

شماره
۴۳۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۷ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

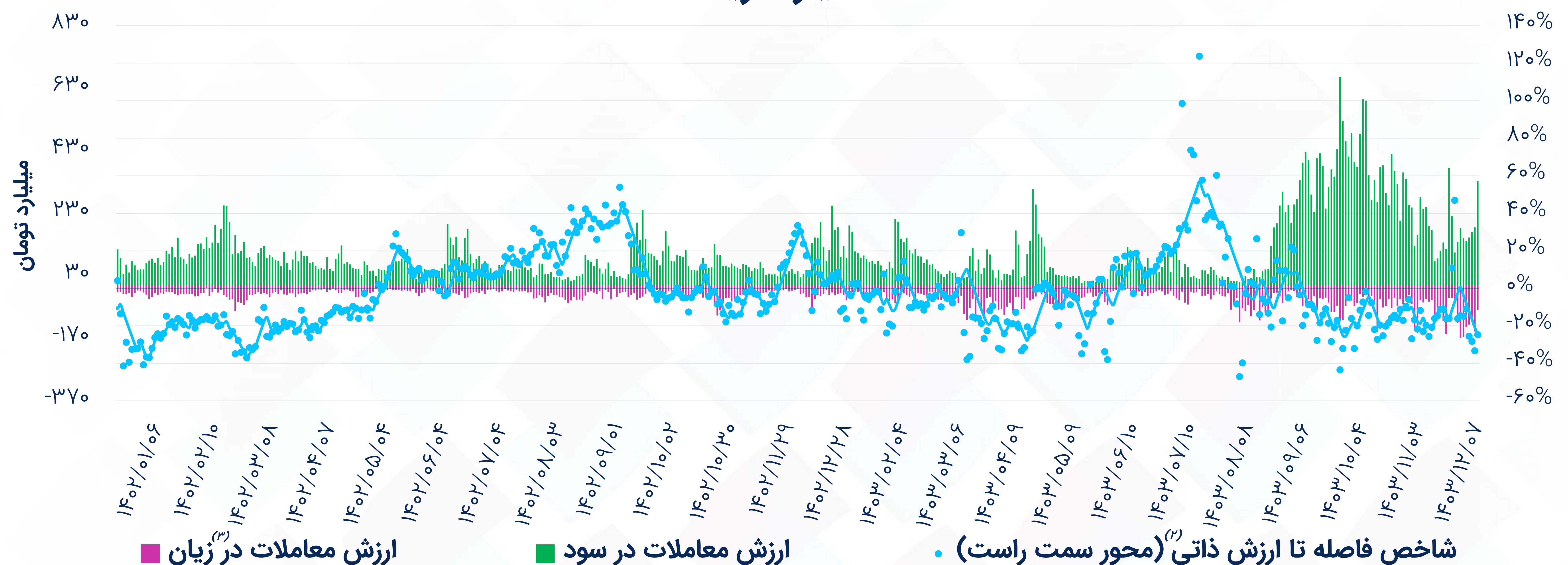




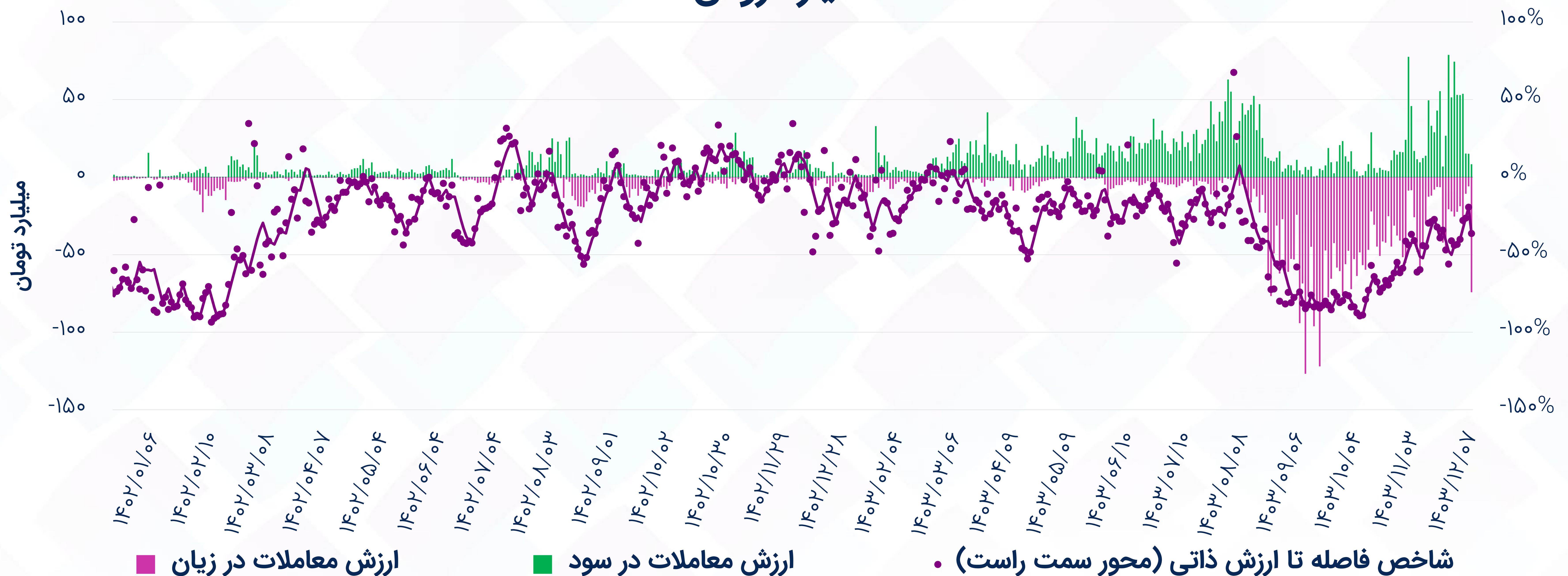
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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

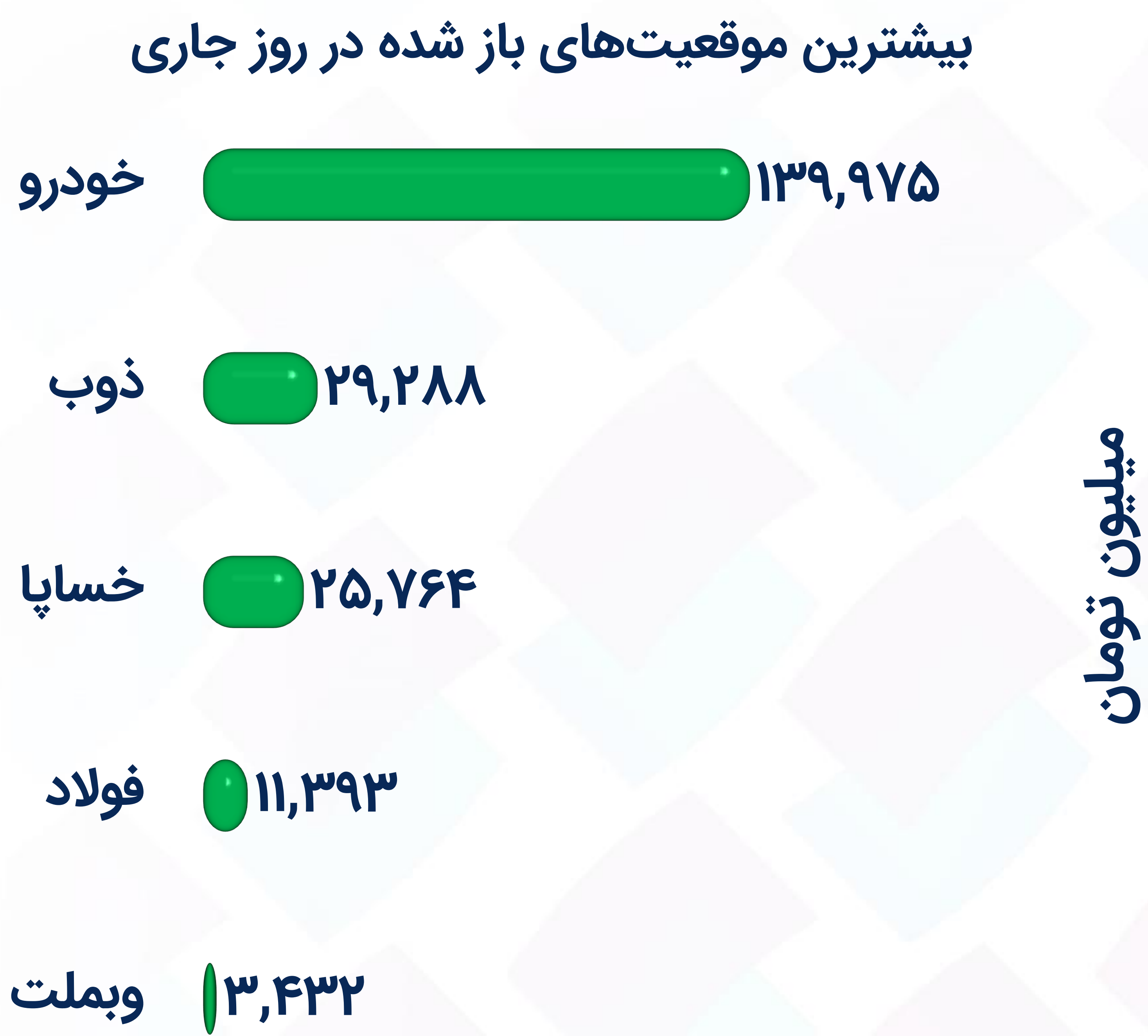
اختیار خرید

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	۴۳	۲۴۱.۱	۳,۴۷۰.۴	۲۰۶.۴	۳۴.۷	(۲۳.۹%)
خودرو	۲۹	۶۸.۰	۶۴۸.۶	۵۴.۳	۱۳.۷	(۴۶.۵%)
شستا	۴۹	۵۹.۳	۱,۳۵۶.۴	۴۰.۵	۱۸.۸	(۵.۷%)
ذوب	۲۷	۱۸.۸	۱۸۳.۲	۱۲.۱	۶.۷	(۲۰.۹%)
خسپا	۱۹	۱۱.۳	۱۷۶.۲	۸.۰	۳.۳	(۳۴.۸%)
وبملت	۱۵	۳.۹	۳۰.۲	۳.۴	۰.۵	(۱۱.۴%)
فولاد	۸	۱.۳	۲۰.۵	۰.۹	۰.۴	(۳.۸%)

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	۶۹,۲۰۴.۱	۳,۱۰۲,۰۵۶.۲	۷,۷۲۷.۸	۶۱,۴۷۶.۴	(۳۵.۳%)
خودرو	۶	۹,۵۰۹.۴	۶۷۳,۵۷۷.۵	۳۳۳.۴	۹,۱۷۵.۹	(۳۵.۲%)
شستا	۷	۳,۴۶۰.۷	۴۵۲,۳۴۵.۹	۹۴.۲	۳,۳۶۶.۵	(۶۱.۱%)
ذوب	۴	۳۸.۹	۷,۳۴۵.۱	۸.۴	۳۰.۵	(۴۵.۷%)
وتعاون	۱	۱۴.۷	۲,۳۷۸.۹	۰.۰	۱۴.۷	(۹۹.۹%)
شپنا	۲	۹.۶	۱,۰۷۴.۷	۰.۰	۹.۶	۴۷.۳%
خودران	۲	۳.۹	۵۳.۳	۳.۶	۰.۳	(۴۲.۱%)

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



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۲,۱۰۷

خودرو ۵۷۷

شستا ۲۴۱

ذوب ۹

توان ۷

رویین ۷

وتعاون ۳

وبملت ۱.۹۴

شپنا ۱.۹۱

خودران ۰.۷۴

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۵۸۲,۲۱۵.۶

خودرو ۱۰۱,۷۷۲.۶

ذوب ۵,۱۴۳.۷

توان ۸۷.۶

شتاب ۱.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۲۰,۹۷۵.۰)

آساس (۱۸۰.۰)

فولاد (۱۰۵.۰)

وبملت (۰.۱)

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
ضنارنج ۱۱۲	نارنج اهرم	۱۵,۰۰۰	۴۰	۱.۵	۲۸	۱۴,۰۹۳	۱۵,۰۲۸	۶.۶%	۵۳۶.۷	۰.۴۱	۴۵۹	۱۵۳۹%
ضفر ۱۲۰۸	فزر	۴۴,۰۰۰	۵	۳۳.۶	۲,۲۴۰	۴۷,۷۵۰	۴۶,۲۴۰	(۳.۲%)	۲۰.۶	۰.۹۸	۴,۰۰۵	۷۹%
ضفر ۱۲۰۹	فزر	۴۶,۰۰۰	۵	۳۱.۳	۱,۴۷۱	۴۷,۷۵۰	۴۷,۴۷۱	(۰.۶%)	۳۲.۳	۰.۸۶	۲,۱۵۲	۴۶%
ضمین ۱۰۵	ثمین	۳۰,۰۰۰	۵۴	۶.۰	۱,۲۰۵	۲۹,۷۹۳	۳۱,۲۰۵	۴.۷%	۲۵.۹	۰.۶۸	۱,۷۱۰	۴۲%
ضروین ۱۲۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۱۹	۱۲۸.۰	۷۳۵	۱۲,۷۵۴	۱۲,۷۳۵	(۰.۱%)	۱۷.۳	۰.۹۳	۱,۰۰۹	۳۷%

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
ضدوب ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۵	۱.۲	۱	۴۷۵	۷۰۱	۴۸%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۹	۱۰۳.۹	۱۸	۳,۵۷۴	۵,۰۱۸	۴۰%	۲۷۸.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹۸	۲.۳	۶۱	۱,۳۷۱	۲,۲۶۱	۶۵%	۳۷.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۷۸	۱۸.۰	۱۷	۴۷۵	۸۱۷	۷۲%	۴۸.۱	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۶۴	۲۳.۴	۳۴	۱,۳۷۱	۱,۹۳۴	۴۱%	۵۶.۹	۰.۰۱	۰	(۹۹%)

(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
طذوب ۱۲۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۱۵	۲.۱	۷۰	۴۷۵	۹۳۰	۹۵.۸%	۱۳.۳	-۱.۰۰	۵۰۸	۶۲۶.۴%
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۵,۰۰۰	۷۱	۹.۵	۸۳	۵,۱۰۳	۴,۹۱۷	(۳.۶%)	۵۹.۲	-۰.۲۶	۱۲۳	۴۸.۸%
طخود ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۲۹	۱۴.۹	۷۴۶	۳,۵۷۴	۳,۷۵۴	۵.۰%	۵.۰	-۰.۹۹	۸۱۶	۹.۴%
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۱۳	۱.۵	۷,۷۰۰	۲۶,۳۹۰	۳۰,۳۰۰	۱۴.۸%	۳.۹	-۰.۸۹	۸,۲۳۷	۷.۰%
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۵	۶,۹۹۲.۰	۱,۵۰۴	۲۶,۳۹۰	۲۶,۴۹۶	۰.۴%	۱۷.۶	-۰.۶۹	۱,۵۵۶	۳.۵%

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
طوتعاون ۱۰۵	وتعاون	۱,۲۰۰	۴۷	۱۴.۷	۱۰	۱,۶۱۶	۱,۱۹۰	(۲۶.۴%)	۱۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۵	۶.۱	۲۰	۲۶,۳۹۰	۱۹,۹۸۰	(۲۴.۳%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۲۹	۱۸.۵	۶	۳,۵۷۴	۲,۷۹۴	(۲۱.۸%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۸.۴%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۵	۳۰.۵	۲	۴۷۵	۳۹۸	(۱۶.۲%)	۱۹۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۴.۴%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۵	۹۸۷.۱	۶۳	۲۶,۳۹۰	۲۱,۹۳۷	(۱۶.۹%)	۳۴۸.۲	-۰.۰۱	۴	(۹۳.۳%)

(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)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

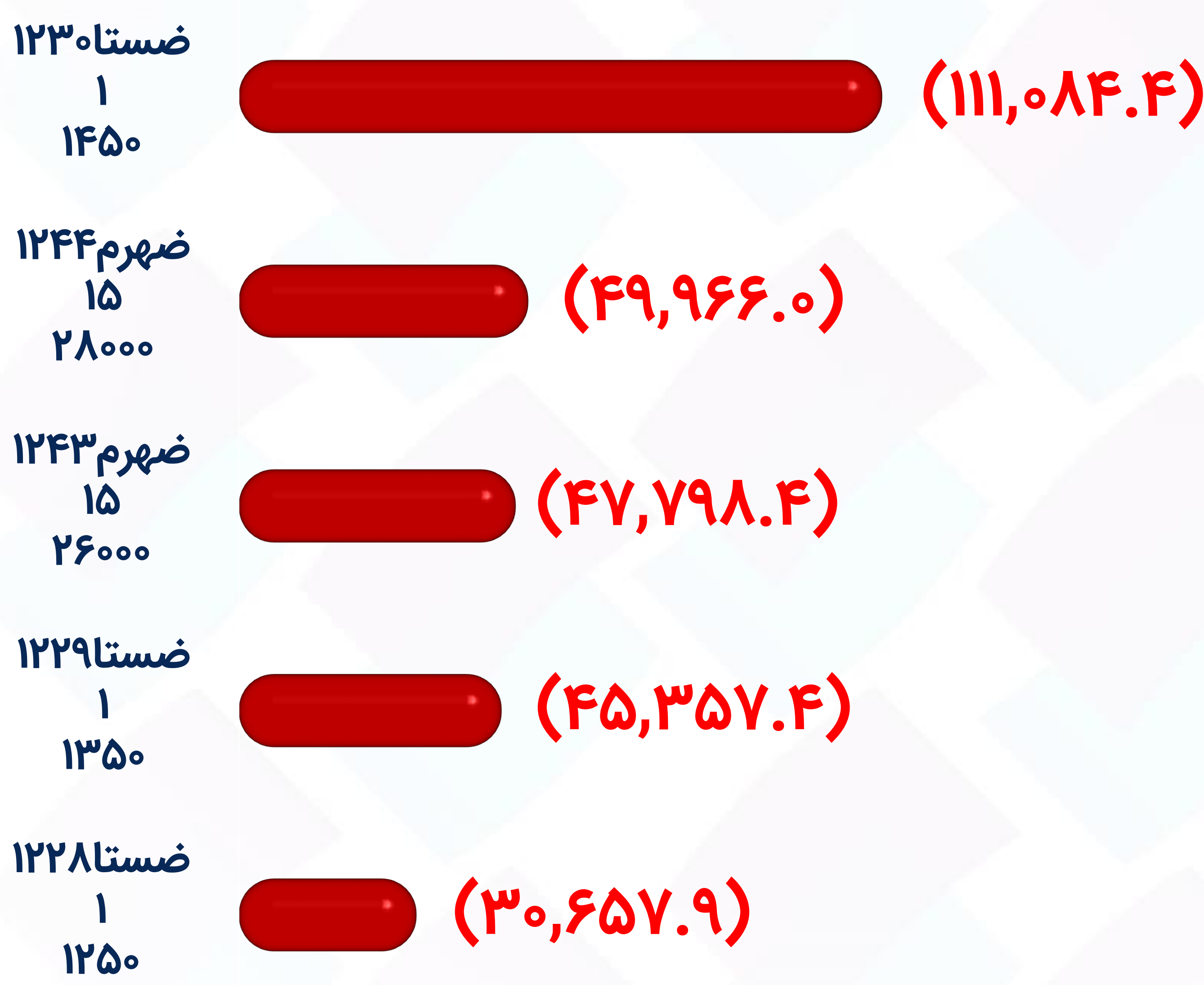
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

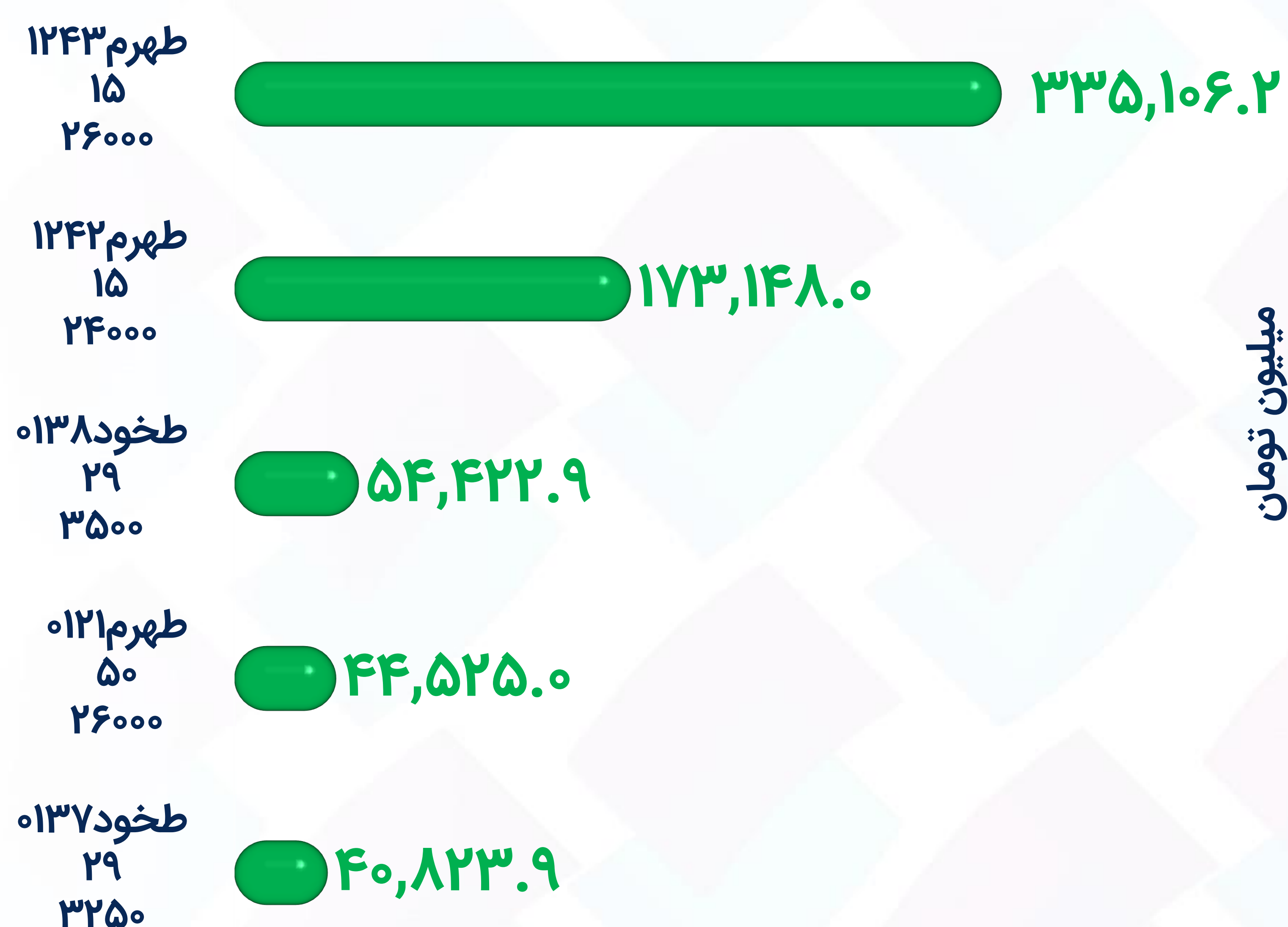
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

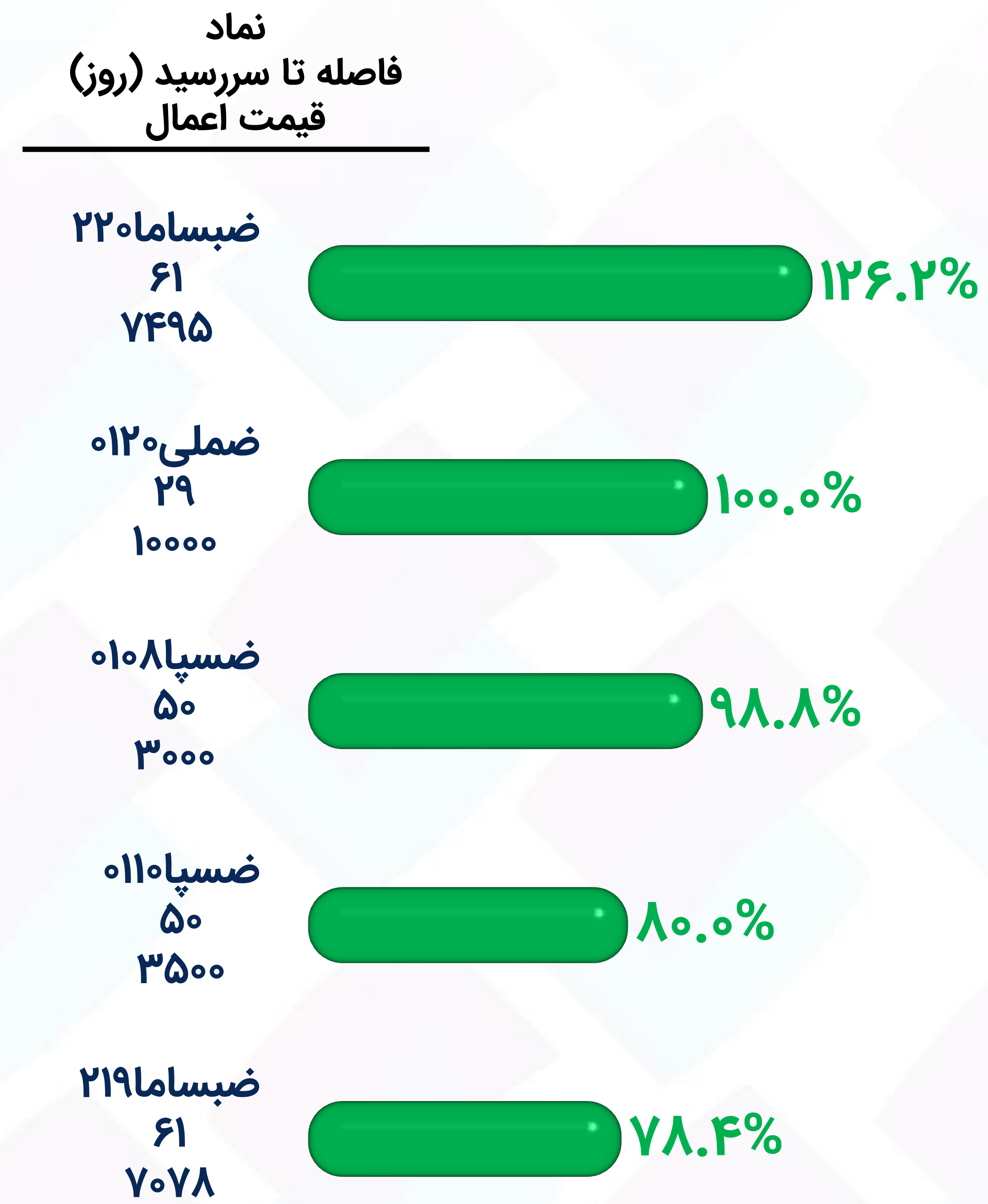
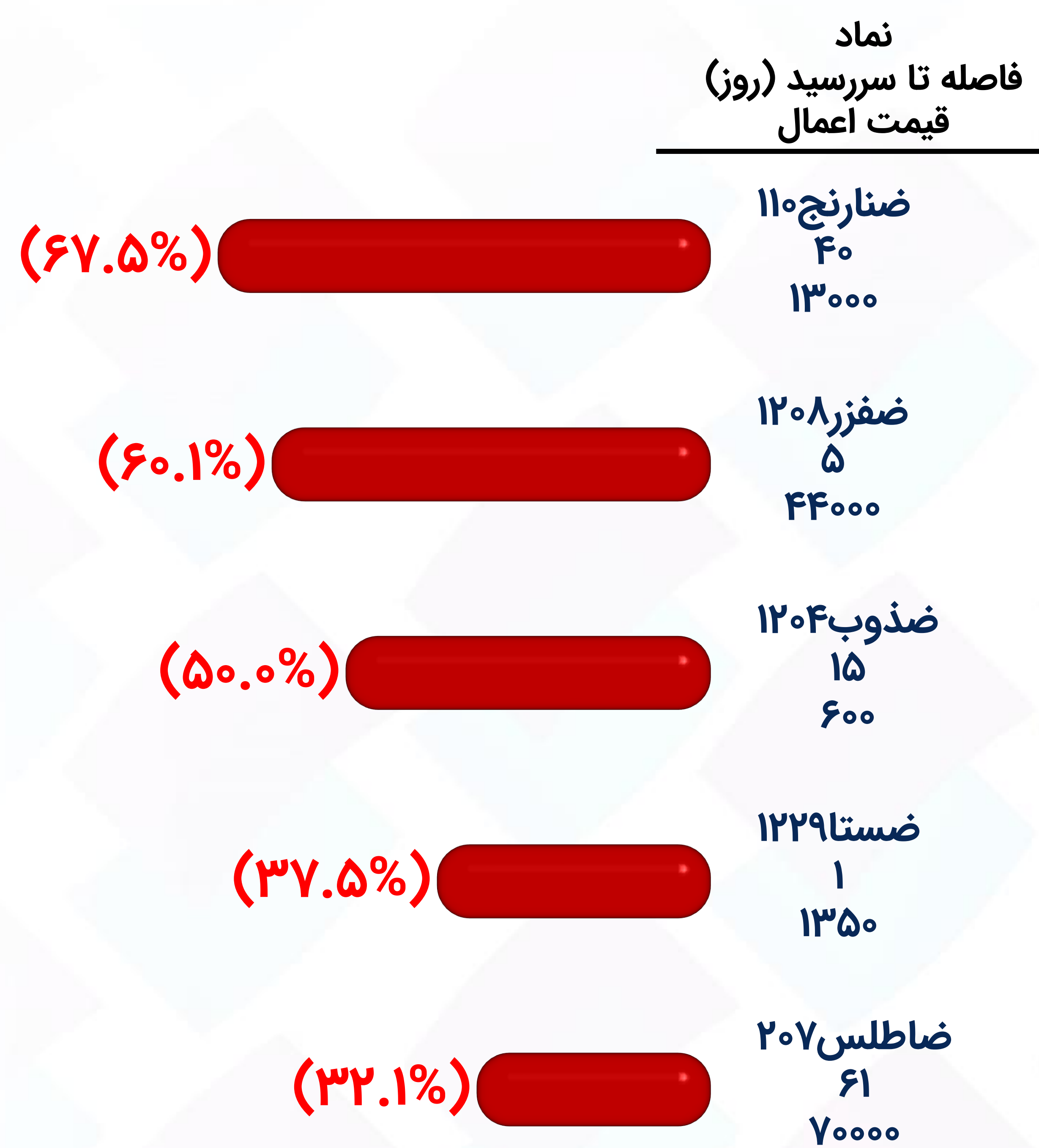
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



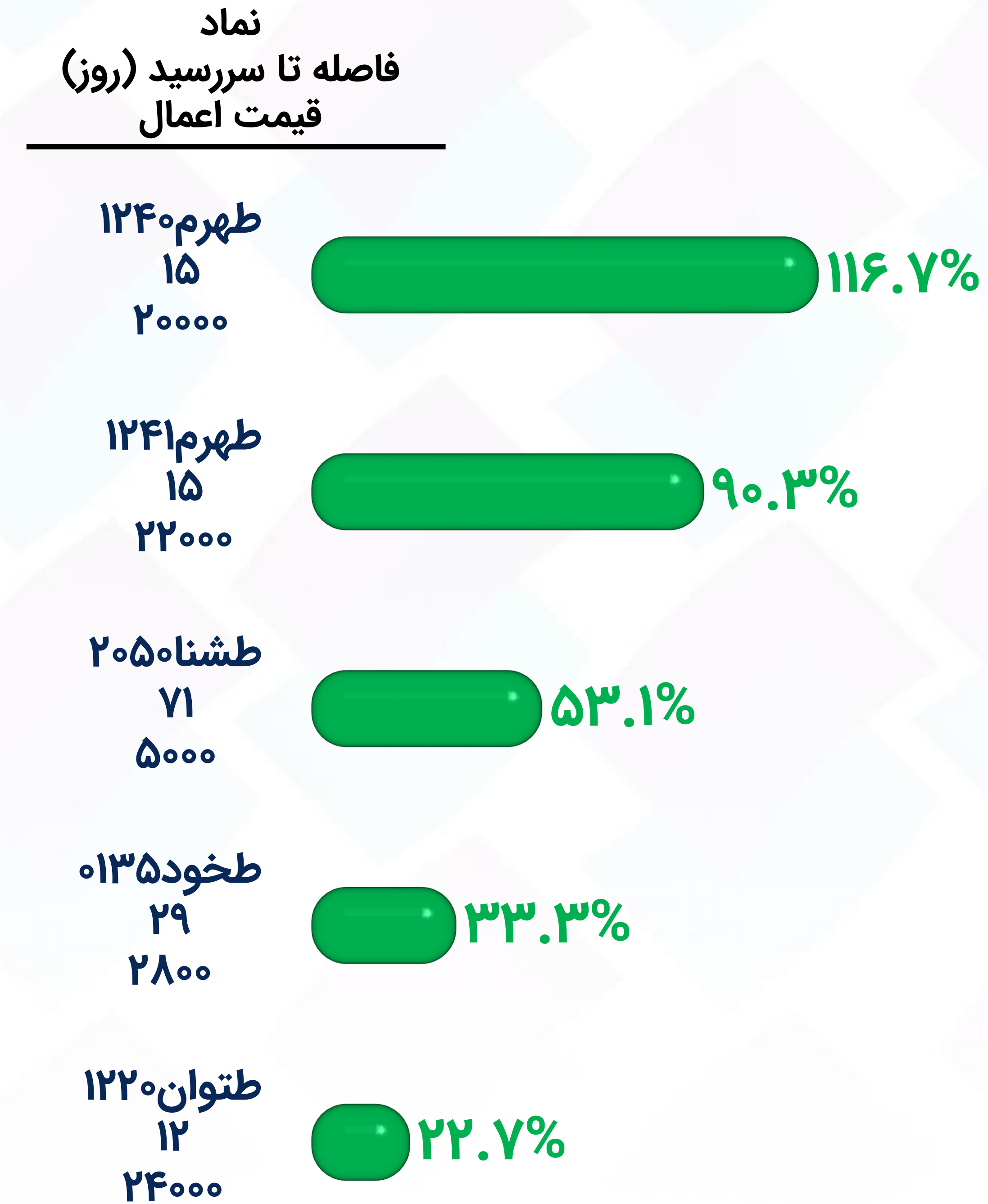
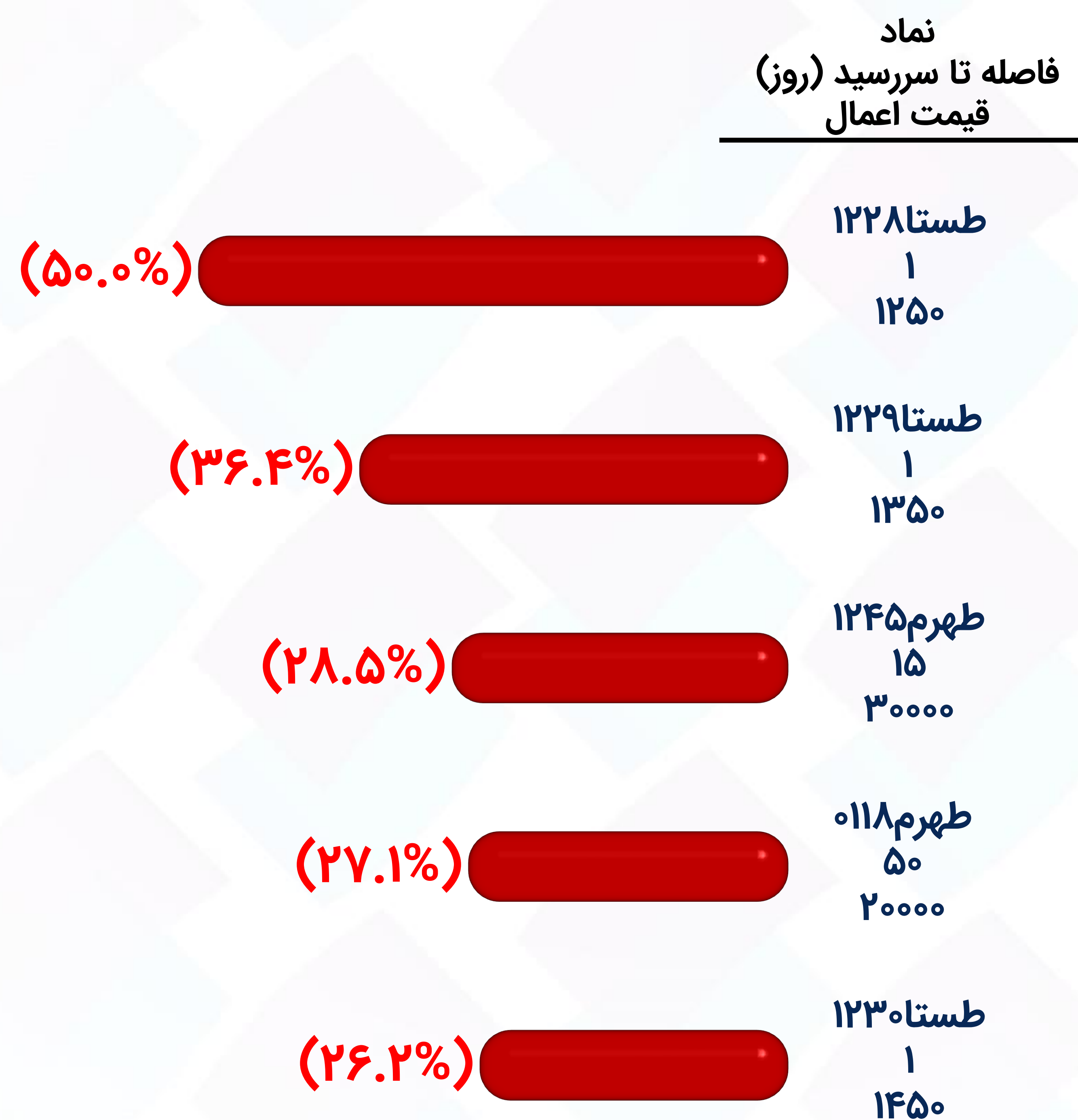
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

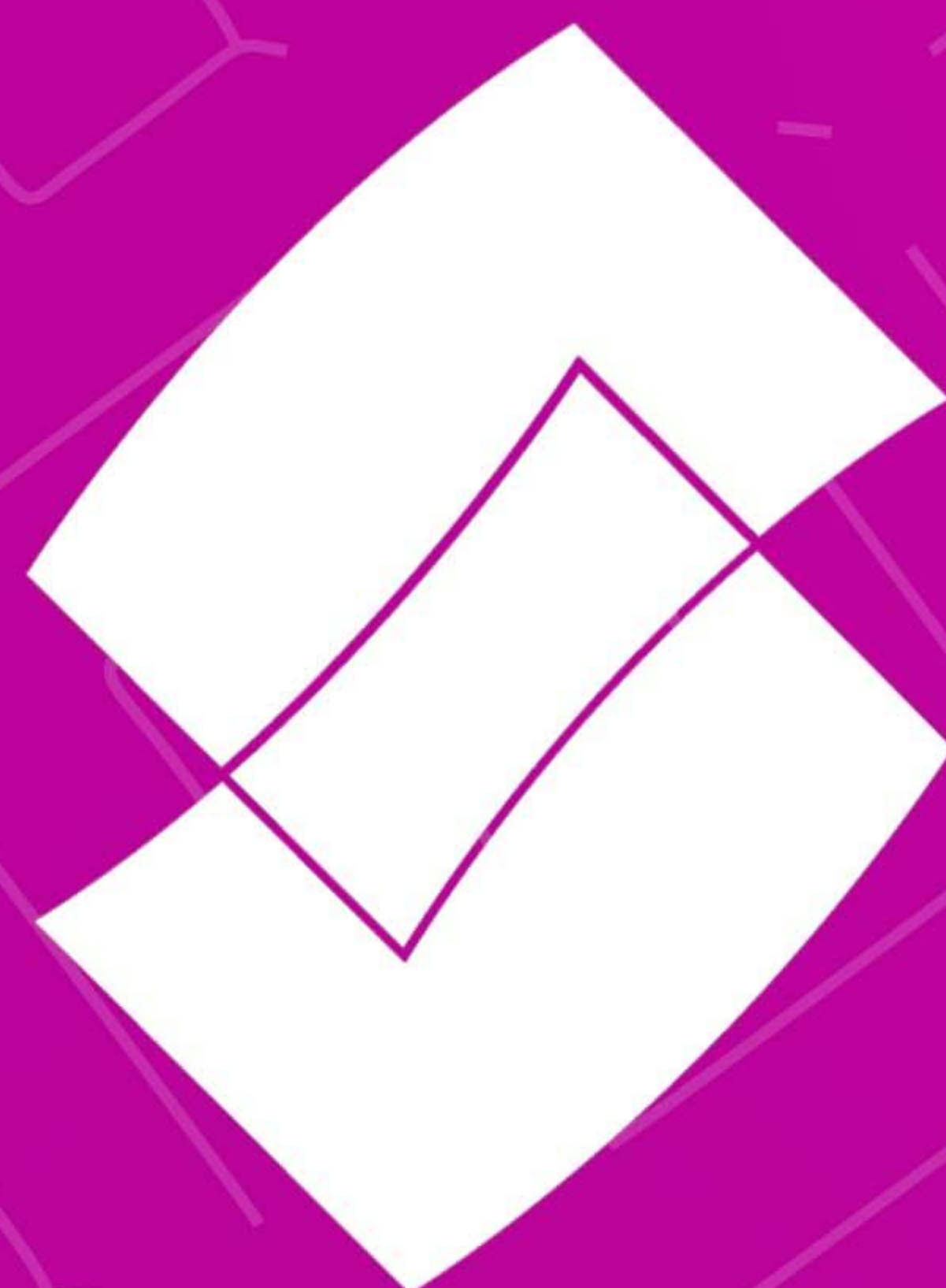
اختیار خرید



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.