

شماره
۴۱۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۷ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





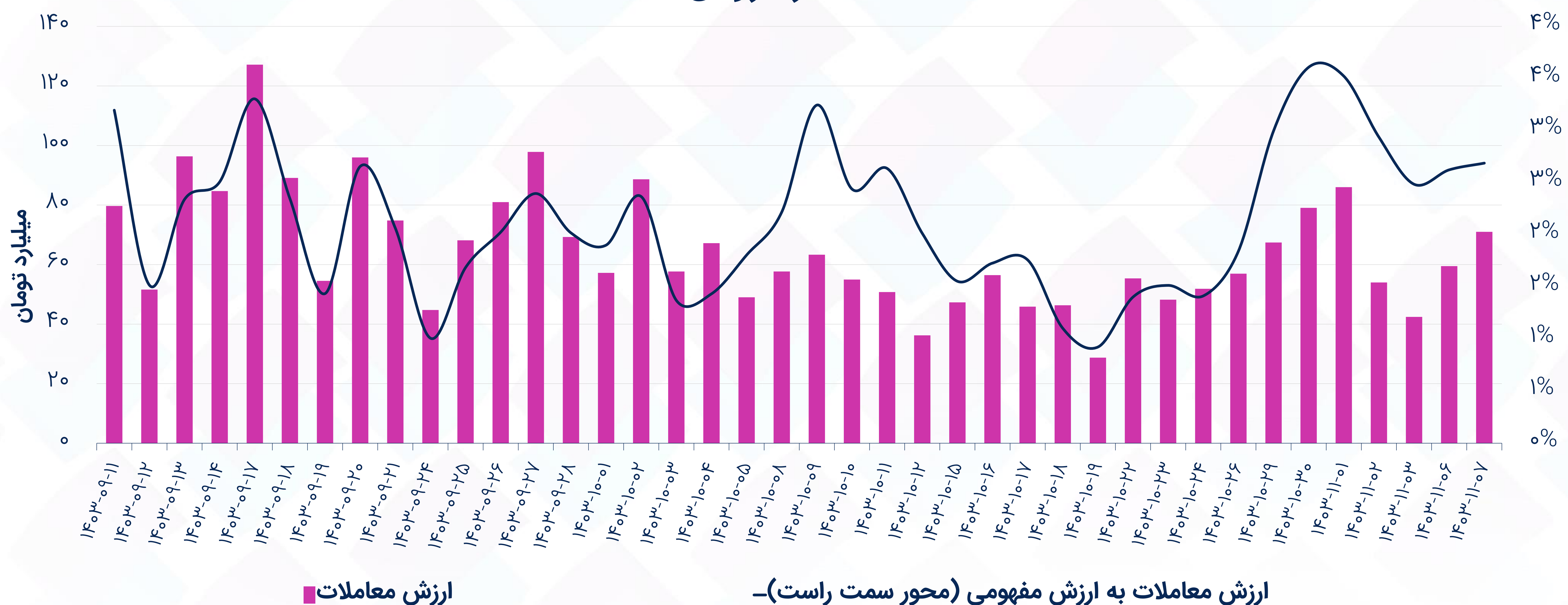
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



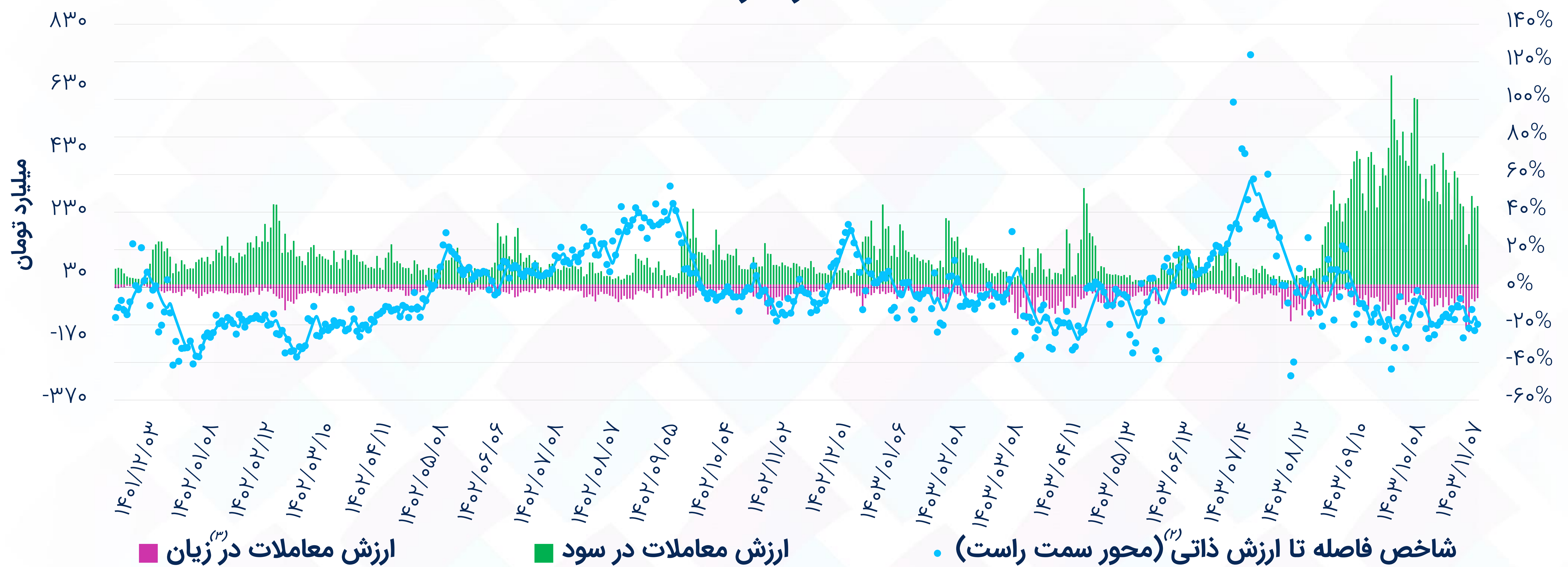
اختیار فروش



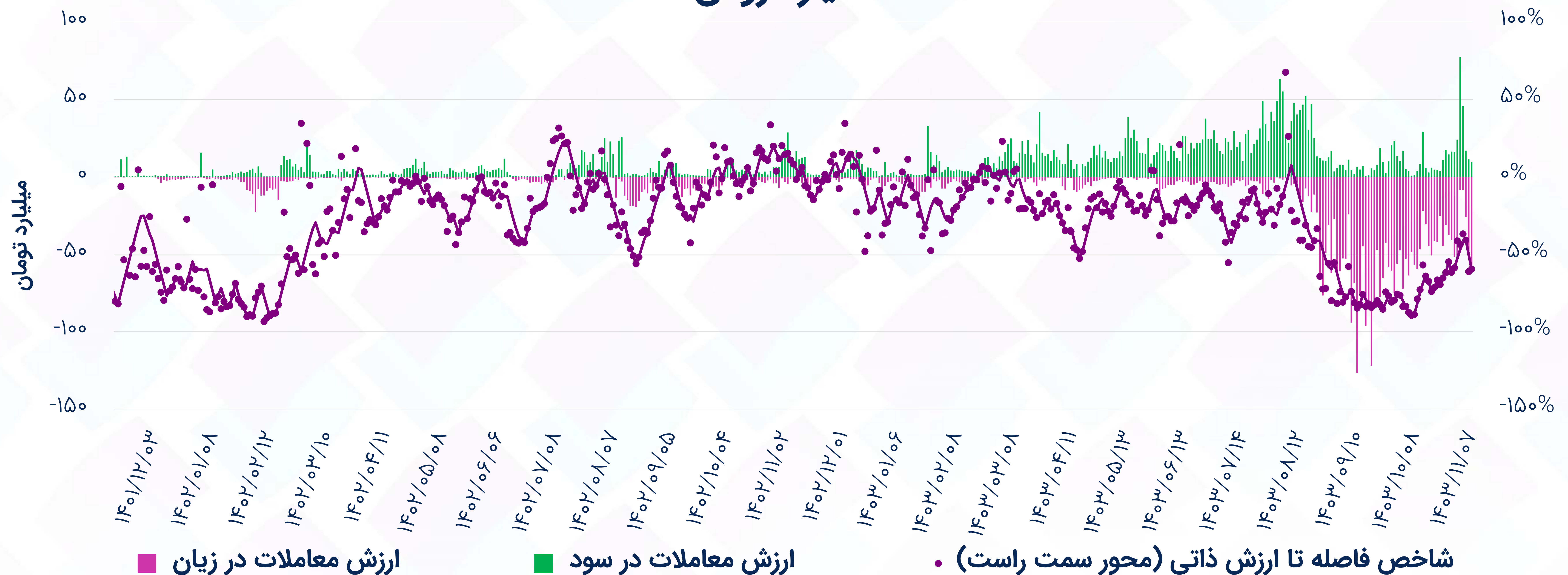
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

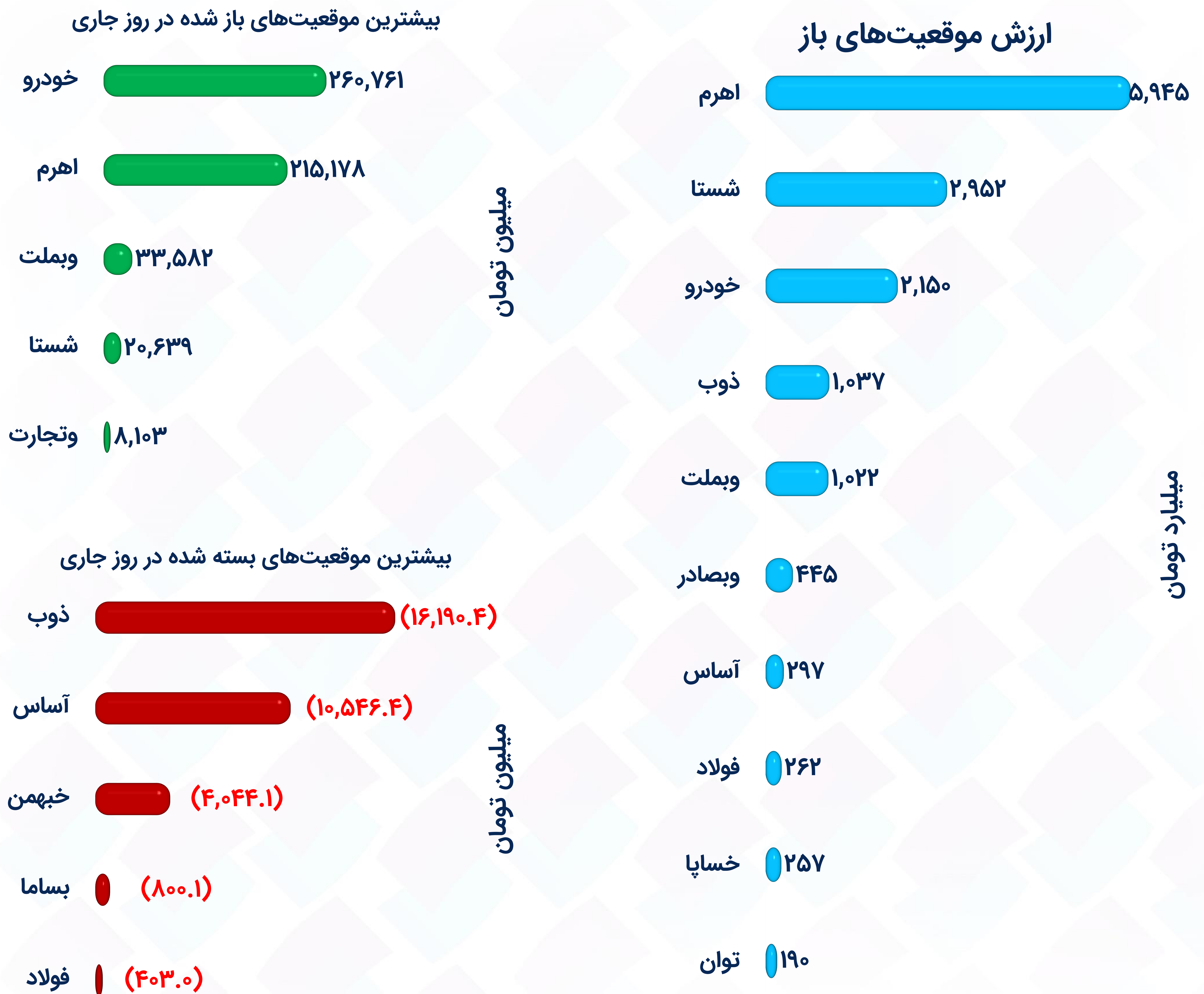
اختیار خرید

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	۳۴	۱۲۷.۱	۲,۰۶۷.۱	۱۱۱.۷	۱۵.۴	(۲۵.۳%)
خودرو	۲۷	۱۰۱.۱	۱,۳۹۳.۸	۸۵.۲	۱۵.۹	(۲۱.۸%)
شستا	۴۱	۳۲.۶	۹۹۲.۹	۲۵.۱	۷.۴	(۲.۰%)
آساس	۶	۸.۳	۳۳.۰	۸.۳	۰.۰	(۰.۵%)
ذوب	۲۳	۷.۱	۱۲۲.۱	۴.۵	۲.۵	(۱۶.۲%)
وبملت	۱۹	۵.۳	۸۶.۸	۴.۷	۰.۶	(۱۰.۱%)
توان	۱۵	۳.۳	۸.۷	۳.۳	۰.۱	(۰.۵%)

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	۱۲	۵۴,۸۰۶.۳	۱,۶۰۵,۹۱۶.۳	۸,۴۴۳.۷	۴۶,۳۶۲.۶	(۵۷.۹%)
خودرو	۴	۱۴,۰۸۶.۲	۸۰۶,۶۳۹.۱	۱۲۷.۴	۱۳,۹۵۸.۷	(۶۶.۳%)
شستا	۱۱	۱,۸۹۸.۲	۲۱۴,۳۹۱.۲	۷۰۸.۶	۱,۱۸۹.۷	(۶۰.۸%)
ذوب	۳	۱۲۰.۳	۶,۲۳۱.۳	۱۰۳.۱	۱۷.۱	(۵۷.۱%)
وبملت	۳	۴۲.۲	۵,۶۵۸.۲	۰.۰	۴۲.۲	(۶۷.۵%)
توان	۲	۱۶.۹	۳۰۹.۷	۱۰.۶	۶.۳	(۵۰.۸%)
وتعاون	۱	۱۴.۷	۱,۸۹۶.۱	۰.۰	۱۴.۷	۱۶.۳%

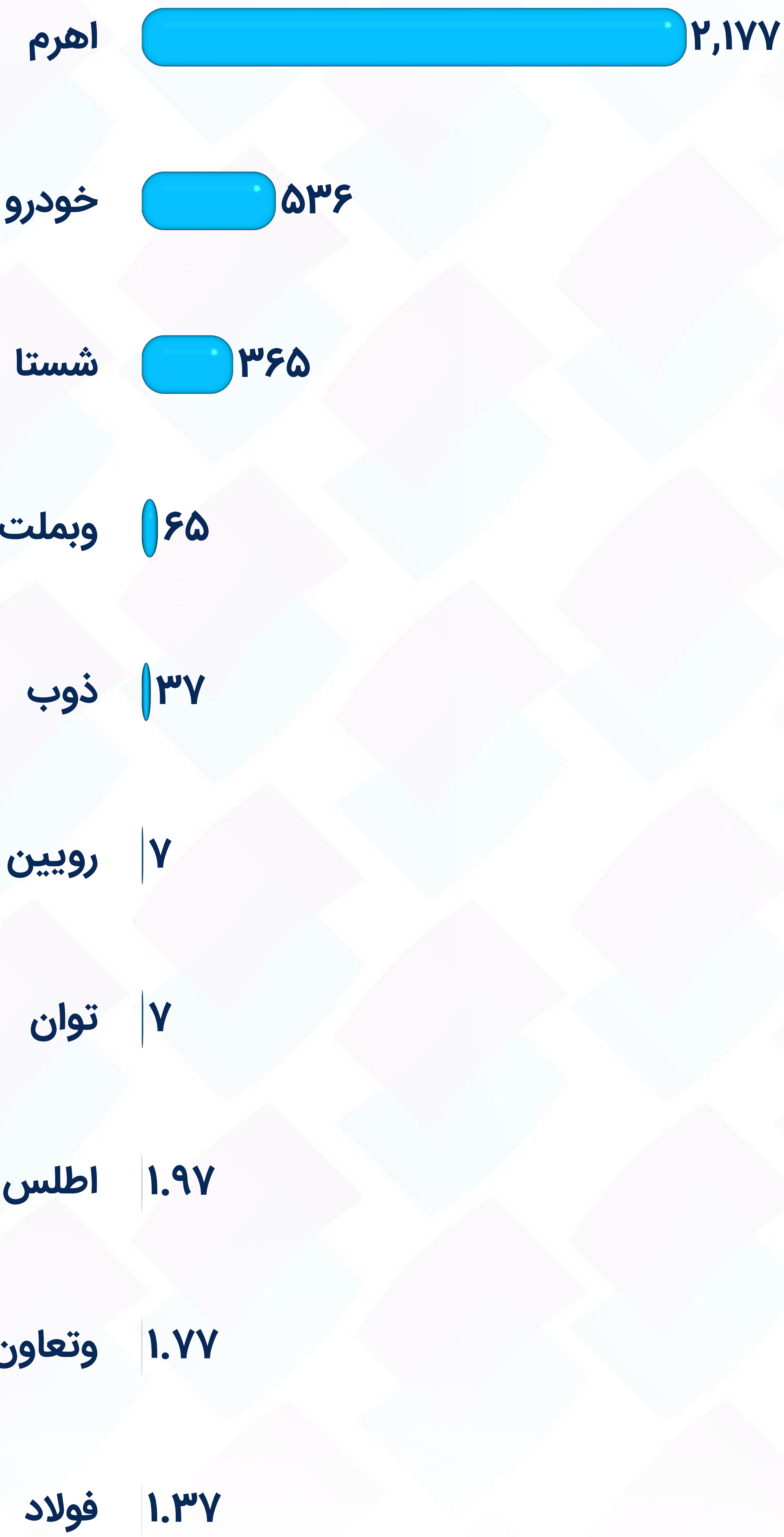
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

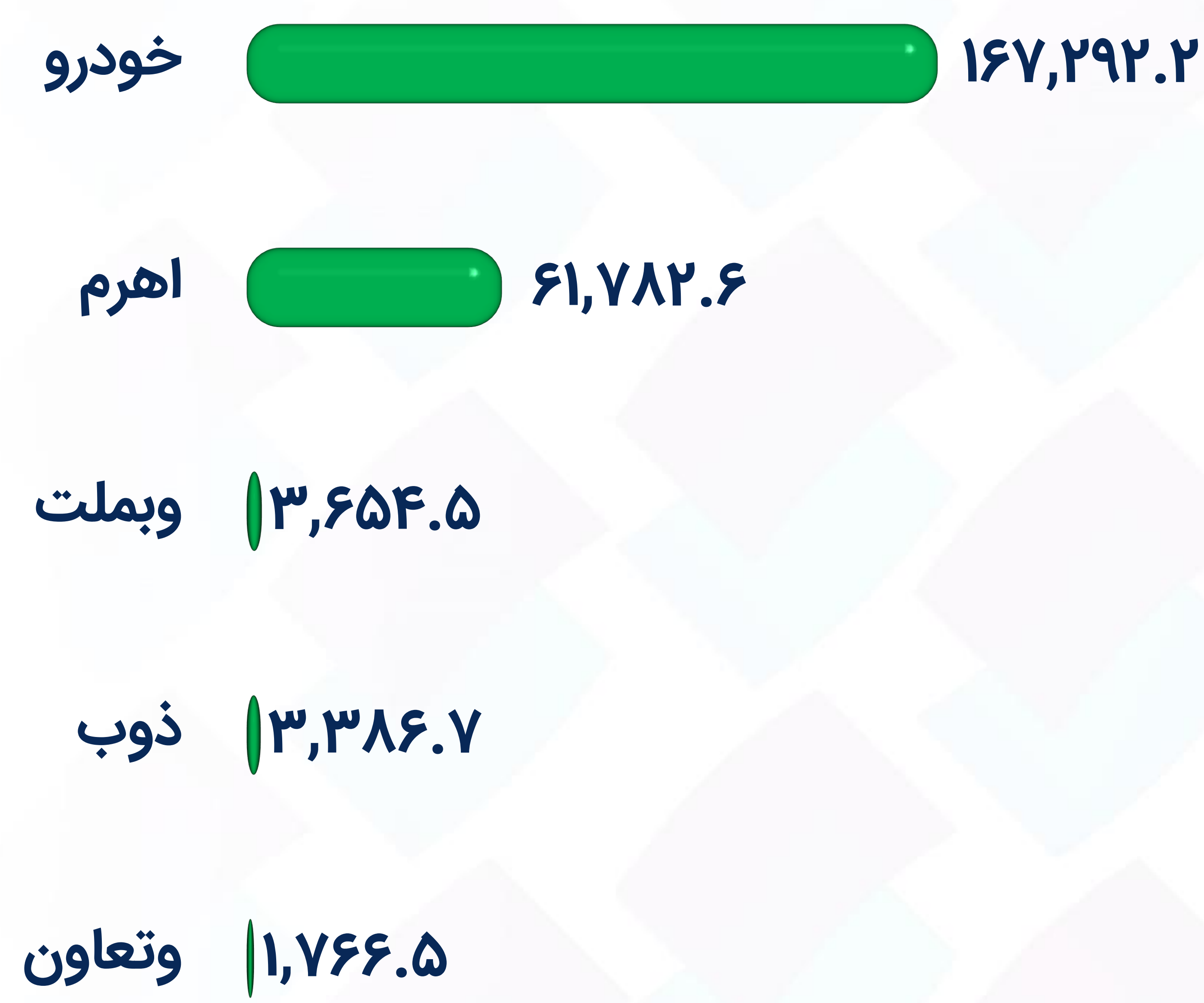
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

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 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
ضسامان ۱۱۱۷	سامان	۲,۰۰۰	۱۴	۱۴.۸	۷۴	۲,۰۶۶	۲,۰۷۴	۰.۴%	۲۸.۰	۰.۸۱	۱۰۶	۴۳%
ضفصبا ۱۱۲۱	فصبا	۴,۰۰۰	۷	۱۵.۹	۴۸۸	۴,۶۴۵	۴,۴۸۸	(۳.۴%)	۹.۲	۱.۰۰	۶۷۲	۳۸%
ضستا ۱۱۲۸	شستا	۱,۳۵۰	۳	۶,۴۵۴.۰	۳۸	۱,۳۹۴	۱,۳۸۸	(۰.۴%)	۳۶.۵	۰.۸۹	۵۲	۳۶%
ضران ۱۱۰۹	خودران	۱۱,۰۰۰	۲۱	۱۰.۹	۴۳۶	۱۱,۰۸۰	۱۱,۴۳۶	۳.۲%	۲۶.۲	۰.۶۴	۵۴۳	۲۵%
ضفصبا ۱۱۱۷	فصبا	۳,۲۰۰	۷	۶.۹	۱,۲۳۶	۴,۶۴۵	۴,۴۳۶	(۴.۵%)	۳.۶	۱.۰۰	۱,۴۶۷	۱۹%

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	۱۷	۳.۰	۲	۴۹۸	۱,۰۰۲	۱۰۱%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۴	ذوب	۹۰۰	۱۷	۳.۲	۲	۴۹۸	۹۰۲	۸۱%	۴۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۱۷	۱۳.۸	۲	۴۹۸	۸۰۲	۶۱%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۱۳۱	شستا	۱,۶۵۰	۳	۲۲.۷	۱	۱,۳۹۴	۱,۶۵۱	۱۸%	۱,۶۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۱۷	۴۴.۳	۲	۴۹۸	۷۰۲	۴۱%	۳۵۱.۰	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
طوتعاون ۱۰۵	وتعاون	۱,۲۰۰	۷۷	۱۴.۷	۱۰	۱,۲۸۸	۱,۱۹۰	(۷.۶%)	۱۱۹.۰	-۰.۱۳	۱۲	۱۶.۳%
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۷	۳۶.۷	۷,۱۹۴	۲۶,۶۰۰	۲۶,۸۰۶	۰.۸%	۳.۷	-۱.۰۰	۶,۸۴۳	(۴.۹%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۷	۴,۹۰۱.۰	۳,۷۸۳	۲۶,۶۰۰	۲۶,۲۱۷	(۱.۴%)	۶.۹	-۰.۹۰	۳,۰۰۴	(۲۰.۶%)
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۳,۲۵۰	۸۰	۱۰.۰	۱۰۰	۳,۲۷۴	۳,۱۵۰	(۳.۸%)	۳۱.۵	-۰.۲۶	۷۵	(۲۴.۹%)
طستا ۱۱۲۹	شستا	۱,۴۵۰	۳	۷۰۵.۶	۷۷	۱,۳۹۴	۱,۳۷۳	(۱.۵%)	۱۷.۸	-۰.۸۸	۵۲	(۳۱.۹%)

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 ۱۱۰۶	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۷	۲۸.۶	۳۲	۲۶,۶۰۰	۱۷,۹۶۸	(۳۲.۵%)	۵۶۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۱۲۷	شستا	۱,۲۵۰	۳	۴۸.۸	۱	۱,۳۹۴	۱,۲۴۹	(۱۰.۴%)	۱,۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۷	۶.۸	۴۲	۲۶,۶۰۰	۱۹,۹۵۸	(۲۵.۰%)	۴۷۵.۲	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۱۷	۱۷.۱	۲	۴۹۸	۳۹۸	(۲۰.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۲%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۳۱	۴.۶	۸	۱,۳۹۴	۱,۱۴۲	(۱۸.۱%)	۱۴۲.۸	۰.۰۰	۰	(۹۹.۰%)

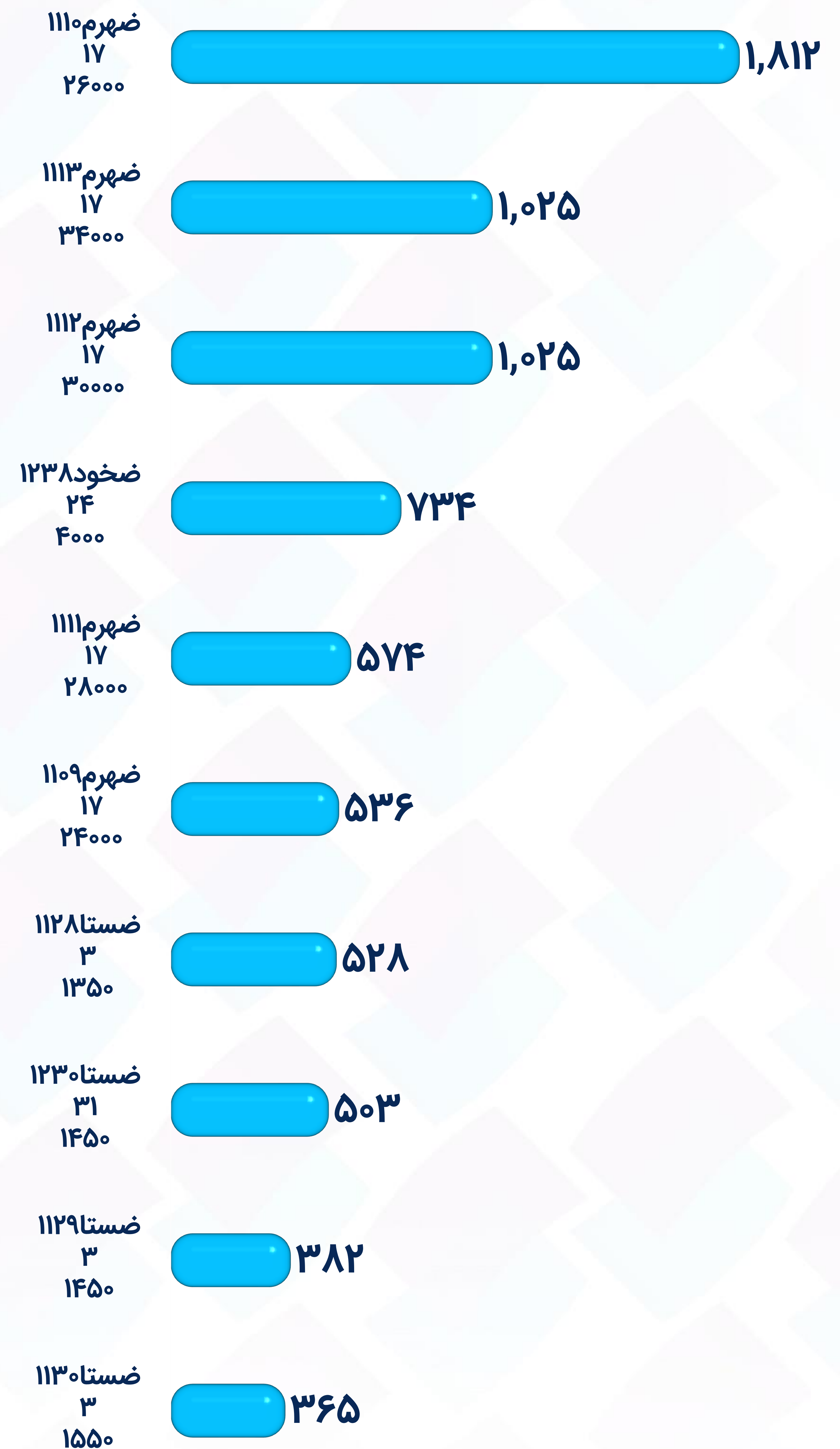
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

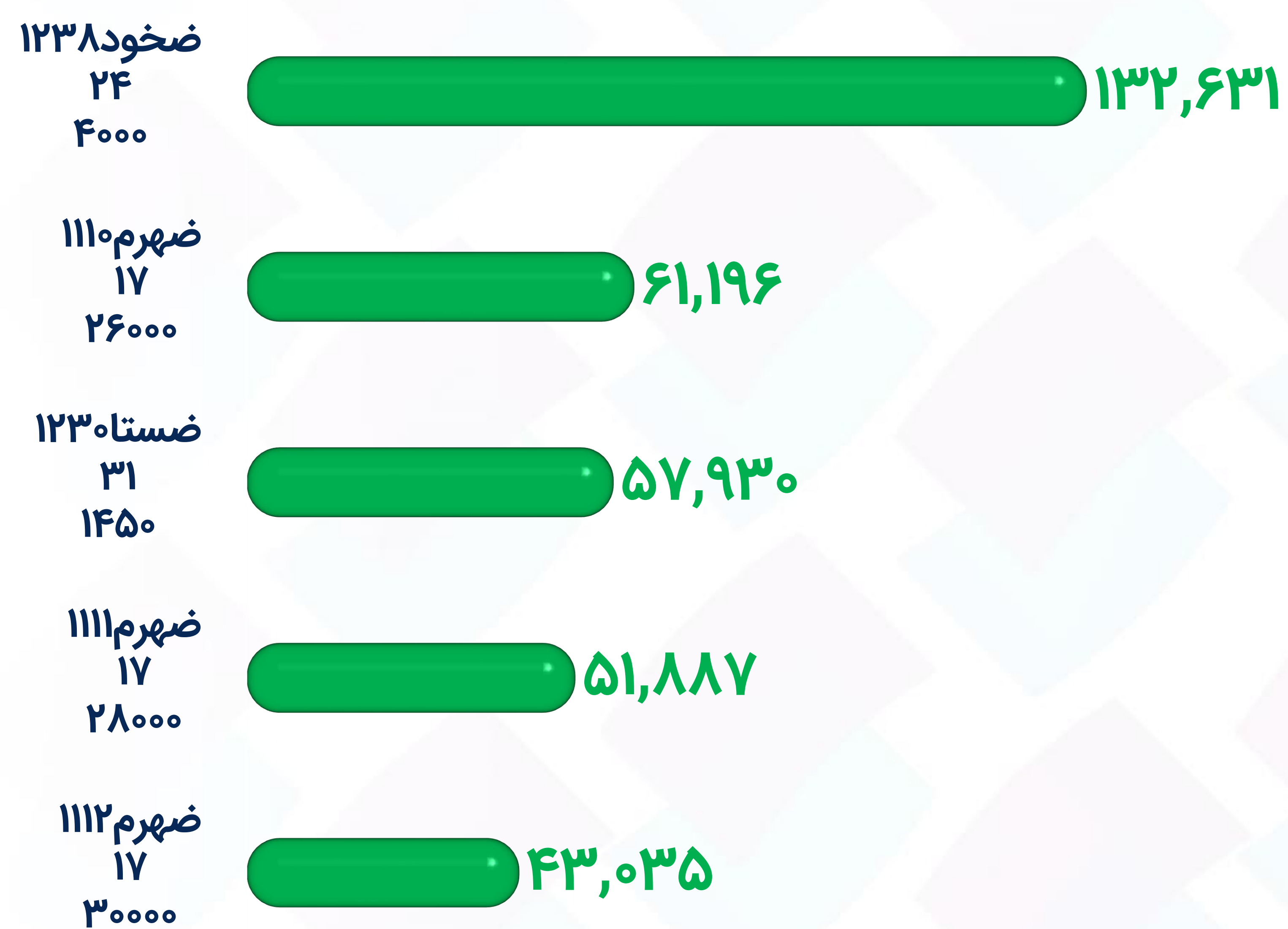
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

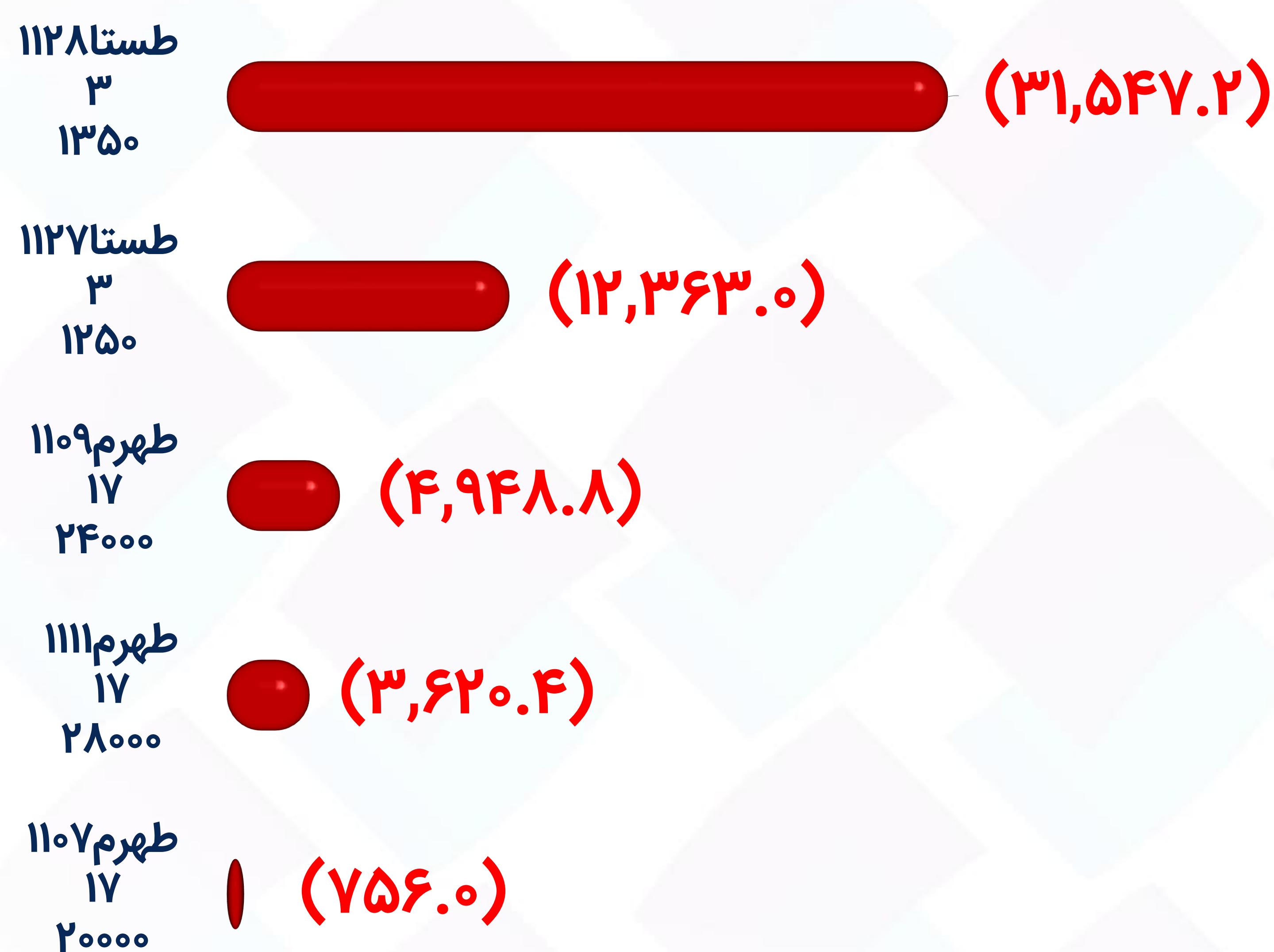
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



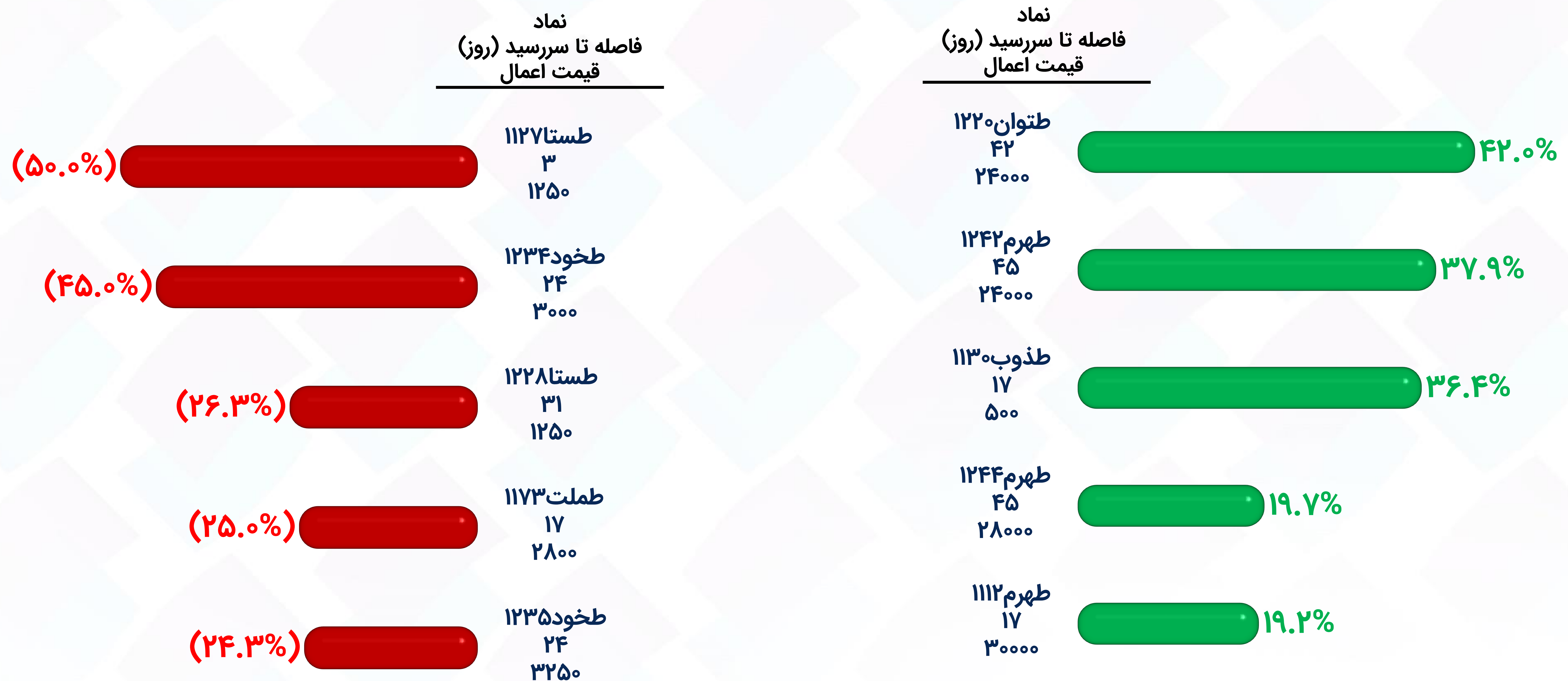
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

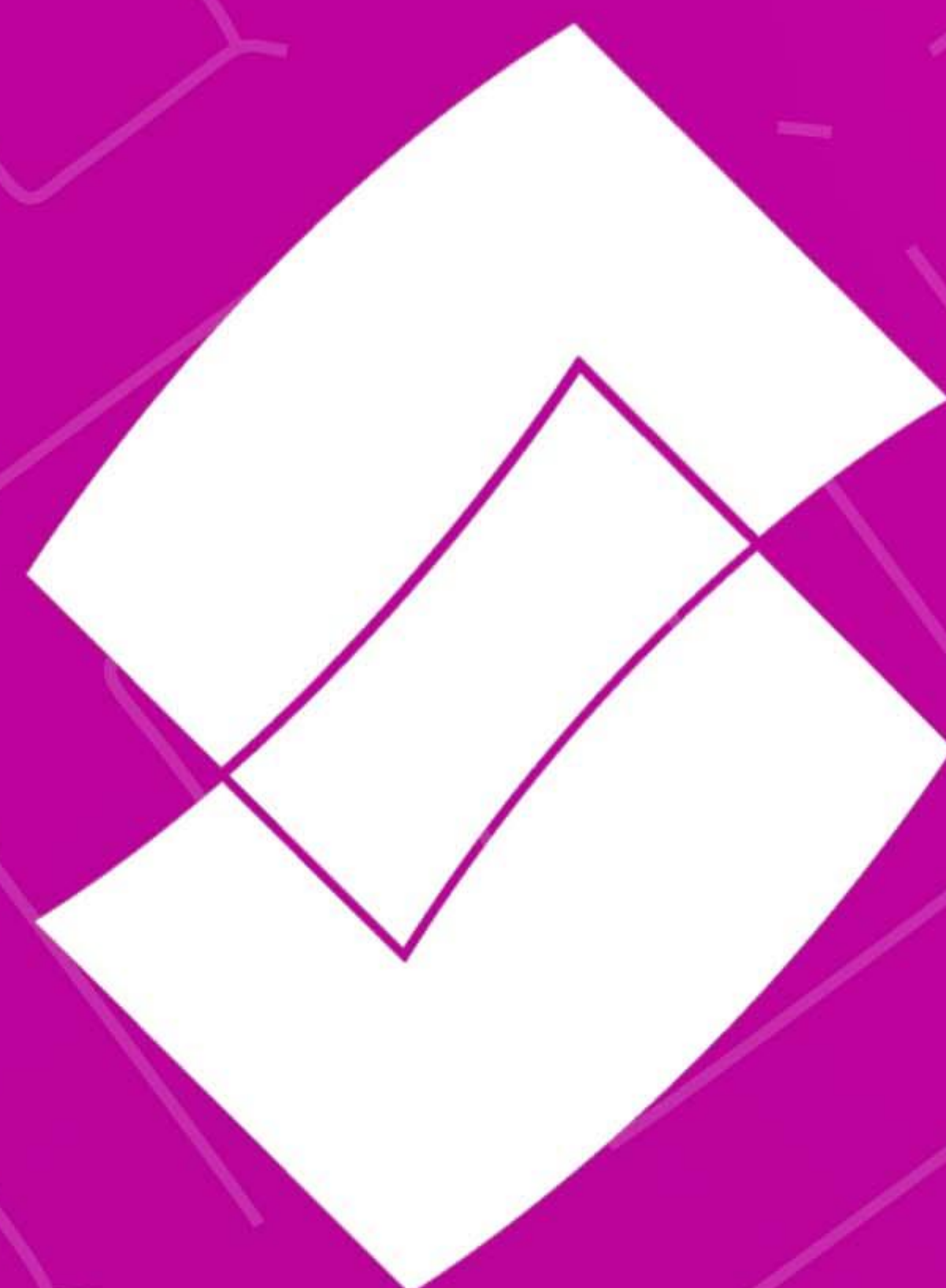
اختیار خرید



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.