

شماره
۴۲۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





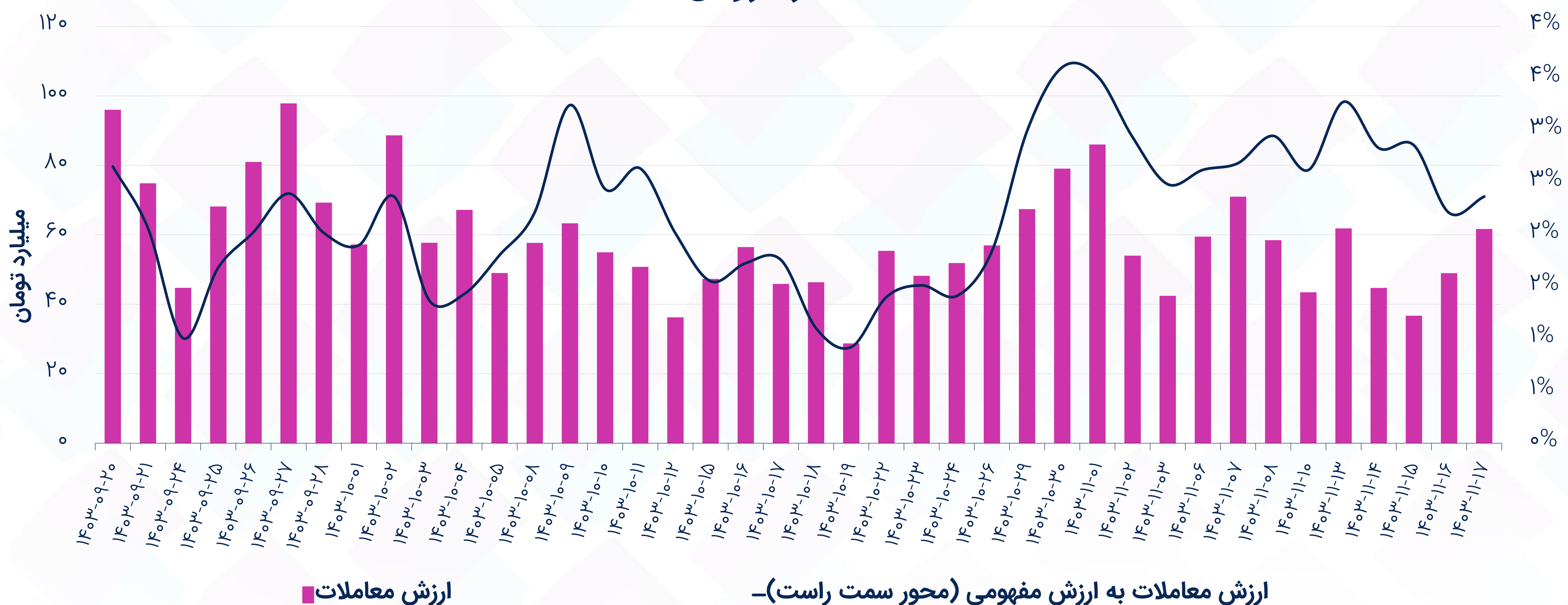
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



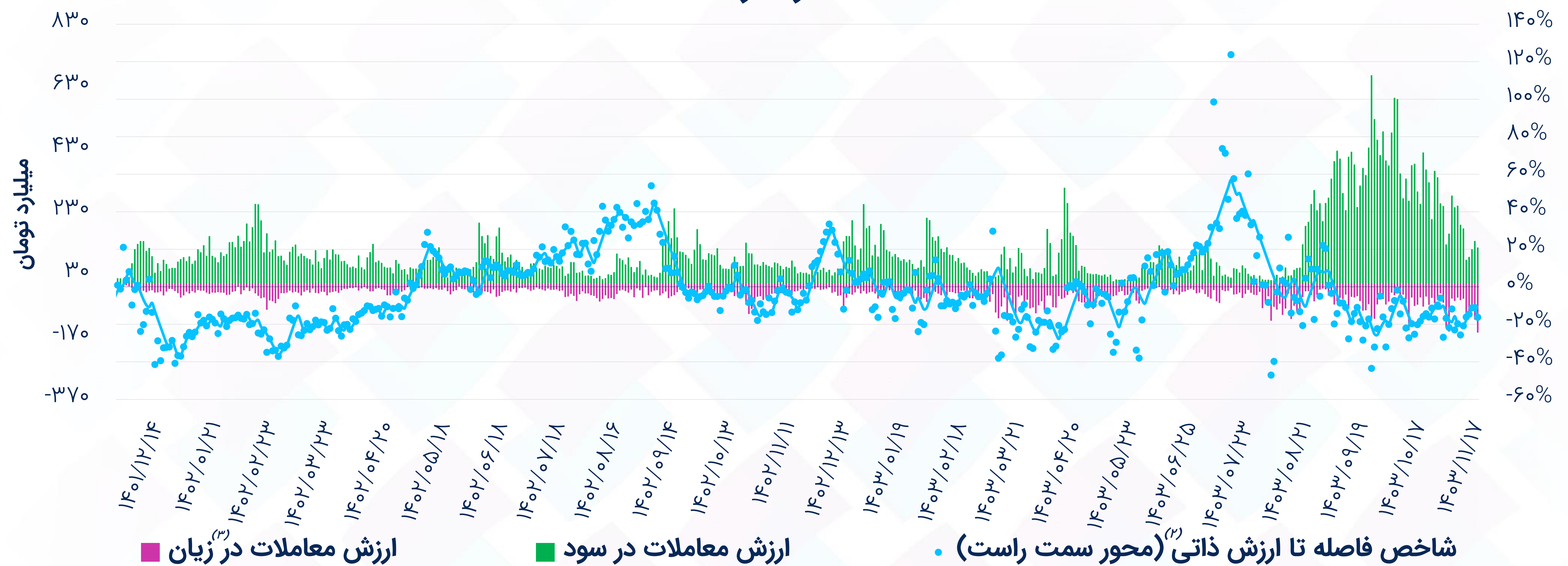
اختیار فروش



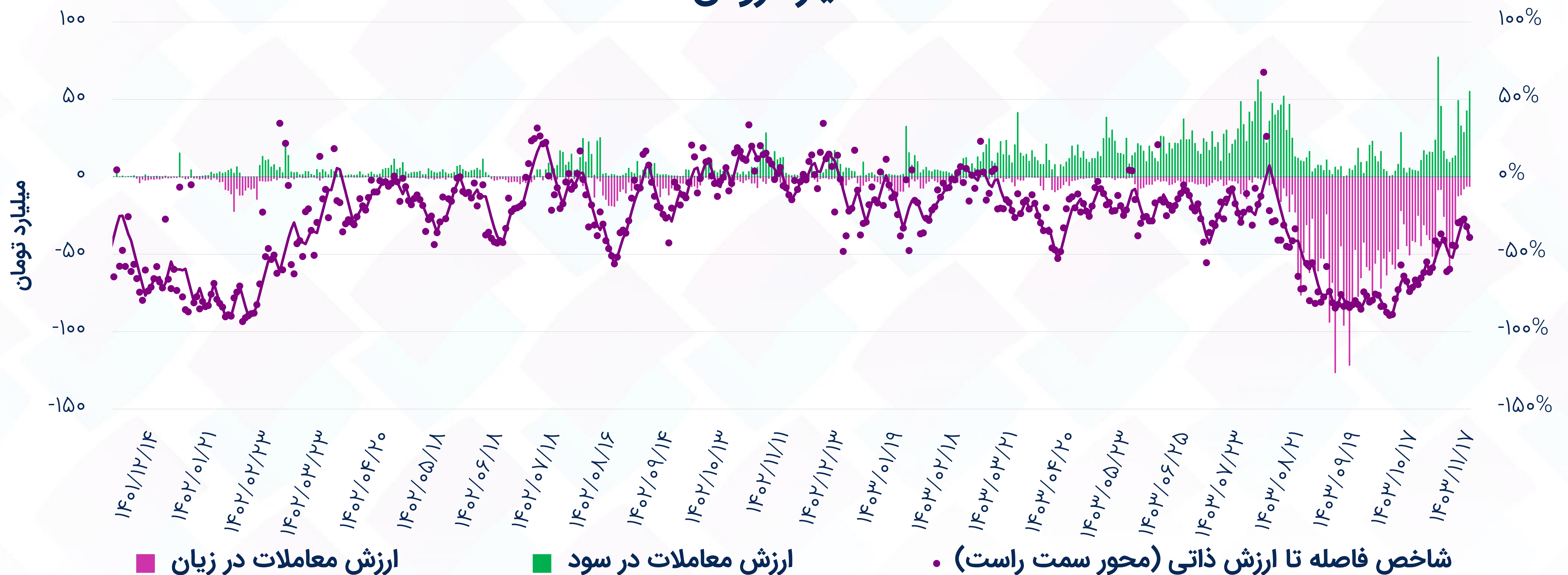
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۶	۲۱۱.۱	۵,۱۰۳.۹	۶۷.۵	۱۴۳.۶	(۱۸.۶%)
شستا	۳۷	۲۰.۶	۵۰۰.۱	۱۲.۸	۷.۷	(۱۸.۷%)
خسپا	۱۳	۹.۷	۲۶۷.۹	۸.۹	۰.۸	۸.۷%
فملی	۳	۶.۳	۲۳.۲	۶.۳	۰.۰	(۵.۶%)
وبملت	۲۳	۶.۱	۱۱۲.۷	۵.۱	۰.۹	(۱.۵%)
ذوب	۲۵	۵.۷	۹۴.۶	۳.۹	۱.۸	(۱۵.۱%)
شتاب	۱۷	۵.۰	۲۵.۲	۵.۰	۰.۰	(۰.۷%)

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	۱۸	۵۹,۹۱۵.۷	۲,۵۲۲,۶۰۰.۷	۵۵,۱۹۵.۱	۴,۷۲۰.۷	(۳۸.۵%)
شستا	۱۲	۱,۶۱۳.۹	۷۱,۸۷۰.۹	۰.۰	۱,۶۱۳.۸	(۶۵.۴%)
ذوب	۴	۱۰۹.۱	۲,۷۰۱.۸	۱۰۷.۴	۱.۷	(۱۷.۴%)
وبملت	۳	۱۸.۰	۷,۷۲۱.۵	۲.۶	۱۵.۴	(۷۲.۷%)
بیدار	۲	۱۳.۹	۲۲۹.۰	۰.۶	۱۳.۳	(۵۵.۵%)
خودران	۱	۱.۳	۱۰۳.۹	۰.۰	۱.۳	(۳۸.۴%)
توان	۳	۰.۸	۲۷.۲	۰.۵	۰.۳	(۲۱.۸%)

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

میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز



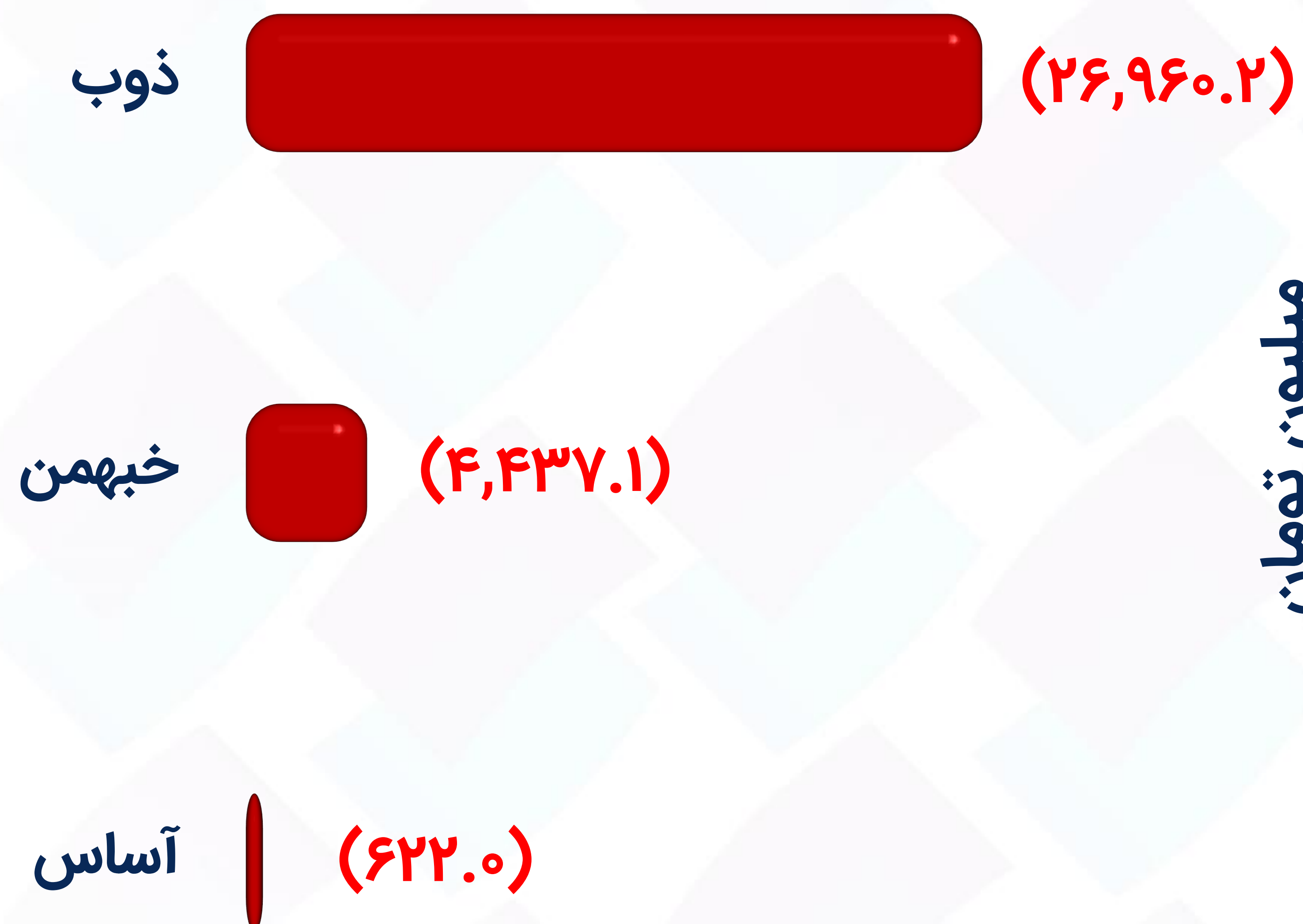
میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



(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
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۱۸	۱۰.۹	۳۷۵	۷,۵۷۰	۷,۴۵۳	(۱.۵%)	۱۹.۹	۰.۹۶	۶۱۲	۶۳%
ضفرز ۱۲۱۰	فزر	۴۸,۰۰۰	۲۵	۹۰.۲	۹۰۲	۴۶,۴۵۰	۴۸,۹۰۲	۵.۳%	۵۴.۲	۰.۴۷	۱,۳۳۸	۴۸%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۱۸	۸۰.۸	۷۳۵	۷,۵۷۰	۷,۳۹۷	(۲.۳%)	۱۰.۱	۱.۰۰	۱,۰۱۴	۳۸%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۱۸	۴۲.۳	۱,۰۸۷	۷,۵۷۰	۷,۳۳۳	(۳.۱%)	۶.۷	۱.۰۰	۱,۴۲۳	۳۱%
ضموچ ۱۱۰۵	موچ	۲۴,۰۰۰	۴	۲.۲	۴۷	۲۲,۶۶۱	۲۴,۰۴۷	۶.۱%	۵۱۱.۶	۰.۱۲	۶۰	۲۸%

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 ۱۱۳۴	دوب	۹۰۰	۷	۱.۳	۱	۴۷۷	۹۰۱	۸۹%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۲	دوب	۷۰۰	۷	۶.۷	۱	۴۷۷	۷۰۱	۴۷%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۵۹.۹	۱۷	۲۵,۸۷۰	۳۴,۰۱۷	۳۱%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۱۳۱	دوب	۶۰۰	۷	۱۱.۴	۱	۴۷۷	۶۰۱	۲۶%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۲۰۵	دوب	۷۰۰	۳۵	۴.۰	۷	۴۷۷	۷۰۷	۴۸%	۱۰۱.۰	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
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۷۴.۸	۸,۱۲۶	۲۵,۸۷۰	۲۵,۸۷۴	۰.۰%	۳.۲	-۱.۰۰	۷,۹۰۳	(۲.۷%)
طهرم ۱۱۱۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۷	۱,۸۳۴.۳	۴,۱۷۲	۲۵,۸۷۰	۲۵,۸۲۸	(۰.۲%)	۶.۲	-۱.۰۰	۳,۹۳۱	(۵.۸%)
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۷	۲,۰۰۴.۶	۲,۱۷۱	۲۵,۸۷۰	۲۵,۸۲۹	(۰.۲%)	۱۱.۹	-۰.۹۲	۱,۹۹۳	(۸.۲%)
طذوب ۱۱۳۰	ذوب	۵۰۰	۷	۱۰۴.۷	۲۷	۴۷۷	۴۷۳	(۰.۸%)	۱۷.۵	-۰.۷۸	۲۳	(۱۵.۷%)
طهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۵	۱.۸	۹,۰۰۰	۲۵,۸۷۰	۲۵,۰۰۰	(۳.۴%)	۲.۸	-۰.۹۸	۷,۰۳۵	(۲۱.۸%)

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	۷	۱.۲	۱۱	۲۵,۸۷۰	۱۷,۹۸۹	(۳۰.۵%)	۱,۶۳۵.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۱۱۲۹	ذوب	۴۰۰	۷	۱.۷	۱	۴۷۷	۳۹۹	(۱۶.۴%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۱۱۰۸	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷	۴.۶	۱۰	۲۵,۸۷۰	۲۱,۹۹۰	(۱۵.۰%)	۲,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۴%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۲۱	۱.۴	۴	۱,۳۵۳	۱,۱۴۶	(۱۵.۳%)	۲۸۶.۵	۰.۰۰	۰	(۹۸.۰%)
طستا ۱۲۲۸	شستا	۱,۲۵۰	۲۱	۴۴۵.۸	۱۴	۱,۳۵۳	۱,۲۳۶	(۸.۶%)	۸۸.۳	-۰.۰۶	۳	(۸۱.۱%)

(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

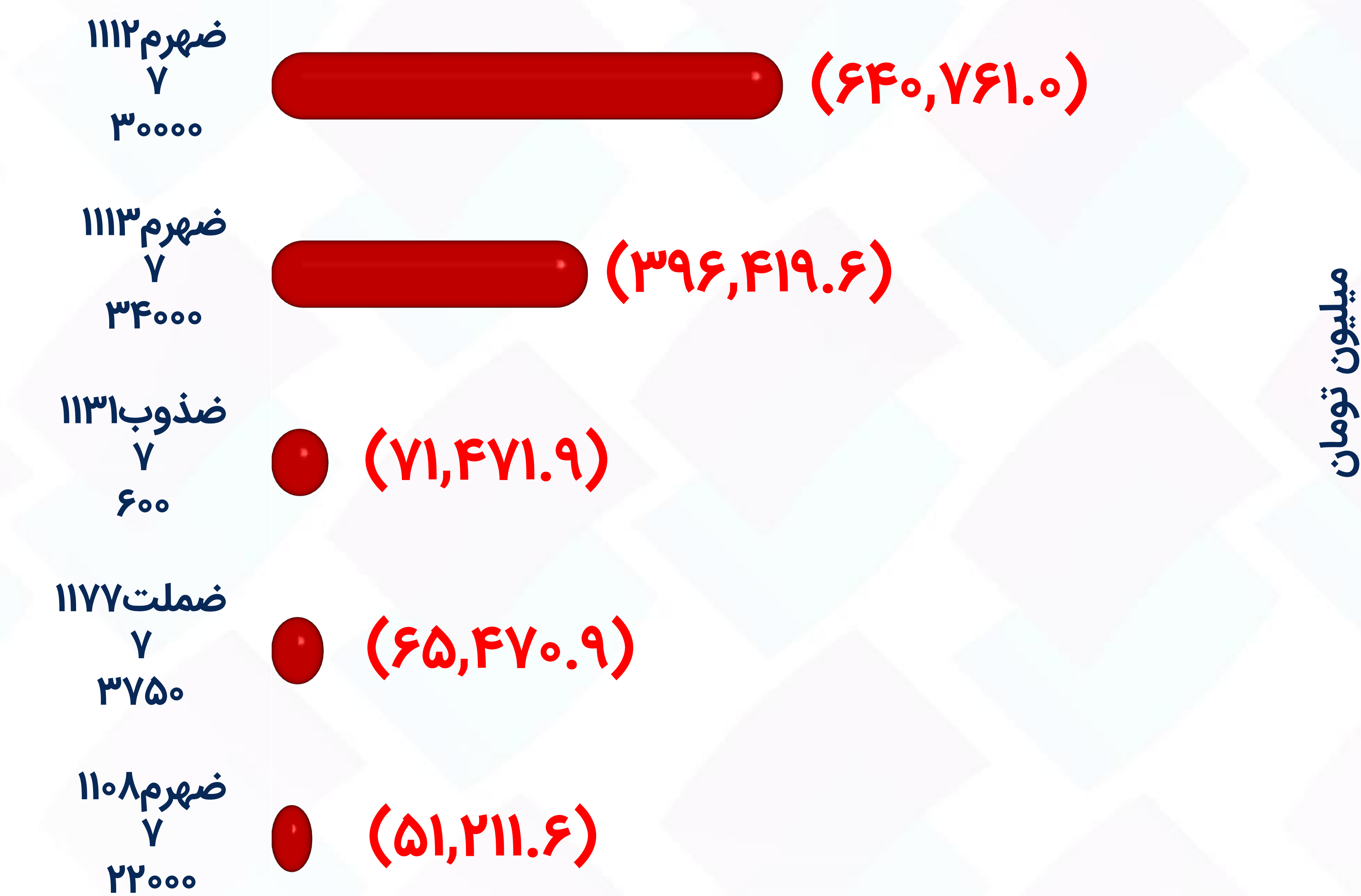
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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



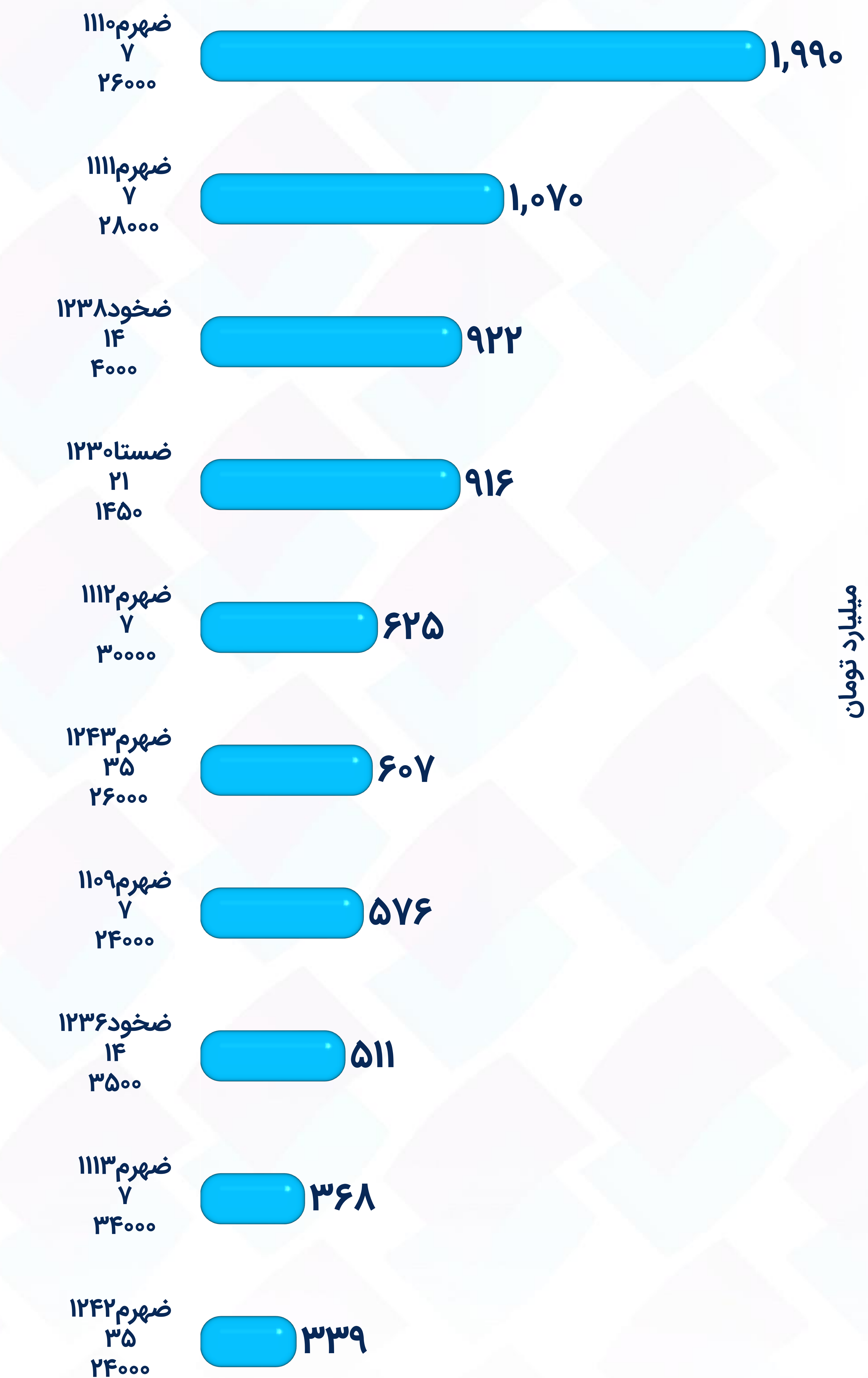
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



ارزش موقعیت‌های باز

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



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)

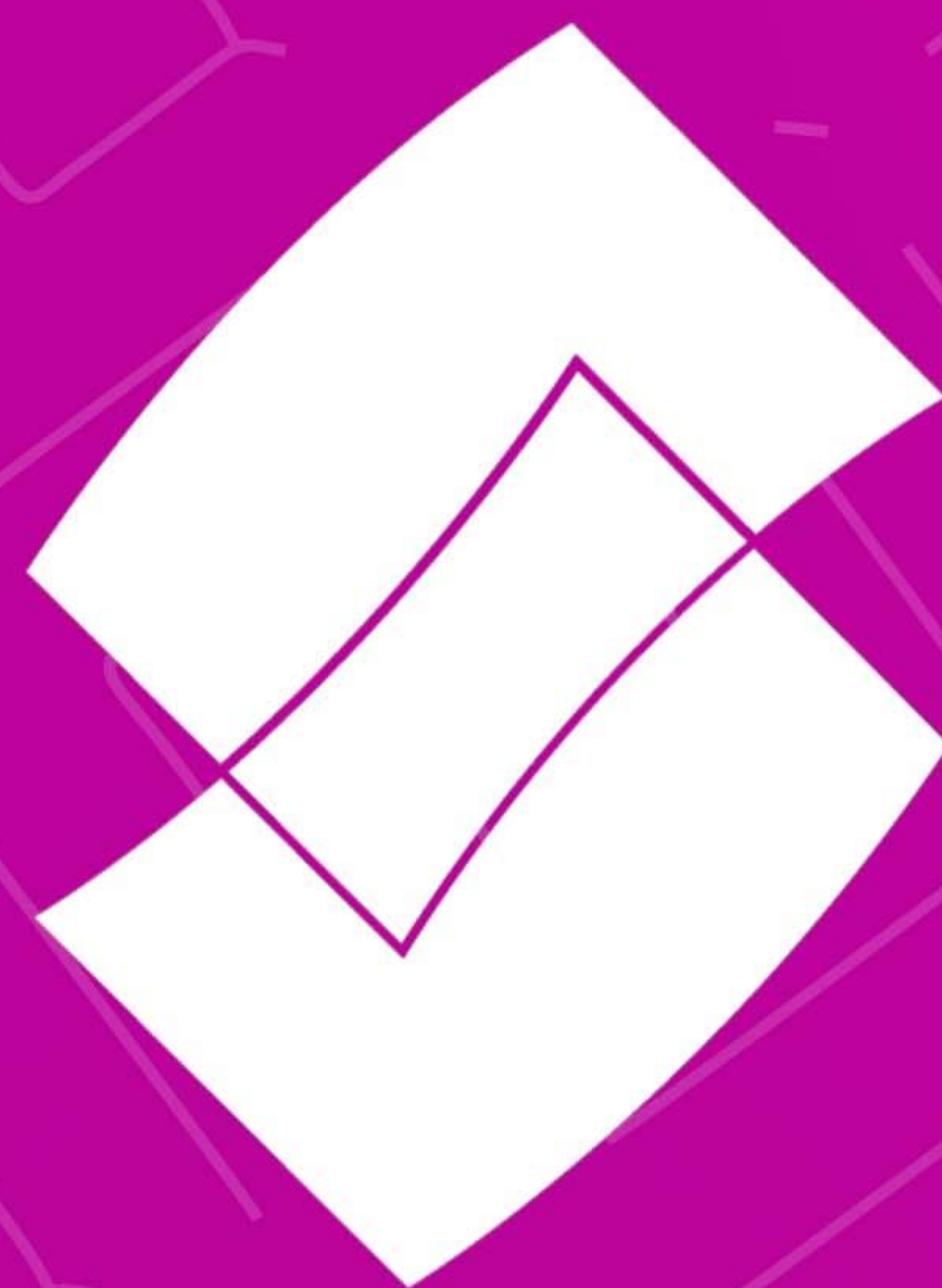
اختیار خرید



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.