

شماره
۴۲۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۸ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





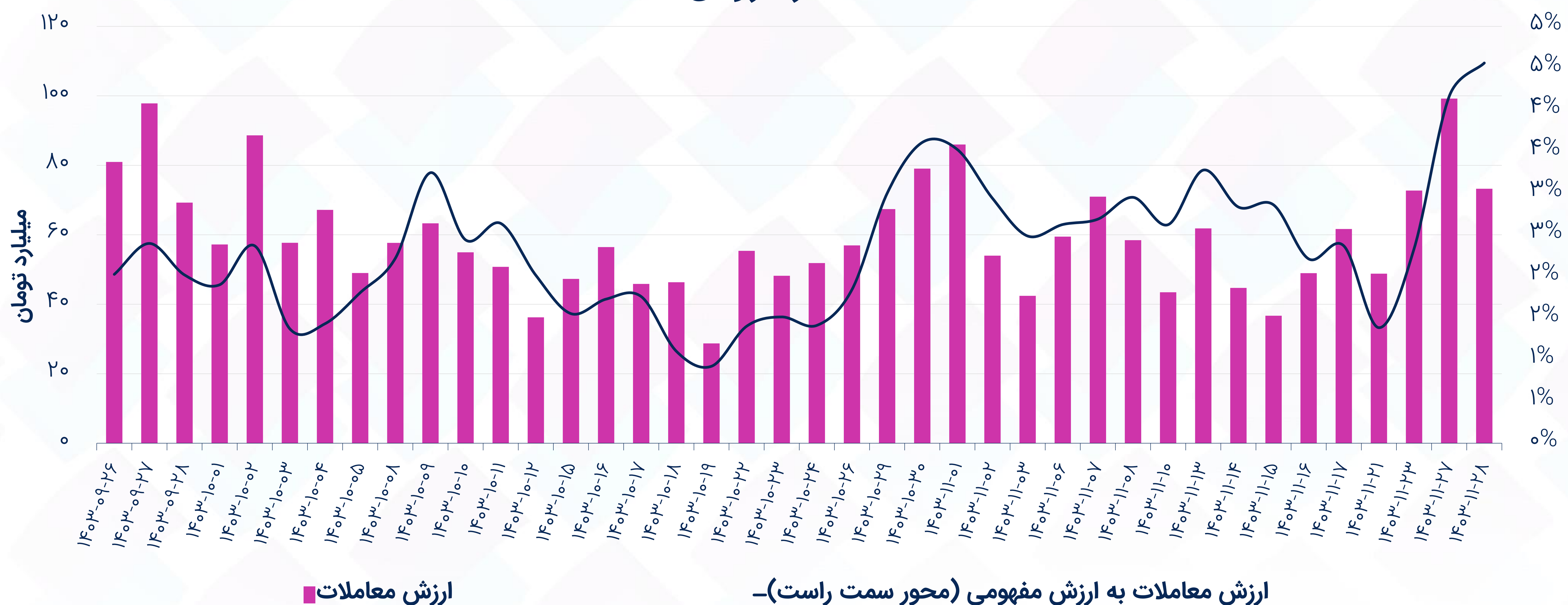
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



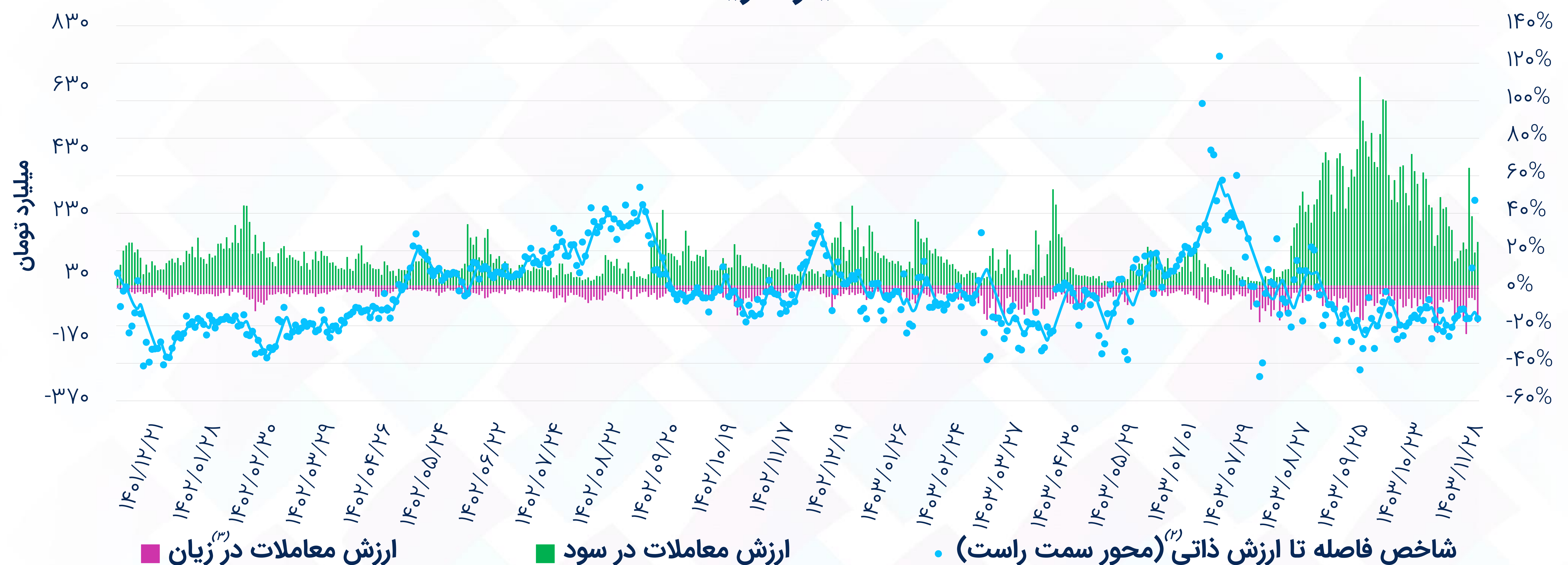
اختیار فروش



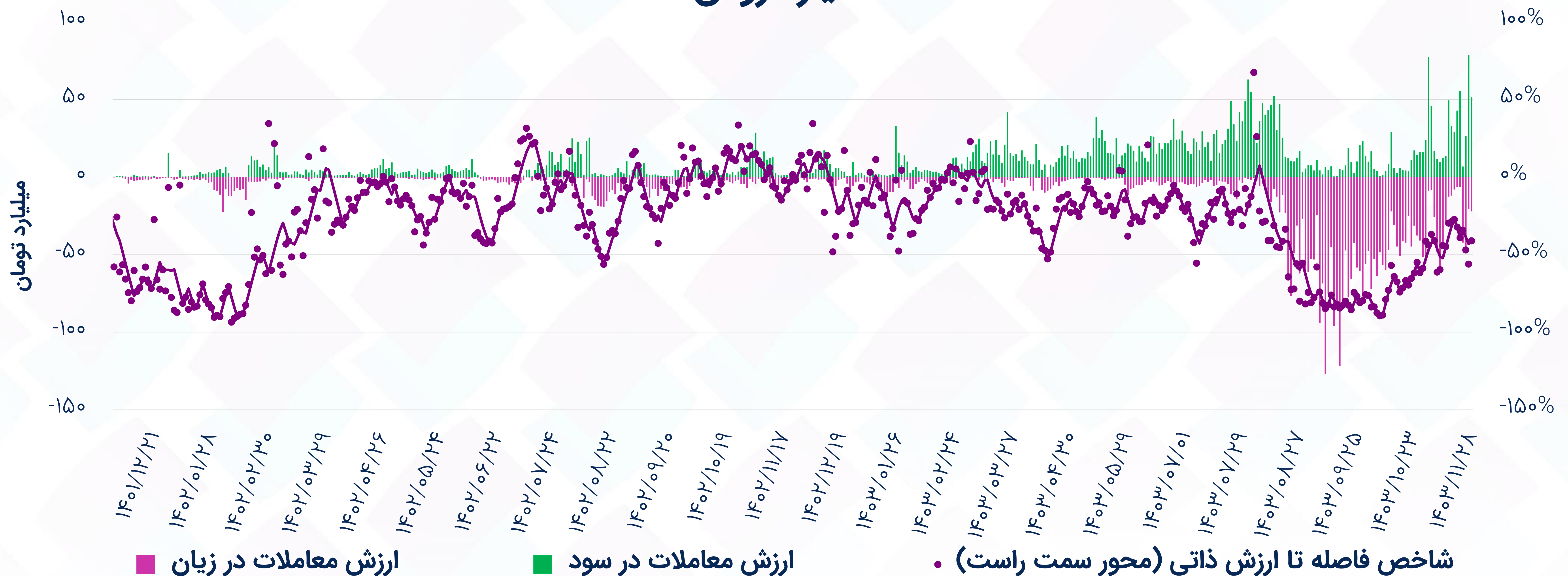
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۶	۱۵۶.۰	۳,۳۰۶.۰	۵۹.۶	۹۶.۴	(۲۲.۱%)
خودرو	۴۳	۵۰.۰	۲,۳۳۵.۱	۴۶.۴	۳.۷	۸.۱%
شستا	۴۲	۱۷.۷	۷۰۸.۳	۸.۴	۹.۳	(۴۴.۱%)
وبملت	۲۰	۱۰.۴	۱۱۱.۶	۵.۷	۴.۷	(۱۷.۱%)
ذوب	۱۹	۷.۱	۱۱۹.۷	۴.۱	۳.۰	(۱۹.۸%)
نارنج اهرم	۴	۳.۱	۱۴.۷	۱.۸	۱.۳	(۱۵.۰%)
توان	۱۷	۲.۶	۱۲.۷	۲.۶	۰.۱	۸.۰%

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	۹	۵۶,۰۶۵.۹	۹۴۷,۶۵۸.۵	۴۱,۹۶۵.۶	۱۴,۱۰۰.۳	(۴۵.۱%)
خودرو	۷	۱۲,۲۲۰.۵	۴۸۸,۹۴۲.۴	۶,۵۲۱.۵	۵,۶۹۹.۰	(۲۶.۴%)
شستا	۱۱	۴,۹۲۴.۳	۱۶۸,۷۲۶.۳	۲,۷۲۸.۸	۲,۱۹۵.۶	(۳۱.۴%)
وبملت	۲	۱۹.۳	۲۰۸.۴	۱۹.۳	۰.۰	(۲۴.۳%)
توان	۳	۱۳.۴	۲۰۵.۰	۱۳.۱	۰.۳	(۲۴.۴%)
خودران	۲	۱۰.۷	۴۷۶.۳	۱۰.۷	۰.۰	(۱۶.۶%)
ذوب	۲	۹.۶	۵۰.۹	۹.۵	۰.۱	(۴۵.۵%)

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

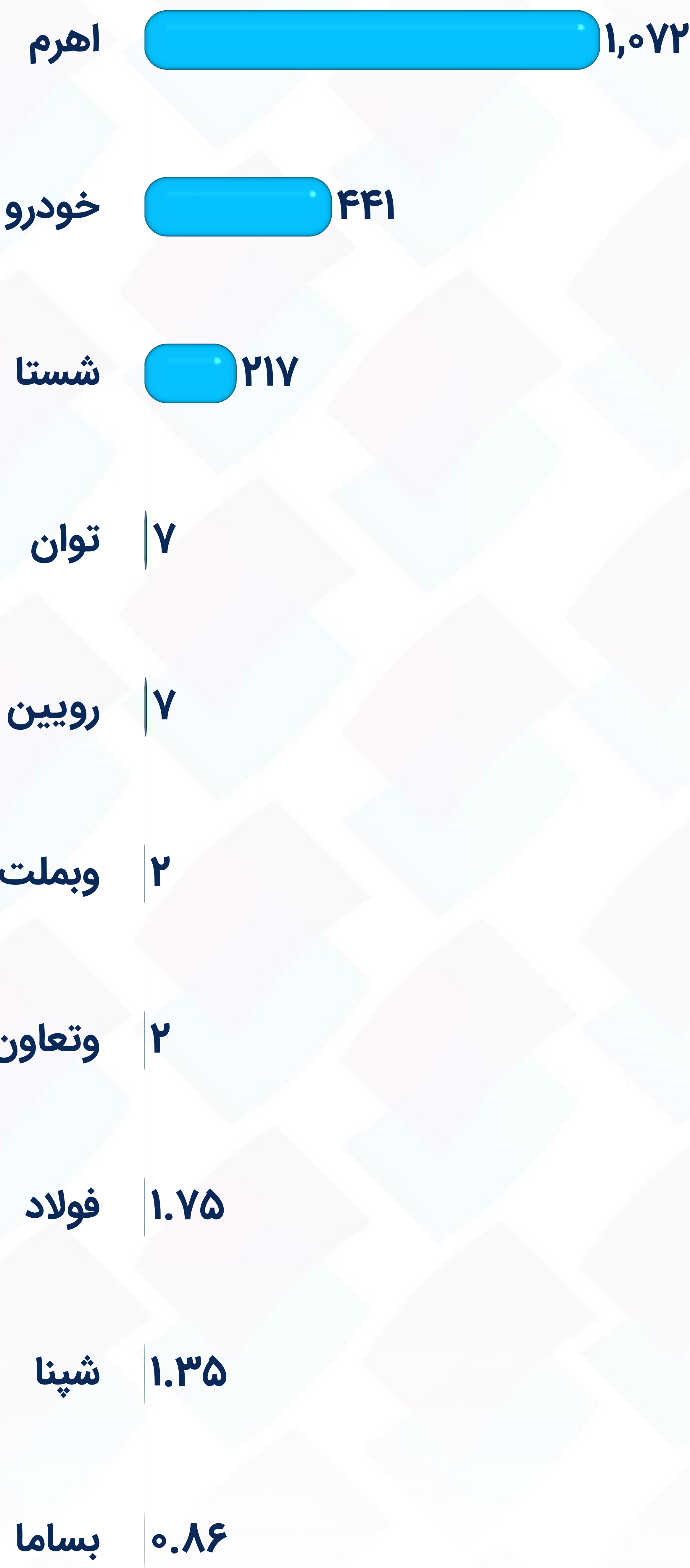


میلیارد تومان

(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

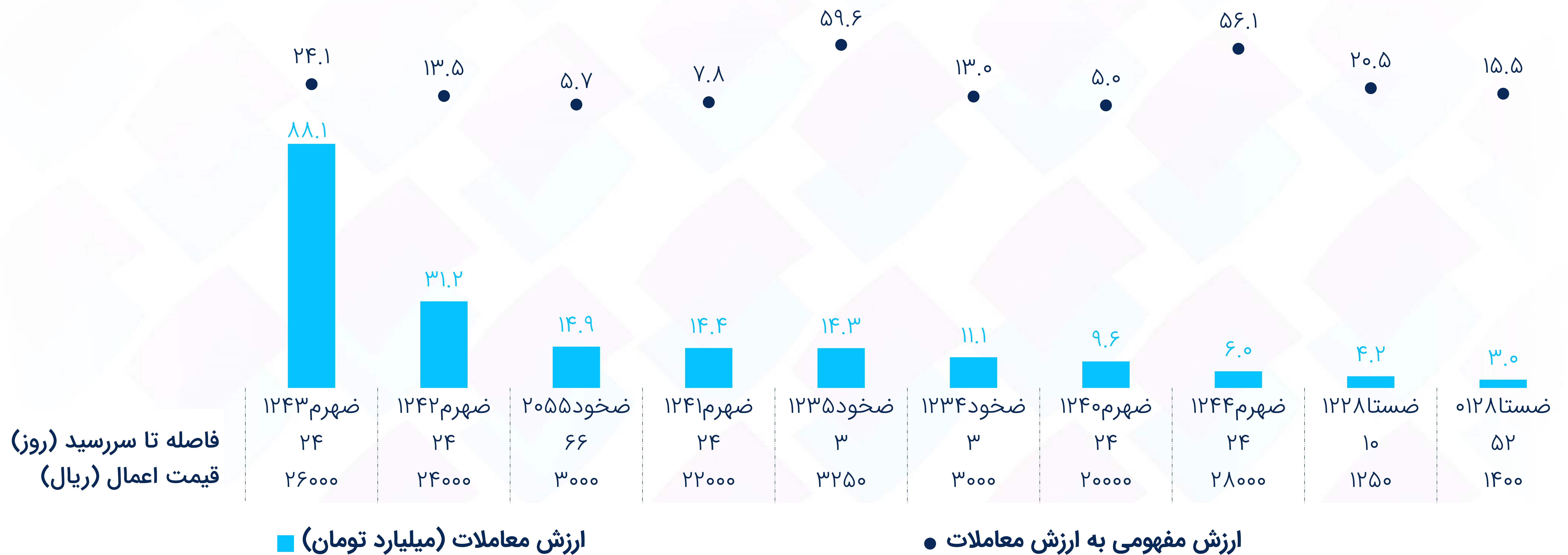
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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 ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۷	۱.۷	۳۴۵	۷,۹۴۰	۷,۴۲۳	(۶.۵%)	۲۱.۵	۱.۰۰	۹۲۰	۱۶۷%
ضستر ۱۲۲۰	خگستر	۴,۵۰۰	۳	۳.۸	۱۸	۴,۳۹۰	۴,۵۱۸	۲.۹%	۲۵۱.۰	۰.۳۴	۴۵	۱۴۸%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۷	۲۰۱.۴	۵۸۰	۷,۹۴۰	۷,۲۴۲	(۸.۸%)	۱۲.۵	۱.۰۰	۱,۳۳۳	۱۳۰%
ضسرو ۱۲۰۵	سرو	۱۶,۰۰۰	۱۰	۲.۱	۲۰۲	۱۶,۰۳۰	۱۶,۲۰۲	۱.۱%	۸۰.۲	۰.۶۳	۴۱۵	۱۰۶%
ضتاب ۱۲۰۵	شتاب	۱۰,۰۰۰	۱۷	۳.۶	۲,۰۰۶	۱۳,۵۶۰	۱۲,۰۰۶	(۱۱.۵%)	۶.۰	۱.۰۰	۳,۷۵۰	۸۷%

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	۳	۱.۸	۱	۳,۲۷۸	۵,۰۰۱	۵۳%	۵,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۳۹	خودرو	۴,۵۰۰	۳	۱.۹	۱	۳,۲۷۸	۴,۵۰۱	۳۷%	۴,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۲۳۲	شتا	۱,۶۵۰	۱۰	۳۱.۱	۲	۱,۲۷۲	۱,۶۵۲	۳۰%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۲۳۸	خودرو	۴,۰۰۰	۳	۸۱.۶	۲	۳,۲۷۸	۴,۰۰۲	۲۲%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۴۲۰	خودرو	۵,۰۰۰	۳۸	۱.۶	۲۶	۳,۲۷۸	۵,۰۲۶	۵۳%	۱۹۳.۳	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
طهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۴	۳.۴	۶,۷۴۰	۲۴,۶۲۰	۲۷,۲۶۰	۱۰.۷%	۴.۰	-۱.۰۰	۸,۵۰۶	۲۶.۲%
طهرم ۰۱۲۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۵۹	۱.۷	۱,۳۳۸	۲۴,۶۲۰	۲۴,۶۶۲	۰.۲%	۱۸.۴	-۰.۴۸	۱,۴۳۰	۶.۹%
طخود ۱۲۳۸	خودرو	۴,۰۰۰	۳	۱.۸	۷۴۵	۳,۲۷۸	۳,۲۵۵	(۰.۷%)	۴.۴	-۱.۰۰	۷۰۰	(۶.۰%)
طتوان ۱۲۲۱	توان	۲۶,۰۰۰	۲۱	۶.۳	۲,۳۳۹	۲۳,۵۵۸	۲۳,۶۶۱	۰.۴%	۱۰.۱	-۰.۷۸	۲,۱۴۱	(۸.۵%)
طملت ۰۱۱۶	وبملت	۳,۰۰۰	۵۹	۲.۲	۱۱۷	۲,۹۱۹	۲,۸۸۳	(۱.۲%)	۲۴.۶	-۰.۴۰	۱۰۴	(۱۰.۹%)

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
طستا ۱۲۲۶	شستا	۱,۰۵۰	۱۰	۱.۵	۲	۱,۲۷۲	۱,۰۴۸	(۱۷.۶%)	۵۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۴	۱۳۹.۱	۸۸	۲۴,۶۲۰	۱۹,۹۱۲	(۱۹.۱%)	۲۲۶.۳	-۰.۰۱	۸	(۹۱.۴%)
طستا ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۱۰	۱۱.۷	۴	۱,۲۷۲	۱,۱۴۶	(۹.۹%)	۲۸۶.۵	-۰.۰۱	۰	(۹۱.۱%)
طخود ۱۲۳۴	خودرو	۳,۰۰۰	۳	۸۴.۹	۴	۳,۲۷۸	۲,۹۹۶	(۸.۶%)	۷۴۹.۰	-۰.۰۱	۱	(۸۶.۱%)
طفلا ۱۲۰۹	فولاد	۵,۵۰۰	۳	۱.۲	۶۰۰	۵,۳۲۰	۴,۹۰۰	(۷.۹%)	۸.۲	-۰.۷۸	۱۷۴	(۷۱.۰%)

(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

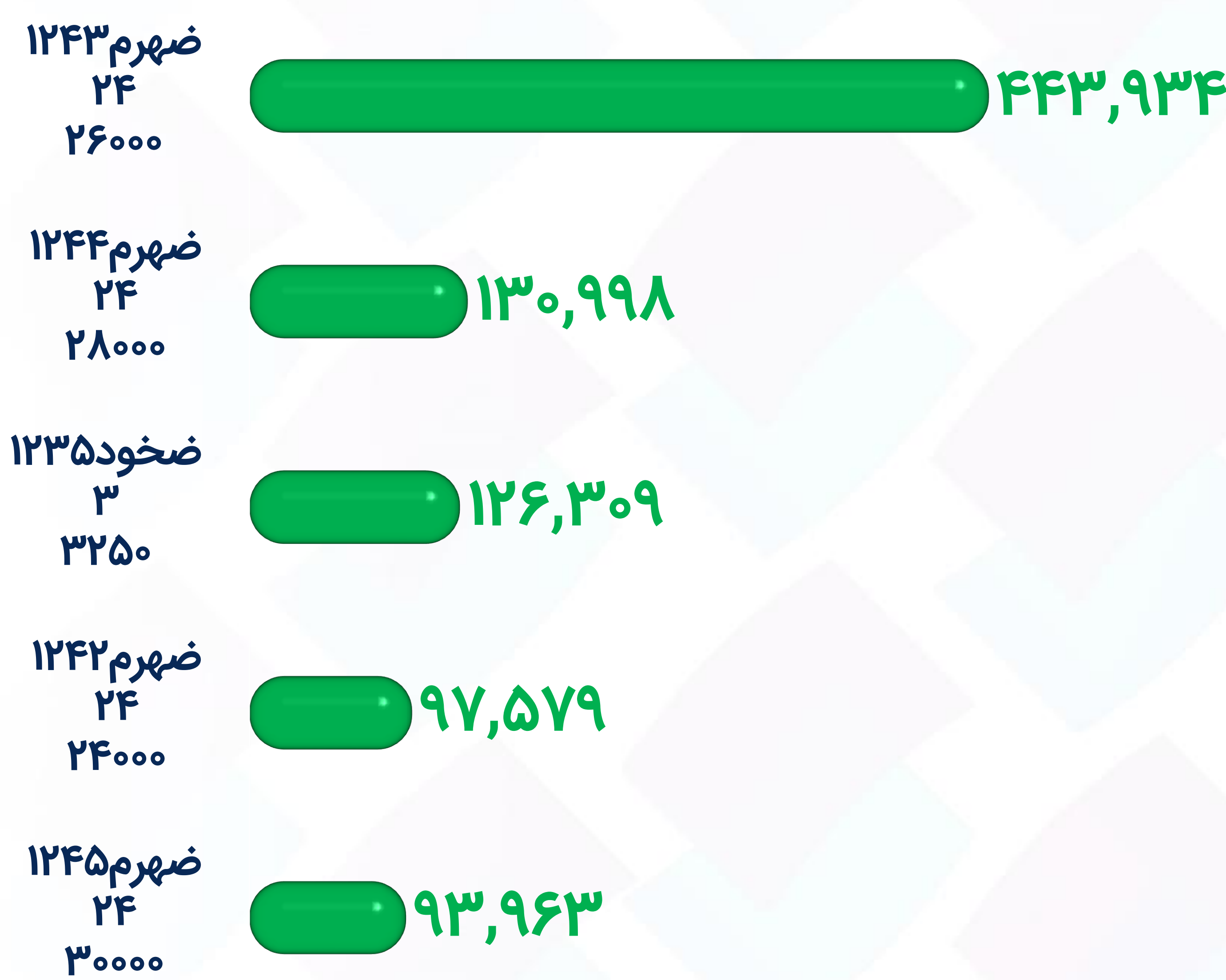
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

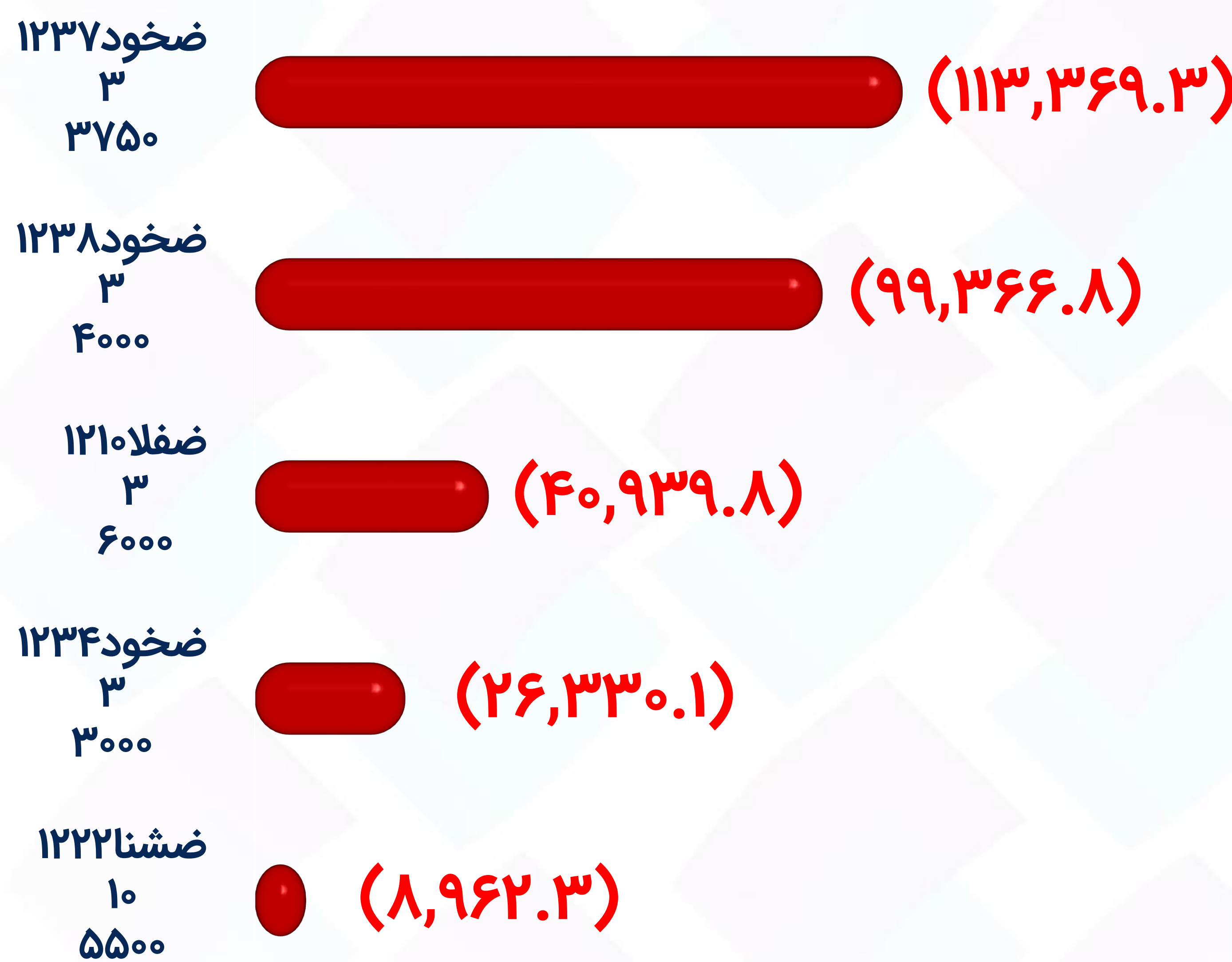
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

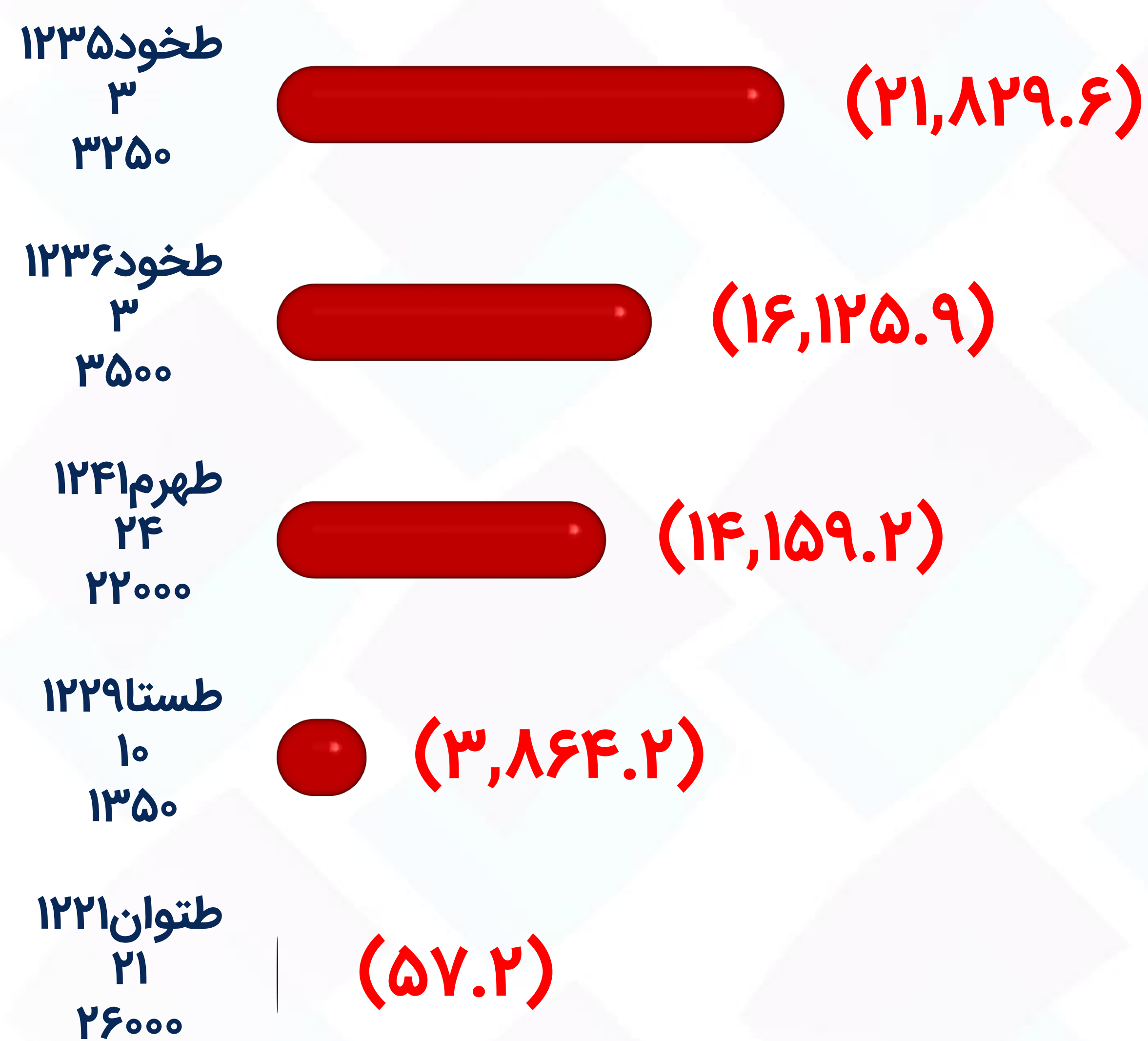
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

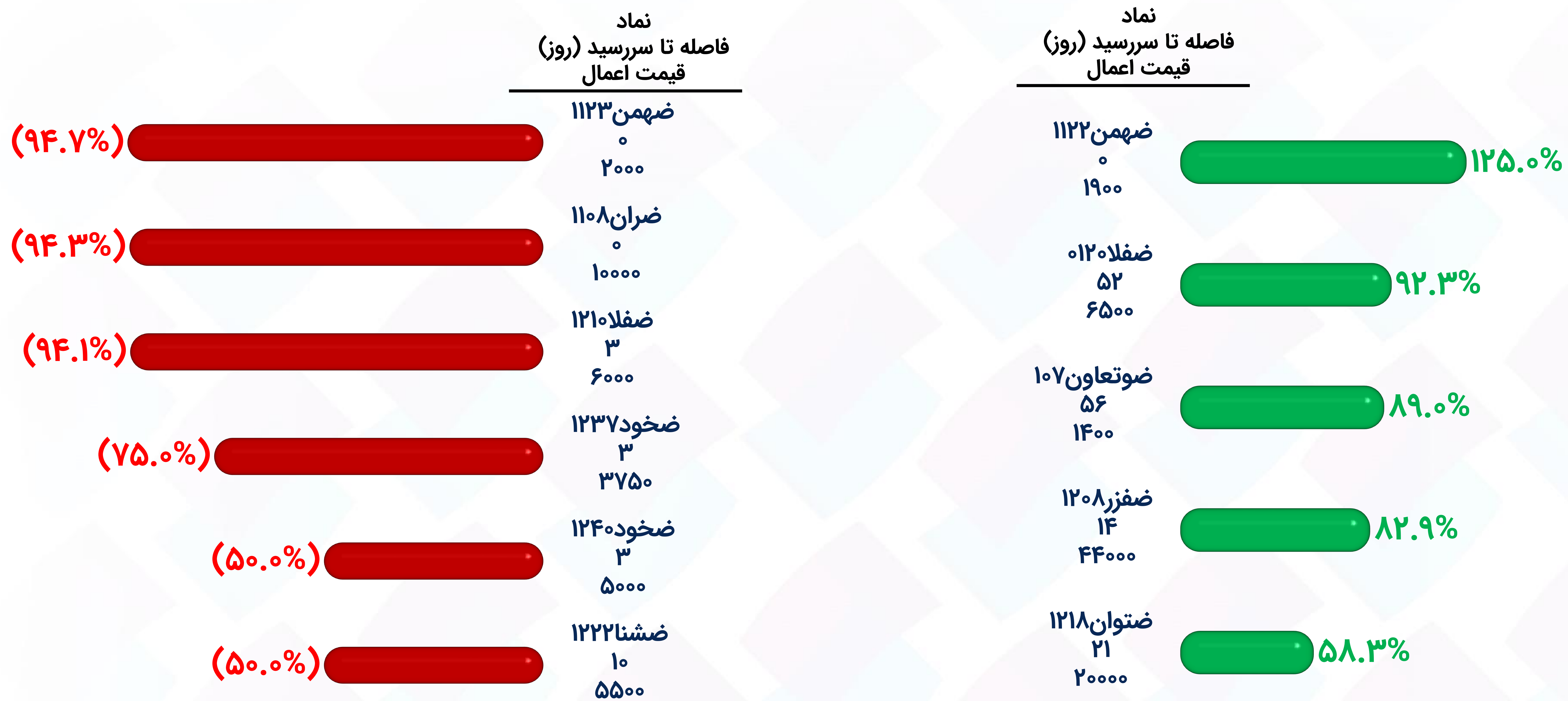
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

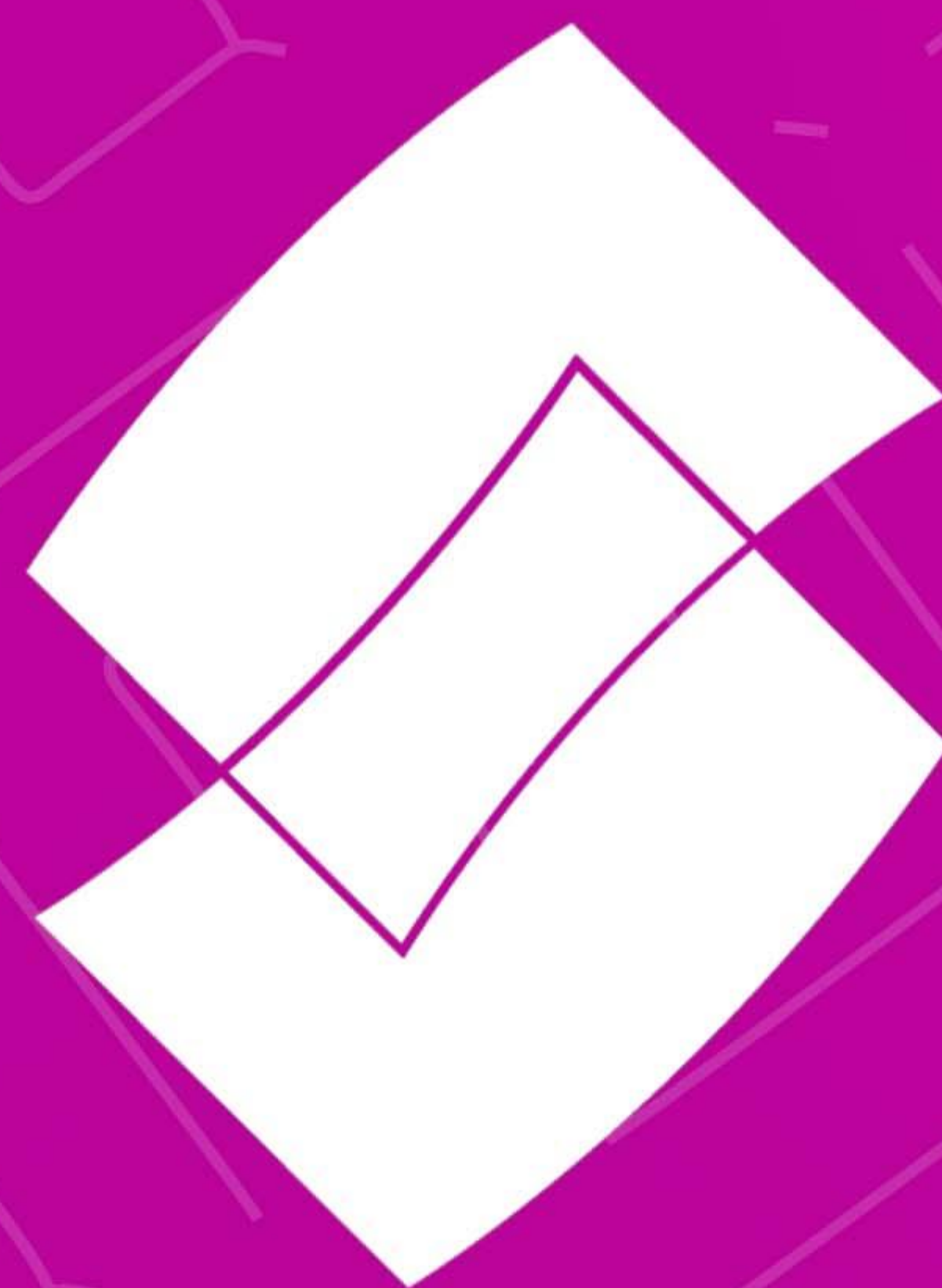
اختیار خرید



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.