

شماره
۴۲۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

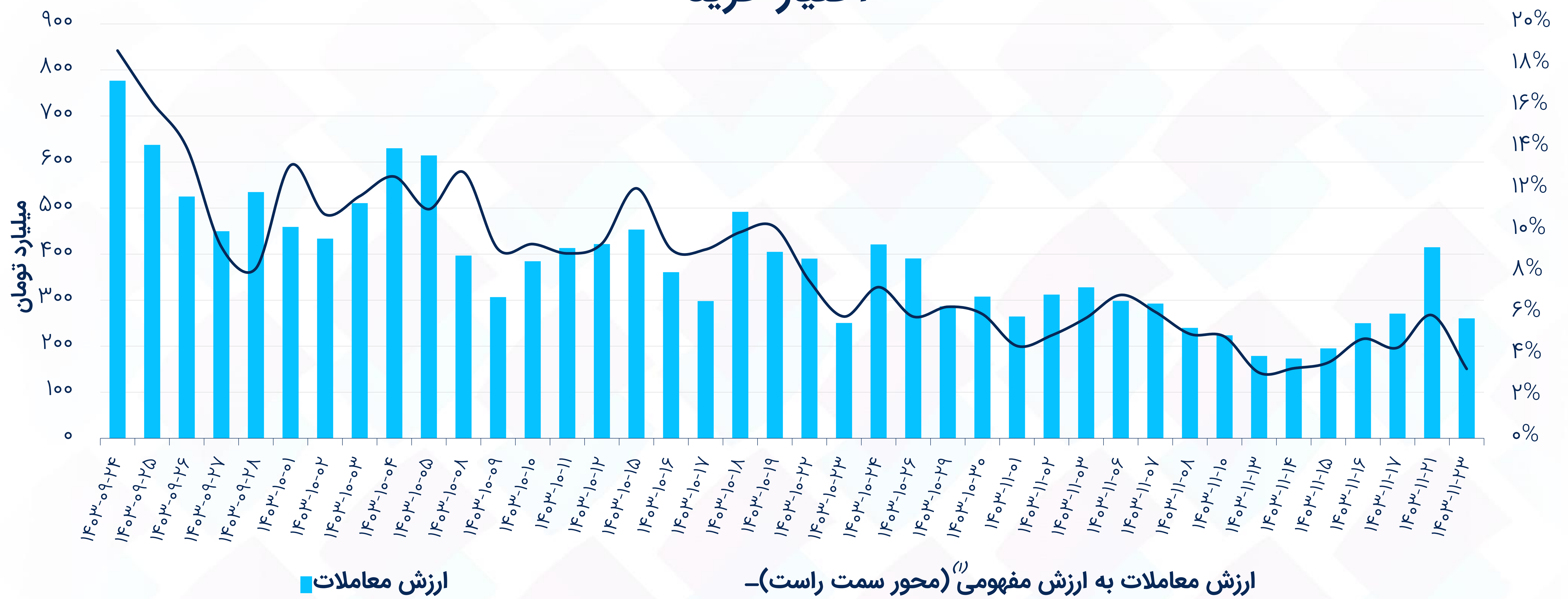




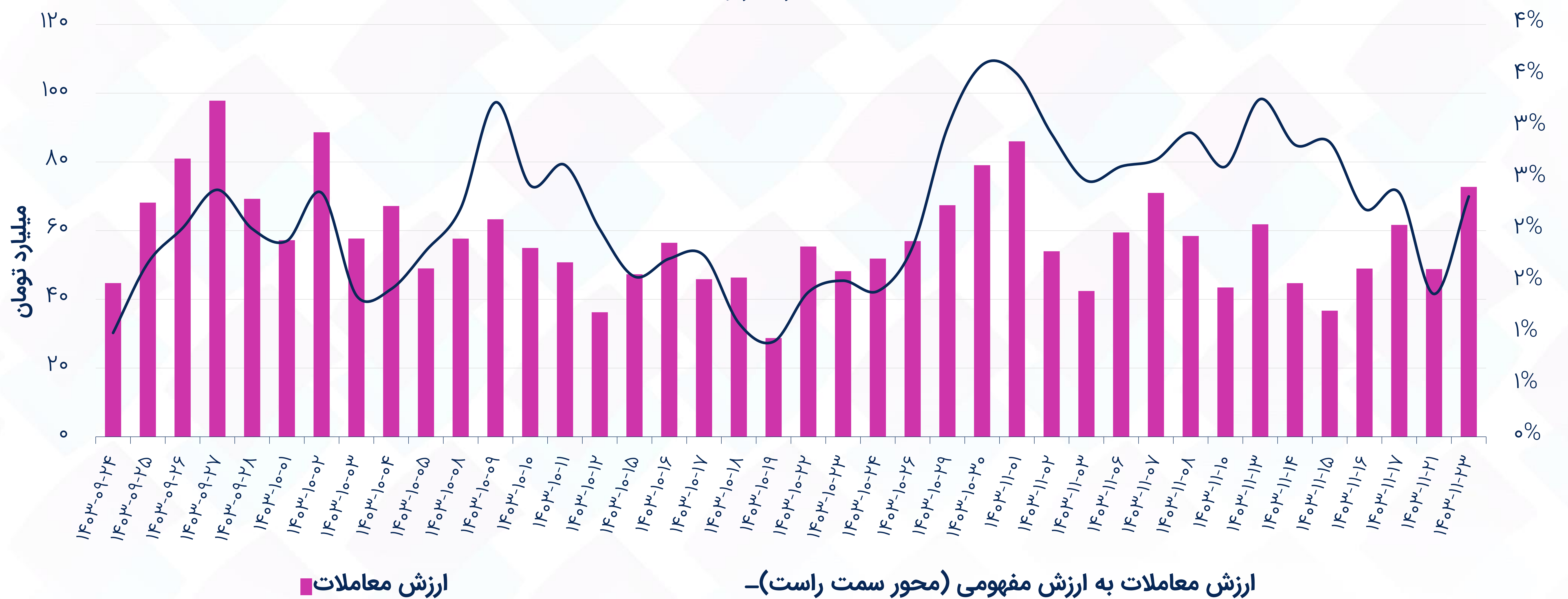
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



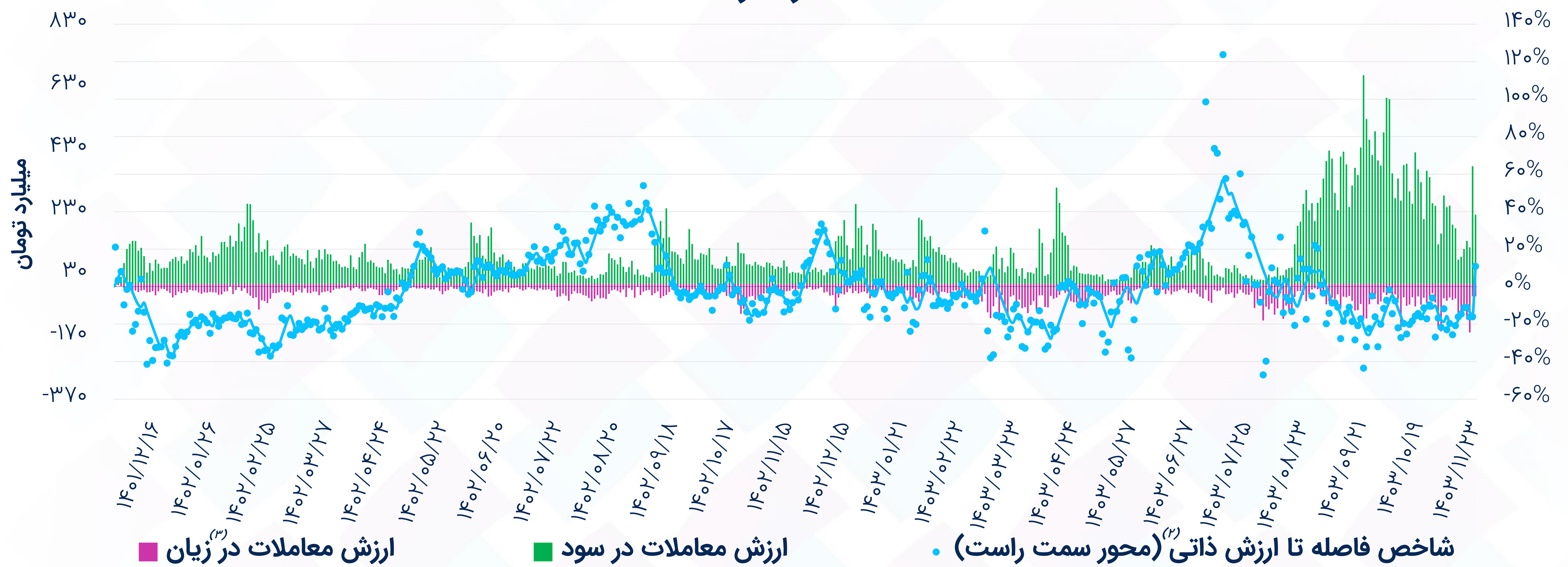
اختیار فروش



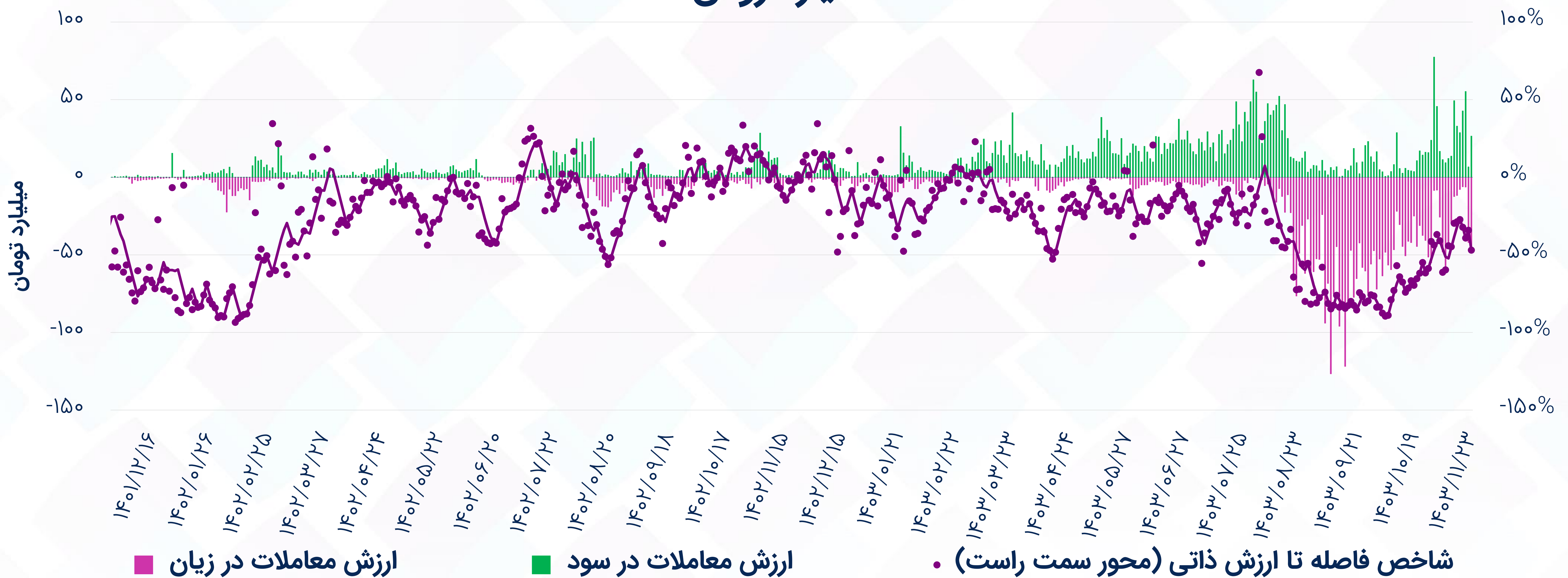
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۸	۱۵۸.۹	۵,۱۰۶.۴	۱۴۷.۱	۱۱.۸	۱۲.۸%
خودرو	۳۴	۴۳.۵	۱,۴۷۴.۲	۲۸.۲	۱۵.۳	۷.۶%
وبملت	۲۲	۱۵.۹	۲۳۰.۸	۱۵.۰	۰.۹	۲۴.۸%
شستا	۳۳	۱۲.۳	۴۴۴.۲	۳.۱	۹.۳	(۲۶.۰%)
ذوب	۲۵	۱۱.۶	۱۲۵.۸	۹.۹	۱.۷	۱۲.۱%
خسپا	۱۴	۶.۳	۲۹۰.۲	۶.۰	۰.۳	۴۰.۳%
توان	۲۱	۳.۲	۱۱.۴	۳.۱	۰.۱	(۰.۲%)

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	۱۸	۵۷,۲۷۲.۰	۲,۲۸۰,۹۰۷.۰	۱۳,۶۳۶.۵	۴۳,۶۳۵.۶	(۴۷.۲%)
خودرو	۶	۱۲,۱۴۹.۲	۶۶۵,۹۲۷.۴	۱۰,۵۱۶.۴	۱,۶۳۲.۷	(۴۴.۰%)
شستا	۱۳	۲,۷۱۳.۱	۱۴۸,۵۲۶.۸	۱,۸۴۹.۱	۸۶۴.۰	(۵۹.۴%)
ذوب	۷	۴۹۵.۱	۵,۷۹۲.۹	۴۹۵.۱	۰.۰	(۲۱.۸%)
وبملت	۳	۸۳.۷	۱۷,۶۶۸.۴	۵.۵	۷۸.۱	(۵۹.۶%)
توان	۲	۱۴.۵	۳۶۶.۲	۸.۳	۶.۱	(۳۴.۵%)
خودران	۲	۷.۵	۲۱۰.۲	۶.۵	۱.۰	(۳۱.۹%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



(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



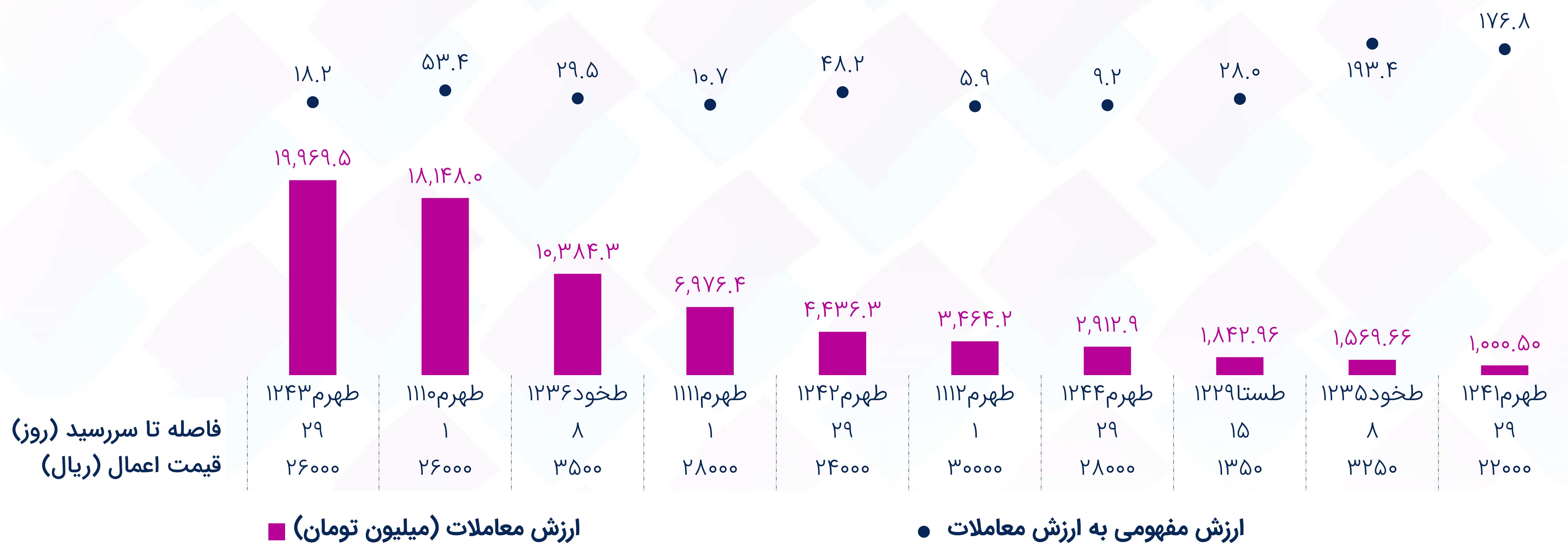
میلیون تومان

بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید تا ارزش بک شولز

ارزانترین نسبت به ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم ^(۳)	فاصله تا سر به سر ^(۲)	سر به سر ^(۱)	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
۲۶۲۱%	۸۲	۰.۰۷	۹,۳۳۴.۳	۲۱.۸%	۲۸,۰۰۳	۲۲,۹۹۳	۳	۱.۲	۲۶	۲۸,۰۰۰	موج ۱۲۱۹
۳۹۹%	۴۴۹	۰.۹۱	۸۵.۲	(۳.۲%)	۷,۶۶۸	۷,۹۲۰	۹۰	۴.۶	۱۲	۷,۵۷۸	بساما ۱۲۱۱
۲۳۲%	۳۱۲	۱.۰۰	۱۲.۲	(۱۴.۹%)	۱,۱۴۴	۱,۳۴۵	۹۴	۴۲.۵	۱۵	۱,۰۵۰	شستا ۱۲۲۶
۱۹۸%	۹۲۹	۱.۰۰	۲۳.۷	(۶.۷%)	۷,۳۹۰	۷,۹۲۰	۳۱۲	۴۹.۱	۱۲	۷,۰۷۸	بساما ۱۲۱۰
۱۳۲%	۱,۳۴۰	۱.۰۰	۱۲.۵	(۸.۶%)	۷,۲۴۰	۷,۹۲۰	۵۷۸	۱۵۰.۹	۱۲	۶,۶۶۲	بساما ۱۲۰۹

گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بک شولز)	دلتا	اهرم	فاصله تا سر به سر	سر به سر	قیمت دارایی پایه	قیمت اختیار	ارزش معاملات (میلیون تومان)	فاصله تا سر رسید (روز)	دارایی پایه قیمت اعمال	نماد
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲,۵۰۱.۰	۴۴%	۵,۰۰۲	۳,۴۸۱	۲	۱۳.۵	۸	۵,۰۰۰	خودرو ۱۲۴۰
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۶۷.۷	۷۰%	۸۰۳	۴۷۱	۳	۱.۲	۲۹	۸۰۰	ذوب ۱۲۰۶
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۵۰۱.۰	۲۹%	۴,۵۰۳	۳,۴۸۱	۳	۱۳.۳	۸	۴,۵۰۰	خودرو ۱۲۳۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۲۳۹.۱	۶۳%	۵,۰۲۱	۳,۰۸۱	۲۱	۱.۴	۶۴	۵,۰۰۰	وبملت ۰۱۲۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱۷۶.۰	۴۹%	۷۰۴	۴۷۱	۴	۱۹.۸	۲۹	۷۰۰	ذوب ۱۲۰۵

(۱) سر به سر: قیمت اختیار + قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
 (۲) فاصله تا سر به سر: ۱ - (قیمت دارایی پایه / قیمت سر به سر)
 (۳) اهرم: قیمت اختیار / قیمت سر به سر
 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	۲۹	۱.۶	۸,۰۰۰	۲۶,۱۶۰	۲۶,۰۰۰	(۰.۶%)	۳.۳	-۰.۹۸	۶,۸۴۶	(۱۴.۴%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۸	۱۲۴.۶	۲۸۹	۳,۴۸۱	۳,۴۶۱	(۰.۶%)	۱۲.۰	-۰.۸۷	۲۴۵	(۱۵.۳%)
طخود ۱۲۳۸	خودرو	۸	۷.۵	۶۴۴	۳,۴۸۱	۳,۳۵۶	(۳.۶%)	۵.۲	-۰.۹۹	۴۸۱	(۲۵.۳%)
طران ۱۱۰۹	خودران	۵	۶.۵	۶۵۲	۱۰,۵۱۰	۱۰,۳۴۸	(۱.۵%)	۱۵.۹	-۰.۸۰	۴۸۴	(۲۵.۷%)
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۲۹	۱۳۷.۵	۴,۳۱۰	۲۶,۱۶۰	۲۵,۶۹۰	(۱.۸%)	۶.۰	-۰.۸۲	۳,۲۰۱	(۲۵.۷%)

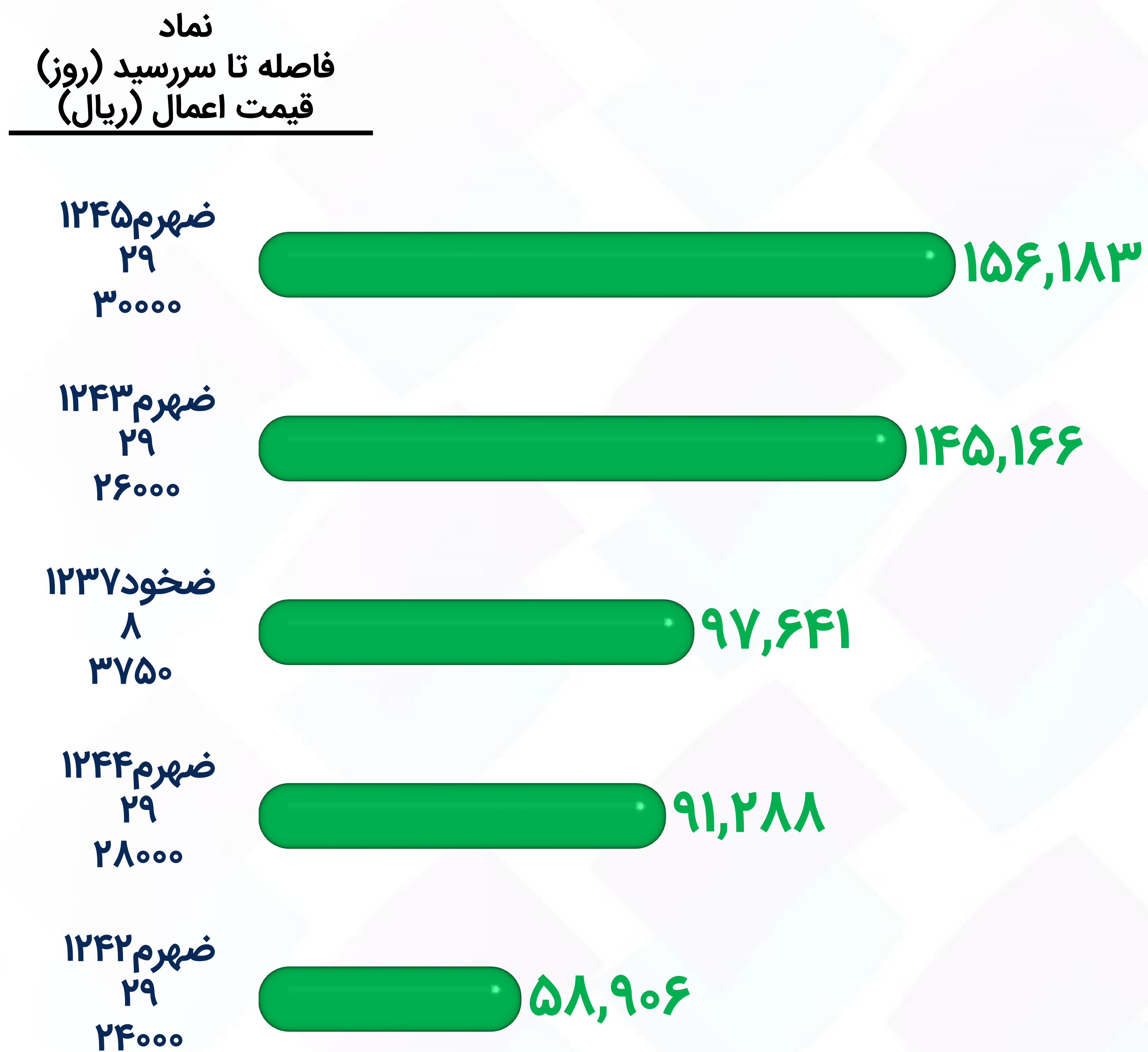
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طخود ۱۲۳۴	خودرو	۸	۶۲.۶	۴	۳,۴۸۱	۲,۹۹۶	(۱۳.۹%)	۷۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۳%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۹	۴.۳	۴۱	۲۶,۱۶۰	۱۹,۹۵۹	(۲۳.۷%)	۴۸۶.۸	۰.۰۰	۲	(۹۴.۹%)
طستا ۰۱۲۶	شستا	۵۷	۱.۲	۲۰	۱,۳۴۵	۱,۱۸۰	(۱۲.۳%)	۵۹.۰	-۰.۰۵	۳	(۸۴.۴%)
طستا ۱۲۲۸	شستا	۱۵	۸۵۸.۳	۱۲	۱,۳۴۵	۱,۲۳۸	(۸.۰%)	۱۰۳.۲	-۰.۰۶	۲	(۸۰.۸%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۹	۱,۰۰۰.۵	۱۴۸	۲۶,۱۶۰	۲۱,۸۵۲	(۱۶.۵%)	۱۴۷.۶	-۰.۰۳	۳۰	(۸۰.۰%)

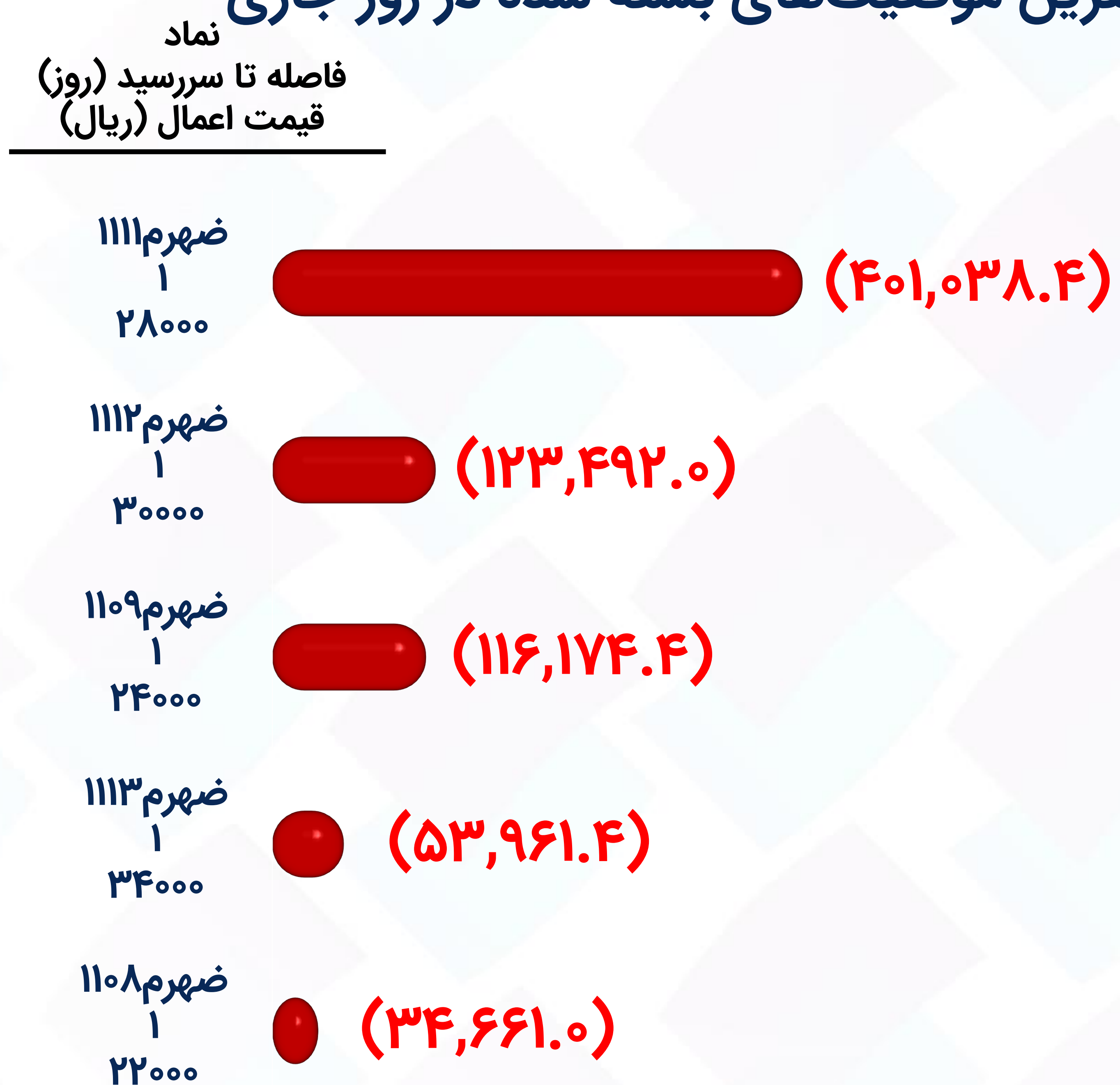
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

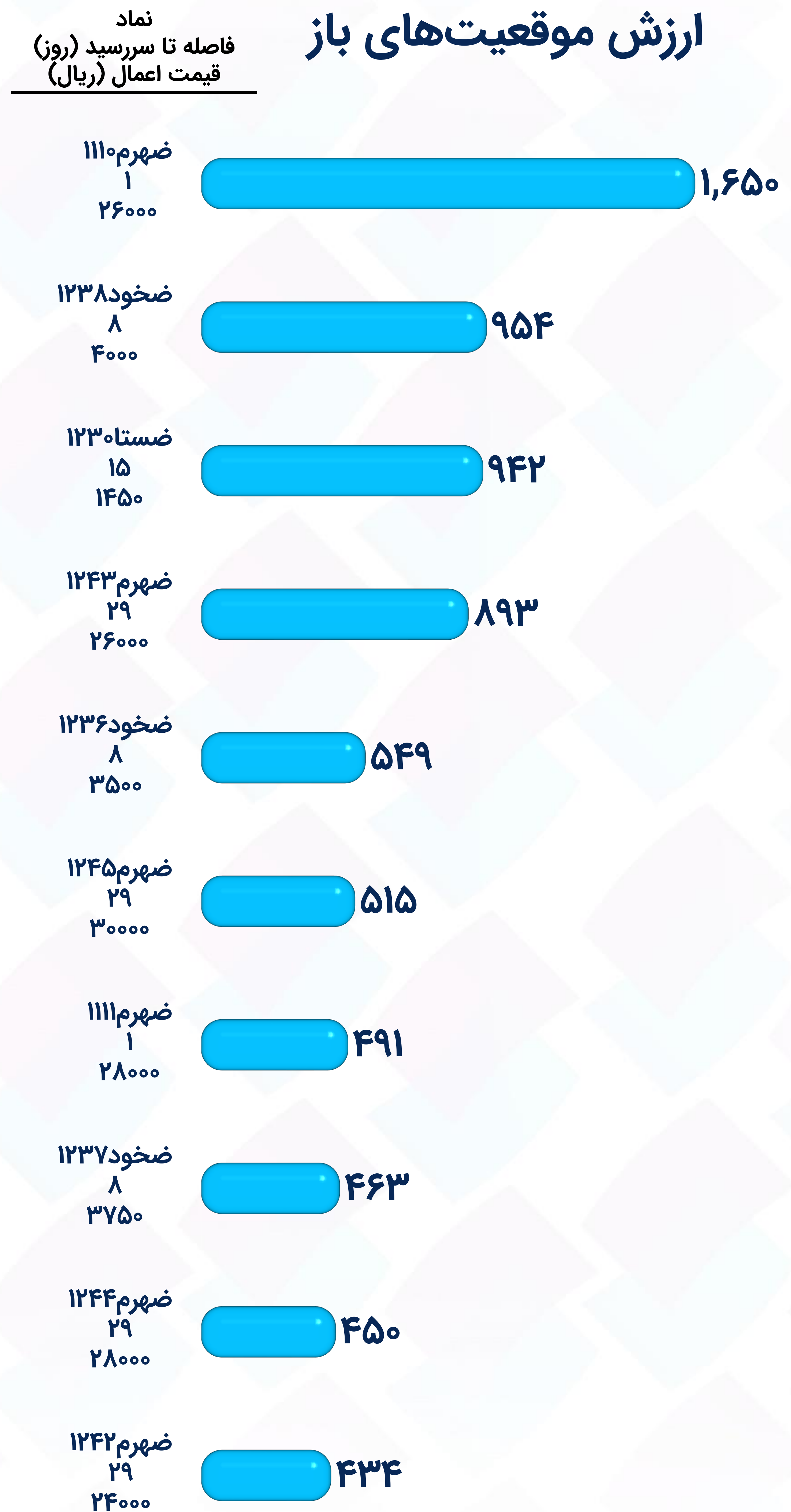
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

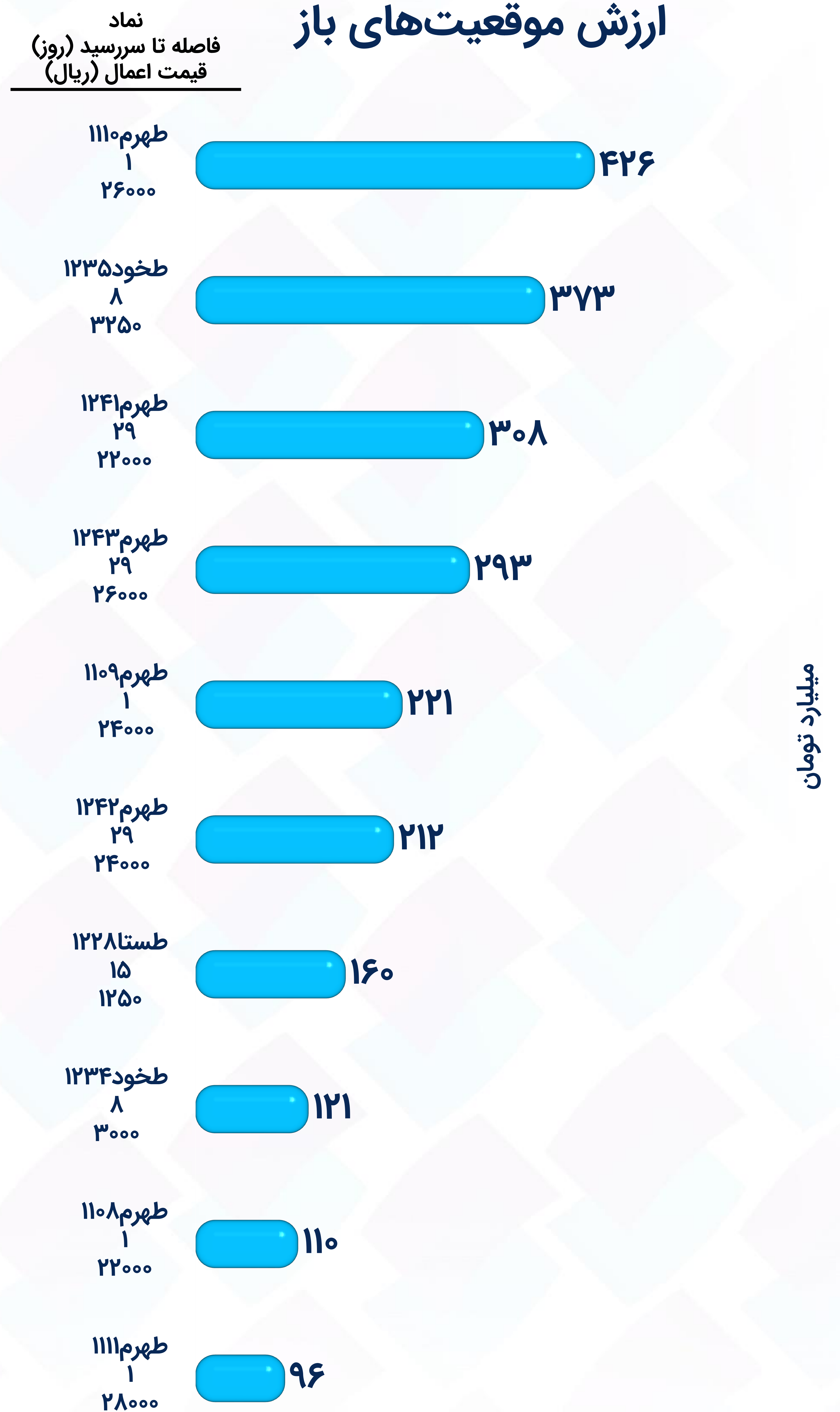
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

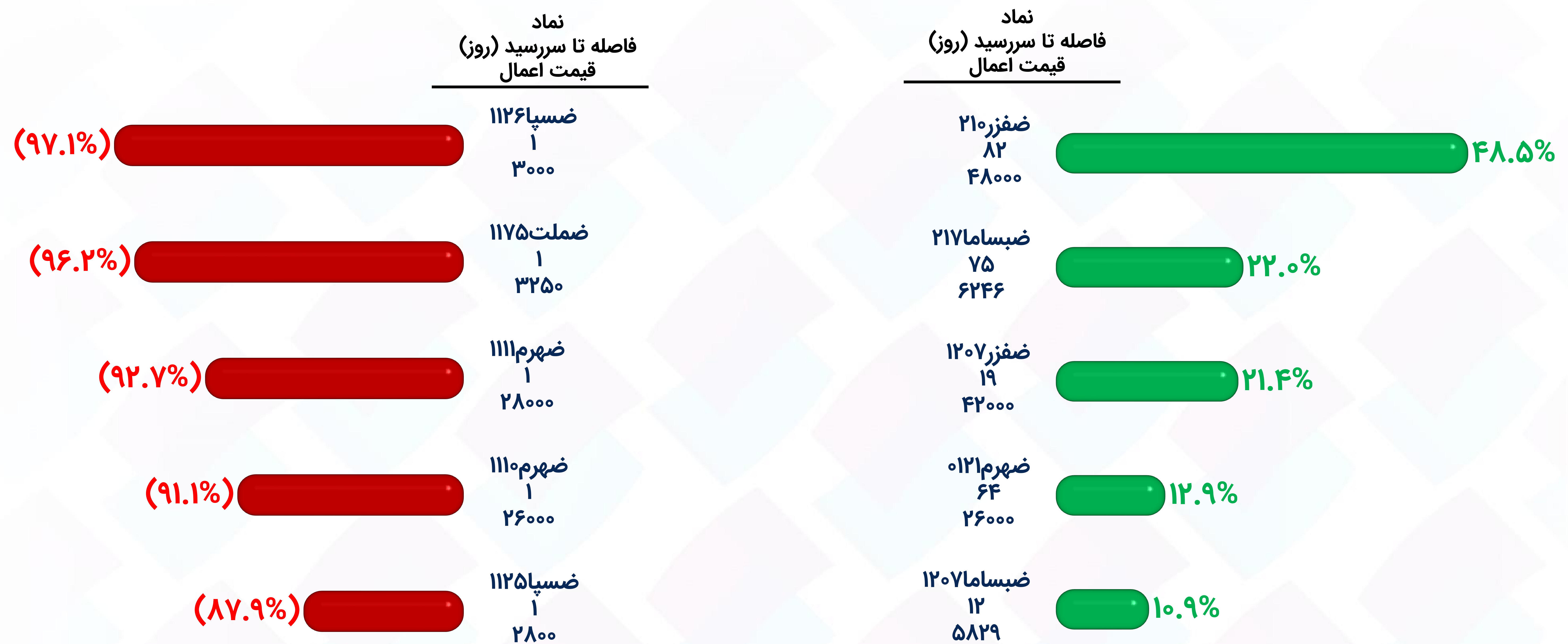


ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

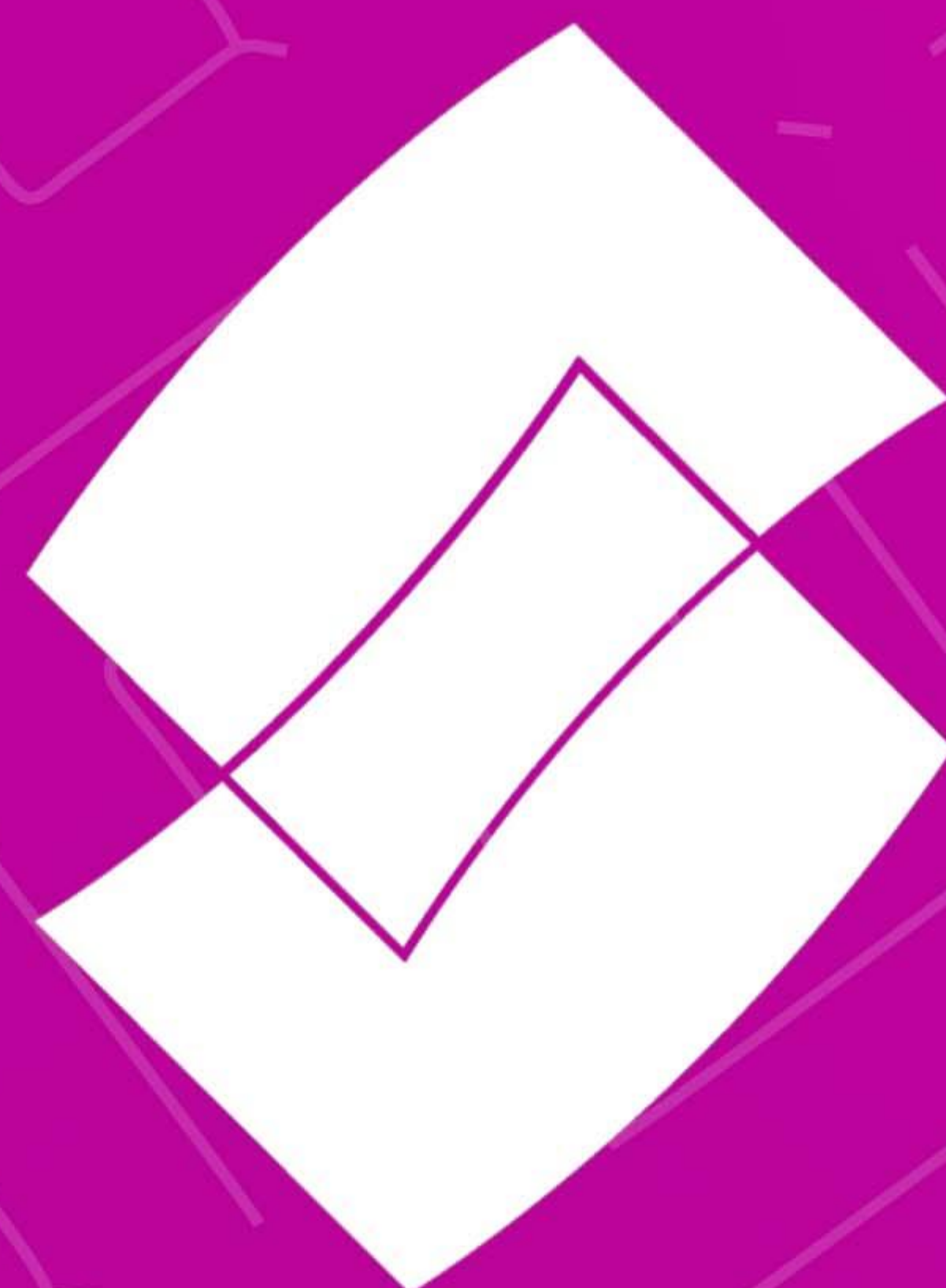
اختیار خرید



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.