

شماره
۴۲۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۵ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





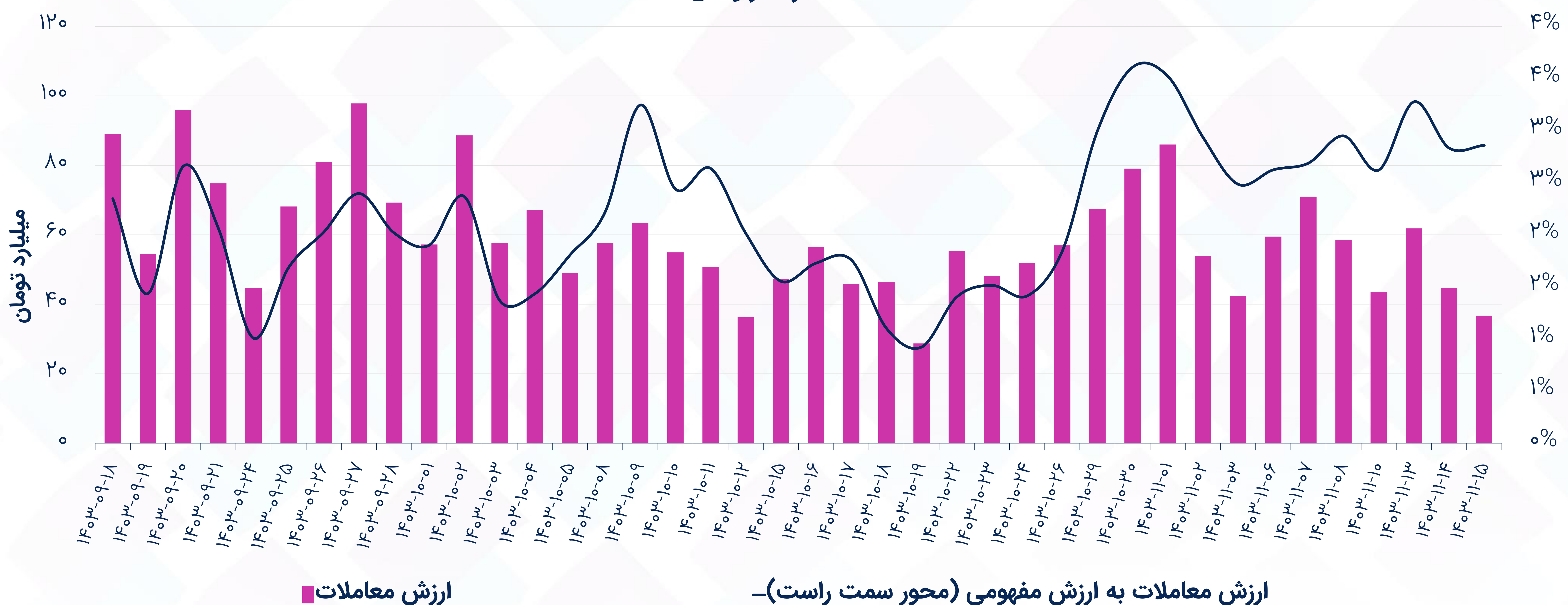
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



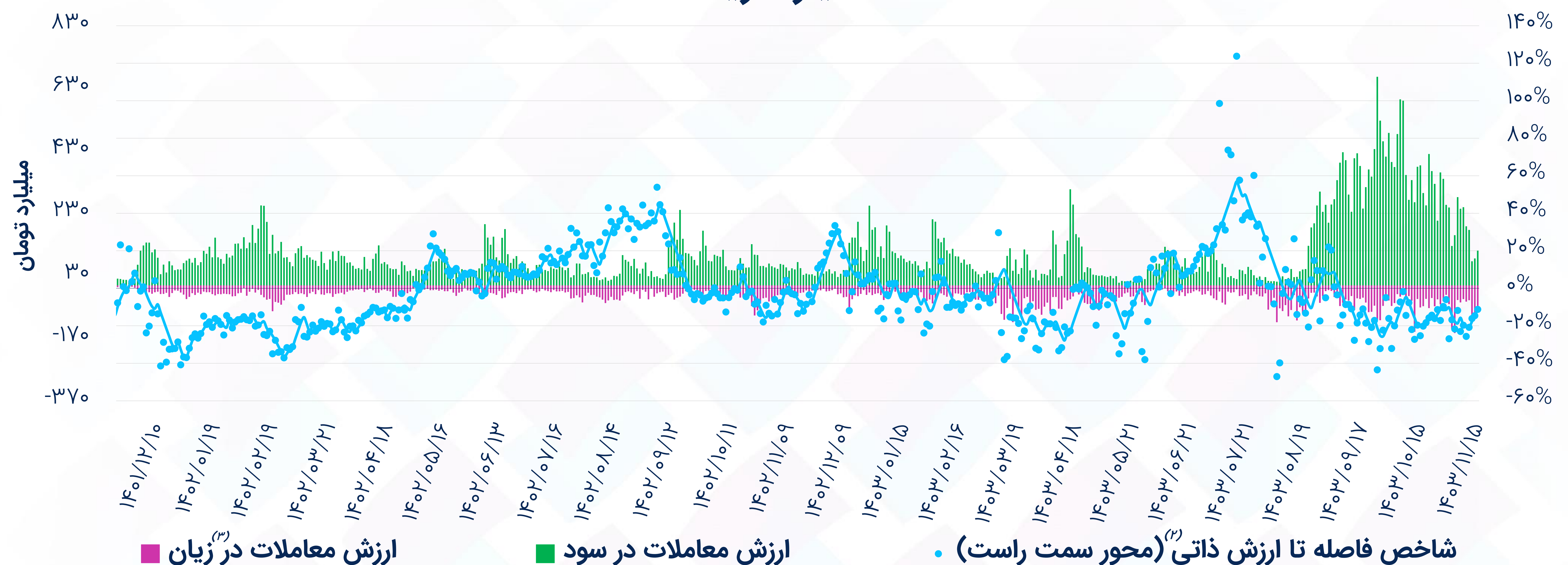
اختیار فروش



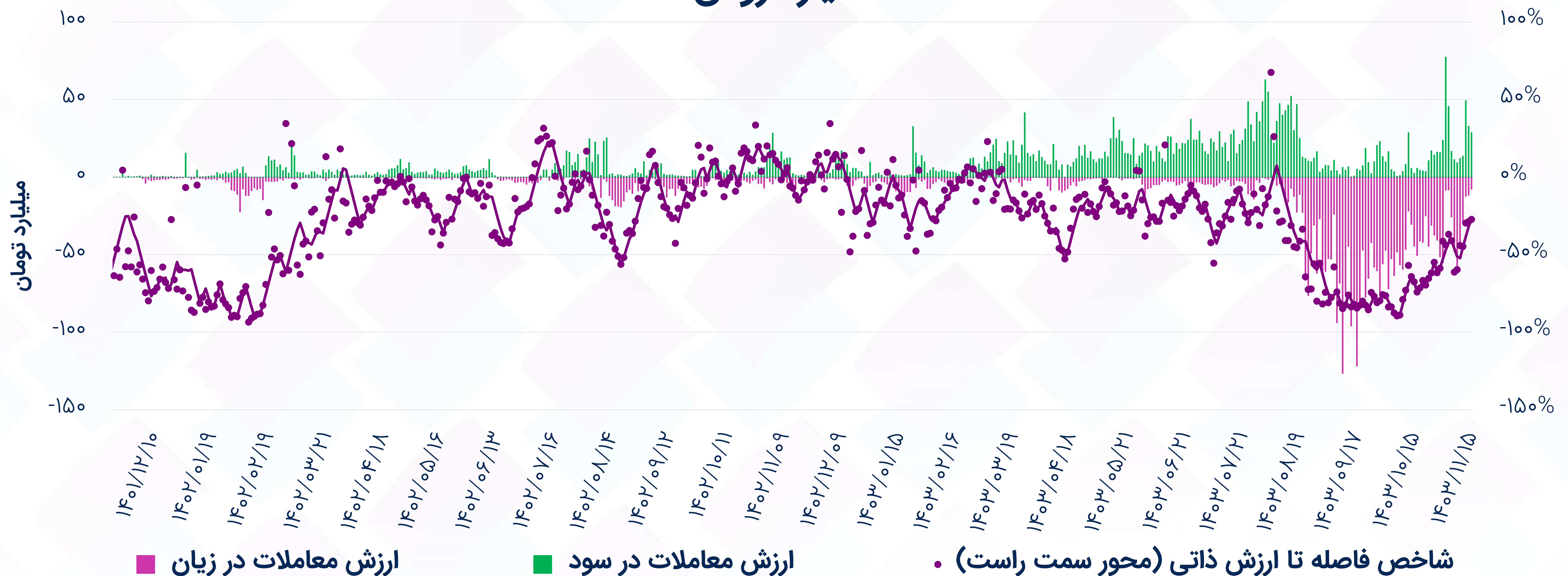
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

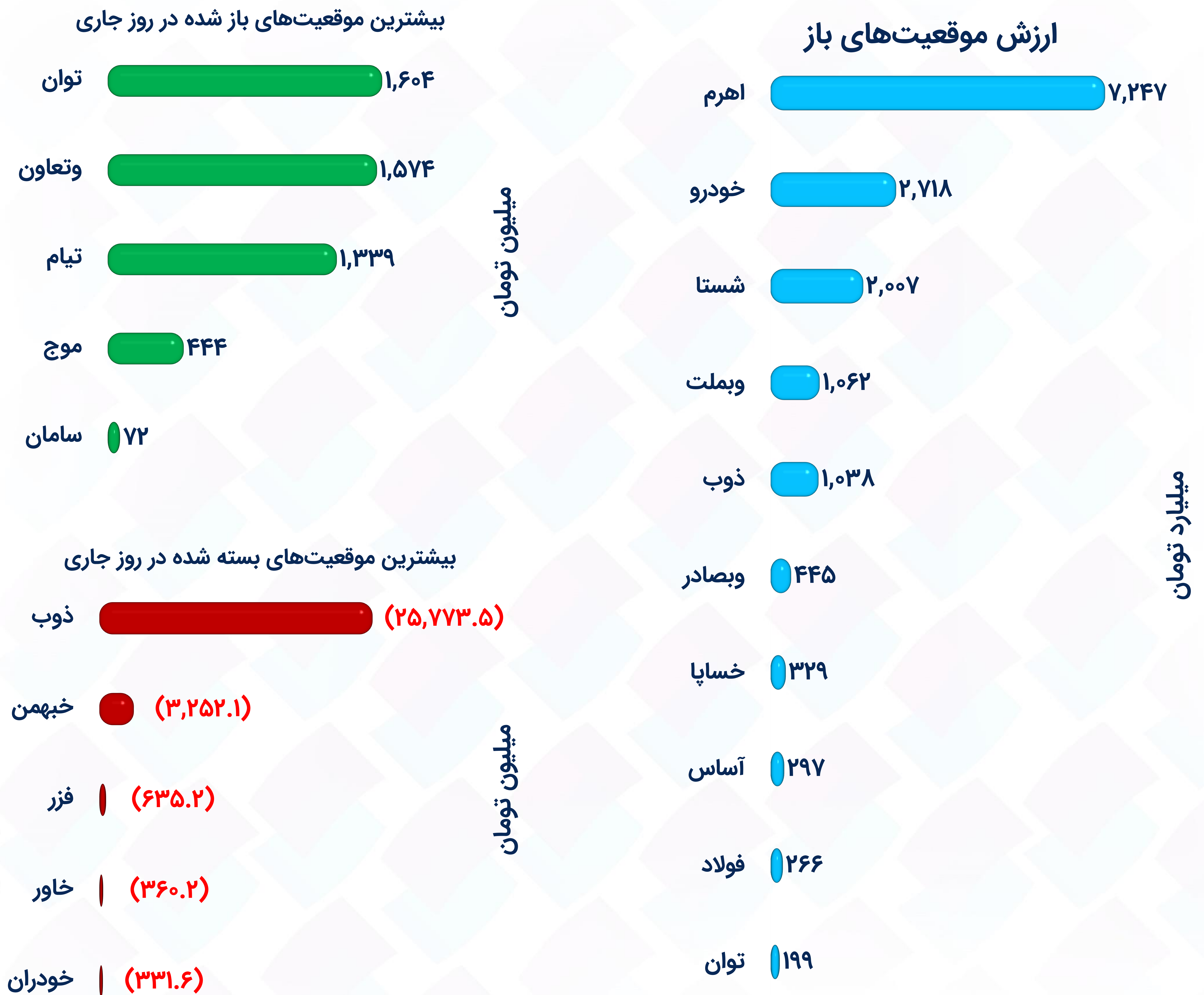
اختیار خرید

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	۴۳	۱۰۸.۰	۳,۴۶۱.۱	۴۵.۱	۶۲.۹	(۲۰.۵%)
خودرو	۳۷	۴۳.۱	۱,۱۲۸.۴	۳۲.۵	۱۰.۶	۸.۵%
شستا	۴۰	۱۲.۲	۳۰۹.۳	۵.۵	۶.۷	(۲۴.۴%)
شتاب	۱۹	۹.۰	۴۹.۷	۷.۶	۱.۴	(۲.۱%)
ذوب	۲۳	۷.۶	۱۳۹.۳	۵.۷	۱.۹	(۱۱.۲%)
وبملت	۱۹	۴.۸	۹۰.۰	۴.۰	۰.۷	(۲.۶%)
خسپا	۱۹	۳.۳	۹۵.۵	۳.۱	۰.۳	۱۹.۳%

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	۱۵	۳۱,۳۲۶.۳	۹۰۸,۷۶۱.۸	۲۷,۱۷۰.۶	۴,۱۵۵.۷	(۲۴.۳%)
خودرو	۶	۴,۳۲۸.۵	۳۲۳,۶۱۶.۸	۱,۰۷۷.۵	۳,۲۵۱.۰	(۴۳.۱%)
شستا	۸	۸۶۵.۴	۴۴,۴۱۶.۰	۳۷۱.۸	۴۹۳.۶	(۵۹.۳%)
ذوب	۵	۱۳۴.۱	۱,۹۱۶.۳	۱۳۳.۵	۰.۶	(۹.۷%)
وبملت	۵	۳۲.۹	۴,۳۱۱.۳	۱۳.۴	۱۹.۶	(۴۵.۵%)
اطلس	۱	۳.۴	۱۲۱.۶	۰.۰	۳.۴	(۵۸.۸%)
توان	۱	۲.۰	۵۰.۶	۰.۰	۲.۰	(۲۷.۰%)

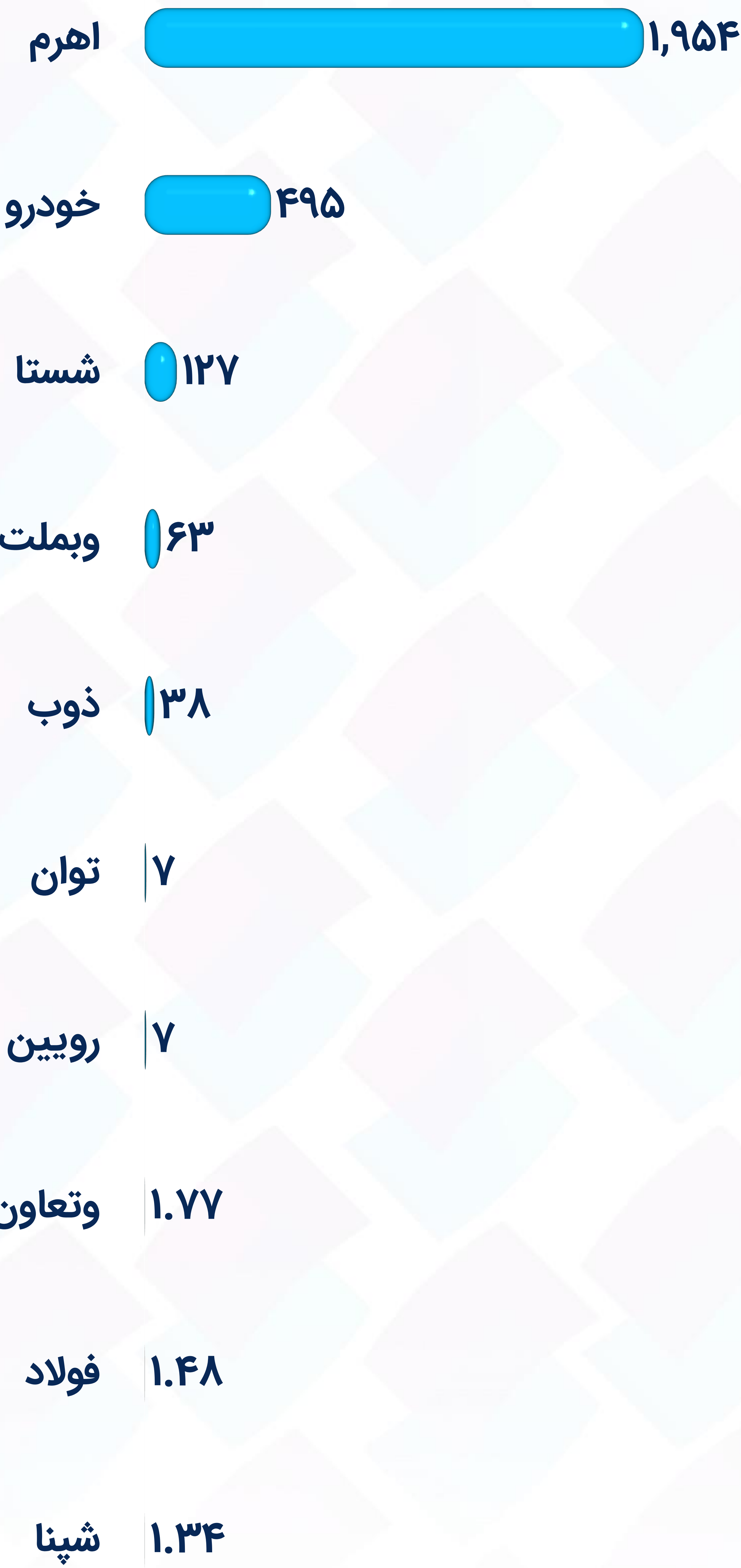
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

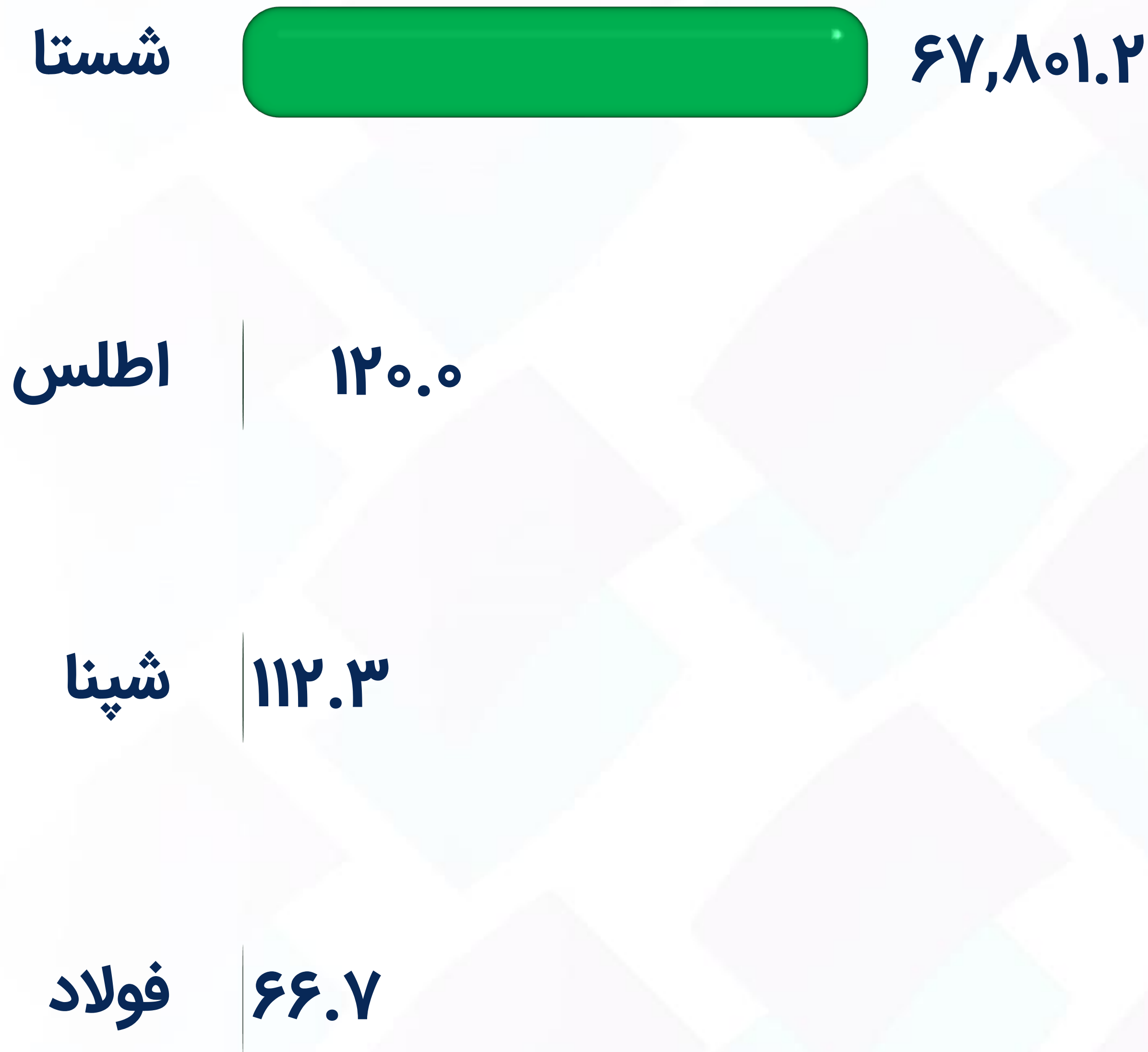
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

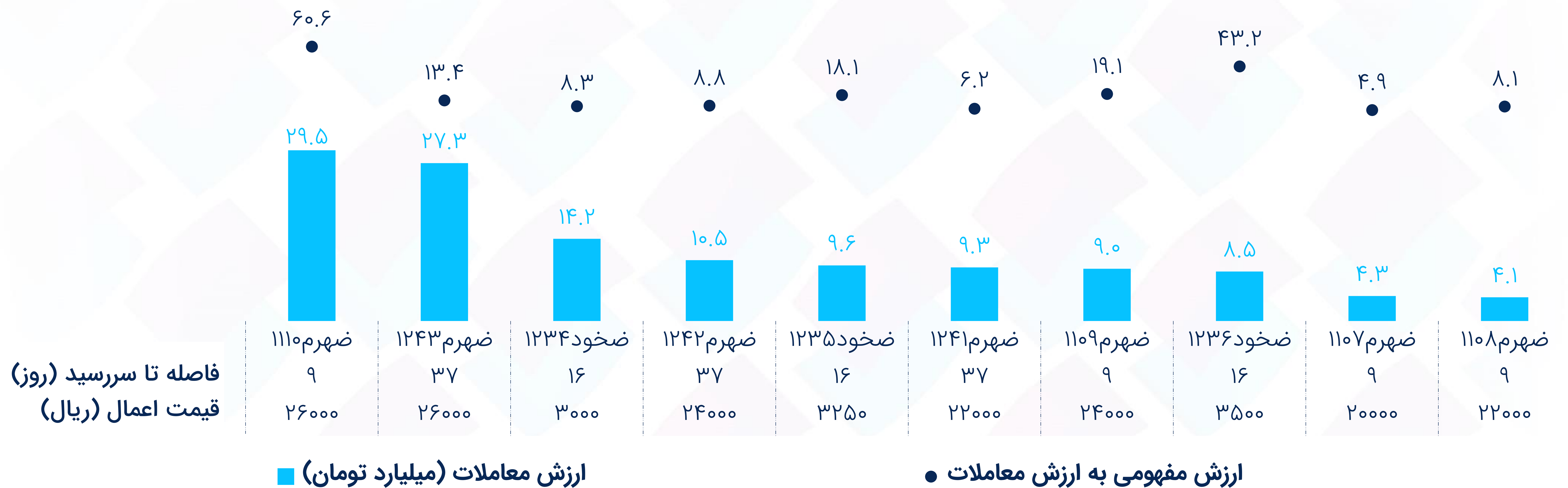
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضتاب ۱۱۱۱	شتاب	۱۴,۰۰۰	۲	۳۴.۰	۱۴۱	۱۳,۹۹۰	۱۴,۱۴۱	۱.۱%	۱۰۰.۳	۰.۵۴	۲۴۸	۷۶%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۲۰	۳۷.۵	۵۸۵	۷,۴۲۰	۷,۲۴۷	(۲.۳%)	۱۲.۴	۰.۹۹	۸۸۱	۵۱%
ضفرز ۱۲۰۸	فرز	۴۴,۰۰۰	۲۷	۵۳.۵	۲,۱۴۸	۴۵,۵۰۰	۴۶,۱۴۸	۱.۴%	۲۱.۵	۰.۷۶	۳,۱۸۶	۴۸%
ضتاب ۰۱۰۵	شتاب	۱۳,۰۰۰	۶۵	۱۰.۹	۱,۲۷۳	۱۳,۹۹۰	۱۴,۲۷۳	۲.۰%	۱۱.۲	۰.۸۲	۱,۸۷۰	۴۷%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۲۰	۲۵۷.۴	۹۰۱	۷,۴۲۰	۷,۱۴۷	(۳.۷%)	۷.۹	۱.۰۰	۱,۲۸۹	۴۳%

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	۹	۱.۵	۱	۴۶۷	۱,۰۰۱	۱۱۴%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۹	۱۰.۵	۱	۴۶۷	۸۰۱	۷۲%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۳۲	ذوب	۷۰۰	۹	۳.۰	۱	۴۶۷	۷۰۱	۵۰%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۱۶	۱.۷	۶	۳,۴۱۵	۵,۰۰۶	۴۷%	۸۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۹	۶۹.۳	۲۳	۲۵,۰۳۰	۳۴,۰۲۳	۳۶%	۱,۴۷۹.۳	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
طدوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۹	۱۱.۱	۱۲۲	۴۶۷	۴۷۸	۲.۴%	۳.۹	-۱.۰۰	۱۲۷	۴.۵%
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۹	۷۶.۲	۸,۶۵۴	۲۵,۰۳۰	۲۵,۳۴۶	۱.۳%	۲.۹	-۱.۰۰	۸,۶۵۶	۰.۰%
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۹	۲,۵۳۰.۸	۴,۸۵۹	۲۵,۰۳۰	۲۵,۱۴۱	۰.۴%	۵.۲	-۱.۰۰	۴,۶۹۴	(۳.۴%)
طدوب ۱۱۳۰	ذوب	۵۰۰	۹	۱۰۶.۸	۳۴	۴۶۷	۴۶۶	(۰.۲%)	۱۳.۷	-۰.۸۳	۳۱	(۸.۹%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۹	۲,۰۵۴.۷	۳,۰۳۰	۲۵,۰۳۰	۲۴,۹۷۰	(۰.۲%)	۸.۲	-۰.۹۵	۲,۷۴۱	(۹.۵%)

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	۹	۵.۶	۱۷	۲۵,۰۳۰	۱۷,۹۸۳	(۲۸.۲%)	۱,۰۵۷.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۹	۱.۵	۱۲	۲۵,۰۳۰	۱۹,۹۸۸	(۲۰.۱%)	۱,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۲۳	۵.۰	۴	۱,۳۲۳	۱,۱۴۶	(۱۳.۴%)	۲۸۶.۵	-۰.۰۱	۰	(۹۱.۸%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۷	۲.۰	۵۸	۲۵,۰۳۰	۱۹,۹۴۲	(۲۰.۳%)	۳۴۳.۸	-۰.۰۱	۱۳	(۷۷.۱%)
طهرم ۱۱۰۸	اهرم	۲۲,۰۰۰	۹	۷۸.۸	۲۳	۲۵,۰۳۰	۲۱,۹۷۷	(۱۲.۲%)	۹۵۵.۵	-۰.۰۱	۵	(۷۶.۳%)

(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

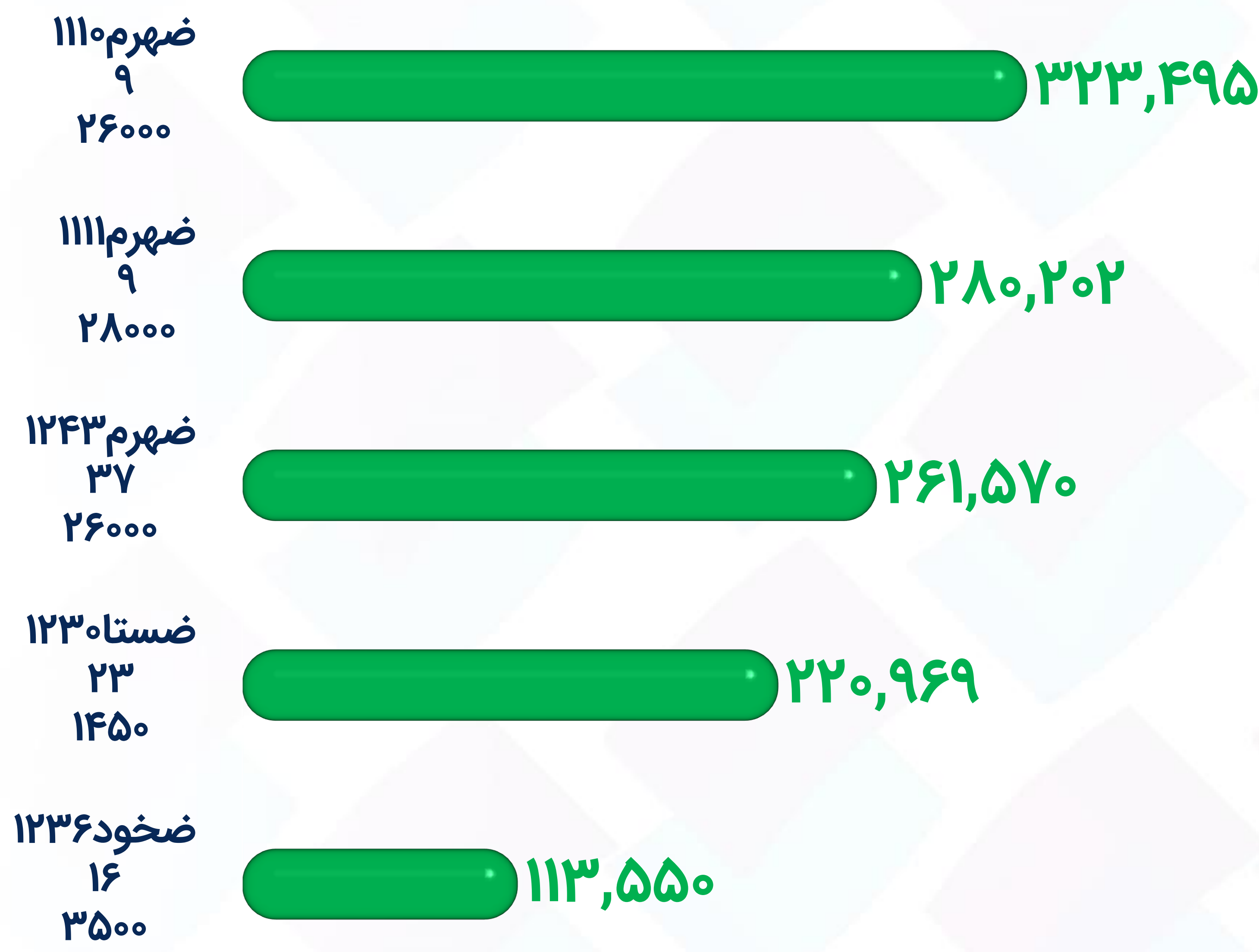
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

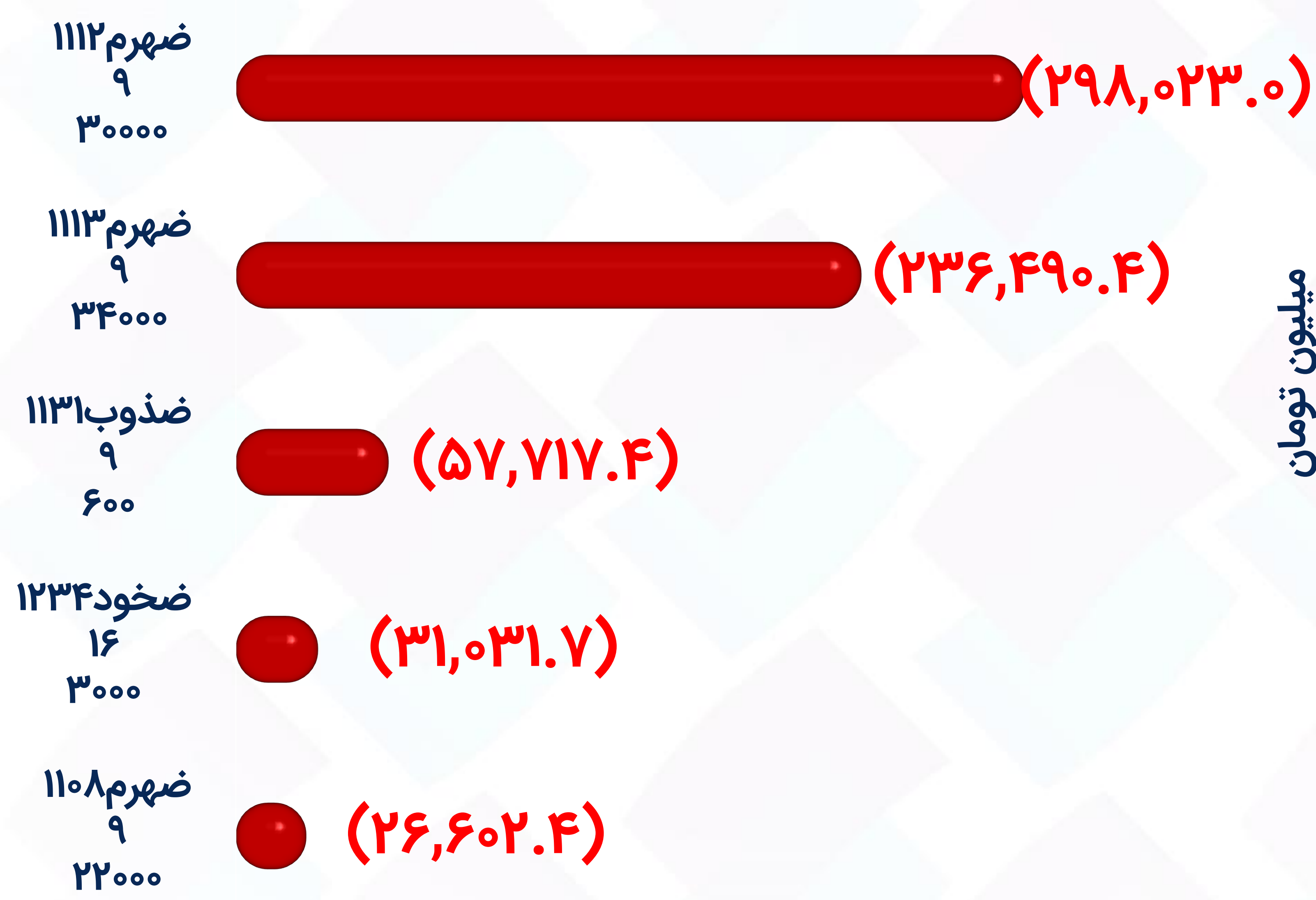
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

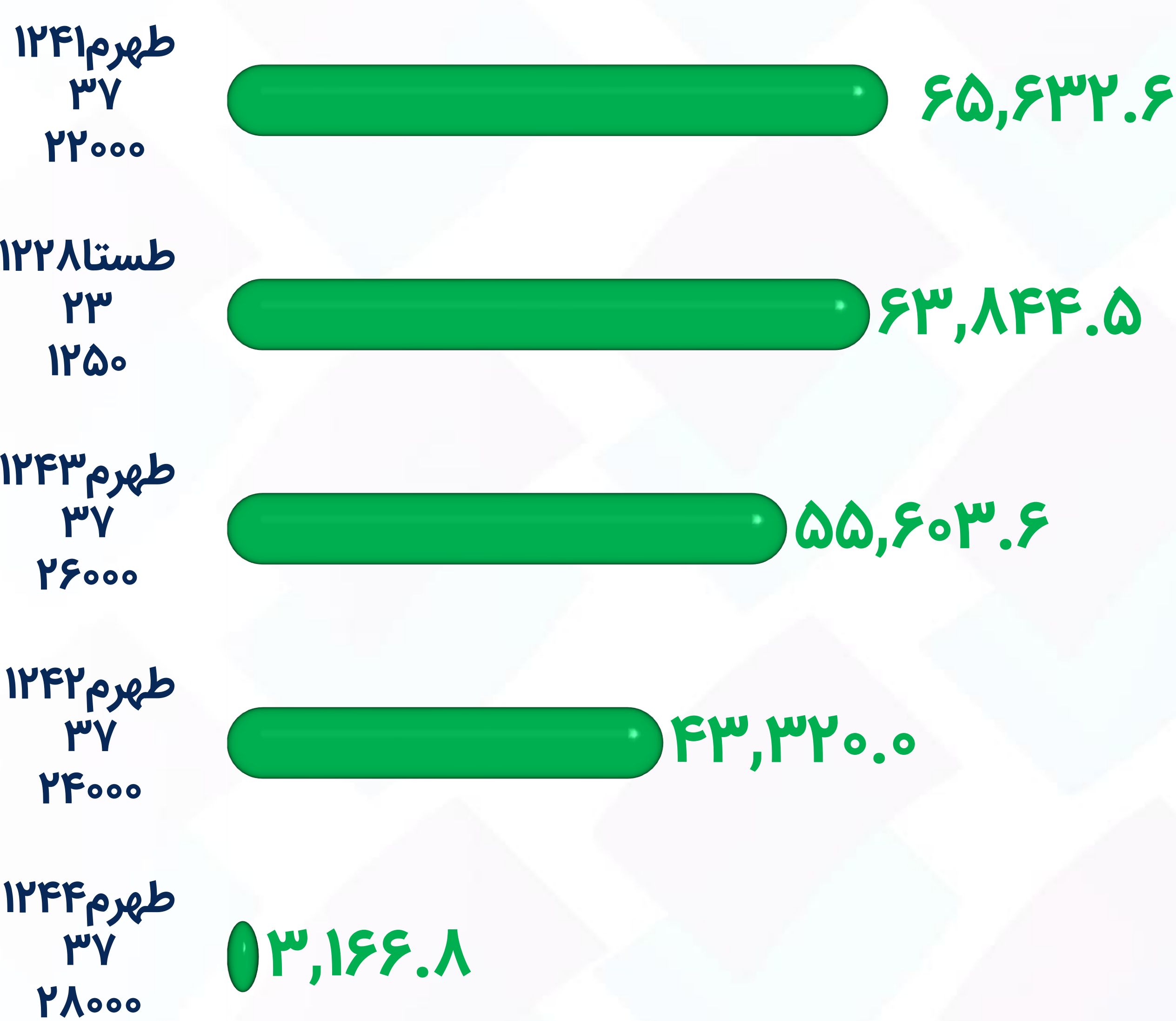
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

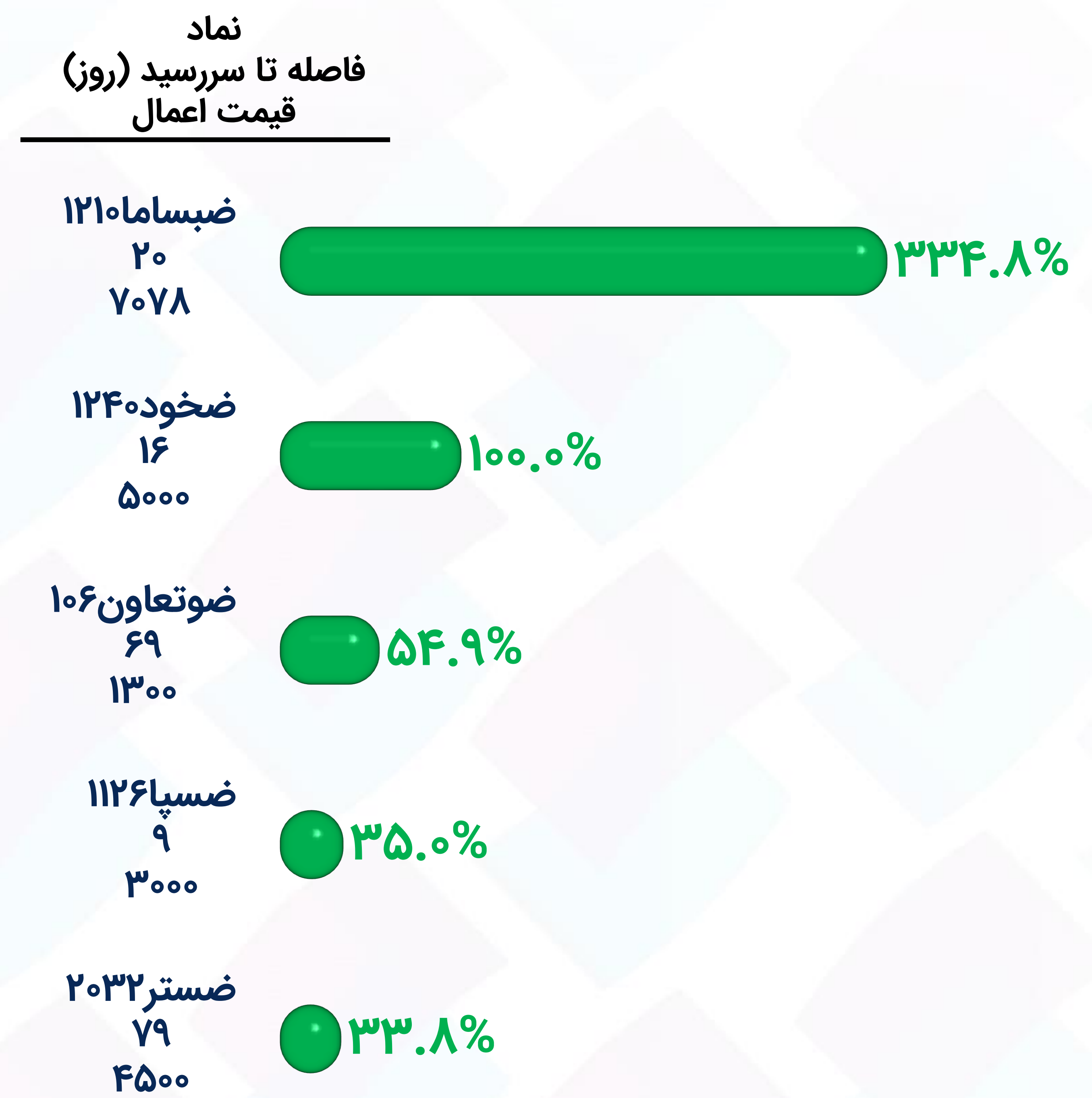
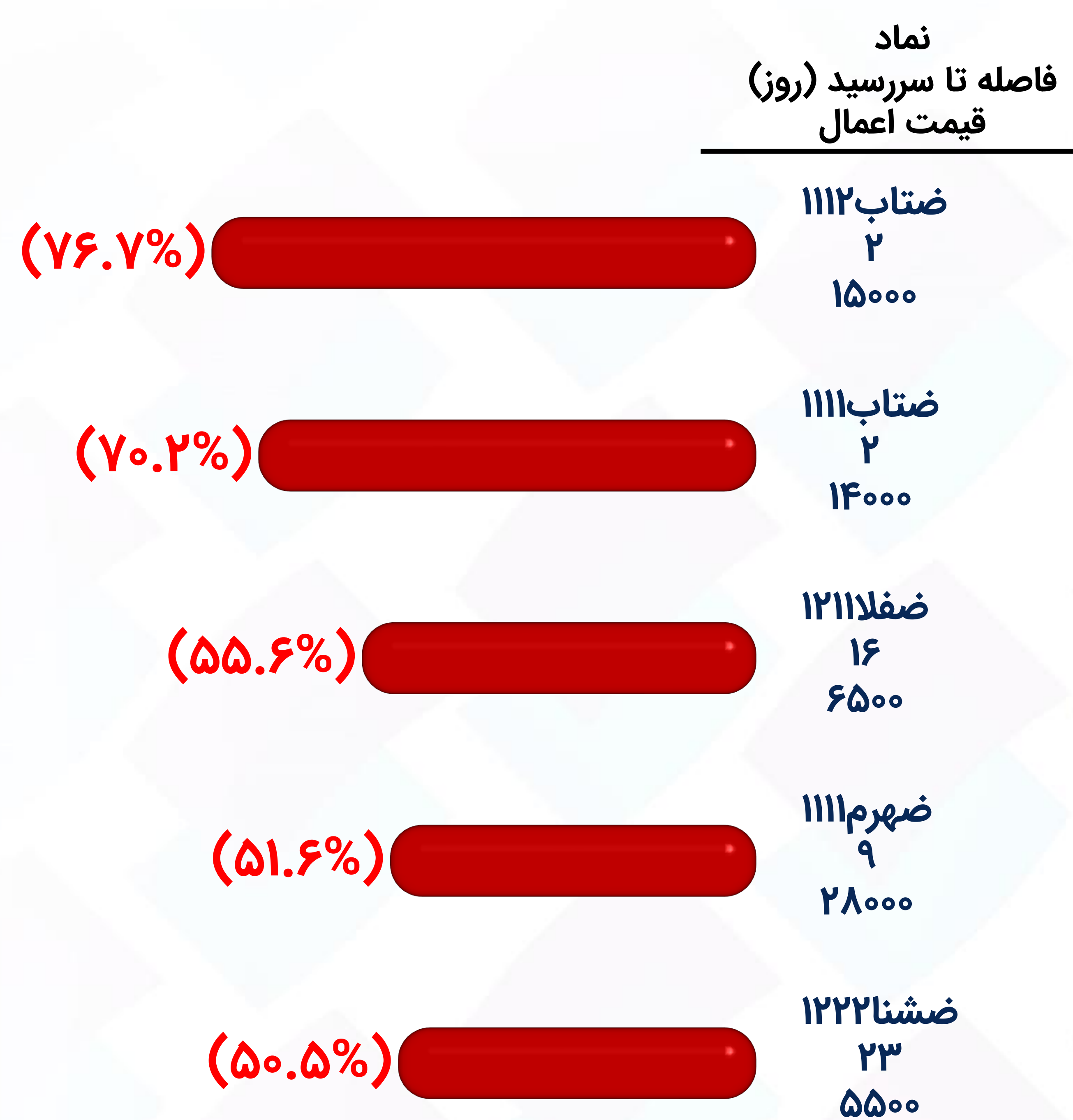
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



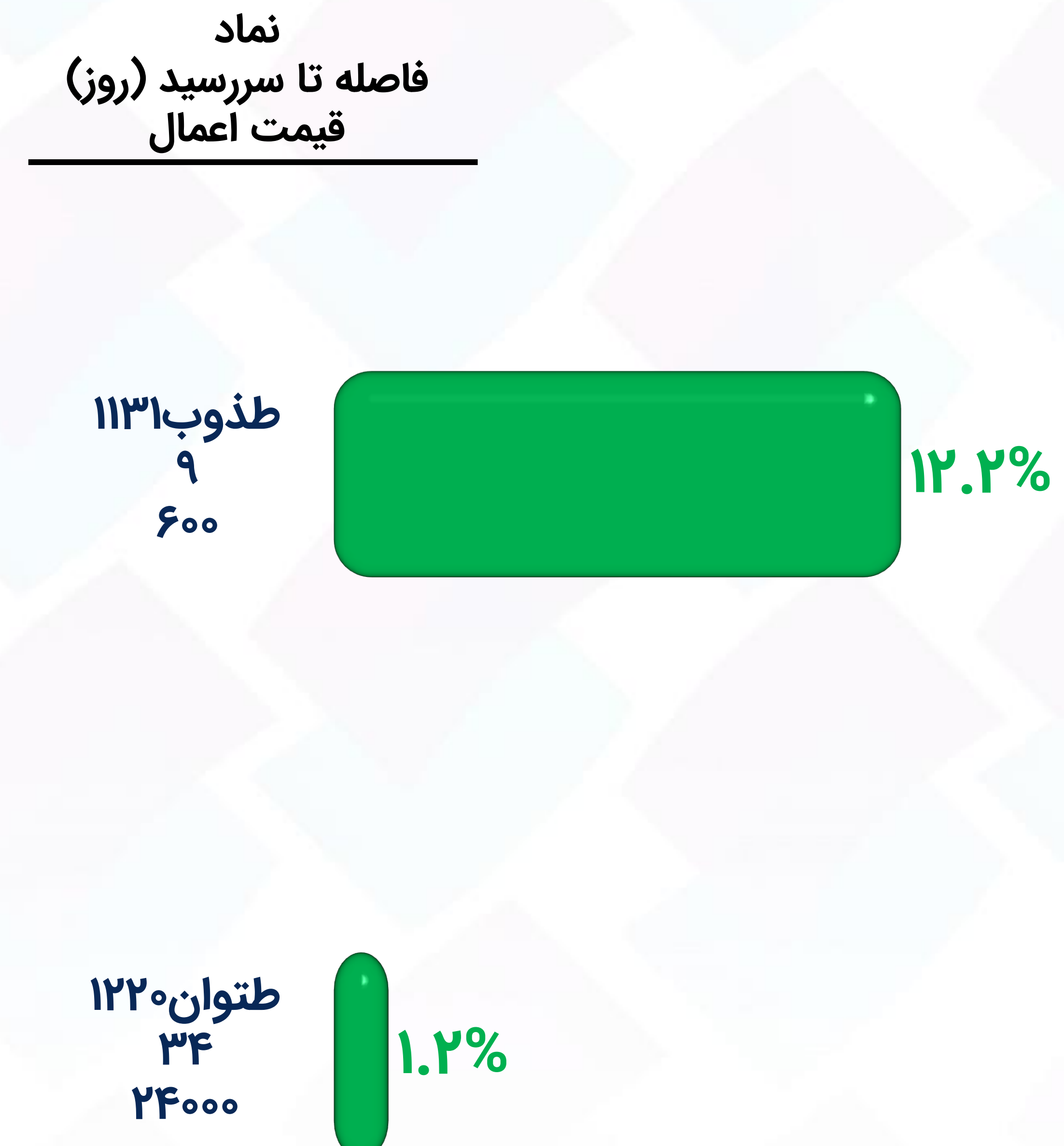
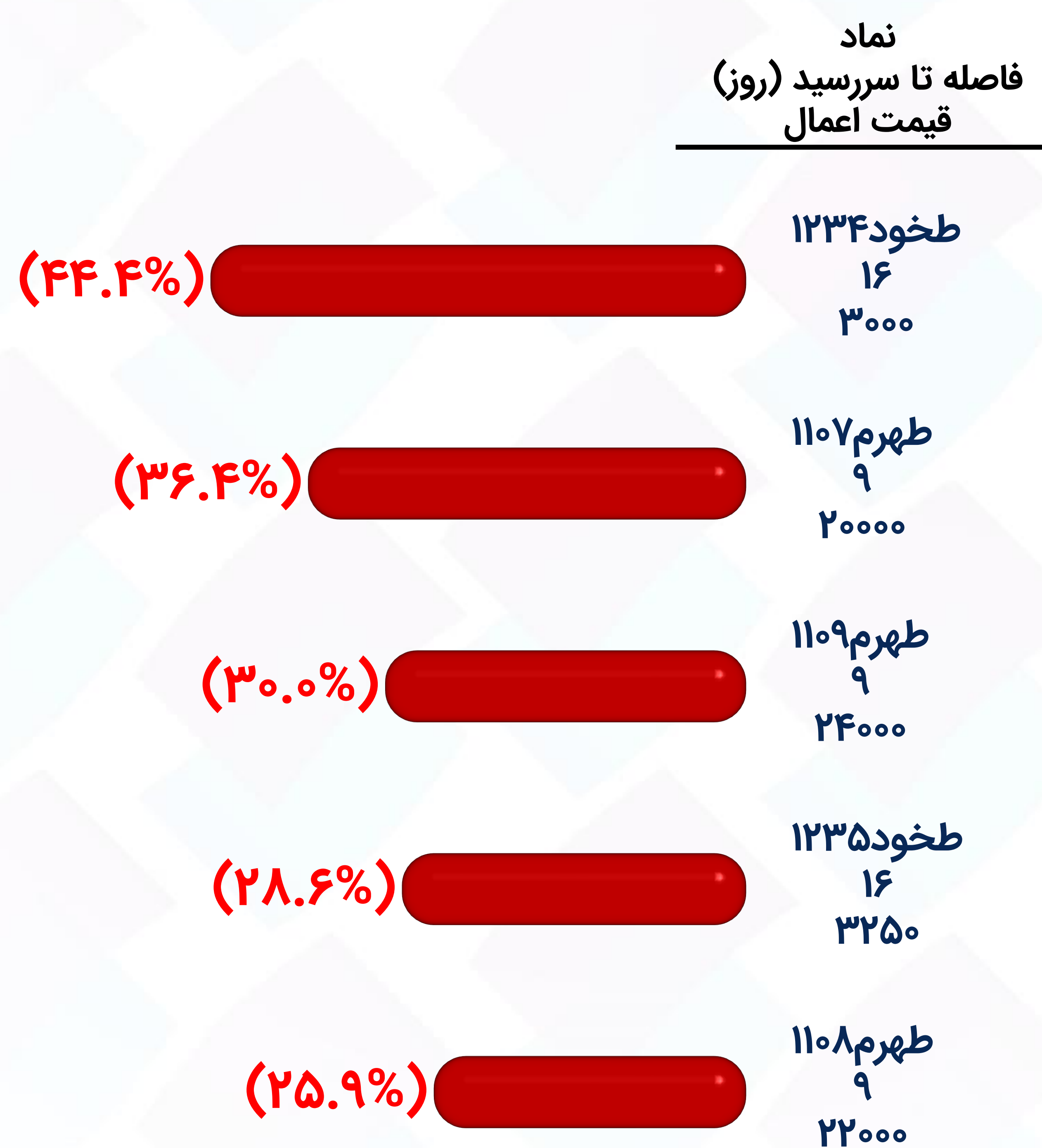
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

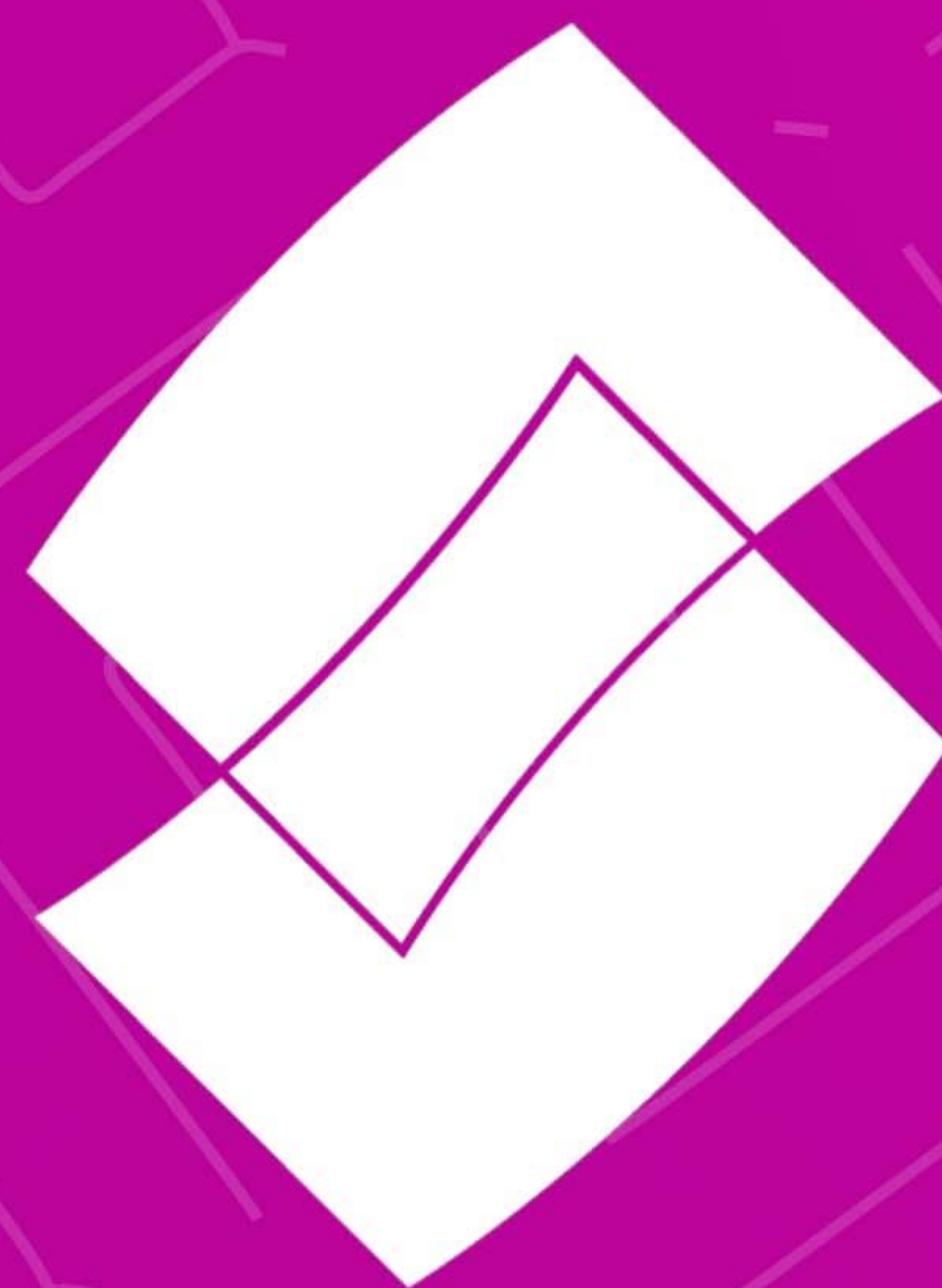
اختیار خرید



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.