

شماره
۴۲۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۹ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





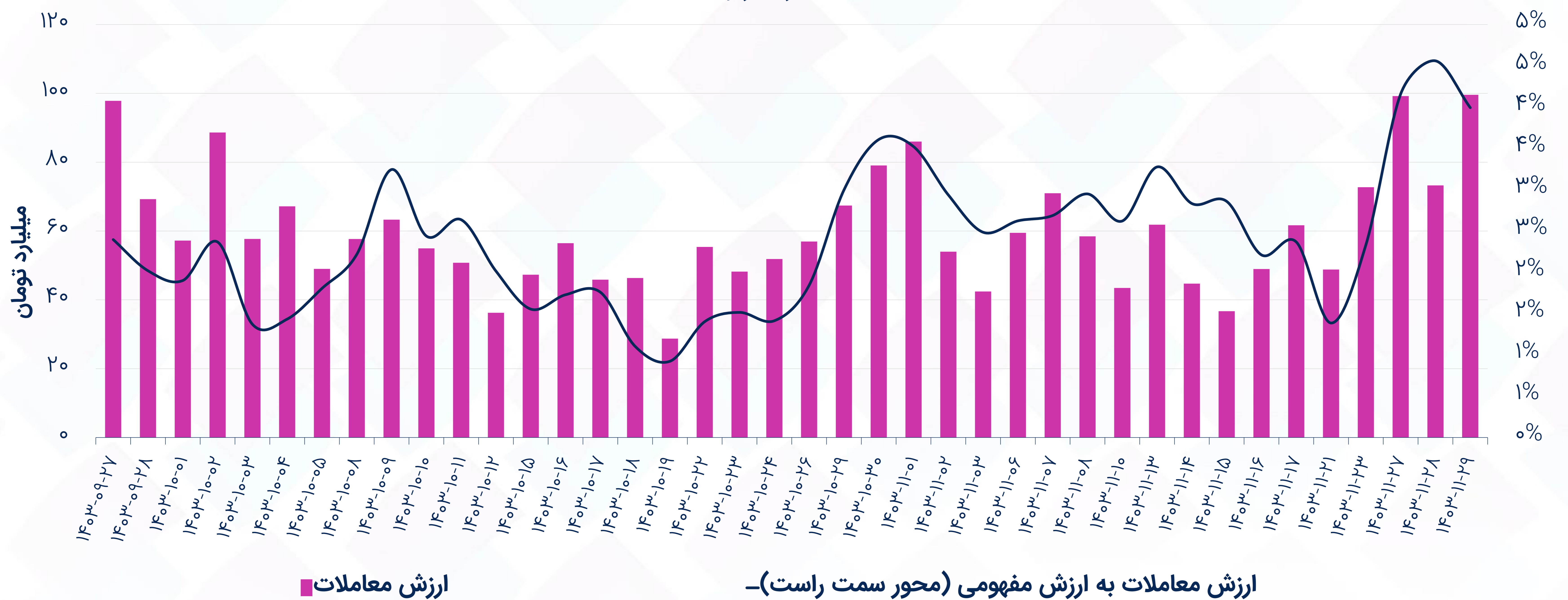
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



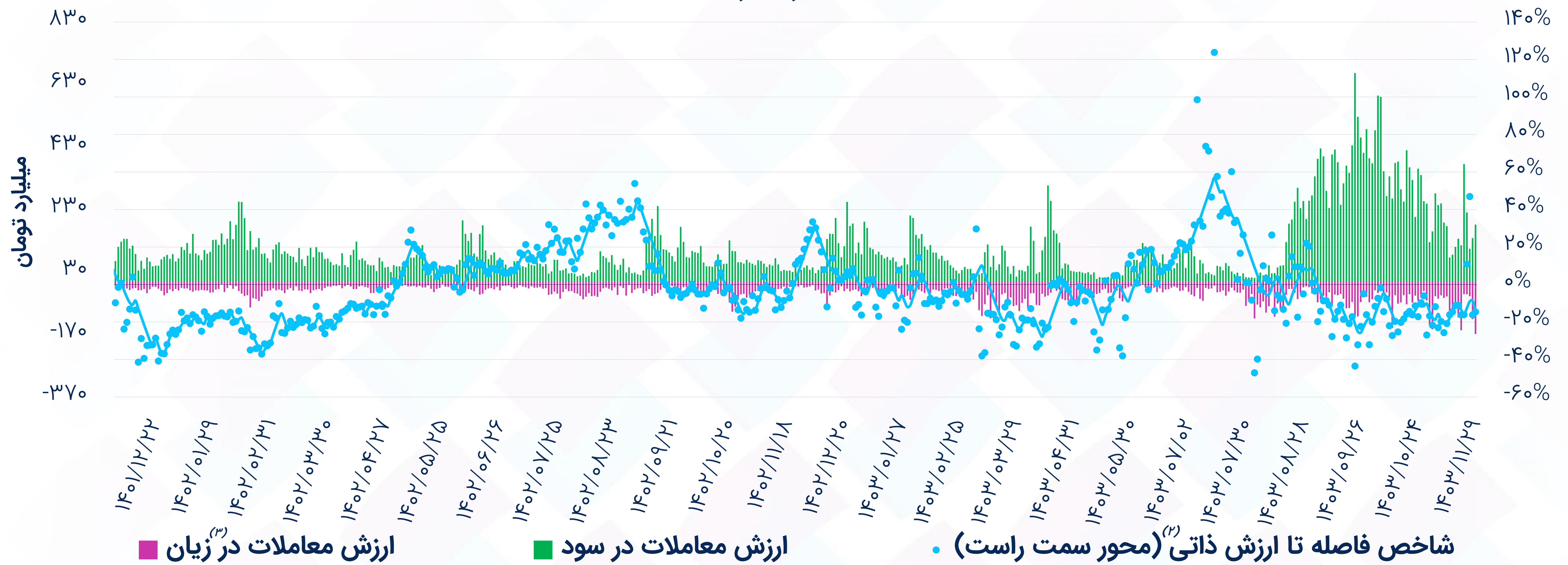
اختیار فروش



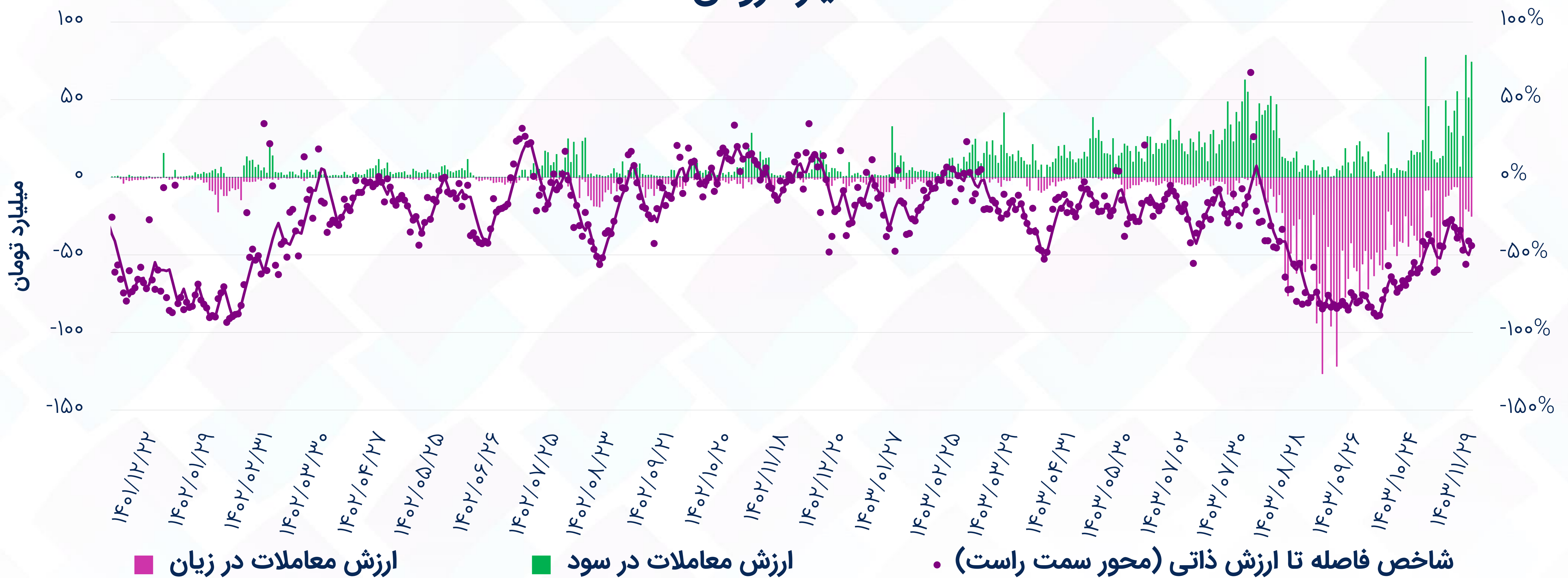
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

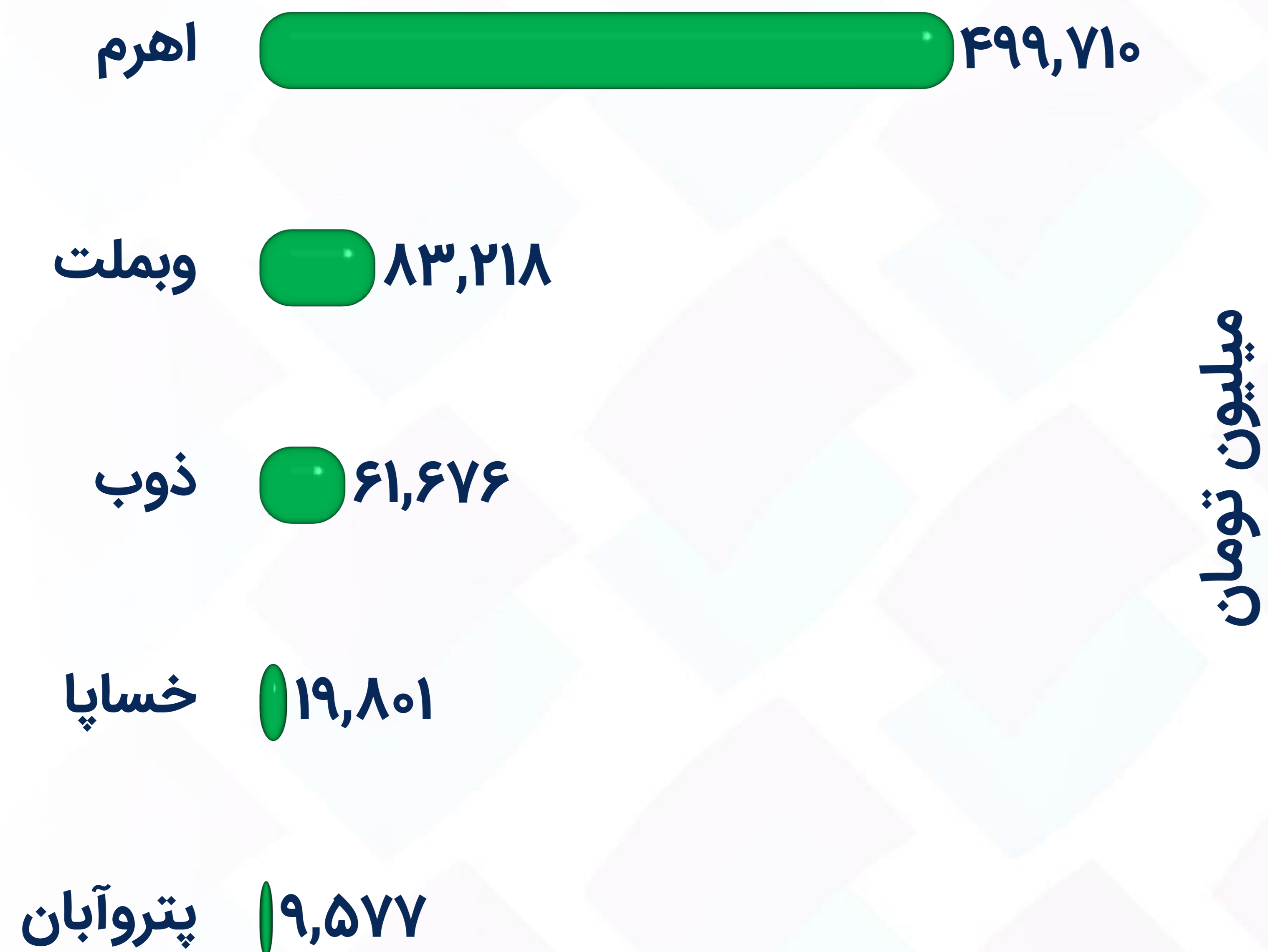
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۱	۲۱۶.۳	۴,۳۲۳.۰	۷۶.۳	۱۳۹.۹	(۲۷.۲%)
خودرو	۴۶	۷۹.۱	۲,۴۰۸.۲	۷۵.۴	۳.۷	۲۳.۹%
شستا	۳۸	۱۶.۸	۶۷۷.۰	۵.۱	۱۱.۸	(۴۱.۸%)
وبملت	۱۸	۱۰.۸	۱۲۵.۷	۴.۱	۶.۷	(۱۴.۰%)
ذوب	۲۳	۱۰.۴	۱۳۱.۰	۷.۵	۲.۹	(۲۴.۹%)
توان	۲۴	۴.۰	۱۵.۹	۳.۹	۰.۱	(۲.۵%)
خسپا	۱۸	۳.۱	۴۵.۵	۲.۶	۰.۵	(۶.۵%)

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	۱۰	۸۶,۵۷۷.۷	۱,۴۳۵,۶۹۹.۱	۶۸,۱۳۵.۹	۱۸,۴۴۱.۷	(۴۳.۶%)
خودرو	۸	۱۰,۴۲۹.۱	۹۴۱,۵۷۶.۵	۴,۶۴۴.۱	۵,۷۸۵.۰	(۴۸.۰%)
شستا	۷	۲,۵۴۹.۶	۱۱۵,۵۱۸.۲	۱,۴۹۹.۵	۱,۰۵۰.۱	(۴۲.۳%)
وبملت	۲	۲۱.۳	۲۱۰.۹	۲۱.۳	۰.۰	(۳۰.۳%)
توان	۲	۱۰.۶	۳۱۶.۷	۰.۰	۱۰.۶	(۴۲.۸%)
خسپا	۱	۱.۸	۱۲۵.۱	۰.۰	۱.۸	(۵۱.۱%)
ذوب	۳	۱.۴	۵۲.۹	۰.۲	۱.۲	(۷۴.۷%)

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



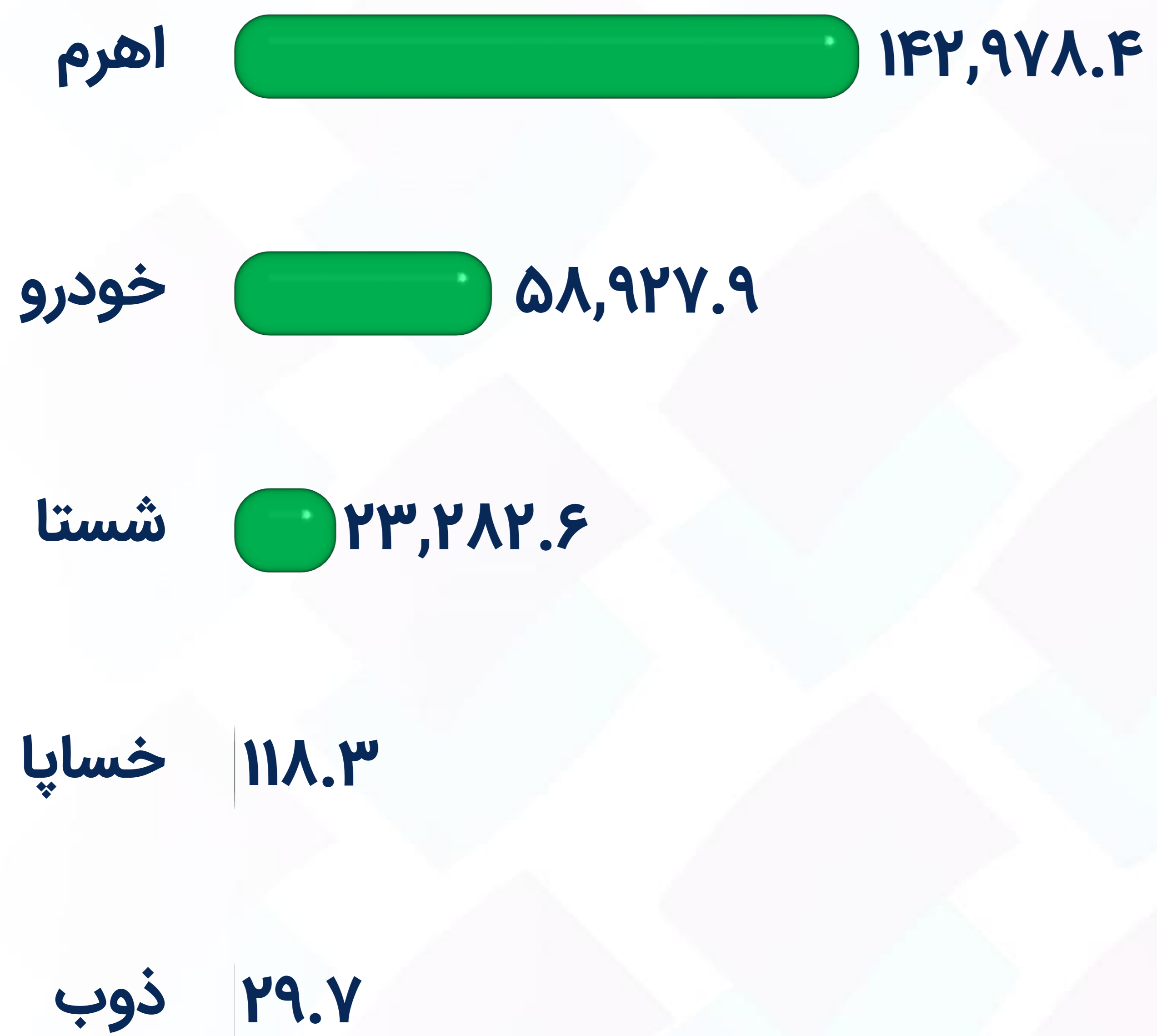
میلیون تومان



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



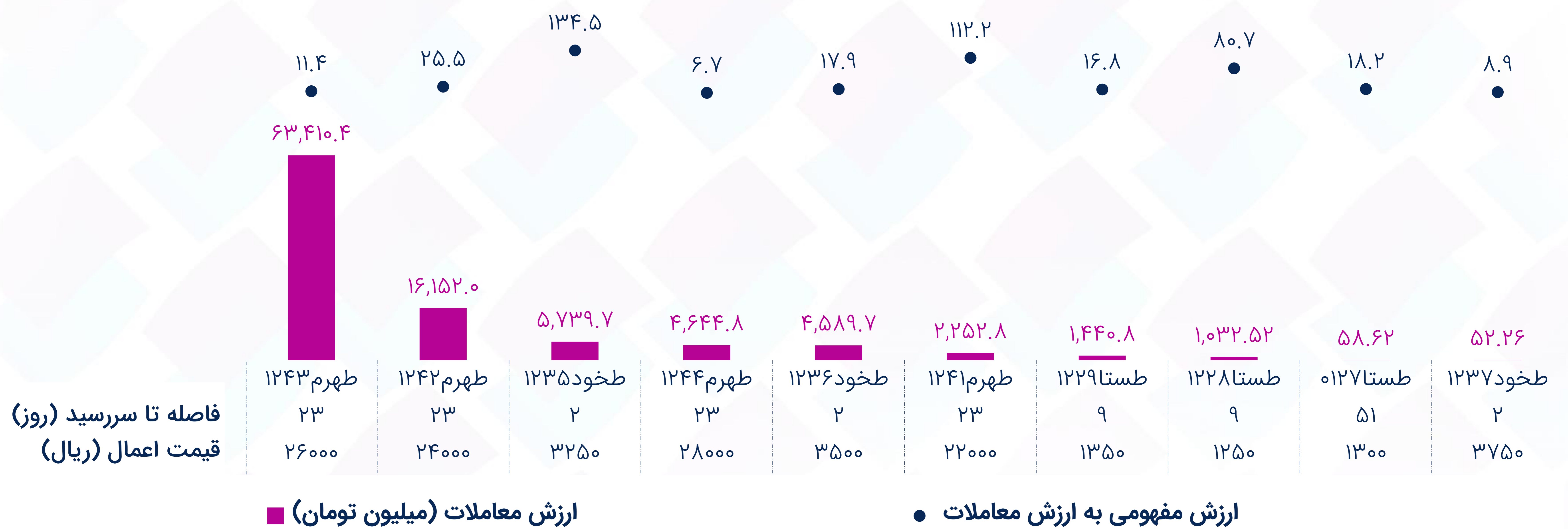
میلیون تومان

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
۵۴۹%	۴۲۸	۰.۹۶	۱۱۵.۸	(۳.۸%)	۷,۶۴۴	۷,۹۵۰	۶۶	۳.۷	۶	۷,۵۷۸	بساما ۱۲۱۱
۲۲۴%	۹۲۰	۱.۰۰	۲۵.۹	(۷.۴%)	۷,۳۶۲	۷,۹۵۰	۲۸۴	۱۲۰.۴	۶	۷,۰۷۸	بساما ۱۲۱۰
۱۸۶%	۱,۳۳۳	۱.۰۰	۱۵.۳	(۱۰.۳%)	۷,۱۲۸	۷,۹۵۰	۴۶۶	۶۰.۸	۶	۶,۶۶۲	بساما ۱۲۰۹
۱۰۹%	۵۶	۰.۳۱	۱۸۶.۲	۴.۹%	۵,۰۲۷	۴,۷۹۰	۲۷	۵.۲	۹	۵,۰۰۰	شپنا ۱۲۲۱
۱۰۱%	۷۸۴	۰.۳۶	۱۲۹.۲	۶.۴%	۵۰,۳۹۰	۴۷,۳۶۷	۳۹۰	۱.۳	۲۷	۵۰,۰۰۰	آساس ۱۲۰۶

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	۴,۵۰۱.۰	۳۴%	۴,۵۰۱	۳,۳۶۲	۱	۴.۲	۲	۴,۵۰۰	خودرو ۱۲۳۹
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۵۱.۰	۶۱%	۷۰۲	۴۳۷	۲	۱۲.۱	۲۳	۷۰۰	ذوب ۱۲۰۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۱,۶۵۱.۰	۲۸%	۱,۶۵۱	۱,۲۹۱	۱	۸.۳	۹	۱,۶۵۰	شستا ۱۲۳۲
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۳۰۱.۰	۴۲%	۲,۴۰۸	۱,۶۹۲	۸	۴.۷	۱۶	۲,۴۰۰	وتجارت ۱۲۲۵
(۱۰۰%)	۰	۰.۰۰	۴,۰۰۱.۰	۱۹%	۴,۰۰۱	۳,۳۶۲	۱	۵۹.۶	۲	۴,۰۰۰	خودرو ۱۲۳۸

(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

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک 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
۲۹.۸%	۶۲۲	-۱.۰۰	۷.۴	۴.۷%	۳,۵۲۱	۳,۳۶۲	۴۷۹	۱.۳	۲	۴,۰۰۰	طخود ۱۲۳۸ خودرو
(۱.۱%)	۳۷۳	-۱.۰۰	۸.۹	۰.۳%	۳,۳۷۳	۳,۳۶۲	۳۷۷	۵۲.۳	۲	۳,۷۵۰	طخود ۱۲۳۷ خودرو
(۱۲.۳%)	۸,۳۷۳	-۱.۰۰	۲.۶	(۱.۴%)	۲۴,۴۵۶	۲۴,۸۰۰	۹,۵۴۴	۱۵.۳	۲۳	۳۴,۰۰۰	طهرم ۱۲۴۶ اهرم
(۱۸.۰%)	۴,۵۲۰	-۰.۹۵	۴.۴	(۱.۳%)	۲۴,۴۸۹	۲۴,۸۰۰	۵,۵۱۱	۲.۸	۲۳	۳۰,۰۰۰	طهرم ۱۲۴۵ اهرم
(۲۶.۰%)	۲,۷۳۸	-۰.۸۲	۶.۶	(۲.۰%)	۲۴,۲۹۹	۲۴,۸۰۰	۳,۷۰۱	۴,۶۴۴.۸	۲۳	۲۸,۰۰۰	طهرم ۱۲۴۴ اهرم

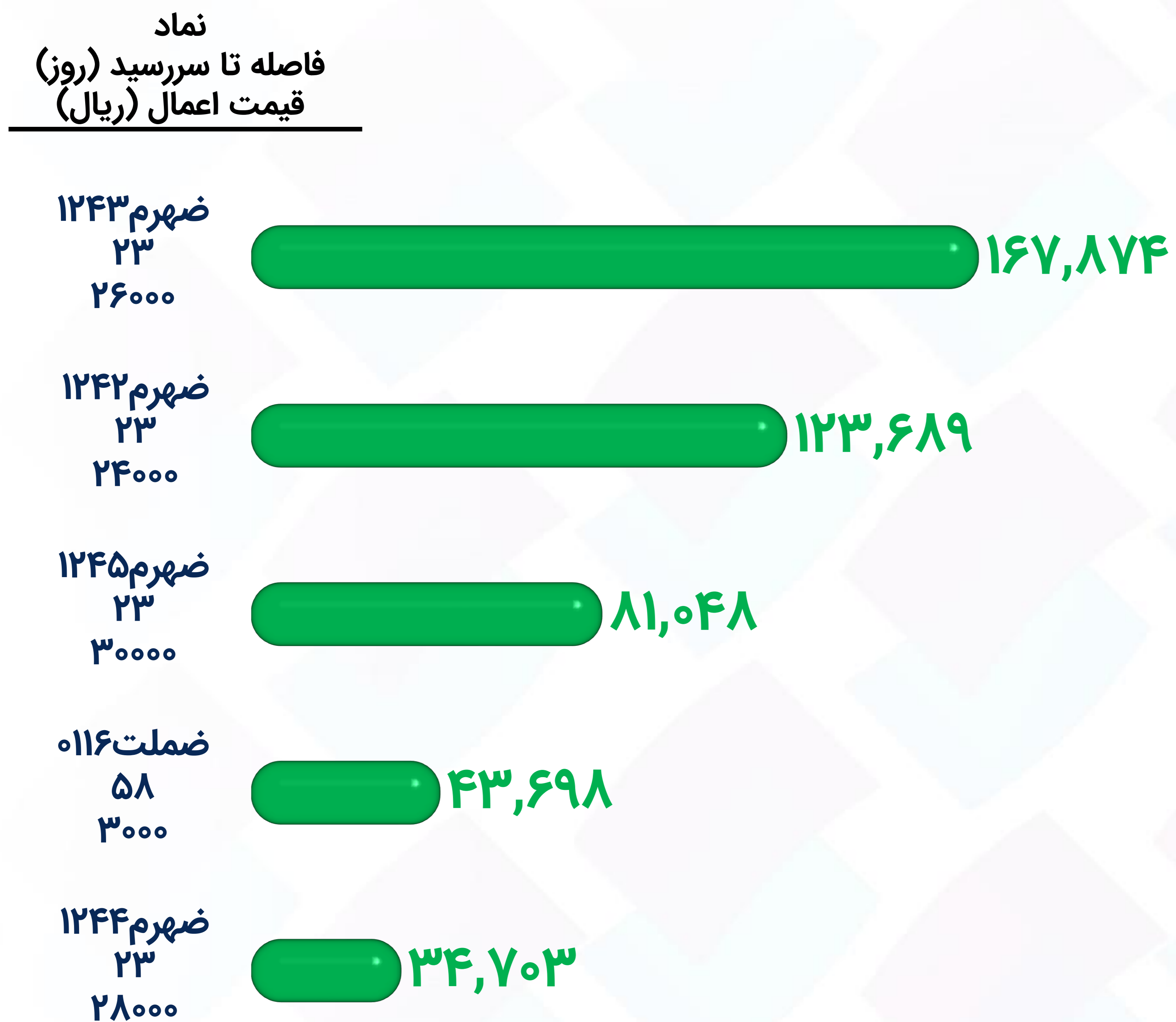
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

فاصله تا ارزش ذاتی	ارزش ذاتی (بلک 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	۰.۰۰	۵۲۴.۰	(۱۸.۸%)	۱,۰۴۸	۱,۲۹۱	۲	۱.۹	۹	۱,۰۵۰	طستا ۱۲۲۶ شستا
(۹۸.۲%)	۰	۰.۰۰	۲,۹۹۹.۰	(۱۰.۸%)	۲,۹۹۹	۳,۳۶۲	۱	۲۵.۳	۲	۳,۰۰۰	طخود ۱۲۳۴ خودرو
(۹۴.۷%)	۰	-۰.۰۱	۵۷۴.۰	(۱۱.۱%)	۱,۱۴۸	۱,۲۹۱	۲	۸.۴	۹	۱,۱۵۰	طستا ۱۲۲۷ شستا
(۹۳.۳%)	۲	-۰.۰۲	۹۲.۳	(۱۷.۶%)	۲,۷۷۰	۳,۳۶۲	۳۰	۱۹.۸	۳۷	۲,۸۰۰	طخود ۰۱۳۵ خودرو
(۹۱.۳%)	۵	-۰.۰۱	۳۲۶.۹	(۱۹.۶%)	۱۹,۹۳۹	۲۴,۸۰۰	۶۱	۳۶.۹	۲۳	۲۰,۰۰۰	طهرم ۱۲۴۰ اهرم

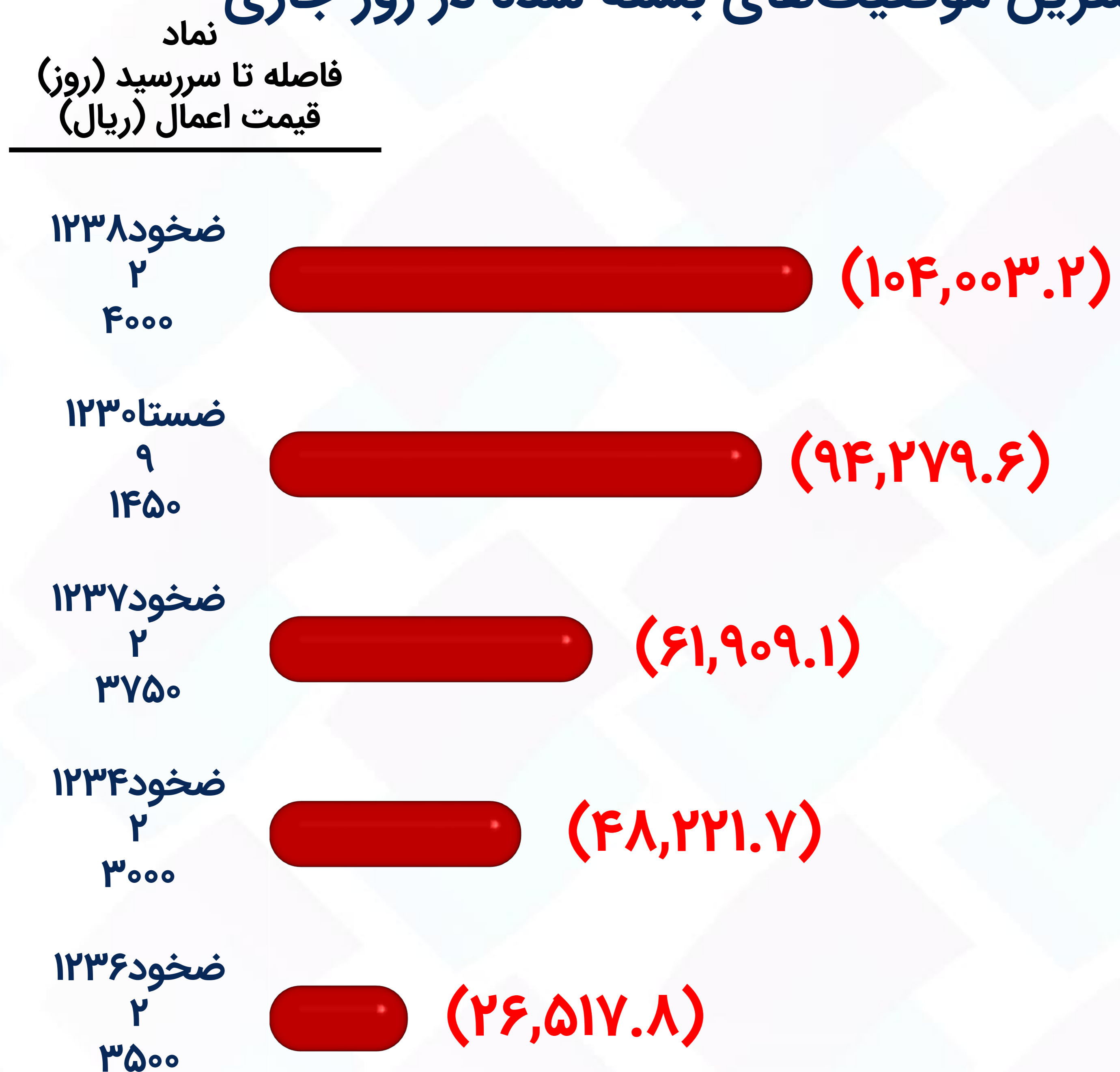
(۱) سر به سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

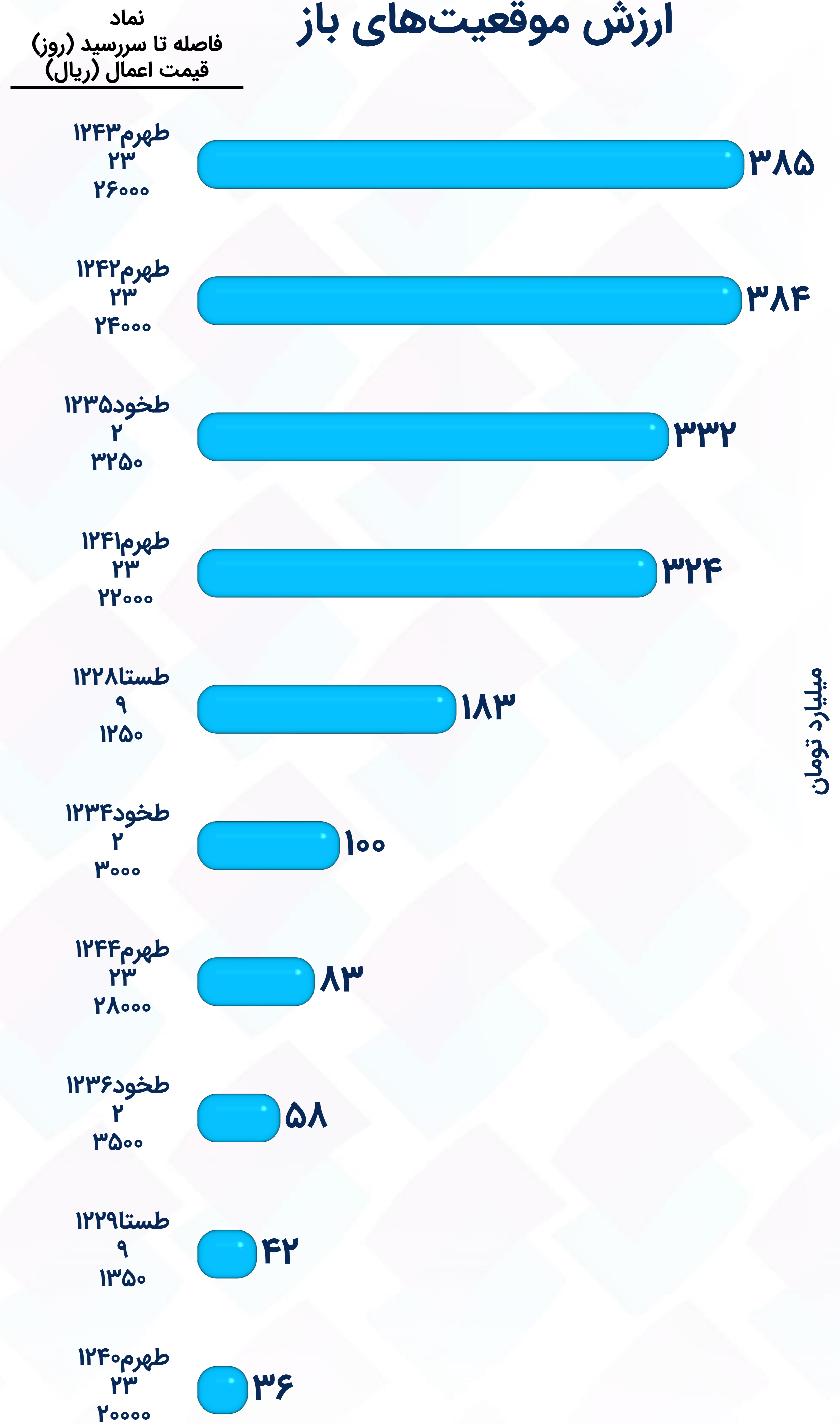
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

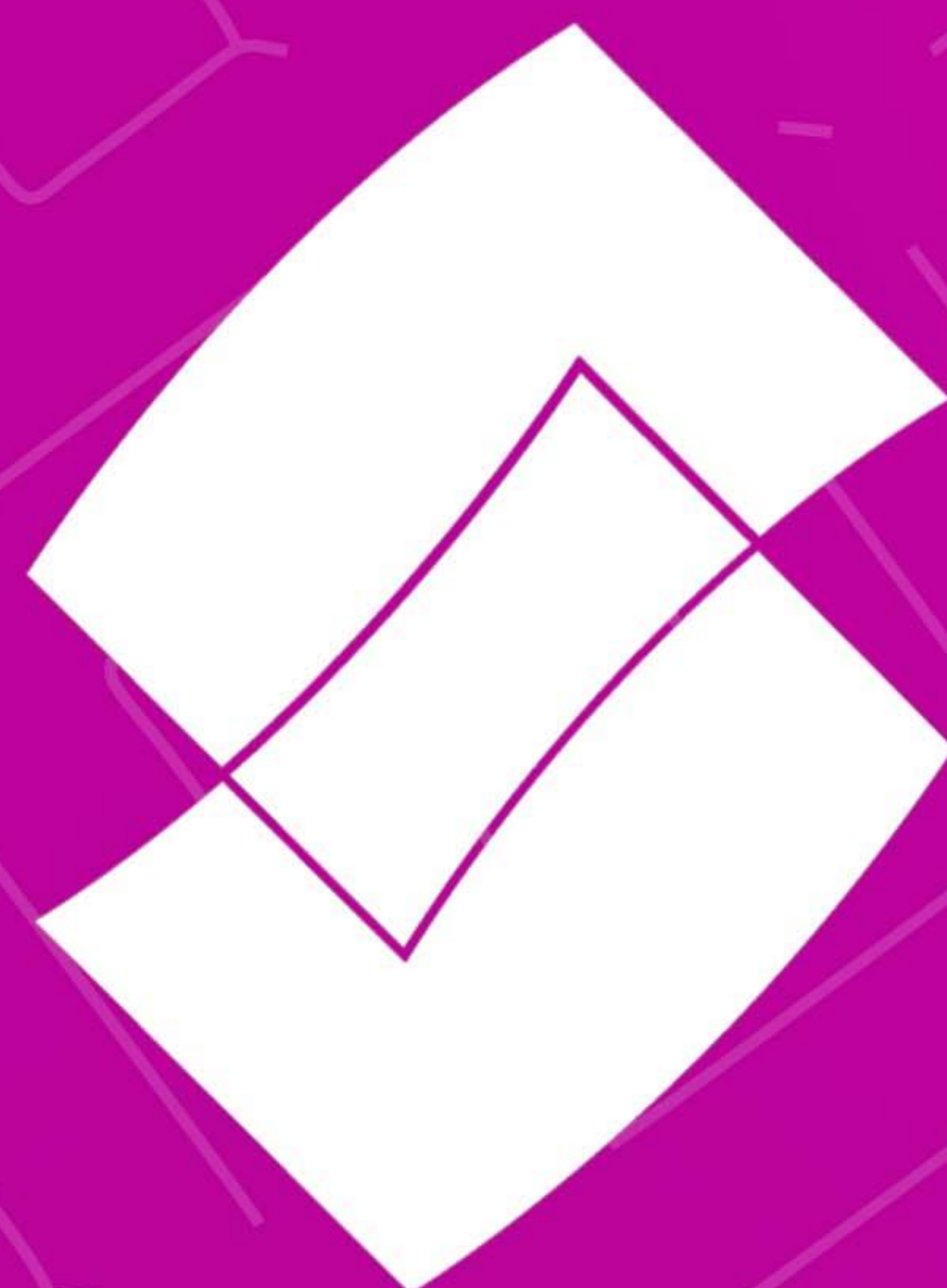
اختیار خرید



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 اخذ تصمیمات مالی و
سرمایه گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.