

شماره
۴۲۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۶ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





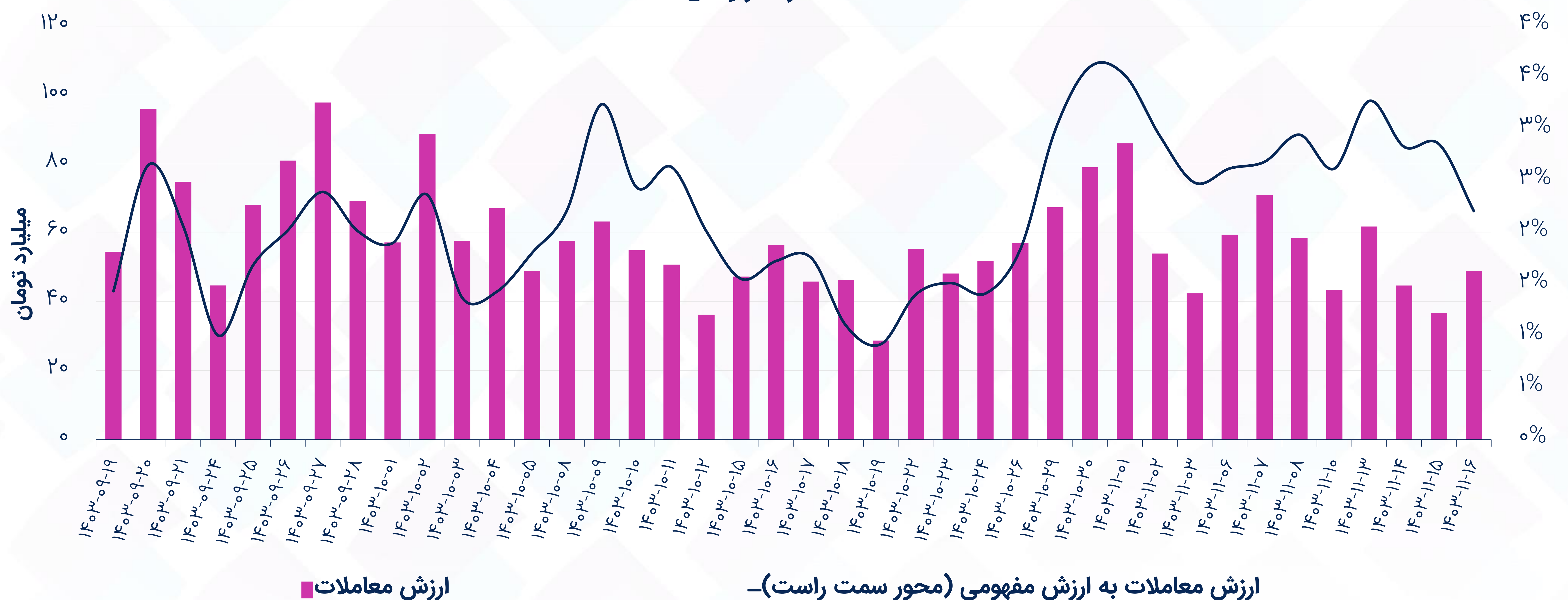
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



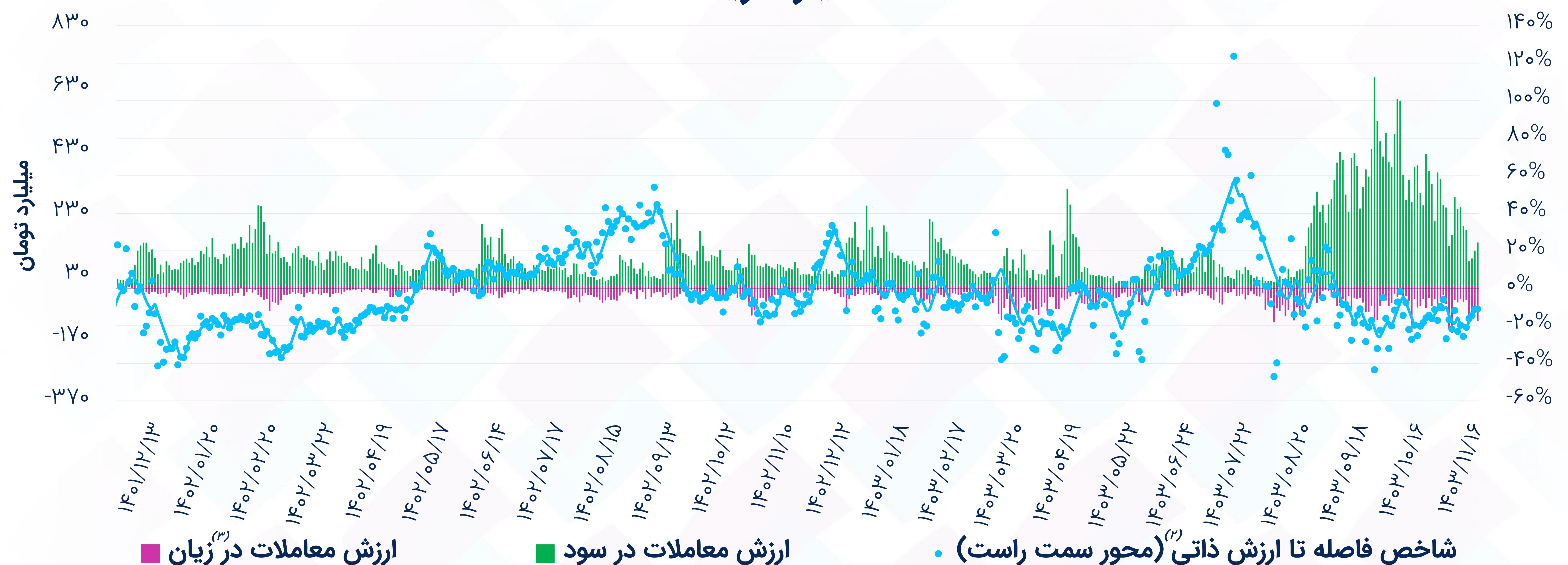
اختیار فروش



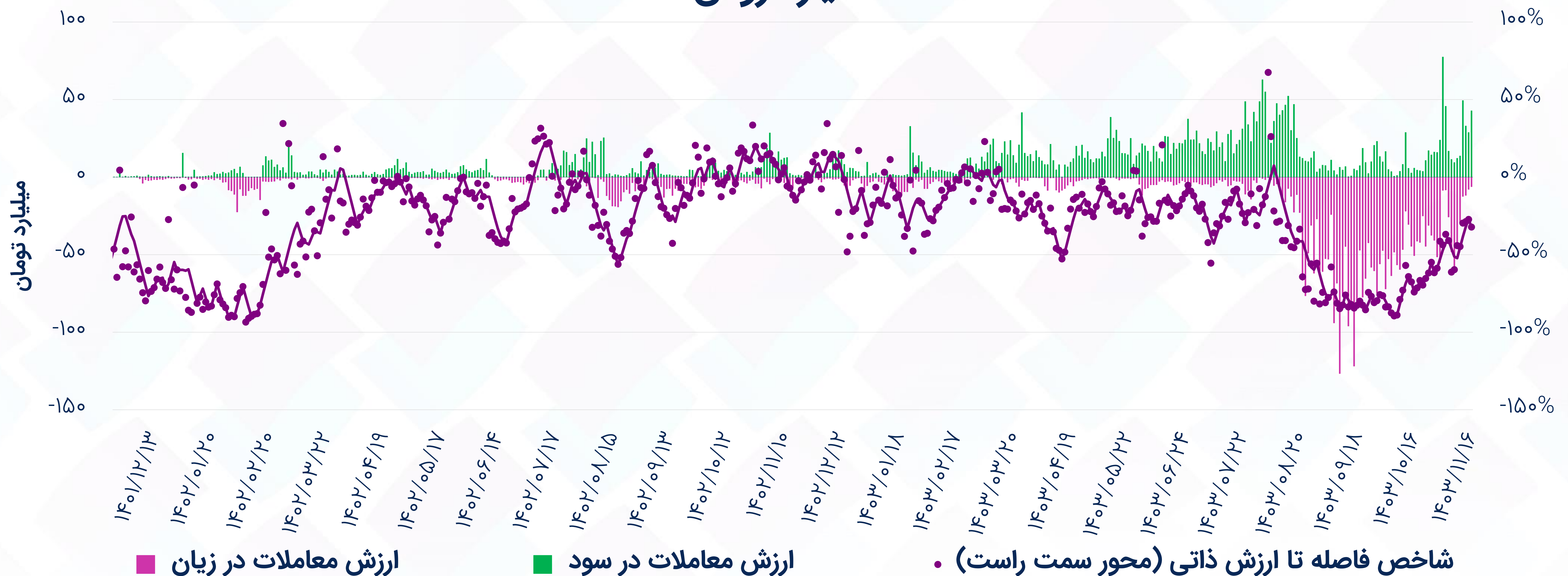
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

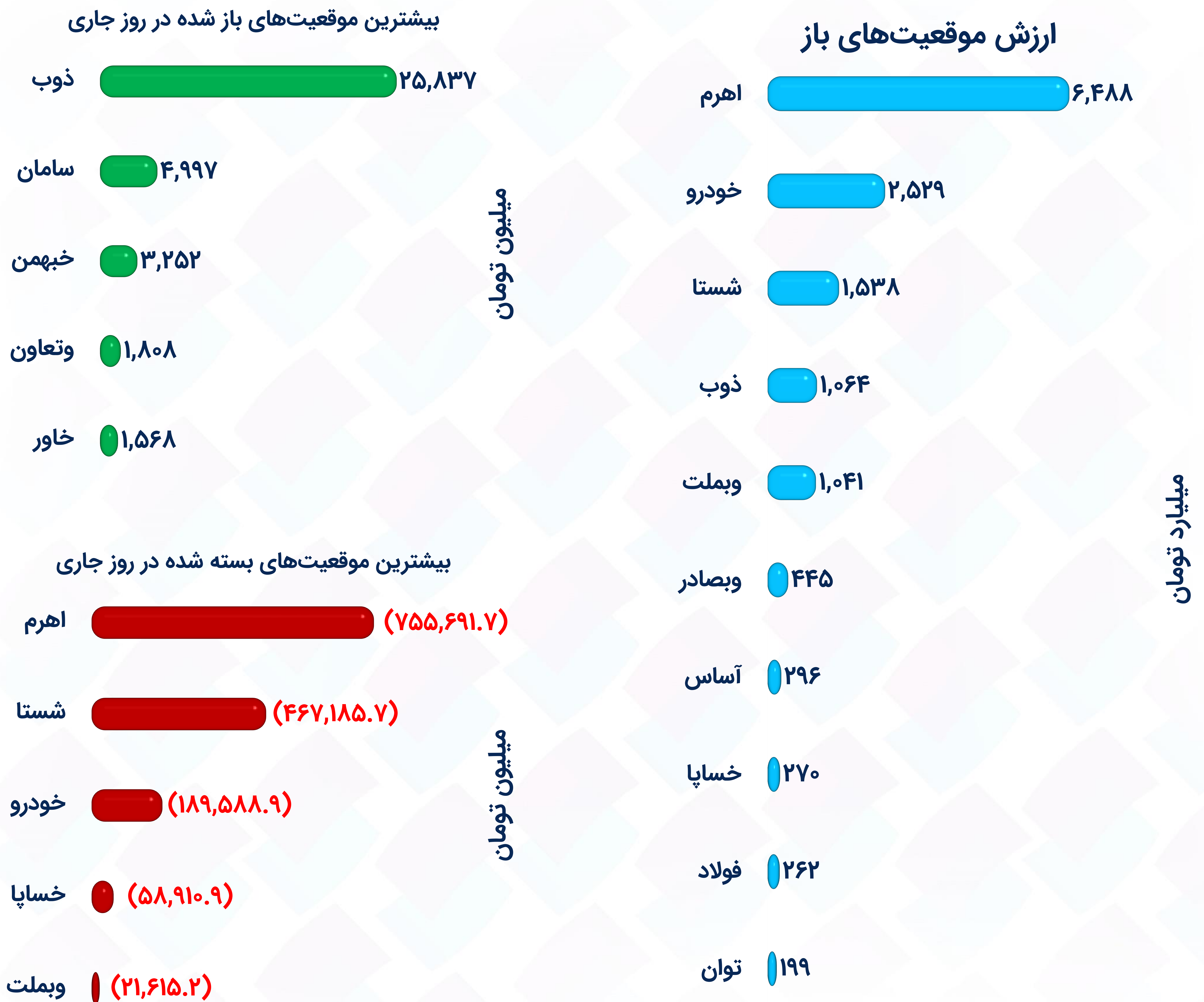
اختیار خرید

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	۴۹	۱۸۰.۲	۳,۹۸۱.۶	۸۲.۹	۹۷.۳	(۱۲.۹%)
شستا	۴۵	۲۹.۲	۶۵۱.۸	۱۷.۶	۱۱.۶	(۱۶.۳%)
وبملت	۲۲	۱۰.۸	۱۵۶.۶	۹.۴	۱.۴	(۰.۶%)
ذوب	۲۸	۱۰.۳	۱۴۲.۵	۷.۵	۲.۸	(۷.۶%)
خسپا	۱۹	۱۰.۰	۲۲۰.۲	۹.۲	۰.۸	۱۳.۱%
شتاب	۱۸	۲.۹	۱۴.۶	۲.۹	۰.۰	۳.۱%
سامان	۷	۲.۲	۶.۷	۲.۲	۰.۰	(۸.۱%)

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	۱۵	۴۷,۱۴۴.۶	۲,۱۱۳,۷۸۶.۳	۴۲,۶۵۰.۸	۴,۴۹۳.۸	(۳۱.۱%)
شستا	۱۶	۱,۶۷۴.۹	۸۶,۵۱۲.۶	۵.۰	۱,۶۶۹.۹	(۶۴.۲%)
ذوب	۵	۹۲.۴	۲,۷۳۴.۸	۹۰.۳	۲.۲	(۱۹.۱%)
وبملت	۴	۲۹.۸	۱۰,۳۵۰.۴	۱۶.۶	۱۳.۲	(۵۸.۷%)
توان	۳	۹.۰	۳۹۸.۹	۰.۴	۸.۶	(۱۹.۹%)
خودران	۳	۶.۶	۱۸۲.۳	۵.۳	۱.۳	(۳۷.۴%)
فولاد	۲	۰.۸	۳۳۸.۰	۰.۰	۰.۸	(۹۳.۷%)

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

اهرم ۲,۲۰۰

خودرو ۶۳۹

وبملت ۶۶

شستا ۵۹

ذوب ۴۱

توان ۷

رویین ۷

وتعاون ۱.۷۷

فولاد ۱.۴۱

شپنا ۱.۲۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۴۶,۰۶۱.۲

خودرو ۱۴۳,۵۰۰.۱

وبملت ۲,۶۱۴.۲

ذوب ۲,۵۶۲.۲

خودرا
ن ۱۱۱.۱

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۶۷,۸۰۱.۲)

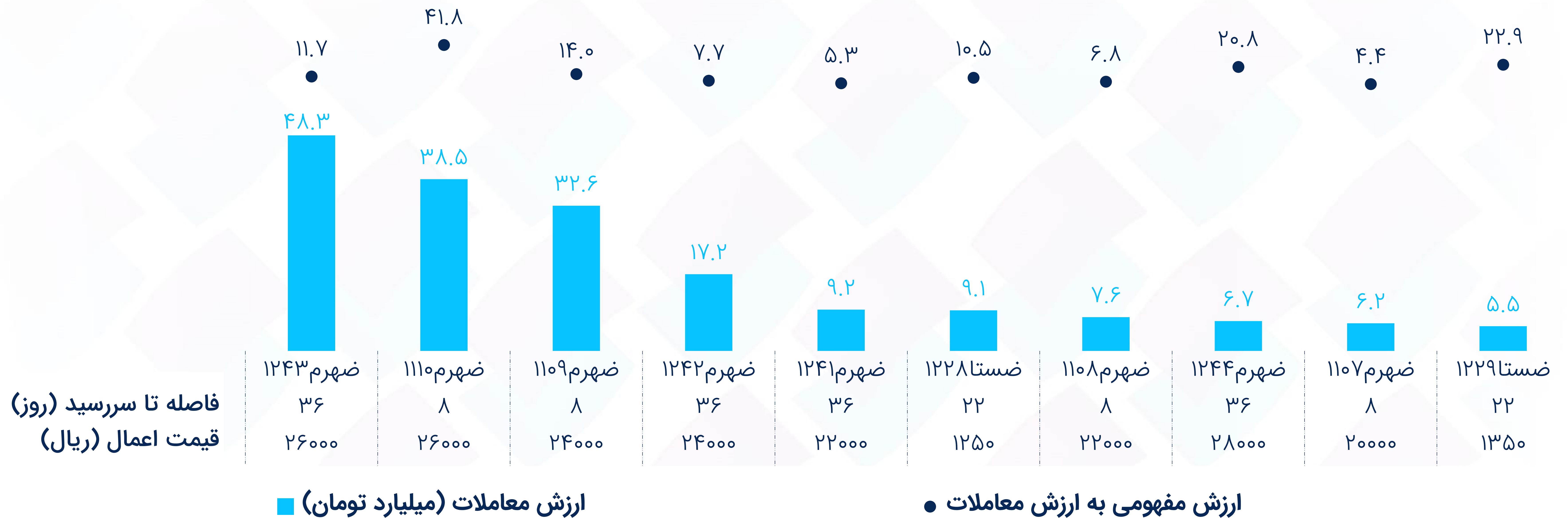
شپنا (۱۱۲.۳)

فولاد (۶۶.۷)

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
ضتیام ۱۲۰۲	تیام	۱۰,۰۰۰	۴۰	۲۰.۰	۲,۰۰۱	۱۳,۲۹۰	۱۲,۰۰۱	(۹.۷%)	۶.۰	۱.۰۰	۳,۶۶۰	۸۳%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۱۹	۷۹.۲	۶۶۵	۷,۴۸۰	۷,۳۲۷	(۲.۰%)	۱۱.۰	۱.۰۰	۹۳۴	۴۰%
ضسپا ۱۱۲۵	خسپا	۲,۸۰۰	۸	۴,۷۴۱.۵	۱۰۹	۲,۹۱۰	۲,۹۰۹	(۰.۰%)	۲۶.۷	۰.۸۴	۱۴۴	۳۲%
ضهمن ۱۱۲۱	خبهمن	۱,۸۰۰	۱۲	۳.۰	۳۰۰	۲,۱۷۲	۲,۱۰۰	(۳.۳%)	۷.۰	۱.۰۰	۳۹۱	۳۰%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۱۹	۳۷۱.۷	۱,۰۳۰	۷,۴۸۰	۷,۲۷۶	(۲.۷%)	۷.۱	۱.۰۰	۱,۳۴۲	۳۰%

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	۸	۷.۳	۱	۴۸۰	۱,۰۰۱	۱۰۹%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۸	۱.۲	۱	۴۸۰	۸۰۱	۶۷%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۸	۷.۳	۱	۴۸۰	۷۰۱	۴۶%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۹۵.۲	۲۴	۲۵,۷۵۰	۳۴,۰۲۴	۳۲%	۱,۴۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۶	ذوب	۸۰۰	۳۶	۱.۵	۴	۴۸۰	۸۰۴	۶۸%	۲۰۱.۰	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 ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۶	۸.۶	۴,۷۸۲	۲۵,۷۵۰	۲۹,۲۱۸	۱۳.۵%	۶.۱	-۰.۹۸	۷,۱۰۴	۴۸.۵%
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۲۷.۳	۷,۸۱۴	۲۵,۷۵۰	۲۶,۱۸۶	۱.۷%	۳.۴	-۱.۰۰	۷,۹۷۶	۲.۱%
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۸	۳,۶۶۱.۴	۴,۰۹۲	۲۵,۷۵۰	۲۵,۹۰۸	۰.۶%	۶.۳	-۰.۹۹	۴,۰۱۱	(۲.۰%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۸	۱,۵۹۷.۷	۲,۲۶۲	۲۵,۷۵۰	۲۵,۷۳۸	(۰.۰%)	۱۱.۴	-۰.۹۱	۲,۰۸۶	(۷.۸%)
طدوب ۱۱۳۰	ذوب	۵۰۰	۸	۸۸.۴	۲۵	۴۸۰	۴۷۵	(۱.۰%)	۱۹.۰	-۰.۷۱	۲۱	(۱۶.۹%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

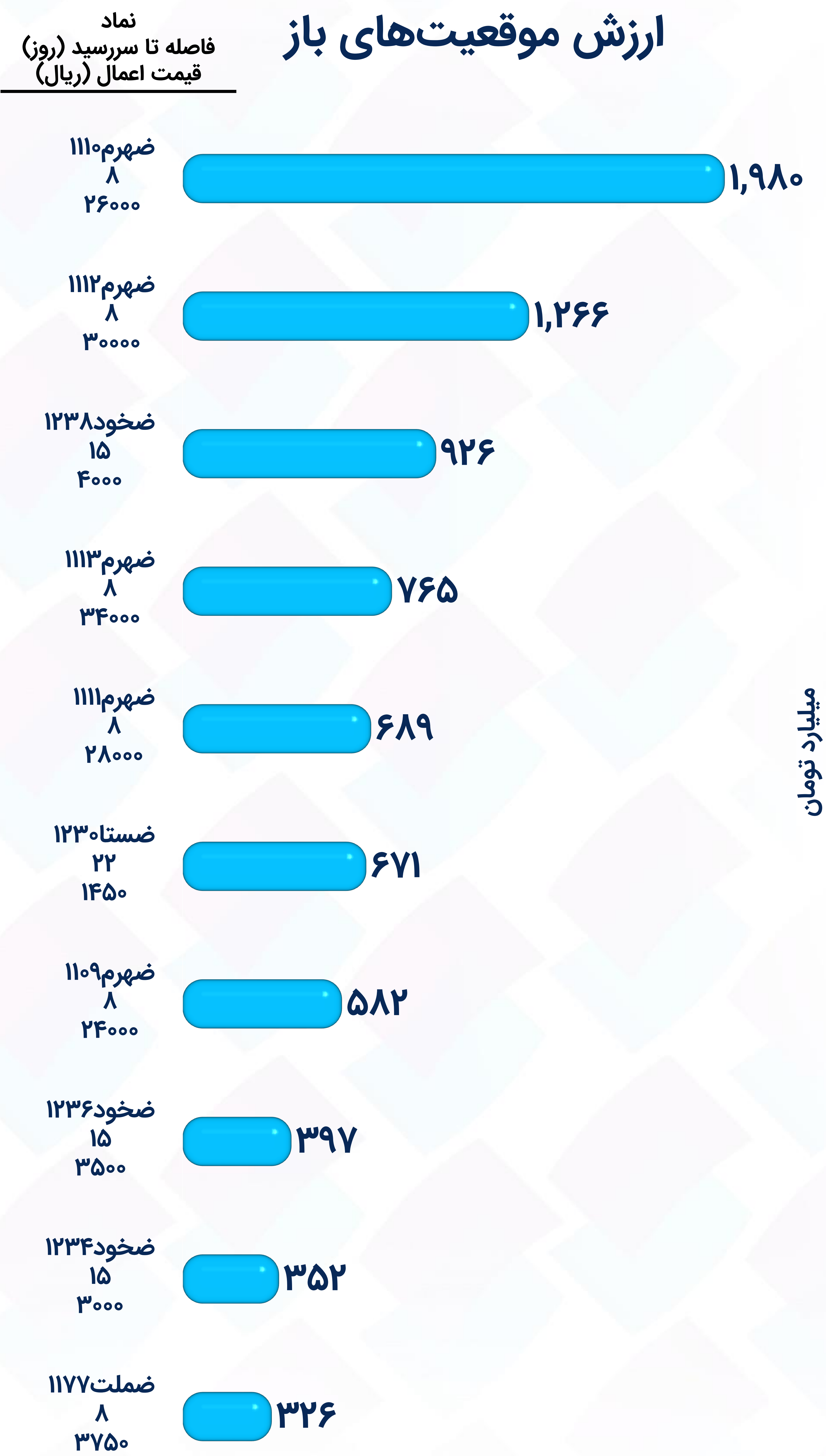
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۸	۱۰.۵	۱۵	۲۵,۷۵۰	۱۷,۹۸۵	(۳۰.۲%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۸	۱.۳	۱۶	۲۵,۷۵۰	۱۹,۹۸۴	(۲۲.۴%)	۱,۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طدوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۸	۲.۱	۱	۴۸۰	۳۹۹	(۱۶.۹%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طملت ۱۱۷۳	وبملت	۲,۸۰۰	۸	۲.۰	۱	۳,۲۳۱	۲,۷۹۹	(۱۳.۴%)	۲,۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۶%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۲۲	۱.۹	۴	۱,۳۵۳	۱,۱۴۶	(۱۵.۳%)	۲۸۶.۵	۰.۰۰	۰	(۹۷.۵%)

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

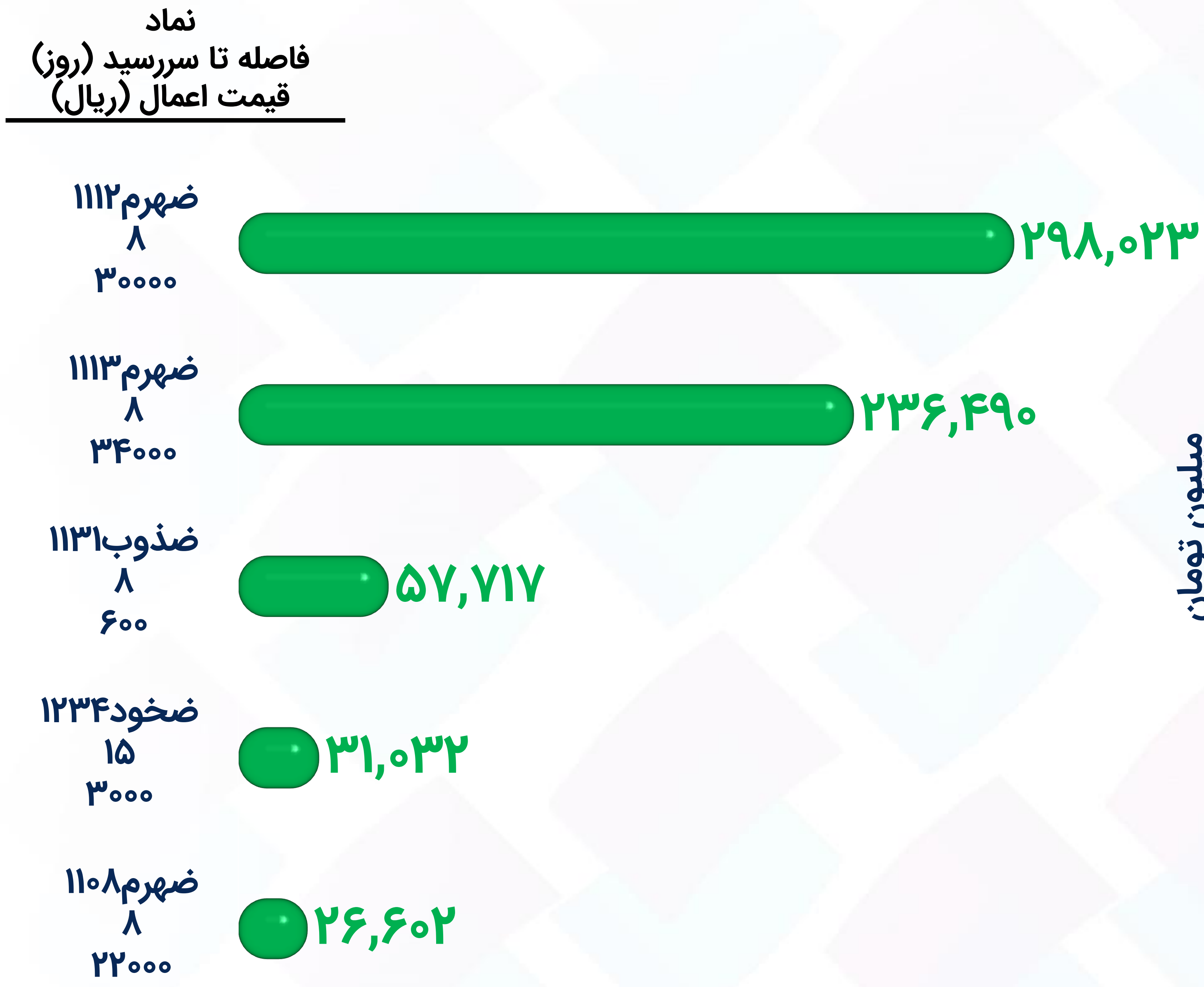


موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

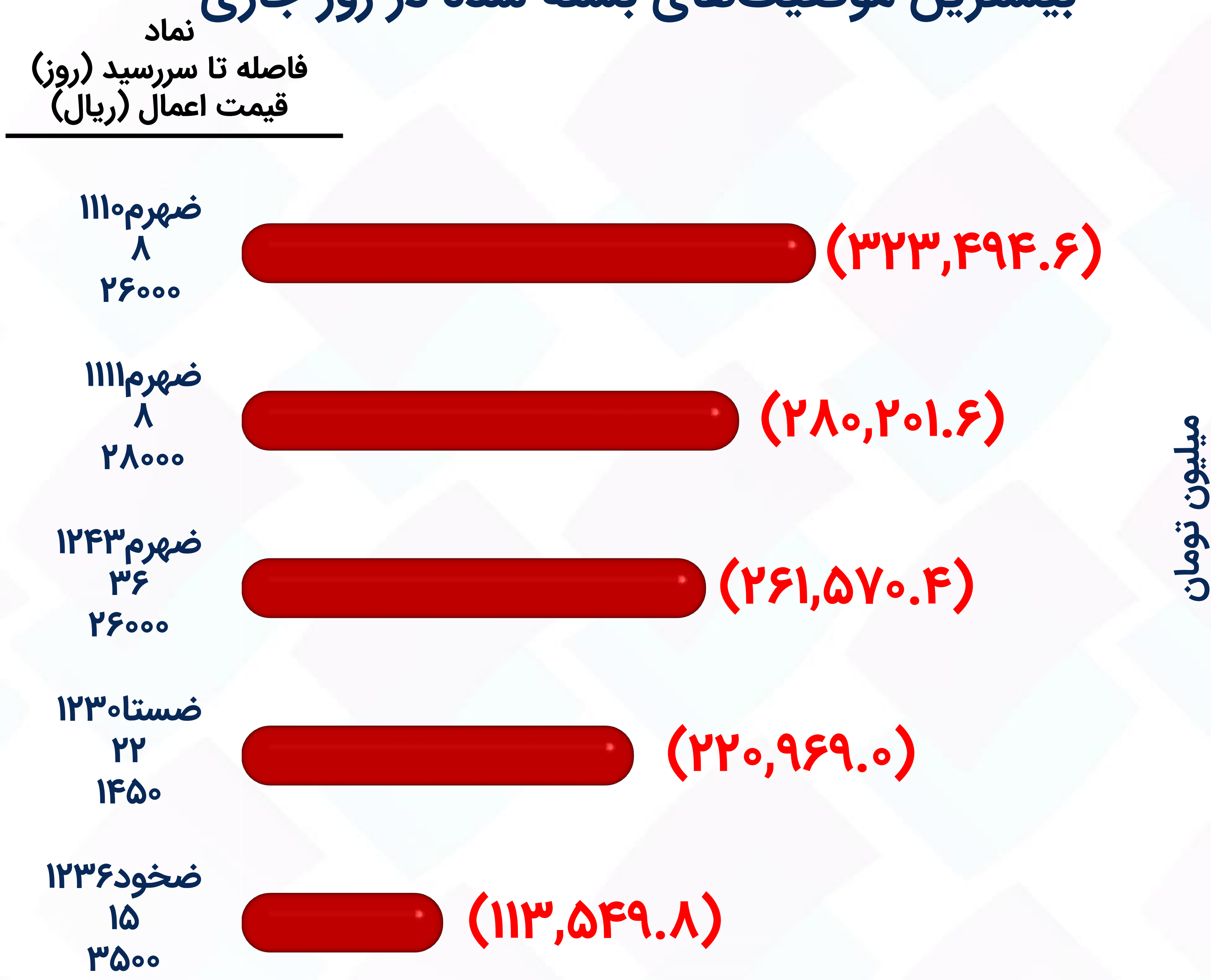
ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



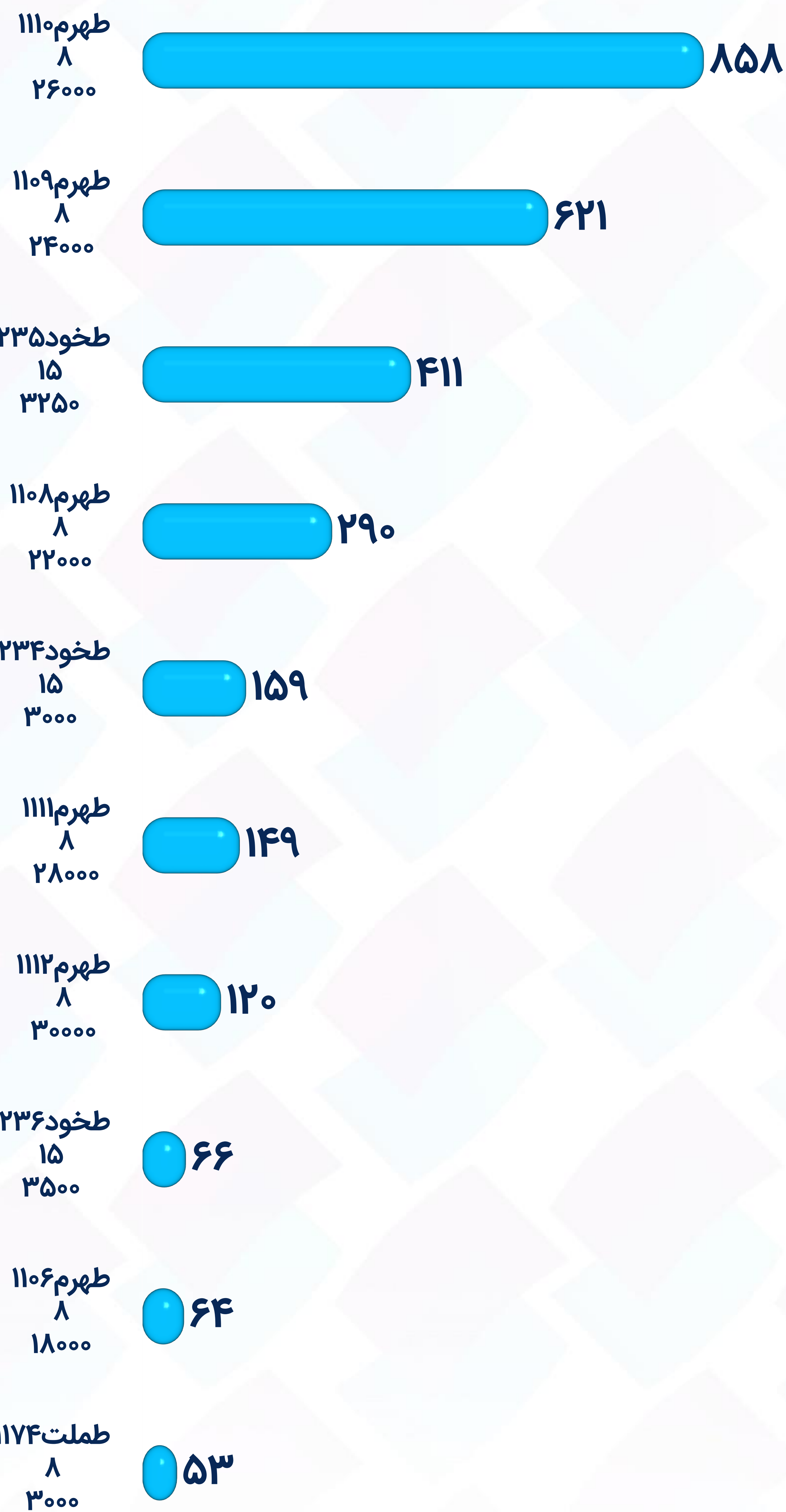
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

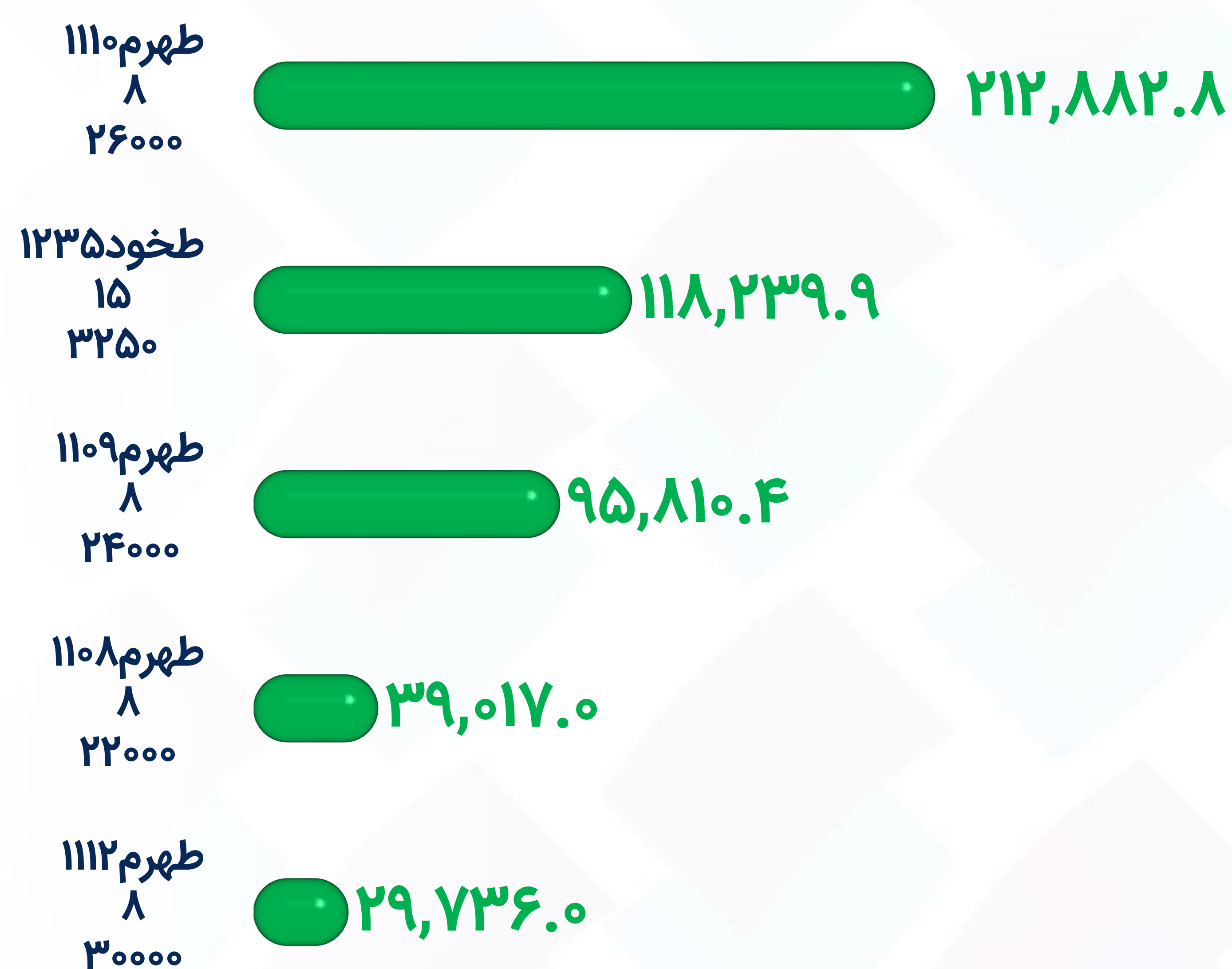
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

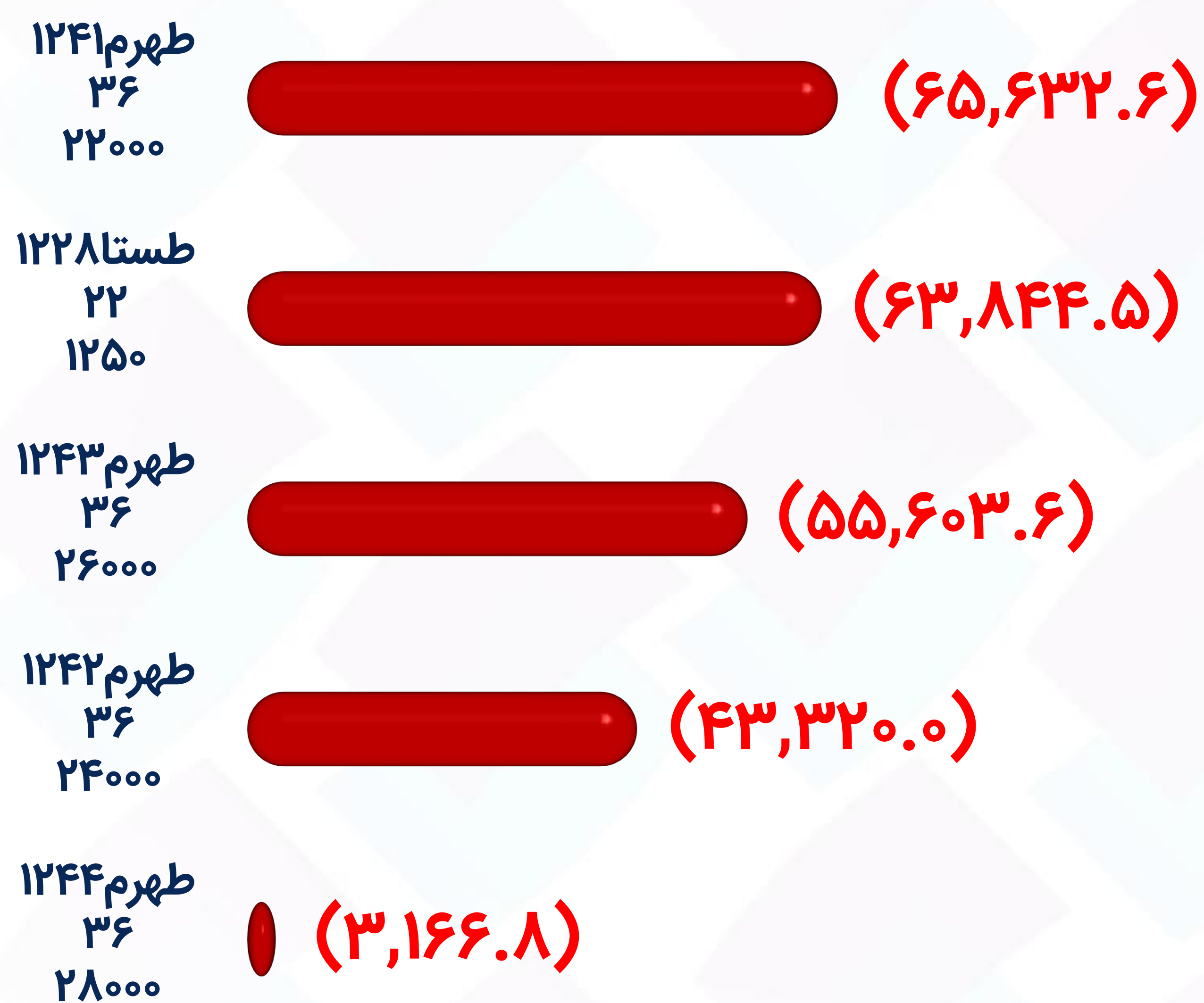
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

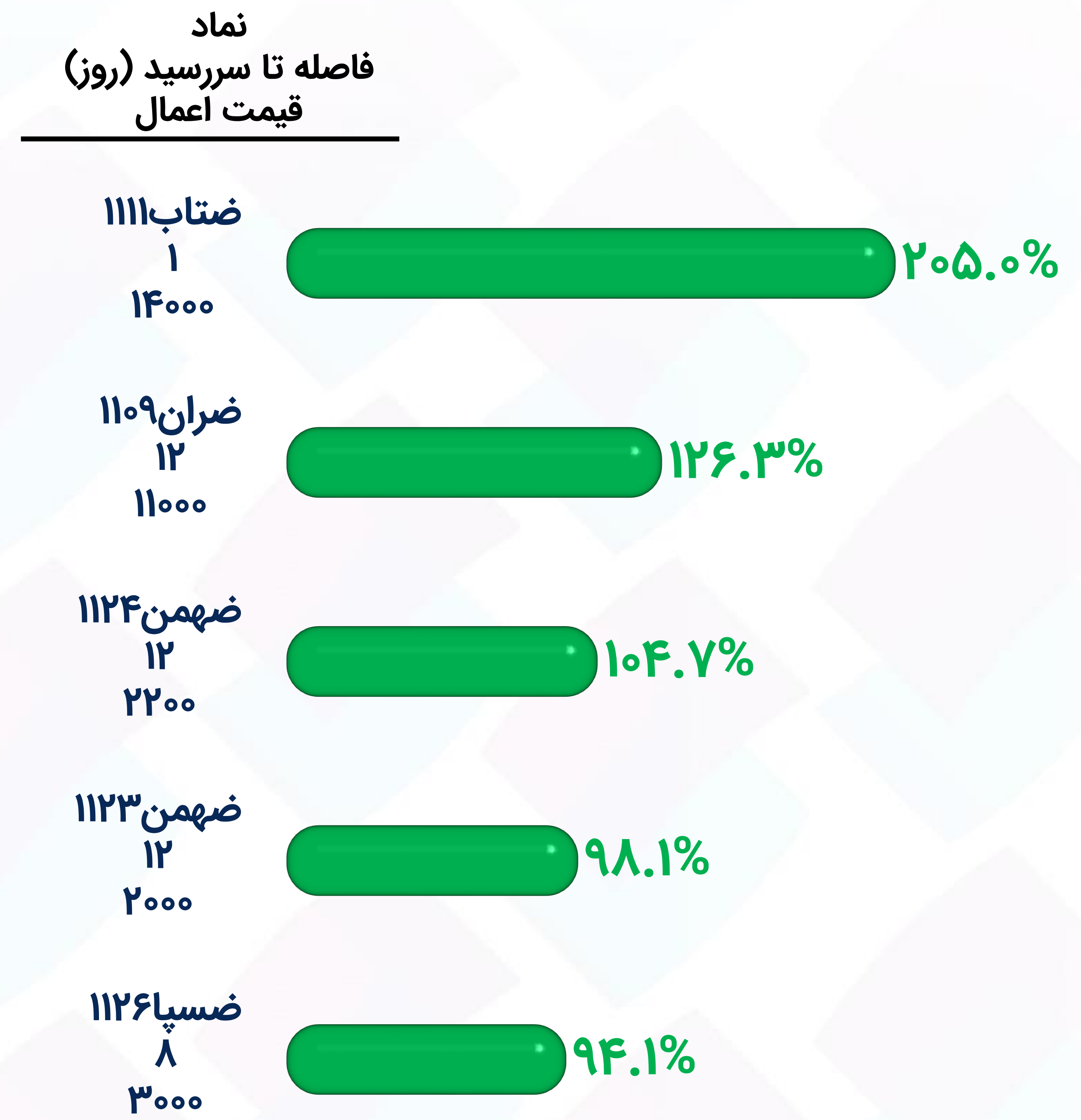
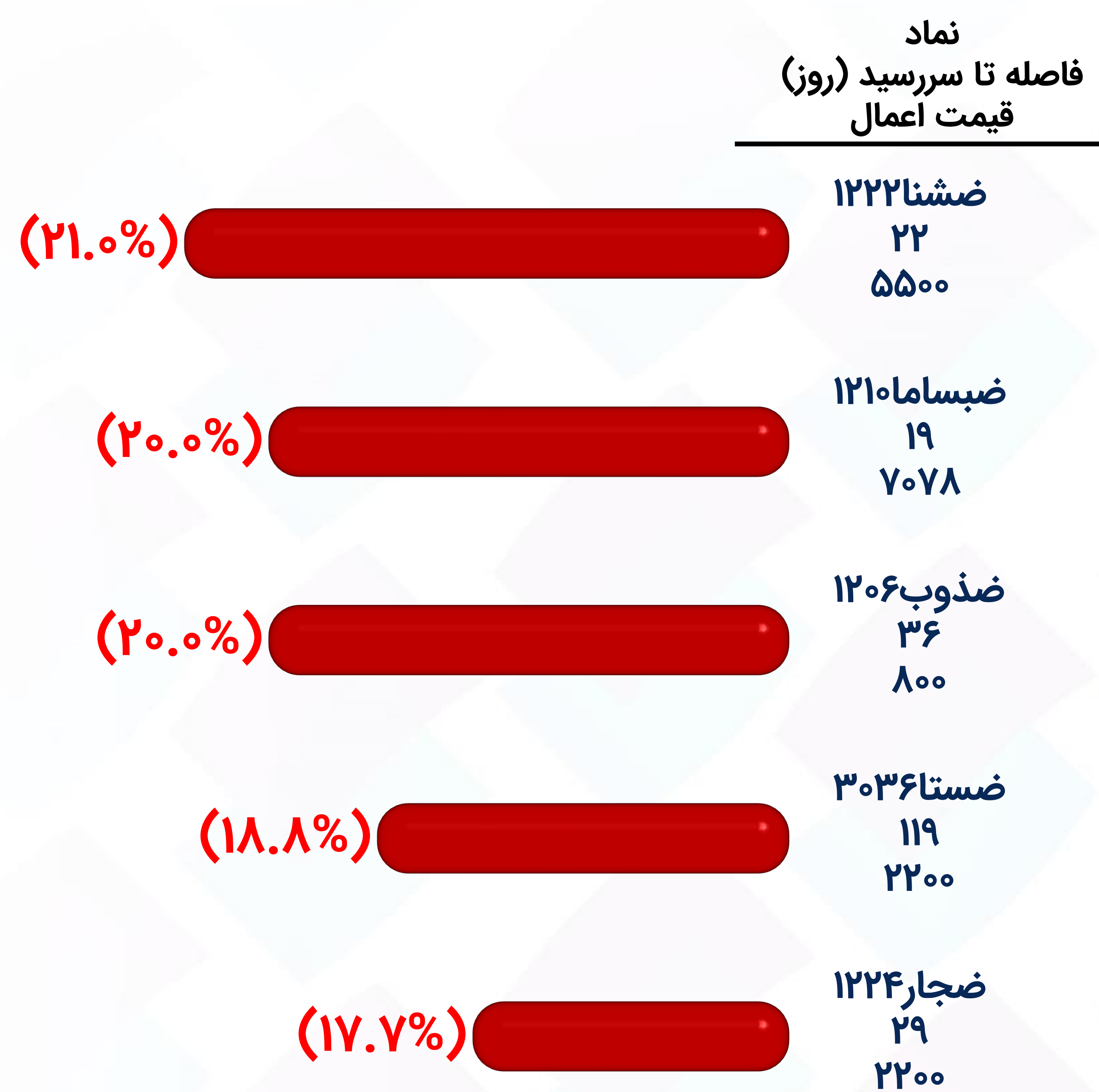
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



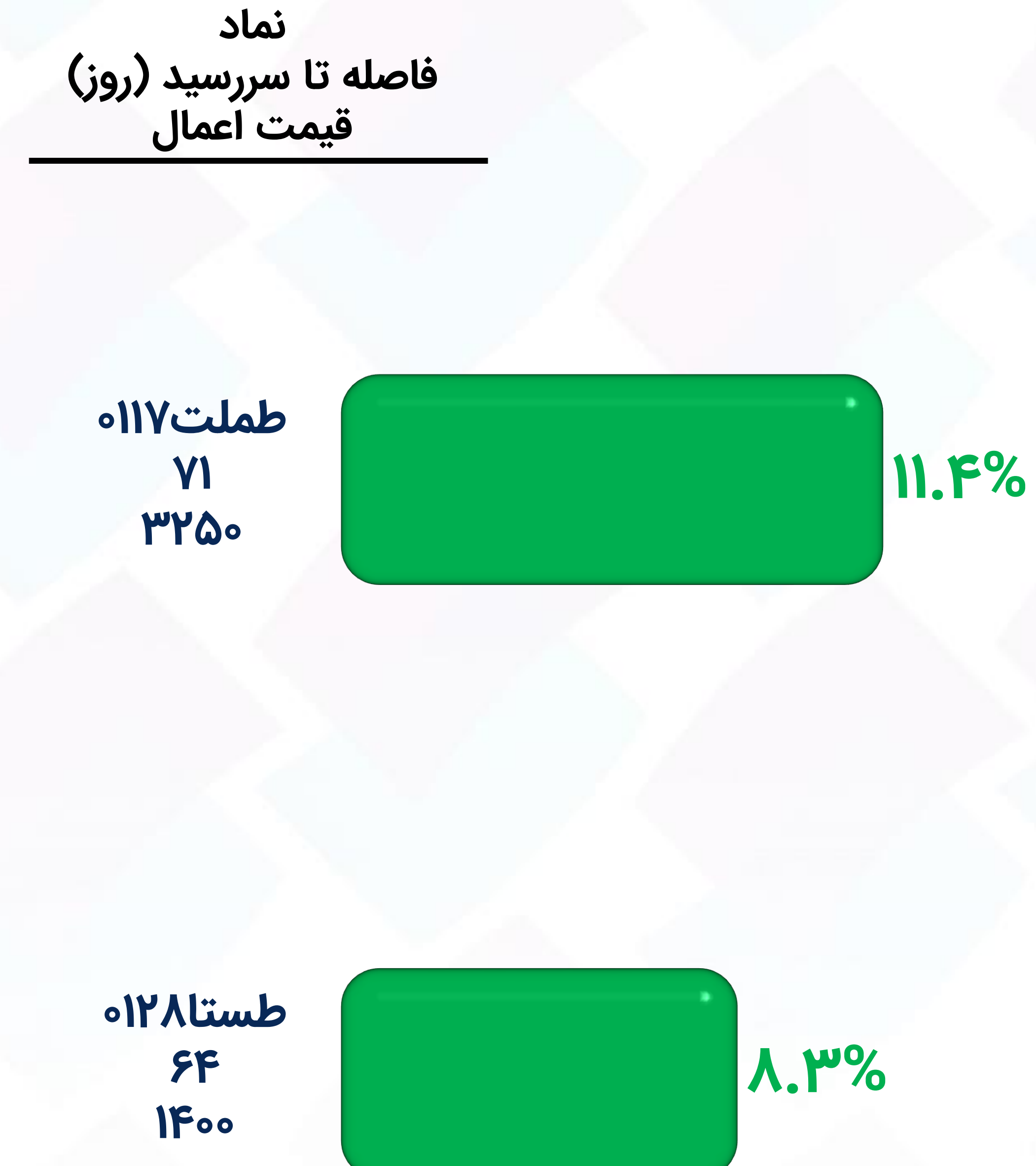
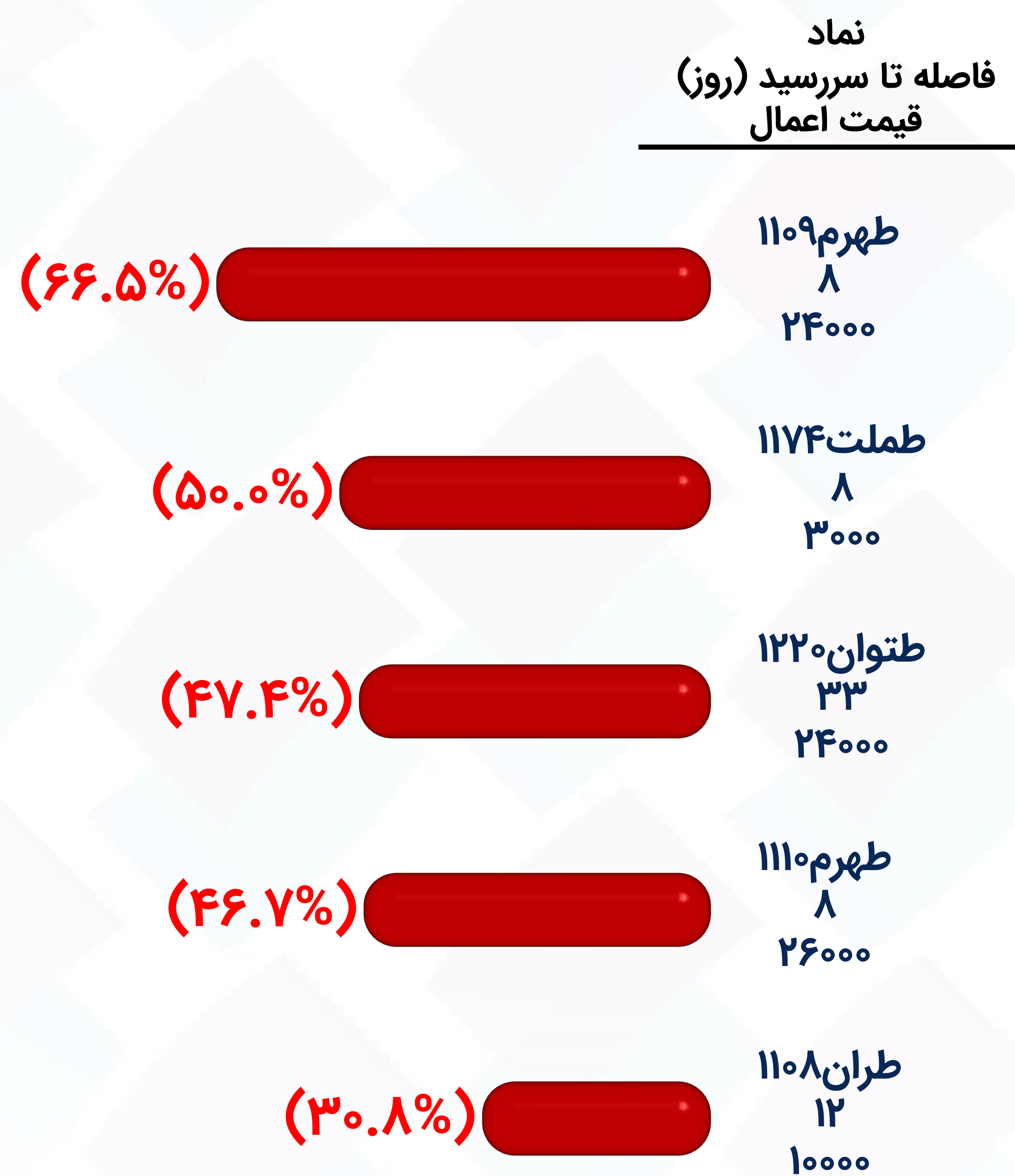
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

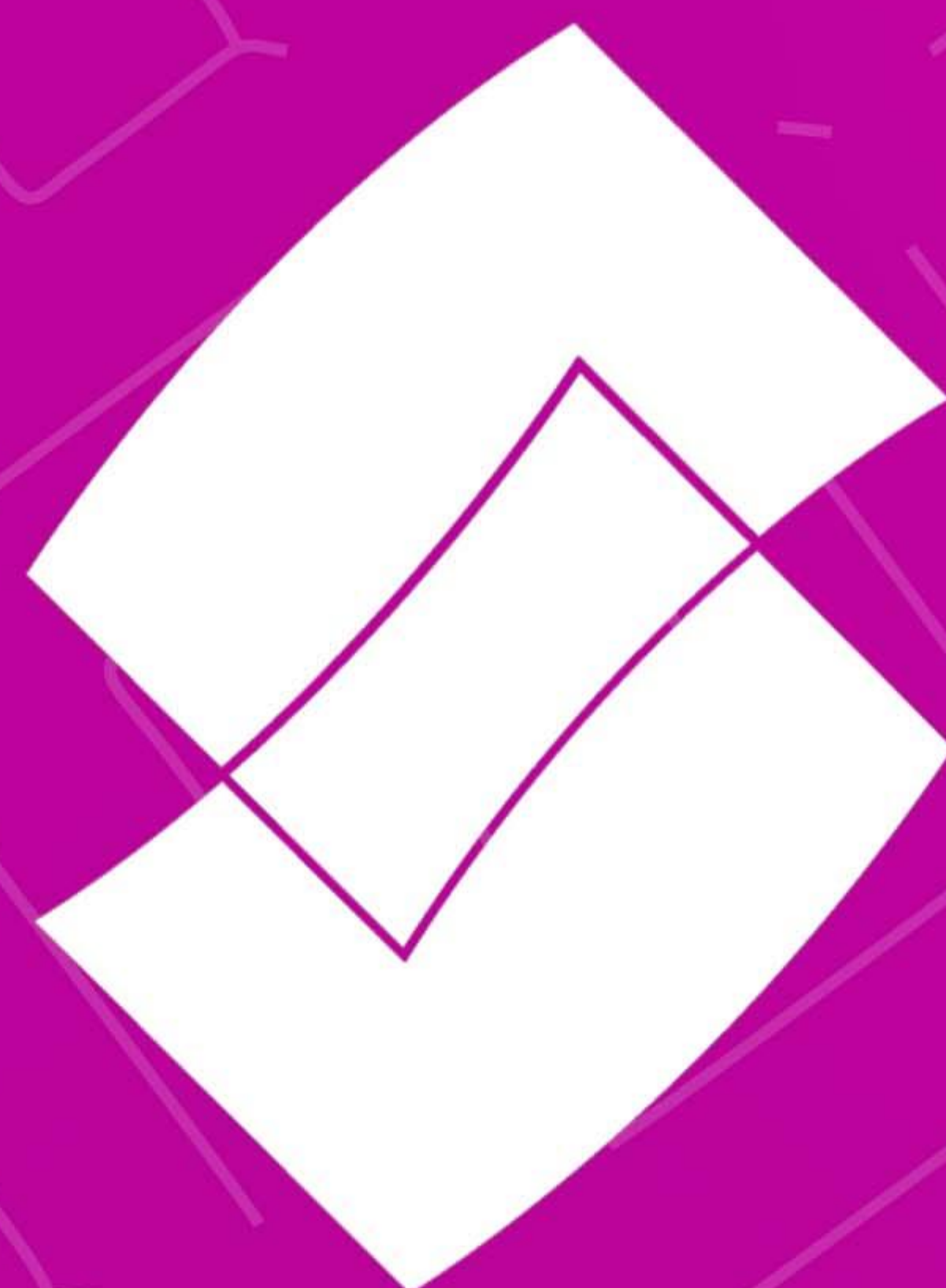
اختیار خرید



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.