

شماره
۴۳۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۶ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





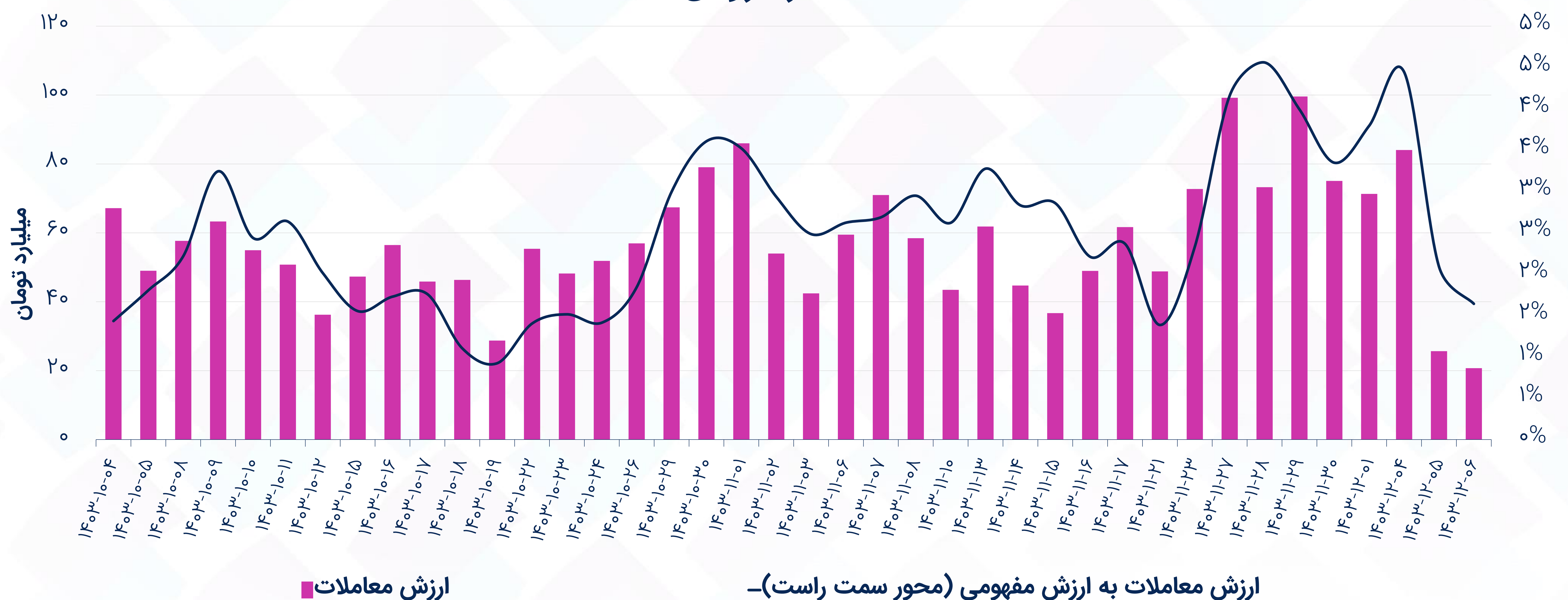
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



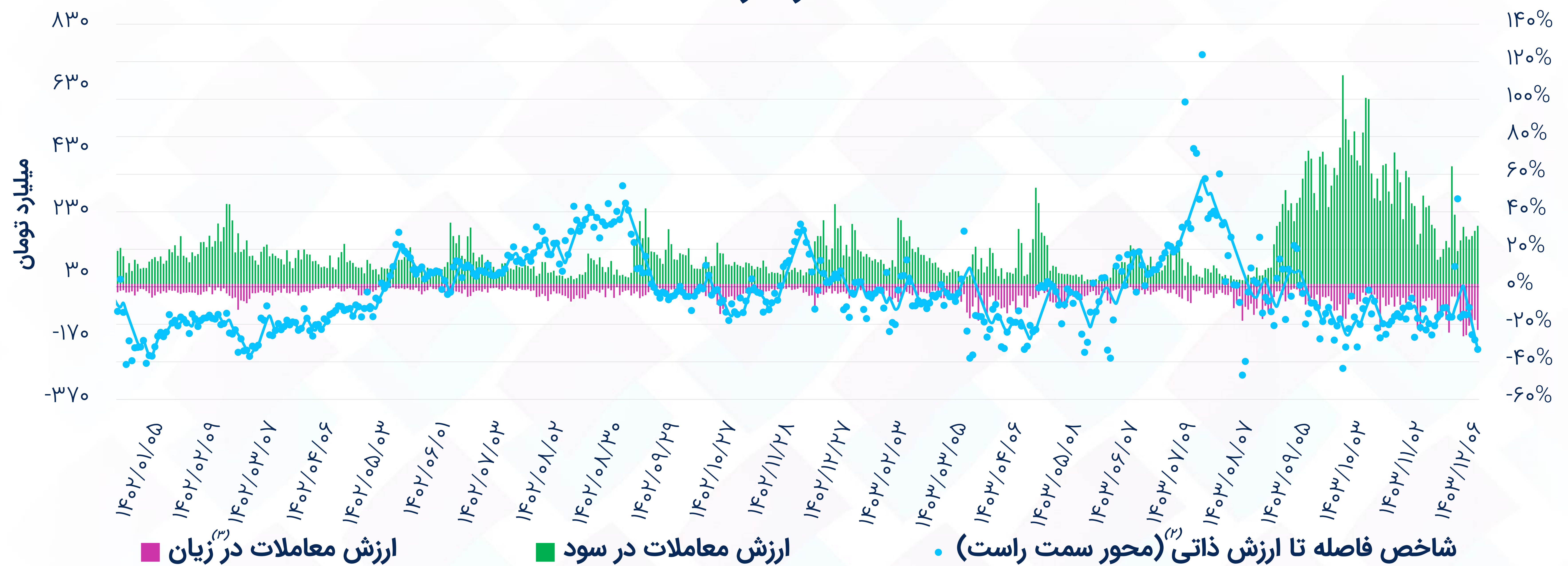
اختیار فروش



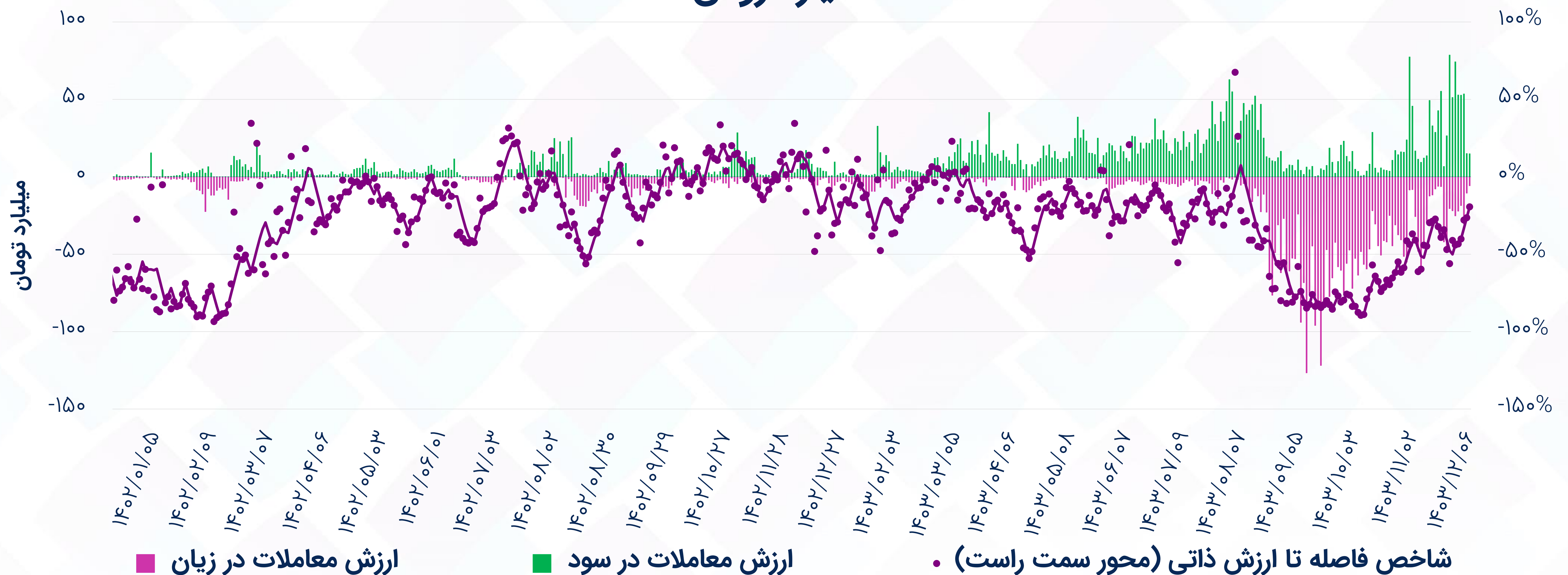
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

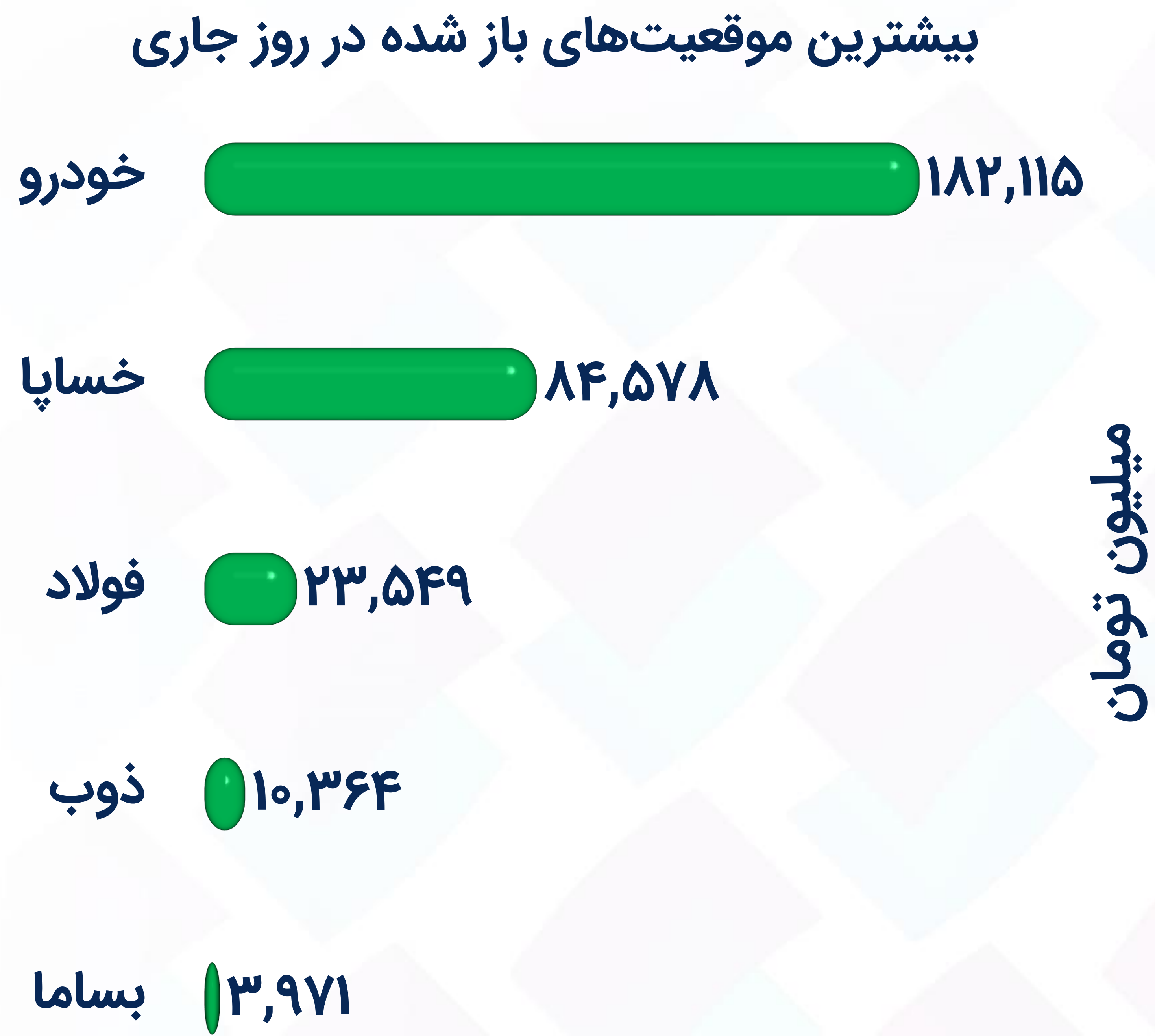
اختیار خرید

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	۴۶	۱۴۷.۸	۱,۵۰۸.۱	۷۲.۶	۷۵.۲	(۲۸.۶%)
خودرو	۳۳	۹۴.۸	۸۱۴.۶	۴۸.۸	۴۶.۰	(۵۴.۱%)
شستا	۵۰	۵۵.۹	۱,۲۹۸.۷	۳۷.۸	۱۸.۱	(۱۵.۶%)
ذوب	۲۶	۱۲.۷	۱۲۳.۵	۸.۸	۴.۰	(۲۴.۵%)
خسپا	۱۸	۱۰.۰	۱۷۶.۸	۷.۷	۲.۳	(۳۹.۷%)
فولاد	۱۰	۱.۸	۲۵.۹	۱.۸	۰.۱	(۱۱.۴%)
فرز	۱۰	۱.۳	۶.۲	۱.۳	۰.۰	۰.۰%

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	۱۶	۸,۴۲۴.۷	۲۷۵,۷۲۰.۸	۷,۱۸۹.۴	۱,۲۳۵.۳	(۲۶.۰%)
خودرو	۷	۷,۵۳۰.۶	۵۲۱,۹۹۴.۸	۳,۴۴۶.۸	۴,۰۸۳.۸	(۱۶.۲%)
شستا	۶	۴,۷۰۶.۱	۴۵۷,۷۷۰.۸	۴,۲۴۱.۳	۴۶۴.۷	(۱۲.۶%)
وتعاون	۱	۱۷.۱	۱,۸۸۱.۰	۰.۰	۱۷.۱	(۵۶.۹%)
ذوب	۴	۱۶.۹	۳,۲۹۴.۳	۲.۸	۱۴.۱	(۷۲.۶%)
شپنا	۲	۱۳.۱	۷۰۱.۰	۱۳.۱	۰.۰	۶۷.۷%
توان	۳	۱۲.۲	۸۱۹.۷	۹.۰	۳.۲	(۱۵.۷%)

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



میلیون تومان



میلیارد تومان



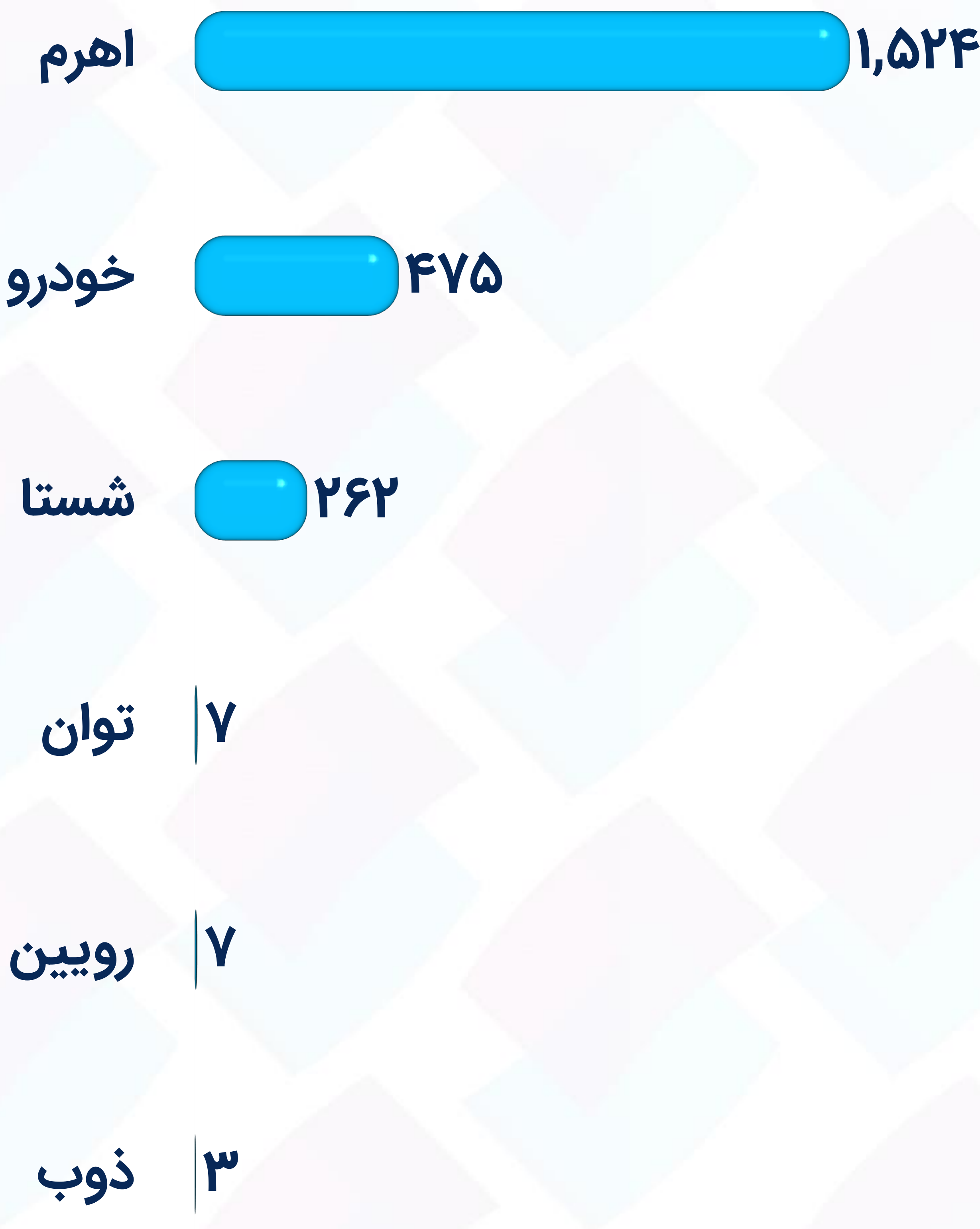
میلیون تومان



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

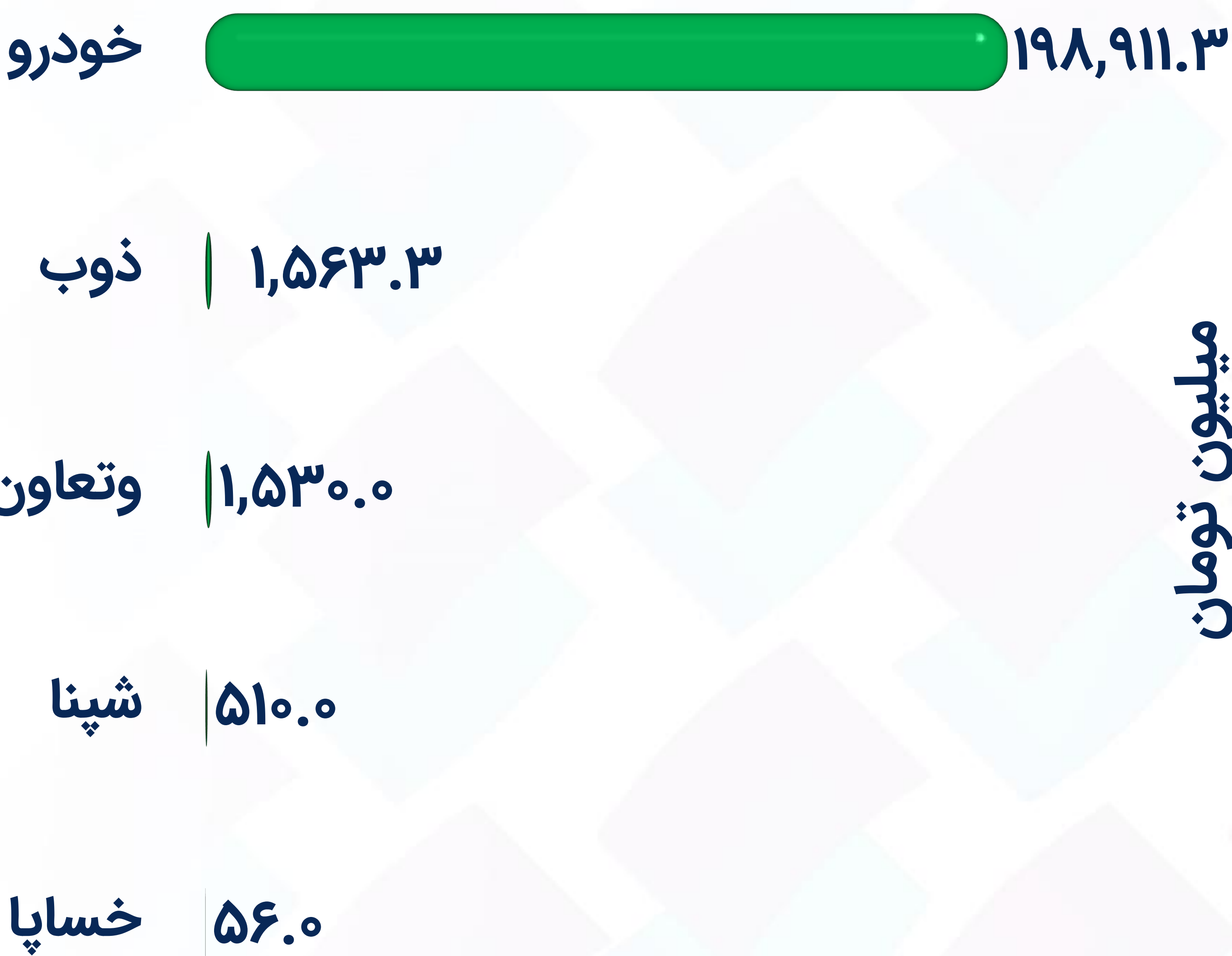
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



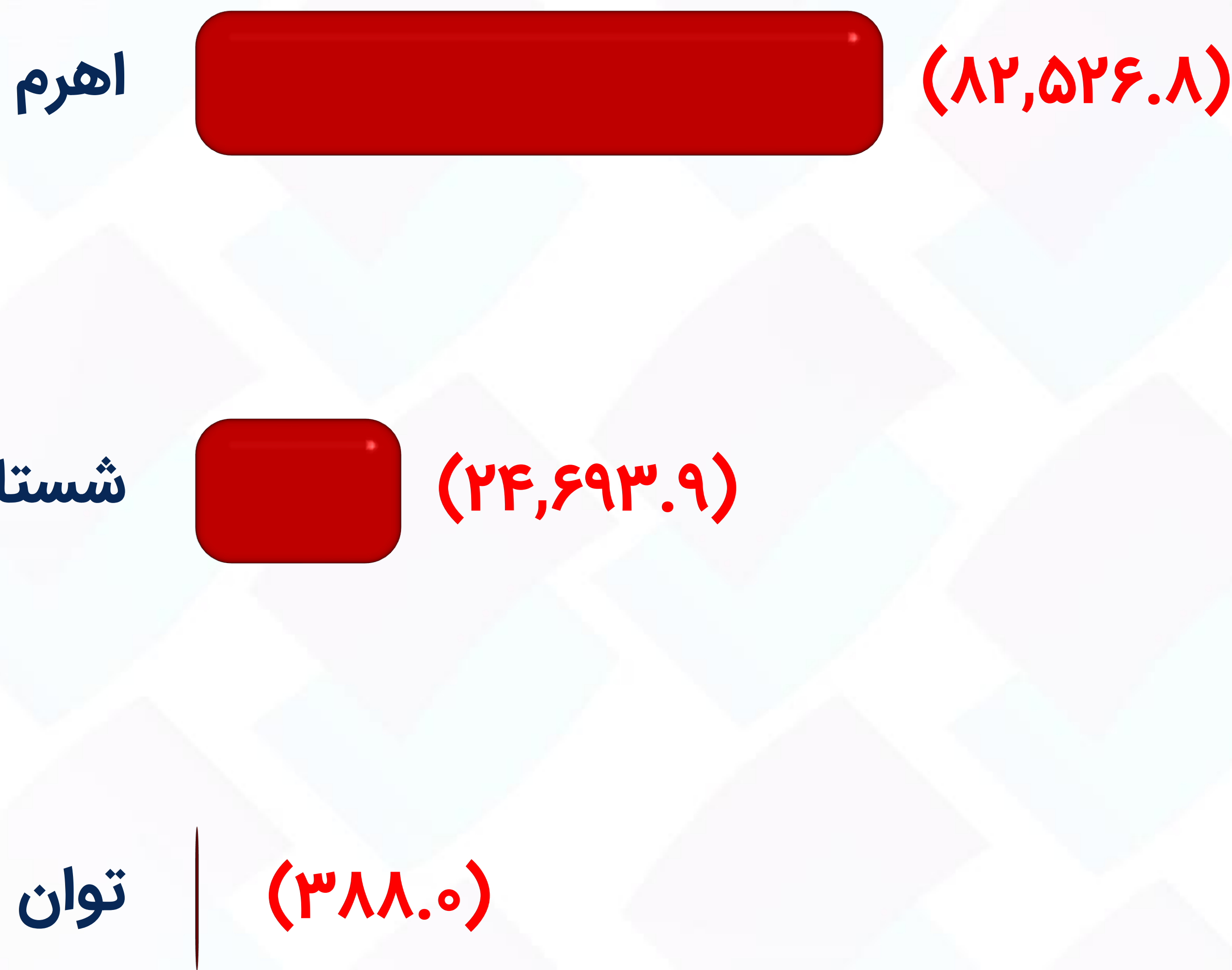
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

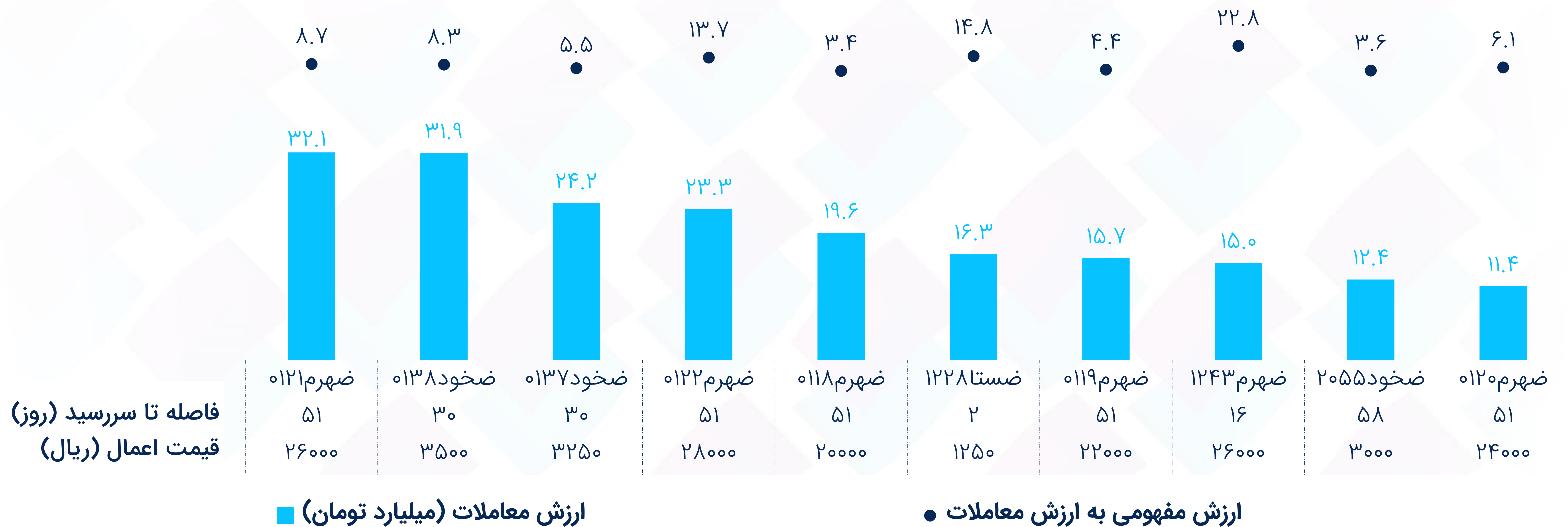
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضاساس ۱۲۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۲۰	۱۲.۴	۶۵۳	۴۹,۳۶۵	۵۰,۶۵۳	۲.۶%	۷۷.۶	۰.۵۶	۱,۳۸۵	۱۱۲%
ضفرز ۱۲۰۶	فرز	۴۰,۰۰۰	۶	۱.۶	۵,۳۶۶	۴۸,۳۵۰	۴۵,۳۶۶	(۶.۲%)	۸.۵	۱.۰۰	۸,۶۲۶	۶۱%
ضکاریس ۱۲۱۴	کاریس	۳۰,۰۰۰	۶	۱۴.۰	۱,۴۰۰	۳۱,۸۵۰	۳۱,۴۰۰	(۱.۴%)	۲۲.۴	۰.۹۸	۲,۰۶۳	۴۷%
ضبساما ۲۱۴	بساما	۴,۹۹۶	۶۲	۲۷.۰	۲,۲۰۲	۷,۷۰۰	۷,۱۹۸	(۶.۵%)	۳.۳	۱.۰۰	۲,۹۶۰	۳۴%
ضثمین ۱۰۶	ثمین	۳۲,۰۰۰	۵۵	۲.۵	۵۰۰	۲۹,۴۳۷	۳۲,۵۰۰	۱۰.۴%	۶۵.۰	۰.۳۶	۶۴۱	۲۸%

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	۲	۳.۴	۱	۱,۳۳۶	۱,۶۵۱	۲۴%	۱,۶۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۶	۱.۵	۱	۴۶۳	۷۰۱	۵۱%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۱۴۲۰	خودرو	۵,۰۰۰	۳۰	۵۰.۹	۱۸	۳,۴۷۰	۵,۰۱۸	۴۵%	۲۷۸.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۱۶۰	ذوب	۷۰۰	۴۴	۳.۷	۶	۴۶۳	۷۰۶	۵۲%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹۹	۳۶.۵	۶۱	۱,۳۳۶	۲,۲۶۱	۶۹%	۳۷.۱	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
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۵,۰۰۰	۷۲	۱۳.۱	۹۸	۴,۹۶۳	۴,۹۰۲	(۱.۲%)	۵۰.۰	-۰.۳۲	۱۶۵	۶۷.۹%
طخود ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۳۰	۴۷.۰	۷۰۱	۳,۴۷۰	۳,۷۹۹	۹.۵%	۵.۴	-۰.۹۹	۹۱۴	۳۰.۴%
طخود ۱۳۹۰	خودرو	۳,۷۵۰	۳۰	۲۶۳.۳	۱۸۶	۳,۴۷۰	۳,۵۶۴	۲.۷%	۱۹.۲	-۰.۷۰	۲۴۱	۲۹.۶%
طخود ۱۳۸۰	خودرو	۳,۵۰۰	۳۰	۳,۱۳۶.۵	۹۲	۳,۴۷۰	۳,۴۰۸	(۱.۸%)	۳۷.۰	-۰.۴۱	۹۷	۵.۸%
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۶	۸۴۳.۰	۲,۰۰۹	۲۵,۶۴۰	۲۵,۹۹۱	۱.۴%	۱۲.۹	-۰.۷۹	۲,۱۱۰	۵.۰%

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	۱۶	۶.۲	۱۲	۲۵,۶۴۰	۱۹,۹۸۸	(۲۲.۰%)	۱,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۷.۰%)
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۳۰	۴.۷	۶	۳,۴۷۰	۲,۷۹۴	(۱۹.۵%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۳.۸%)
طستا ۱۲۲۸	شستا	۱,۲۵۰	۲	۲۸۷.۸	۲	۱,۳۳۶	۱,۲۴۸	(۶.۶%)	۶۲۴.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۳.۱%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۶	۱۴.۱	۲	۴۶۳	۳۹۸	(۱۴.۰%)	۱۹۹.۰	-۰.۰۲	۰	(۸۳.۴%)
طهرم ۱۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۵۱	۱.۰	۷۰	۲۵,۶۴۰	۱۹,۹۳۰	(۲۲.۳%)	۲۸۴.۷	-۰.۰۱	۱۲	(۸۳.۰%)

(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

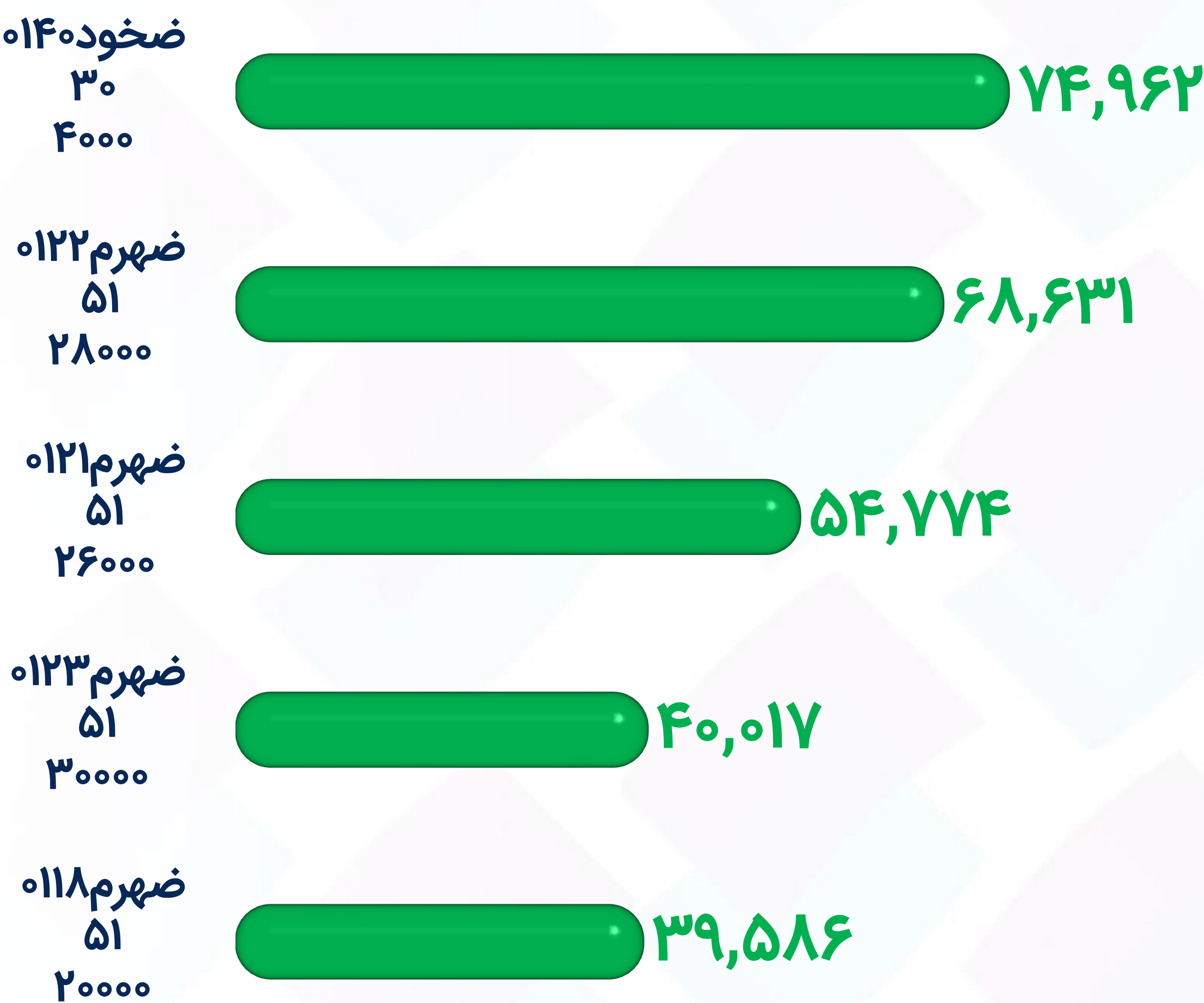
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

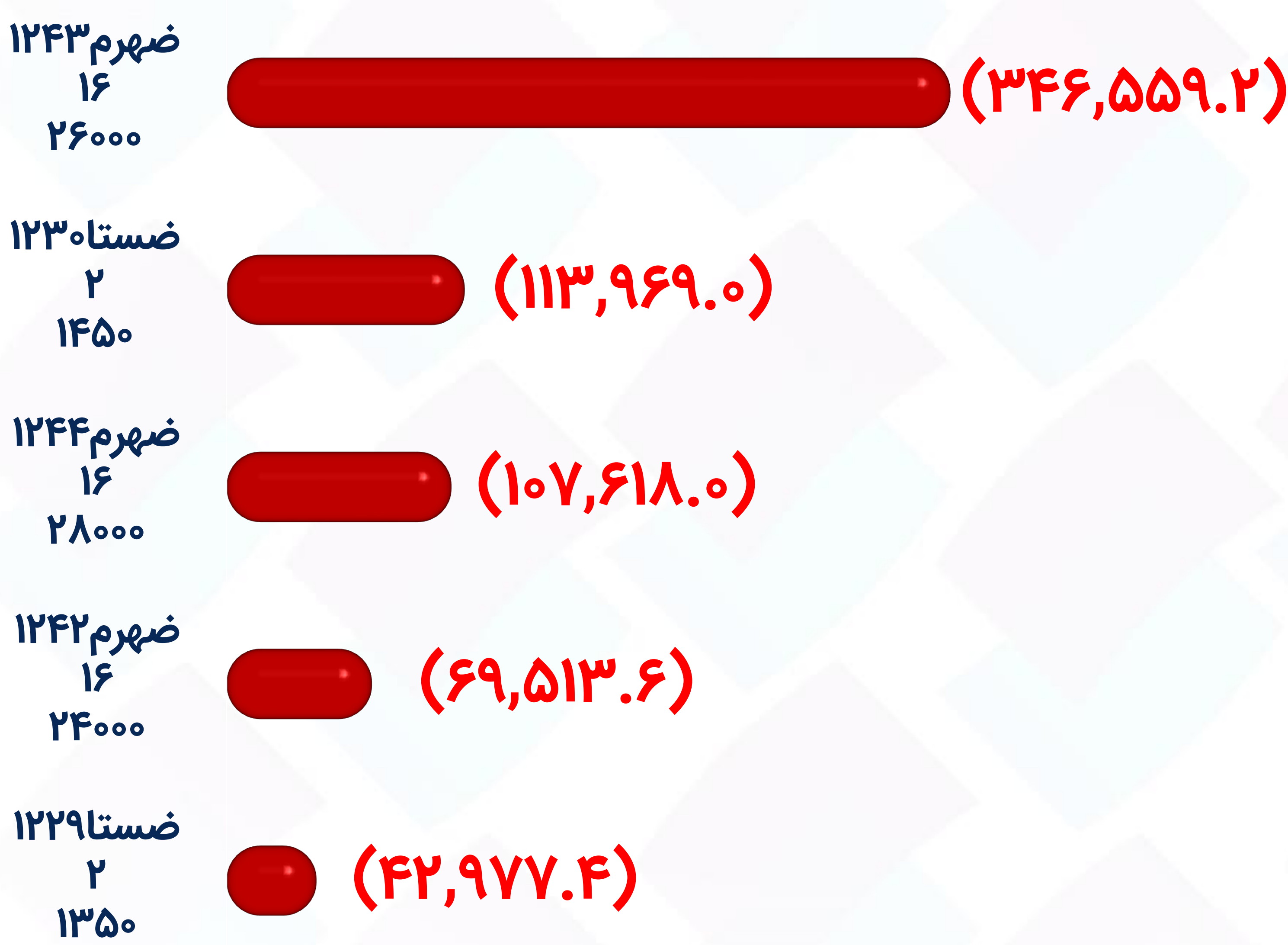
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

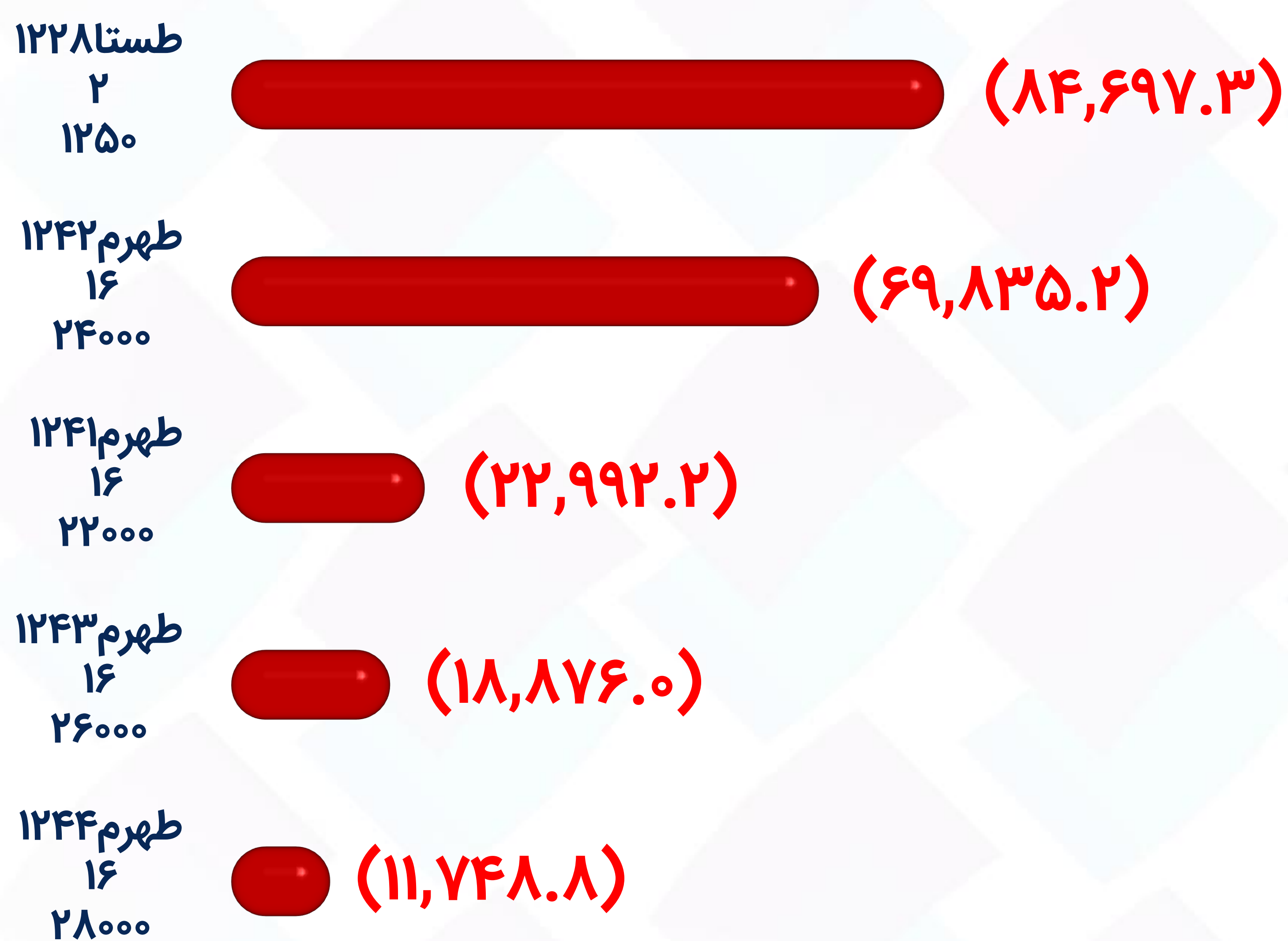
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

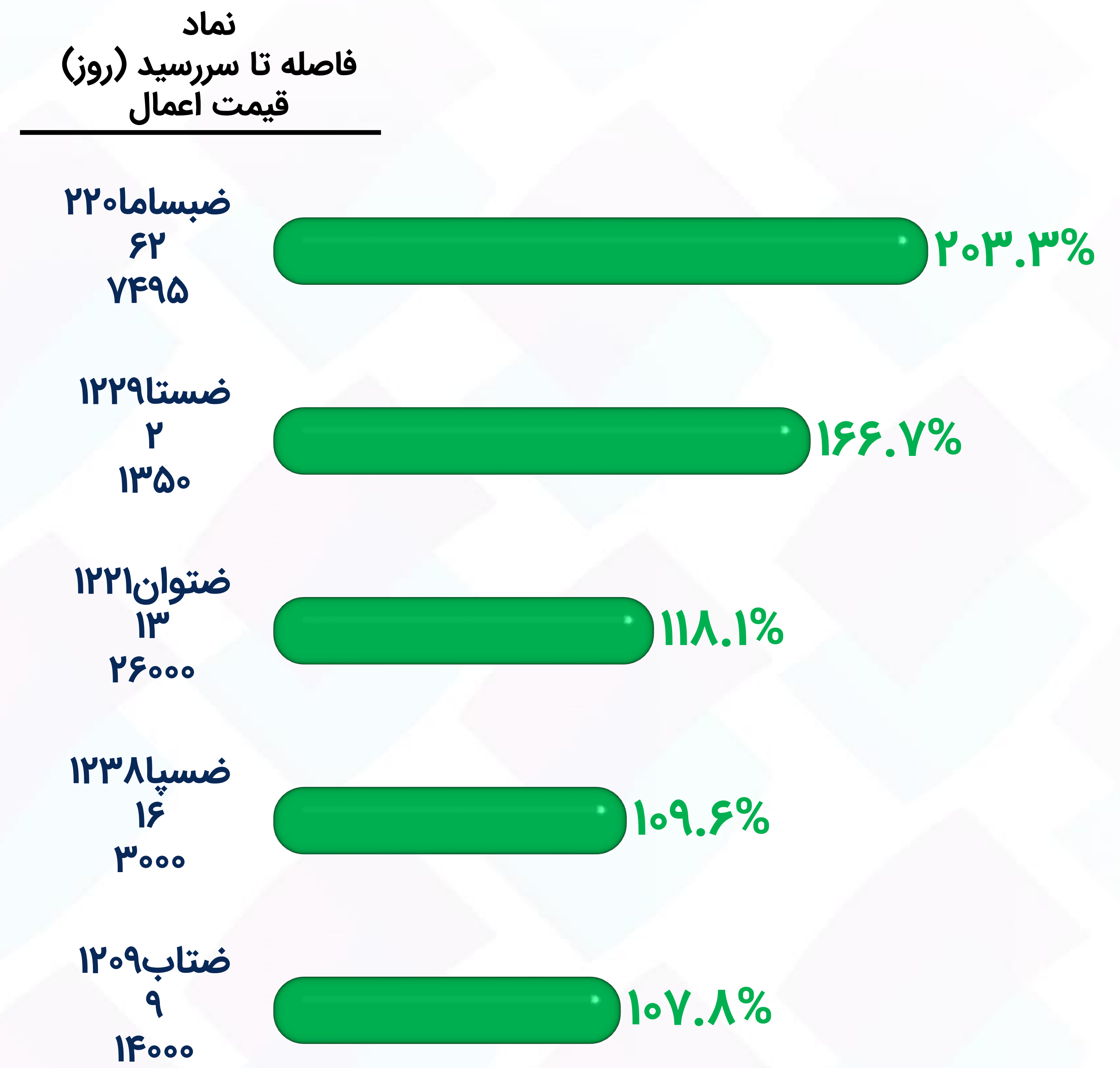
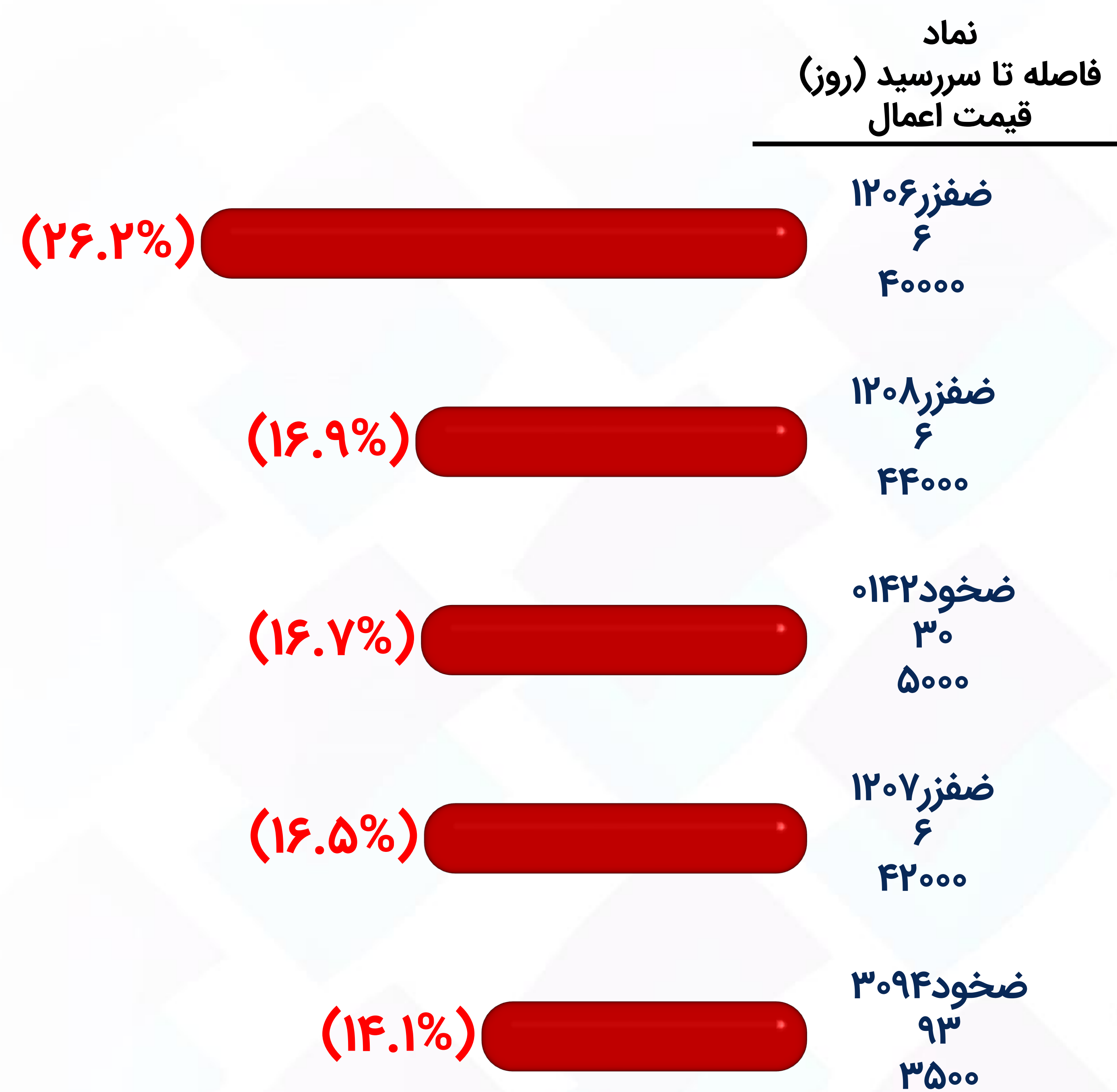
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



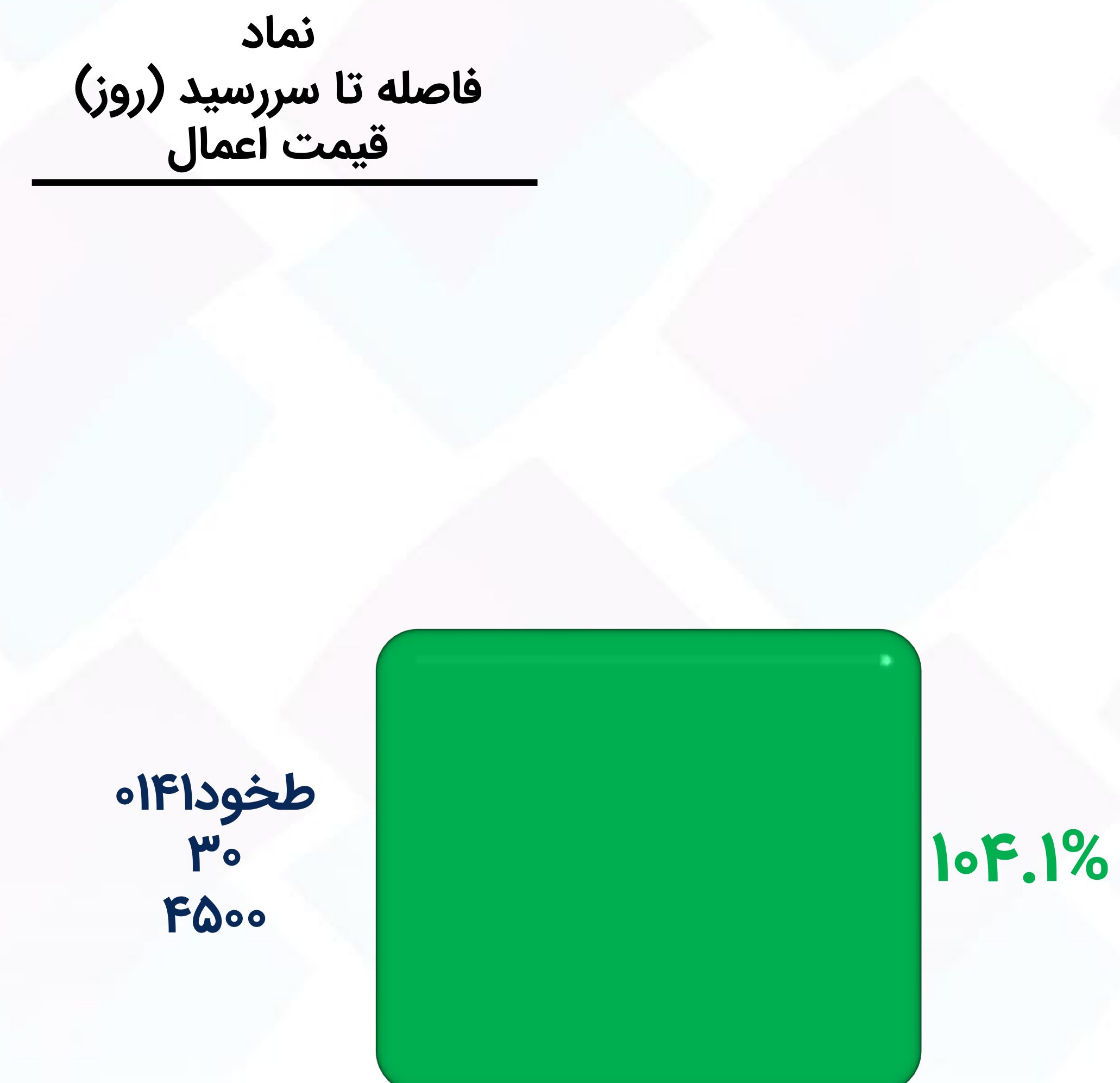
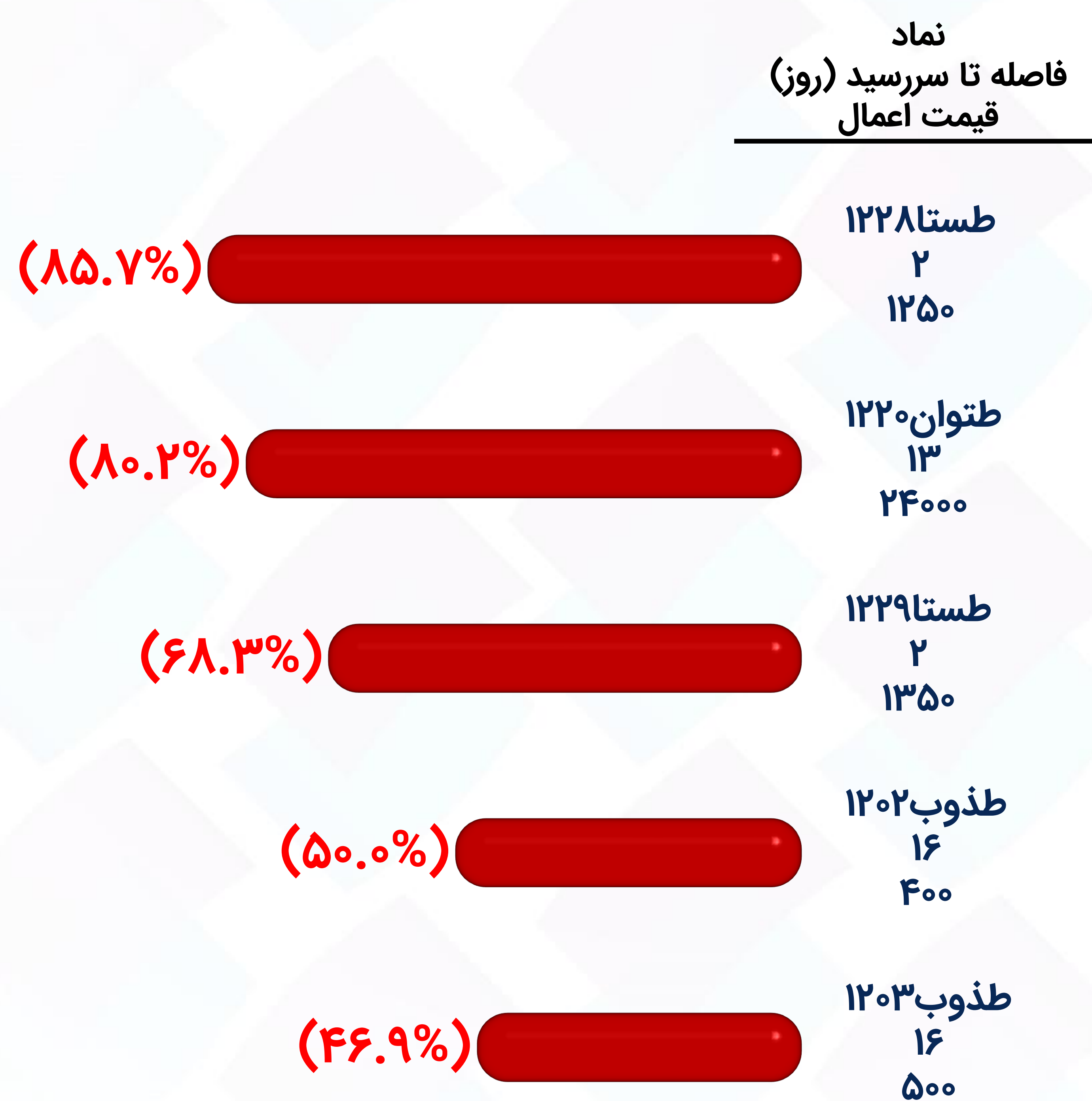
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

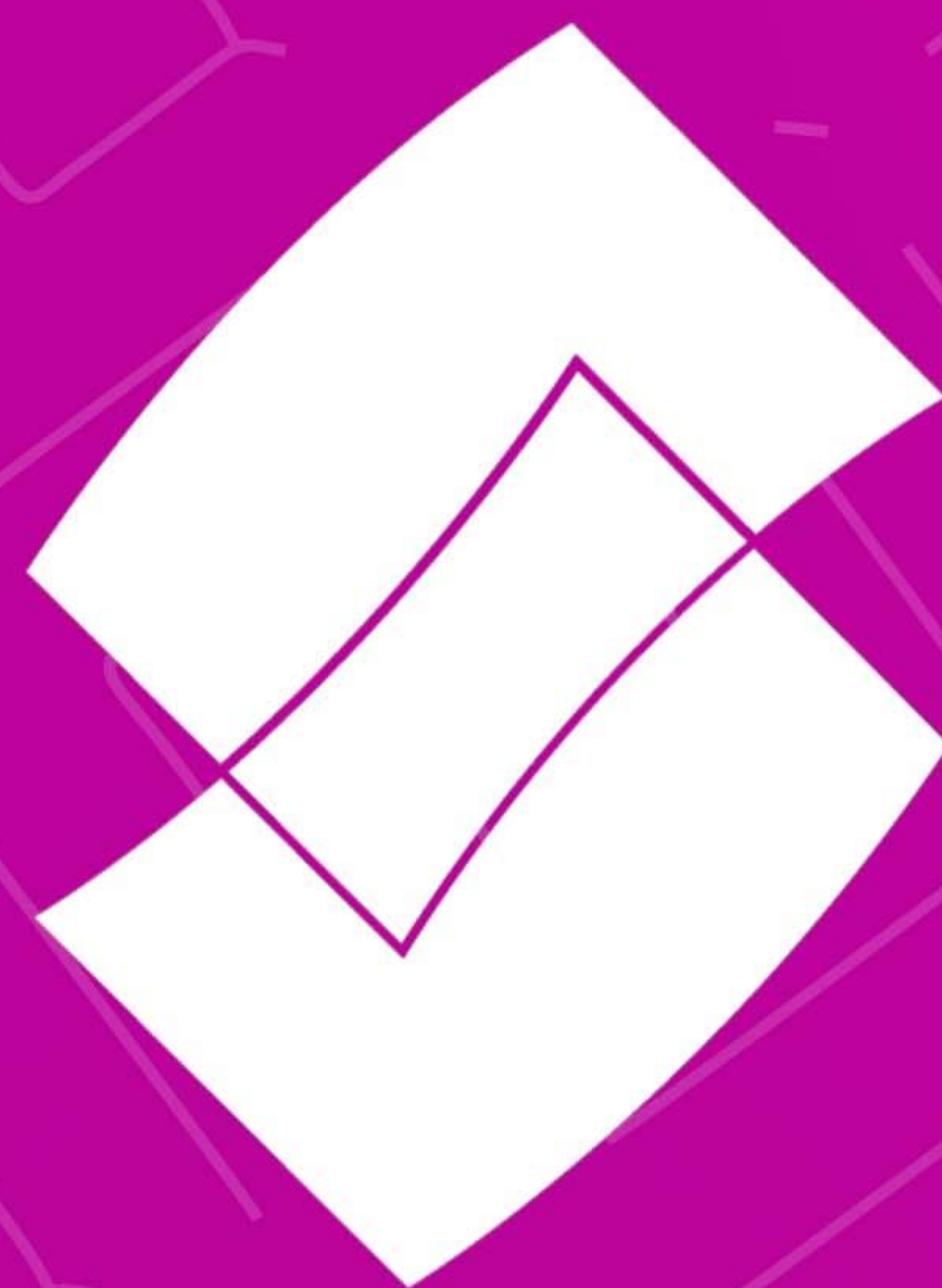
اختیار خرید



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.