

شماره
۴۳۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۲ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





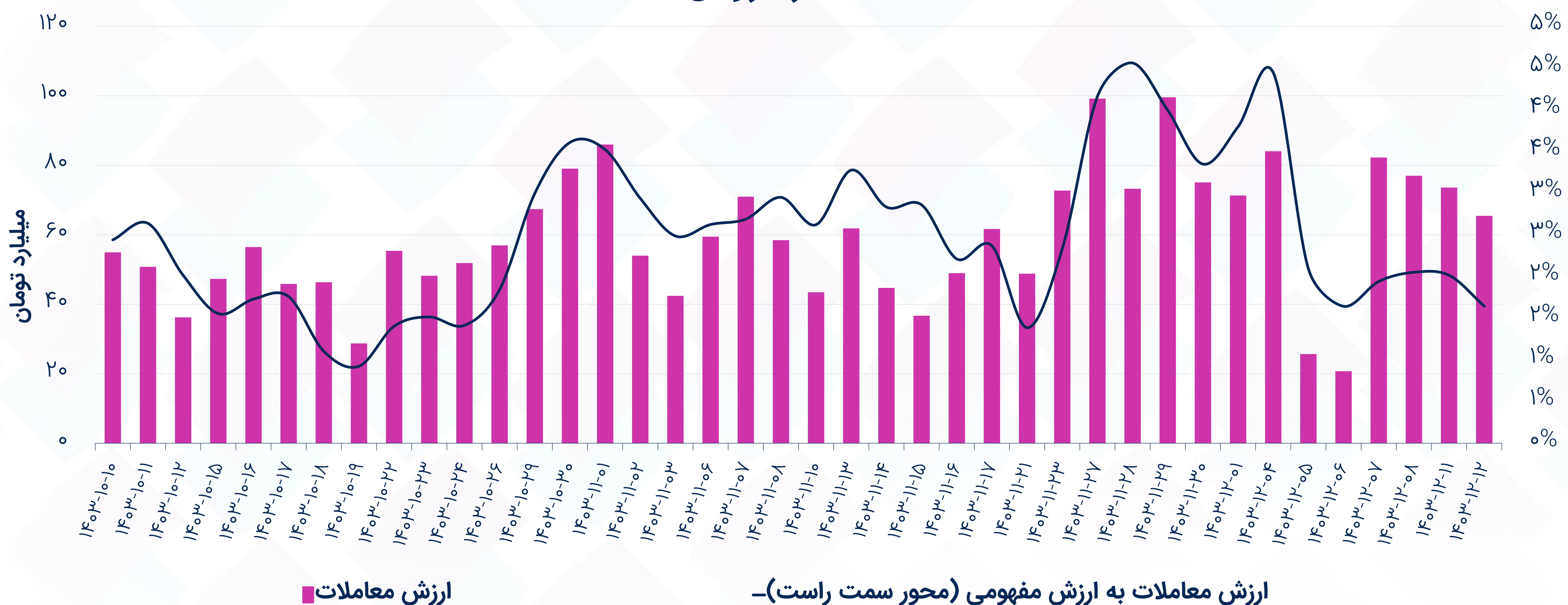
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



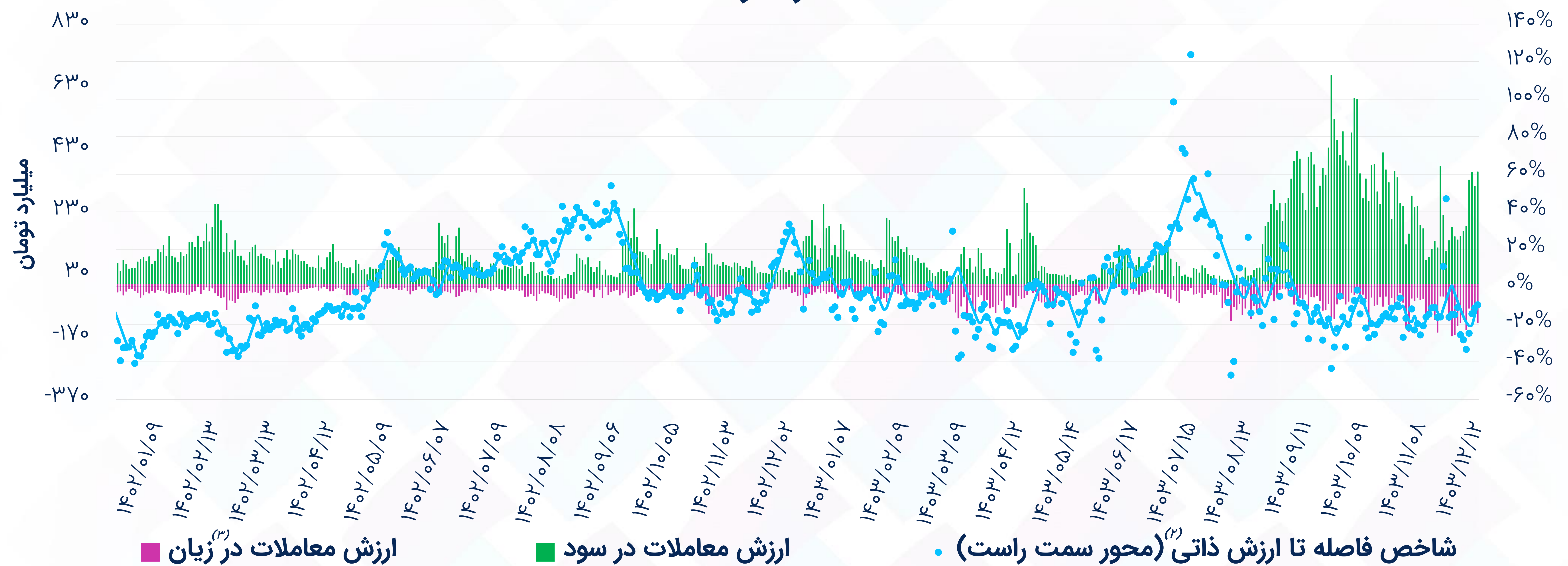
اختیار فروش



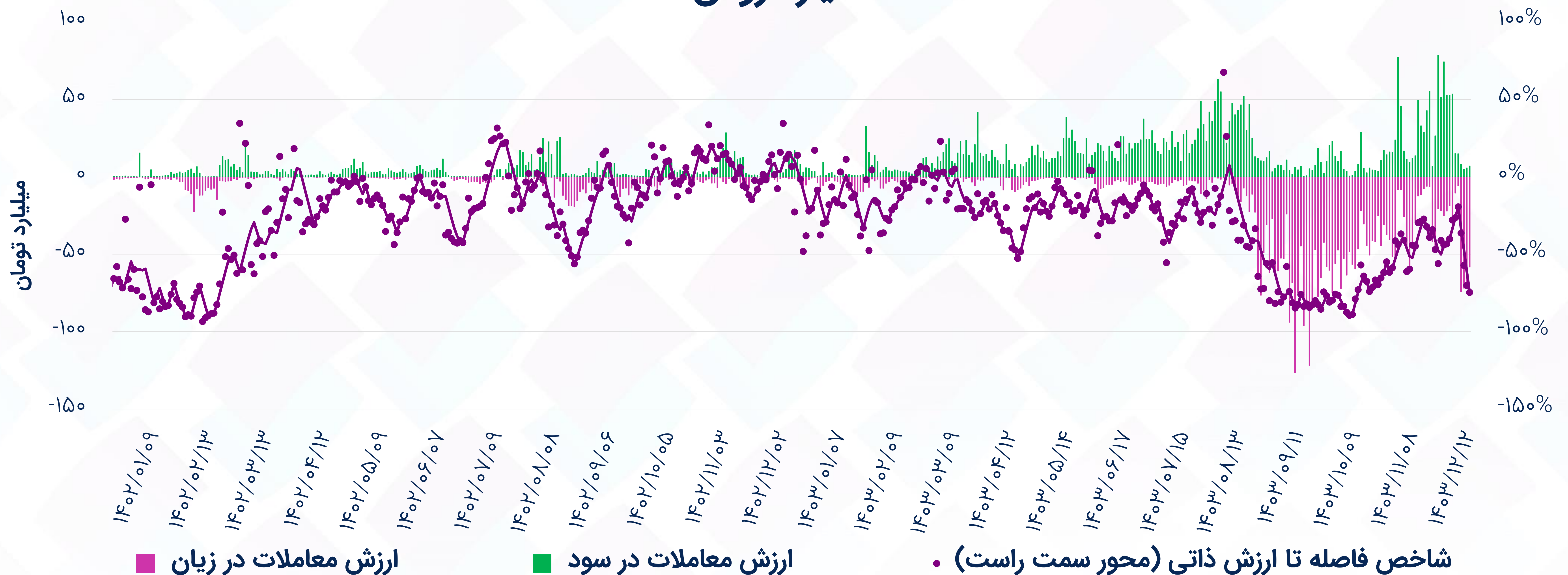
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

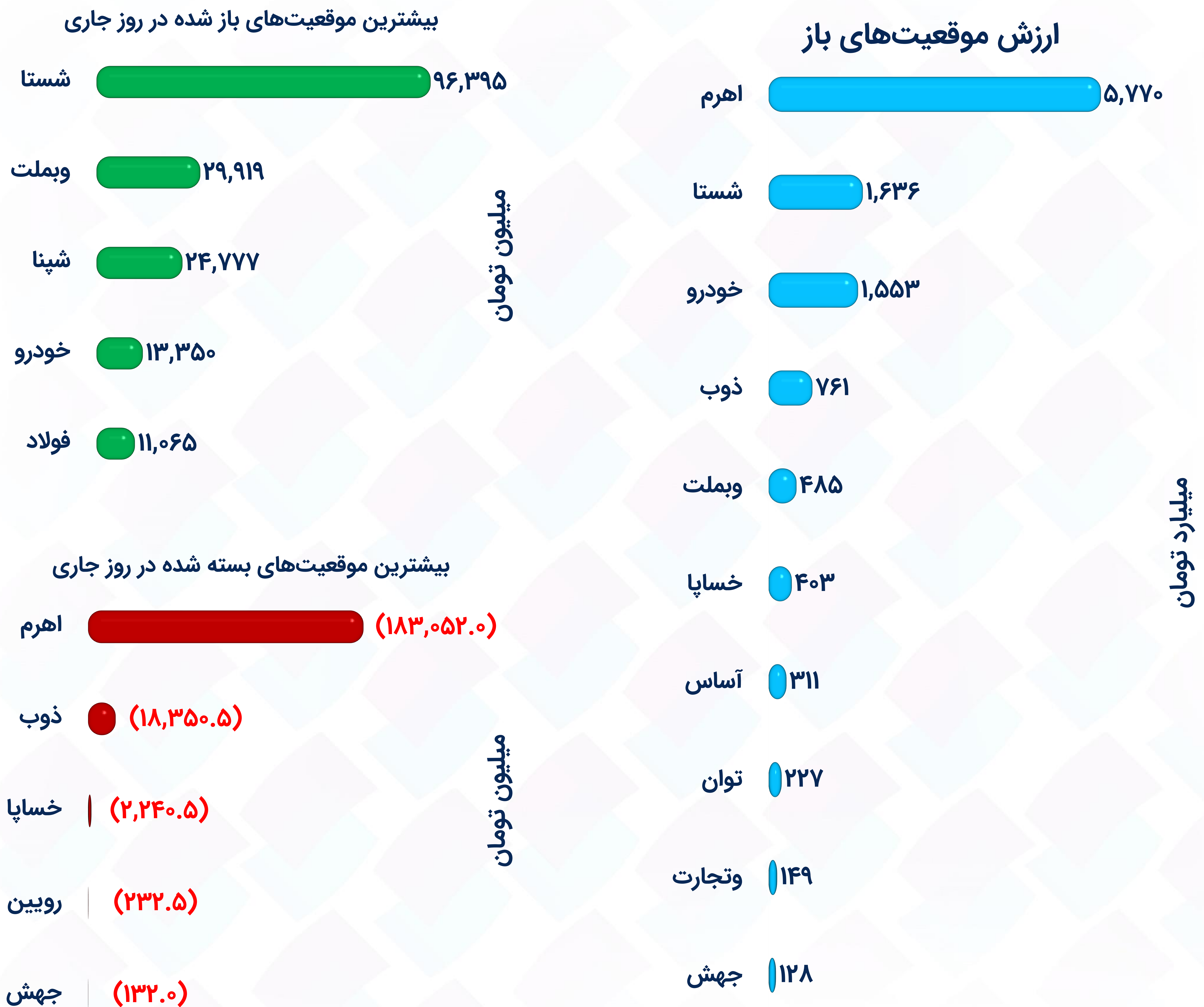
اختیار خرید

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	۴۸	۳۱۲.۷	۴,۳۲۰.۲	۲۴۷.۵	۶۵.۳	(۵.۹%)
خودرو	۳۵	۵۴.۲	۶۱۳.۲	۴۰.۲	۱۴.۰	(۱۸.۶%)
شستا	۴۷	۴۹.۲	۶۷۷.۱	۱۴.۲	۳۵.۰	(۲۴.۴%)
ذوب	۲۴	۱۷.۱	۱۶۹.۸	۱۱.۸	۵.۳	(۱۸.۰%)
وبملت	۲۰	۱۶.۰	۱۰۰.۲	۱۵.۰	۱.۰	(۲۱.۴%)
خسپا	۱۸	۱۴.۴	۲۳۵.۴	۱۲.۱	۲.۳	۲.۶%
توان	۲۴	۵.۰	۱۳.۸	۵.۰	۰.۰	۱.۷%

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	۵۳,۶۰۳.۹	۳,۰۸۳,۲۹۵.۲	۶,۵۴۰.۹	۴۷,۰۶۳.۱	(۷۲.۹%)
خودرو	۷	۱۰,۲۷۲.۶	۸۲۴,۰۰۰.۹	۵۳.۸	۱۰,۲۱۸.۷	(۸۴.۲%)
شستا	۷	۱,۵۵۲.۴	۷۰,۷۹۵.۳	۴۸۳.۴	۱,۰۶۹.۰	(۷۳.۸%)
ذوب	۲	۱۷.۱	۱,۲۶۳.۸	۱۵.۰	۲.۱	(۴۰.۸%)
خودران	۲	۶.۹	۱۵۲.۳	۶.۹	۰.۰	(۱۹.۷%)
توان	۲	۱.۲	۳۵۴.۲	۰.۰	۱.۲	(۹۱.۵%)
وبملت	۴	۱.۰	۶۲۳.۶	۰.۰	۱.۰	(۸۰.۴%)

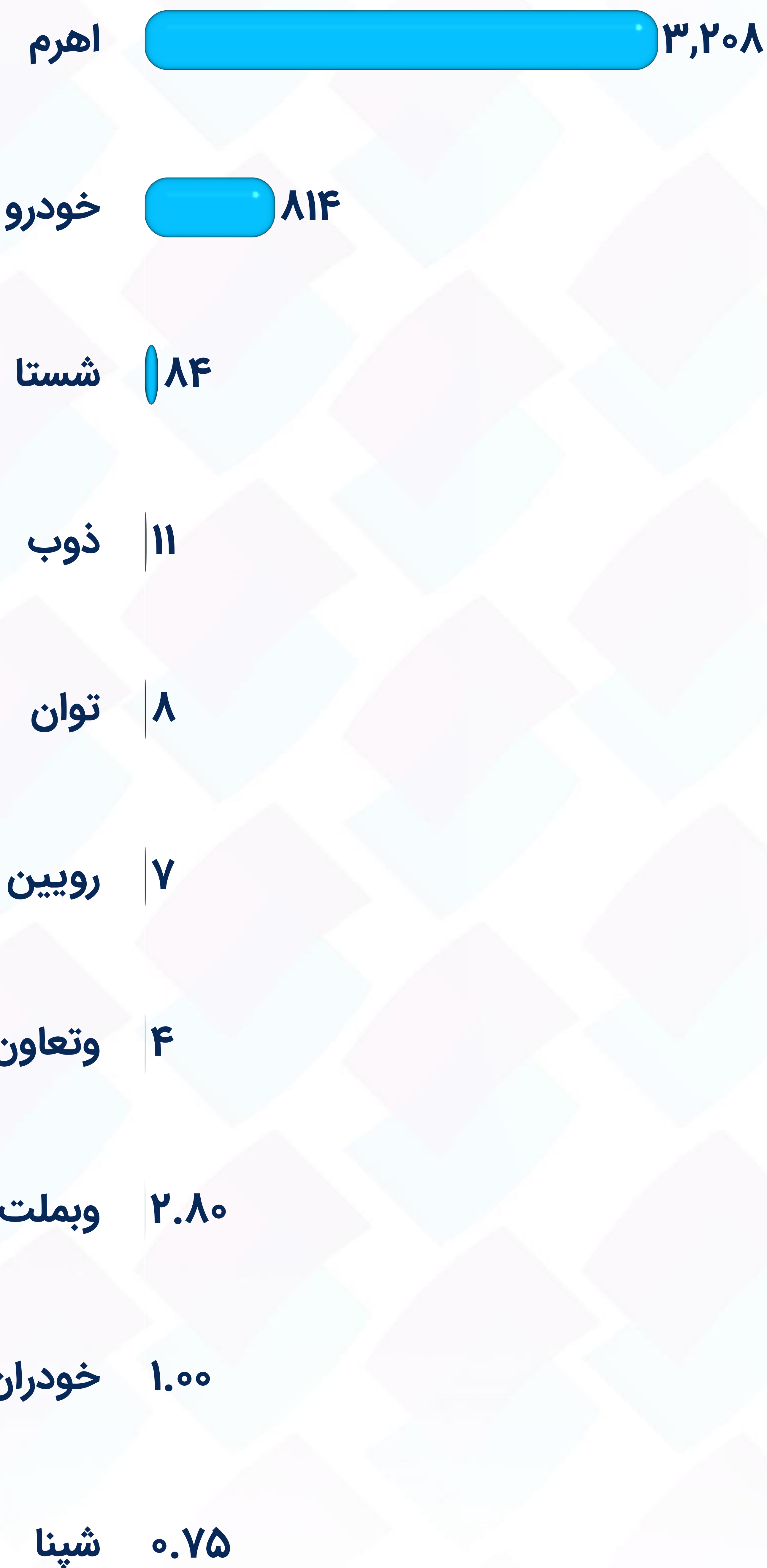
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



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
ضتوان ۱۲۲۲	توان	۲۸,۰۰۰	۷	۱.۵	۲۰۰	۲۷,۰۳۷	۲۸,۲۰۰	۴.۳%	۱۴۱.۰	۰.۳۳	۳۲۷	۶۳%
ضتیام ۱۲۰۶	تیام	۱۴,۰۰۰	۱۴	۳.۷	۱۵۰	۱۳,۶۸۳	۱۴,۱۵۰	۳.۴%	۹۴.۳	۰.۴۵	۲۳۶	۵۷%
ضفلا ۳۰۴۸	فولاد	۶,۰۰۰	۹۳	۷۹.۱	۳۵۱	۵,۸۲۰	۶,۳۵۱	۹.۱%	۱۸.۱	۰.۶۸	۴۹۷	۴۲%
ضاساس ۱۲۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۱۴	۹.۸	۶۰۰	۴۸,۸۴۱	۵۰,۶۰۰	۳.۶%	۸۴.۳	۰.۴۵	۸۲۵	۳۷%
ضرویین ۱۲۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۱۴	۱۲۸.۴	۷۱۵	۱۲,۷۲۲	۱۲,۷۱۵	(۰.۱%)	۱۷.۸	۰.۹۴	۹۲۶	۳۰%

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 ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۳۸	۳.۷	۶	۴۸۳	۷۰۶	۴۶%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۷۳	۵.۰	۱۸	۴۸۳	۸۱۸	۶۹%	۴۵.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضملت ۰۱۲۲	وبملت	۲,۹۳۴	۴۵	۸.۹	۲۷	۲,۱۱۴	۲,۹۶۱	۴۰%	۱۰۹.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۴	۴۵.۴	۱۸	۳,۸۸۷	۵,۰۱۸	۲۹%	۲۷۸.۸	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۵۹	۷.۴	۳۱	۱,۳۹۹	۱,۹۳۱	۳۸%	۶۲.۳	۰.۰۱	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
طران ۳۰۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۱۰۸	۲۰	۵۰۰	۱۰,۸۸۰	۱۰,۵۰۰	(۳.۵%)	۲۱.۰	-۰.۲۹	۴۲۹	(۱۴.۲%)
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۰	۳۵۳.۹	۲,۵۳۷	۲۷,۸۰۰	۲۷,۴۶۳	(۱.۲%)	۱۰.۸	-۰.۸۱	۲,۰۱۳	(۲۰.۷%)
طران ۰۱۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۴۵	۴.۹	۴۹۲	۱۰,۸۸۰	۱۰,۵۰۸	(۳.۴%)	۲۱.۴	-۰.۳۹	۳۸۴	(۲۲.۰%)
طخود ۰۱۴۱	خودرو	۴,۵۰۰	۲۴	۵.۹	۶۹۸	۳,۸۸۷	۳,۸۰۲	(۲.۲%)	۵.۴	-۰.۹۳	۵۲۷	(۲۴.۵%)
طذوب ۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۱۰	۱۵.۰	۲۹	۴۸۳	۴۷۱	(۲.۵%)	۱۶.۲	-۰.۶۱	۲۰	(۳۲.۷%)

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
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۰	۱۴.۴	۱۷	۲۷,۸۰۰	۱۹,۹۸۳	(۲۸.۱%)	۱,۱۷۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۲۴	۷.۶	۸	۳,۸۸۷	۲,۷۹۲	(۲۸.۲%)	۳۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۰	۲۱۷.۴	۳۷	۲۷,۸۰۰	۲۱,۹۶۳	(۲۱.۰%)	۵۹۳.۶	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۲۴	۳۴.۰	۶	۳,۸۸۷	۲,۹۹۴	(۲۳.۰%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طذوب ۱۲۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۰	۲.۱	۱	۴۸۳	۳۹۹	(۱۷.۴%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۳%)

(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)

ضهرم ۱۲۴۳
۱۰
۲۶۰۰۰ ۱,۰۹۵

ضهرم ۱۲۴۴
۱۰
۲۸۰۰۰ ۸۴۹

ضهرم ۱۲۴۵
۱۰
۳۰۰۰۰ ۸۲۶

ضستا ۱۲۴۸
۳۸
۱۴۰۰ ۵۸۴

ضهرم ۱۲۴۲
۱۰
۲۴۰۰۰ ۵۶۴

ضهرم ۱۲۴۱
۴۵
۲۶۰۰۰ ۵۰۵

ضهرم ۱۲۴۲
۴۵
۲۸۰۰۰ ۴۱۴

ضخود ۱۴۰
۲۴
۴۰۰۰ ۳۵۷

ضهرم ۱۲۴۱
۱۰
۲۲۰۰۰ ۲۸۲

ضخود ۱۳۸
۲۴
۳۵۰۰ ۲۷۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۴۱
۴۵
۲۶۰۰۰ ۳۳,۲۲۳

ضستا ۱۲۴۸
۳۸
۱۴۰۰ ۲۶,۳۹۶

ضستا ۱۲۴۹
۳۸
۱۵۰۰ ۲۵,۴۰۰

ضهرم ۱۲۴۴
۴۵
۳۴۰۰۰ ۲۱,۱۳۴

ضهرم ۱۲۴۰
۴۵
۲۴۰۰۰ ۱۸,۱۷۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۴۳
۱۰
۲۶۰۰۰ (۱۷۹,۰۸۸.۰)

ضهرم ۱۲۴۲
۱۰
۲۴۰۰۰ (۵۸,۳۹۲.۰)

ضهرم ۱۲۴۴
۱۰
۲۸۰۰۰ (۲۸,۹۸۰.۰)

ضدوب ۱۲۰۳
۱۰
۵۰۰ (۲۲,۷۸۶.۷)

ضهرم ۱۲۴۱
۱۰
۲۲۰۰۰ (۲۲,۷۱۵.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

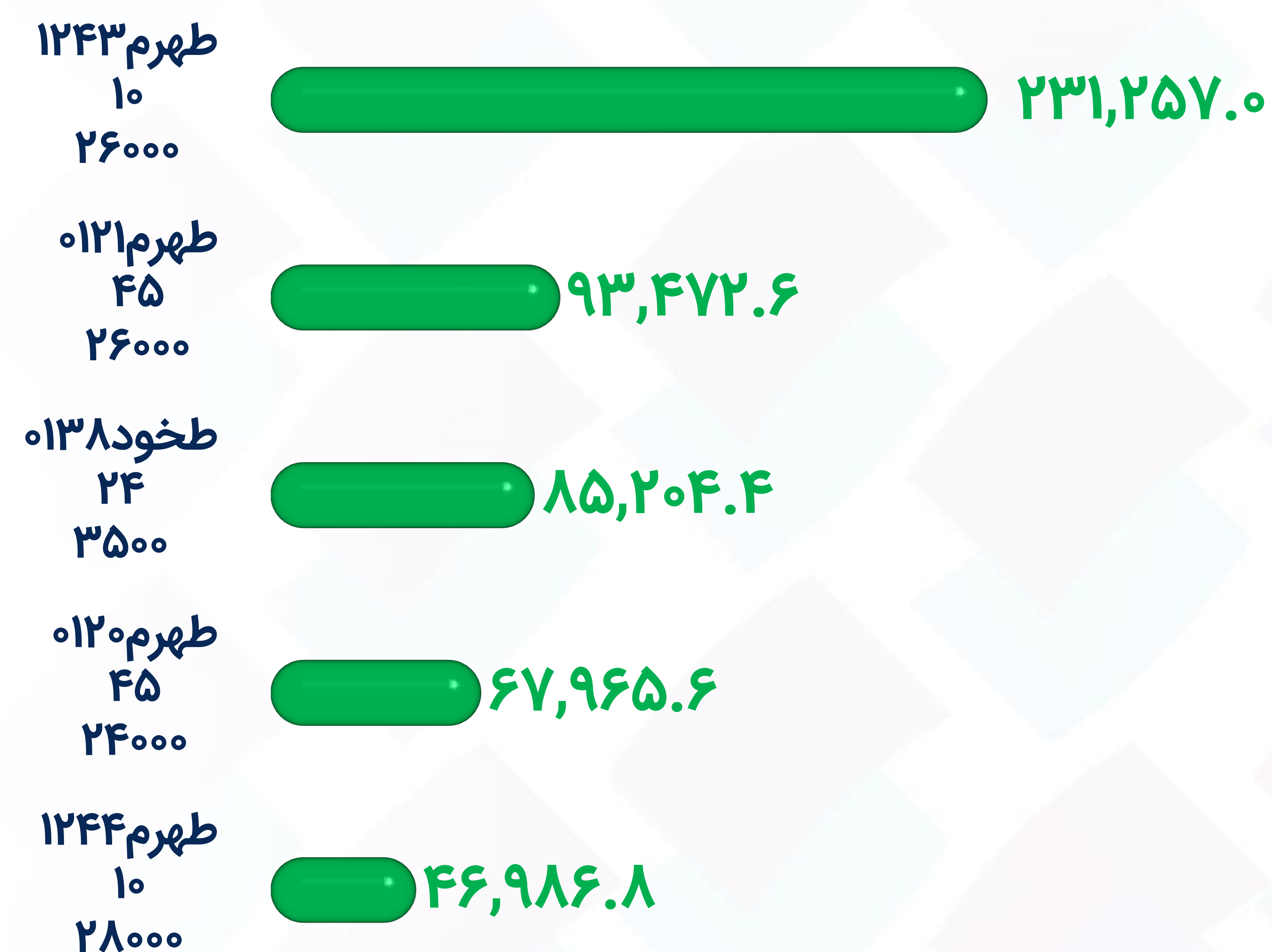
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

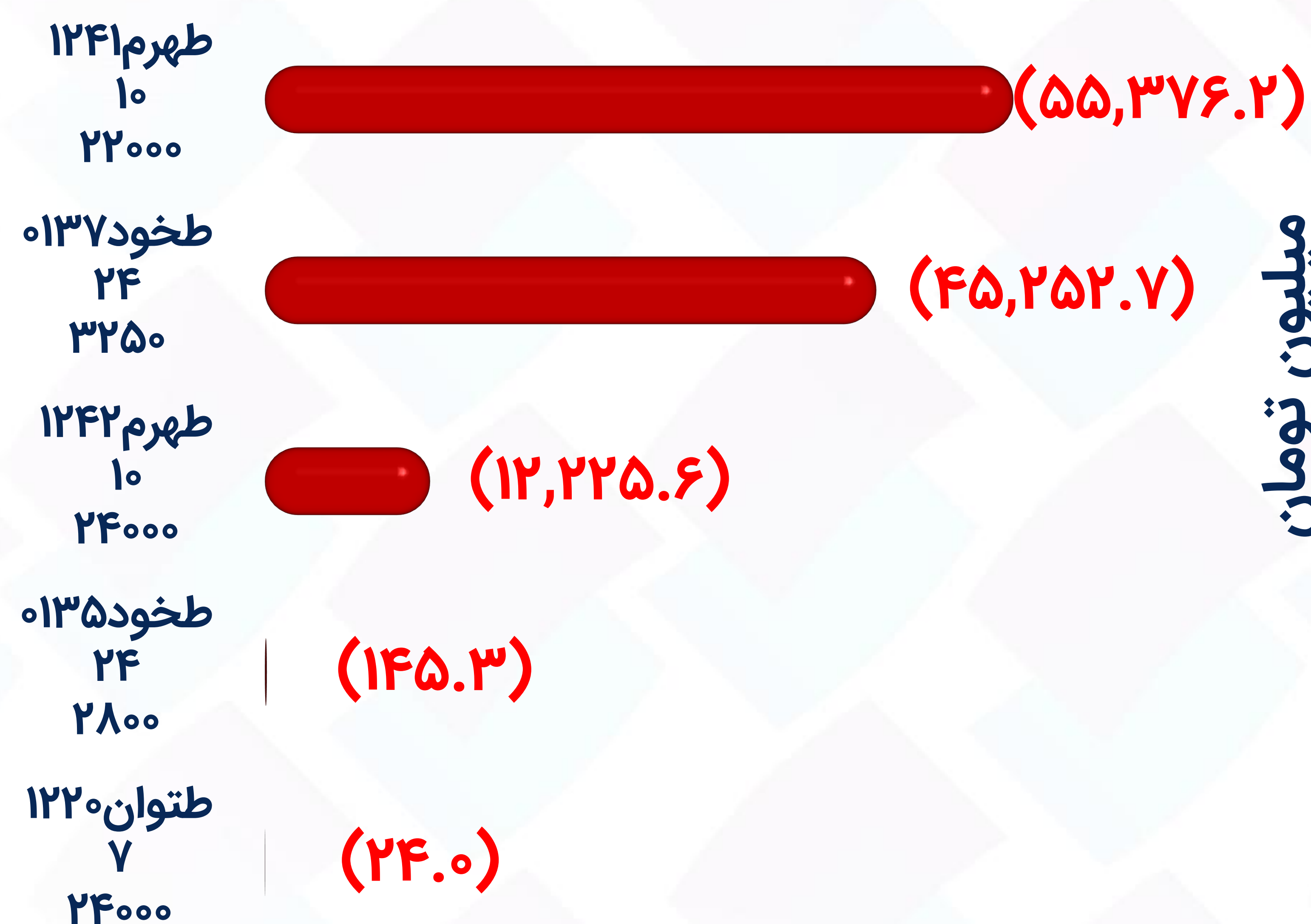
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

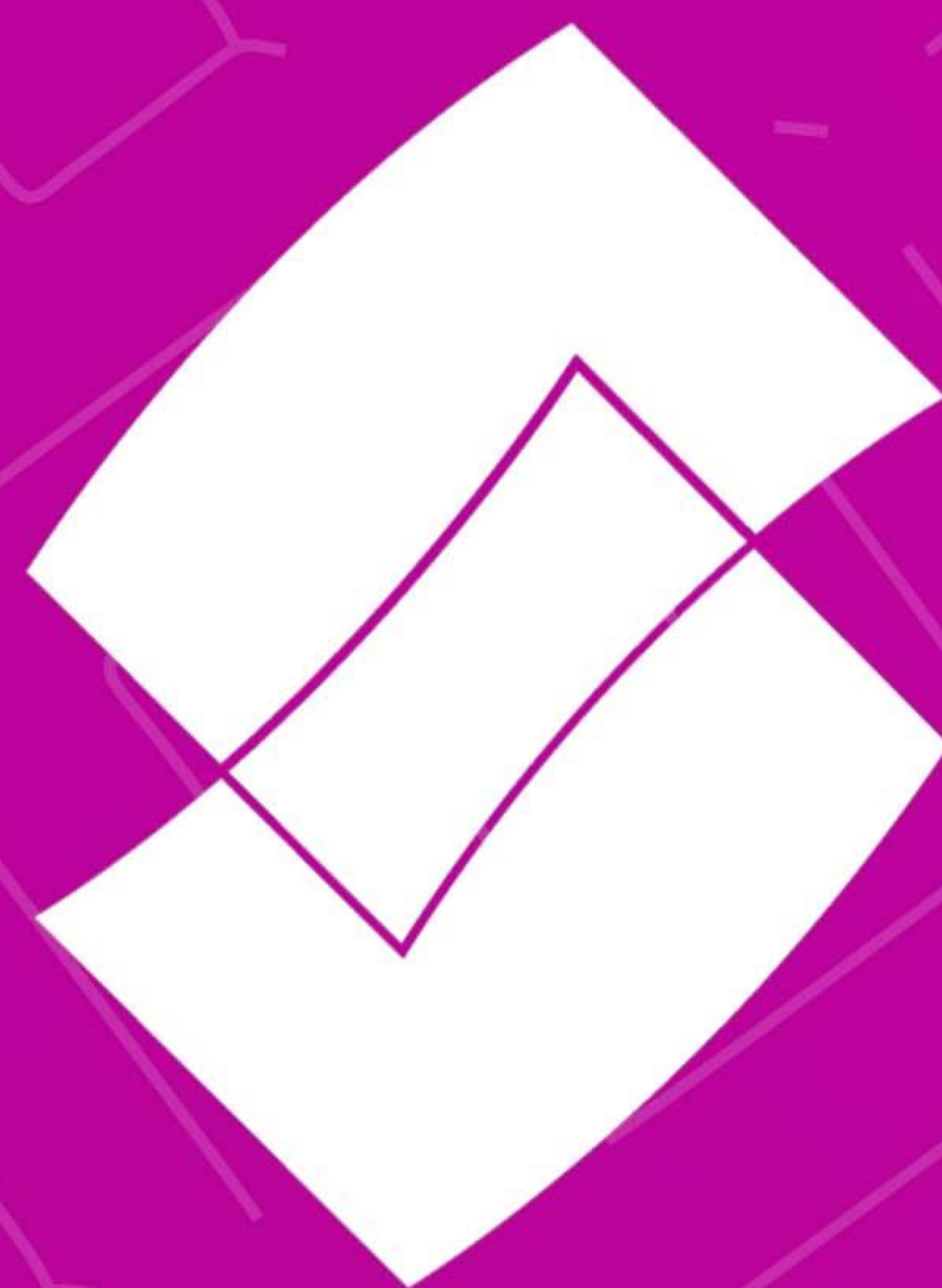
اختیار خرید



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.