

شماره
۴۲۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





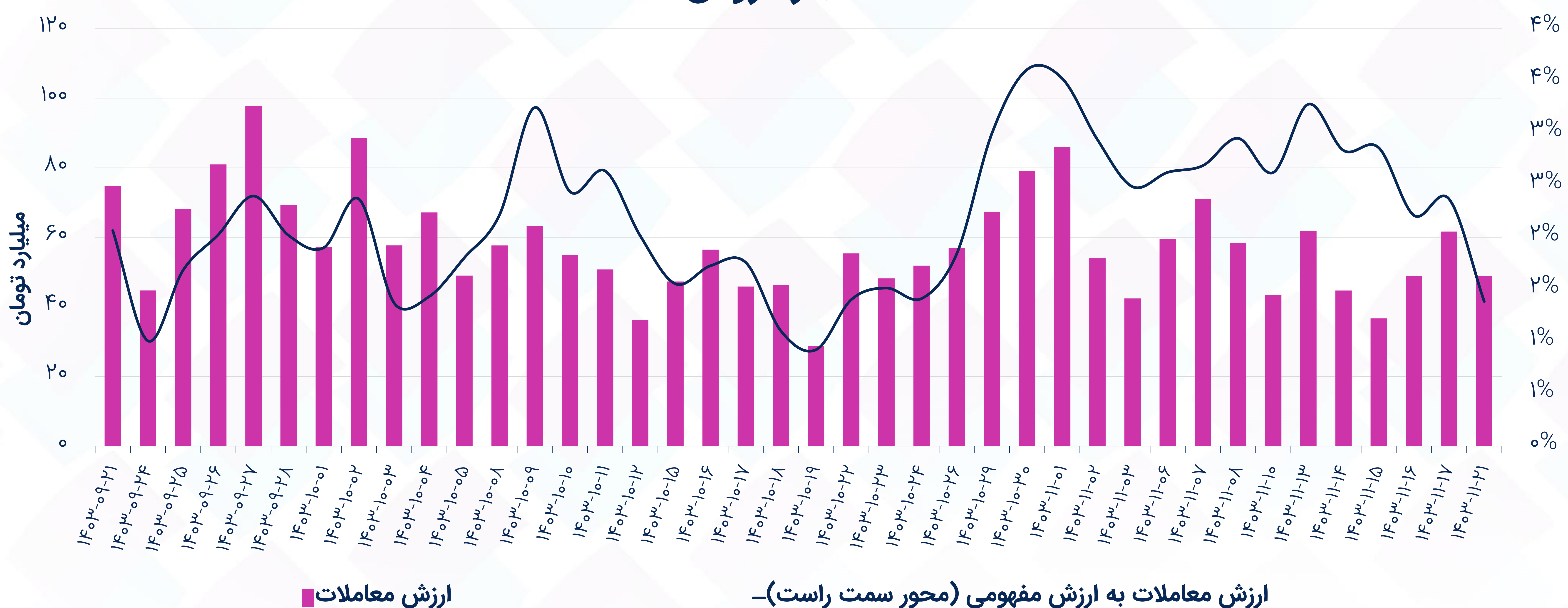
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



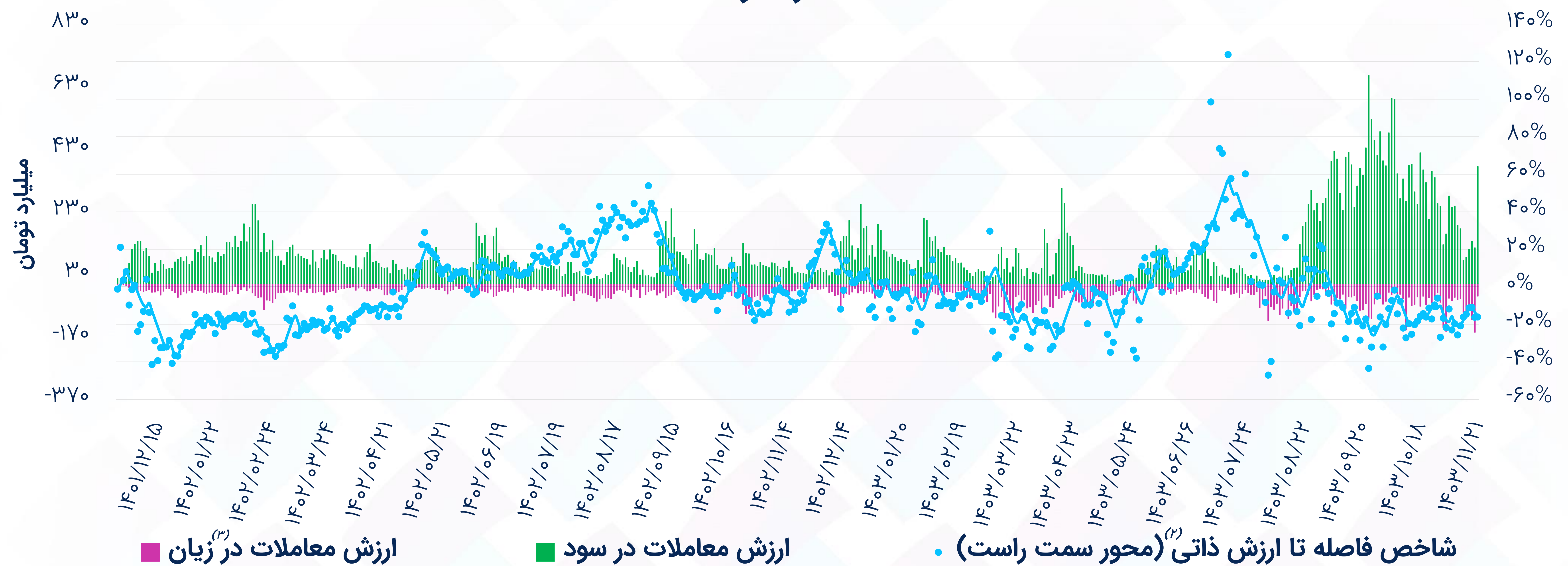
اختیار فروش



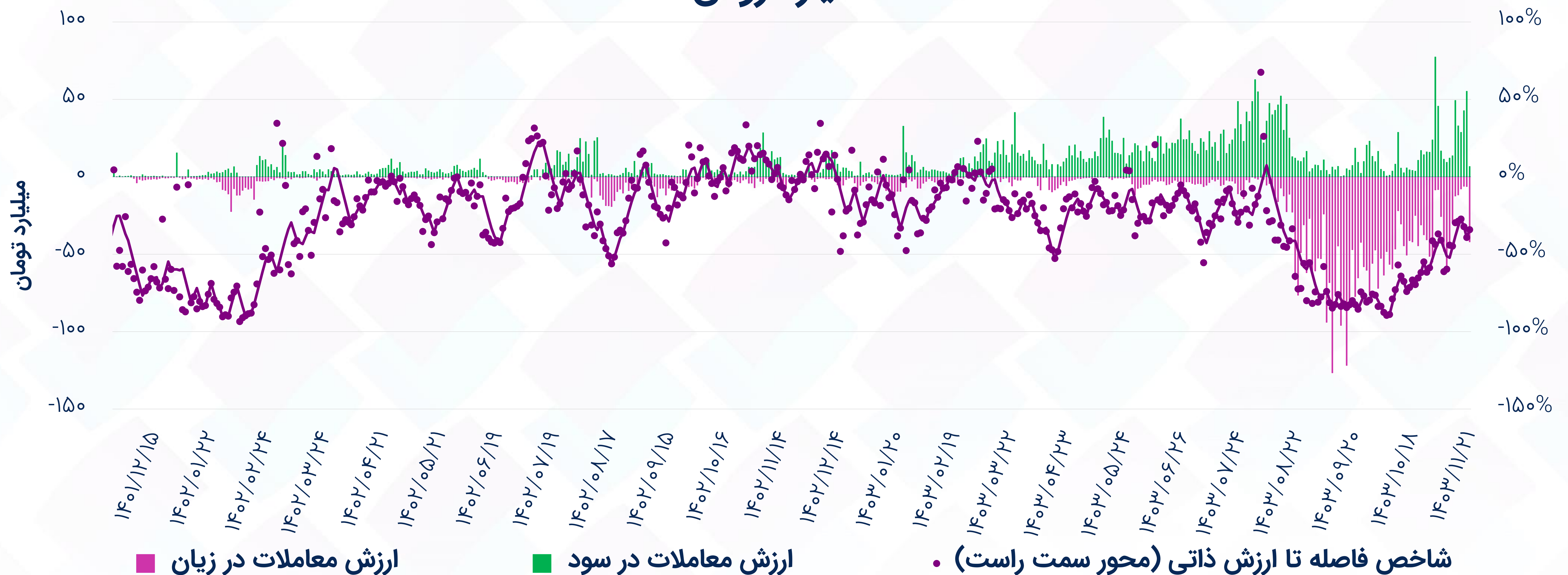
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۸	۲۷۲.۵	۴,۴۰۸.۱	۲۵۶.۸	۱۵.۷	(۱۷.۶%)
خودرو	۳۱	۵۶.۷	۱,۱۳۹.۴	۵۲.۲	۴.۵	(۱۹.۷%)
شستا	۴۴	۲۸.۲	۵۵۵.۹	۱۵.۵	۱۲.۷	(۲۳.۱%)
وبملت	۲۰	۱۵.۴	۳۱۹.۷	۱۳.۰	۲.۴	(۴.۹%)
خسپا	۲۰	۱۳.۵	۲۵۹.۳	۱۲.۴	۱.۱	۶.۴%
ذوب	۲۷	۱۲.۲	۲۰۸.۷	۹.۸	۲.۵	(۵.۲%)
شتاب	۱۱	۶.۲	۲۲.۰	۵.۶	۰.۶	(۰.۳%)

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	۱۶	۴۰,۰۸۲.۱	۲,۷۳۳,۱۵۹.۶	۶,۲۱۳.۹	۳۳,۸۶۸.۲	(۳۳.۷%)
خودرو	۵	۶,۰۰۹.۲	۵۹۹,۶۰۸.۲	۲۰۳.۳	۵,۸۰۵.۹	(۲۶.۳%)
شستا	۹	۲,۳۷۲.۴	۱۶۵,۷۱۰.۸	۰.۷	۲,۳۷۱.۸	(۶۳.۵%)
ذوب	۶	۲۷۱.۲	۴,۶۳۷.۳	۲۷۱.۰	۰.۲	(۱۷.۳%)
وبملت	۴	۳۶.۰	۱۷,۳۵۲.۶	۷.۱	۲۸.۹	(۶۸.۱%)
توان	۳	۱۴.۹	۵۶۱.۶	۸.۹	۵.۹	(۲۹.۱%)
خودران	۲	۱۴.۳	۴۳۰.۷	۱۴.۱	۰.۳	(۳.۰%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

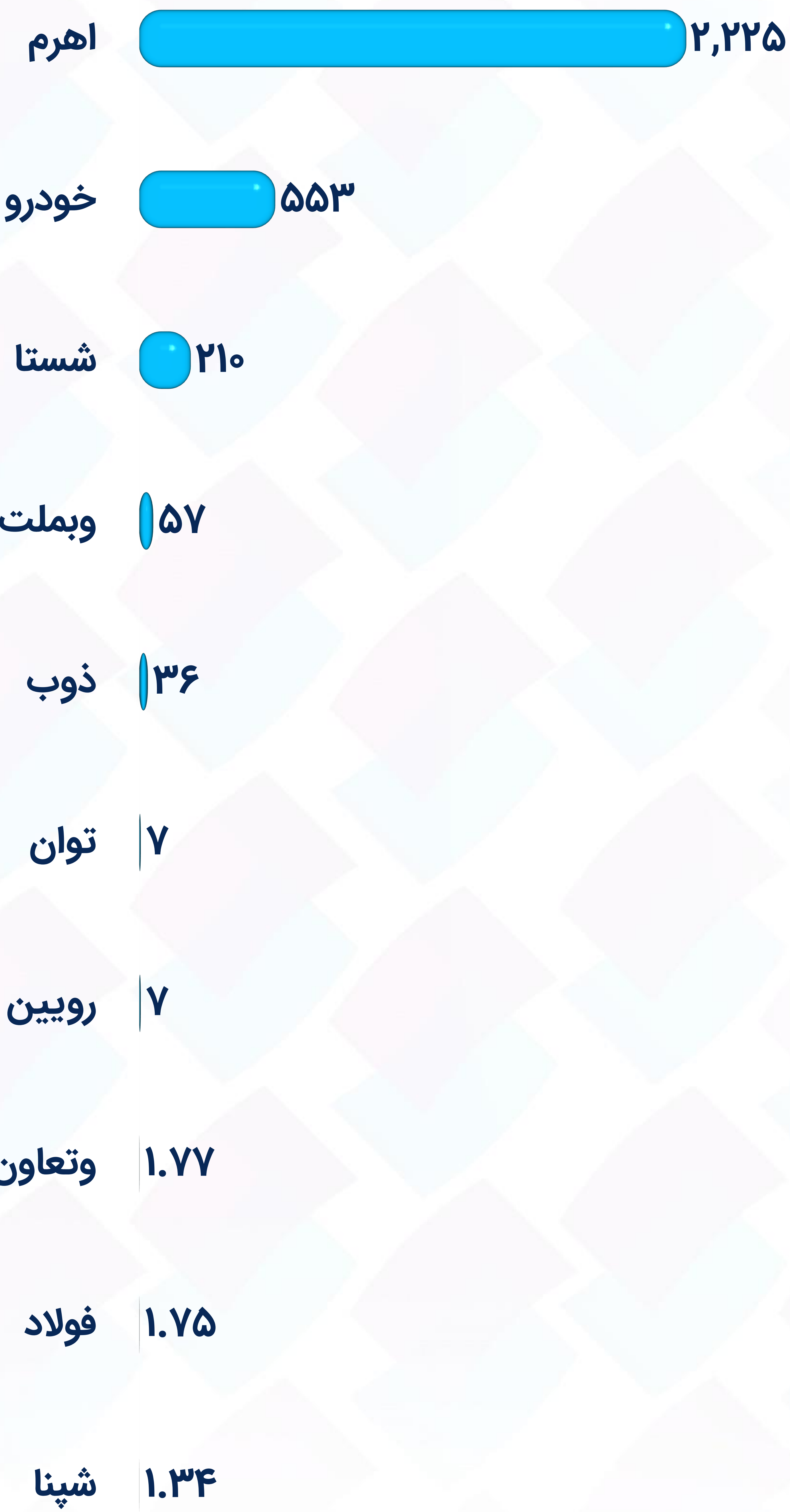


میلیارد تومان

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

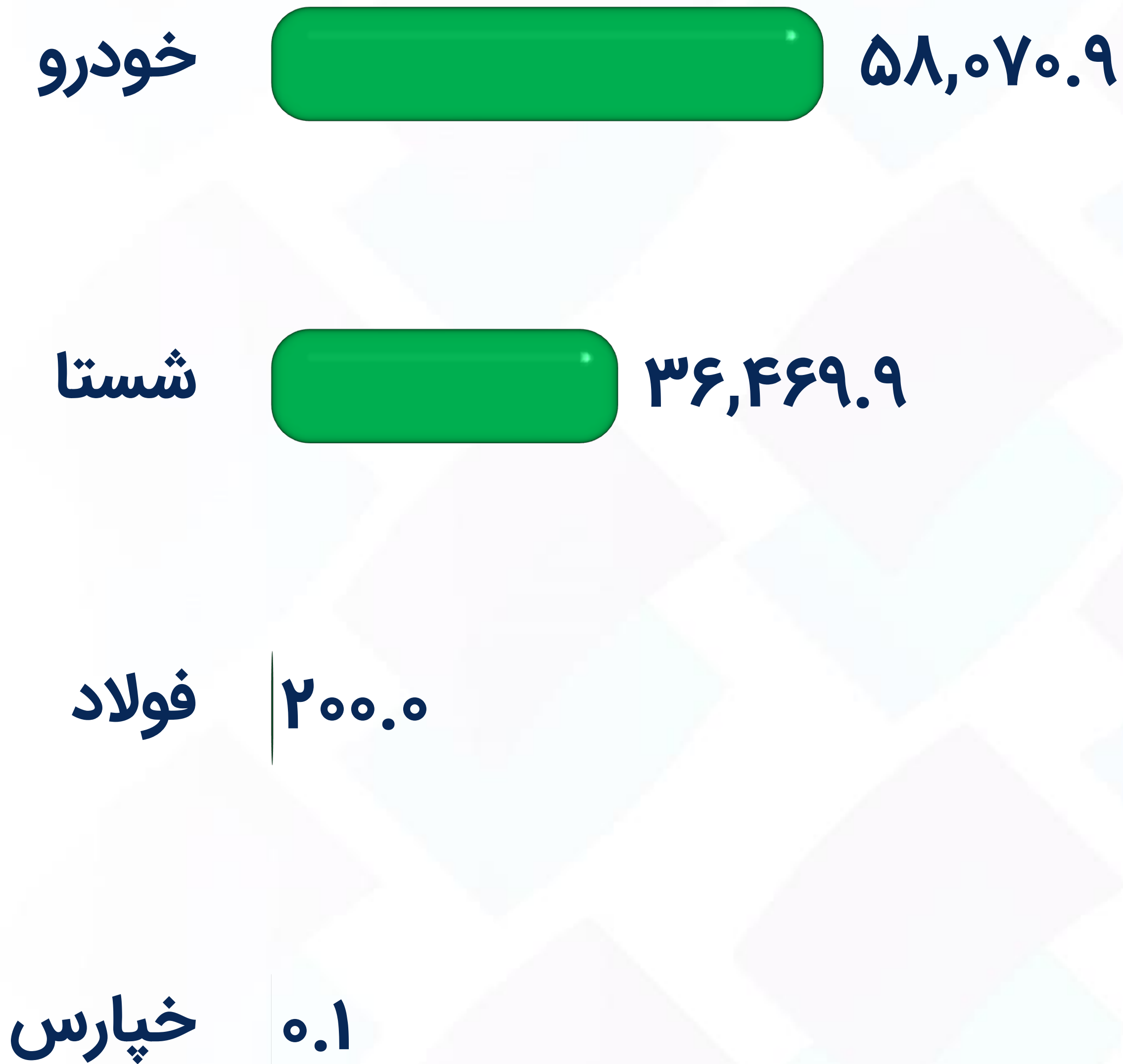
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

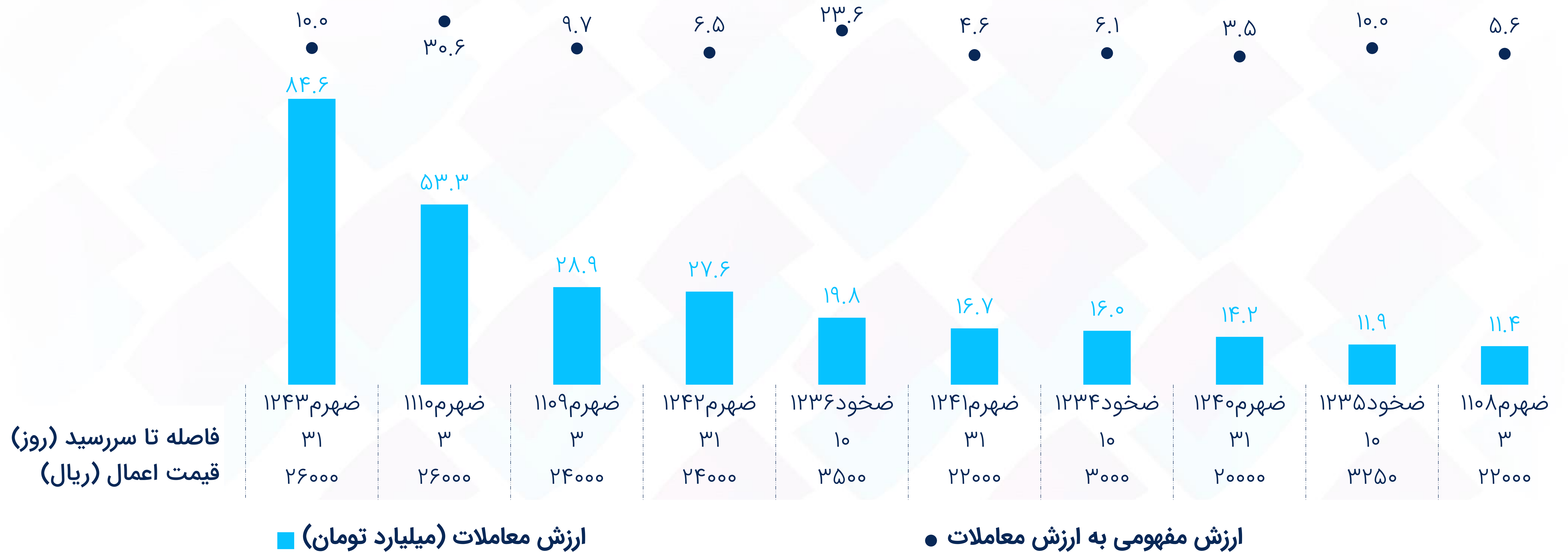
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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 ۱۲۱۱	بساما	۷,۵۷۸	۱۴	۱۷.۱	۱۰۴	۷,۶۹۰	۷,۶۸۲	(۰.۱%)	۷۳.۹	۰.۷۴	۲۶۹	۱۵۹%
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۱۴	۱۳۳.۰	۳۶۱	۷,۶۹۰	۷,۴۳۹	(۳.۳%)	۲۰.۶	۰.۹۹	۷۱۰	۹۷%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۱۴	۹۲.۰	۶۸۳	۷,۶۹۰	۷,۳۴۵	(۴.۵%)	۱۰.۸	۱.۰۰	۱,۱۱۹	۶۴%
ضبساما ۱۲۰۸	بساما	۶,۲۴۶	۱۴	۲۸.۲	۹۸۶	۷,۶۹۰	۷,۲۳۲	(۶.۰%)	۷.۳	۱.۰۰	۱,۵۲۹	۵۵%
ضبساما ۱۲۰۷	بساما	۵,۸۲۹	۱۴	۶۹.۴	۱,۳۰۷	۷,۶۹۰	۷,۱۳۶	(۷.۲%)	۵.۵	۱.۰۰	۱,۹۴۰	۴۸%

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
ضذب ۱۱۳۳	ذوب	۸۰۰	۳	۳.۰	۱	۴۸۴	۸۰۱	۶۵%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۳۴.۰	۷	۲۶,۴۷۰	۳۴,۰۰۷	۲۸%	۴,۸۵۸.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۱۰	۸.۳	۵	۳,۵۱۵	۵,۰۰۵	۴۲%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۳	۱۱.۹	۱	۴۸۴	۶۰۱	۲۴%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضملت ۱۱۷۷	وبملت	۳,۷۵۰	۳	۳۱.۷	۱	۳,۱۷۵	۳,۷۵۱	۱۸%	۳,۷۵۱.۰	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 ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۶۶	۱۵۰	۲۶,۴۷۰	۲۶,۴۷۰	۲۹,۸۵۰	۱۲.۸%	۱۹۹.۰	-۰.۶۵	۲,۷۲۹	۱۷۱۹.۳%
طهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۱	۹.۶	۵,۶۲۴	۲۶,۴۷۰	۲۸,۳۷۶	۷.۲%	۵.۰	-۰.۹۷	۶,۵۰۴	۱۵.۶%
طذوب ۱۱۳۱	ذوب	۶۰۰	۳	۷۰.۴	۱۰۱	۴۸۴	۴۹۹	۳.۱%	۴.۹	-۱.۰۰	۱۱۴	۱۲.۴%
طهرم ۱۱۱۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳	۲,۸۶۹.۲	۱,۳۴۵	۲۶,۴۷۰	۲۶,۶۵۵	۰.۷%	۱۹.۸	-۰.۹۰	۱,۴۶۴	۸.۸%
طهرم ۱۱۱۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۲۸۷.۹	۷,۰۷۴	۲۶,۴۷۰	۲۶,۹۲۶	۱.۷%	۳.۸	-۱.۰۰	۷,۳۹۰	۴.۵%

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	۳	۲.۲	۶	۲۶,۴۷۰	۱۷,۹۹۴	(۳۲.۰%)	۲,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳	۱.۲	۴	۲۶,۴۷۰	۱۹,۹۹۶	(۲۴.۵%)	۴,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۰۸	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳	۱۲.۲	۵	۲۶,۴۷۰	۲۱,۹۹۵	(۱۶.۹%)	۴,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۱۱۷۳	وبملت	۲,۸۰۰	۳	۱.۸	۲	۳,۱۷۵	۲,۷۹۸	(۱۱.۹%)	۱,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طخود ۱۲۳۴	خودرو	۳,۰۰۰	۱۰	۷۹.۳	۴	۳,۵۱۵	۲,۹۹۶	(۱۴.۸%)	۷۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۲%)

(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)



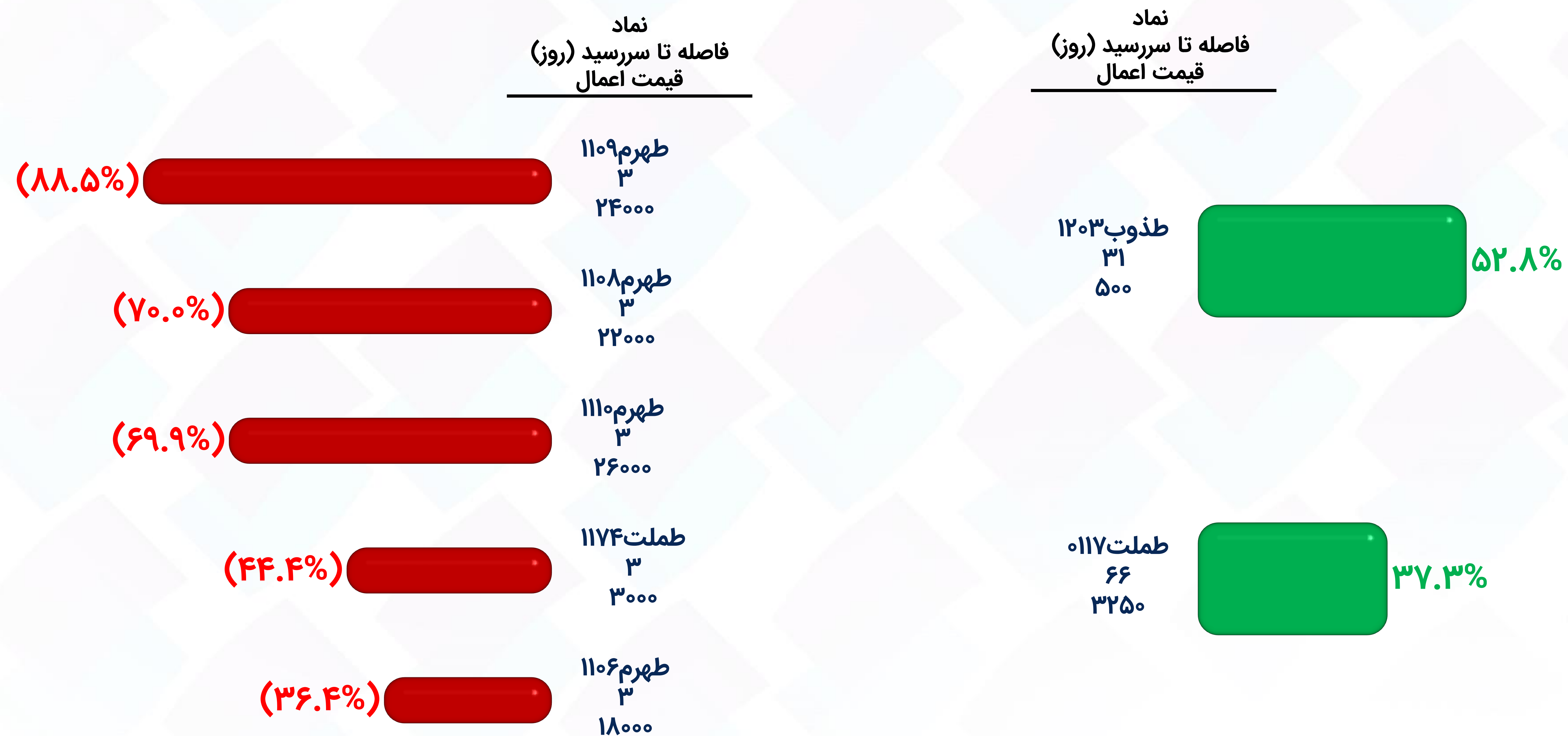
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

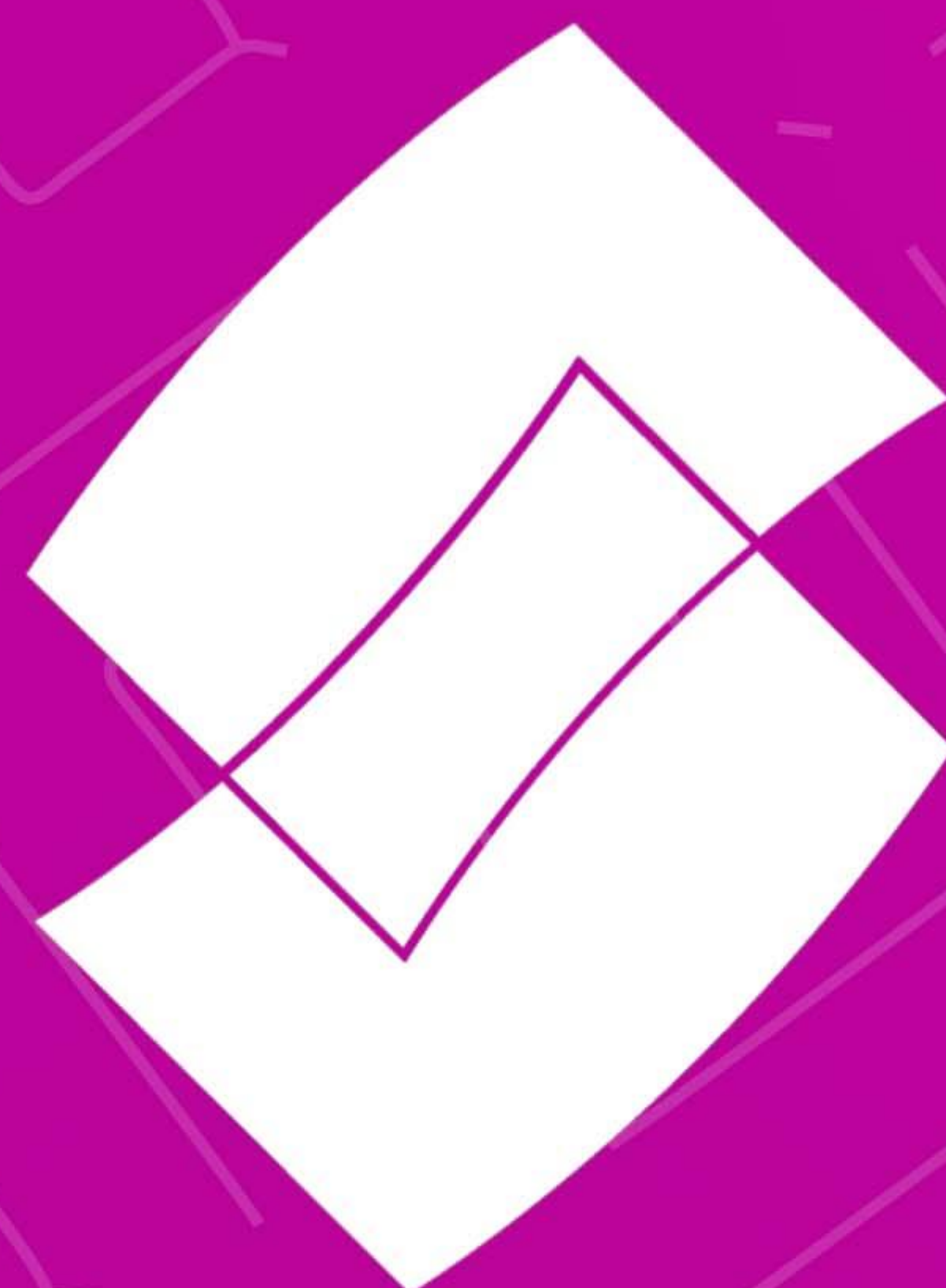
اختیار خرید



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.