

شماره
۴۰۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ دی ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





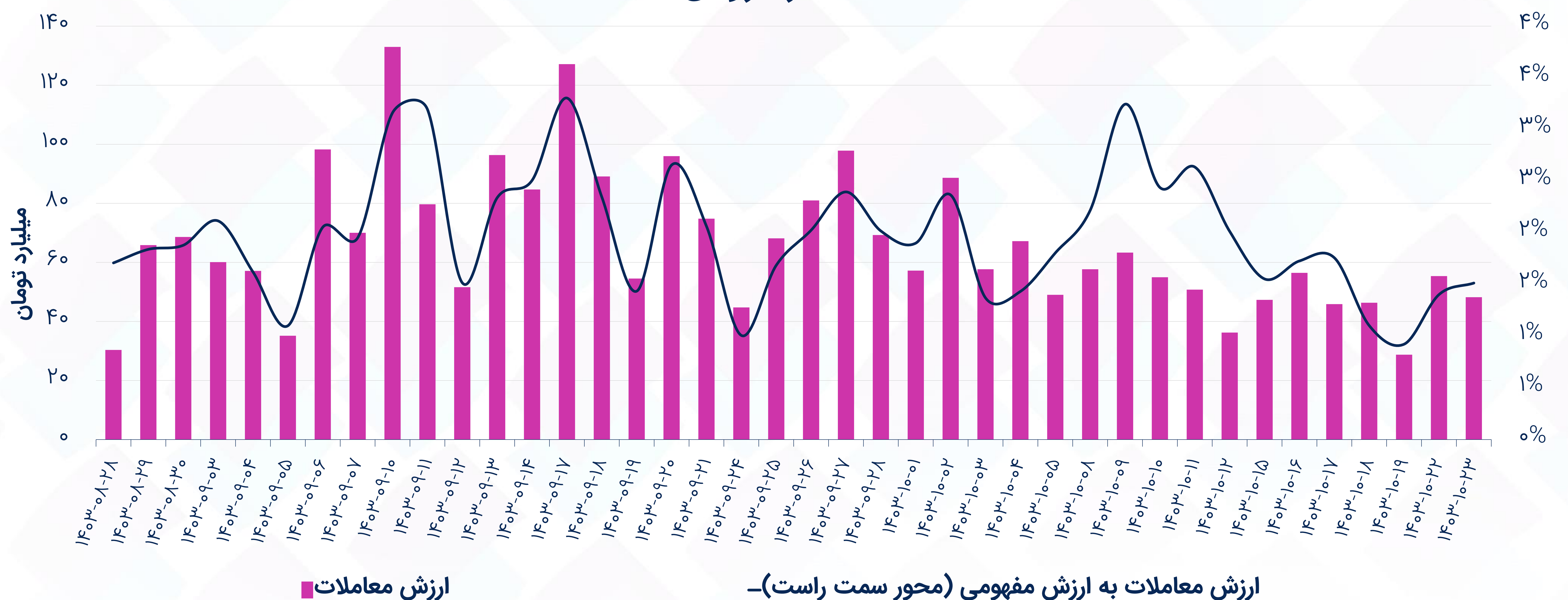
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



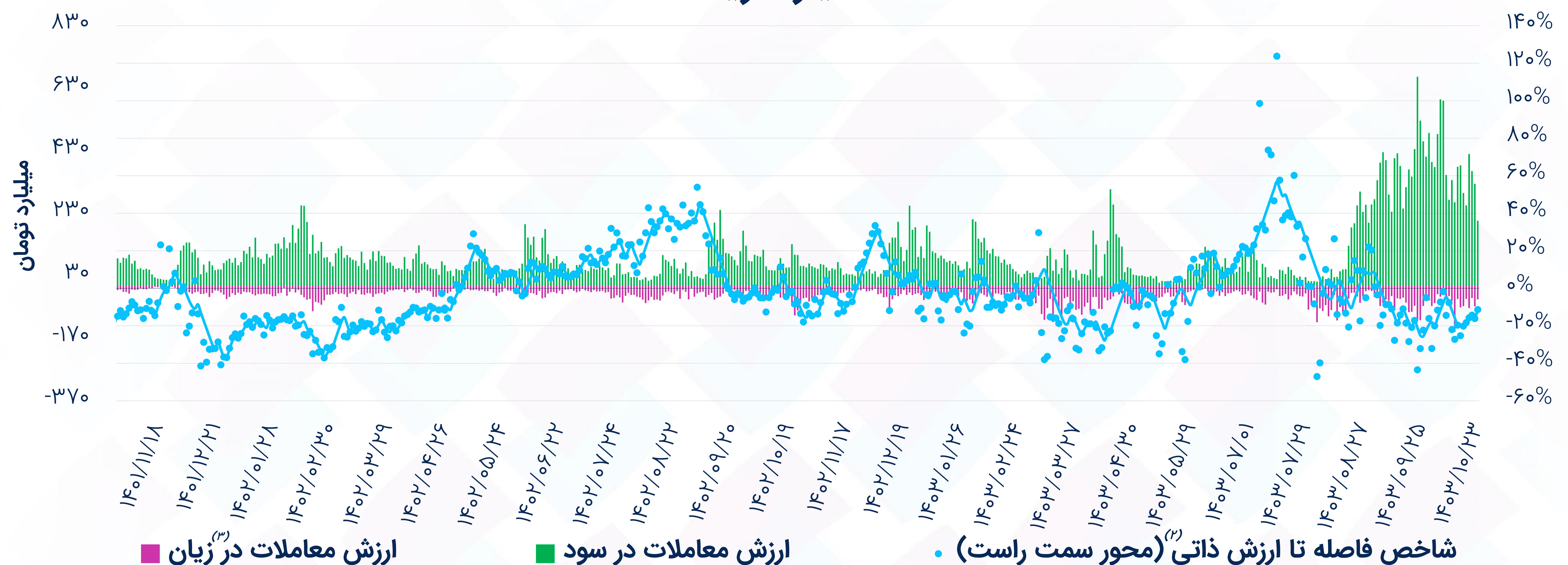
اختیار فروش



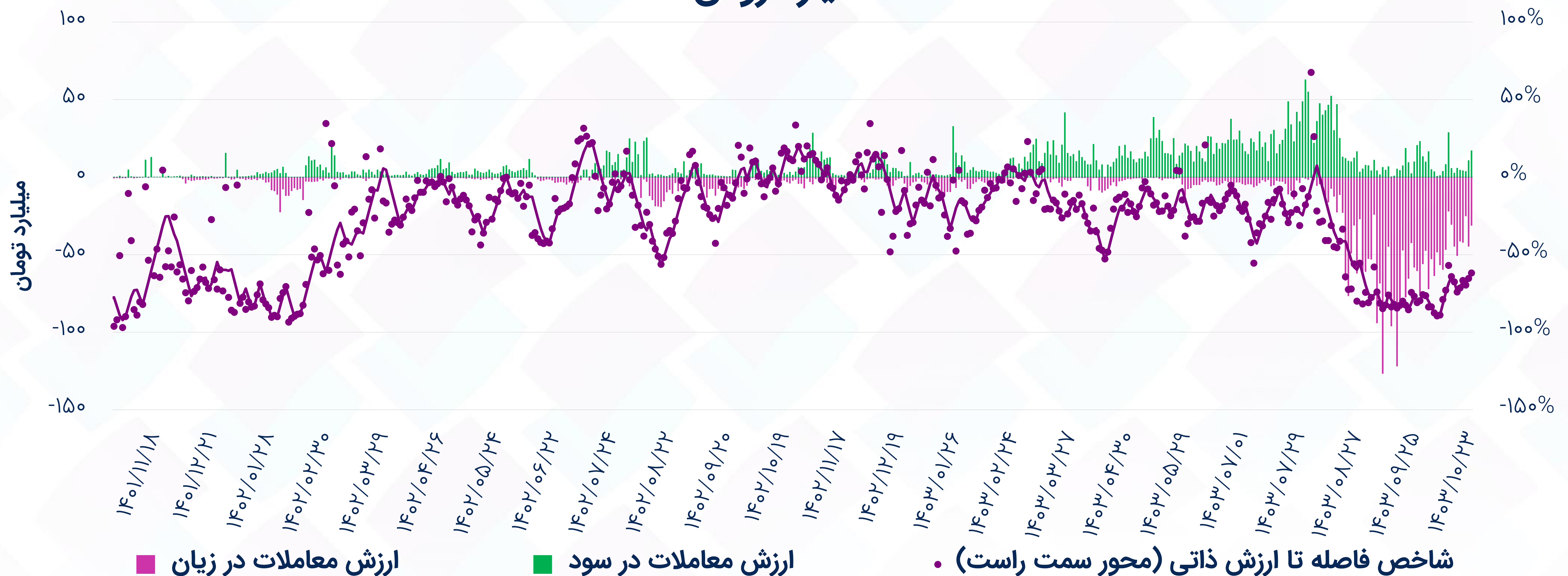
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

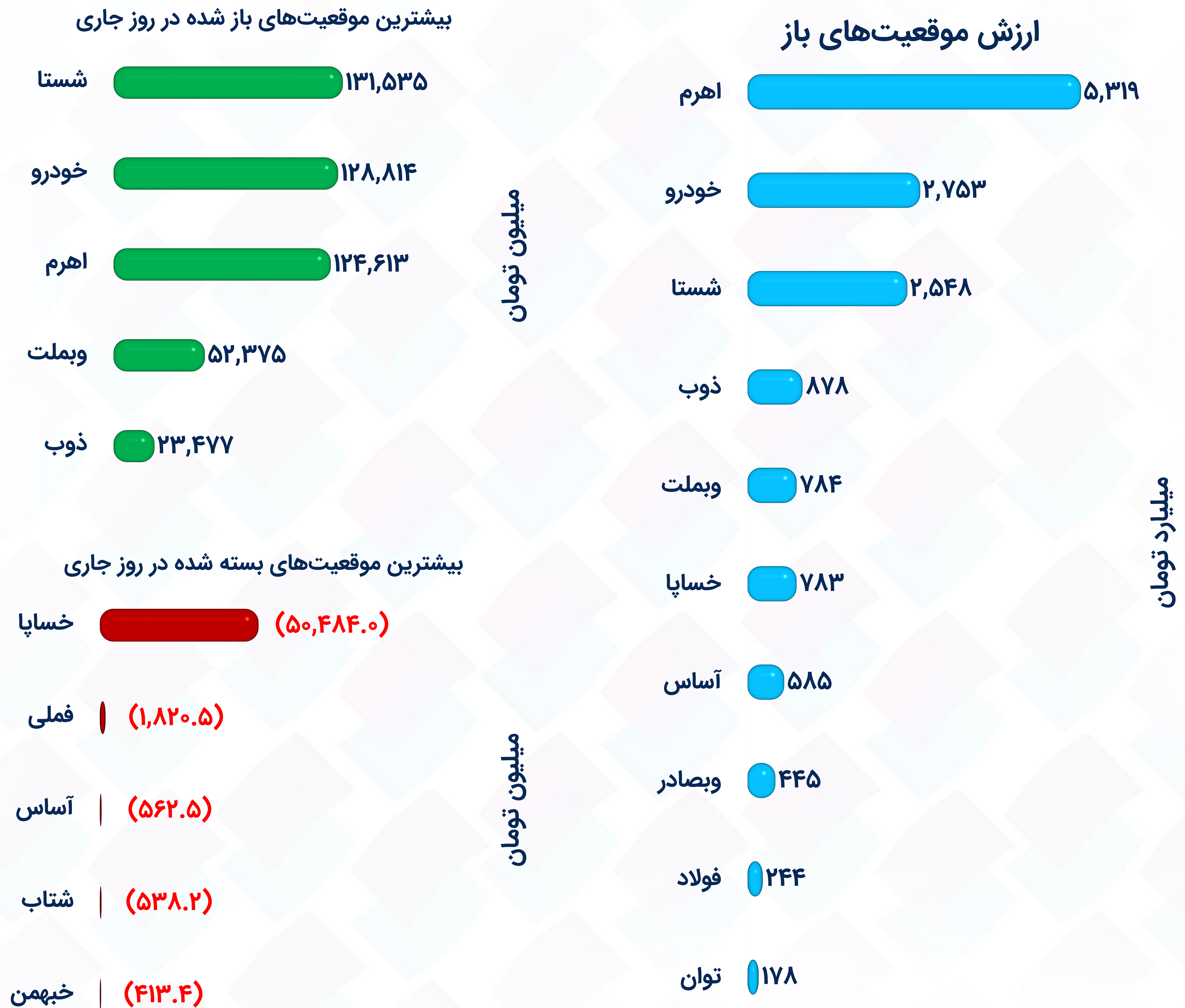
اختیار خرید

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
اهرم	۴۰	۱۳۸.۴	۲,۰۱۳.۱	۱۲۵.۴	۱۳.۰	(۴.۳%)
خودرو	۳۳	۵۲.۵	۱,۱۴۵.۶	۴۰.۴	۱۲.۱	(۱۱.۲%)
شستا	۳۸	۲۲.۳	۴۱۵.۱	۹.۵	۱۲.۸	(۴۵.۹%)
ذوب	۲۲	۱۰.۵	۷۶.۶	۹.۱	۱.۳	(۲۰.۹%)
وبملت	۱۹	۸.۸	۷۷.۶	۷.۱	۱.۷	(۲۵.۵%)
خسپا	۱۹	۸.۱	۴۸۳.۷	۵.۲	۲.۹	(۱۴.۲%)
توان	۱۴	۲.۶	۷.۴	۲.۶	۰.۱	۲.۳%

اختیار فروش

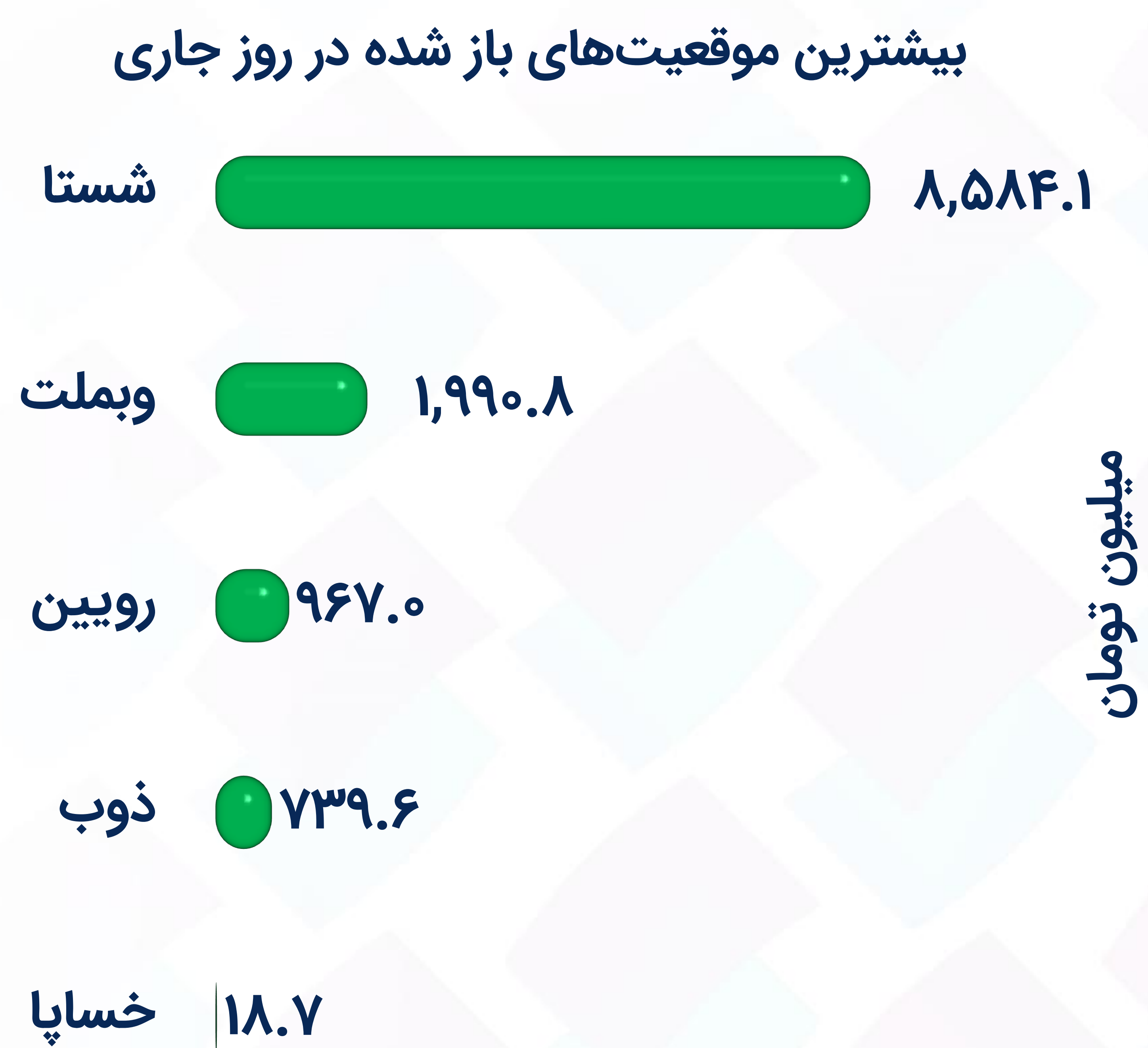
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیون تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیون تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیون تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیون تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۲۰	۳۰,۷۹۰.۵	۲,۲۰۵,۴۲۳.۹	۱۱,۹۲۹.۹	۱۸,۸۶۰.۶	(۵۹.۴%)
خودرو	۸	۱۳,۸۸۳.۴	۸۵۸,۱۴۷.۱	۳,۶۸۴.۶	۱۰,۱۹۸.۸	(۶۵.۶%)
شستا	۱۶	۳,۲۷۷.۵	۱۰۹,۹۴۰.۸	۱,۴۴۵.۹	۱,۸۳۱.۵	(۶۷.۶%)
وبملت	۴	۱۲۷.۴	۴,۱۷۵.۸	۰.۰	۱۲۷.۴	(۶۶.۶%)
ذوب	۵	۱۱۹.۸	۳,۲۳۵.۰	۱۰.۳	۱۰۹.۵	(۷۷.۴%)
رویین	۴	۲.۲	۱,۳۵۶.۷	۰.۰	۲.۲	(۹۹.۳%)
اطلس	۱	۰.۴	۱۲.۳	۰.۰	۰.۴	(۸۱.۳%)

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



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

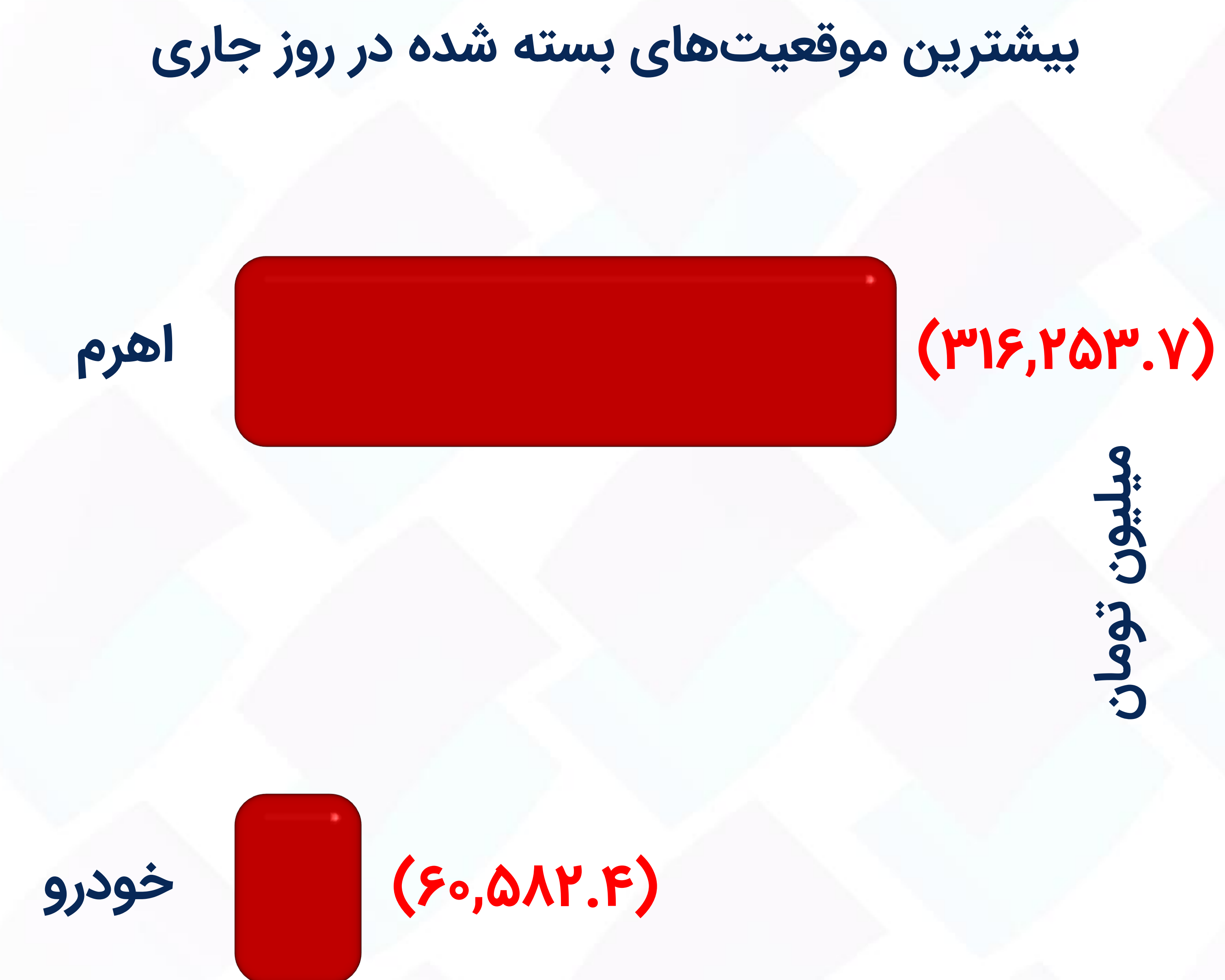
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



میلیون تومان



میلیارد تومان



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
ضاساس ۱۰۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۷	۱۵.۳	۵۵۲	۵۰,۰۱۸	۵۰,۵۵۲	۱.۱%	۹۱.۶	۰.۵۹	۸۵۲	۵۴%
ضاطلس ۱۲۰۷	اطلس	۶۵,۰۰۰	۴۲	۴.۱	۱,۰۱۷	۶۱,۴۱۰	۶۶,۰۱۷	۷.۵%	۶۴.۹	۰.۴۲	۱,۵۲۳	۵۰%
ضهرم ۱۰۱۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۳	۷,۳۹۰.۰	۱,۳۶۹	۲۷,۸۸۰	۲۷,۳۶۹	(۱.۸%)	۲۰.۰	۰.۹۷	۱,۹۹۵	۴۶%
ضهرم ۱۰۱۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳	۳,۱۹۲.۲	۳۰۰	۲۷,۸۸۰	۲۸,۳۰۰	۱.۵%	۹۴.۳	۰.۵۰	۴۳۱	۴۴%
ضهرم ۱۲۳۸	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۹	۴.۵	۹,۰۰۰	۲۷,۸۸۰	۲۵,۰۰۰	(۱۰.۳%)	۲.۸	۱.۰۰	۱۲,۷۲۷	۴۱%

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	۳۱	۴۴.۹	۵	۵۳۶	۱,۰۰۵	۸۸%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۳۱	۴۲.۲	۷	۵۳۶	۹۰۷	۶۹%	۱۲۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۰۱۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۶.۰	۸	۲۷,۸۸۰	۳۴,۰۰۸	۲۲%	۴,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۳۱	۹۰.۱	۸	۵۳۶	۸۰۸	۵۱%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۱۴۱	خودرو	۴,۵۰۰	۱۰	۲.۵	۱۳	۳,۶۴۳	۴,۵۱۳	۲۴%	۳۴۷.۲	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 ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۱	۴۰۴.۵	۶,۱۸۵	۲۷,۸۸۰	۲۷,۸۱۵	(۰.۲%)	۴.۵	-۰.۹۴	۵,۲۵۰	(۱۵.۱%)
طخود ۱۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۰	۴۴۷.۵	۳۹۲	۳,۶۴۳	۳,۶۰۸	(۱.۰%)	۹.۲	-۰.۹۲	۳۲۳	(۱۷.۷%)
طهرم ۱۰۱۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳	۶۲.۶	۲,۵۷۵	۲۷,۸۸۰	۲۷,۴۲۵	(۱.۶%)	۱۰.۷	-۰.۹۶	۲,۰۱۸	(۲۱.۶%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۱	۳,۶۷۴.۲	۲,۸۳۳	۲۷,۸۸۰	۲۷,۱۶۷	(۲.۶%)	۹.۶	-۰.۶۵	۱,۹۳۶	(۳۱.۷%)
طخود ۱۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۱۰	۳,۲۳۷.۱	۲۰۳	۳,۶۴۳	۳,۵۴۷	(۲.۶%)	۱۷.۵	-۰.۶۱	۱۲۴	(۳۸.۹%)

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 ۱۰۰۵	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳	۴.۹	۵	۲۷,۸۸۰	۱۴,۹۹۵	(۴۶.۲%)	۲,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۲۲۲	شستا	۶۵۰	۴۵	۱.۲	۶	۱,۳۹۶	۶۴۴	(۵۳.۹%)	۱۰۷.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۳	شستا	۸۵۰	۱۷	۲.۸	۲	۱,۳۹۶	۸۴۸	(۳۹.۳%)	۴۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۴	اهرم	۱۴,۰۰۰	۳	۱.۱	۳	۲۷,۸۸۰	۱۳,۹۹۷	(۴۹.۸%)	۴,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۰۰۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳	۲۷.۴	۹	۲۷,۸۸۰	۱۹,۹۹۱	(۲۸.۳%)	۲,۲۲۱.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

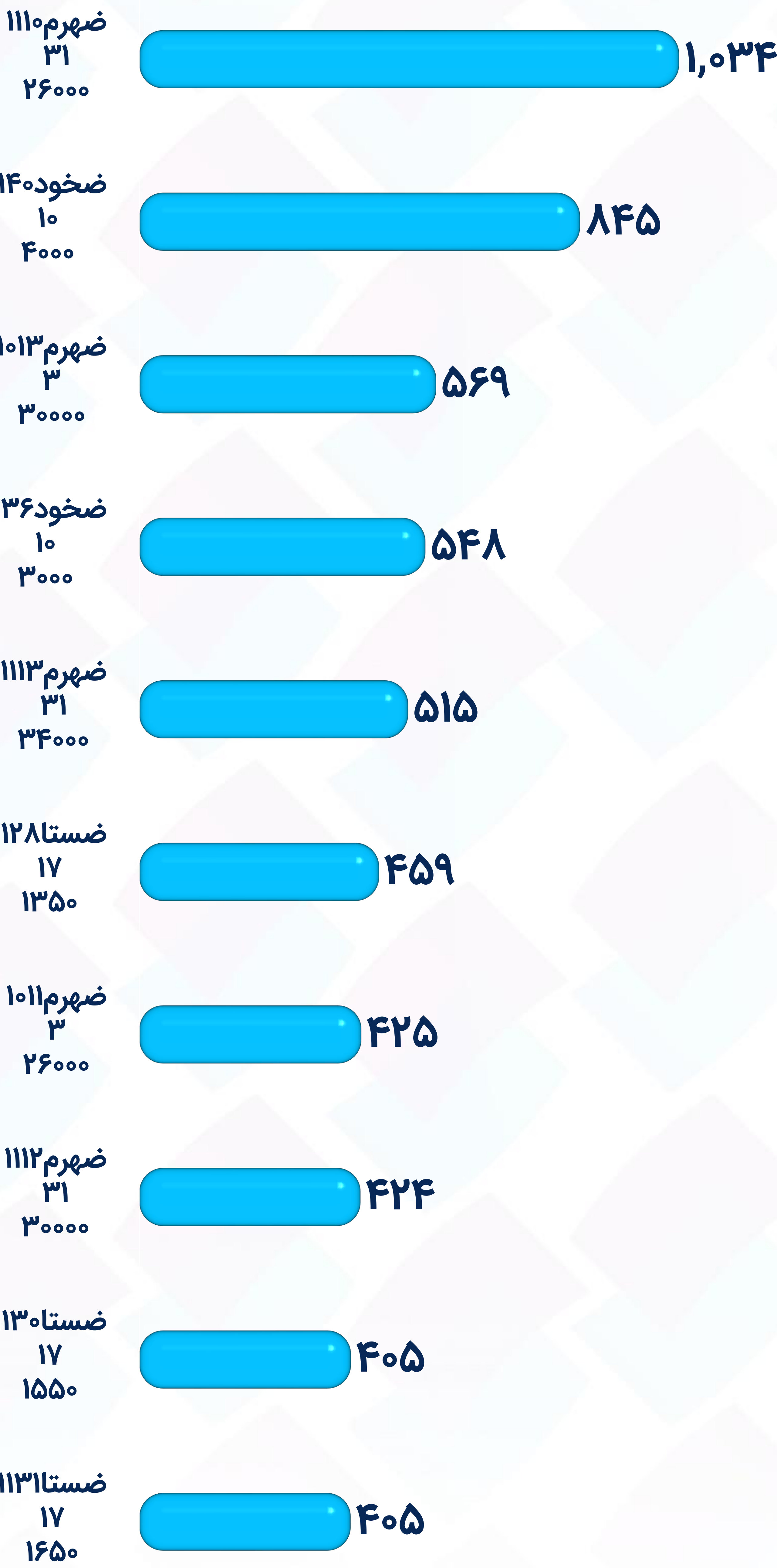
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

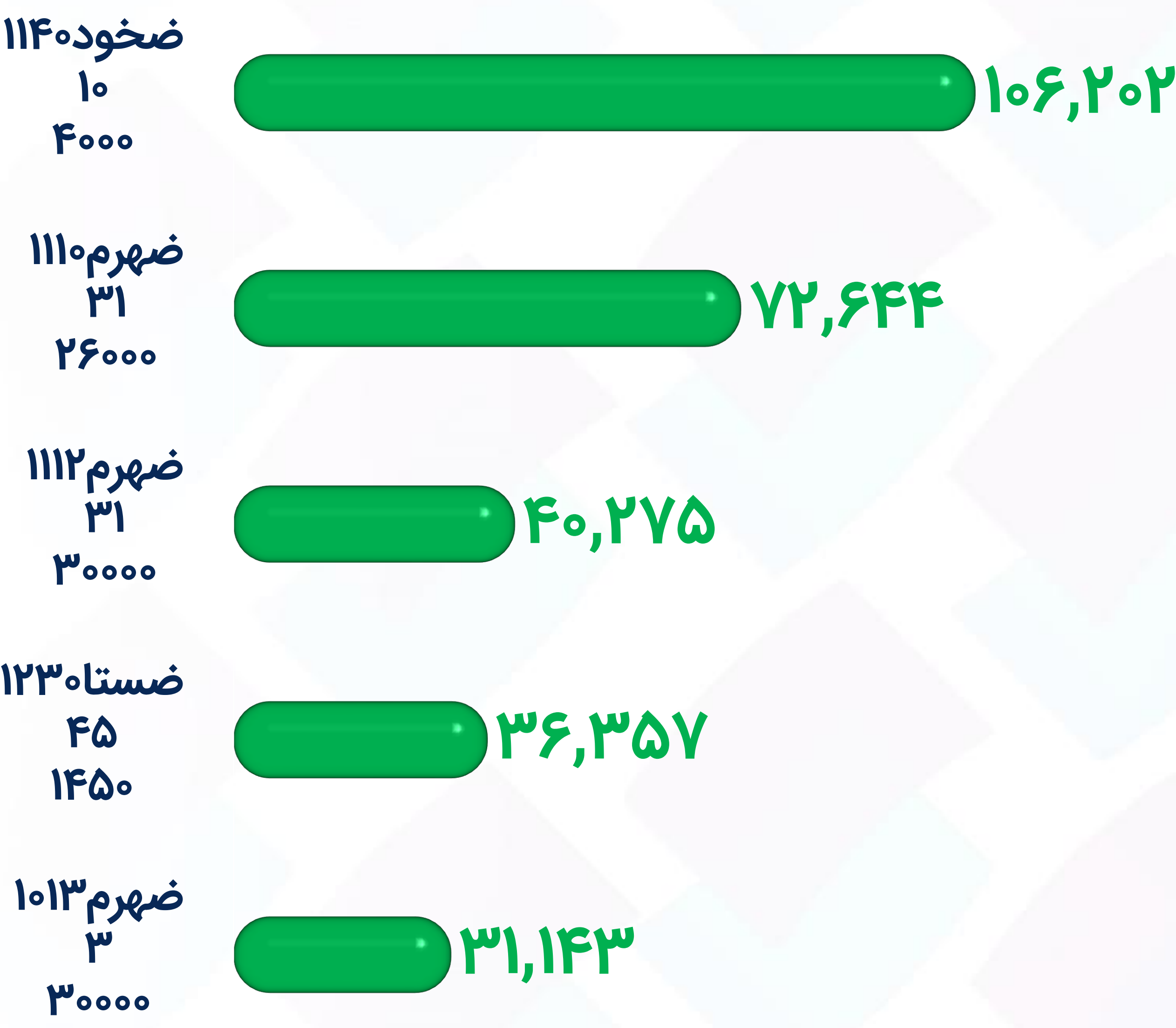
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

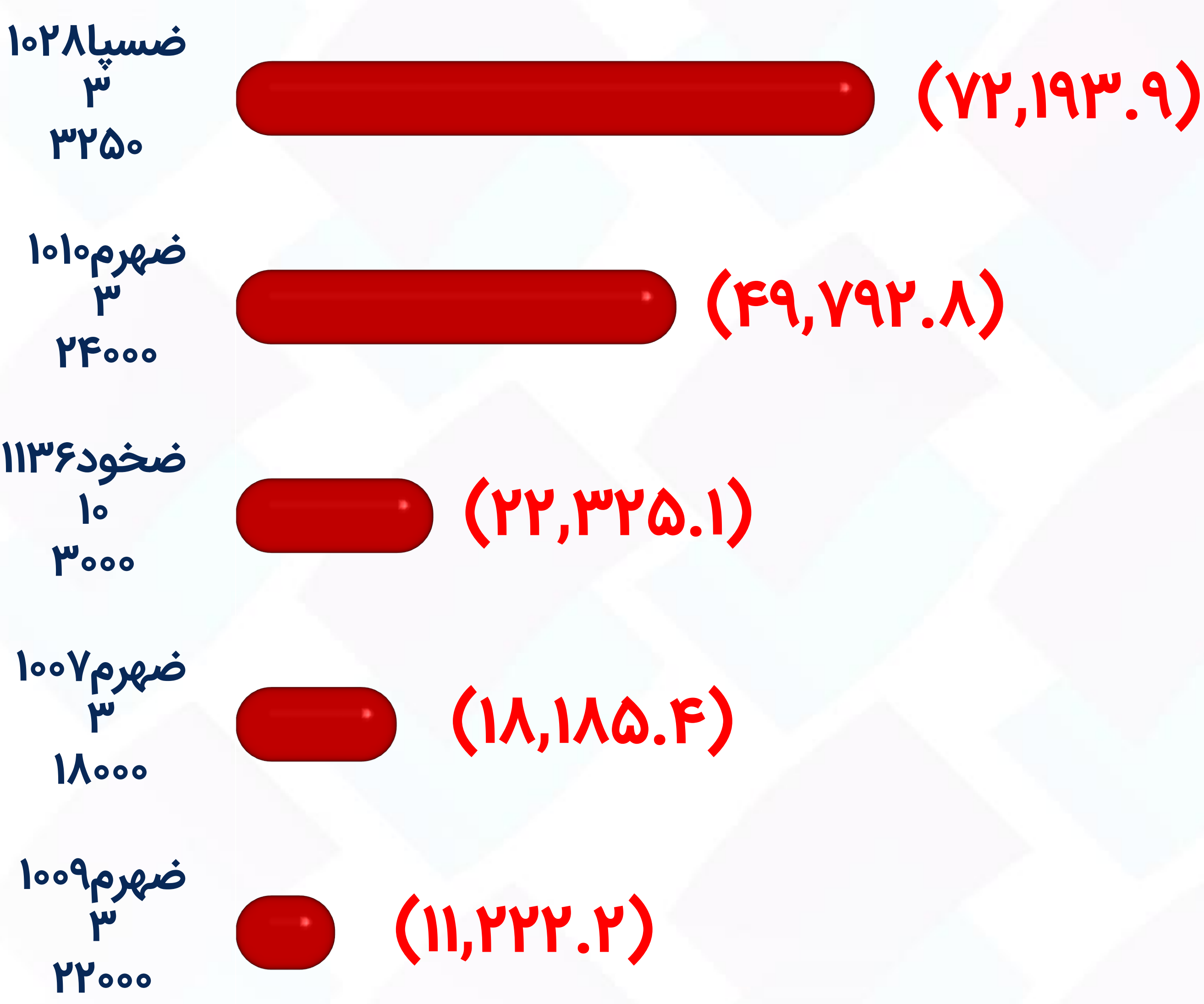
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

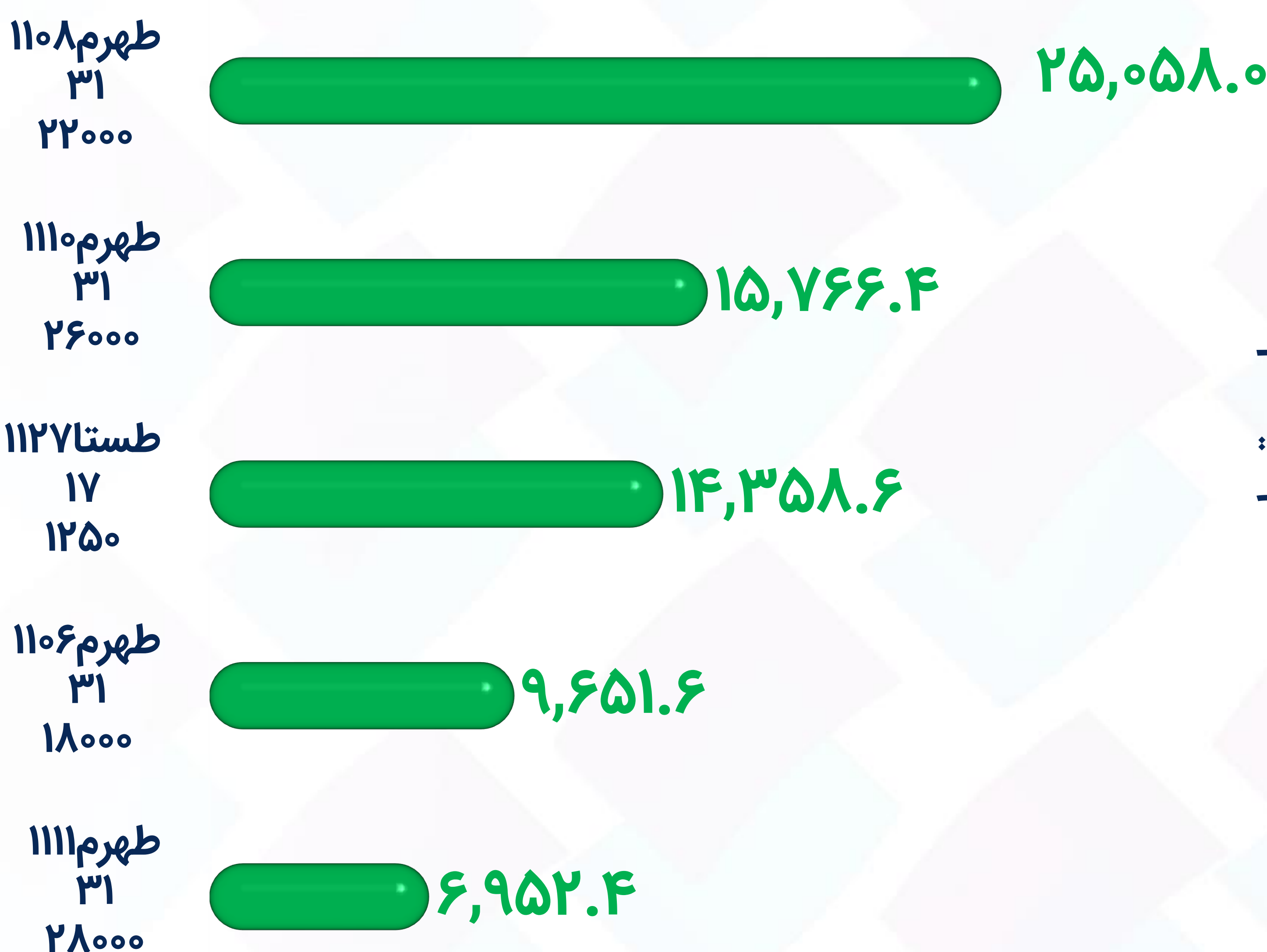
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

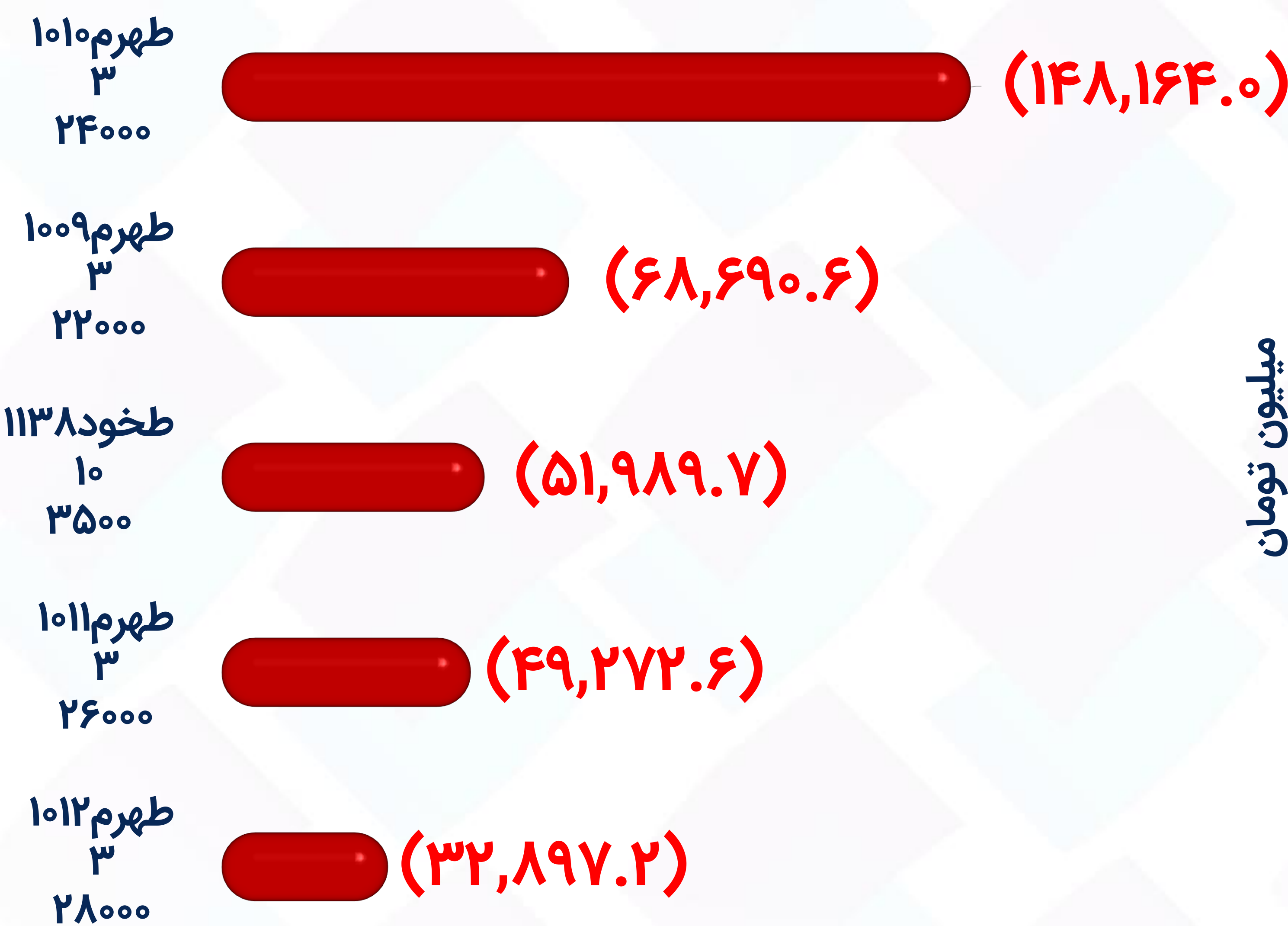
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

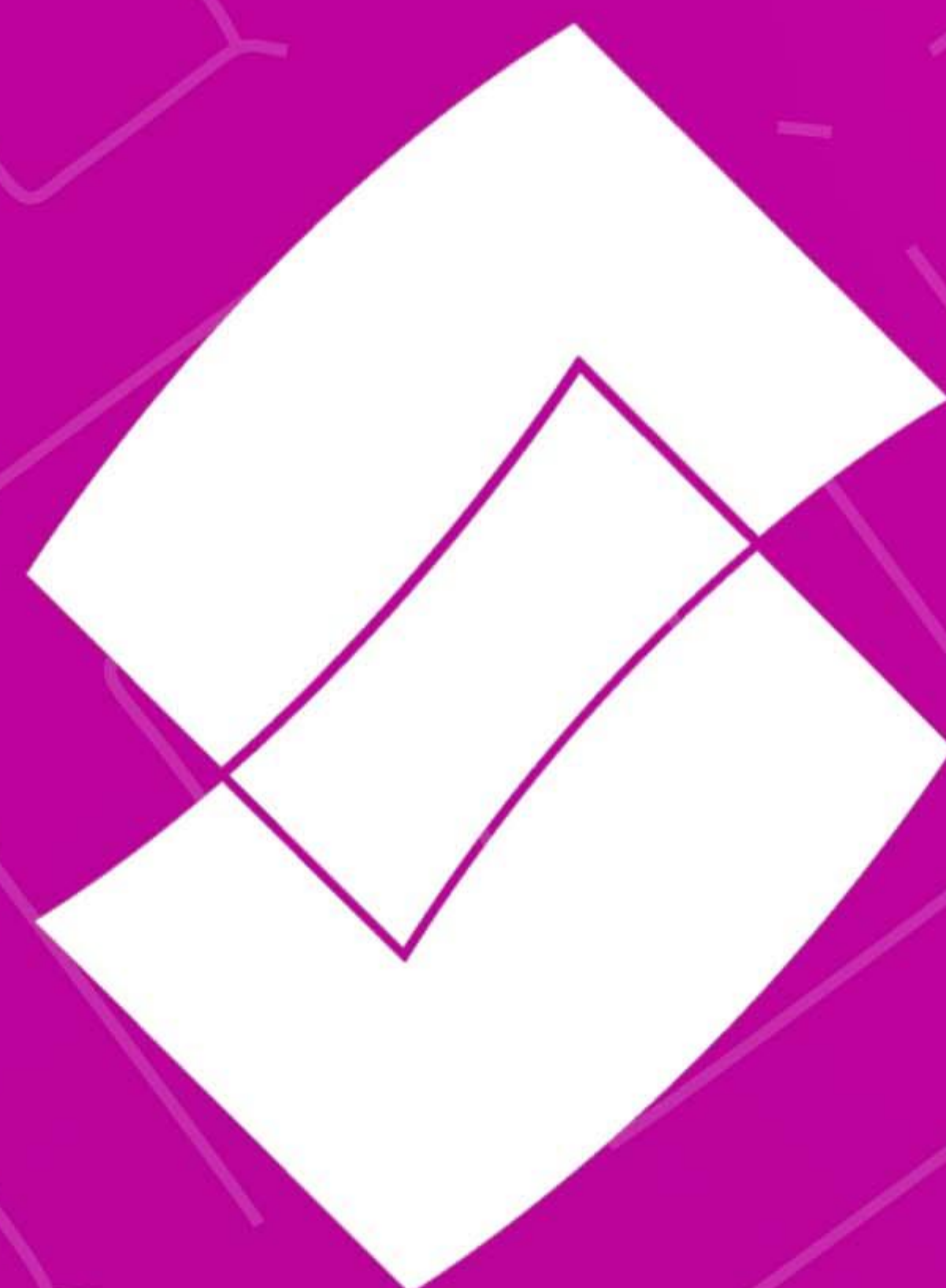
اختیار خرید



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.