

شماره
۴۲۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

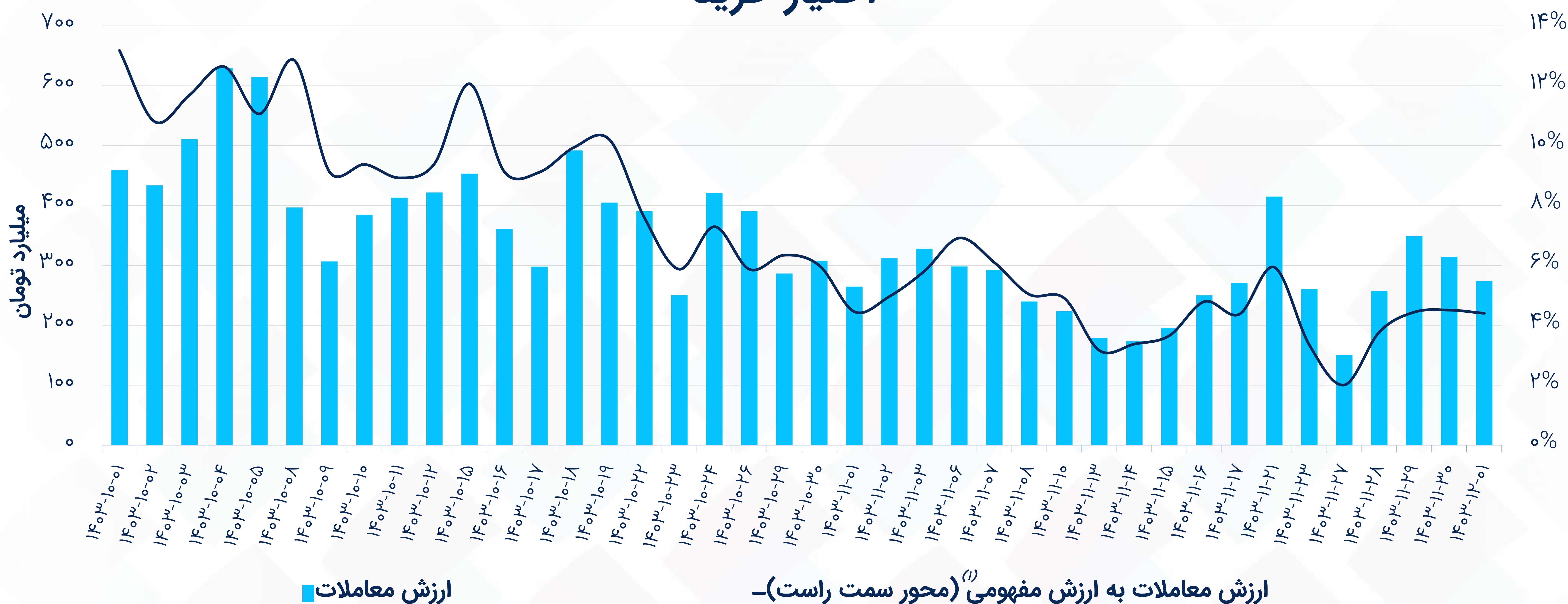




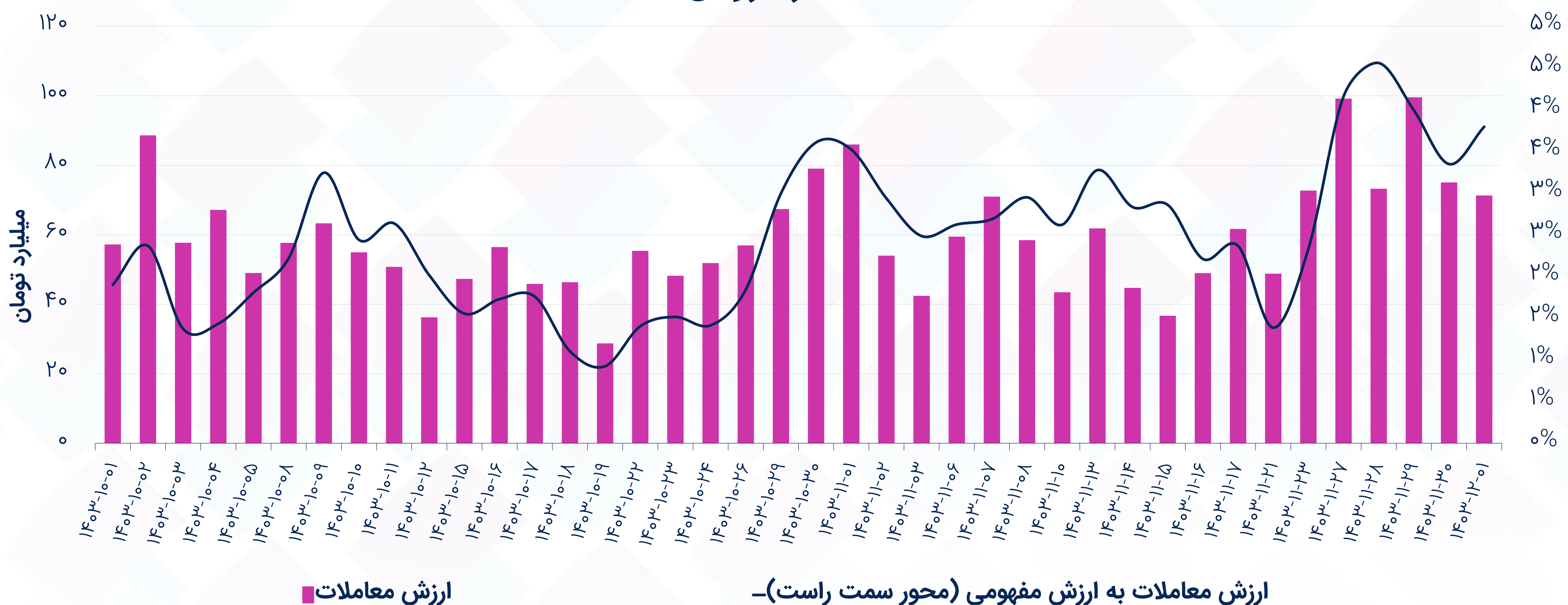
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



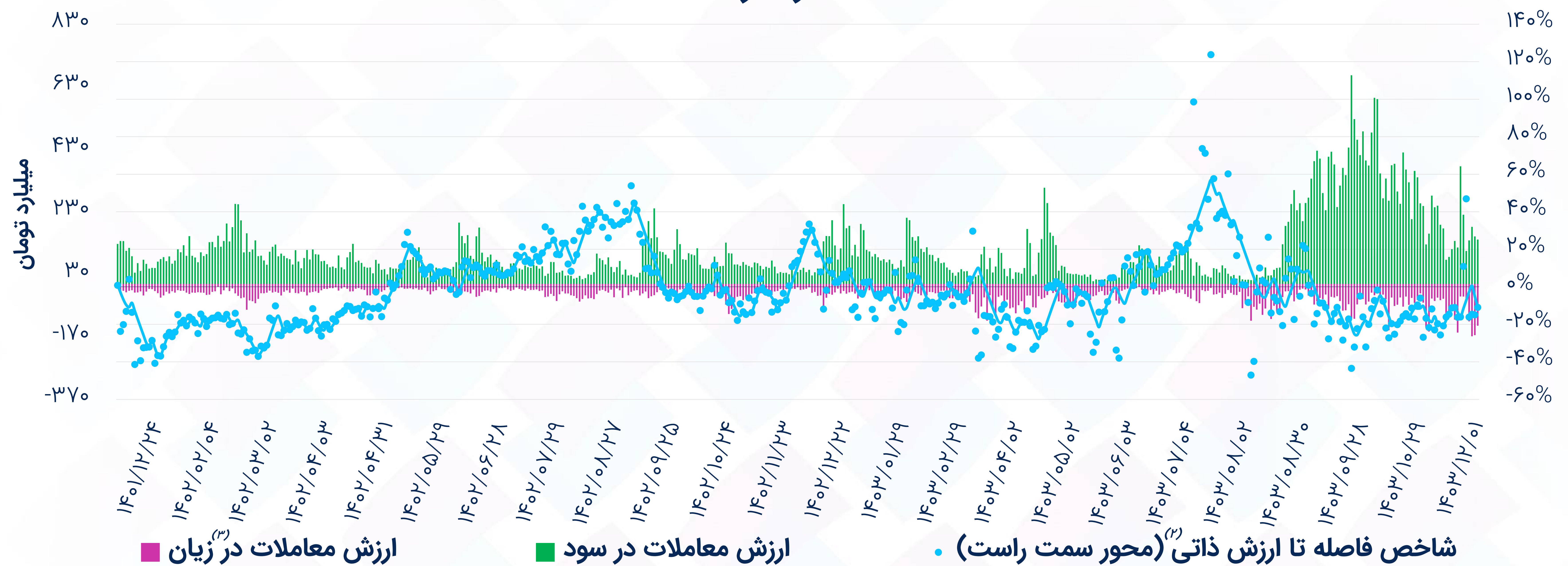
اختیار فروش



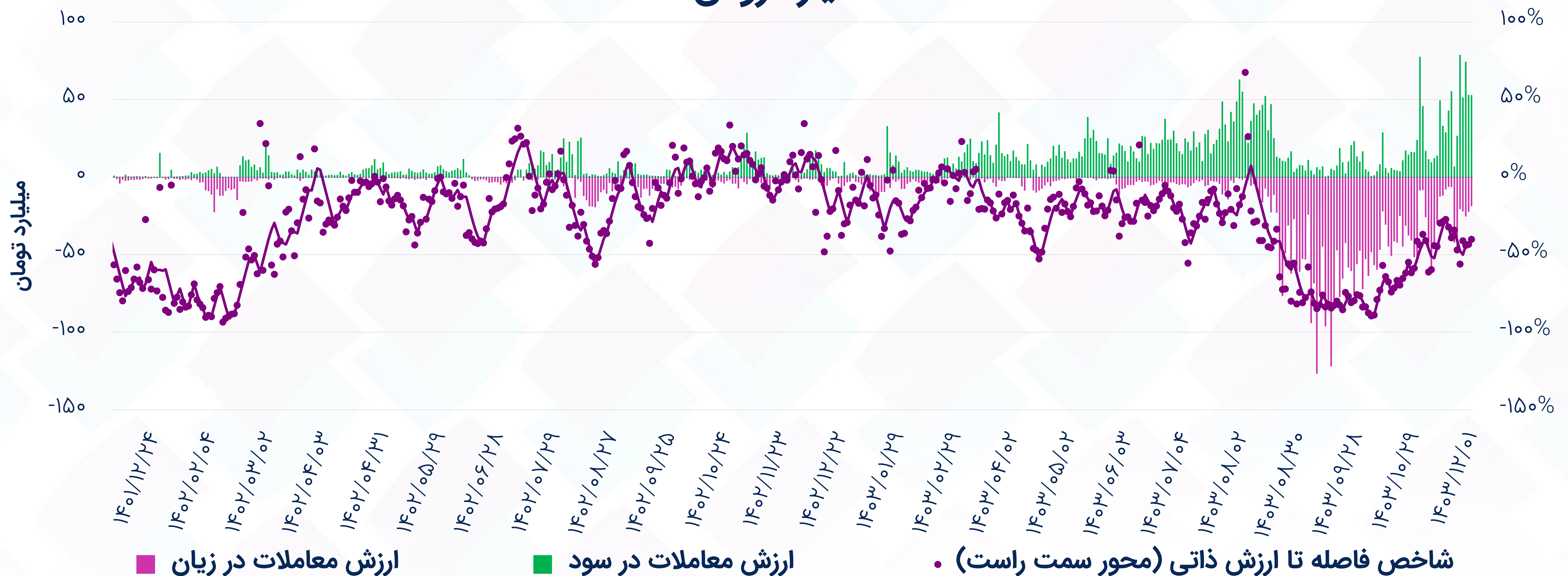
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۶۴.۹	۳,۶۶۴.۴	۴۸.۴	۱۱۶.۵	(۲۸.۰%)
خودرو	۴۳	۶۹.۲	۱,۷۴۹.۲	۶۴.۲	۵.۰	۲۹.۸%
شستا	۴۱	۱۳.۱	۴۸۸.۷	۶.۴	۶.۷	(۲۶.۹%)
ذوب	۲۴	۷.۶	۹۹.۴	۴.۷	۲.۹	(۲۶.۷%)
بساما	۱۴	۶.۲	۳۱.۶	۶.۱	۰.۱	۲۵.۲%
فولاد	۱۲	۲.۵	۵۲.۱	۲.۱	۰.۳	۱۲.۶%
توان	۲۰	۲.۱	۱۱.۶	۱.۷	۰.۴	(۱.۱%)

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	۱۴	۶۳,۲۰۴.۶	۱,۳۵۵,۱۱۲.۸	۴۷,۰۰۶.۹	۱۶,۱۹۷.۷	(۴۱.۱%)
خودرو	۱۰	۶,۵۷۹.۴	۳۹۵,۲۳۷.۰	۵,۰۹۴.۸	۱,۴۸۴.۷	(۳۱.۴%)
شستا	۱۴	۱,۵۰۰.۷	۱۲۷,۲۱۸.۷	۶۰۰.۴	۹۰۰.۳	(۳۹.۵%)
فولاد	۴	۱۸.۶	۴۲۲.۰	۱۸.۵	۰.۰	(۲۳.۲%)
توان	۲	۹.۶	۳۰۶.۴	۰.۲	۹.۴	(۵۸.۸%)
ذوب	۴	۴.۲	۳۴۴.۸	۰.۲	۴.۰	(۸۱.۸%)
آساس	۱	۲.۸	۱۹۰.۴	۰.۰	۲.۸	(۷۷.۴%)

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

اهرم ۱,۶۹۷

شستا ۲۸۲

خودرو ۲۷۸

توان ۷

رویین ۷

وبملت ۲

وتعاون ۲

فولاد ۱.۷۱

شپنا ۱.۴۰

بساما ۰.۸۶

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۳۴,۹۹۹.۲

خودرو ۳۳,۹۸۱.۷

ذوب ۲۳۶.۵

آساس ۱۸۰.۰

توان ۷.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۳,۹۹۱.۶)

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	۴	۱۰.۸	۴۷	۸,۰۰۰	۷,۶۲۵	(۴.۷%)	۱۶۲.۲	۰.۹۹	۴۵۴	۸۶۶%
ضبساما ۱۲۱۰	بساما	۷,۰۷۸	۴	۱۹۴.۲	۳۱۹	۸,۰۰۰	۷,۳۹۷	(۷.۵%)	۲۳.۲	۱.۰۰	۹۵۱	۱۹۸%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۶۷	۲۲۰.۷	۱,۰۶۷	۸,۰۰۰	۷,۳۱۳	(۸.۶%)	۶.۹	۱.۰۰	۲,۰۹۸	۹۷%
ضفرز ۱۲۰۹	فرز	۴۶,۰۰۰	۱۱	۱۰.۰	۱,۰۰۰	۴۶,۷۰۰	۴۷,۰۰۰	۰.۶%	۴۷.۰	۰.۶۸	۱,۷۷۶	۷۸%
ضپتروپاداش ۱۲۰۳	پتروپاداش	۱۱,۰۰۰	۴	۲۶.۹	۷۴۷	۱۲,۱۶۹	۱۱,۷۴۷	(۳.۵%)	۱۵.۷	۱.۰۰	۱,۲۱۴	۶۳%

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
ضبساما ۱۲۱۴	بساما	۹,۰۷۸	۴	۱۱۴.۱	۸,۹۶۲	۸,۰۰۰	۱۸,۰۴۰	۱۲۶%	۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضاطلس ۱۲۰۸	اطلس	۷۰,۰۰۰	۴	۱۵۰.۰	۱۴,۵۶۳	۶۰,۳۲۰	۸۴,۵۶۳	۴۰%	۵.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۲۳۲	شستا	۱,۶۵۰	۷	۱۷.۴	۲	۱,۲۹۱	۱,۶۵۲	۲۸%	۸۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۱	۲.۵	۲	۴۴۷	۷۰۲	۵۷%	۳۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۲۳۱	شستا	۱,۵۵۰	۷	۵.۸	۱	۱,۲۹۱	۱,۵۵۱	۲۰%	۱,۵۵۱.۰	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 ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۱	۱.۵	۵,۱۳۳	۲۴,۸۹۰	۲۴,۸۶۷	(۰.۱%)	۴.۸	-۰.۹۶	۴,۴۹۳	(۱۲.۵%)
طستا ۱۲۳۰	شستا	۱,۴۵۰	۷	۳.۸	۱۸۱	۱,۲۹۱	۱,۲۶۹	(۱.۷%)	۷.۰	-۰.۹۹	۱۴۷	(۱۸.۷%)
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۵۶	۱۷.۷	۵,۰۶۰	۲۴,۸۹۰	۲۴,۹۴۰	۰.۲%	۴.۹	-۰.۸۳	۴,۰۱۶	(۲۰.۶%)
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۱	۲,۴۵۱.۷	۳,۴۵۴	۲۴,۸۹۰	۲۴,۵۴۶	(۱.۴%)	۷.۱	-۰.۸۴	۲,۶۸۸	(۲۲.۲%)
طستا ۱۲۲۹	شستا	۱,۳۵۰	۷	۵۹۲.۰	۷۲	۱,۲۹۱	۱,۲۷۸	(۱.۰%)	۱۷.۸	-۰.۷۹	۵۴	(۲۴.۷%)

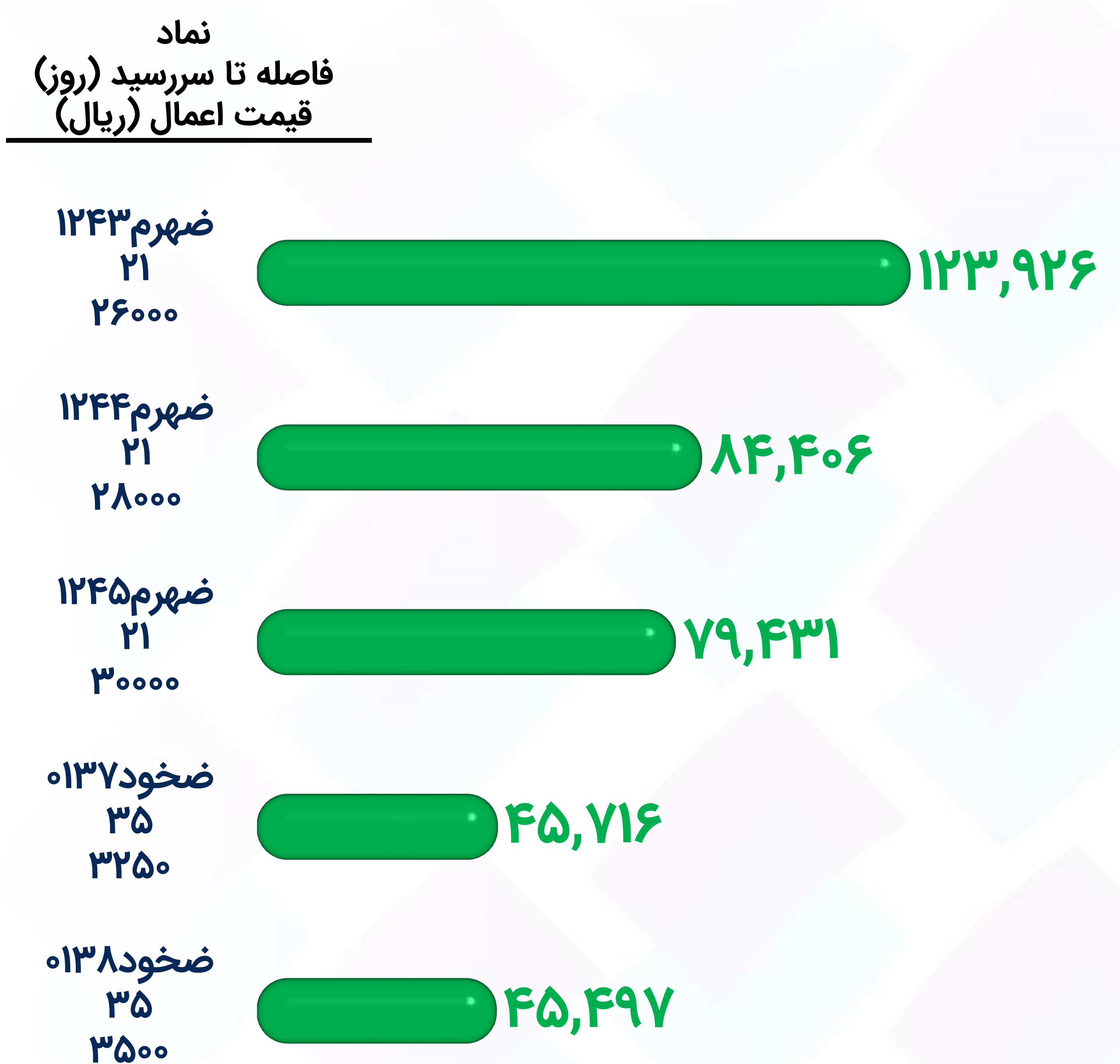
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۷	۱.۱	۲	۱,۲۹۱	۱,۱۴۸	(۱۱.۱%)	۵۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۴%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۱	۱۸.۱	۵۳	۲۴,۸۹۰	۱۹,۹۴۷	(۱۹.۹%)	۳۷۶.۴	۰.۰۰	۳	(۹۴.۳%)
طخود ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۳۵	۲۹.۱	۱۷	۳,۳۶۶	۲,۷۸۳	(۱۷.۳%)	۱۶۳.۷	-۰.۰۱	۲	(۹۰.۸%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۲۱	۳.۷	۸	۴۴۷	۳۹۲	(۱۲.۳%)	۴۹.۰	-۰.۰۷	۱	(۸۳.۲%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۳۵	۱.۵	۴۸	۳,۳۶۶	۲,۹۵۲	(۱۲.۳%)	۶۱.۵	-۰.۰۶	۱۰	(۸۰.۱%)

(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

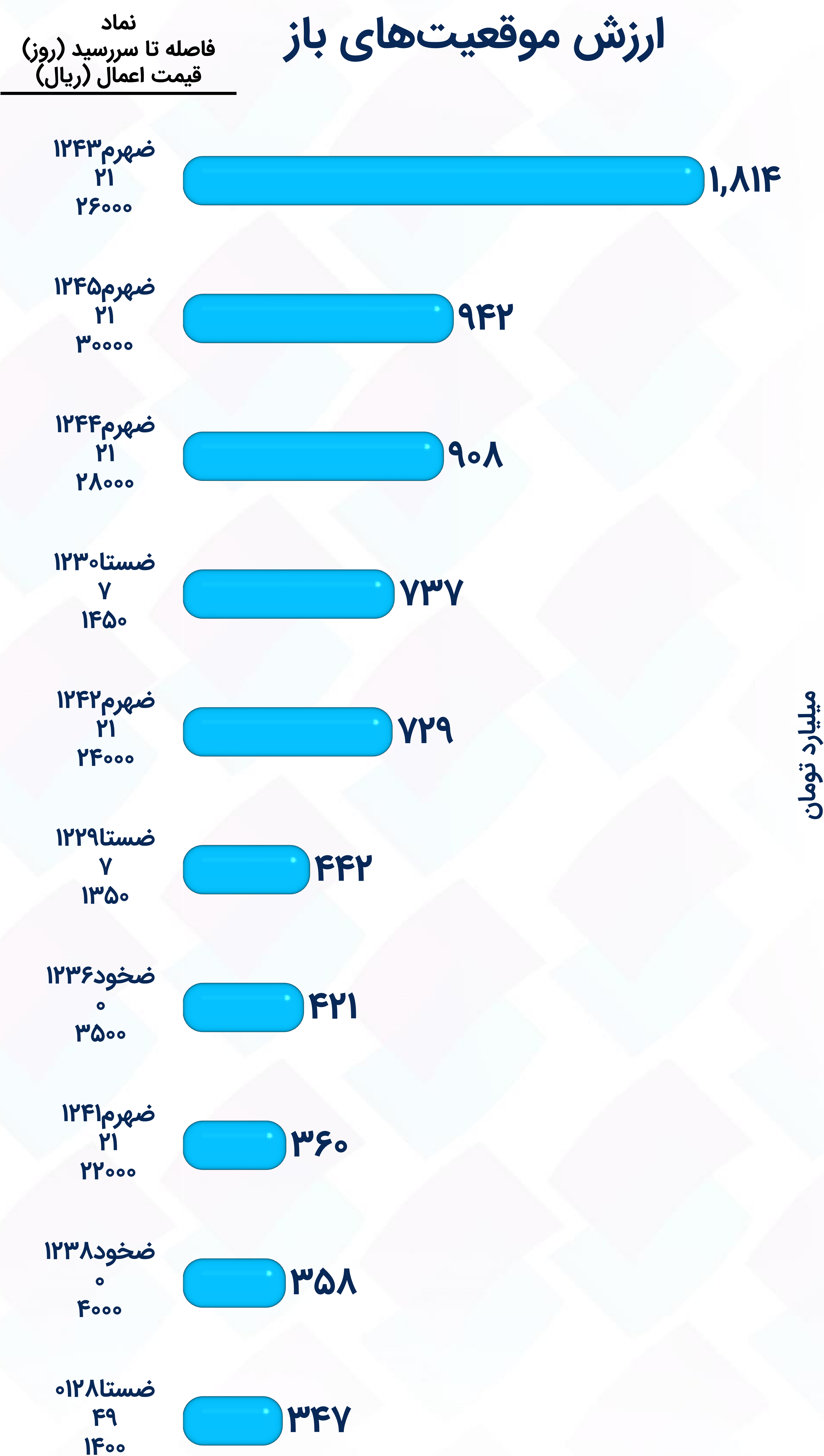
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



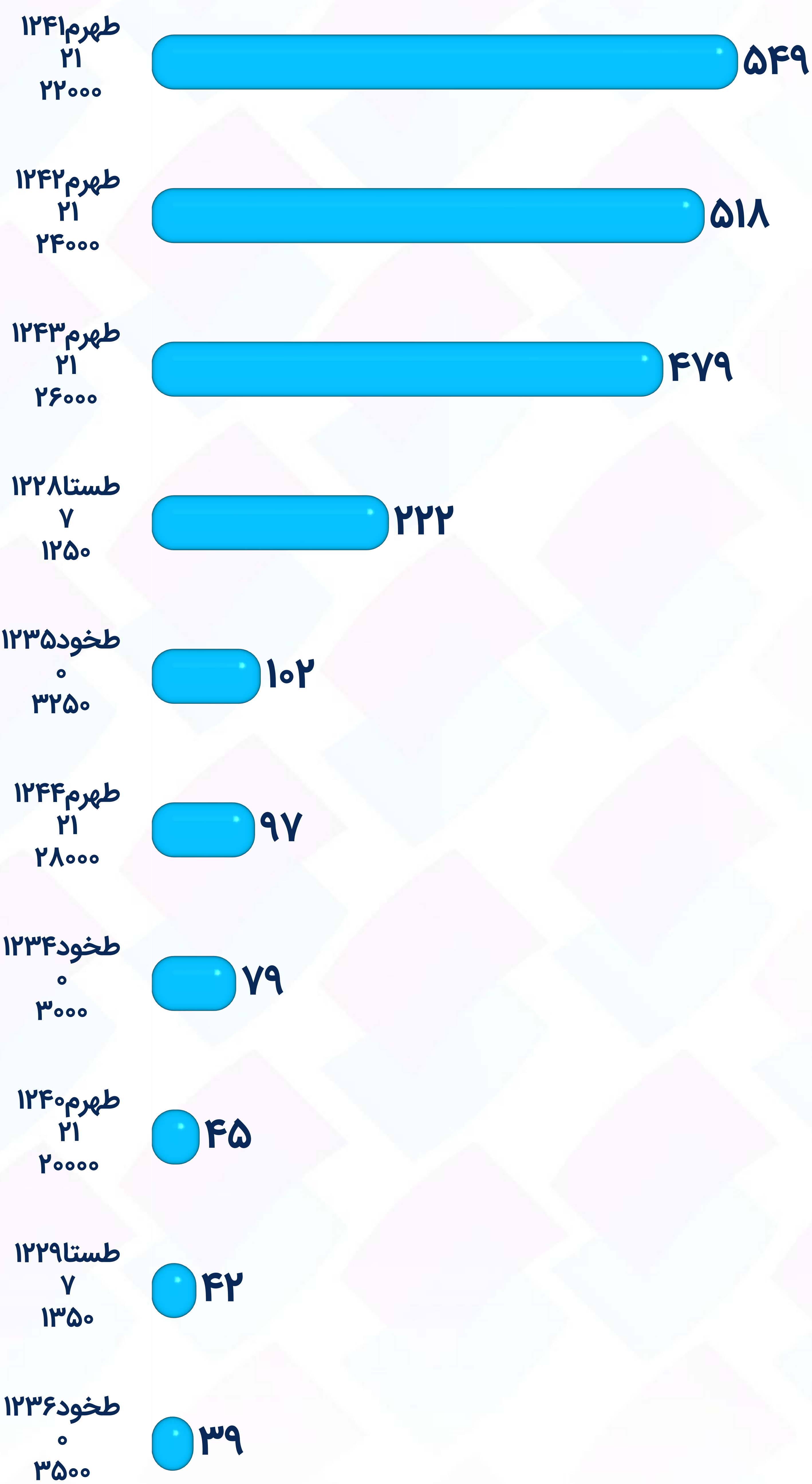
ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

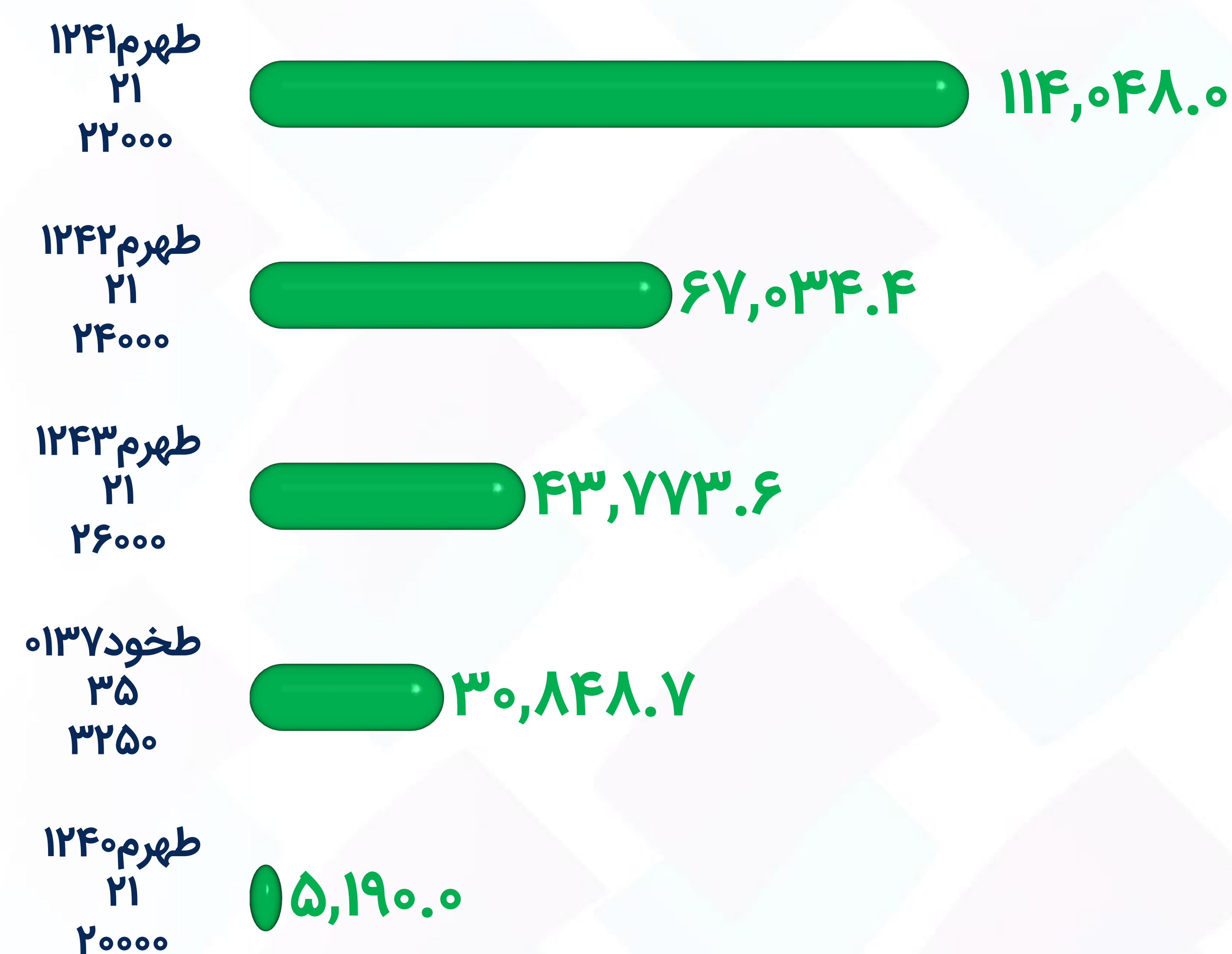
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

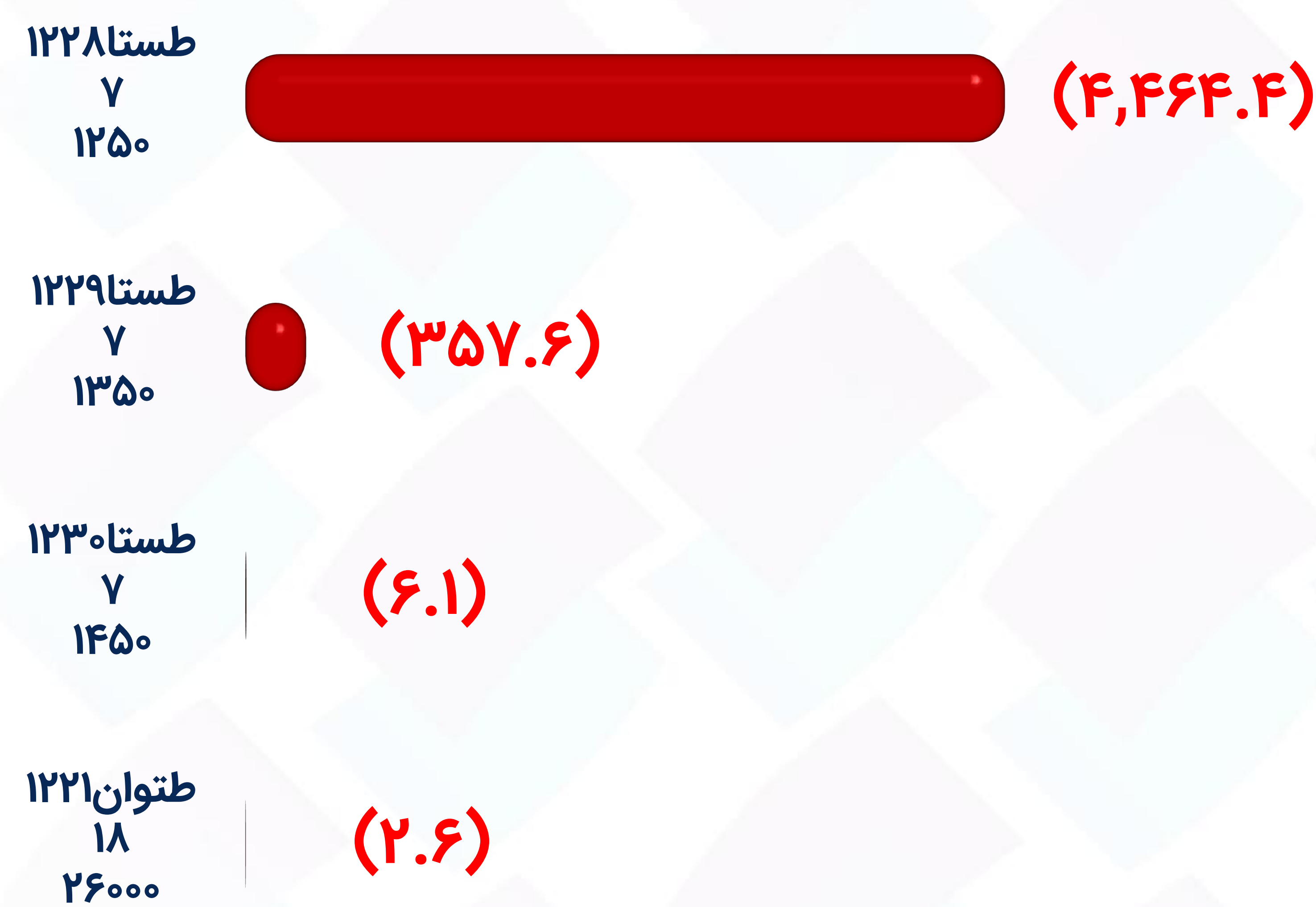
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



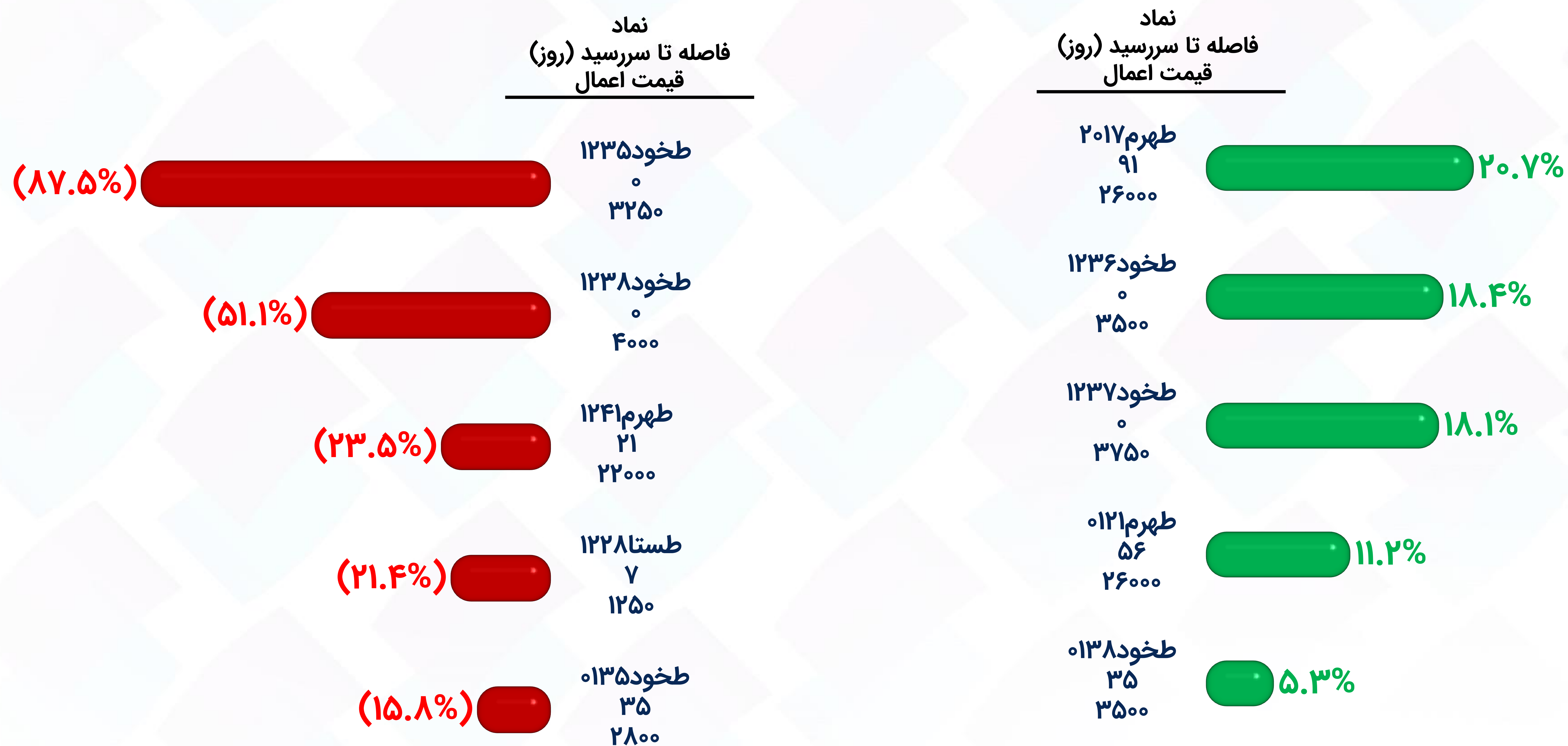
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

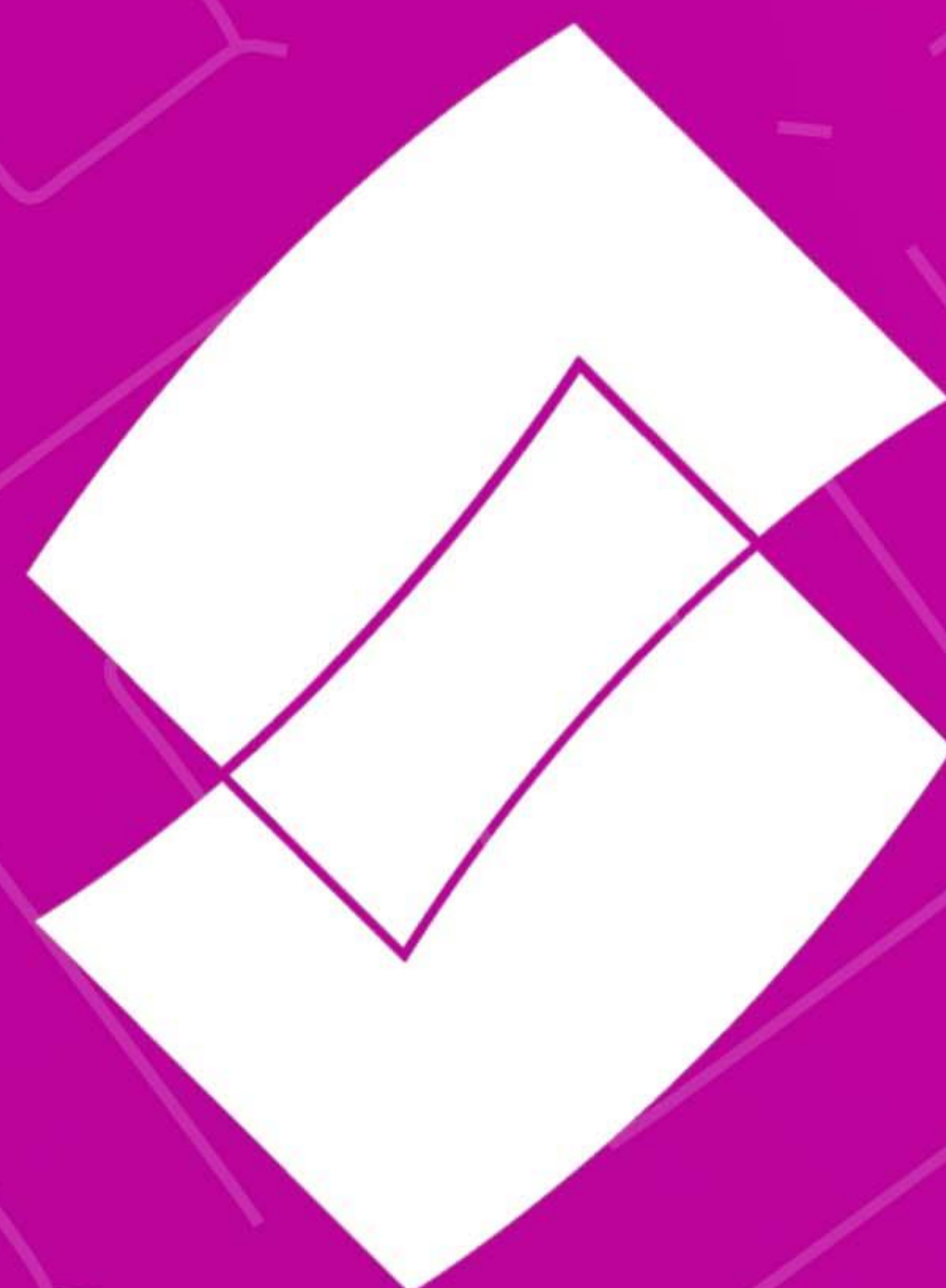
اختیار خرید



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.