

شماره
۳۹۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

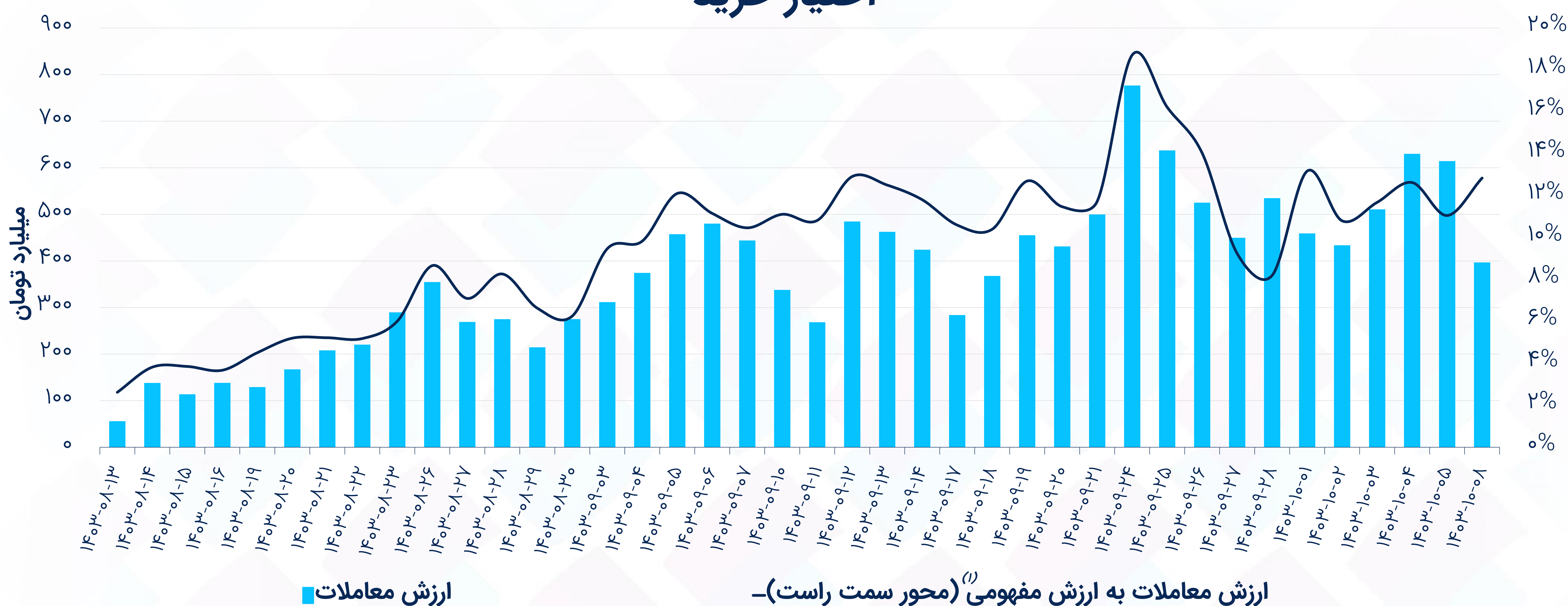




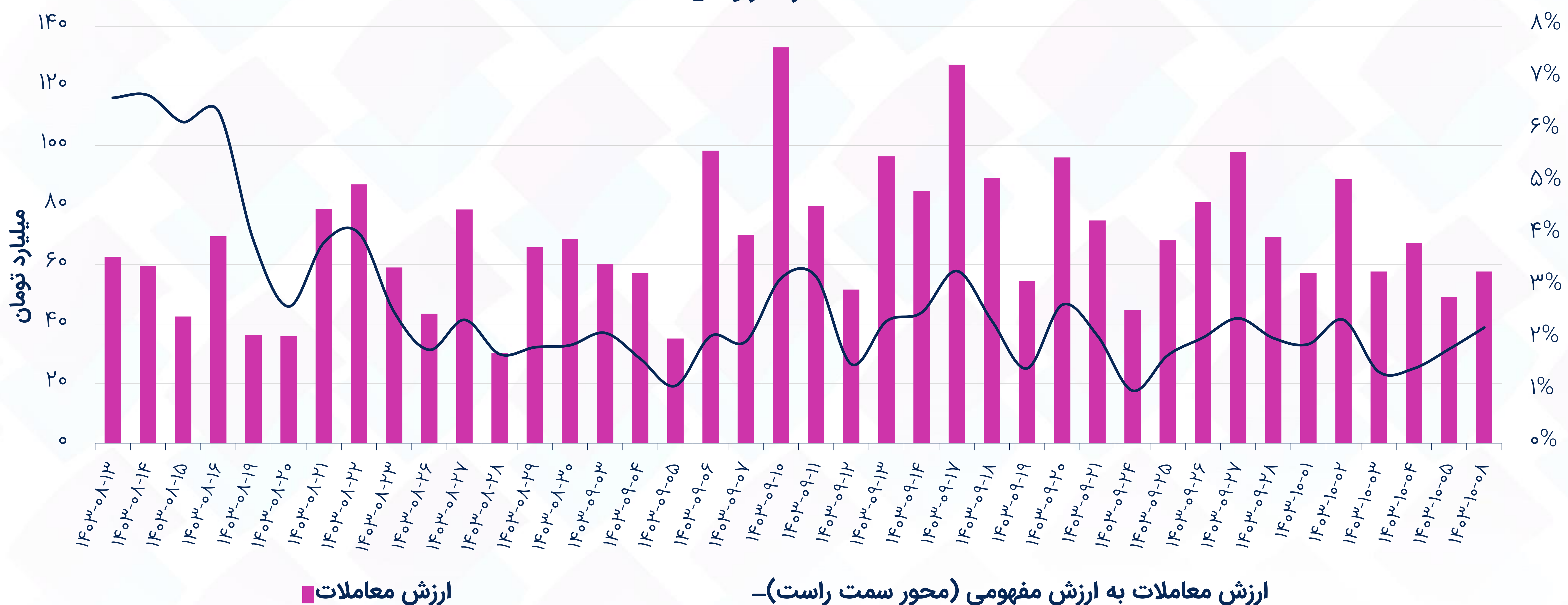
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



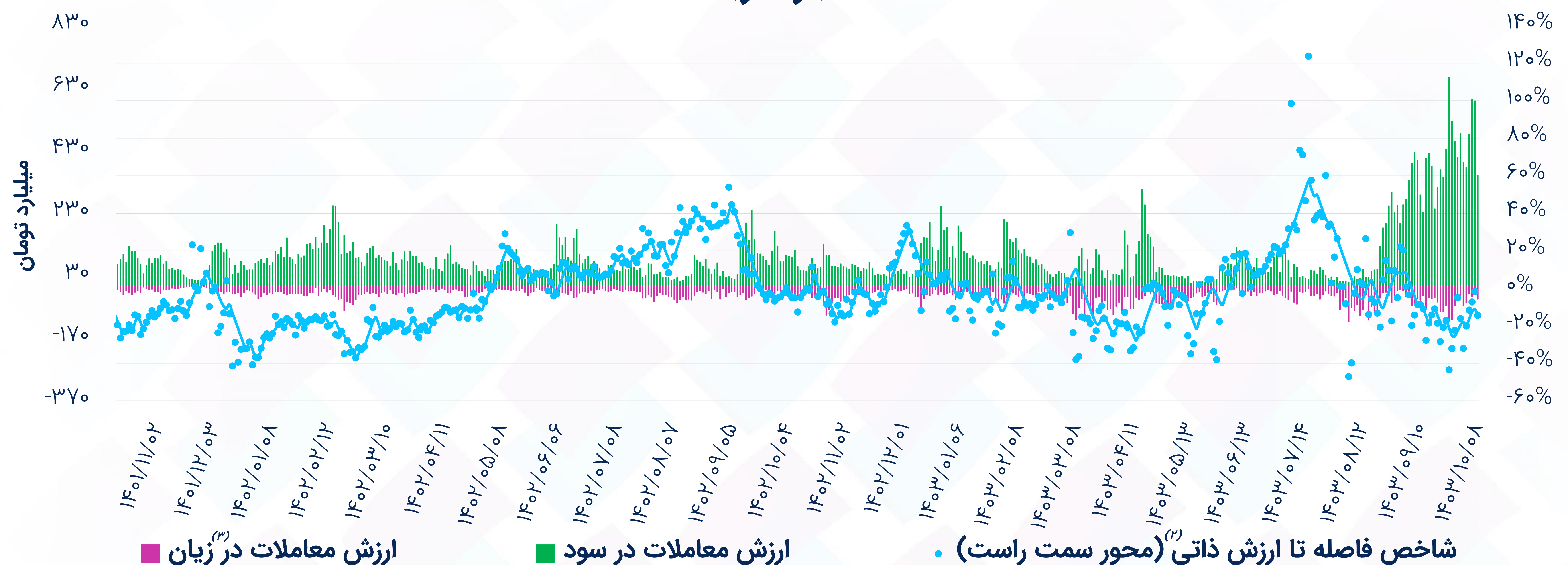
اختیار فروش



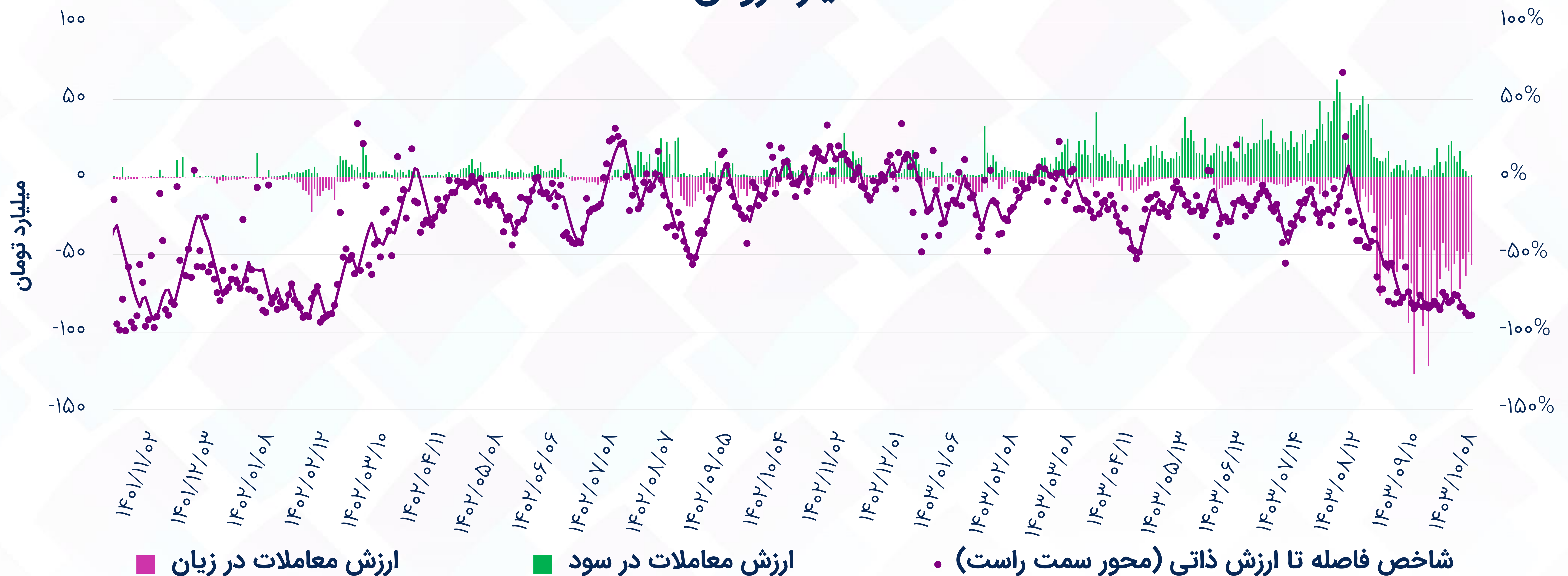
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

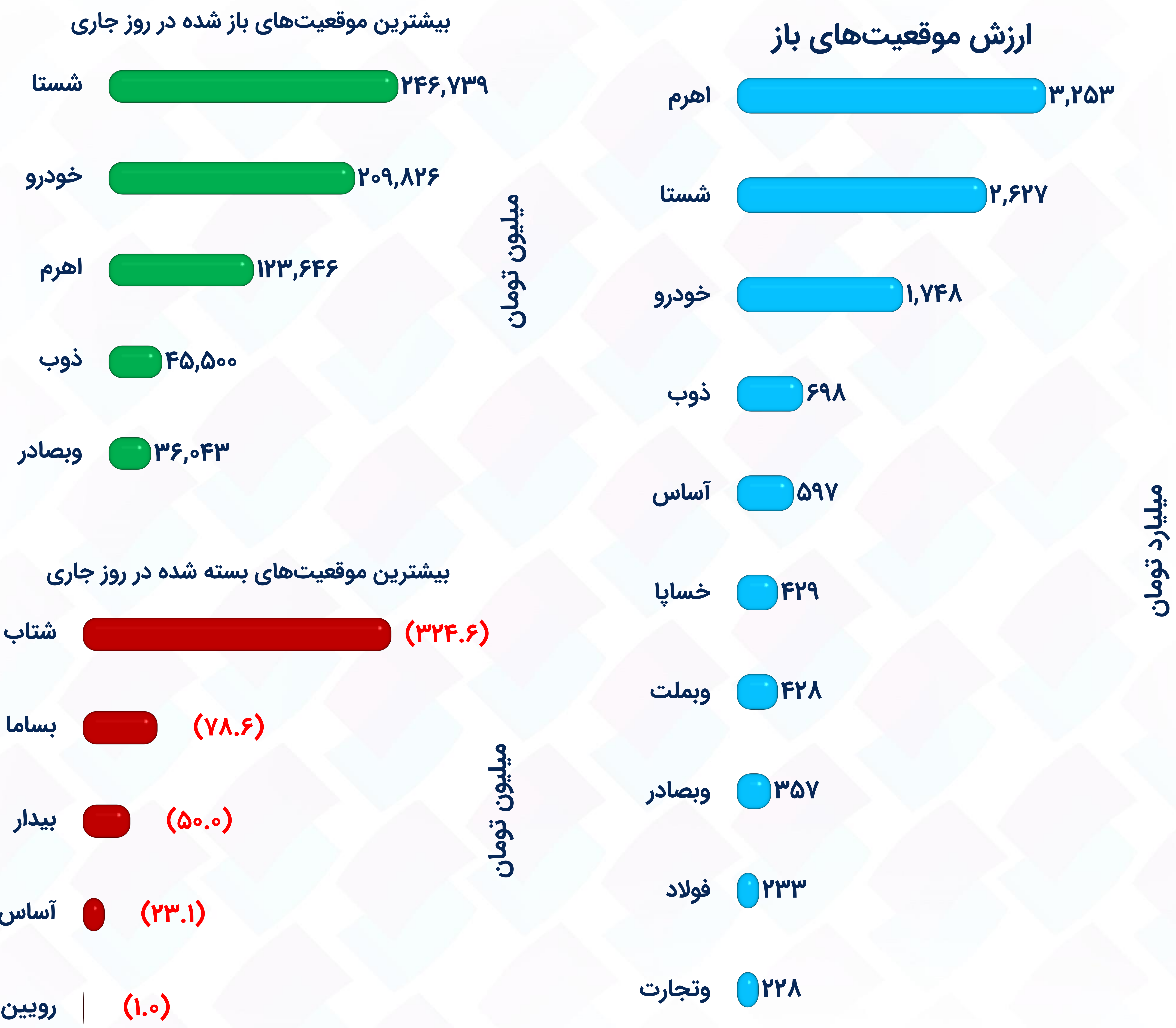
اختیار خرید

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
خودرو	۳۱	۱۹۴.۰	۱,۱۴۴.۷	۱۷۷.۴	۱۶.۵	(۱۲.۲%)
اهرم	۳۹	۷۱.۶	۴۶۹.۴	۶۶.۱	۵.۵	(۲۳.۳%)
شستا	۴۰	۶۵.۷	۱,۰۳۴.۸	۵۴.۸	۱۰.۹	(۵.۲%)
ذوب	۲۰	۲۵.۷	۱۰۷.۴	۲۲.۸	۲.۹	(۱۹.۹%)
خسپا	۱۱	۸.۳	۱۰۱.۱	۶.۱	۲.۲	(۲۳.۱%)
وبملت	۱۱	۷.۱	۴۸.۱	۴.۳	۲.۸	(۴۰.۸%)
وبصادر	۹	۴.۷	۴۸.۹	۲.۹	۱.۸	(۵۴.۸%)

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
خودرو	۶	۳۶,۰۲۷.۷	۱,۴۶۰,۵۹۰.۳	۰.۵	۳۶,۰۲۷.۳	(۹۴.۲%)
اهرم	۱۷	۱۸,۵۱۱.۰	۷۴۲,۰۸۸.۷	۴۱۶.۷	۱۸,۰۹۴.۳	(۷۹.۱%)
شستا	۲۱	۲,۷۰۸.۴	۳۸۴,۴۷۵.۲	۶۲۷.۴	۲,۰۸۱.۰	(۸۷.۸%)
وبملت	۲	۳۲۲.۸	۷,۹۹۲.۴	۰.۰	۳۲۲.۸	(۸۴.۳%)
ذوب	۴	۷۵.۵	۲,۶۴۶.۳	۱۵.۷	۵۹.۸	(۸۳.۳%)
توان	۳	۱۲.۸	۲۹۱.۶	۰.۰	۱۲.۸	(۷۷.۱%)
موج	۱	۷.۱	۱,۸۱۷.۴	۰.۰	۷.۱	(۹۹.۳%)

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



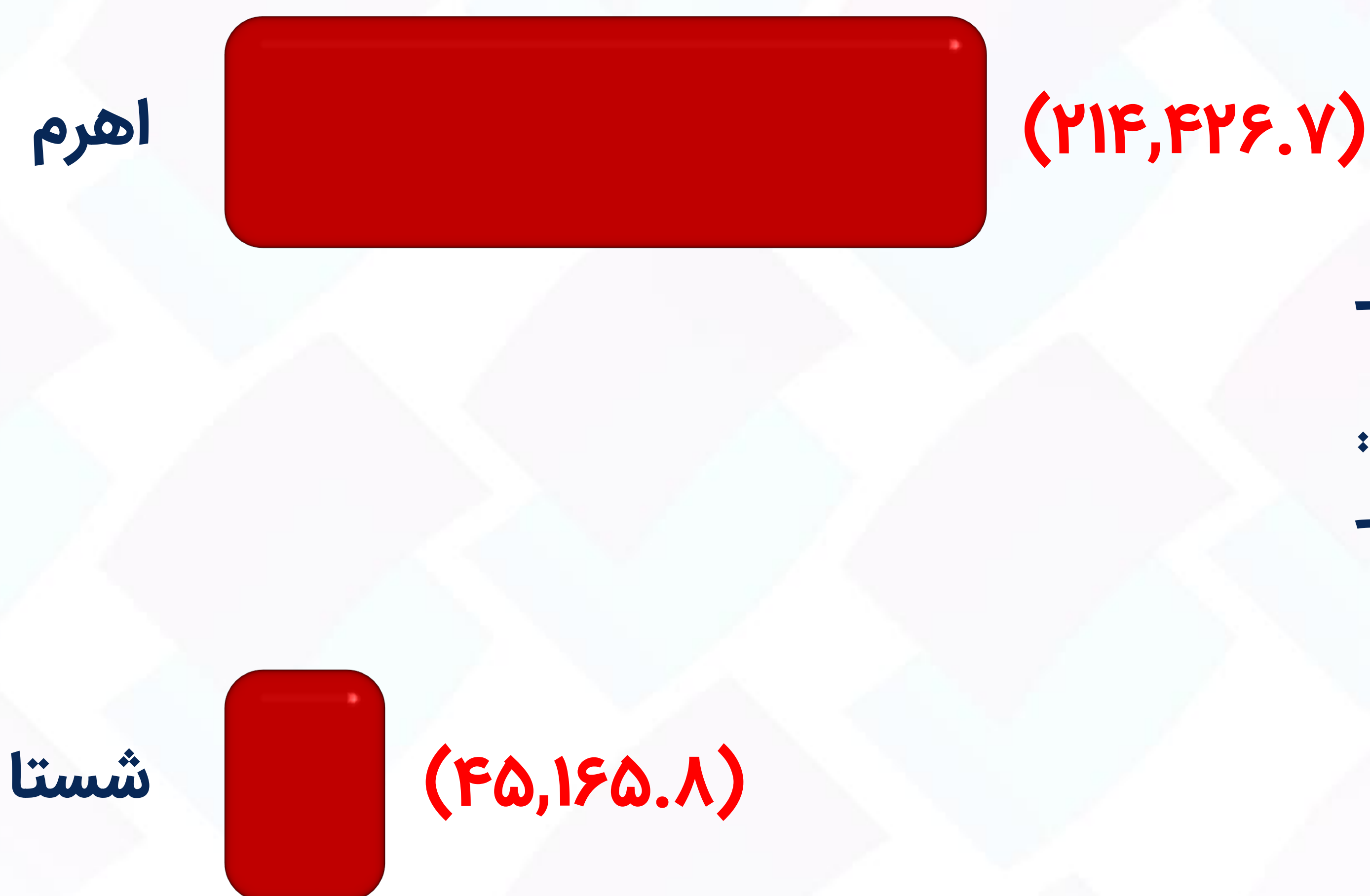
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



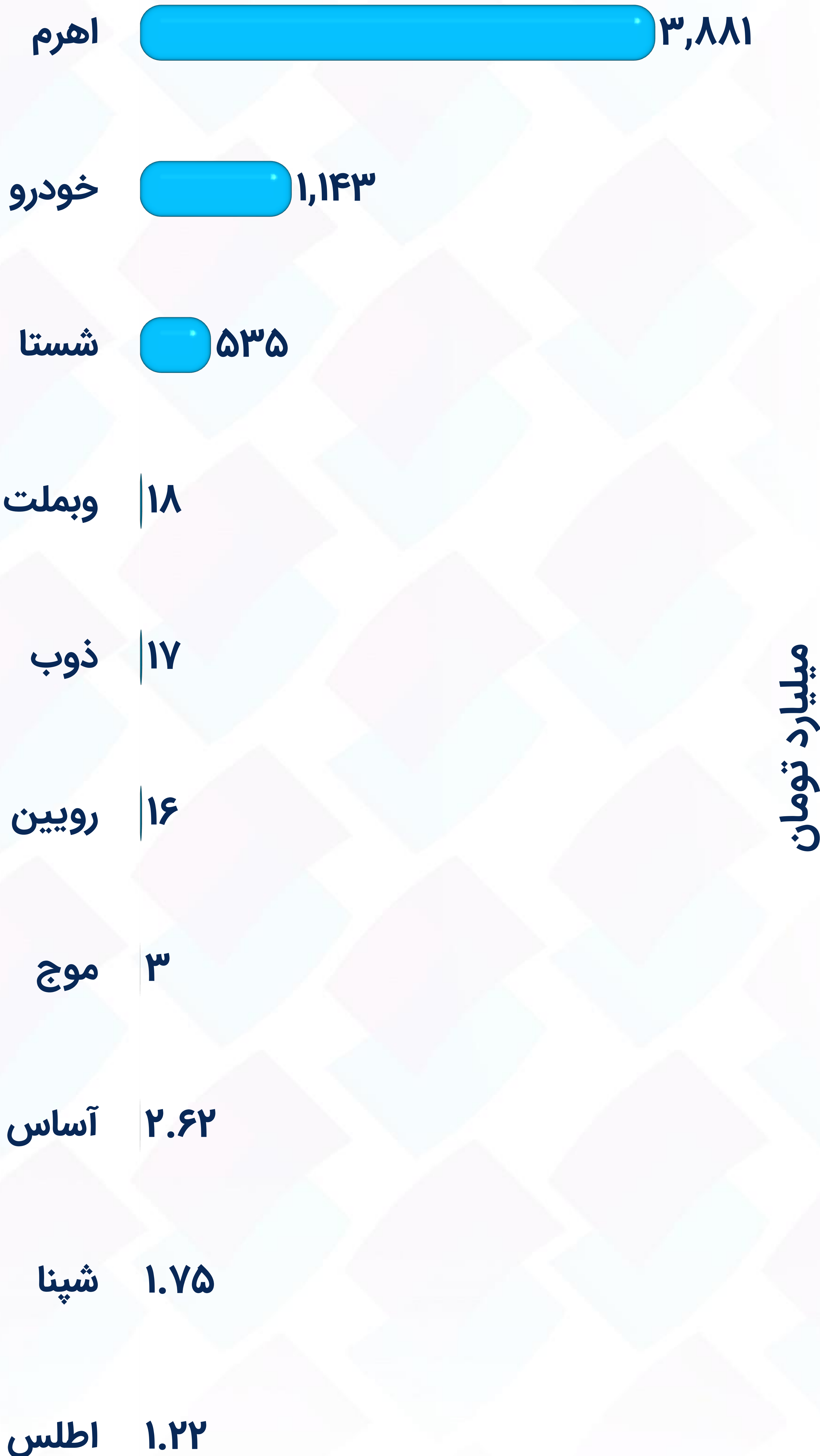
میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد 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
ضستره ۱۲۲۰	خگستر	۴,۵۰۰	۵۳	۴.۶	۲۰۵	۴,۷۵۵	۴,۷۰۵	(۱.۱%)	۲۳.۰	۰.۷۹	۵۳۳	۱۶۰%
ضشنا ۱۰۷۲	شپنا	۵,۰۰۰	۴	۷۹.۴	۲۴۰	۵,۳۶۰	۵,۲۴۰	(۲.۲%)	۲۱.۸	۰.۹۵	۳۹۵	۶۵%
ضهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴۴	۱.۹	۸۹۳	۲۷,۵۸۰	۳۴,۸۹۳	۲۶.۵%	۳۹.۱	۰.۳۷	۱,۳۷۱	۵۴%
ضملی ۱۱۹۴	فملی	۷,۰۰۰	۲۵	۷.۵	۷۵۰	۷,۹۶۰	۷,۷۵۰	(۲.۶%)	۱۰.۳	۰.۹۸	۱,۱۲۳	۵۰%
ضشنا ۱۰۷۱	شپنا	۴,۵۰۰	۴	۵۵۱.۹	۵۹۶	۵,۳۶۰	۵,۰۹۶	(۴.۹%)	۸.۶	۱.۰۰	۸۸۷	۴۹%

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
ضدوب ۱۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۱۸	۴.۶	۲	۵۵۷	۱,۰۰۲	۸۰%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۵	ذوب	۱,۰۰۰	۴۶	۵۲.۶	۱۵	۵۵۷	۱,۰۱۵	۸۲%	۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۴۶	۱۳.۰	۱۹	۵۵۷	۹۱۹	۶۵%	۴۸.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۴۶	۲۰۰.۳	۳۰	۵۵۷	۸۳۰	۴۹%	۲۷.۷	۰.۰۱	۰	(۹۹%)
ضدوب ۱۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۸	۱.۸	۹	۵۵۷	۷۰۹	۲۷%	۷۸.۸	۰.۰۱	۰	(۹۹%)

(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 ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۱۸	۲۵۷.۹	۱۸۶	۲۷,۵۸۰	۲۵,۸۱۴	(۶.۴%)	۱۳۸.۸	-۰.۱۷	۲۱۸	۱۷.۱%
طهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۸	۳۵.۲	۱,۶۰۸	۲۷,۵۸۰	۲۶,۳۹۲	(۴.۳%)	۱۶.۴	-۰.۴۷	۸۹۱	(۴۴.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۶	۲۹۳.۹	۳,۹۷۱	۲۷,۵۸۰	۲۶,۰۲۹	(۵.۶%)	۶.۶	-۰.۶۲	۲,۱۴۸	(۴۵.۹%)
طدوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۴۶	۱۵.۷	۹۱	۵۵۷	۵۰۹	(۸.۶%)	۵.۶	-۰.۵۸	۴۱	(۵۵.۱%)
طستا ۱۰۴۱	شستا	۱,۵۵۰	۴	۶۲۷.۴	۶۷	۱,۵۳۳	۱,۴۸۳	(۳.۳%)	۲۲.۱	-۰.۵۵	۲۶	(۶۱.۱%)

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
طستا ۱۰۳۵	شستا	۹۵۰	۴	۲.۹	۱	۱,۵۳۳	۹۴۹	(۳۸.۱%)	۹۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۶	شستا	۱,۰۵۰	۴	۷۶.۸	۱	۱,۵۳۳	۱,۰۴۹	(۳۱.۶%)	۱,۰۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۱۸	۶.۲	۲۷	۲۷,۵۸۰	۱۳,۹۷۳	(۴۹.۳%)	۵۱۷.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۰۳۷	شستا	۱,۱۵۰	۴	۲.۰	۱	۱,۵۳۳	۱,۱۴۹	(۲۵.۰%)	۱,۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۳۲	۳.۵	۵	۱,۵۳۳	۸۴۵	(۴۴.۹%)	۱۶۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

(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

ارزش موقعیت‌های باز

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

۱۰۱۱
۱۸
۲۶۰۰۰
۶۲۱

۱۱۳۶
۲۵
۳۰۰۰
۵۷۰

۱۰۴۲
۴
۱۶۵۰
۵۱۰

۱۰۱۰
۱۸
۲۴۰۰۰
۴۴۰

۱۰۰۷
۱۸
۱۸۰۰۰
۳۹۷

۱۰۴۱
۴
۱۵۵۰
۳۰۹

۱۰۴۰
۴
۱۴۵۰
۲۸۹

۱۰۰۹
۱۸
۲۲۰۰۰
۲۷۵

۱۱۱۰
۴۶
۲۶۰۰۰
۲۷۲

۱۰۰۸
۱۸
۲۰۰۰۰
۲۵۷

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

۱۰۴۲
۴
۱۶۵۰
۱۳۳,۴۶۷

۱۱۴۰
۲۵
۴۰۰۰
۱۰۳,۲۶۸

۱۱۱۰
۴۶
۲۶۰۰۰
۷۵,۳۶۶

۱۱۱۳
۴۶
۳۴۰۰۰
۵۸,۹۶۶

۱۰۴۱
۴
۱۵۵۰
۵۷,۸۴۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

۱۰۱۰
۱۸
۲۴۰۰۰
(۱۶,۸۷۴.۴)

۱۰۳۸
۴
۱۲۵۰
(۱۵,۴۰۹.۹)

۱۰۱۱
۱۸
۲۶۰۰۰
(۱۴,۸۵۱.۲)

۱۰۰۷
۱۸
۱۸۰۰۰
(۱۰,۳۲۸.۴)

۱۰۳۷
۴
۱۱۵۰
(۱۰,۰۶۸.۰)

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

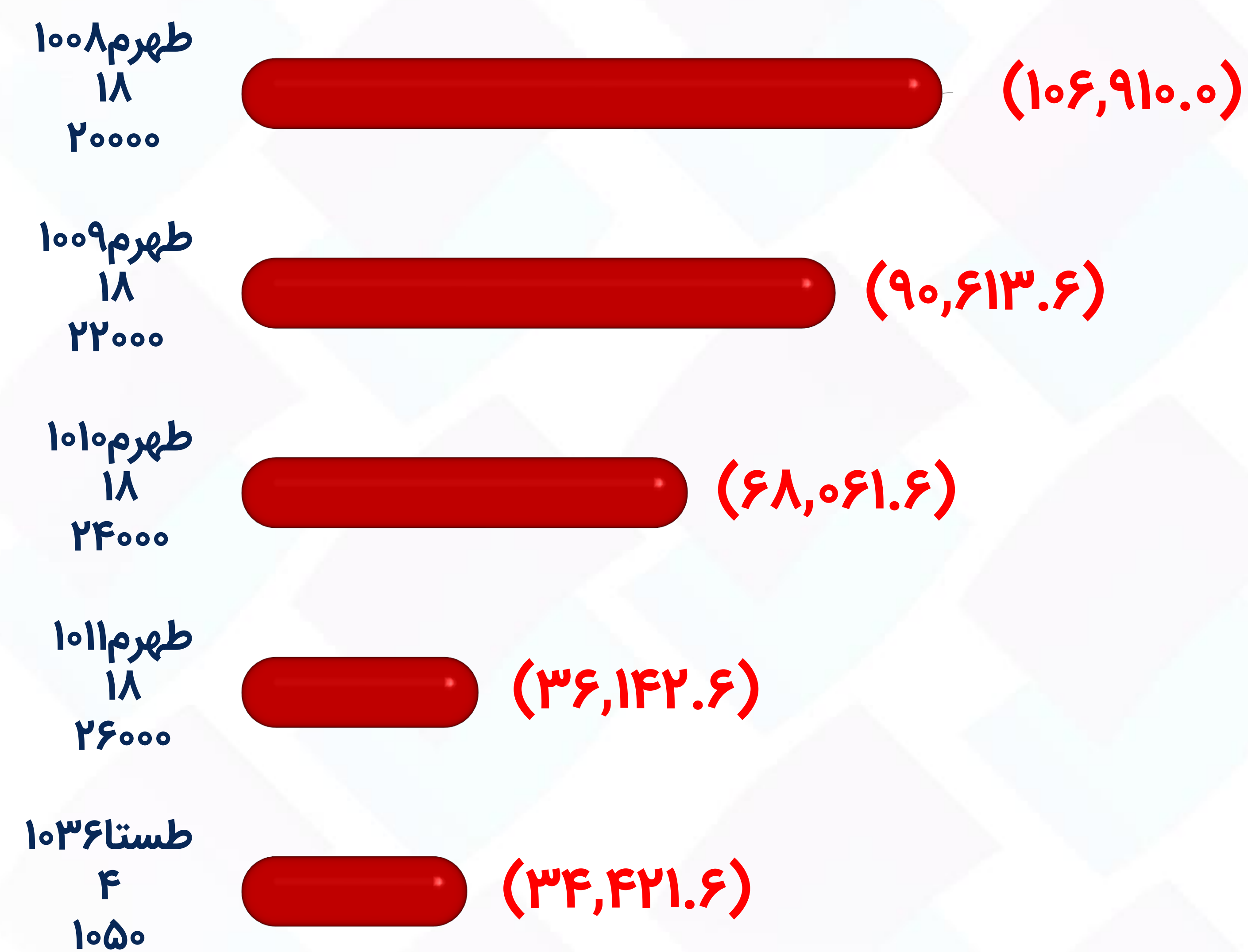
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

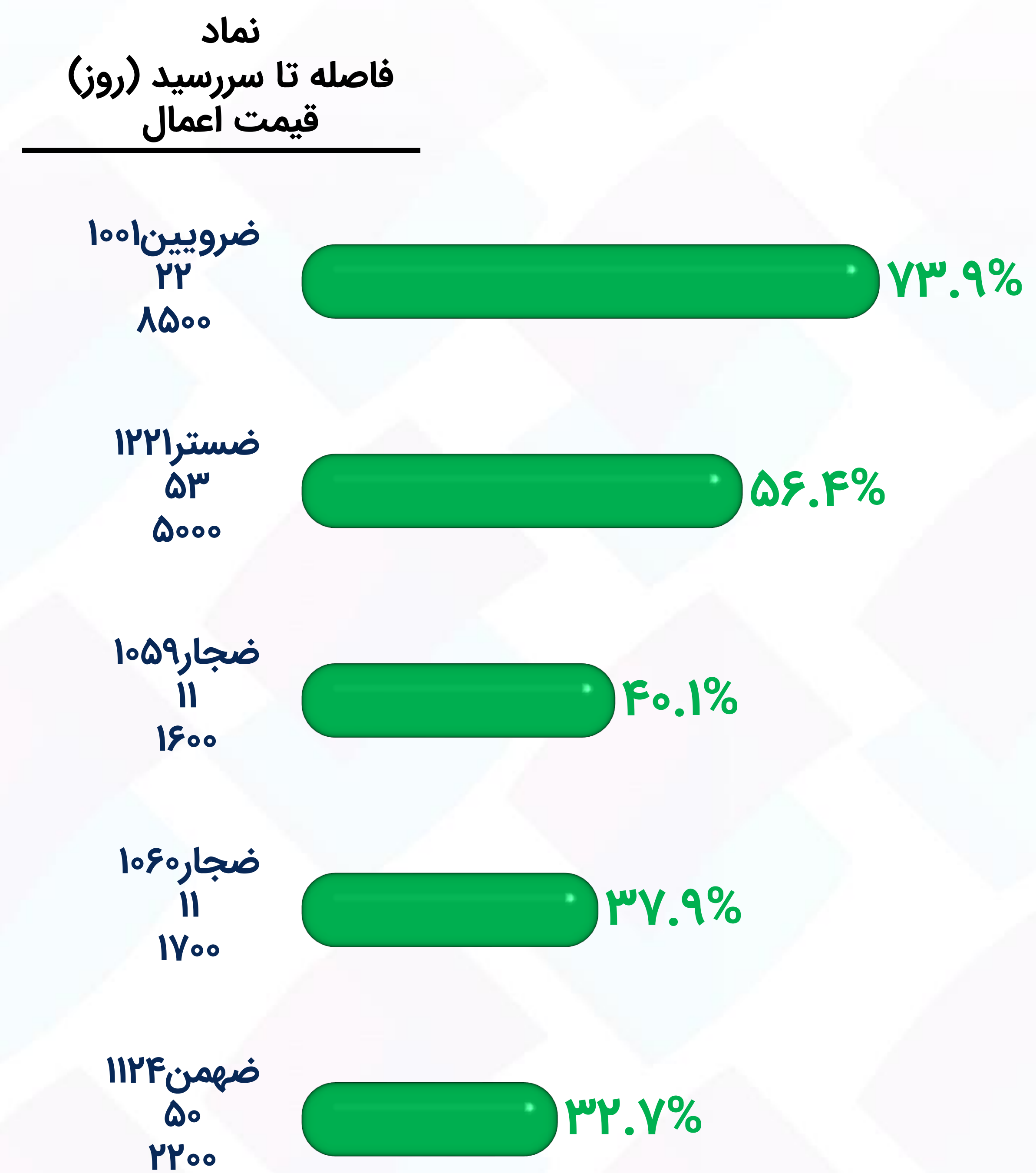
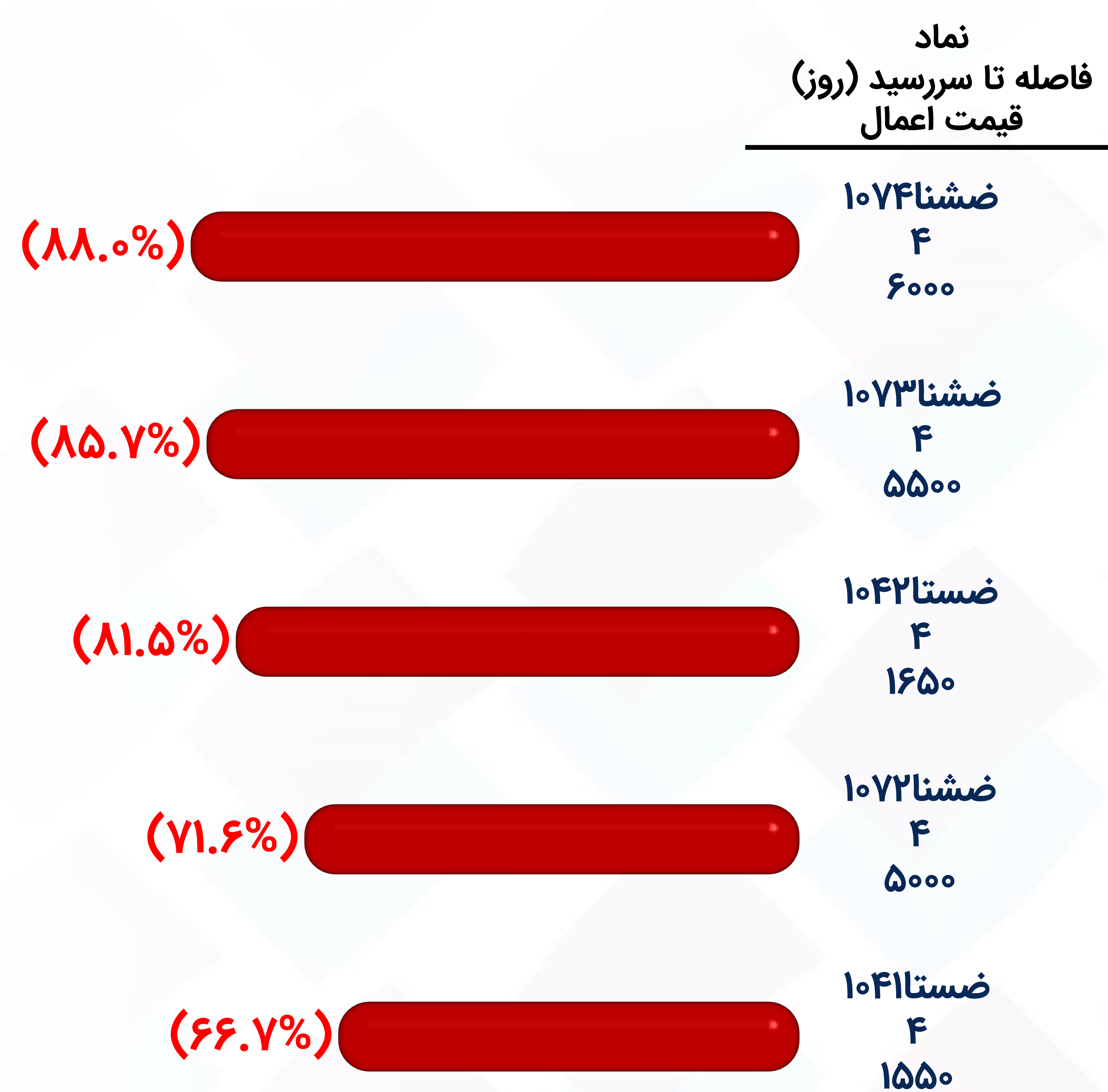
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



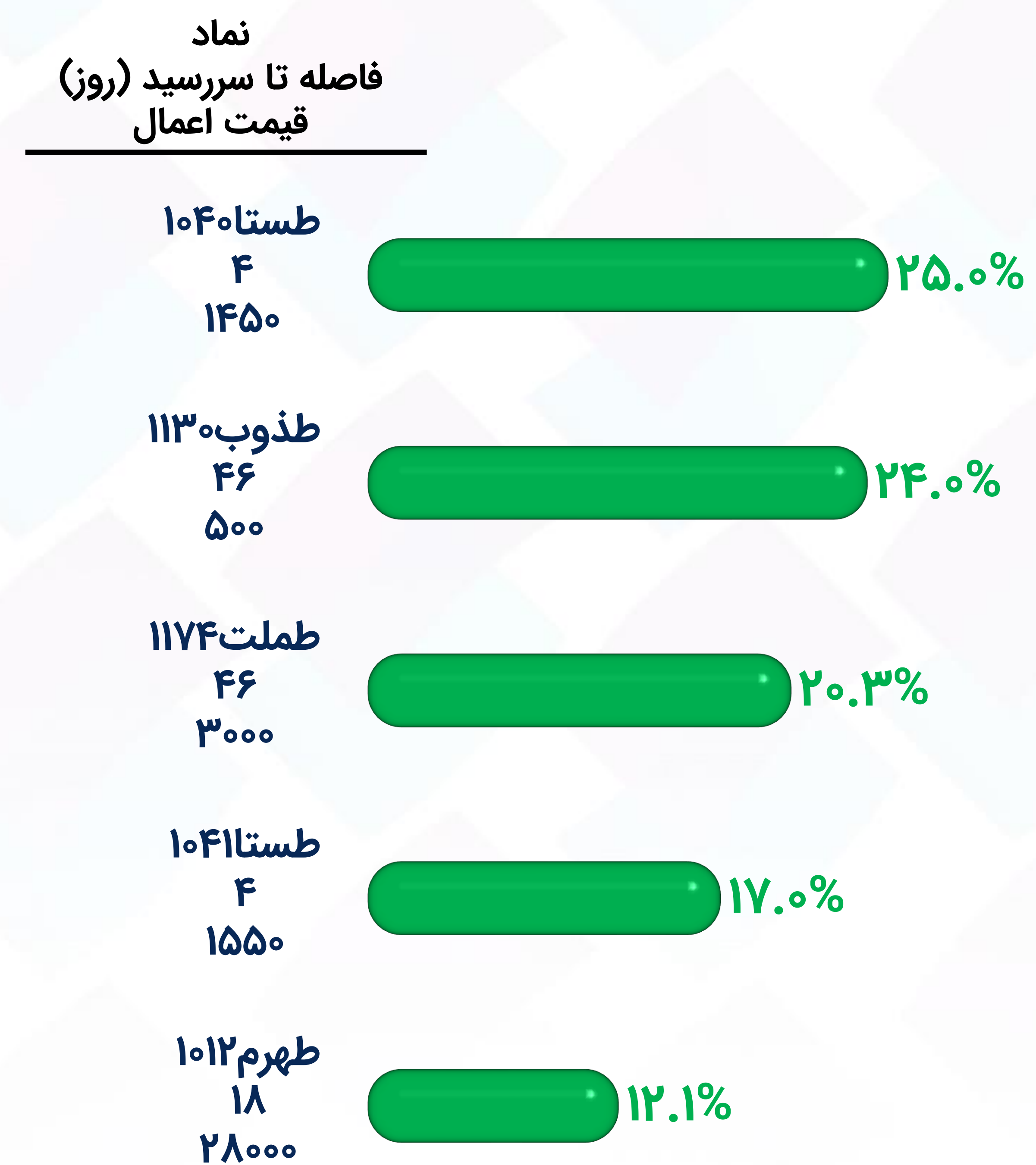
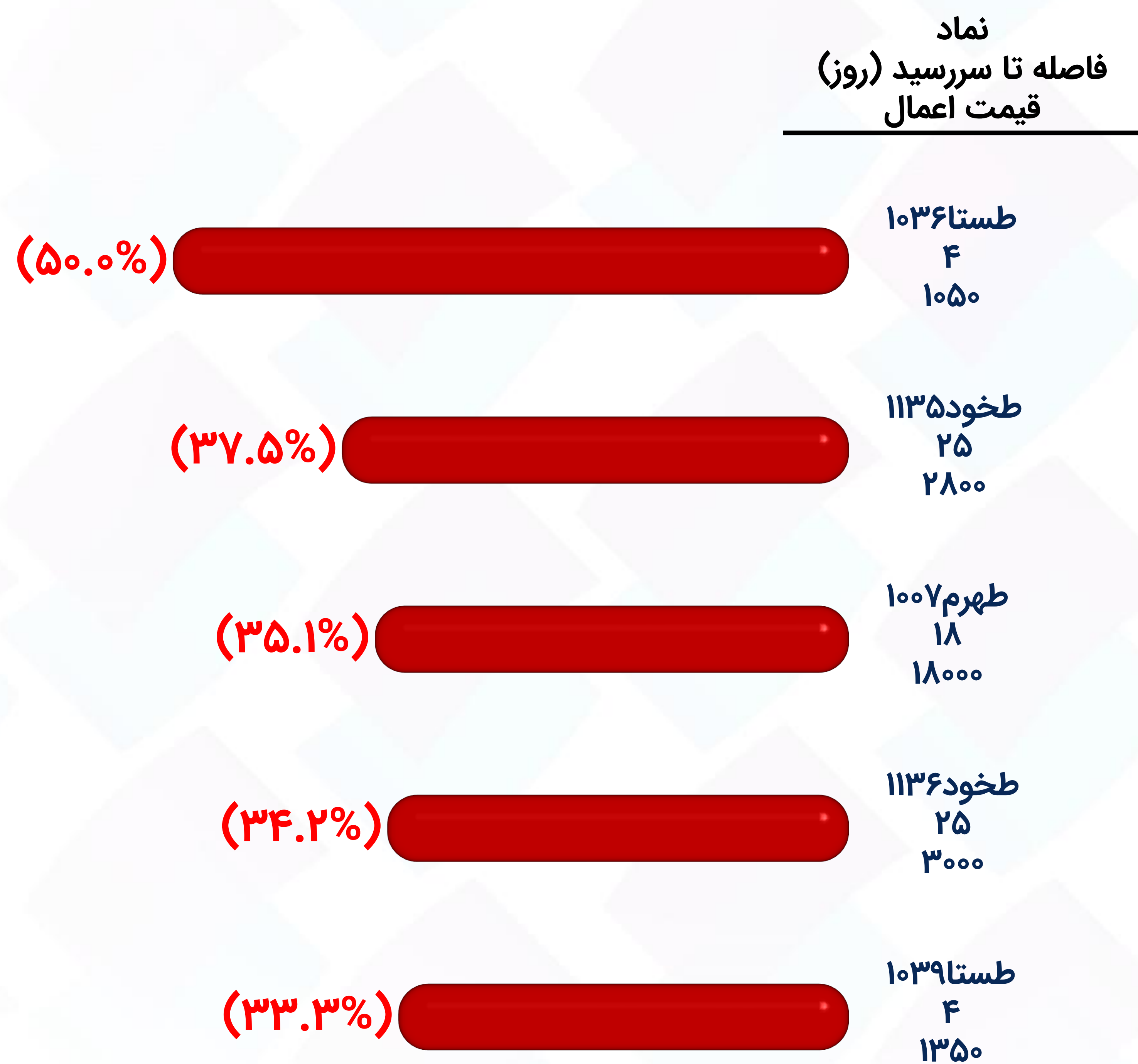
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

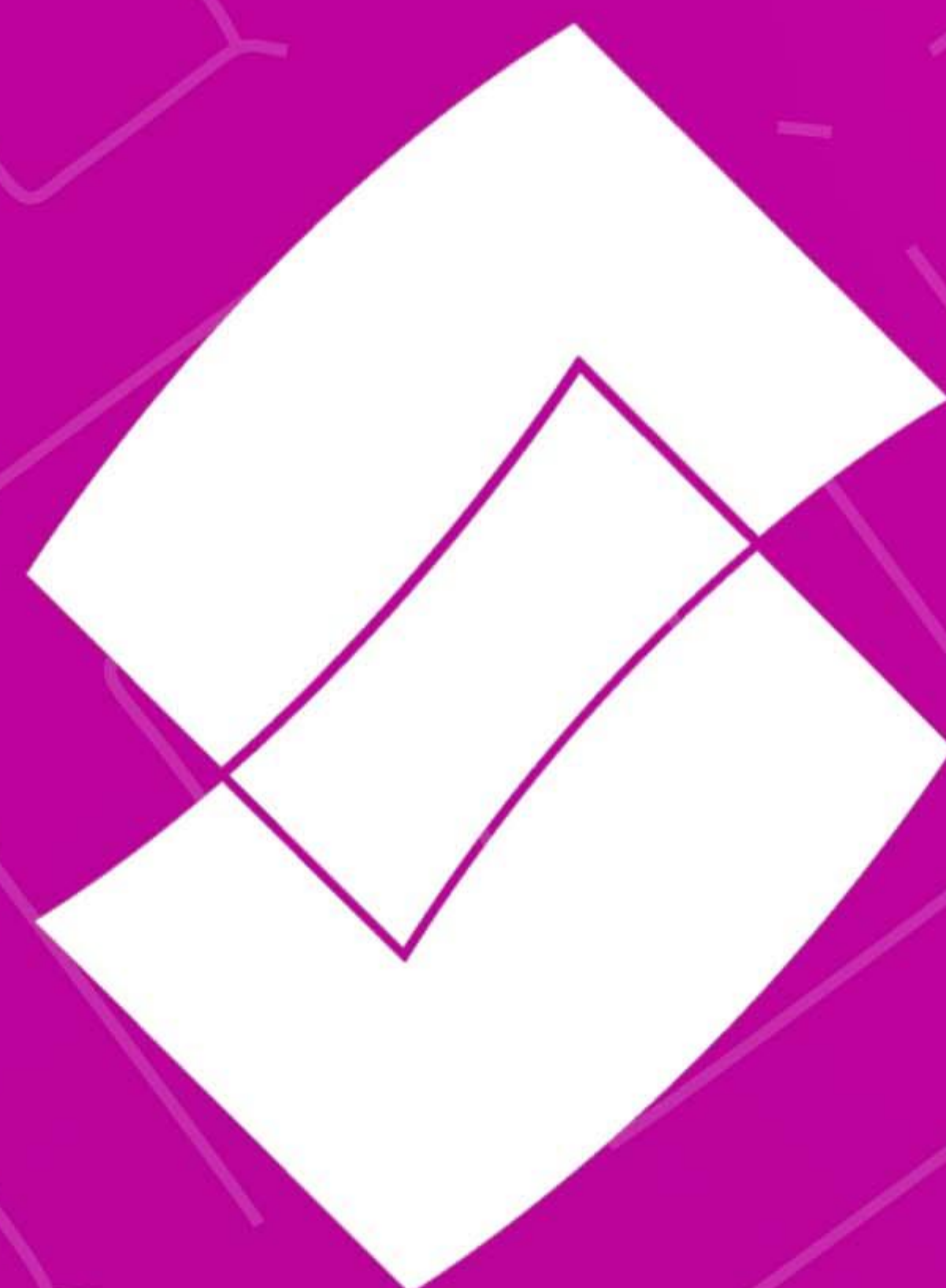
اختیار خرید



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

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.