

شماره
۴۲۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ بهمن ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





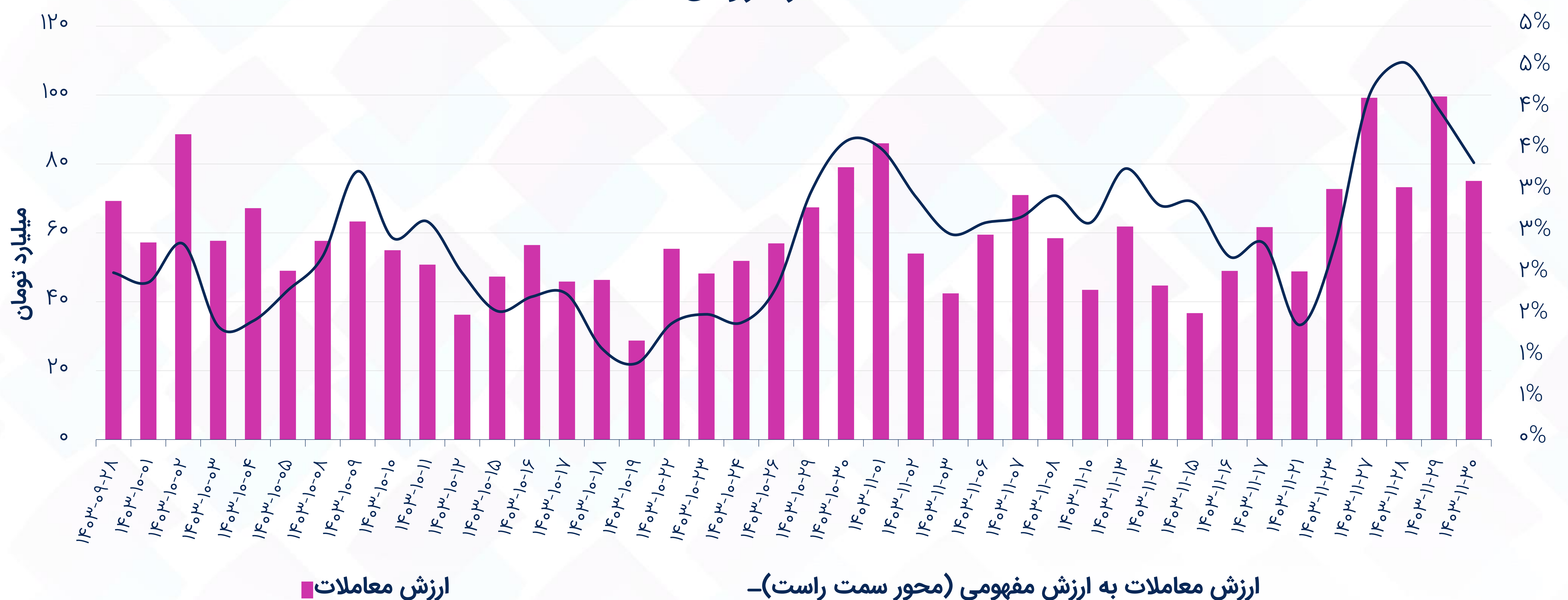
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



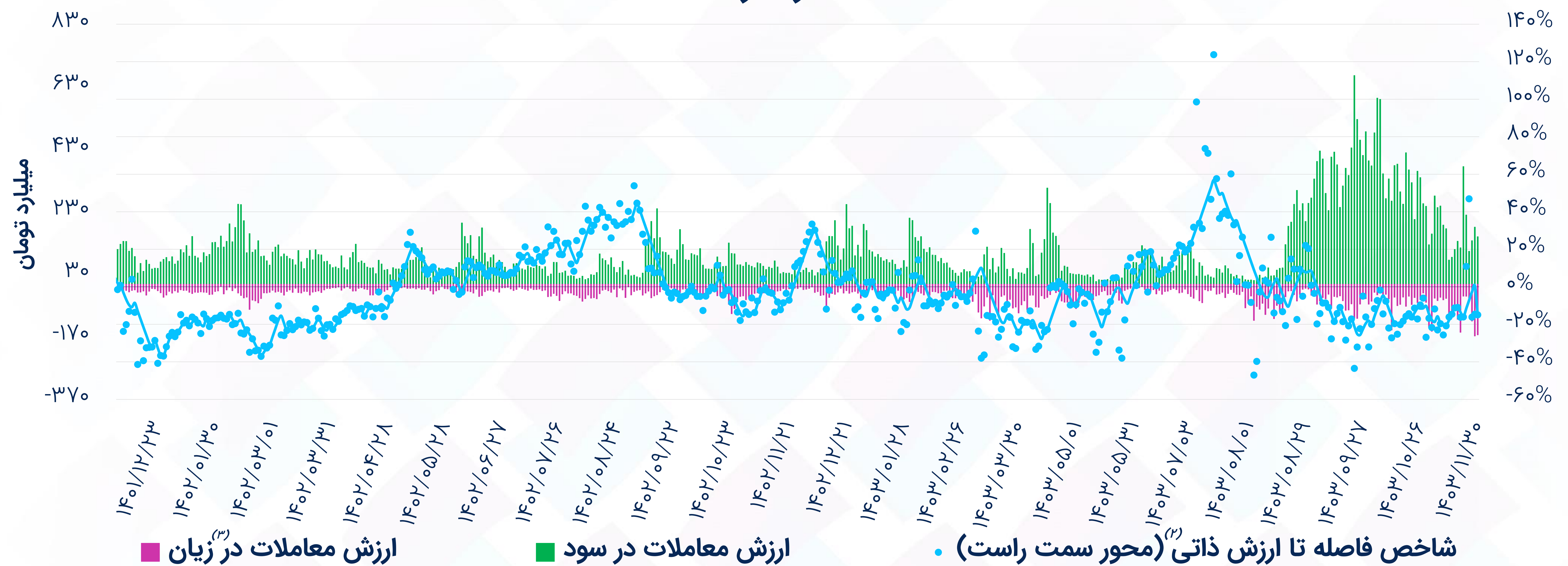
اختیار فروش



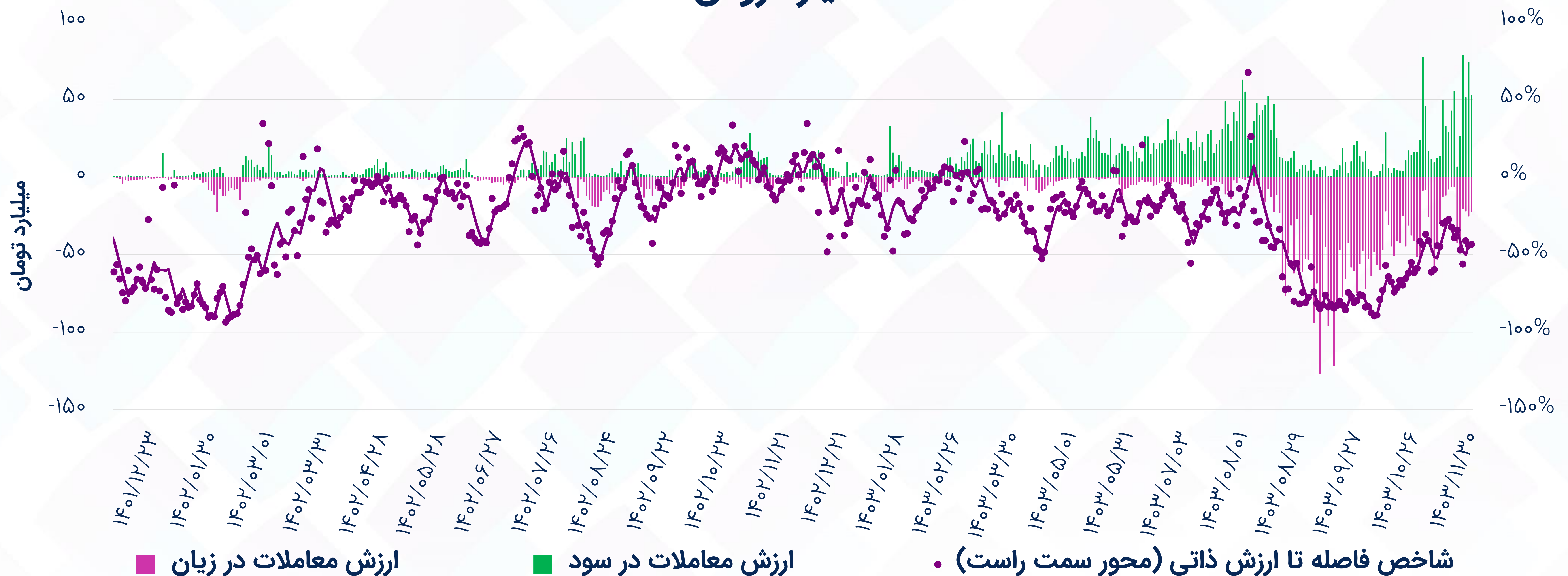
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۷	۲۰۴.۴	۴,۱۸۷.۳	۵۸.۹	۱۴۵.۵	(۲۵.۶%)
خودرو	۴۲	۶۰.۲	۱,۸۷۹.۵	۵۷.۱	۳.۱	۲۳.۶%
شستا	۴۵	۱۶.۸	۵۵۶.۱	۷.۹	۸.۹	(۳۰.۳%)
ذوب	۲۵	۱۰.۵	۱۱۸.۵	۷.۱	۳.۴	(۲۷.۶%)
وبملت	۱۸	۸.۷	۸۷.۵	۷.۴	۱.۳	(۱۴.۶%)
توان	۱۶	۳.۲	۱۴.۰	۲.۹	۰.۳	۱.۴%
پتروآبان	۳	۲.۷	۱۸.۳	۲.۷	۰.۰	(۲.۵%)

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	۱۲	۶۶,۸۶۸.۴	۱,۳۶۵,۰۷۶.۰	۴۷,۶۰۴.۴	۱۹,۲۶۴.۰	(۴۴.۹%)
خودرو	۱۰	۶,۲۵۲.۵	۷۵۳,۴۹۷.۲	۴,۴۸۹.۷	۱,۷۶۲.۸	(۲۴.۹%)
شستا	۹	۱,۹۳۷.۶	۱۲۲,۴۴۴.۸	۷۷۱.۰	۱,۱۶۶.۶	(۵۰.۰%)
وبملت	۳	۷.۱	۱۵۰.۰	۱.۸	۵.۳	(۴۷.۴%)
شپنا	۳	۶.۳	۴۵۵.۸	۲.۷	۳.۶	(۳۱.۰%)
توان	۲	۴.۸	۳۱۷.۰	۱.۹	۲.۹	(۵۶.۶%)
فملی	۳	۴.۱	۲۲۸.۵	۰.۰	۴.۱	(۶۳.۸%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۱,۴۶۲

خودرو ۴۶۰

شستا ۲۸۶

توان ۷

رویین ۷

وبملت ۲

وتعاون ۲

فولاد ۱.۷۵

شپنا ۱.۴۰

بساما ۰.۸۶

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۴۷,۱۶۱.۰

شستا ۴۵,۳۹۰.۹

فملی ۲۱۱.۶

خودران ۹۰.۰

توان ۶۷.۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۴۰,۱۳۳.۴)

رویین (۲.۴)

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	۵	۱۲.۰	۴۵	۷,۹۴۰	۷,۶۲۳	(۴.۰%)	۱۶۹.۴	۰.۹۷	۴۰۶	۸۰۳%
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۵	۴۸.۸	۲۶۱	۷,۹۴۰	۷,۳۳۹	(۷.۶%)	۲۸.۱	۱.۰۰	۹۰۱	۲۴۵%
ضبساما ۱۲۰۹	بساما	۶,۶۶۲	۵	۸۵.۷	۵۶۸	۷,۹۴۰	۷,۲۳۰	(۸.۹%)	۱۲.۷	۱.۰۰	۱,۳۱۵	۱۳۱%
ضفر ۱۲۰۸	فرز	۴۴,۰۰۰	۱۲	۱۲.۲	۱,۴۴۹	۴۵,۶۰۰	۴۵,۴۴۹	(۰.۳%)	۳۱.۴	۰.۷۹	۲,۴۷۸	۷۱%
ضپتروپاداش ۱۲۰۲	پتروپاداش	۱۰,۰۰۰	۵	۳۶۱.۸	۱,۲۲۴	۱۲,۰۲۷	۱۱,۲۲۴	(۶.۷%)	۹.۲	۱.۰۰	۲,۰۸۲	۷۰%

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
ضستا ۱۲۳۲	شستا	۱,۶۵۰	۸	۱۰.۴	۲	۱,۲۹۵	۱,۶۵۲	۲۸%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۱۲۲۵	وتجارت	۲,۴۰۰	۱۵	۲.۰	۵	۱,۷۰۵	۲,۴۰۵	۴۱%	۴۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۲	۱.۰	۱	۴۴۱	۷۰۱	۵۹%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۱۰۵	۲۱.۳	۶۹	۱,۲۹۵	۲,۲۶۹	۷۵%	۳۲.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۸۵	۶.۱	۱۸	۴۴۱	۸۱۸	۸۵%	۴۵.۴	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	۲۲	۹.۶	۹,۶۴۳	۲۴,۹۵۰	۲۴,۳۵۷	(۲.۴%)	۲.۵	-۱.۰۰	۸,۲۶۶	(۱۴.۳%)
طستا ۱۲۳۰	شستا	۱,۴۵۰	۸	۲.۴	۱۷۱	۱,۲۹۵	۱,۲۷۹	(۱.۲%)	۷.۵	-۰.۹۹	۱۴۱	(۱۷.۳%)
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۵,۰۰۰	۷۸	۲.۷	۲۷۰	۴,۸۴۰	۴,۷۳۰	(۲.۳%)	۱۷.۵	-۰.۳۸	۲۱۰	(۲۲.۱%)
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۲	۲,۳۸۸.۷	۳,۴۸۴	۲۴,۹۵۰	۲۴,۵۱۶	(۱.۷%)	۷.۰	-۰.۸۲	۲,۶۲۷	(۲۴.۶%)
طستا ۱۲۲۹	شستا	۱,۳۵۰	۸	۷۳۰.۳	۷۳	۱,۲۹۵	۱,۲۷۷	(۱.۴%)	۱۷.۵	-۰.۷۵	۵۱	(۳۰.۰%)

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 ۱۲۲۷	شستا	۱,۱۵۰	۸	۱.۵	۲	۱,۲۹۵	۱,۱۴۸	(۱۱.۴%)	۵۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۵%)
طستا ۰۱۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۵۰	۱.۴	۱۳	۱,۲۹۵	۱,۰۸۷	(۱۶.۱%)	۸۳.۶	-۰.۰۲	۱	(۹۴.۶%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۲	۱۷.۷	۵۴	۲۴,۹۵۰	۱۹,۹۴۶	(۲۰.۱%)	۳۶۹.۴	۰.۰۰	۴	(۹۳.۴%)
طخود ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۳۶	۵۵.۵	۱۹	۳,۳۵۸	۲,۷۸۱	(۱۷.۲%)	۱۴۶.۴	-۰.۰۲	۲	(۹۰.۱%)
طستا ۰۱۲۶	شستا	۱,۲۰۰	۵۰	۳.۷	۲۵	۱,۲۹۵	۱,۱۷۵	(۹.۳%)	۴۷.۰	-۰.۱۰	۶	(۷۴.۳%)

(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)

ضهرم ۱۲۴۳
۲۲
۲۶۰۰۰ ۱,۶۹۰

ضهرم ۱۲۴۵
۲۲
۳۰۰۰۰ ۸۶۳

ضهرم ۱۲۴۴
۲۲
۲۸۰۰۰ ۸۲۳

ضستا ۱۲۳۰
۸
۱۴۵۰ ۸۰۲

ضهرم ۱۲۴۲
۲۲
۲۴۰۰۰ ۷۱۴

ضخود ۱۲۳۶
۱
۳۵۰۰ ۵۵۶

ضستا ۱۲۲۹
۸
۱۳۵۰ ۴۵۸

ضخود ۱۲۳۸
۱
۴۰۰۰ ۴۳۱

ضهرم ۱۲۴۱
۲۲
۲۲۰۰۰ ۳۳۷

ضخود ۱۲۳۵
۱
۳۲۵۰ ۳۲۵

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۴۳
۲۲
۲۶۰۰۰ ۱۳۲,۰۲۸

ضهرم ۱۲۴۵
۲۲
۳۰۰۰۰ ۱۲۵,۵۷۴

ضهرم ۱۲۴۴
۲۲
۲۸۰۰۰ ۱۰۰,۷۸۰

ضهرم ۱۲۴۱
۲۲
۲۲۰۰۰ ۴۶,۴۷۳

ضخود ۲۰۵۵
۶۴
۳۰۰۰ ۴۰,۹۰۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضخود ۱۲۳۶
۱
۳۵۰۰ (۱۹۶,۴۶۴.۸)

ضستا ۱۲۳۰
۸
۱۴۵۰ (۹۰,۶۵۵.۶)

ضخود ۱۲۳۸
۱
۴۰۰۰ (۷۰,۹۶۹.۲)

ضخود ۱۲۳۷
۱
۳۷۵۰ (۶۴,۷۱۰.۴)

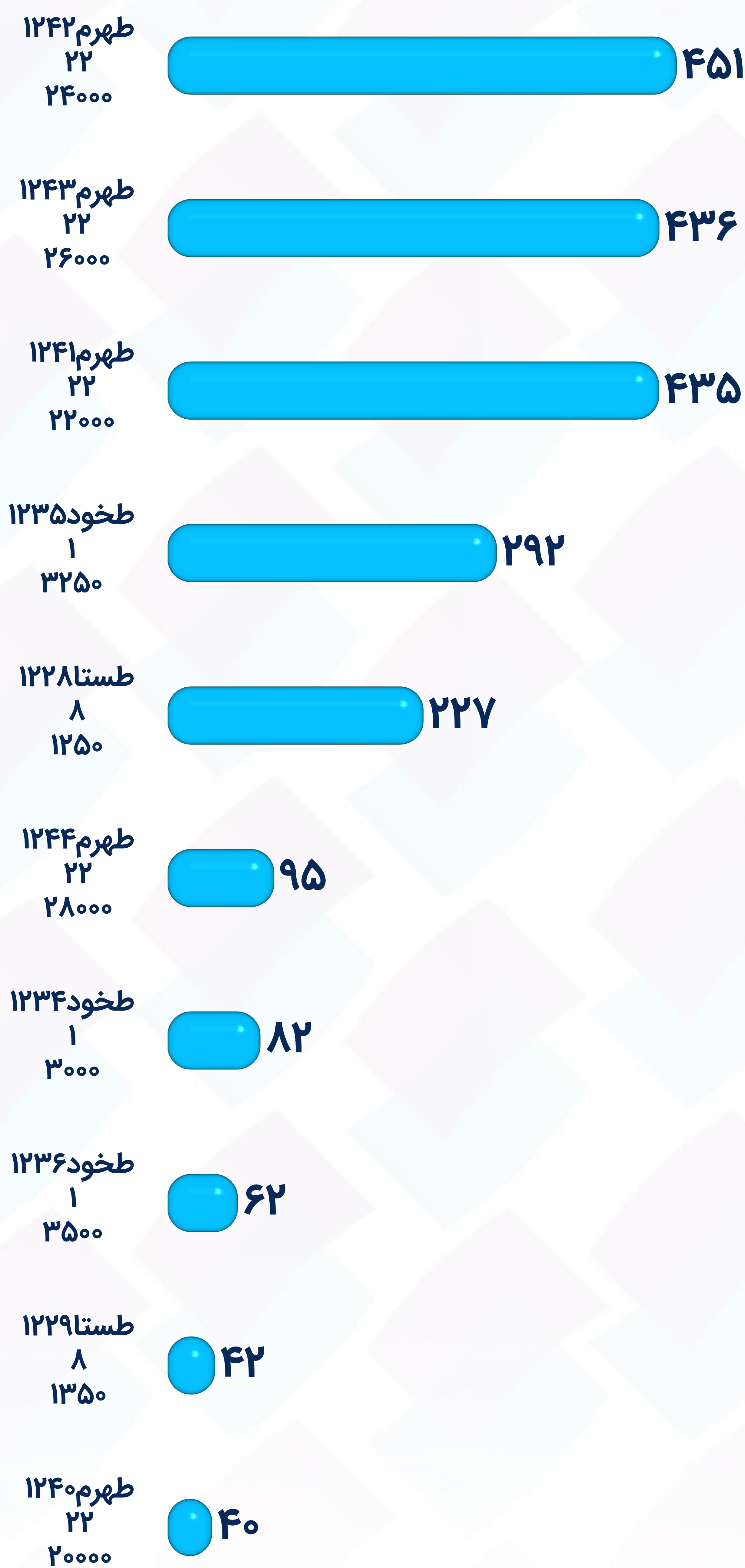
ضخود ۱۲۳۵
۱
۳۲۵۰ (۵۶,۵۷۰.۲)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

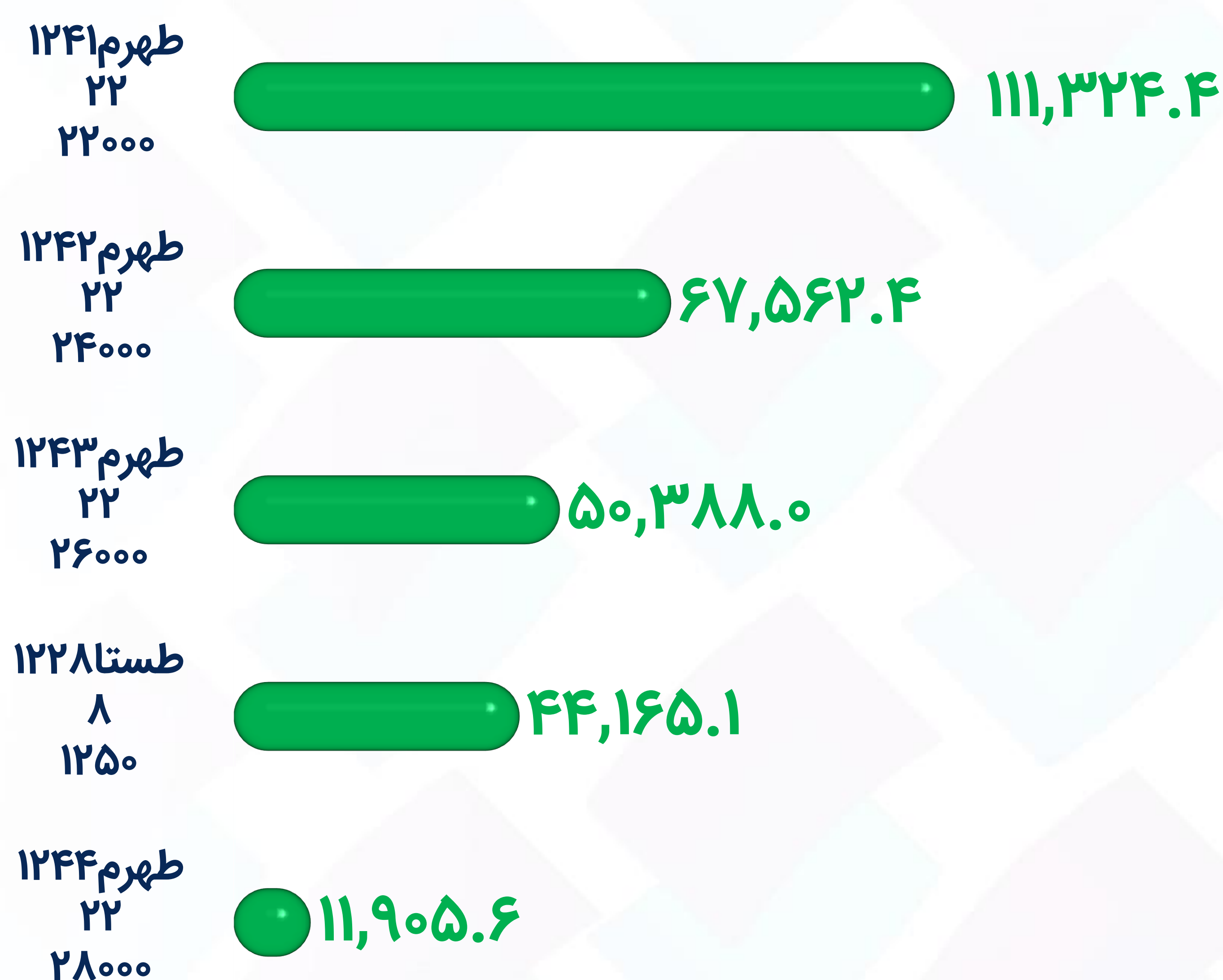
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

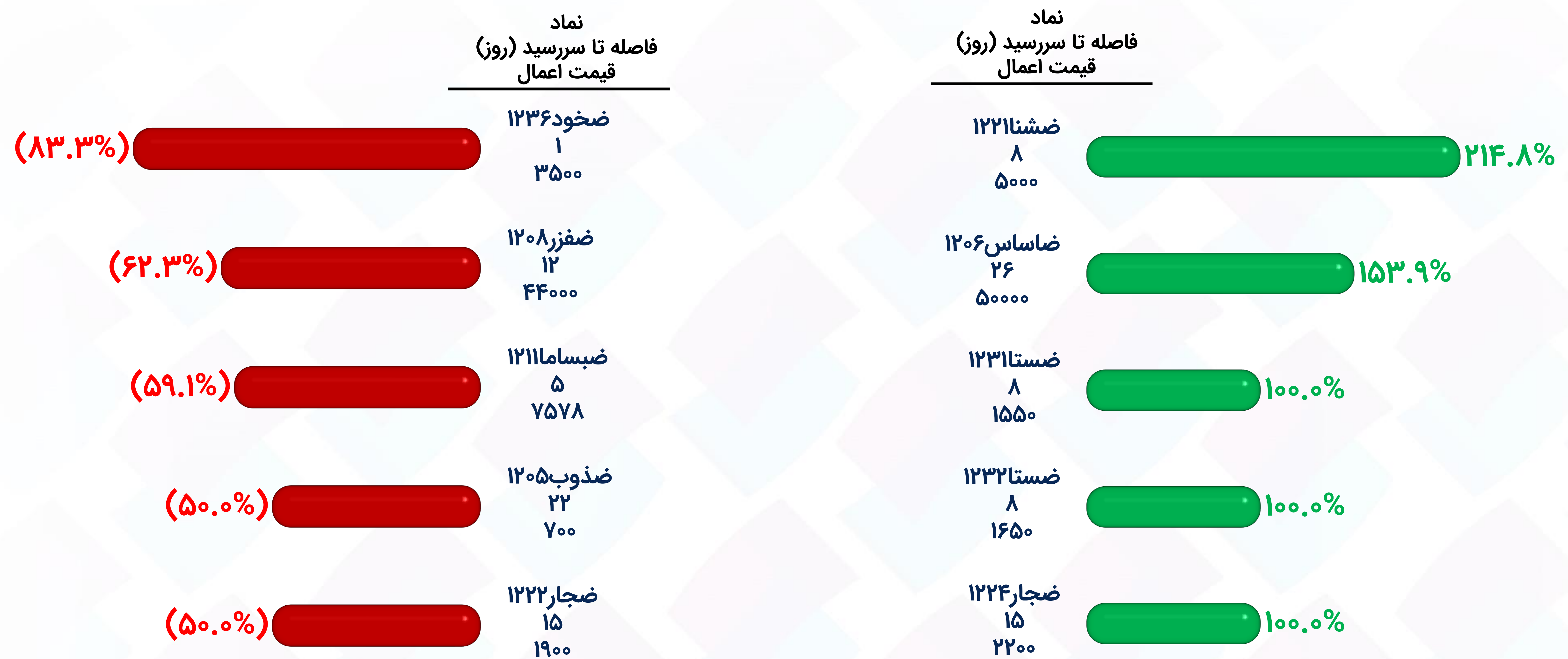
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



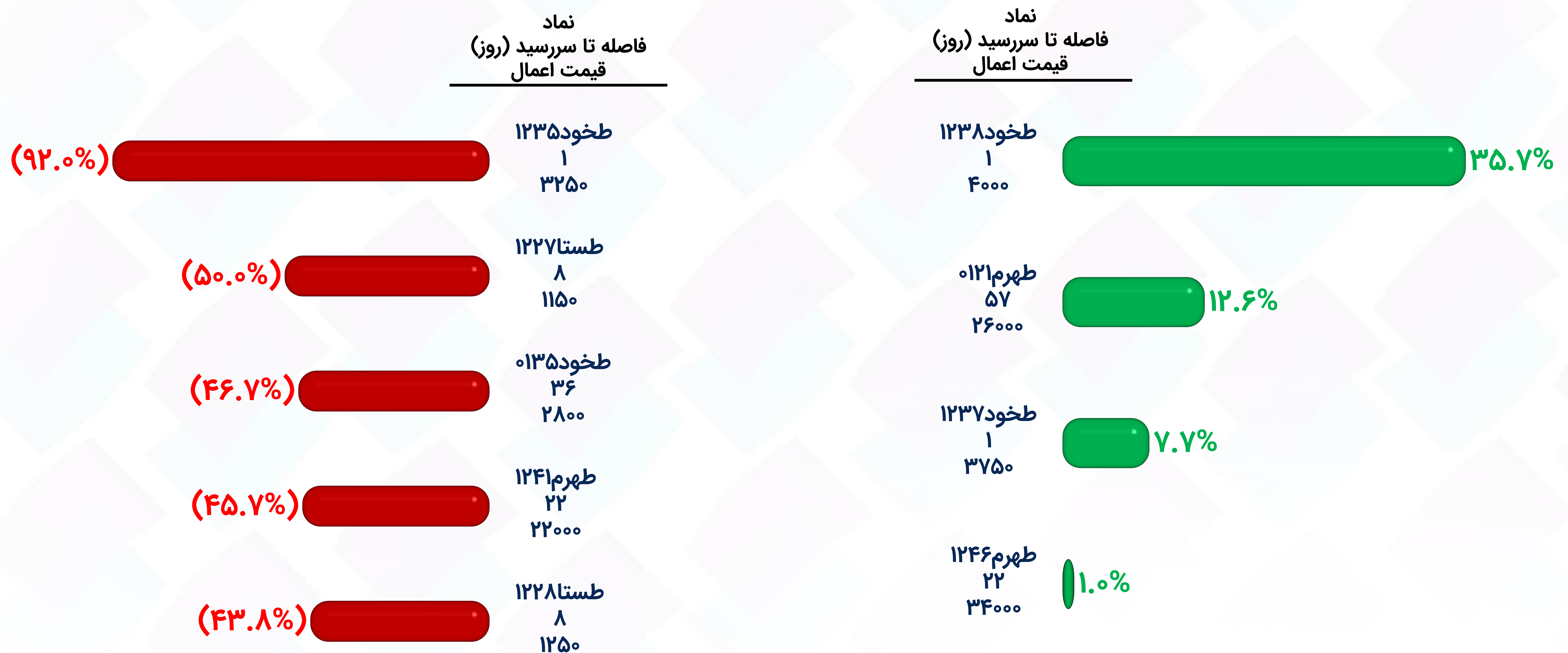
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

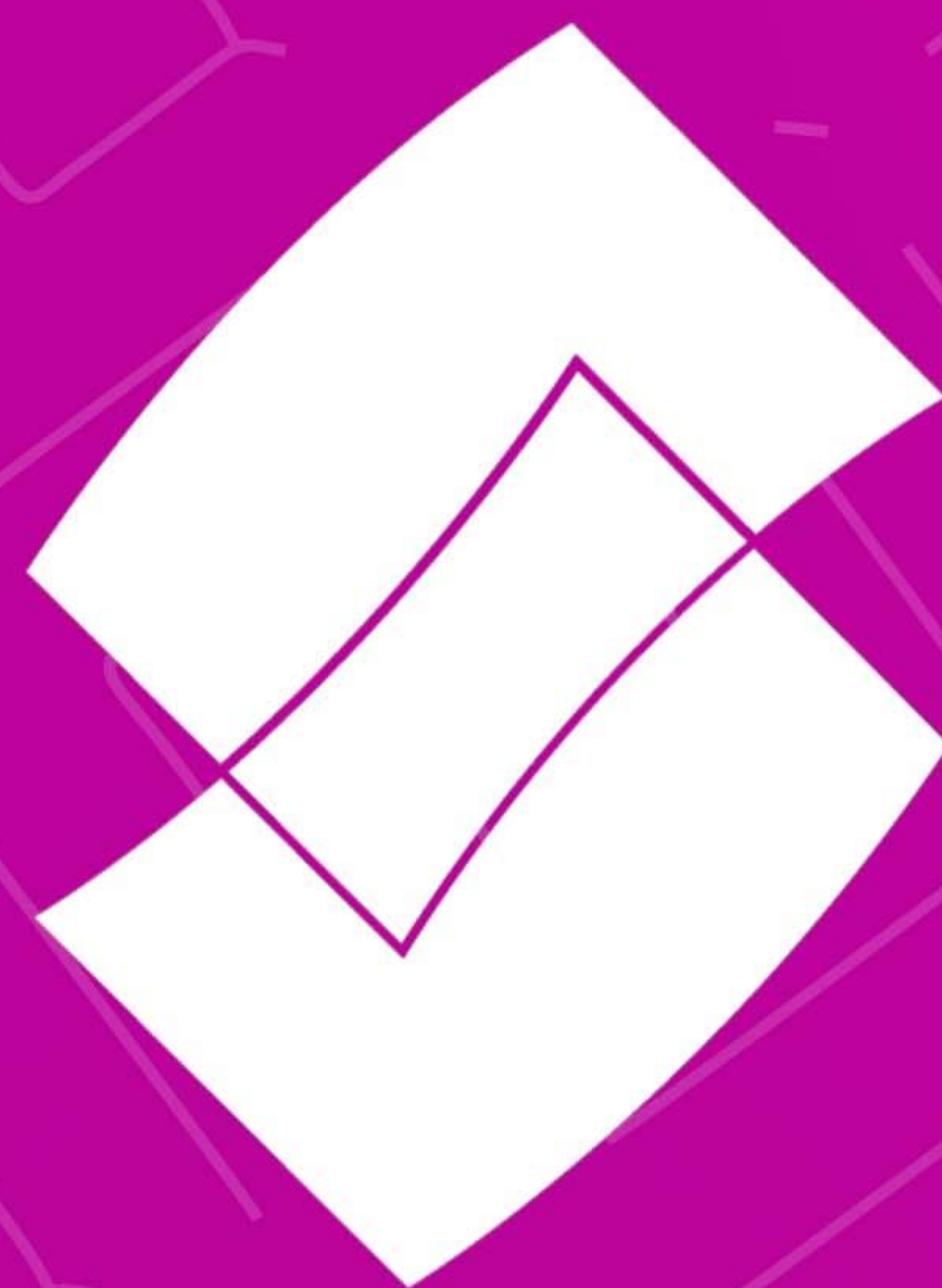
اختیار خرید



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.