

شماره
۴۲۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۷ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





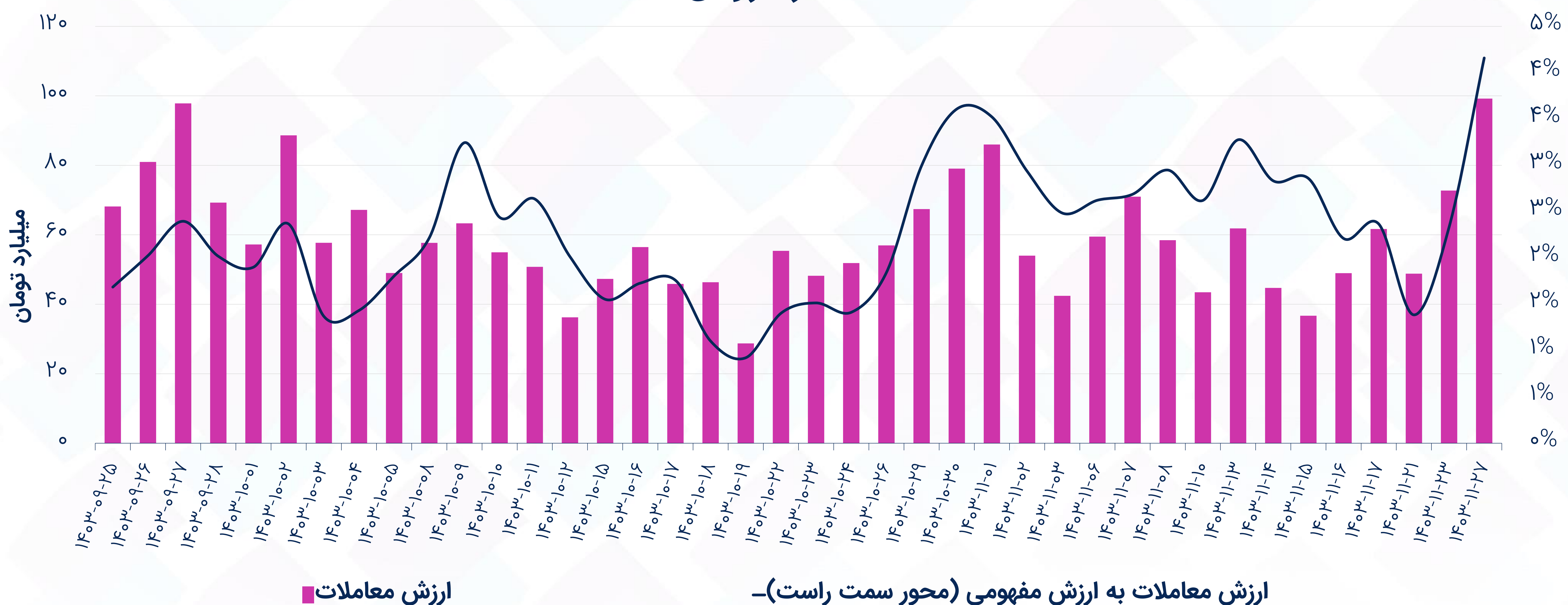
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



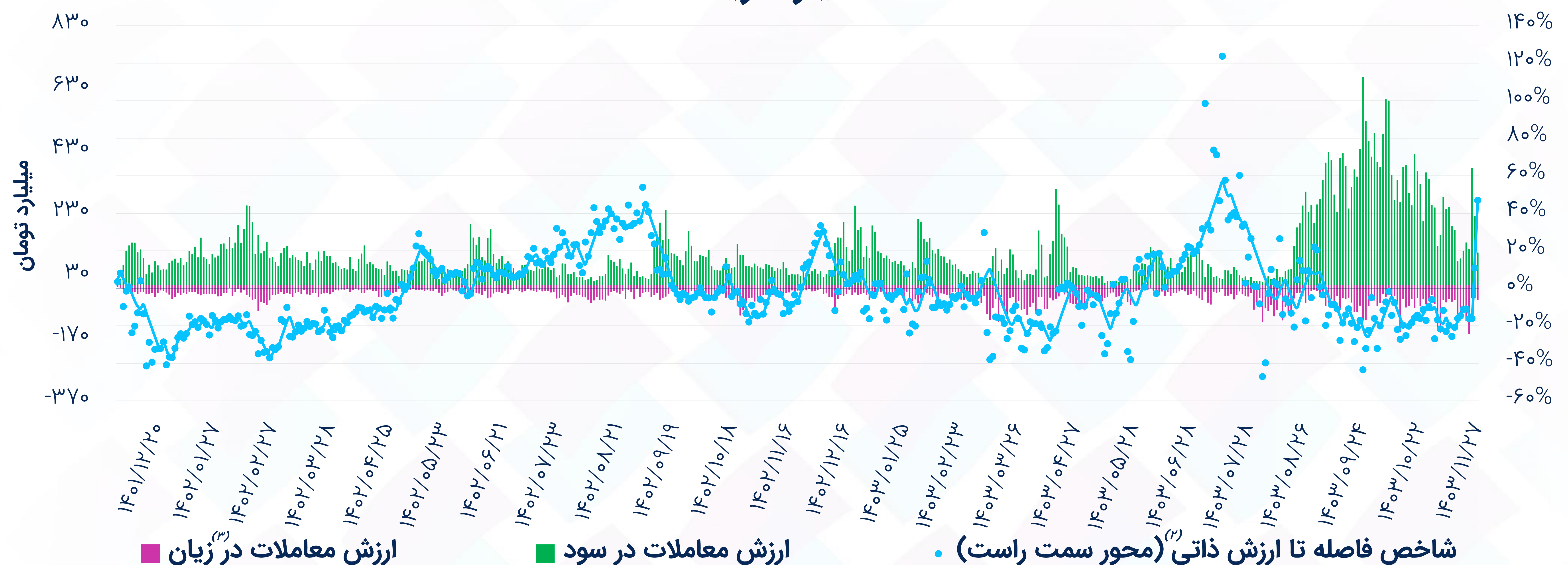
اختیار فروش



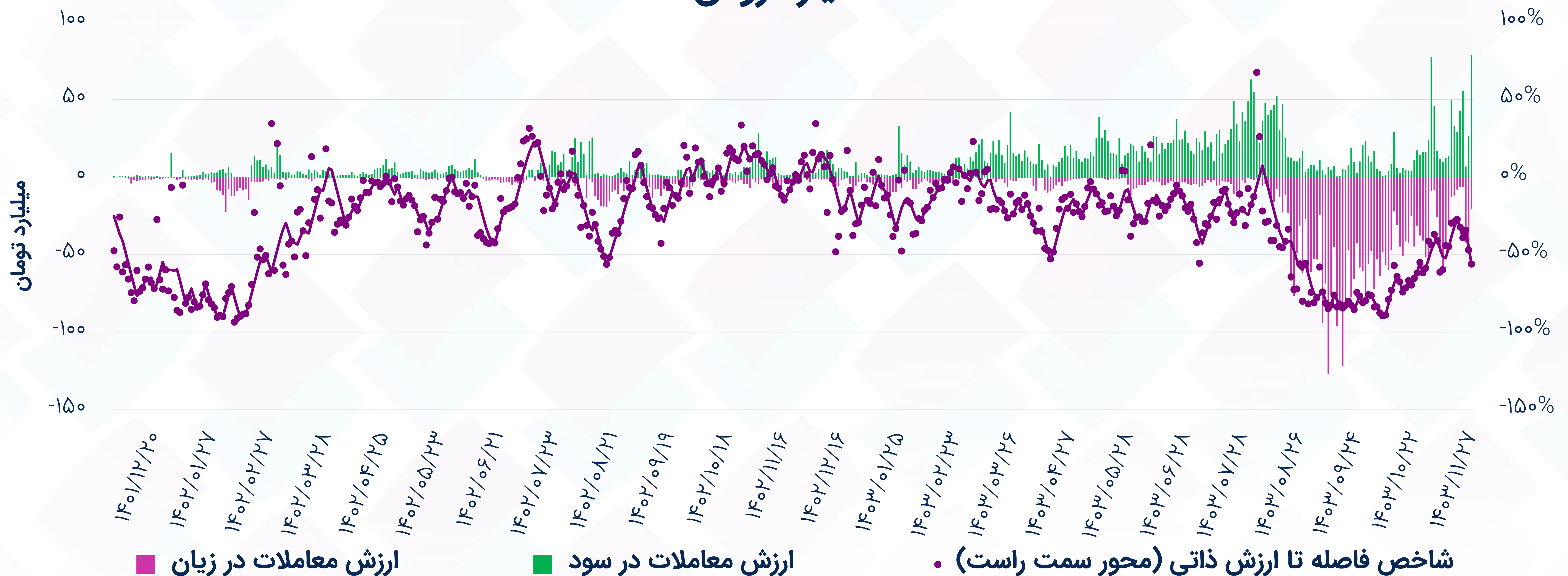
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۴	۸۲.۹	۴,۵۱۷.۶	۵۰.۴	۳۲.۵	۵۷.۶%
خودرو	۳۳	۲۱.۰	۱,۶۶۲.۱	۱۷.۷	۳.۳	۶۹.۳%
وبملت	۲۴	۱۶.۵	۳۹۸.۶	۱۳.۱	۳.۳	۲۳.۷%
ذوب	۲۶	۱۱.۷	۱۵۰.۳	۱۰.۳	۱.۵	۴۰.۷%
شستا	۴۱	۹.۳	۵۴۹.۴	۴.۳	۵.۱	(۱۸.۶%)
سامان	۳	۱.۷	۵.۰	۱.۷	۰.۰	(۲۵.۷%)
خسپا	۱۷	۱.۶	۹۱.۶	۱.۵	۰.۱	۴۱.۶%

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	۷۹,۳۶۴.۶	۱,۵۸۲,۵۹۱.۷	۶۷,۲۱۸.۵	۱۲,۱۴۶.۲	(۵۵.۴%)
خودرو	۶	۱۲,۶۰۶.۶	۵۷۲,۵۹۱.۷	۶,۵۶۵.۷	۶,۰۴۱.۰	(۵۹.۷%)
شستا	۱۳	۵,۶۸۲.۹	۱۹۰,۴۳۷.۷	۳,۳۲۸.۵	۲,۳۵۴.۴	(۵۹.۵%)
وبملت	۵	۷۹۸.۴	۳۴,۶۱۹.۴	۷۹۷.۰	۱.۴	(۶۵.۲%)
ذوب	۷	۷۴۳.۴	۴,۶۸۶.۴	۷۴۳.۱	۰.۳	(۳۸.۰%)
خودران	۳	۱۴.۷	۲۵۱.۸	۷.۵	۷.۲	(۳۹.۵%)
توان	۲	۱۲.۱	۲۵۳.۶	۰.۰	۱۲.۱	(۵۰.۰%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۴۵,۸۰۶

شستا ۶۰,۱۹۸

وبملت ۵۱,۵۰۶

ذوب ۳۱,۲۲۲

موج ۶,۳۹۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۱۵۱,۷۵۷.۳)

فولاد (۱۹,۰۴۱.۲)

شپنا (۵,۹۵۱.۷)

خبهمن (۵,۱۹۸.۴)

خودران (۸۸۰.۵)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۵,۱۰۲

خودرو ۲,۷۱۹

شستا ۲,۳۲۹

ذوب ۹۶۹

وبملت ۸۳۲

خسپا ۳۷۸

آساس ۲۹۷

فولاد ۲۵۰

توان ۲۰۶

بساما ۱۶۶

میلیارد تومان

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

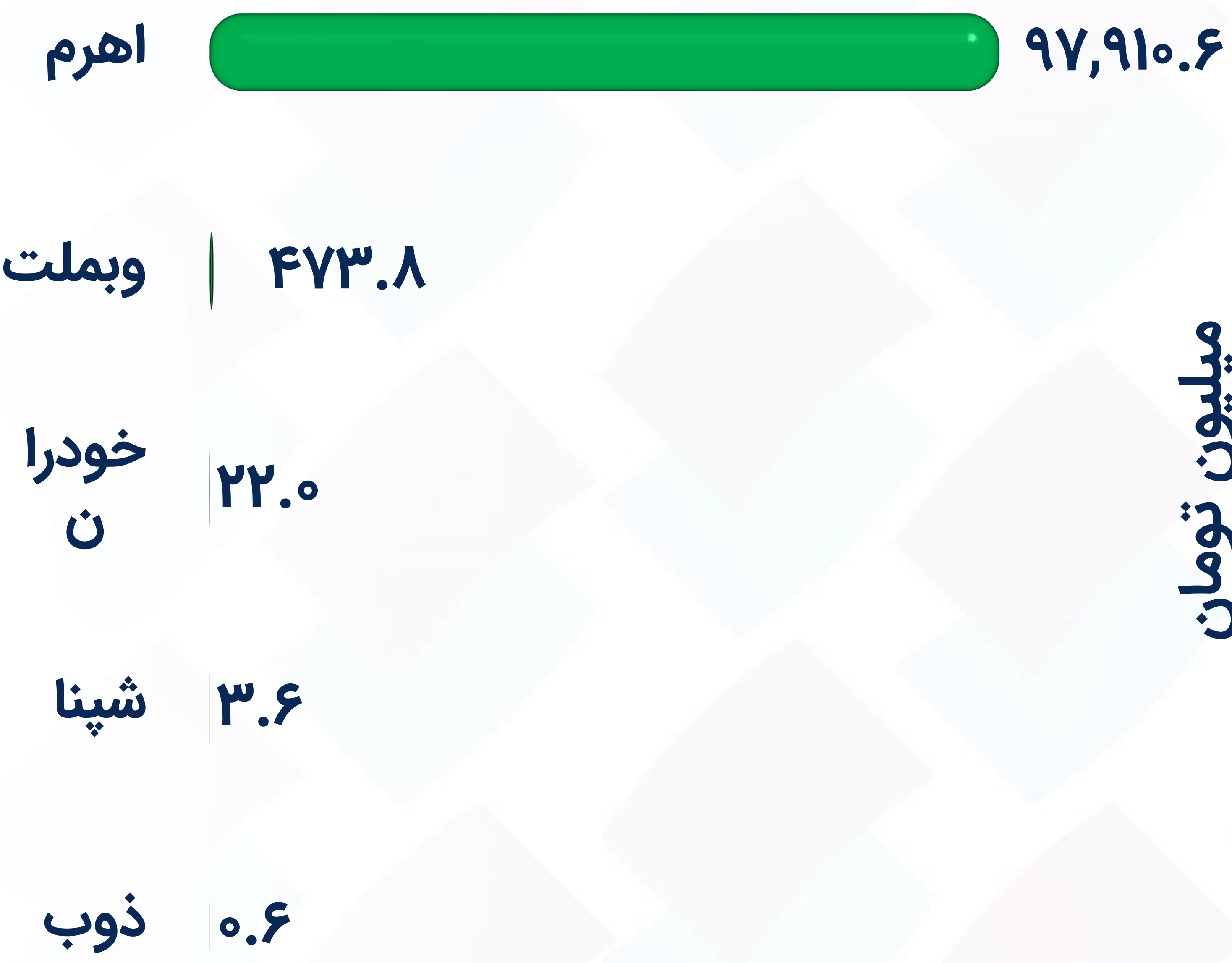
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

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	۸	۴.۹	۱۰۰	۷,۹۵۰	۷,۶۷۸	(۳.۴%)	۷۶.۸	۰.۹۴	۴۵۴	۳۵۴%
ضخاور ۱۲۰۶	خاور	۱,۶۰۰	۲۲	۱.۲	۳	۱,۴۱۳	۱,۶۰۳	۱۳.۴%	۵۳۴.۳	۰.۱۵	۱۰	۲۳۷%
ضخود ۱۲۳۵	خودرو	۳,۲۵۰	۴	۵,۹۳۰.۲	۶۵	۳,۳۷۷	۳,۳۱۵	(۱.۸%)	۵۱.۰	۰.۸۴	۱۶۳	۱۵۱%
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۸	۱۰۴.۱	۴۲۱	۷,۹۵۰	۷,۴۹۹	(۵.۷%)	۱۷.۸	۱.۰۰	۹۴۱	۱۲۴%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۸	۱۳۰.۹	۶۱۴	۷,۹۵۰	۷,۲۷۶	(۸.۵%)	۱۱.۹	۱.۰۰	۱,۳۵۳	۱۲۰%

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
ضخود ۱۲۴۰	خودرو	۵,۰۰۰	۴	۶.۸	۲	۳,۳۷۷	۵,۰۰۲	۴۸%	۲,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۳۹	خودرو	۴,۵۰۰	۴	۴.۷	۲	۳,۳۷۷	۴,۵۰۲	۳۳%	۲,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۲۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۵	۳.۱	۲	۴۵۷	۸۰۲	۷۵%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۵	۸.۰	۵	۴۵۷	۷۰۵	۵۴%	۱۴۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۲۳۲	شستا	۱,۶۵۰	۱۱	۲۵.۵	۲	۱,۳۰۵	۱,۶۵۲	۲۷%	۸۲۶.۰	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
طخود ۱۲۳۸	خودرو	۴,۰۰۰	۴	۳۱.۴	۷۲۱	۳,۳۷۷	۳,۲۷۹	(۲.۹%)	۴.۵	-۱.۰۰	۵۹۵	(۱۷.۵%)
طخود ۱۲۳۷	خودرو	۳,۷۵۰	۴	۴۵۲.۹	۴۵۰	۳,۳۷۷	۳,۳۰۰	(۲.۳%)	۷.۳	-۰.۹۸	۳۴۸	(۲۲.۷%)
طملت ۰۱۱۶	وبملت	۳,۰۰۰	۶۰	۱۶.۴	۱۰۲	۲,۹۹۲	۲,۸۹۸	(۳.۱%)	۲۸.۴	-۰.۳۱	۷۷	(۲۴.۷%)
طستا ۱۲۳۰	شستا	۱,۴۵۰	۱۱	۹.۷	۱۸۲	۱,۳۰۵	۱,۲۶۸	(۲.۸%)	۷.۰	-۰.۹۵	۱۲۶	(۳۰.۶%)
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۳,۲۵۰	۶۰	۱۸.۹	۳۰۹	۲,۹۹۲	۲,۹۴۱	(۱.۷%)	۹.۵	-۰.۵۷	۱۹۳	(۳۷.۵%)

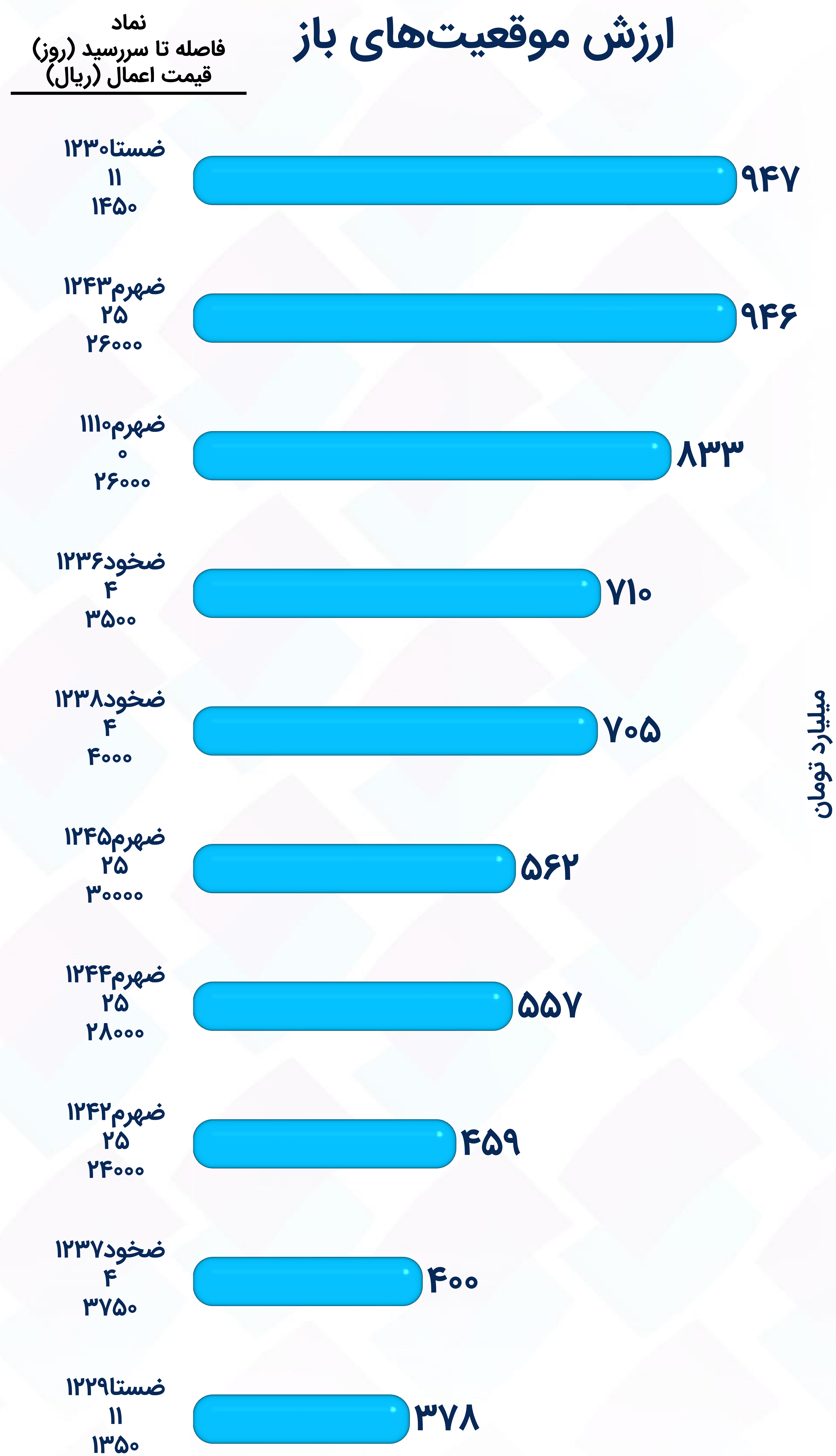
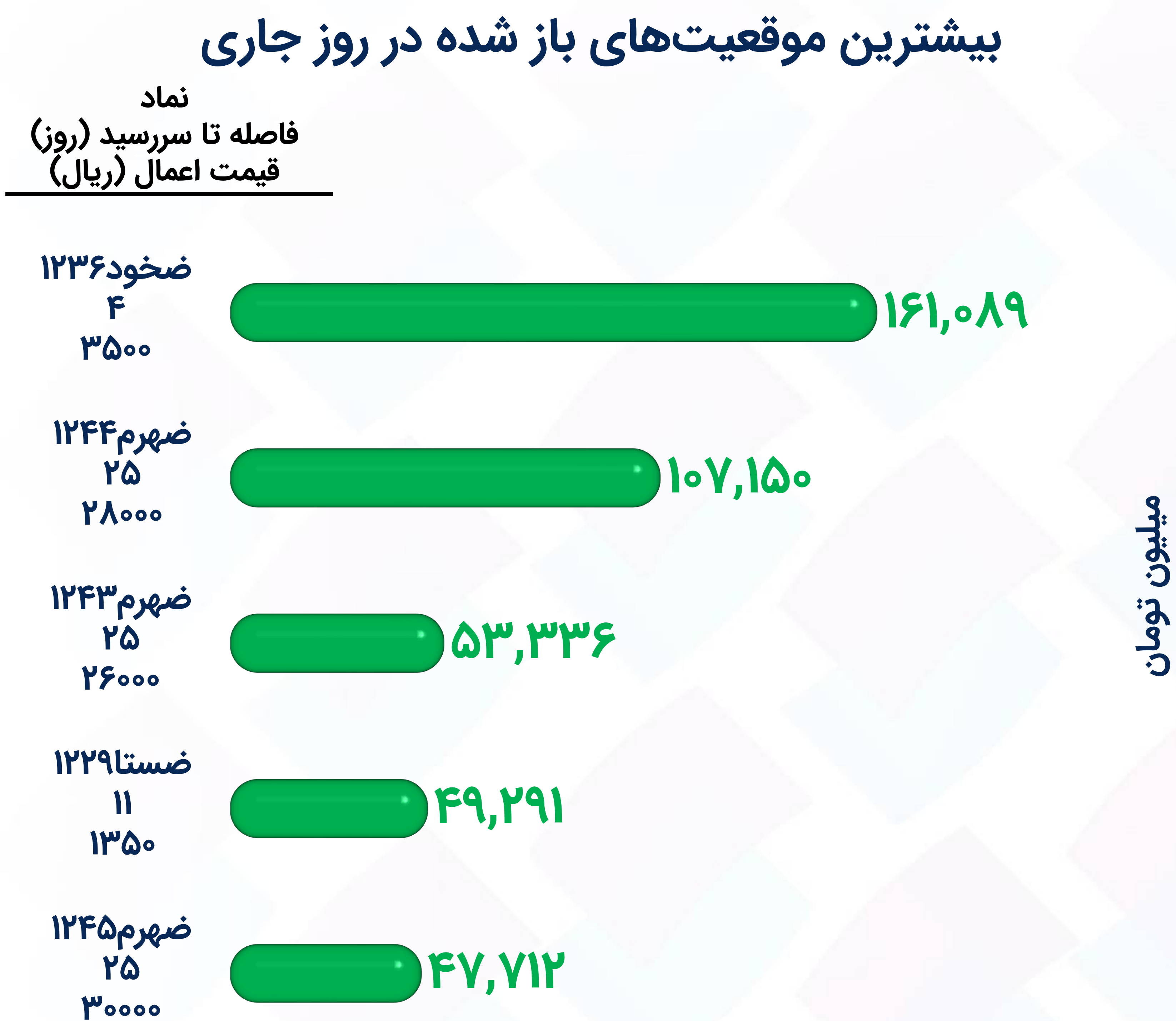
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طخود ۱۲۳۴	خودرو	۳,۰۰۰	۴	۲۰۵.۲	۶	۳,۳۷۷	۲,۹۹۴	(۱۱.۳%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۳%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۱۱	۱۸.۸	۴	۱,۳۰۵	۱,۱۴۶	(۱۲.۲%)	۲۸۶.۵	-۰.۰۱	۰	(۹۷.۱%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۵	۳۰.۶	۸۹	۲۵,۳۸۰	۱۹,۹۱۱	(۲۱.۵%)	۲۲۳.۷	۰.۰۰	۴	(۹۶.۰%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲۵	۲,۸۰۶.۳	۲۵۱	۲۵,۳۸۰	۲۱,۷۴۹	(۱۴.۳%)	۸۶.۶	-۰.۰۴	۴۹	(۸۰.۵%)
طستا ۱۲۲۸	شستا	۱,۲۵۰	۱۱	۲,۳۲۵.۴	۲۳	۱,۳۰۵	۱,۲۲۷	(۶.۰%)	۵۳.۳	-۰.۱۴	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



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

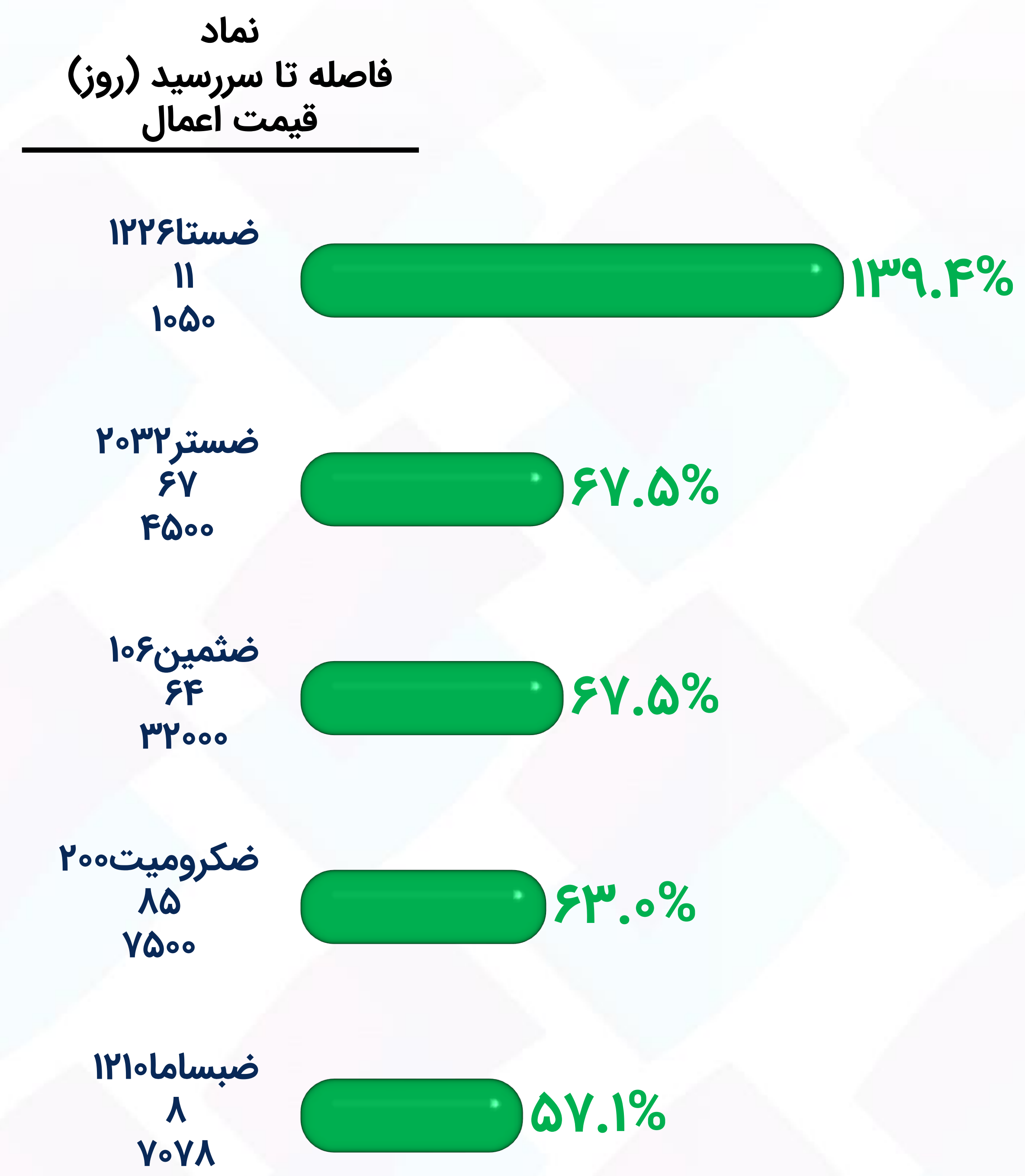
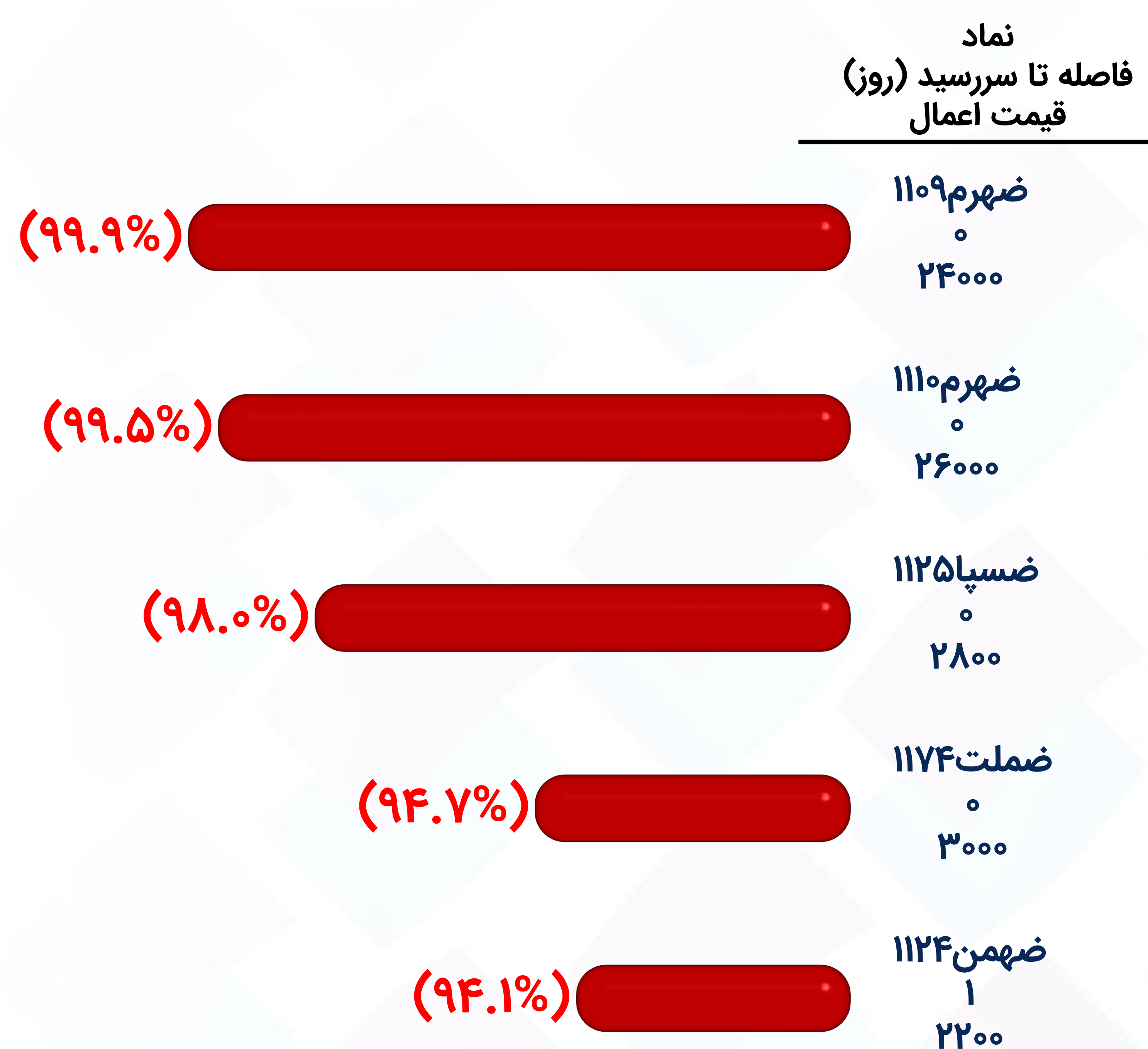
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



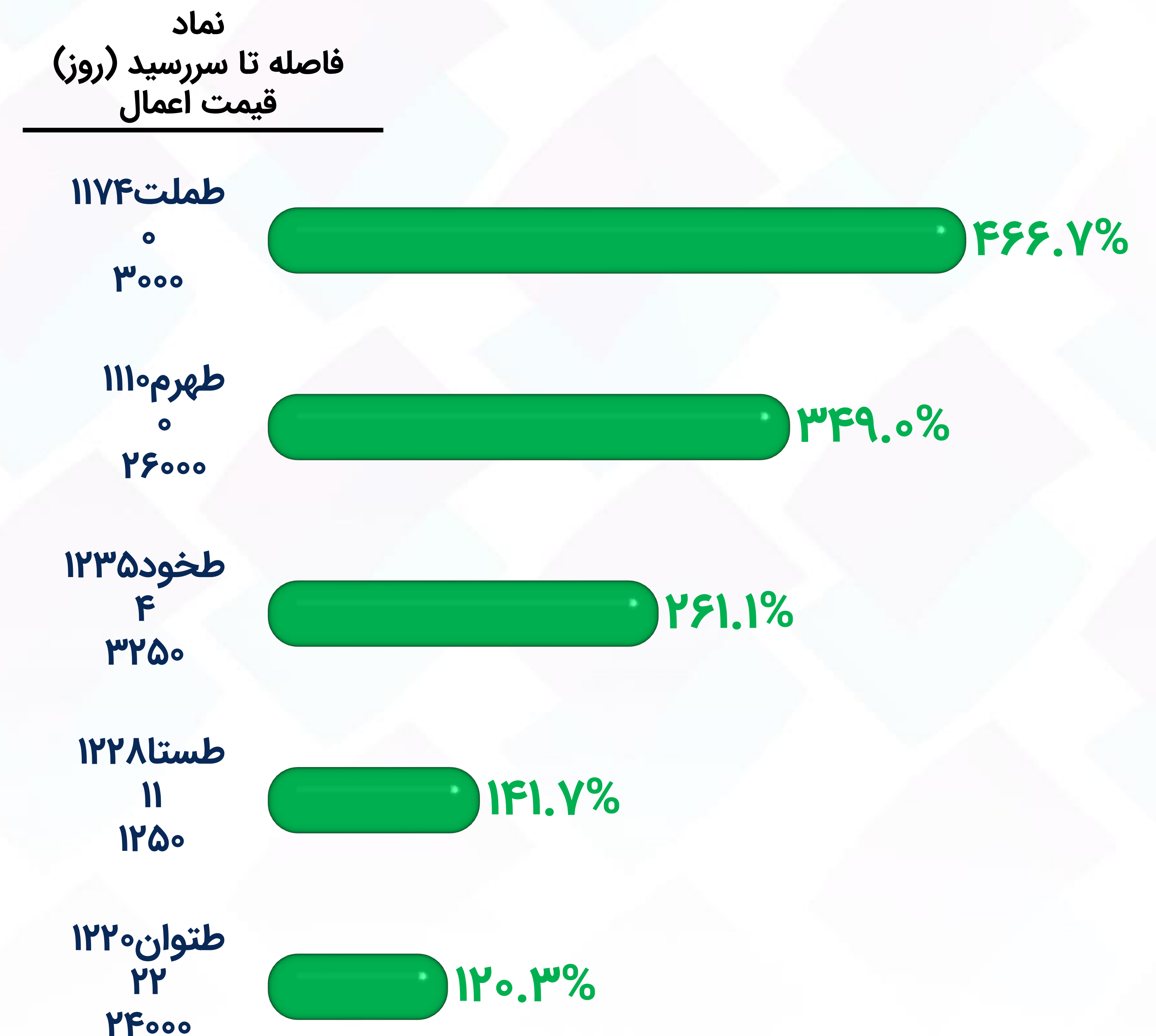
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

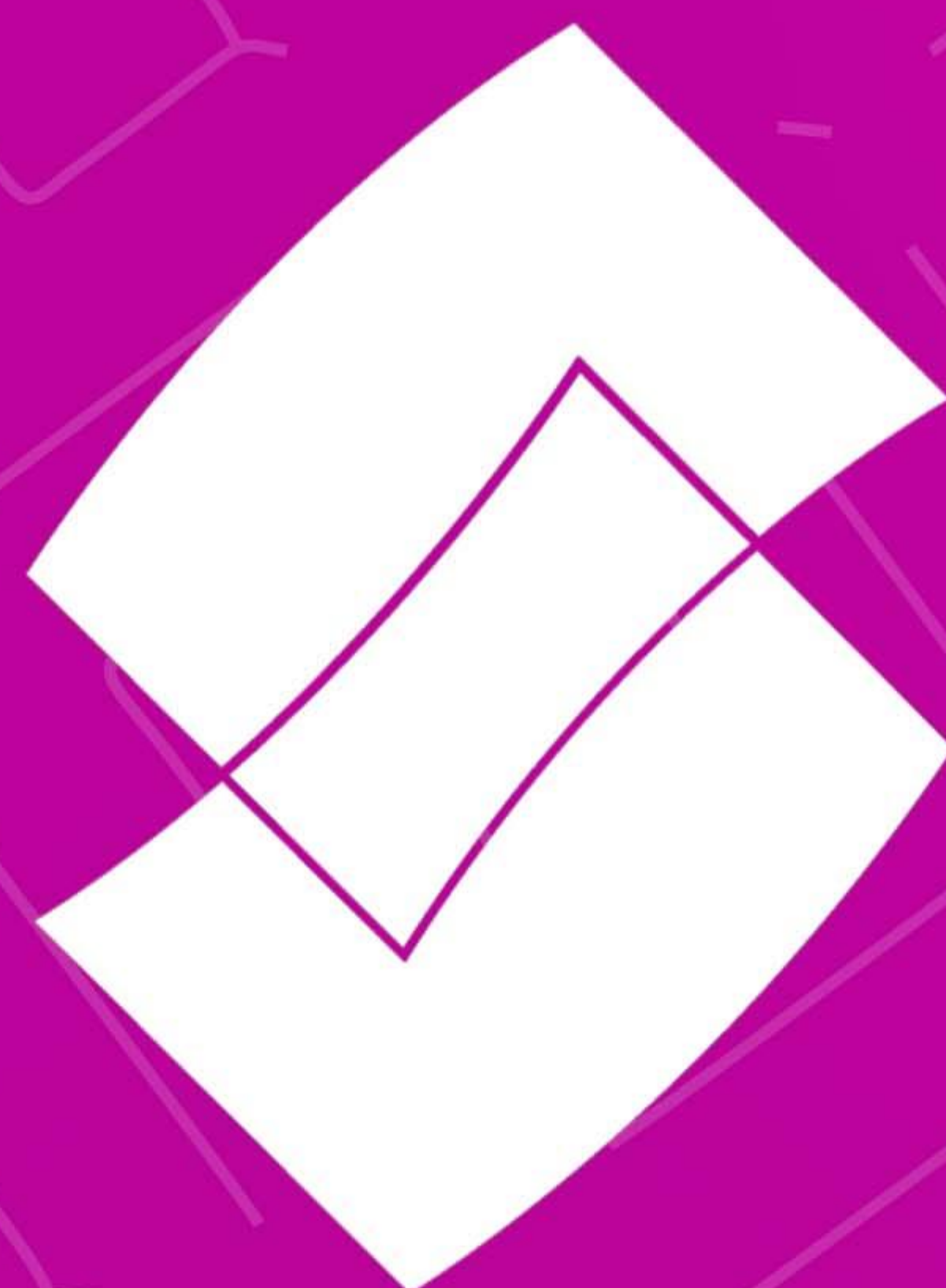
اختیار خرید



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.