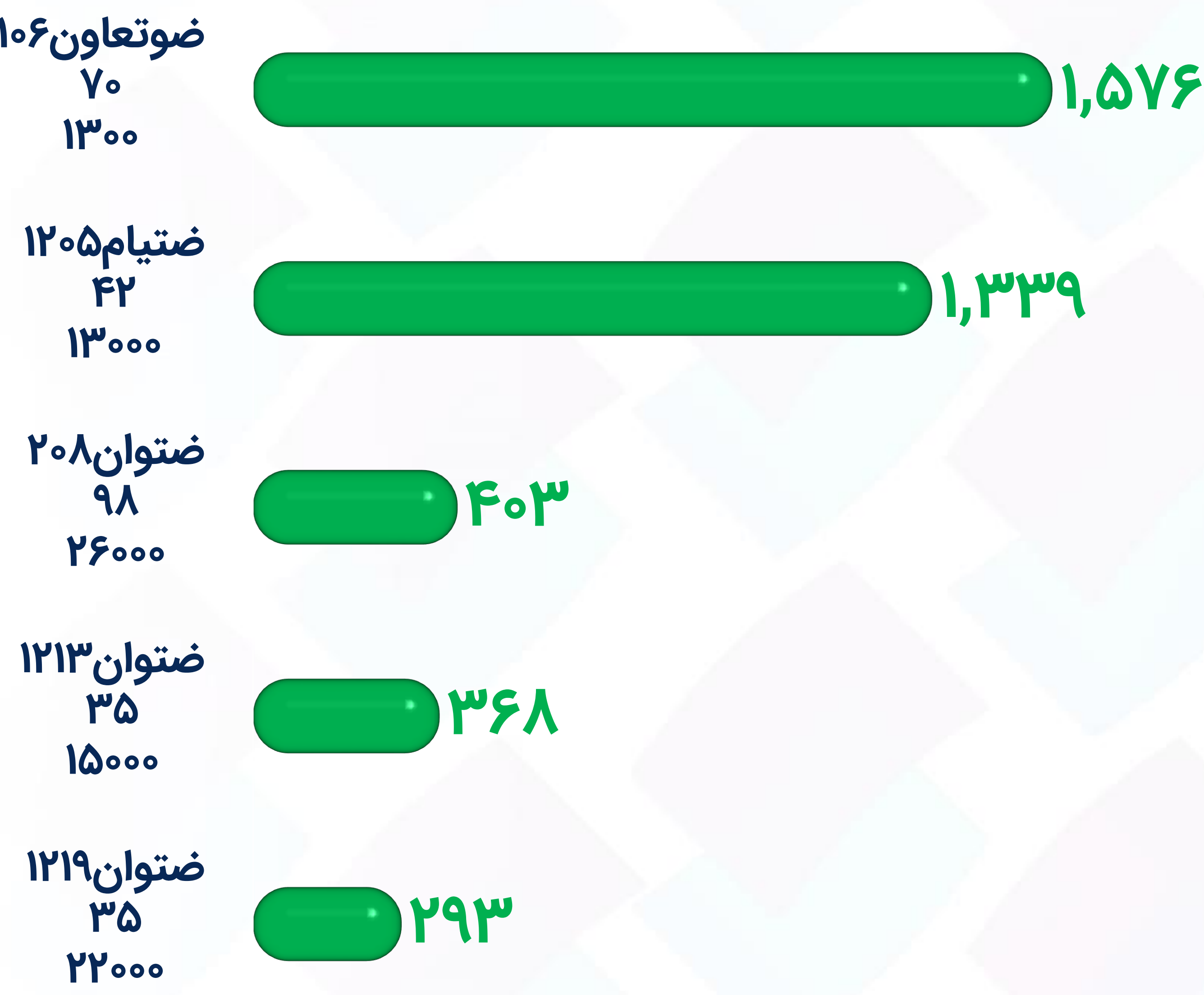
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

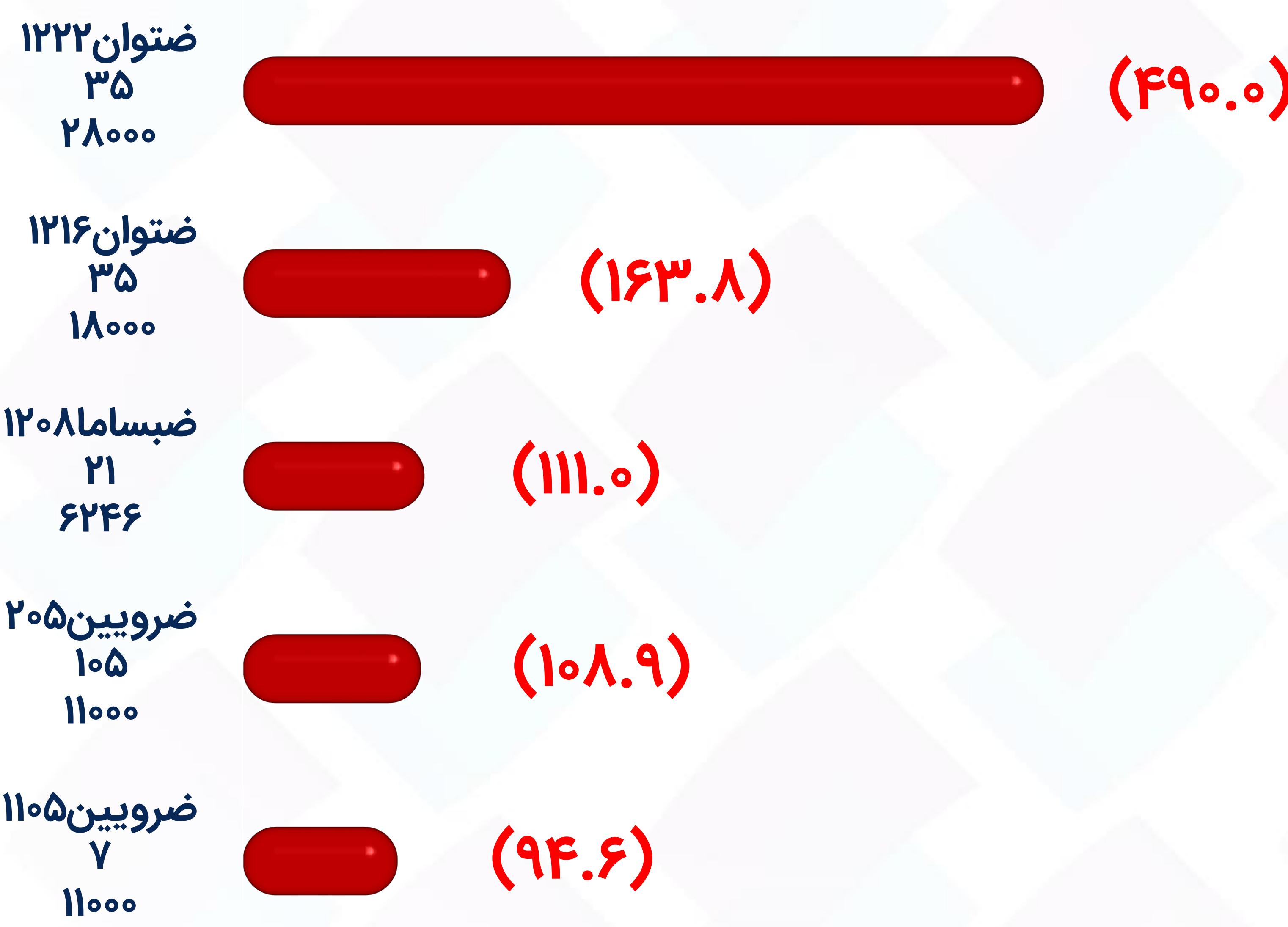
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

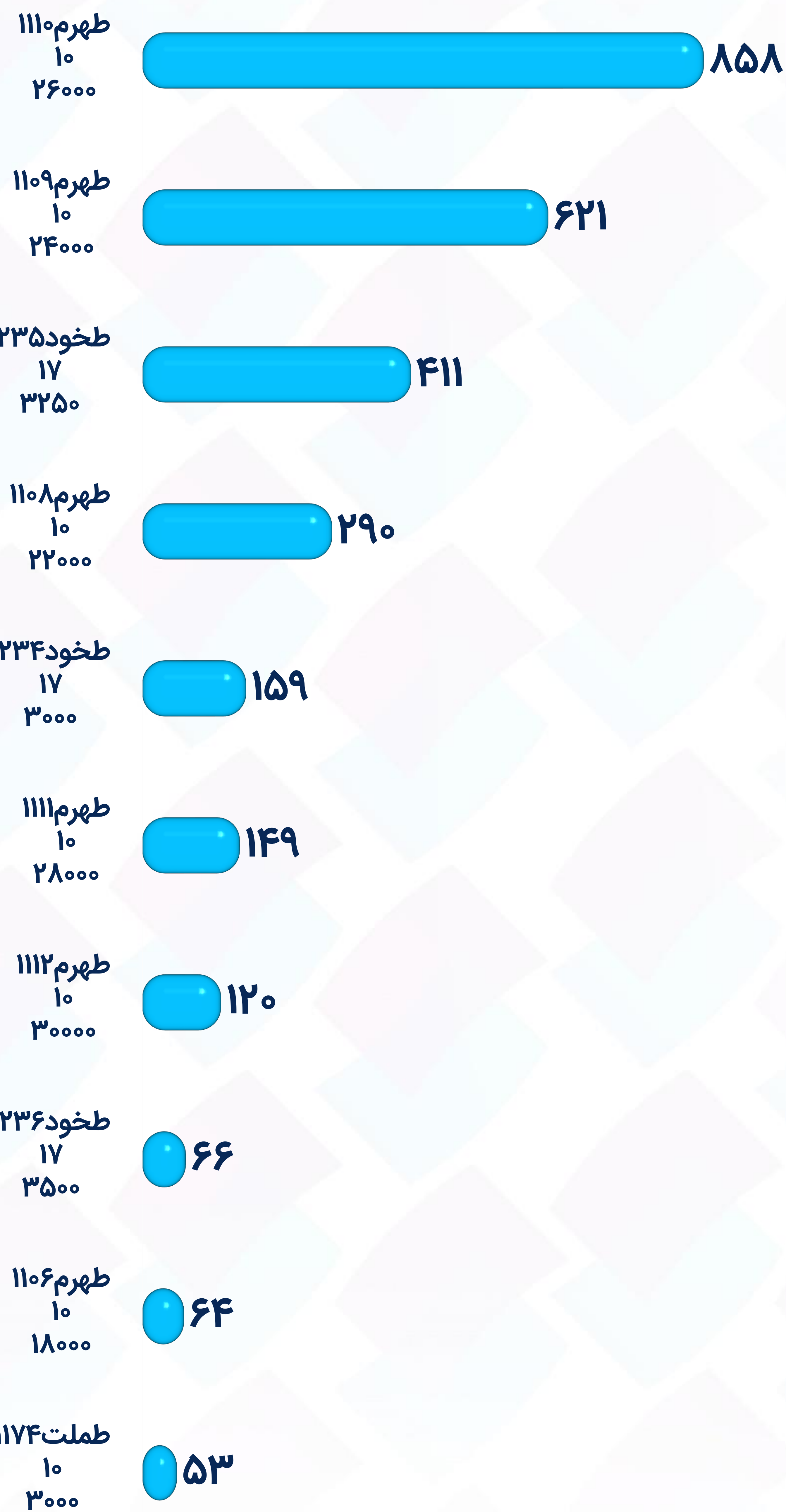


میلیون تومان

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

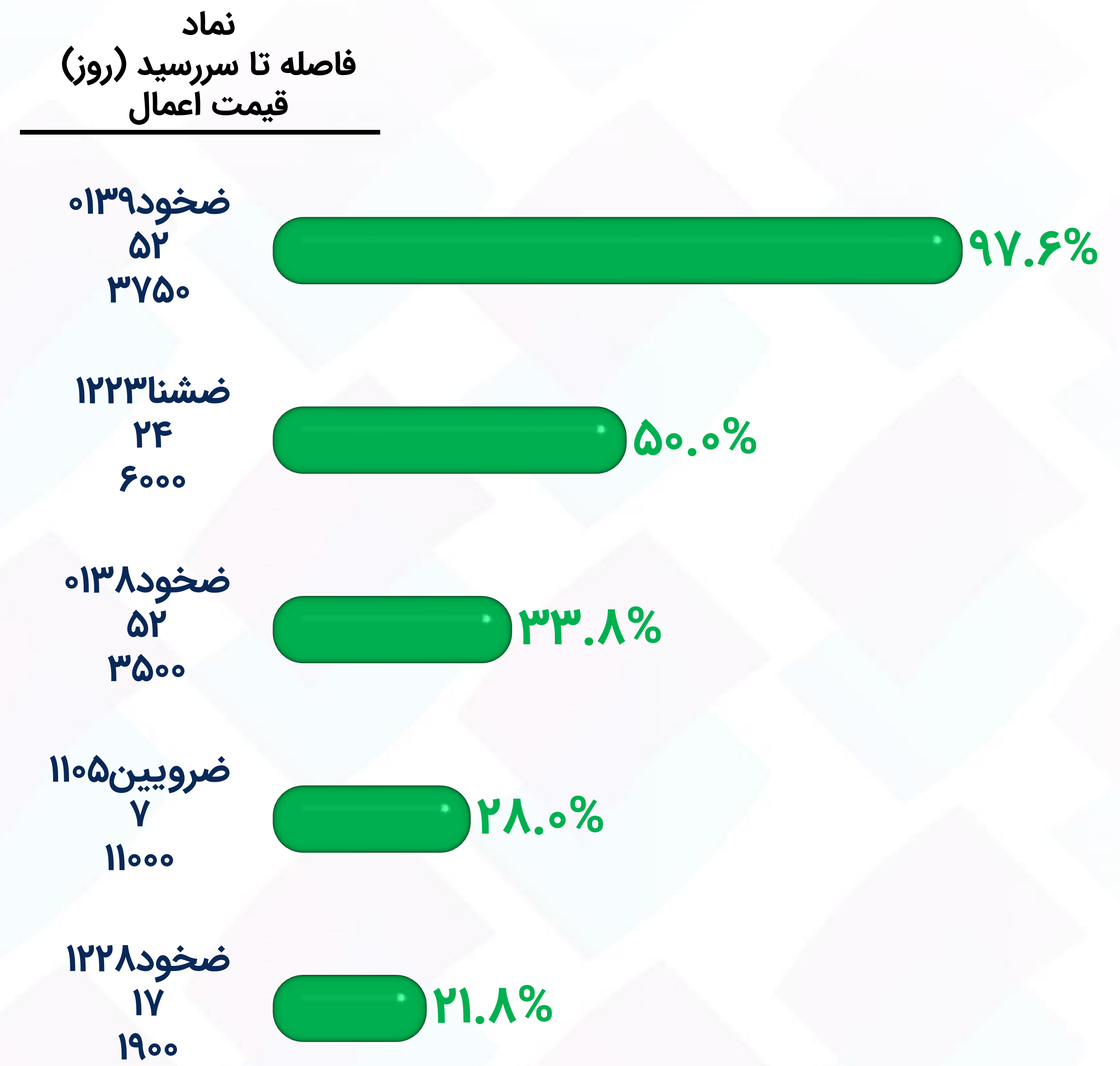
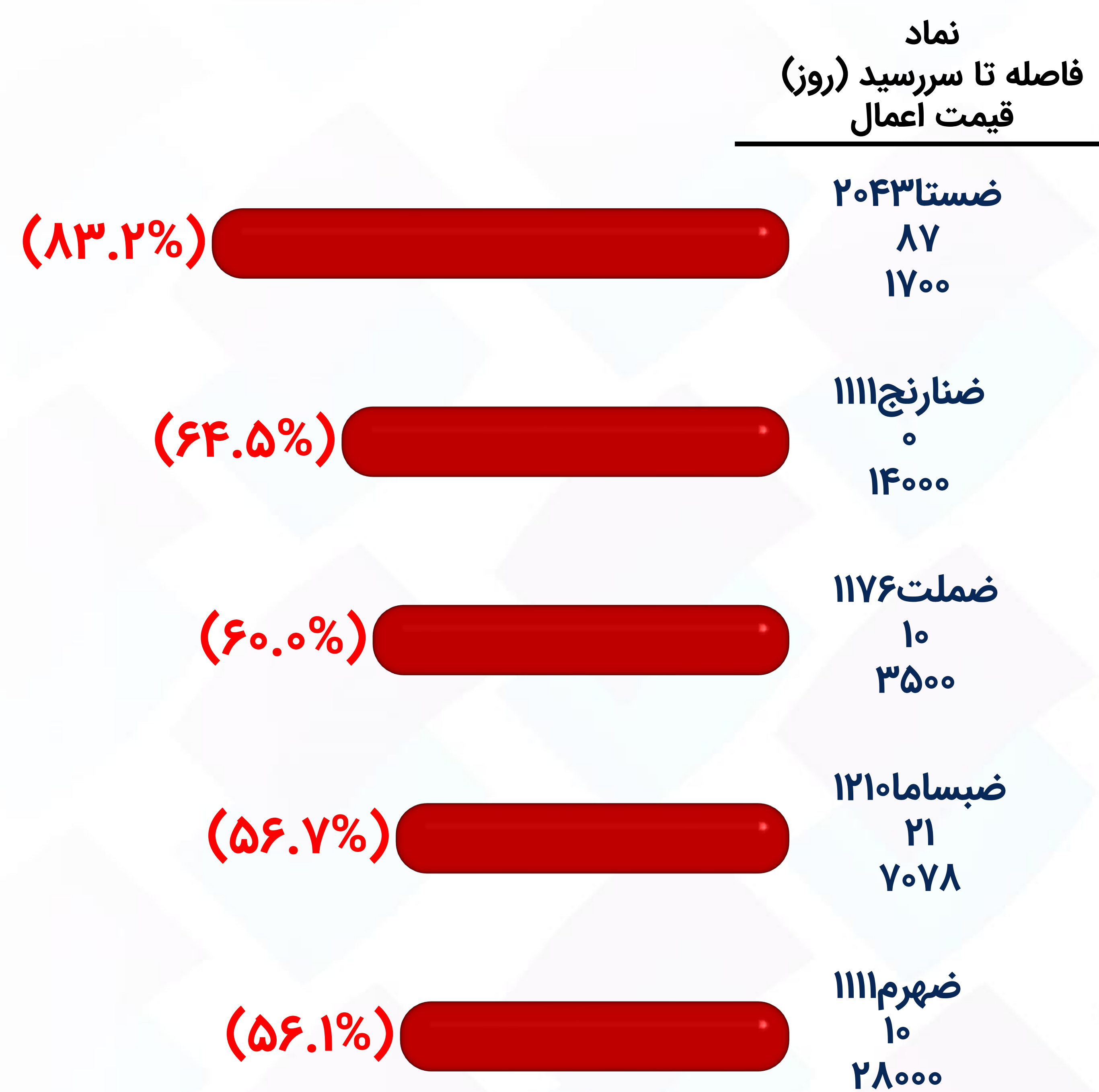
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



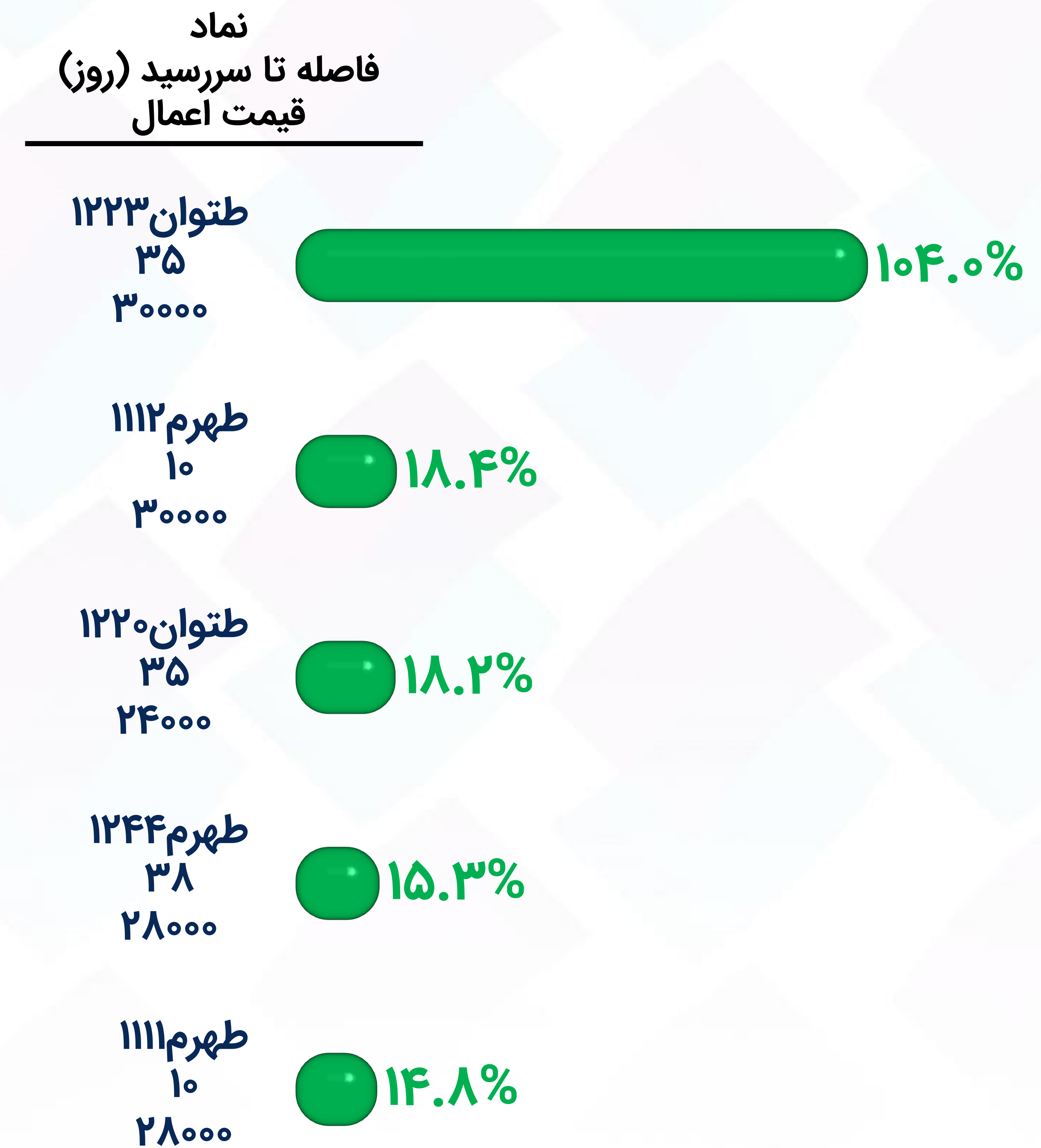
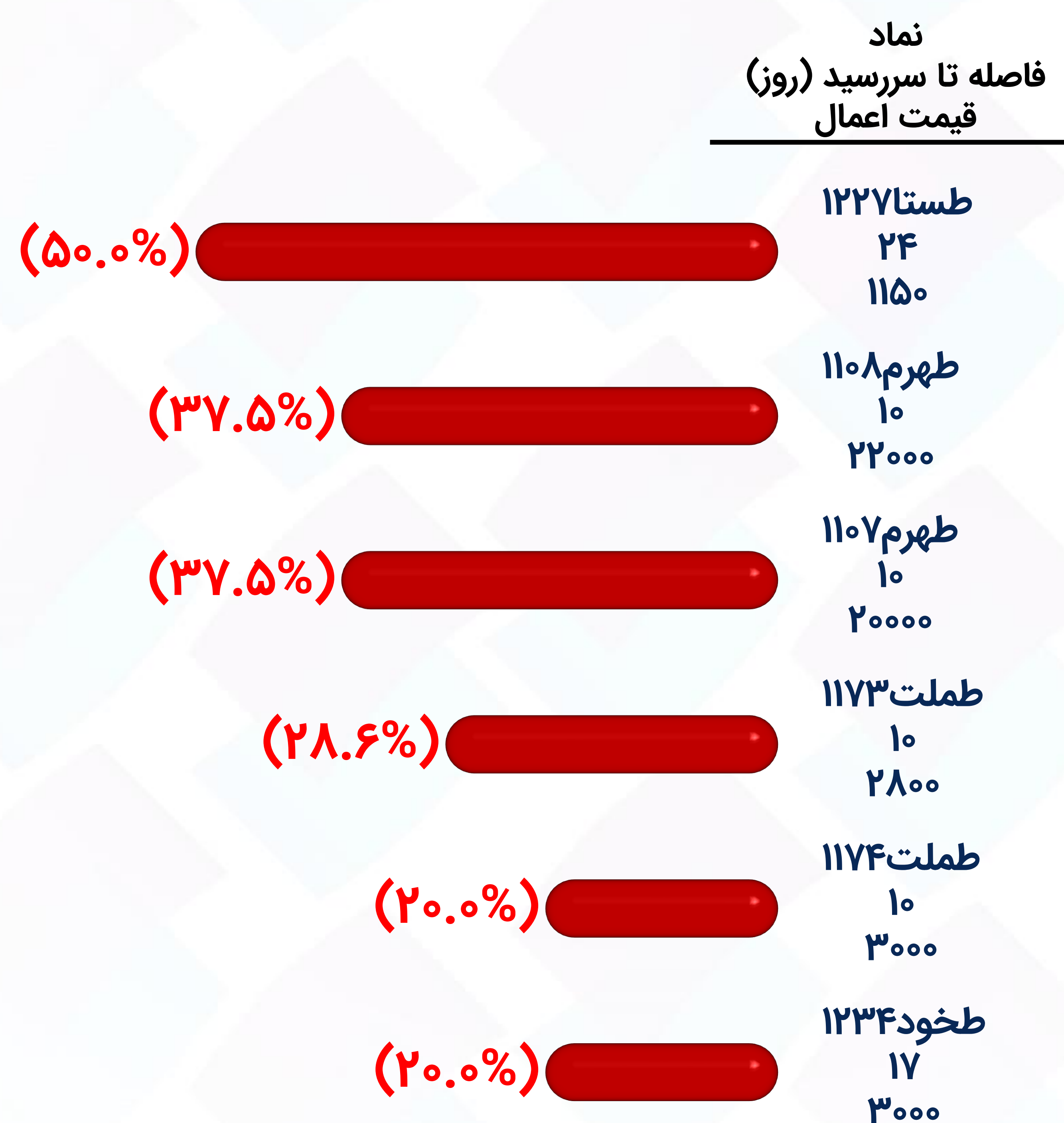
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

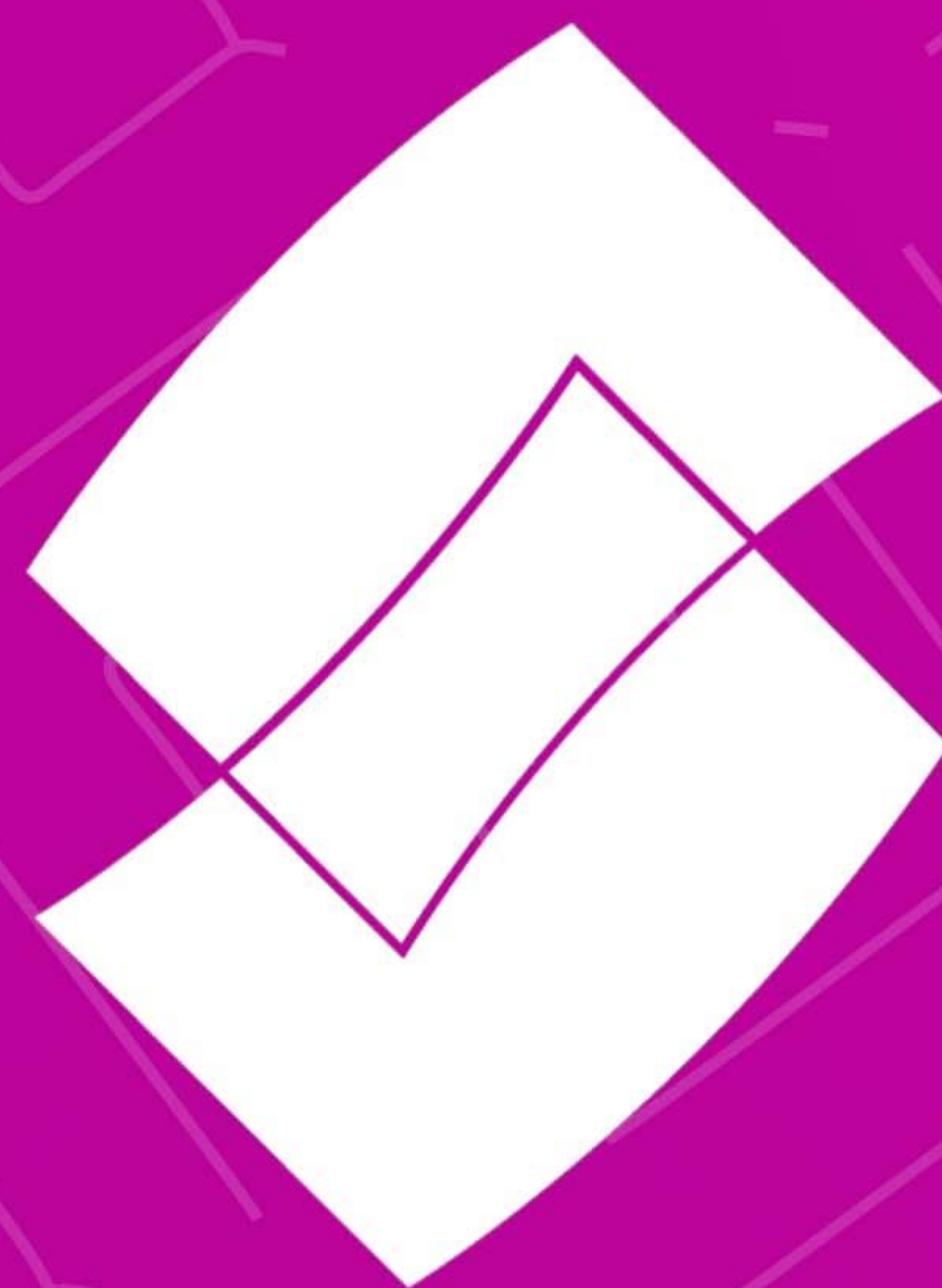
اختیار خرید



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.