

شماره
۴۴۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۰ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





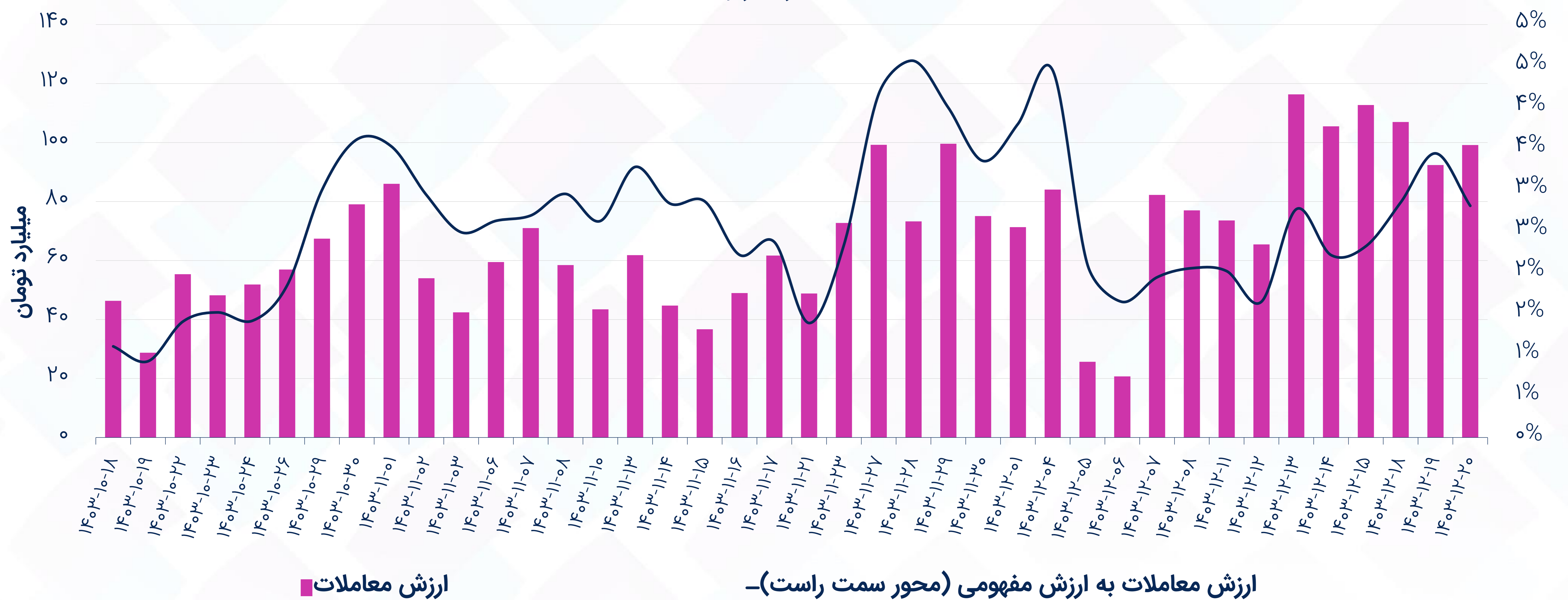
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



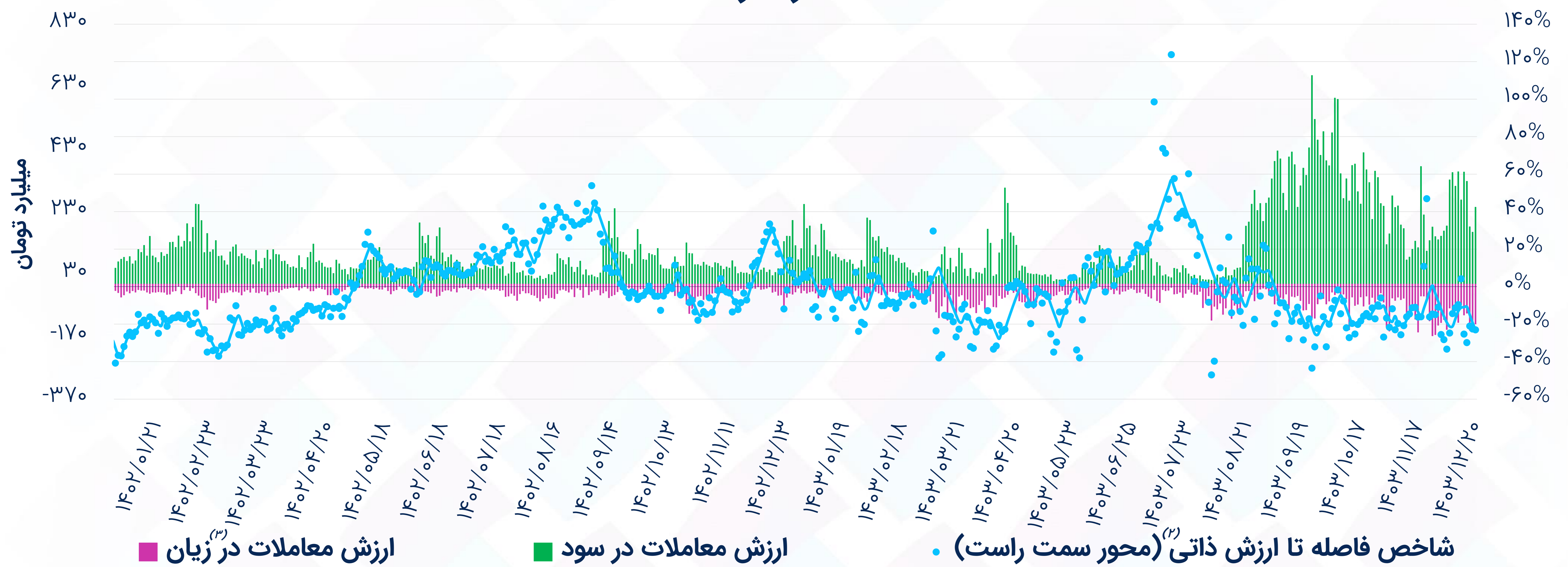
اختیار فروش



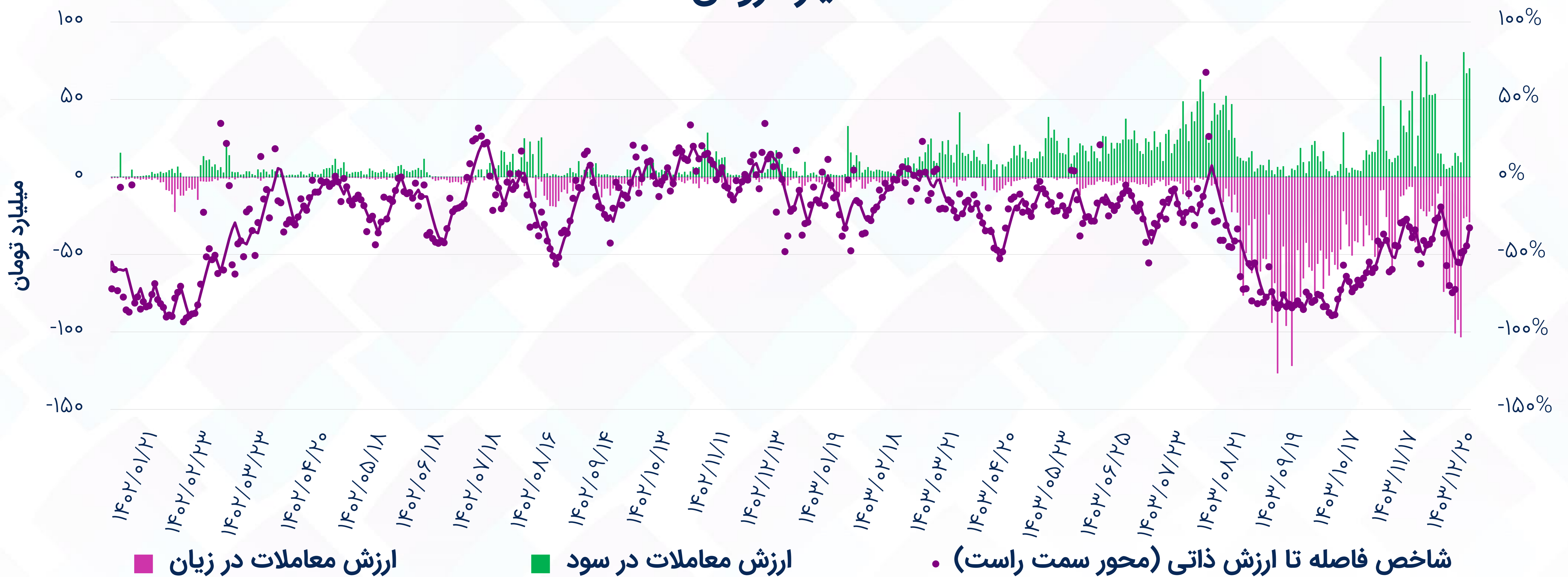
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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 | ۵۰ | ۲۴۹.۱ | ۱۰,۸۰۱.۹ | ۱۴۱.۳ | ۱۰۷.۸ | (۲۷.۷%) |
| خودرو | ۳۶ | ۶۷.۱ | ۹۶۵.۳ | ۶۴.۳ | ۲.۸ | (۱.۵%) |
| شستا | ۳۵ | ۲۳.۶ | ۳۹۸.۸ | ۸.۸ | ۱۴.۹ | (۶۰.۲%) |
| ذوب | ۲۳ | ۱۰.۵ | ۸۴.۹ | ۹.۱ | ۱.۴ | (۲۷.۶%) |
| خسپا | ۲۶ | ۹.۹ | ۲۷۷.۶ | ۹.۳ | ۰.۶ | ۲۴.۸% |
| وبملت | ۲۲ | ۹.۷ | ۹۰.۵ | ۸.۳ | ۱.۴ | (۱۰.۹%) |
| موج | ۵ | ۱.۲ | ۷.۶ | ۱.۰ | ۰.۲ | (۱۴.۱%) |

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 | ۱۷ | ۹۲,۲۰۳.۴ | ۲,۴۴۱,۷۰۱.۱ | ۶۹,۴۶۳.۴ | ۲۲,۷۴۰.۰ | (۲۹.۷%) |
| خودرو | ۸ | ۵,۳۶۶.۳ | ۱,۰۵۲,۸۸۸.۹ | ۴۸.۴ | ۵,۳۱۸.۰ | (۸۱.۲%) |
| شستا | ۶ | ۱,۴۱۰.۰ | ۳۵,۹۳۹.۲ | ۴۳۴.۷ | ۹۷۵.۳ | (۵۰.۷%) |
| خپارس | ۱ | ۱۰۰.۱ | ۱.۰ | ۰.۰ | ۱۰۰.۱ | (۱۰۰.۰%) |
| ذوب | ۴ | ۳۷.۲ | ۲,۹۴۲.۰ | ۳۰.۹ | ۶.۳ | (۲.۵%) |
| خودران | ۱ | ۱۸.۴ | ۲۰۲.۰ | ۱۸.۴ | ۰.۰ | (۱۵.۷%) |
| وبملت | ۲ | ۹.۰ | ۶۹۷.۰ | ۰.۰ | ۹.۰ | (۷۰.۹%) |

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۱۷,۴۲۶

اهرم ۱۸,۵۳۹

وبملت ۱۷,۹۲۱

ذوب ۱۲,۴۲۶

خسپا ۸,۹۰۲

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۸,۶۱۶

شستا ۲,۰۳۴

خودرو ۱,۷۷۵

ذوب ۸۸۸

وبملت ۵۹۹

خسپا ۴۳۸

آساس ۳۱۵

شتاب ۱۳۵

فملی ۱۲۹

فولاد ۱۱۹

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

فملی (۲,۵۶۹.۲)

بساما (۱۸۶.۷)

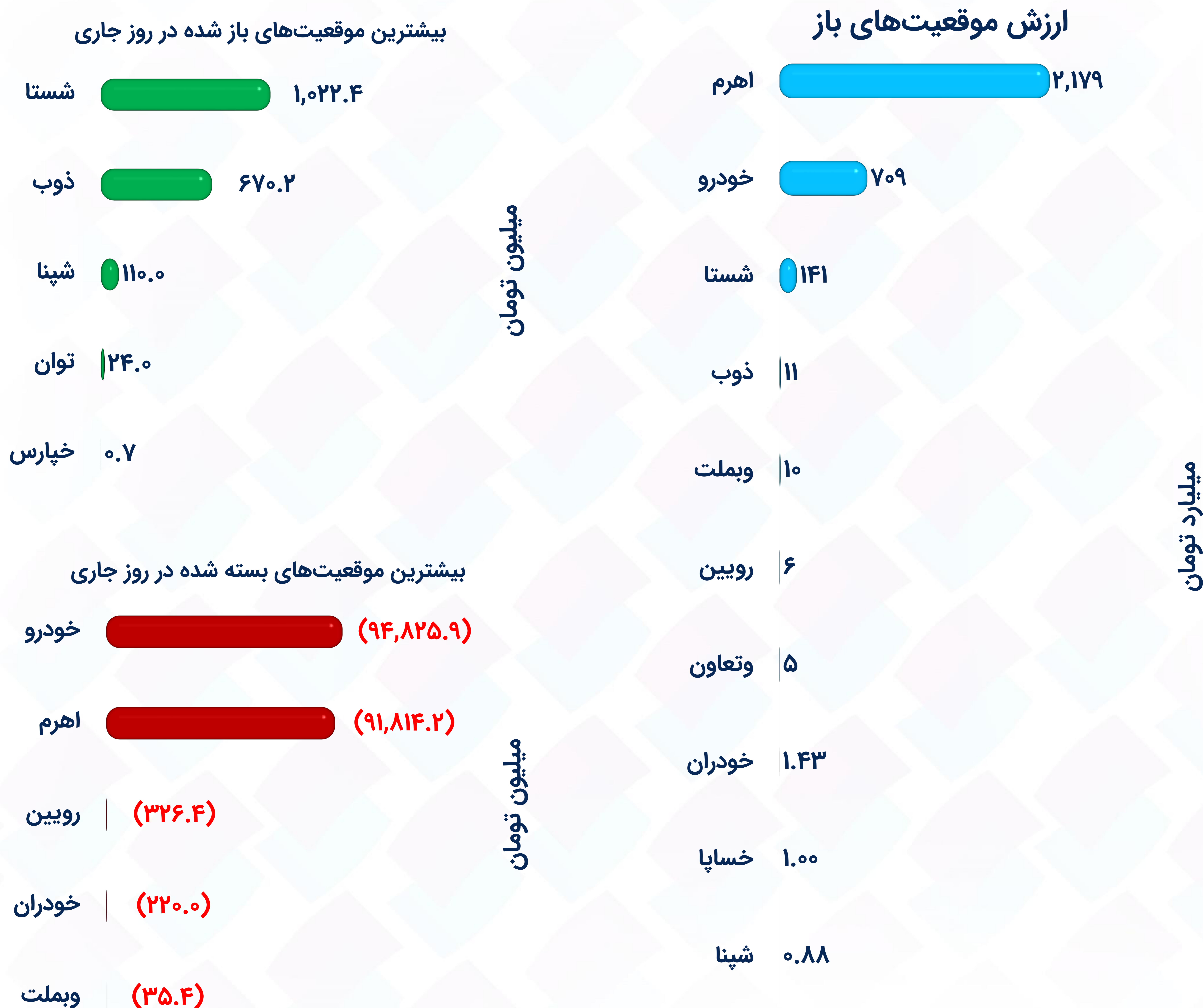
ثمین (۹۶.۰)

تیام (۱۵.۴)

میلیون تومان

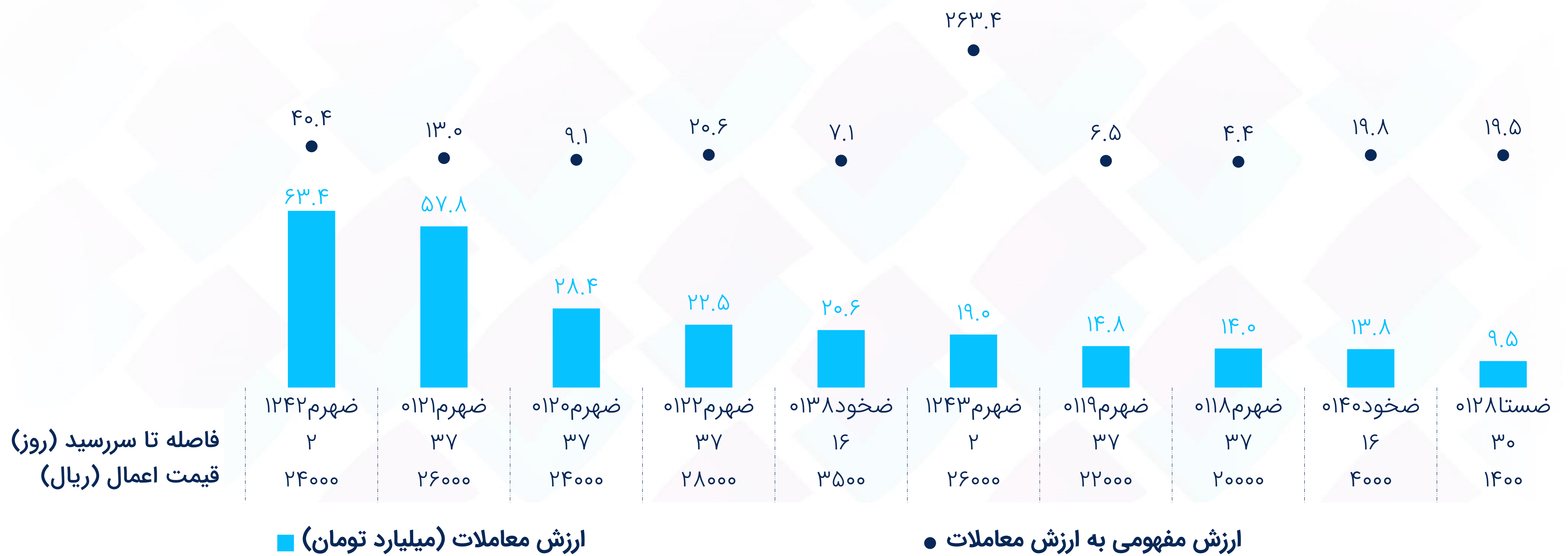
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

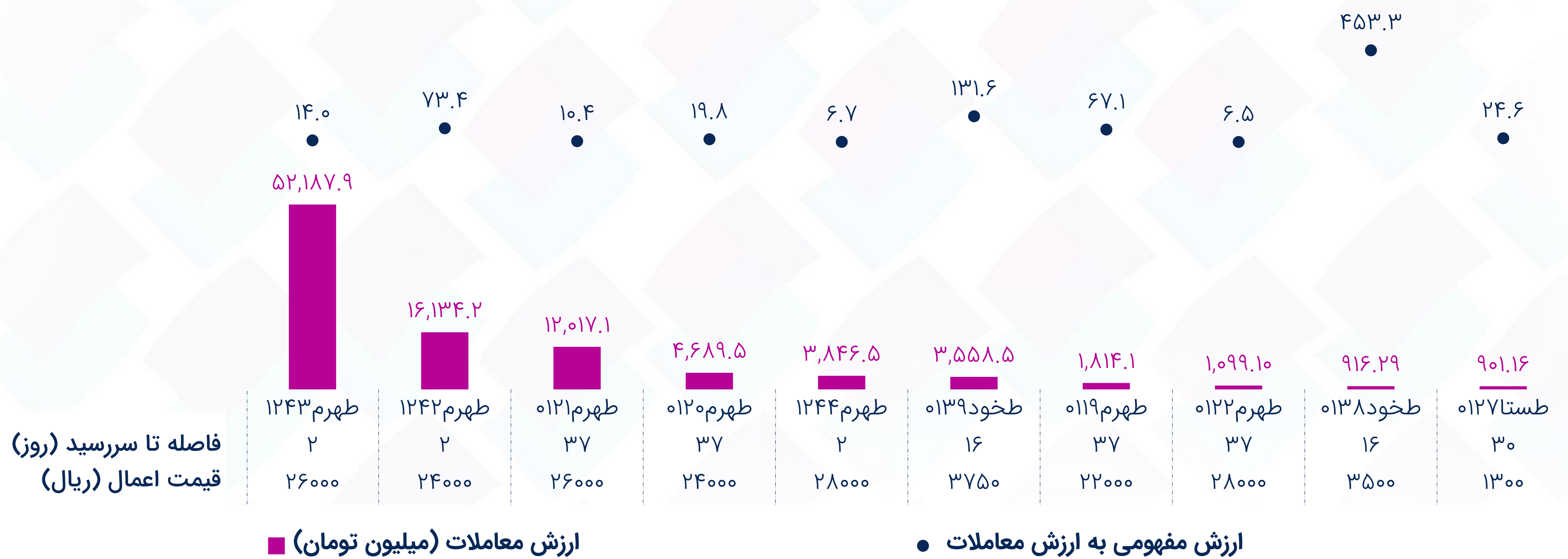


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

اختیار خرید



اختیار فروش



فاصله بهای اختیار خرید 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 |
|--------------------|----------------------|------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|-------------|
| ۳۹۲% | ۳۴۹ | ۰.۷۷ | ۱۷۰.۰ | (۱.۱%) | ۱۲,۰۷۱ | ۱۲,۲۰۹ | ۷۱ | ۲.۰ | ۶ | ۱۲,۰۰۰ | ضرویین ۱۲۰۶ |
| ۷۳% | ۳,۹۴۰ | ۰.۷۲ | ۲۲.۱ | ۳.۲% | ۵۰,۲۸۰ | ۴۸,۷۰۰ | ۲,۲۸۰ | ۶۰.۴ | ۵۵ | ۴۸,۰۰۰ | ضفرز ۲۱۰ |
| ۵۲% | ۴۰۶ | ۰.۲۲ | ۹۸.۴ | ۲۲.۳% | ۲۶,۲۶۷ | ۲۱,۴۷۴ | ۲۶۷ | ۴.۳ | ۶۲ | ۲۶,۰۰۰ | ضموج ۲۱۹ |
| ۴۹% | ۱۵۳ | ۰.۹۳ | ۳۰.۱ | (۱.۱%) | ۳,۱۰۳ | ۳,۱۳۷ | ۱۰۳ | ۳,۸۱۷.۳ | ۲ | ۳,۰۰۰ | ضسپا ۱۲۳۸ |
| ۴۶% | ۱,۴۹۰ | ۰.۹۹ | ۸.۷ | (۱.۷%) | ۸,۹۳۴ | ۹,۰۹۰ | ۱,۰۲۳ | ۱۳.۰ | ۴۸ | ۷,۹۱۱ | ضبساما ۲۲۱ |

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 | ۰.۰۰ | ۴,۲۵۱.۰ | ۳۹% | ۳۴,۰۰۸ | ۲۴,۵۰۰ | ۸ | ۳.۵ | ۲ | ۳۴,۰۰۰ | ضهرم ۱۲۴۶ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۴,۲۸۶.۷ | ۲۲% | ۳۰,۰۰۷ | ۲۴,۵۰۰ | ۷ | ۹۹.۹ | ۲ | ۳۰,۰۰۰ | ضهرم ۱۲۴۵ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۴.۷ | ۷۲% | ۲,۲۴۱ | ۱,۳۰۶ | ۴۱ | ۱.۲ | ۸۵ | ۲,۲۰۰ | ضستا ۳۰۳۶ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۲۱۳.۵ | ۳۱% | ۱,۷۰۸ | ۱,۳۰۶ | ۸ | ۱۱۶.۴ | ۳۰ | ۱,۷۰۰ | ضستا ۰۱۳۱ |
| (۱۰۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۰۱.۰ | ۱۶% | ۵۰۱ | ۴۳۳ | ۱ | ۷.۳ | ۲ | ۵۰۰ | ضدوب ۱۲۰۳ |

(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 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 |
|--------------------|---------------------|-------|---------------------|----------------------------------|-------------------------|------------------|-------------|-----------------------------|------------------------|------------------------|-----------|
| ۱۰.۲% | ۴۶۸ | -۰.۹۵ | ۹.۶ | ۲.۵% | ۴,۰۷۵ | ۳,۹۷۴ | ۴۲۵ | ۱۳.۶ | ۱۷ | ۴,۵۰۰ | طخود ۱۴۱۰ |
| (۲.۸%) | ۶۳ | -۱.۰۰ | ۶.۷ | ۰.۲% | ۴۳۵ | ۴۳۴ | ۶۵ | ۳۰.۱ | ۳ | ۵۰۰ | طذوب ۱۲۰۳ |
| (۴.۳%) | ۱۶۳ | -۱.۰۰ | ۲.۵ | (۰.۹%) | ۴۳۰ | ۴۳۴ | ۱۷۰ | ۸.۵ | ۳ | ۶۰۰ | طذوب ۱۲۰۴ |
| (۶.۵%) | ۵,۰۹۱ | -۱.۰۰ | ۴.۵ | (۰.۸%) | ۲۴,۵۵۴ | ۲۴,۷۴۰ | ۵,۴۴۶ | ۱۹۶.۱ | ۳ | ۳۰,۰۰۰ | طهرم ۱۲۴۵ |
| (۱۶.۳%) | ۳,۱۰۴ | -۰.۹۹ | ۶.۵ | (۱.۸%) | ۲۴,۲۸۹ | ۲۴,۷۴۰ | ۳,۷۱۱ | ۶,۱۰۸.۲ | ۳ | ۲۸,۰۰۰ | طهرم ۱۲۴۴ |

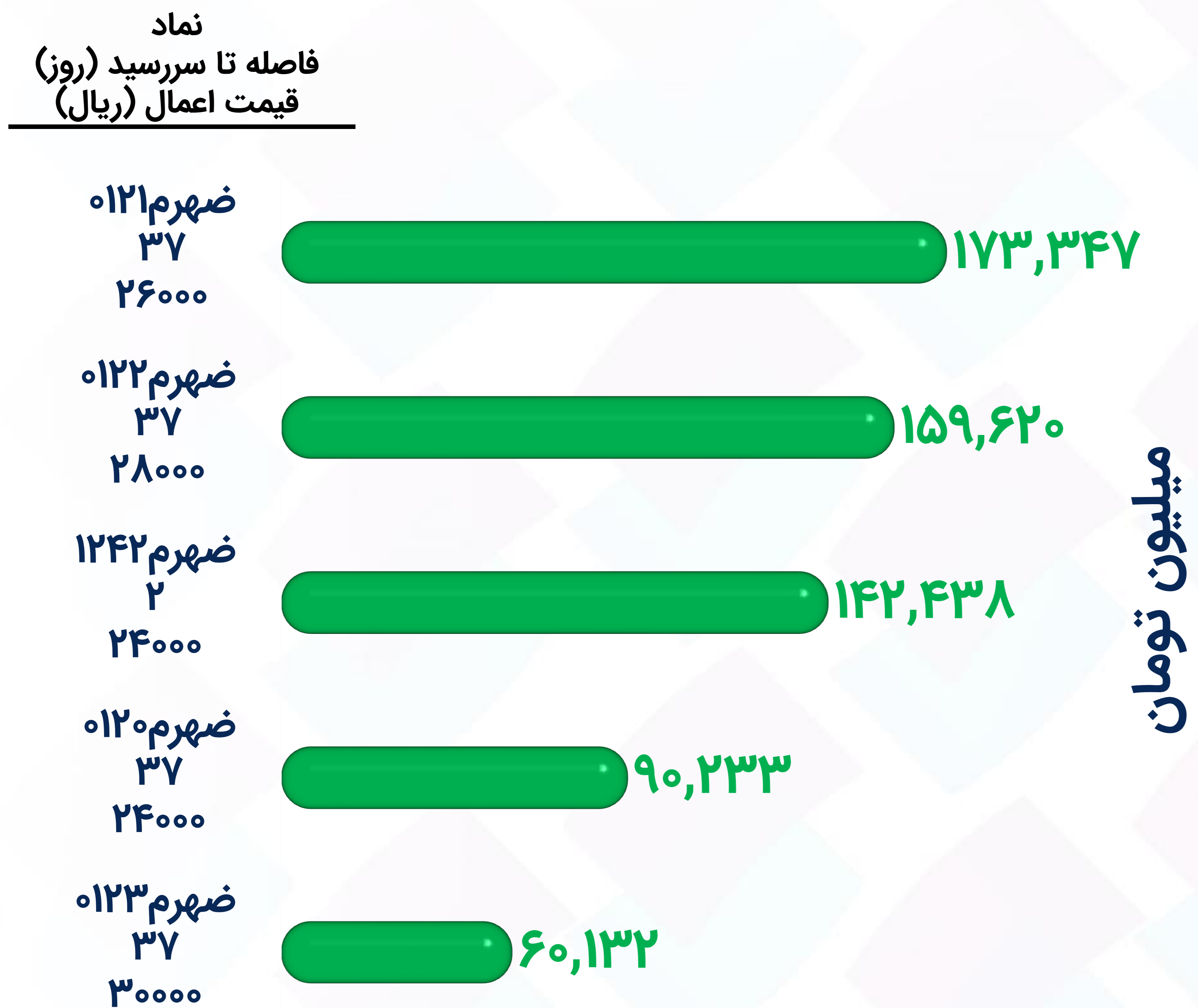
گرانترین نسبت به ارزش بک شولز

| 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 | ۰.۰۰ | ۱۹۹.۰ | (۵۴.۳%) | ۵۹۷ | ۱,۳۰۶ | ۳ | ۱.۱ | ۳۰ | ۶۰۰ | طستا ۱۲۰ |
| (۱۰۰.۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۶۹۹.۰ | (۳۱.۵%) | ۲,۷۹۶ | ۴,۰۸۰ | ۴ | ۰.۸ | ۱۶ | ۲,۸۰۰ | طخود ۱۳۵ |
| (۱۰۰.۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۹۹.۰ | (۲۶.۶%) | ۲,۹۹۵ | ۴,۰۸۰ | ۵ | ۱۷.۹ | ۱۶ | ۳,۰۰۰ | طخود ۱۳۶ |
| (۱۰۰.۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۳,۹۹۹.۰ | (۱۸.۴%) | ۱۹,۹۹۵ | ۲۴,۵۰۰ | ۵ | ۲.۰ | ۲ | ۲۰,۰۰۰ | طهرم ۱۲۴۰ |
| (۱۰۰.۰%) | ۰ | ۰.۰۰ | ۵۴۰.۷ | (۲۰.۵%) | ۳,۲۴۴ | ۴,۰۸۰ | ۶ | ۱۹۲.۹ | ۱۶ | ۳,۲۵۰ | طخود ۱۳۷ |

(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

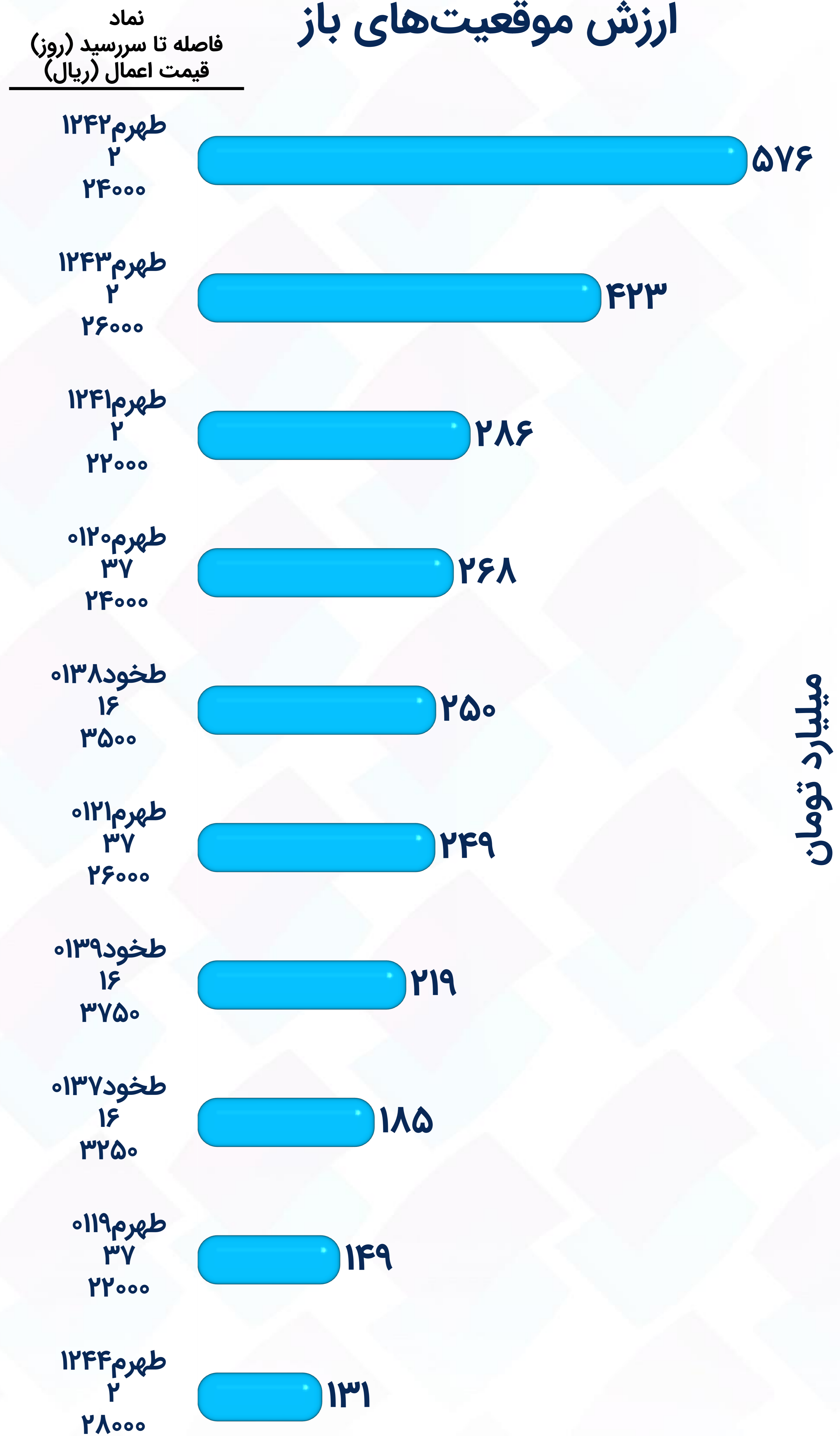
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین تغییرات قیمت (۱)

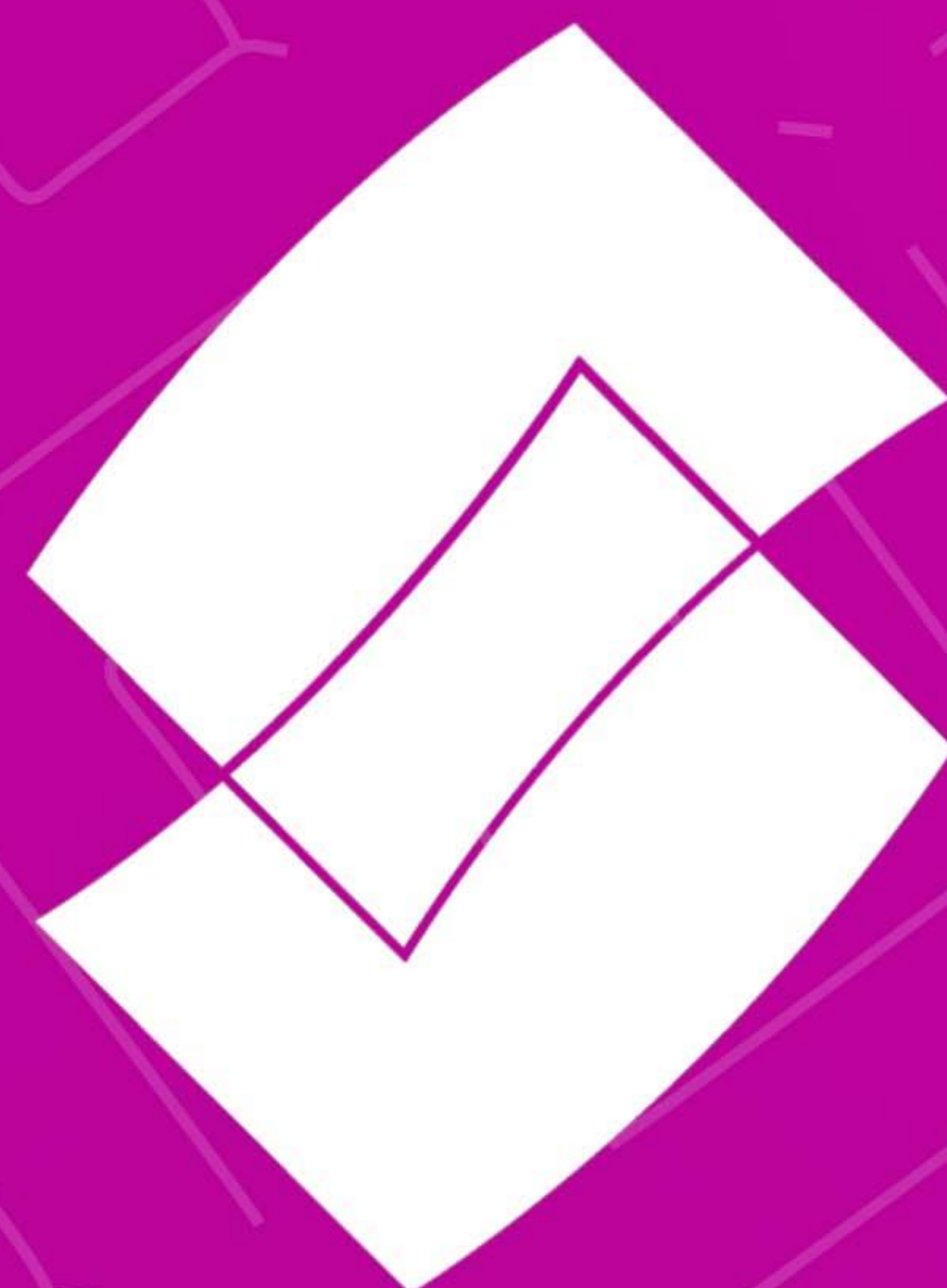
اختیار خرید



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.