

شماره
۴۳۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۵ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

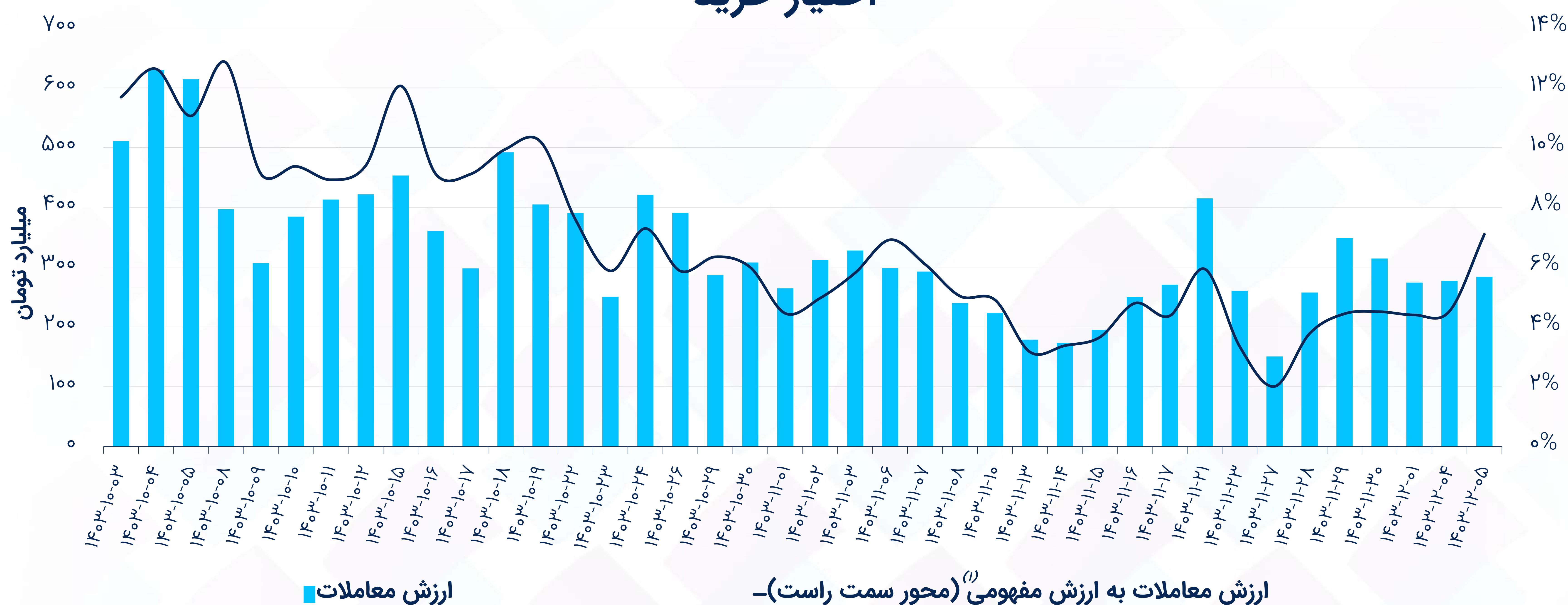




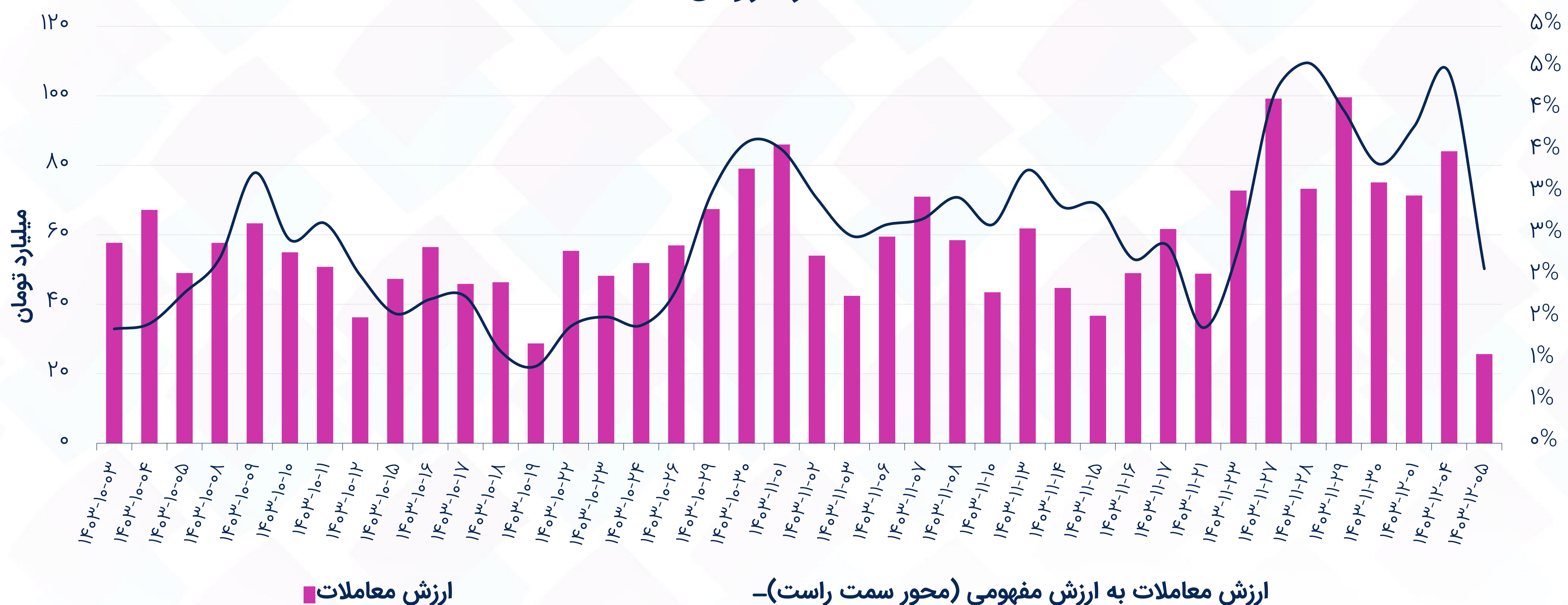
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



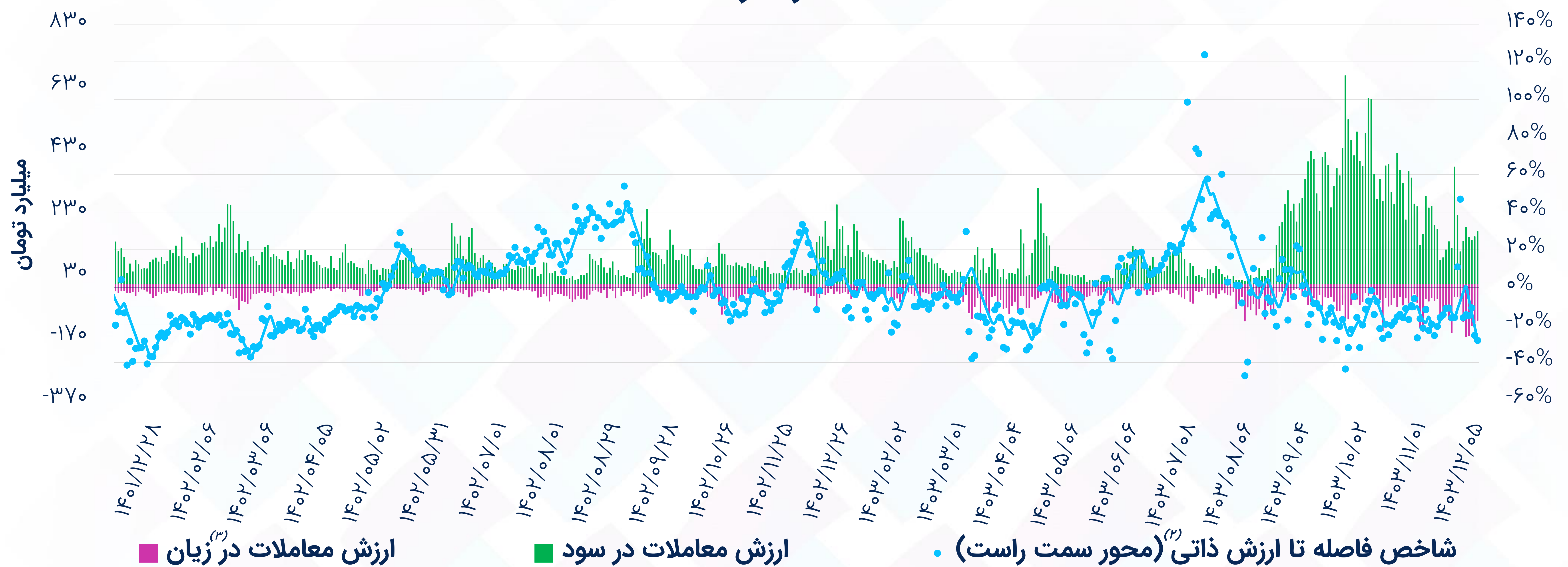
اختیار فروش



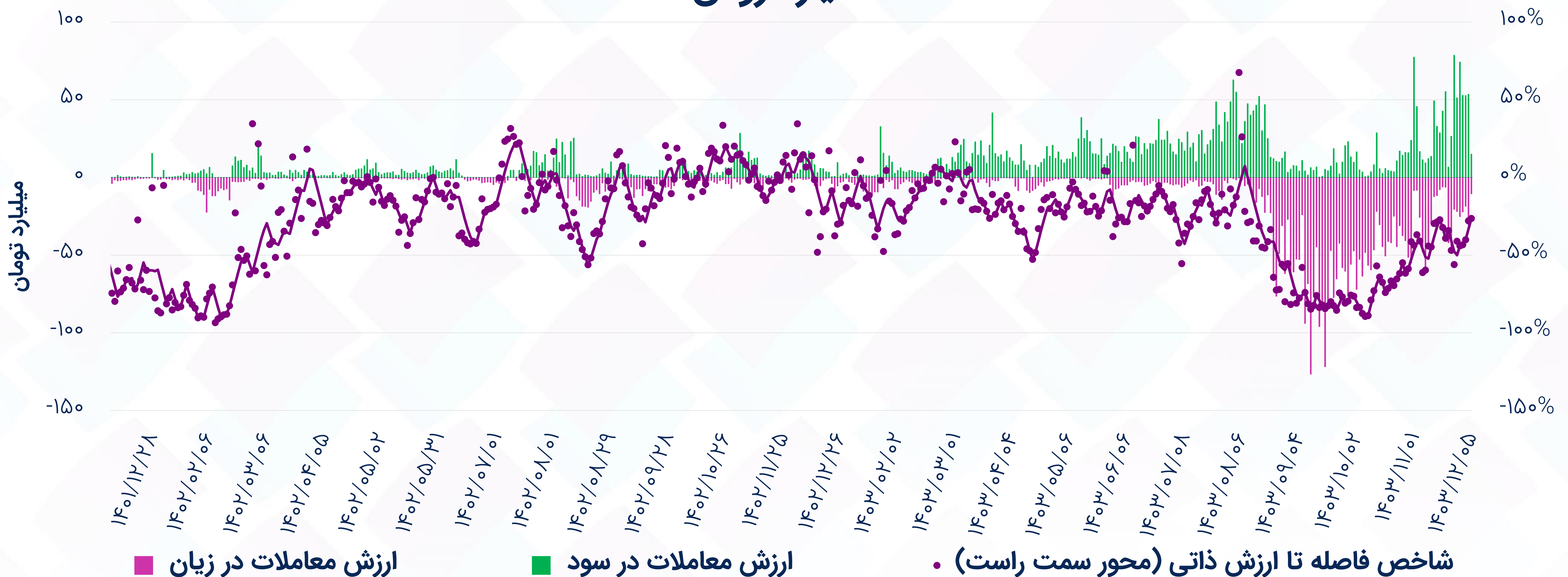
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۸	۱۲۵.۸	۱,۶۲۹.۳	۶۴.۴	۶۱.۴	(۲۸.۰%)
خودرو	۳۴	۸۰.۸	۸۳۵.۸	۵۰.۴	۳۰.۴	(۴۴.۷%)
شستا	۴۸	۴۳.۲	۱,۱۸۷.۲	۲۷.۰	۱۶.۱	(۱۱.۳%)
ذوب	۲۴	۱۲.۳	۱۴۹.۸	۷.۹	۴.۴	(۲۹.۳%)
فزر	۱۴	۴.۹	۲۳.۰	۴.۹	۰.۰	(۴.۷%)
خسپا	۲۳	۳.۹	۶۹.۷	۲.۴	۱.۵	(۲۷.۳%)
بساما	۱۷	۳.۳	۲۳.۶	۳.۳	۰.۰	۴۸.۷%

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	۱۵	۱۵,۰۱۶.۴	۴۴۷,۷۲۳.۹	۱۱,۹۰۰.۶	۳,۱۱۵.۸	(۲۵.۰%)
خودرو	۶	۷,۱۰۲.۴	۴۸۹,۴۸۹.۰	۹۳۰.۳	۶,۱۷۲.۱	(۲۳.۸%)
شستا	۱۰	۳,۴۹۷.۸	۲۸۴,۴۶۷.۰	۲,۲۱۰.۶	۱,۲۸۷.۳	(۳۷.۶%)
ذوب	۳	۲۲.۸	۱,۵۶۶.۰	۹.۵	۱۳.۲	(۵۸.۶%)
توان	۳	۲۰.۹	۱,۵۸۱.۱	۰.۳	۲۰.۶	(۴۹.۲%)
بساما	۳	۱.۲	۱,۳۷۶.۸	۰.۰	۱.۲	(۱۰۰.۰%)
اطلس	۱	۰.۸	۱۵۱.۳	۰.۰	۰.۸	(۴۶.۲%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۲۶۶,۱۲۰

شستا ۱۳۶,۴۶۶

ذوب ۳۸,۱۲۲

خسپا ۲۸,۶۹۲

فولاد ۱۳,۸۴۹

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۳۸۸,۲۲۱.۰)

توان (۷۴۶.۷)

تیام (۱۲۲.۷)

رویین (۷۵.۳)

خاور (۳۴.۶)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۶,۱۳۴

شستا ۲,۵۲۲

خودرو ۱,۱۵۲

ذوب ۶۶۰

وبملت ۴۳۴

آساس ۲۹۹

خسپا ۲۳۷

توان ۲۲۳

وتجارت ۱۵۶

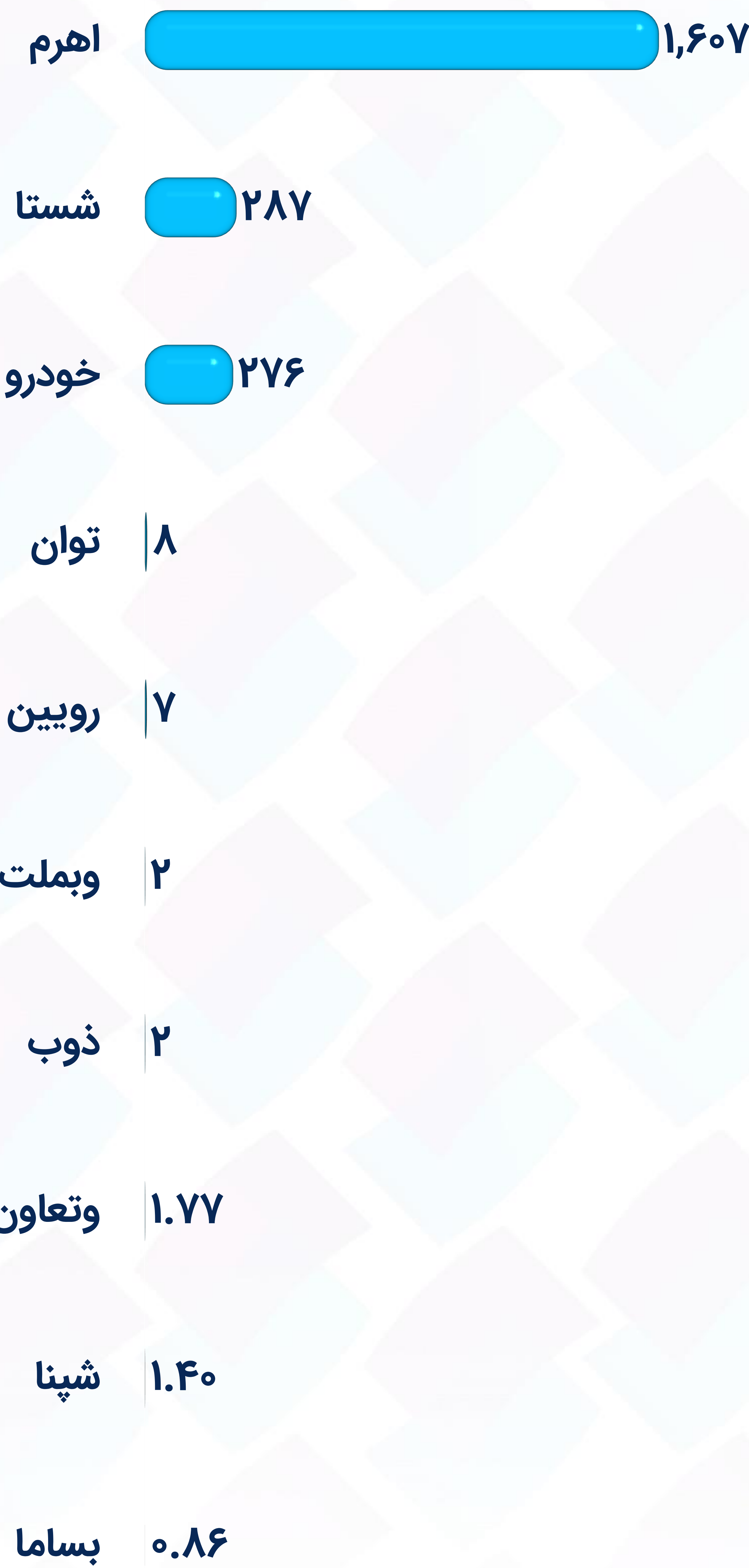
بساما ۱۳۱

میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



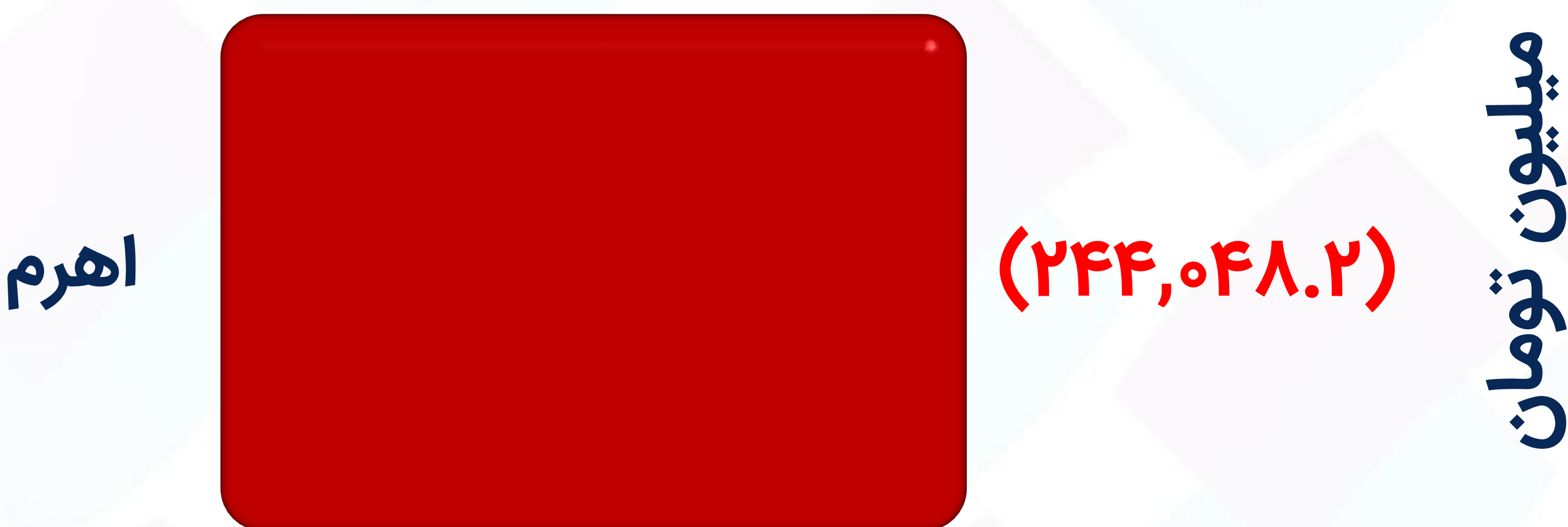
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

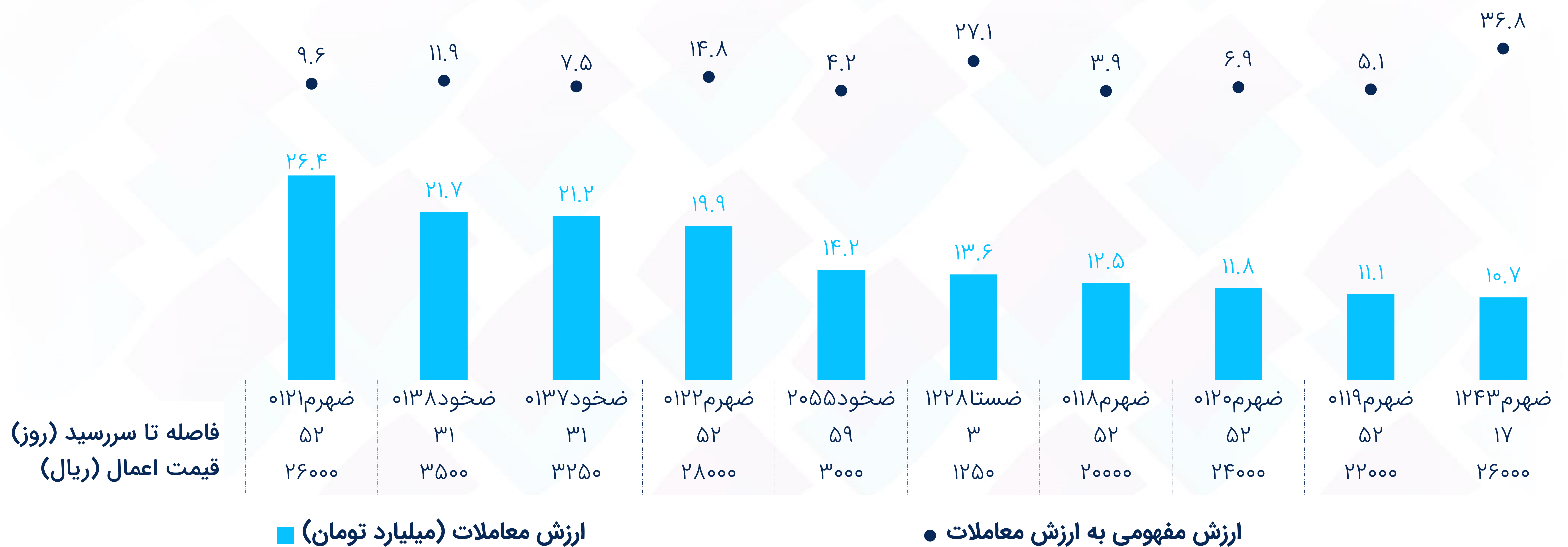
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



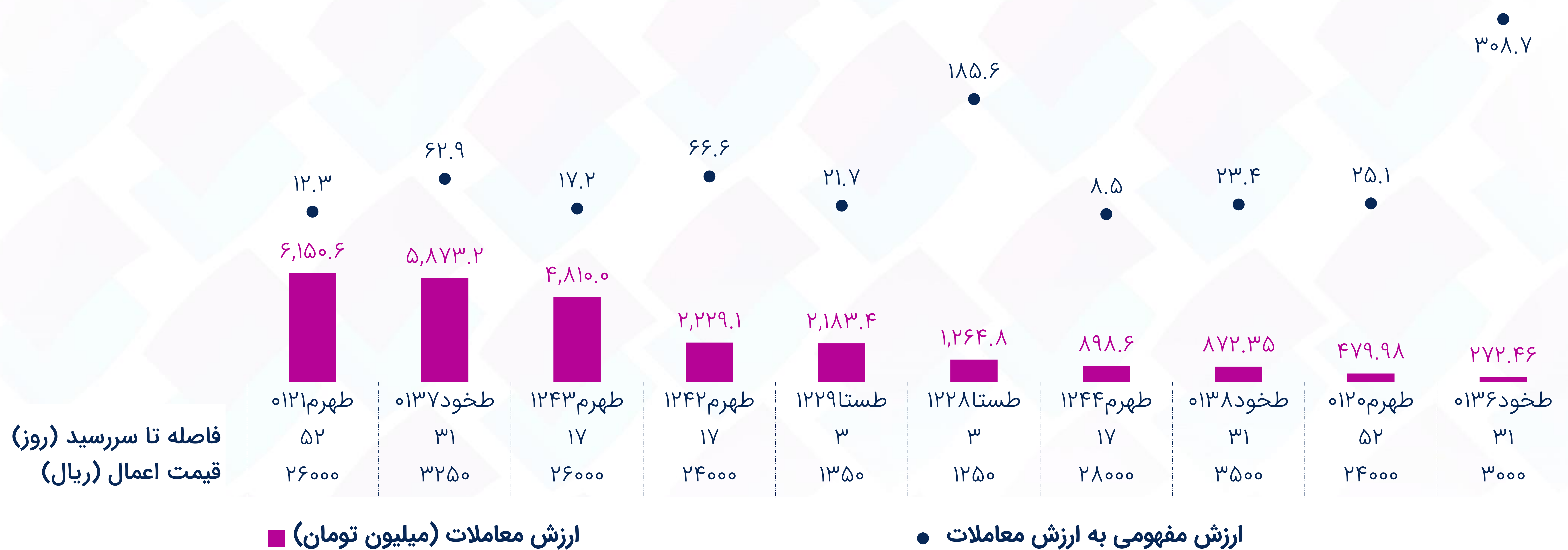
میلیون تومان

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 ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۶۳	۱۷.۵	۳۰۵	۷,۸۲۰	۷,۸۰۰	(۰.۳%)	۲۵.۶	۰.۸۷	۷۶۳	۱۵۰%
ضبساما ۲۱۹	بساما	۷,۰۷۸	۶۳	۴۹.۱	۵۰۰	۷,۸۲۰	۷,۵۷۸	(۳.۱%)	۱۵.۲	۰.۹۶	۱,۱۲۳	۱۲۵%
ضبساما ۲۱۸	بساما	۶,۶۶۲	۶۳	۱۶.۸	۷۰۰	۷,۸۲۰	۷,۳۶۲	(۵.۹%)	۱۰.۵	۰.۹۹	۱,۵۰۸	۱۱۵%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۶۳	۳۴۲.۹	۹۸۲	۷,۸۲۰	۷,۲۲۸	(۷.۶%)	۷.۴	۱.۰۰	۱,۹۰۱	۹۴%
ضبساما ۲۱۴	بساما	۴,۹۹۶	۶۳	۵۱.۰	۲,۱۰۳	۷,۸۲۰	۷,۰۹۹	(۹.۲%)	۳.۴	۱.۰۰	۳,۰۸۶	۴۷%

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
ضذوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۷	۲.۰	۱	۴۵۰	۷۰۱	۵۶%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۳۱	۱۱.۶	۱۸	۳,۳۹۶	۵,۰۱۸	۴۸%	۲۷۸.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۱۰۰	۲۲.۵	۶۳	۱,۲۹۹	۲,۲۶۳	۷۴%	۳۵.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۸۰	۱۶.۵	۱۴	۴۵۰	۸۱۴	۸۱%	۵۸.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۶۶	۳۷.۱	۴۳	۱,۲۹۹	۱,۹۴۳	۵۰%	۴۵.۲	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 ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۳۱	۴۸.۸	۳۱۹	۳,۳۹۶	۴,۱۸۱	۲۳.۱%	۱۳.۱	-۱.۰۰	۹۸۲	۲۰۷.۸%
طخود ۱۳۹۰	خودرو	۳,۷۵۰	۳۱	۹.۱	۲۶۰	۳,۳۹۶	۳,۴۹۰	۲.۸%	۱۳.۴	-۰.۷۶	۲۹۴	۱۳.۲%
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۷	۸۹۸.۶	۲,۹۳۵	۲۴,۹۰۰	۲۵,۰۶۵	۰.۷%	۸.۵	-۰.۸۶	۲,۷۱۲	(۷.۶%)
طخود ۱۳۸۰	خودرو	۳,۵۰۰	۳۱	۸۷۲.۴	۱۴۵	۳,۳۹۶	۳,۳۵۵	(۱.۲%)	۲۳.۱	-۰.۴۹	۱۳۲	(۹.۲%)
طهرم ۱۲۴۲	اهرم	۲۴,۰۰۰	۱۷	۲,۲۲۹.۱	۳۷۴	۲۴,۹۰۰	۲۳,۶۲۶	(۵.۱%)	۶۳.۲	-۰.۲۵	۳۲۹	(۱۲.۰%)

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
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۷	۴.۳	۱۸	۲۴,۹۰۰	۱۹,۹۸۲	(۱۹.۸%)	۱,۱۱۰.۱	۰.۰۰	۲	(۹۰.۲%)
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۳۱	۲۶.۴	۶	۳,۳۹۶	۲,۷۹۴	(۱۷.۷%)	۴۶۵.۷	-۰.۰۱	۱	(۸۵.۰%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۷	۱۳.۱	۴	۴۵۰	۳۹۶	(۱۲.۰%)	۹۹.۰	-۰.۰۵	۱	(۷۸.۰%)
طستا ۱۲۶۰	شستا	۱,۲۰۰	۴۵	۲۱.۹	۱۹	۱,۲۹۹	۱,۱۸۱	(۹.۱%)	۶۲.۲	-۰.۰۹	۵	(۷۱.۳%)
طتوان ۱۲۱۹	توان	۲۲,۰۰۰	۱۴	۲.۲	۸۲	۲۴,۹۸۱	۲۱,۹۱۸	(۱۲.۳%)	۲۶۷.۳	-۰.۰۳	۲۴	(۷۰.۴%)

(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 ۱۷ ۲۶۰۰۰ ۱,۸۰۲

ضهرم ۱۲۴۴ ۱۷ ۲۸۰۰۰ ۱,۰۵۷

ضهرم ۱۲۴۵ ۱۷ ۳۰۰۰۰ ۷۸۳

ضهرم ۱۲۴۲ ۱۷ ۲۴۰۰۰ ۷۰۴

ضستا ۱۲۳۰ ۳ ۱۴۵۰ ۵۹۸

ضستا ۱۲۲۸ ۴۵ ۱۴۰۰ ۴۴۷

ضستا ۱۲۲۹ ۳ ۱۳۵۰ ۴۲۳

ضهرم ۱۲۴۱ ۱۷ ۲۲۰۰۰ ۳۴۱

ضهرم ۱۲۲۲ ۵۲ ۲۸۰۰۰ ۳۰۳

ضهرم ۱۲۱۱ ۵۲ ۲۶۰۰۰ ۳۰۲

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۲۲ ۵۲ ۲۸۰۰۰ ۱۲۶,۱۷۹

ضخود ۱۴۰۰ ۳۱ ۴۰۰۰ ۱۱۷,۸۶۱

ضهرم ۱۲۲۱ ۵۲ ۲۶۰۰۰ ۹۵,۵۵۸

ضهرم ۱۲۲۳ ۵۲ ۳۰۰۰۰ ۷۶,۱۹۱

ضستا ۱۲۲۸ ۴۵ ۱۴۰۰ ۶۳,۲۱۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۴۳ ۱۷ ۲۶۰۰۰ (۴۱۰,۲۰۷.۲)

ضهرم ۱۲۴۲ ۱۷ ۲۴۰۰۰ (۱۳۸,۸۱۶.۰)

ضهرم ۱۲۴۴ ۱۷ ۲۸۰۰۰ (۱۰۱,۰۲۱.۲)

ضهرم ۱۲۴۱ ۱۷ ۲۲۰۰۰ (۵۵,۳۷۴.۰)

ضهرم ۱۲۴۵ ۱۷ ۳۰۰۰۰ (۵۳,۱۵۷.۰)

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

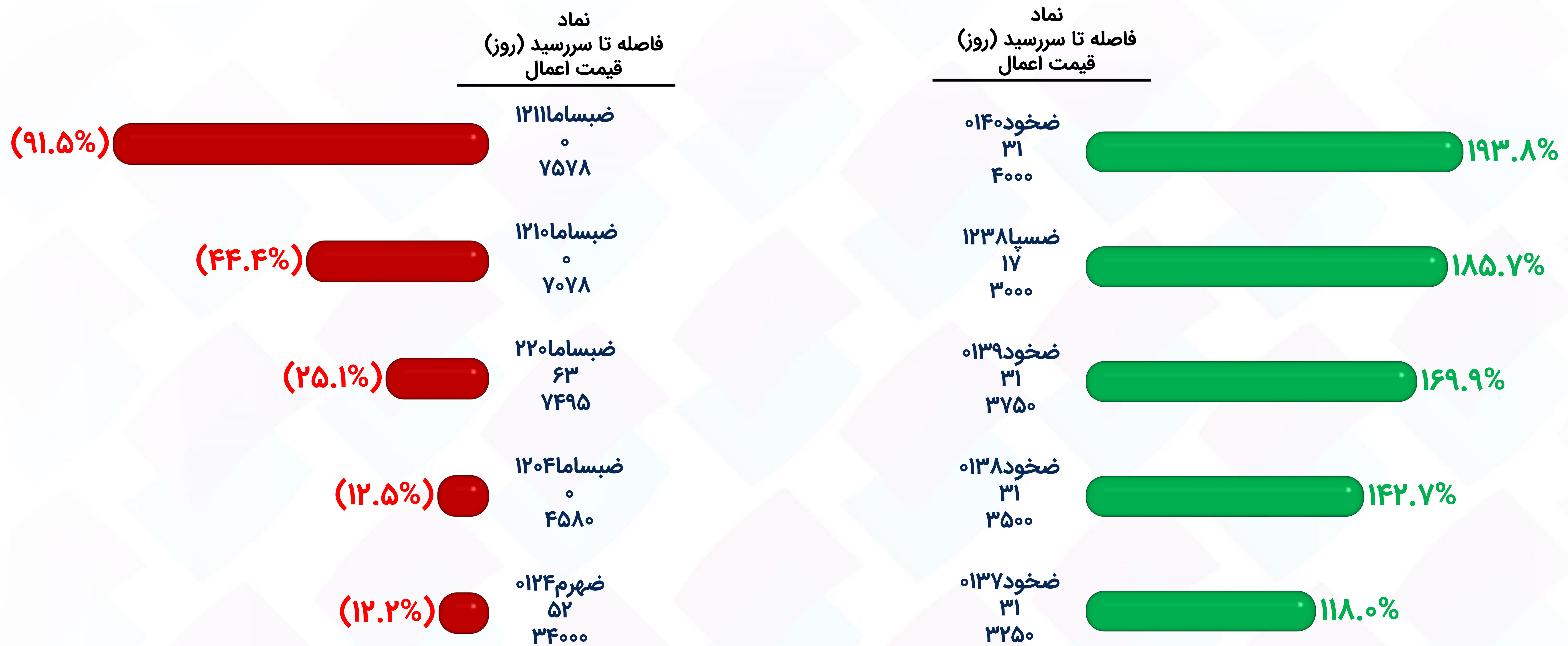
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



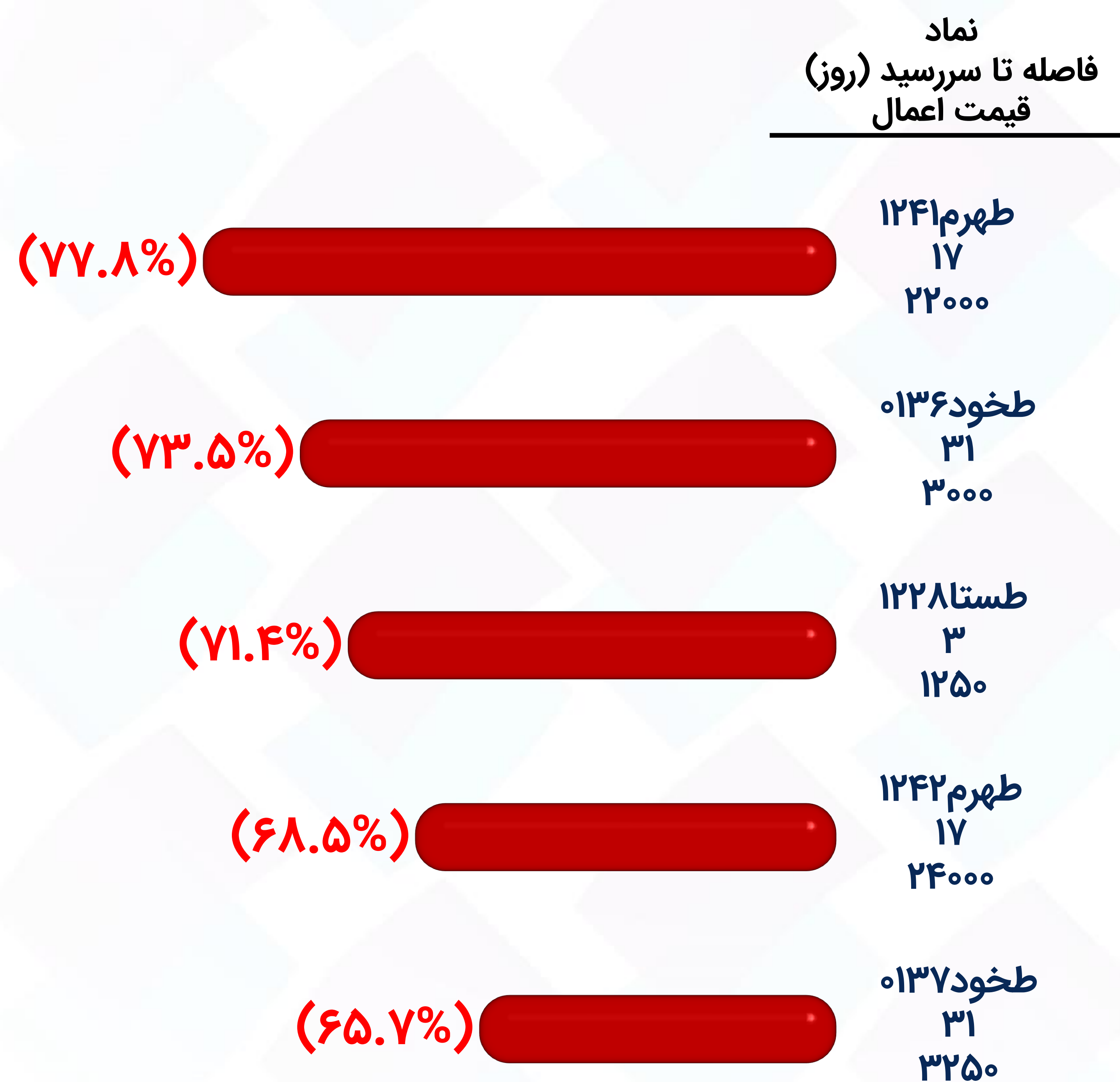
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

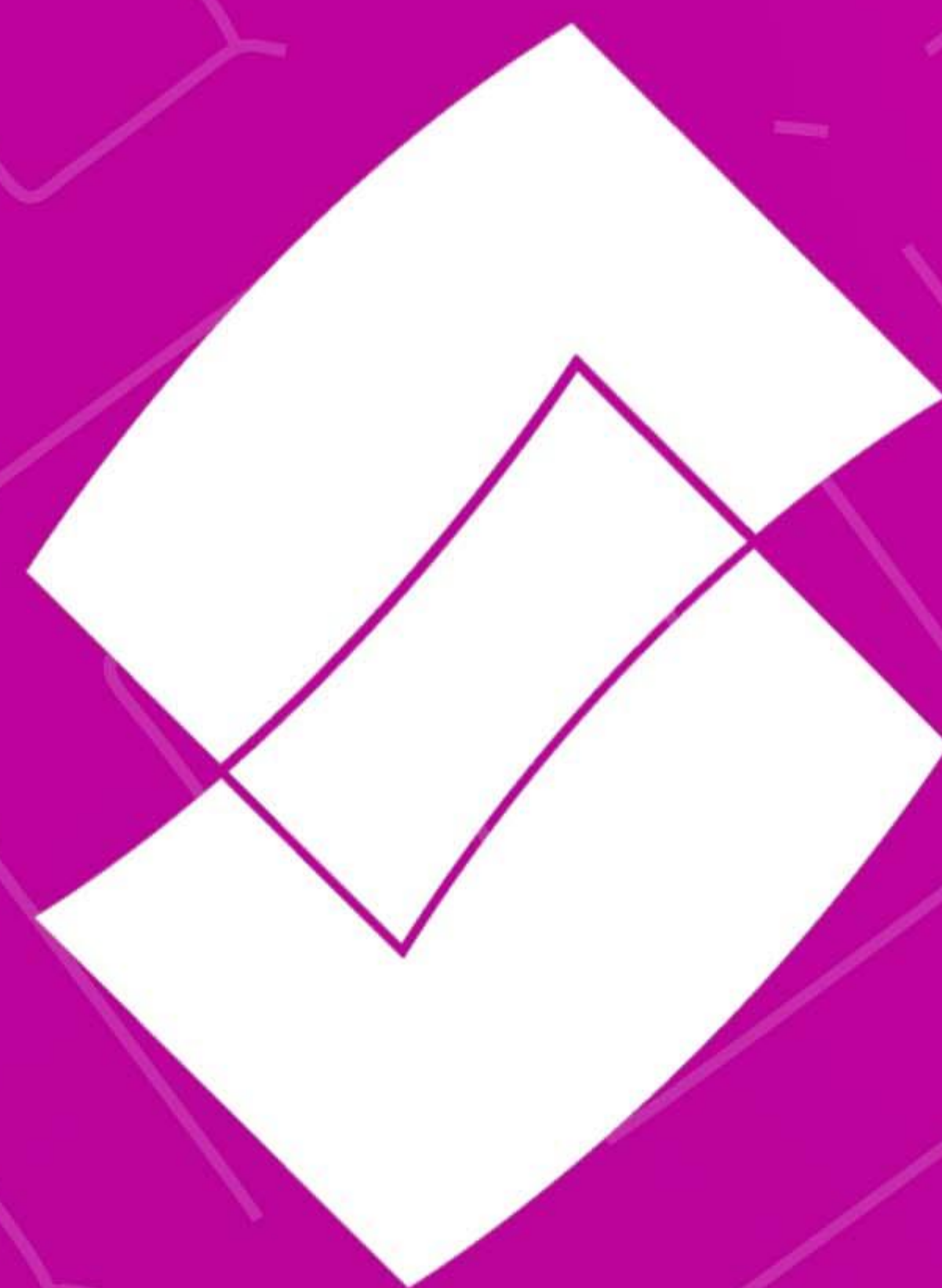
اختیار خرید



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.