

شماره
۴۳۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





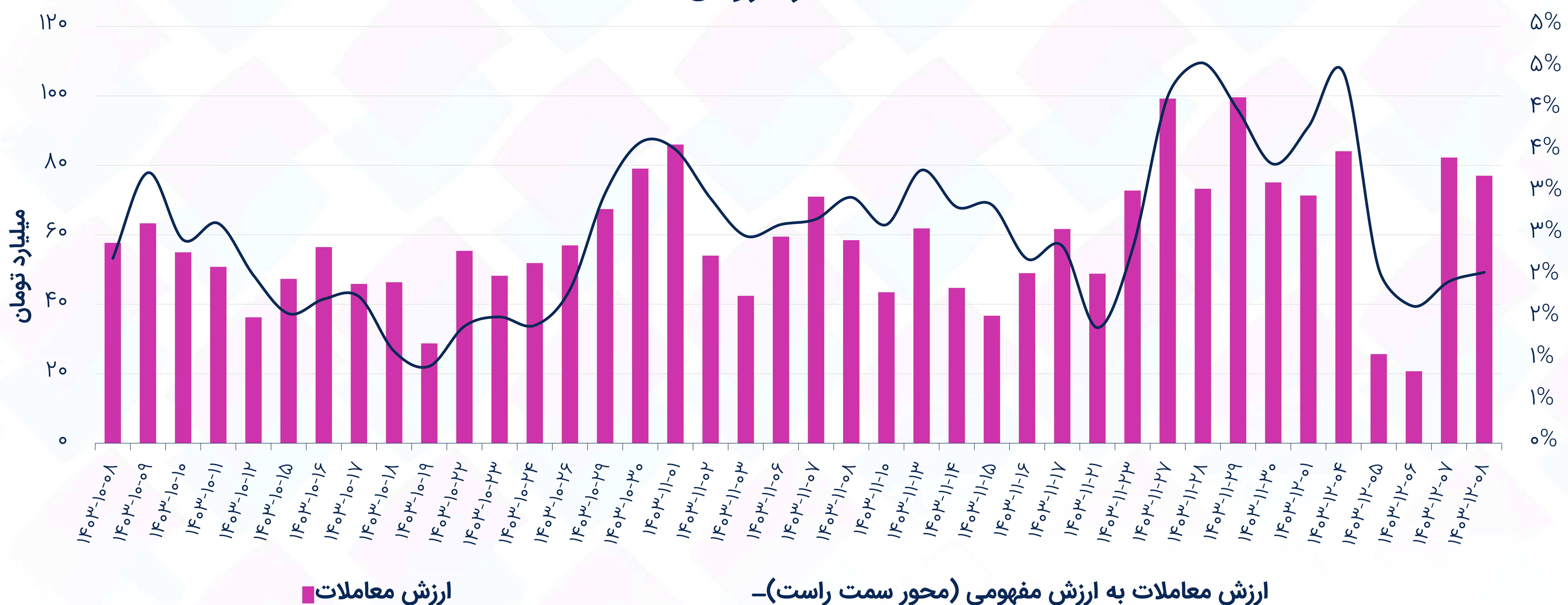
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



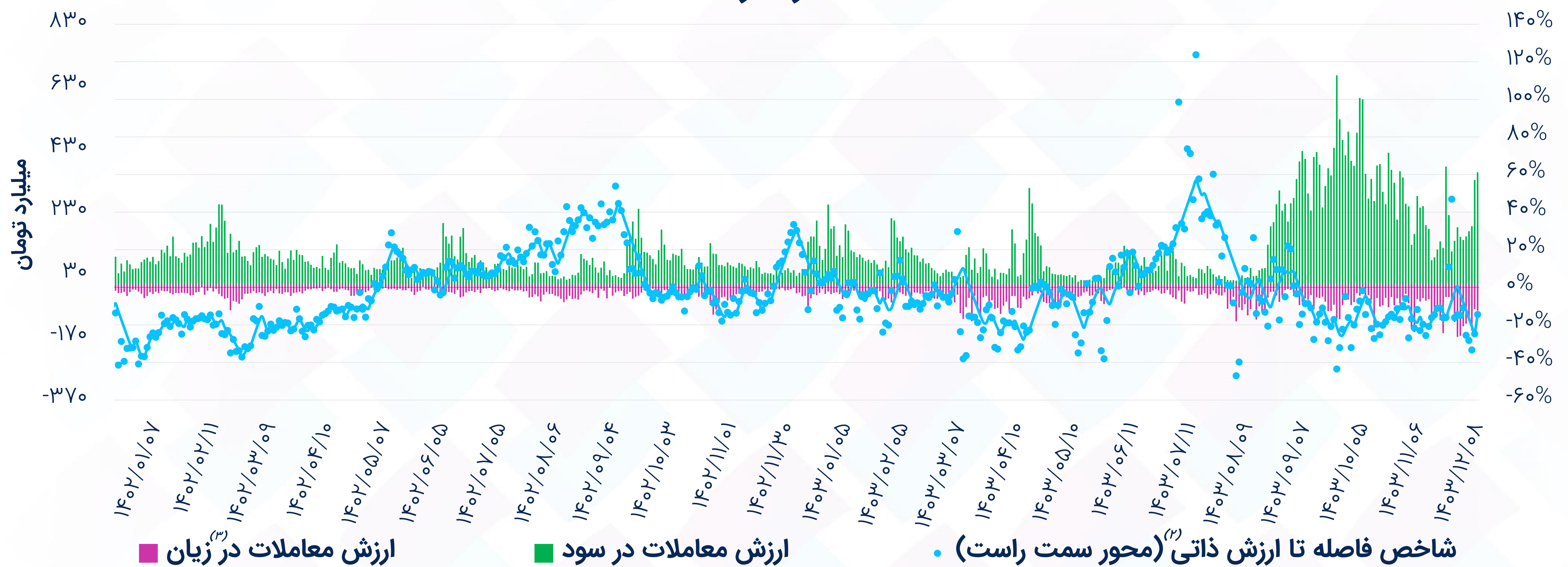
اختیار فروش



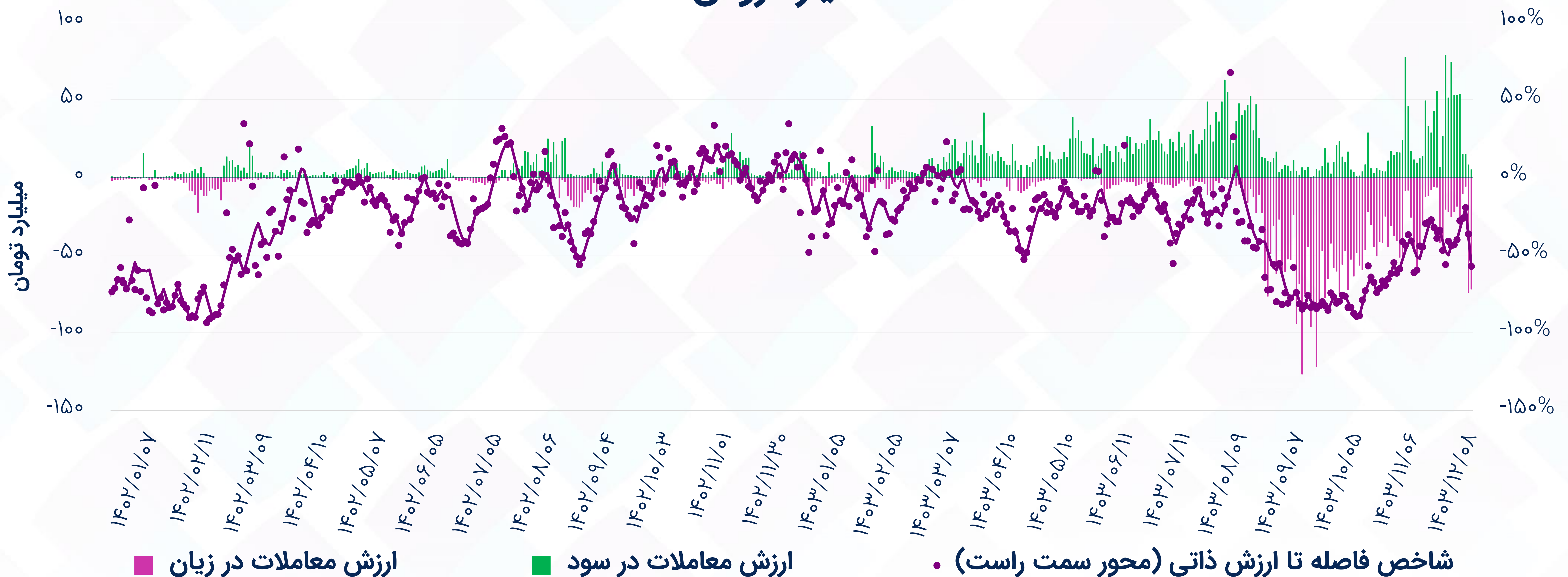
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۹	۲۶۶.۸	۴,۱۴۰.۷	۲۲۸.۵	۳۸.۳	(۱۳.۶%)
خودرو	۳۱	۵۶.۹	۶۸۰.۸	۴۱.۸	۱۵.۱	(۳۰.۷%)
شستا	۴۷	۵۵.۵	۱,۴۷۹.۷	۳۵.۶	۱۹.۹	۱.۷%
خسپا	۲۰	۲۰.۴	۳۲۱.۶	۱۷.۹	۲.۵	(۲۷.۰%)
وبملت	۱۸	۱۱.۵	۸۶.۰	۸.۵	۳.۱	(۱۶.۱%)
ذوب	۲۵	۱۰.۴	۱۳۹.۸	۶.۶	۳.۸	(۲۲.۰%)
شپنا	۱۹	۶.۳	۴۷.۴	۶.۲	۰.۰	۱.۸%

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	۱۶	۶۱,۱۴۶.۶	۲,۶۰۳,۵۲۴.۳	۴,۲۳۶.۲	۵۶,۹۱۰.۵	(۵۴.۷%)
خودرو	۵	۱۲,۲۳۷.۶	۷۶۶,۶۳۸.۵	۳۹۶.۸	۱۱,۸۴۰.۸	(۶۸.۱%)
شستا	۱۰	۳,۳۹۳.۰	۳۸۰,۴۹۷.۱	۲۶۴.۲	۳,۱۲۸.۷	(۶۴.۳%)
بساما	۱	۱۰۲.۹	۵۸۸.۱	۱۰۲.۹	۰.۰	(۲۲.۲%)
وبملت	۳	۴۷.۲	۸۲۹.۵	۰.۰	۴۷.۲	(۷۸.۵%)
تیام	۱	۲۹.۳	۶۰۶.۷	۰.۰	۲۹.۳	(۸۰.۳%)
توان	۴	۱۴.۴	۹۴۷.۳	۵.۶	۸.۸	(۱۳.۴%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



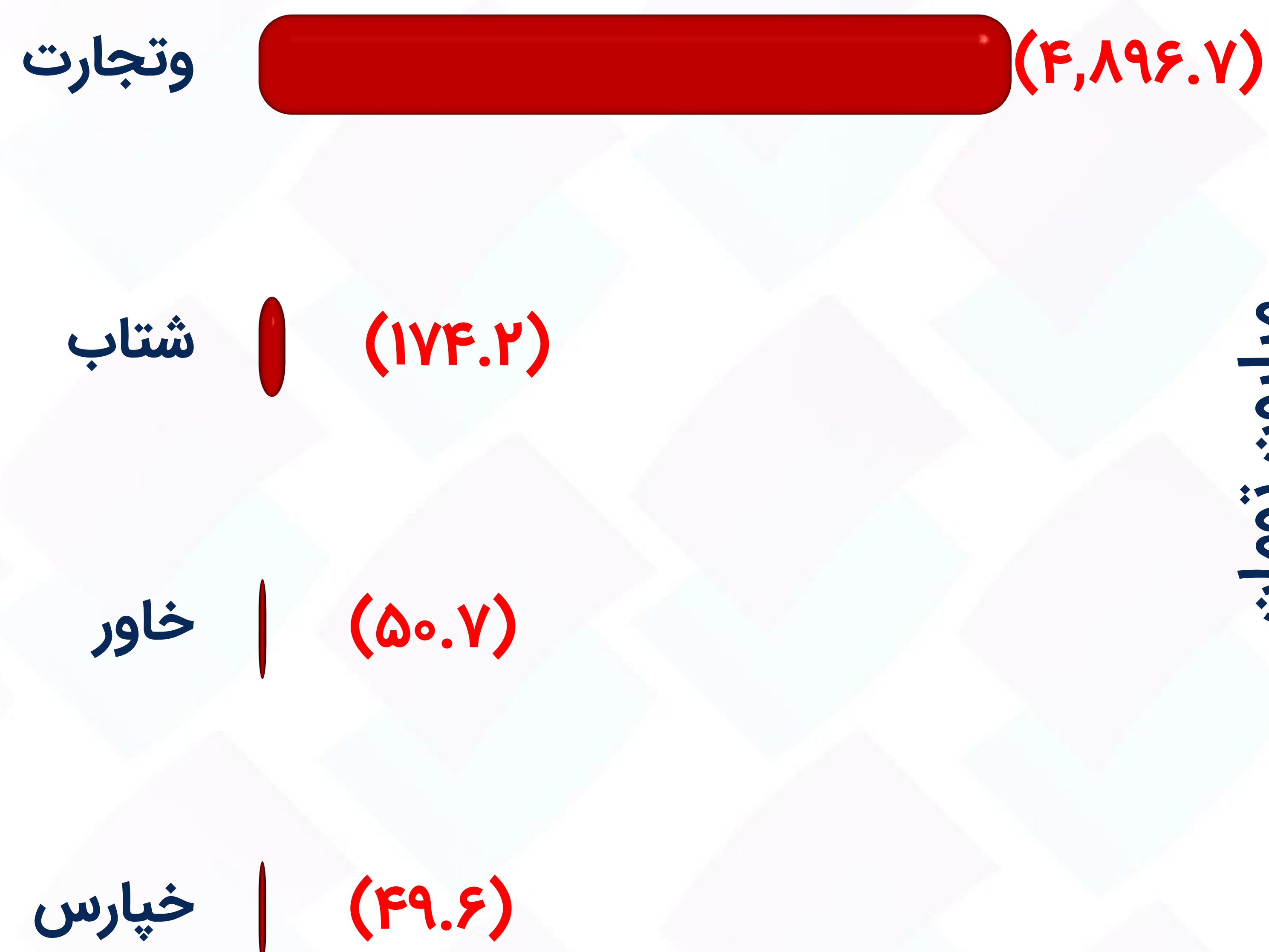
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

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

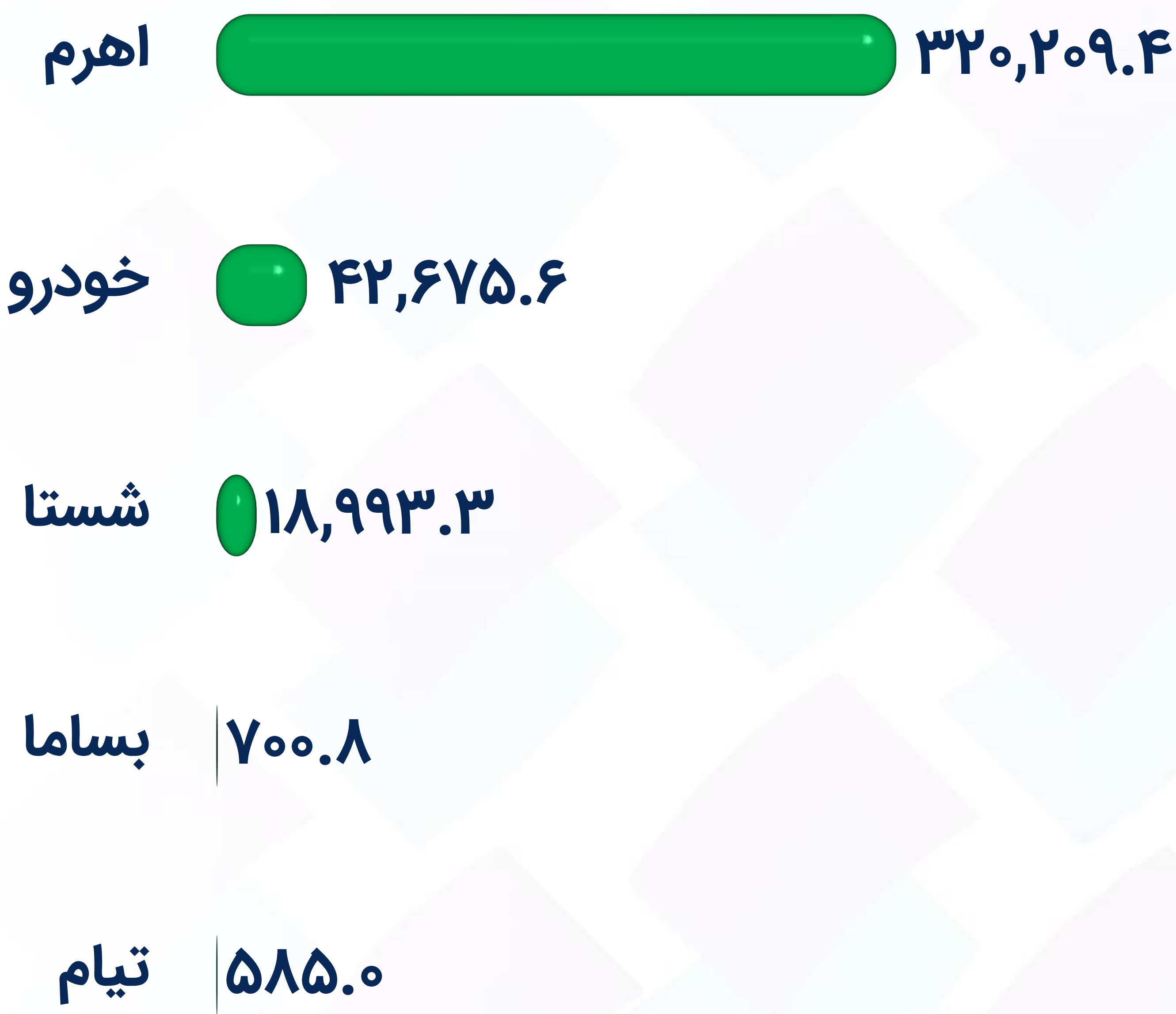
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



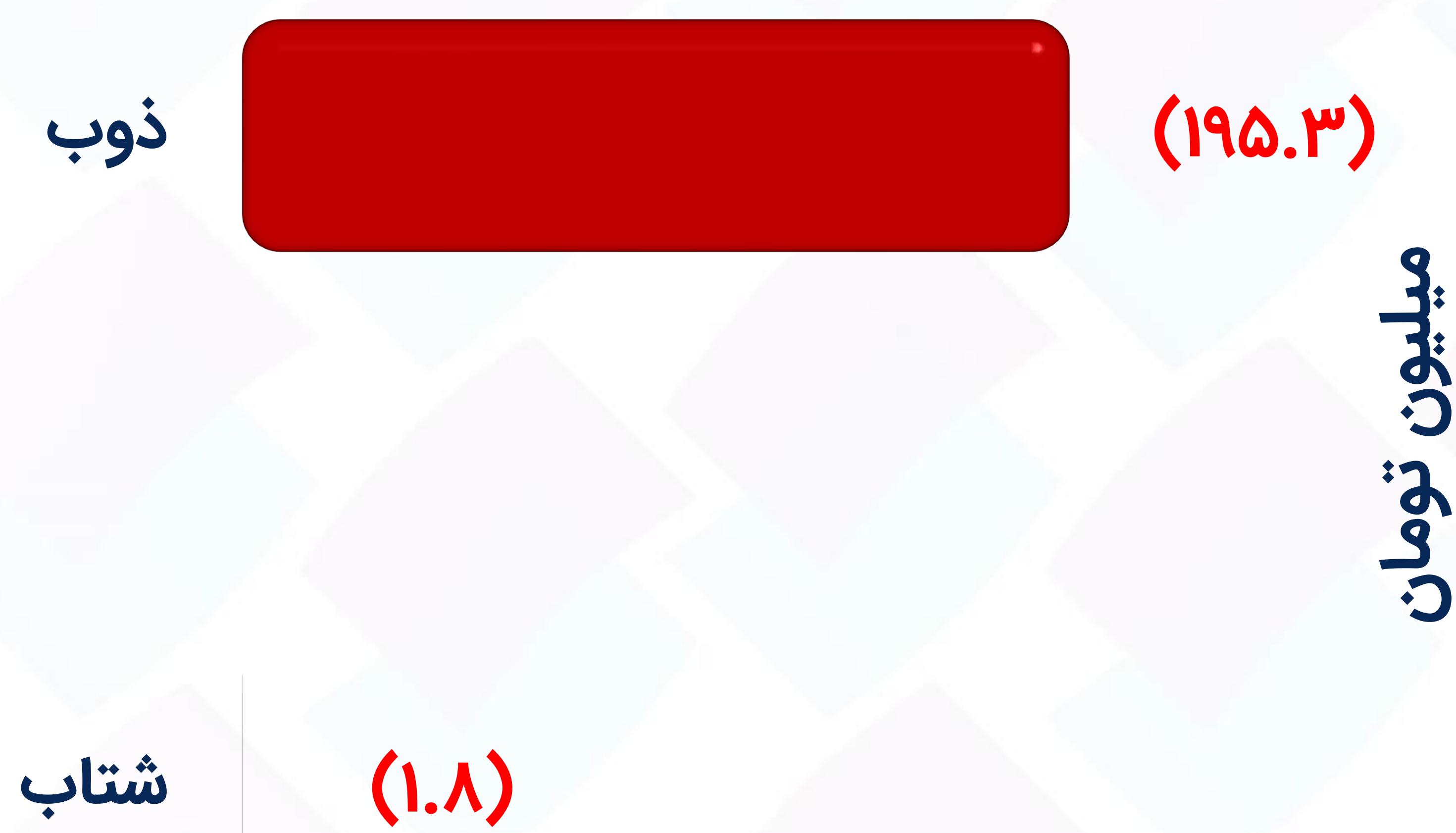
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



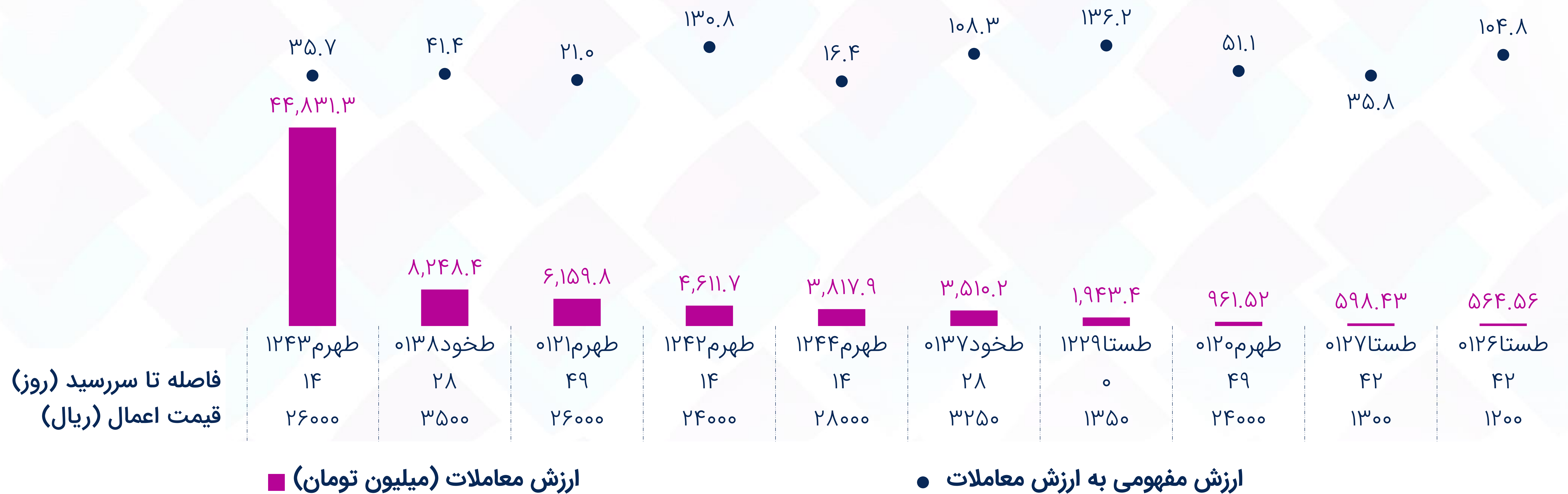
میلیون تومان

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
ضتاب ۱۲۰۹	شتاب	۱۴,۰۰۰	۷	۲۸.۲	۴۶۶	۱۴,۵۴۰	۱۴,۴۶۶	(۰.۵%)	۳۱.۰	۰.۷۹	۷۵۶	۶۲%
ضفرز ۱۲۰۸	فزر	۴۴,۰۰۰	۴	۳۸.۷	۲,۳۱۹	۴۷,۵۵۰	۴۶,۳۱۹	(۲.۶%)	۲۰.۰	۰.۹۹	۳,۷۳۸	۶۱%
ضجار ۱۲۲۱	وتجارت	۱,۸۰۰	۷	۹۳.۲	۲۲	۱,۷۸۰	۱,۸۲۲	۲.۴%	۸۲.۸	۰.۴۹	۳۴	۵۳%
ضجار ۱۲۲۰	وتجارت	۱,۷۰۰	۷	۱۶۸.۴	۷۲	۱,۷۸۰	۱,۷۷۲	(۰.۴%)	۲۴.۶	۰.۸۶	۱۰۱	۴۰%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۶۰	۱۸.۴	۱,۵۰۰	۷,۹۰۰	۷,۷۴۶	(۱.۹%)	۵.۲	۱.۰۰	۱,۹۵۸	۳۱%

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 ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۷۷	۲.۴	۱۸	۴۷۱	۸۱۸	۷۴%	۴۵.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۸	۳۰.۵	۱۱	۳,۶۸۱	۵,۰۱۱	۳۶%	۴۵۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۶۳	۱۶.۷	۳۳	۱,۳۶۲	۱,۹۳۳	۴۲%	۵۸.۶	۰.۰۱	۰	(۹۹%)
ضذوب ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۱۴	۱۲.۴	۱	۴۷۱	۶۰۱	۲۸%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸%)
ضهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴	۱۰۶.۳	۶۱	۲۶,۸۲۰	۳۴,۰۶۱	۲۷%	۵۵۸.۴	۰.۰۰	۱	(۹۸%)

(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
طتوان ۱۲۲۳	توان	۳۰,۰۰۰	۱۱	۵.۶	۲,۰۰۰	۲۶,۵۹۱	۲۸,۰۰۰	۵.۳%	۱۴.۰	-۰.۹۵	۳,۱۱۸	۵۵.۹%
طهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴	۱.۲	۶,۰۰۰	۲۶,۸۲۰	۲۸,۰۰۰	۴.۴%	۴.۷	-۱.۰۰	۶,۶۶۸	۱۱.۱%
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۵,۰۰۰	۷۰	۳.۶	۱۰۶	۵,۱۸۸	۴,۸۹۴	(۵.۷%)	۴۶.۲	-۰.۲۲	۱۰۳	(۲.۹%)
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۴	۷۴.۵	۲,۹۸۱	۲۶,۸۲۰	۲۷,۰۱۹	۰.۷%	۹.۱	-۰.۸۹	۲,۸۳۶	(۴.۹%)
طهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۹	۱۴.۰	۷,۰۰۰	۲۶,۸۲۰	۲۷,۰۰۰	۰.۷%	۳.۹	-۰.۹۳	۵,۹۳۴	(۱۵.۲%)

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	۱۴	۳۳.۱	۳۳	۲۶,۸۲۰	۱۹,۹۶۷	(۲۵.۶%)	۶۰۵.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۲۸	۷.۴	۷	۳,۶۸۱	۲,۷۹۳	(۲۴.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۴	۲۰۱.۷	۴۸	۲۶,۸۲۰	۲۱,۹۵۲	(۱۸.۲%)	۴۵۷.۳	۰.۰۰	۲	(۹۶.۷%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۲۸	۷۴.۹	۸	۳,۶۸۱	۲,۹۹۲	(۱۸.۷%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۵.۳%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۴	۶.۴	۲	۴۷۱	۳۹۸	(۱۵.۵%)	۱۹۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۴.۲%)

(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

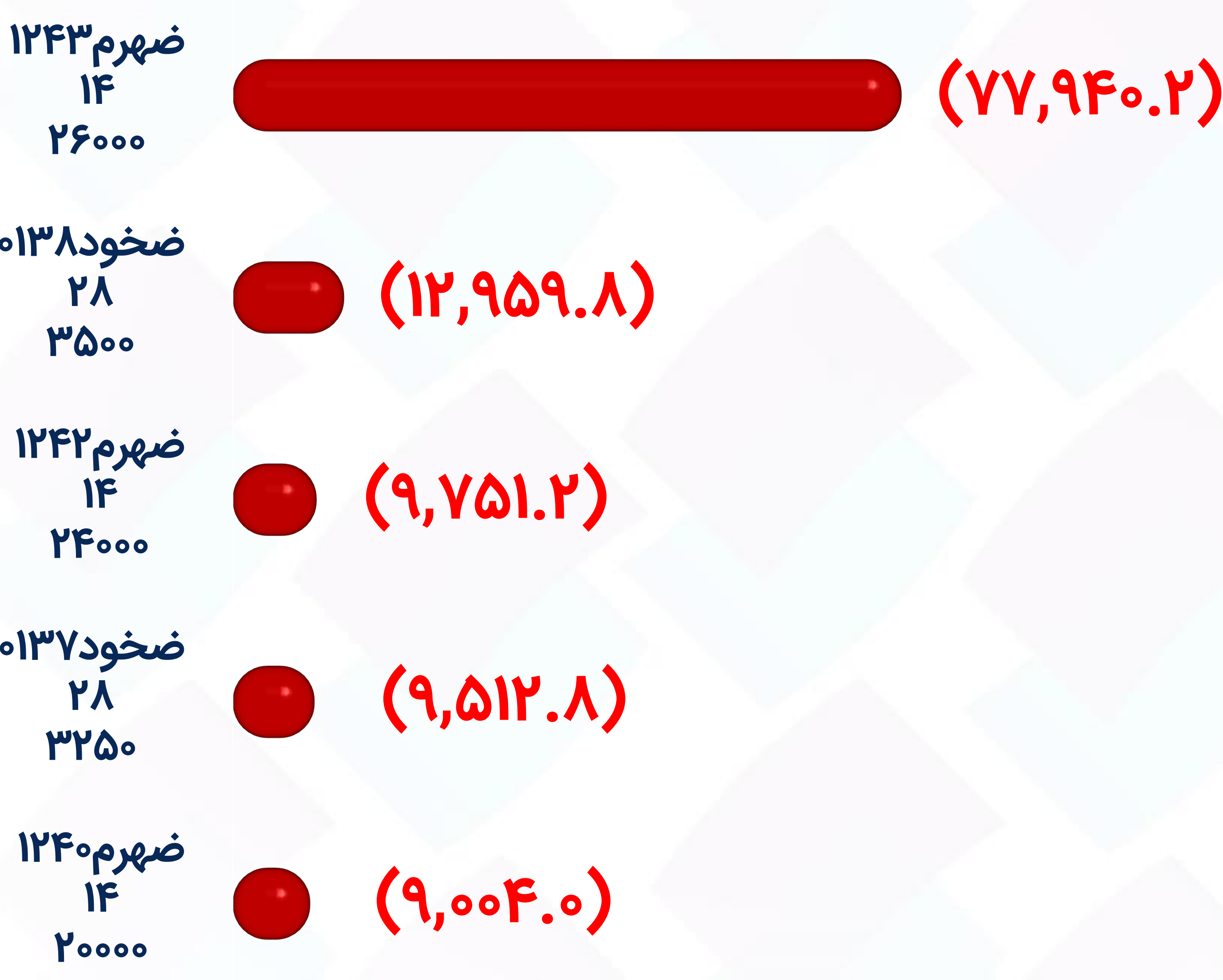
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

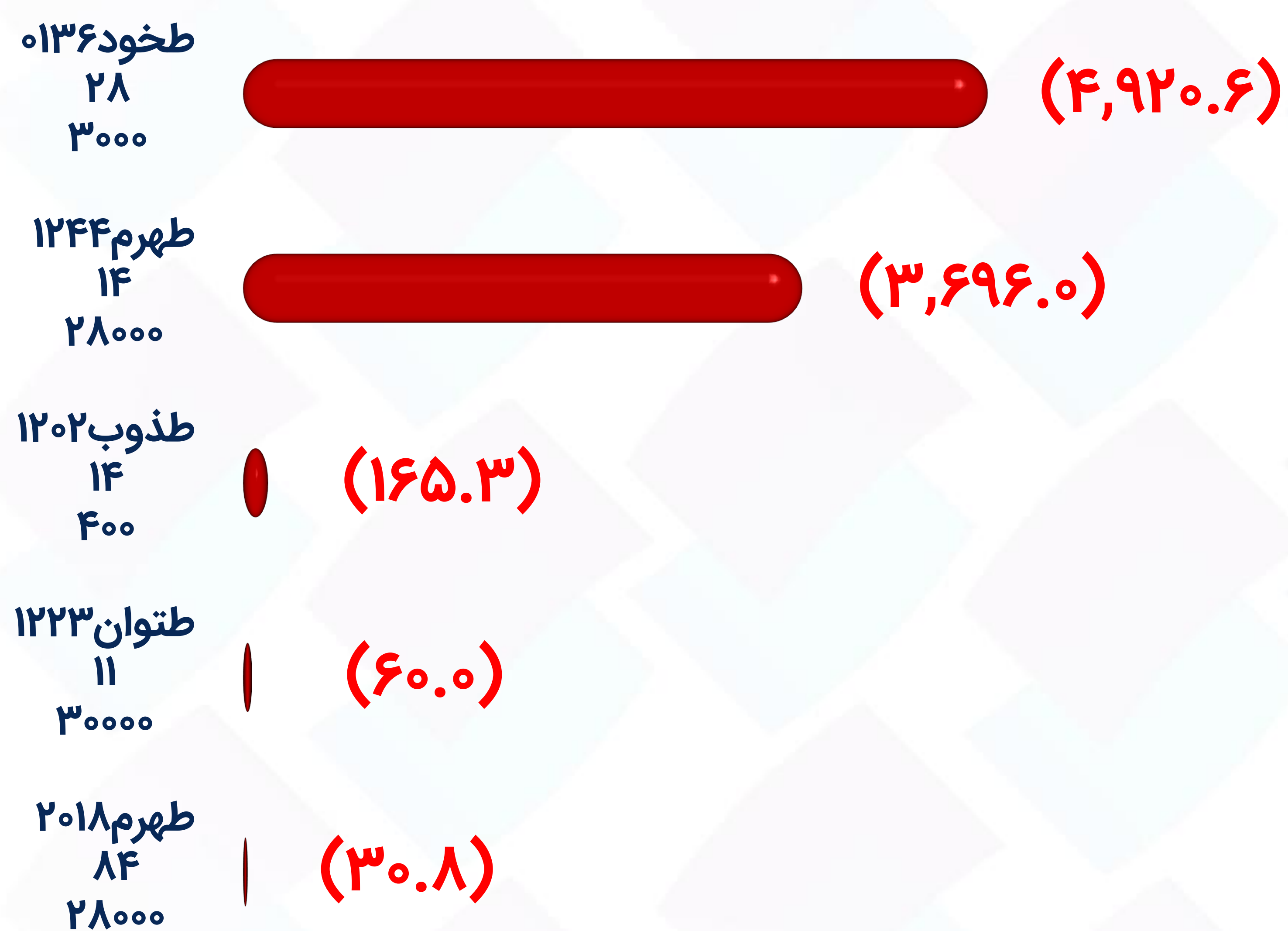
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



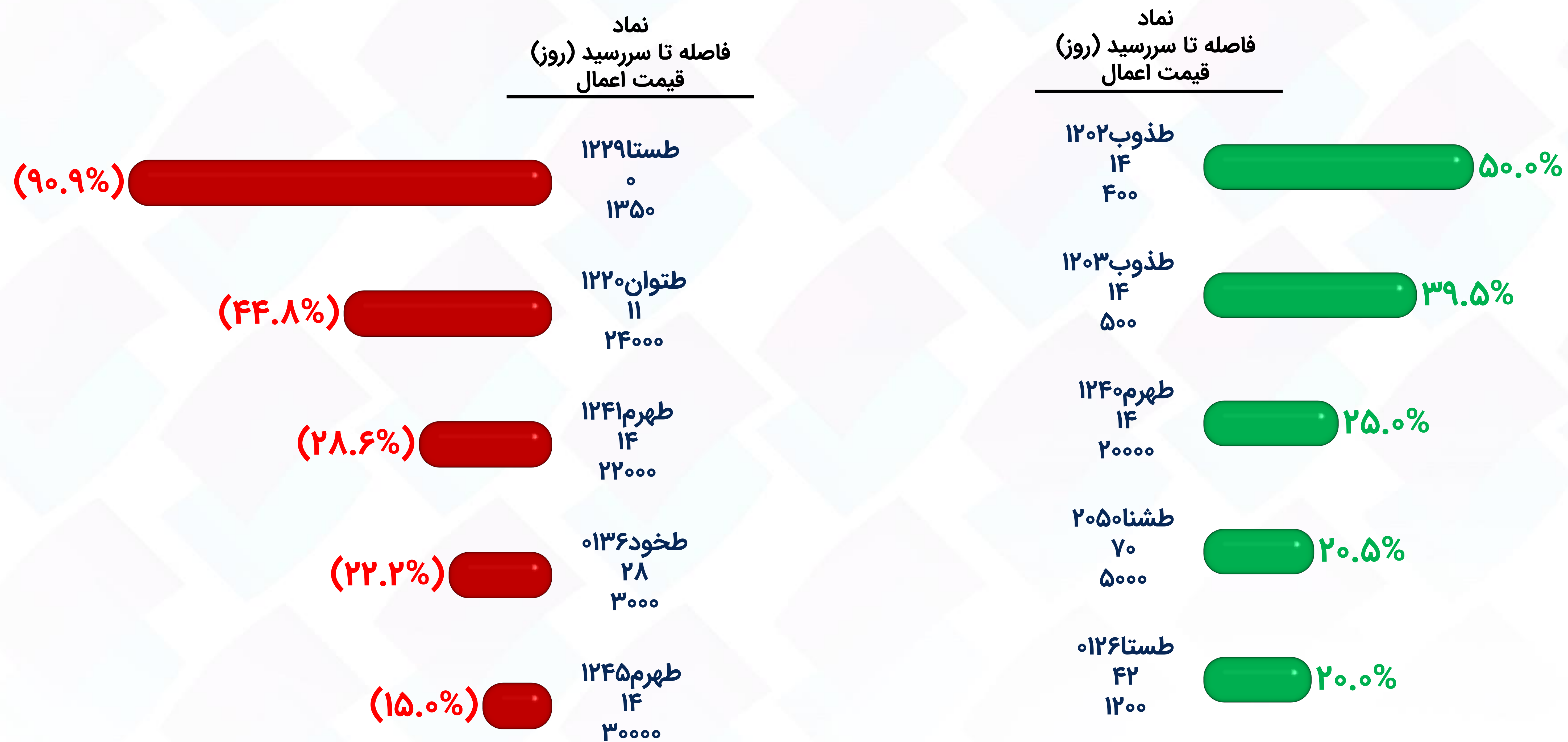
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

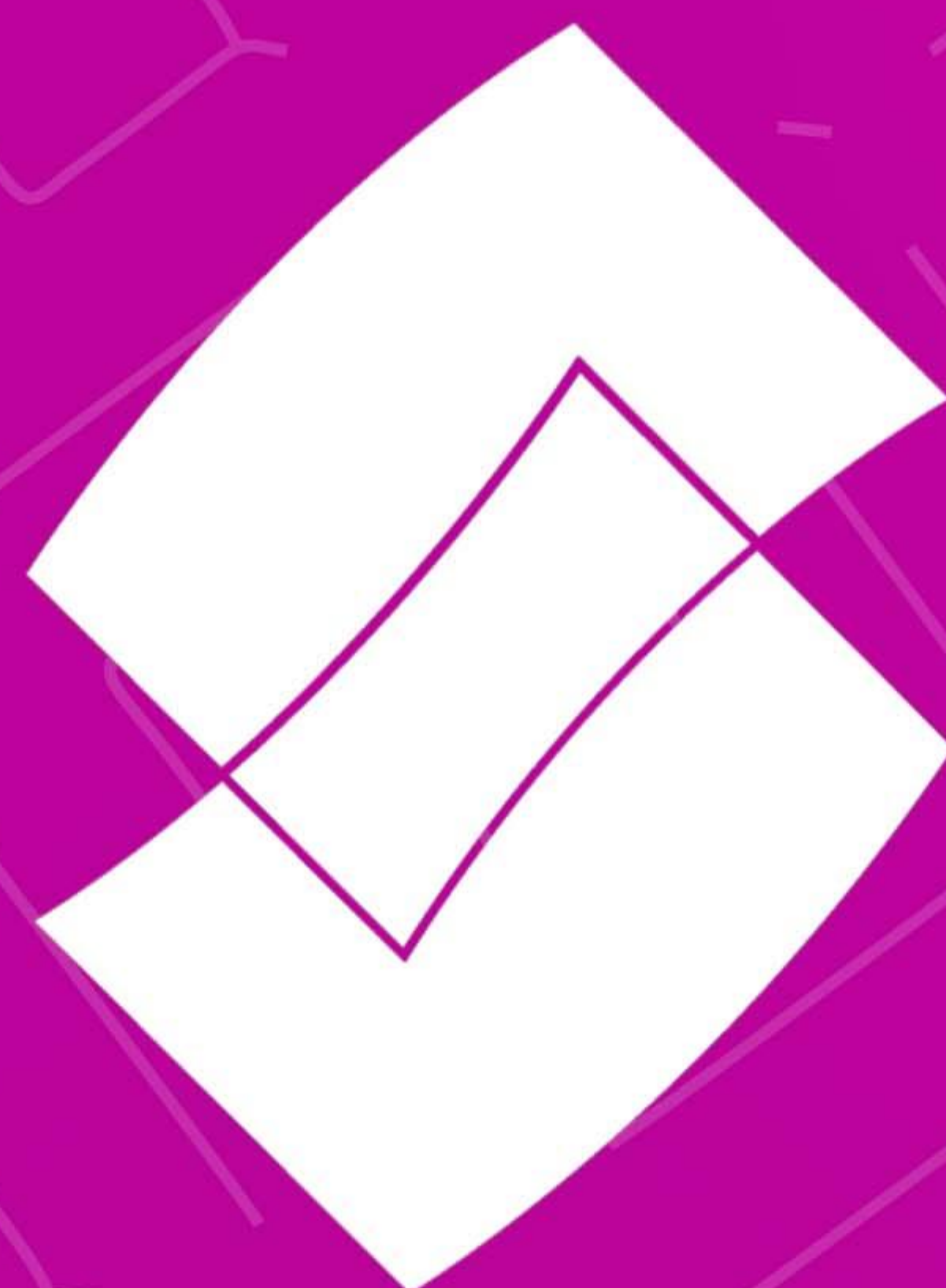
اختیار خرید



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.