

شماره
۴۳۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





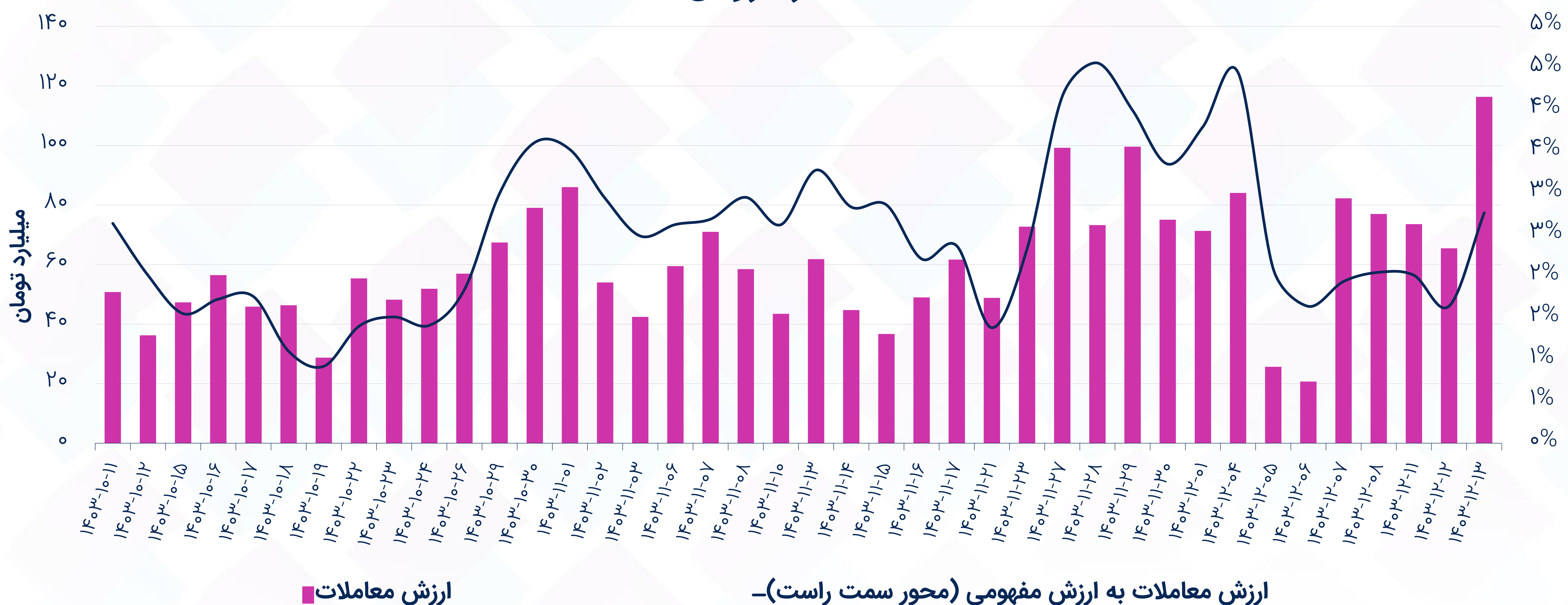
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



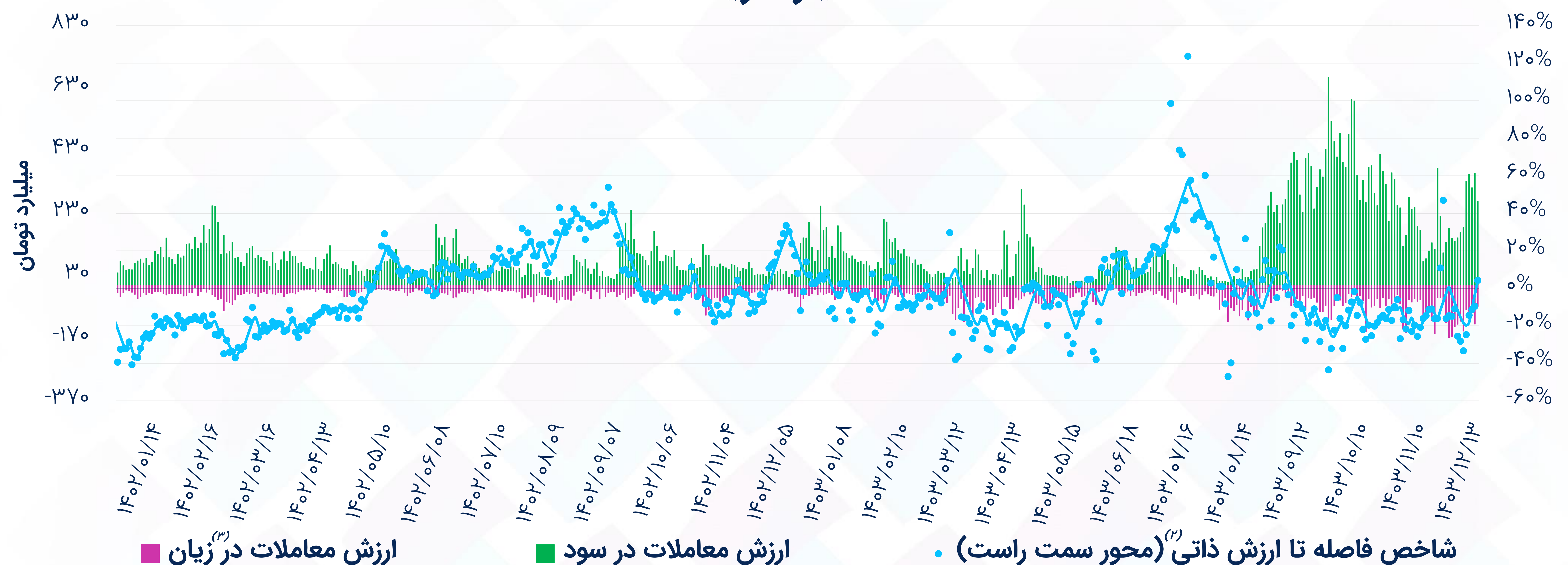
اختیار فروش



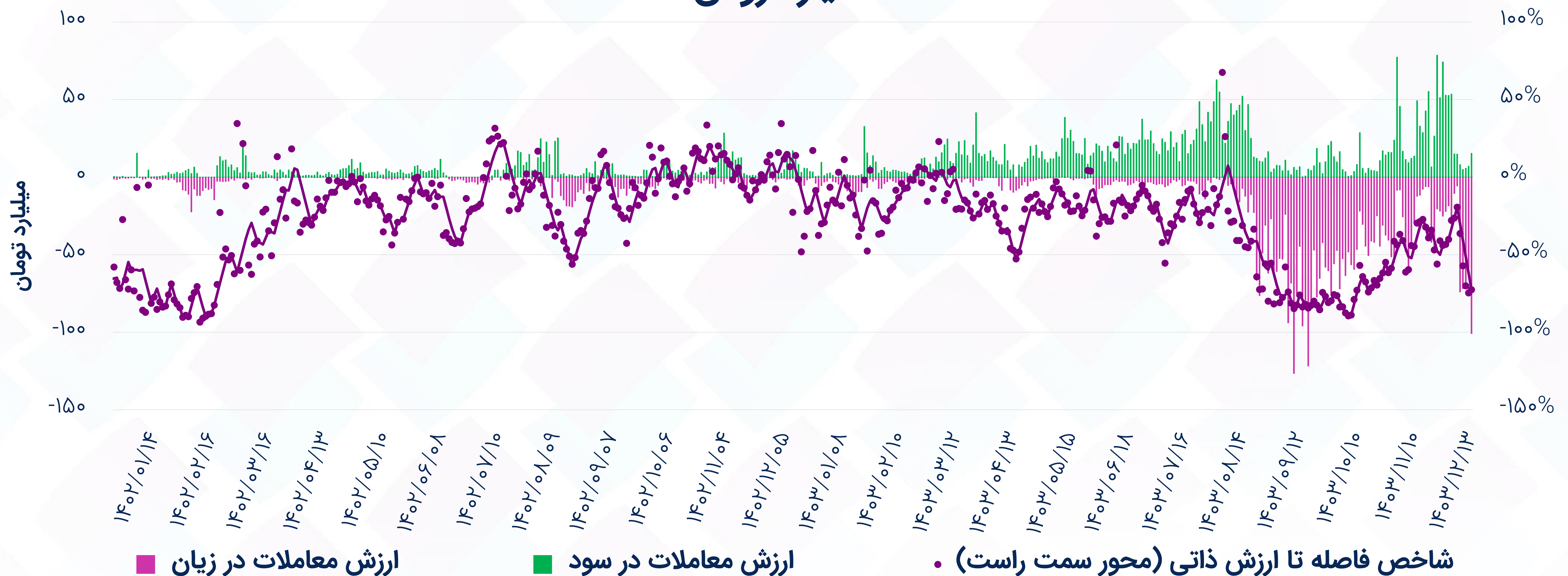
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۲	۱۸۳.۹	۴,۳۲۶.۹	۱۵۴.۹	۲۹.۰	۱۶.۵%
خودرو	۳۷	۷۰.۵	۹۱۶.۲	۵۸.۸	۱۱.۷	(۱۳.۵%)
شستا	۴۲	۲۶.۵	۴۷۲.۰	۷.۶	۱۸.۹	(۲۸.۴%)
وبملت	۱۹	۱۶.۰	۱۱۴.۹	۱۴.۵	۱.۶	(۱۹.۳%)
ذوب	۲۷	۱۲.۴	۲۳۰.۷	۷.۹	۴.۶	(۱۲.۶%)
توان	۱۹	۱۰.۶	۳۴.۷	۱۰.۶	۰.۰	۱۹.۲%
خسپا	۱۹	۹.۹	۲۳۲.۲	۹.۳	۰.۶	۳۲.۶%

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	۱۸	۹۲,۴۲۸.۸	۳,۰۰۱,۵۹۵.۷	۱۴,۴۴۸.۲	۷۷,۹۸۰.۶	(۷۱.۴%)
خودرو	۸	۲۰,۳۸۷.۶	۱,۰۹۸,۱۳۱.۵	۱۷۵.۷	۲۰,۲۱۱.۹	(۷۷.۹%)
شستا	۴	۳,۴۵۴.۸	۱۰۴,۴۲۵.۲	۷۵۴.۱	۲,۷۰۰.۷	(۷۳.۷%)
ذوب	۴	۳۶.۱	۳,۶۸۶.۳	۲۸.۹	۷.۲	(۴۱.۸%)
وبملت	۲	۱۴.۸	۶۳۵.۳	۰.۰	۱۴.۸	(۸۳.۱%)
توان	۱	۴.۴	۲۱.۰	۴.۴	۰.۰	(۳۵.۲%)
وتعاون	۱	۲.۱	۱۴۰.۳	۰.۰	۲.۱	(۵۴.۴%)

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



میلیون تومان



میلیون تومان

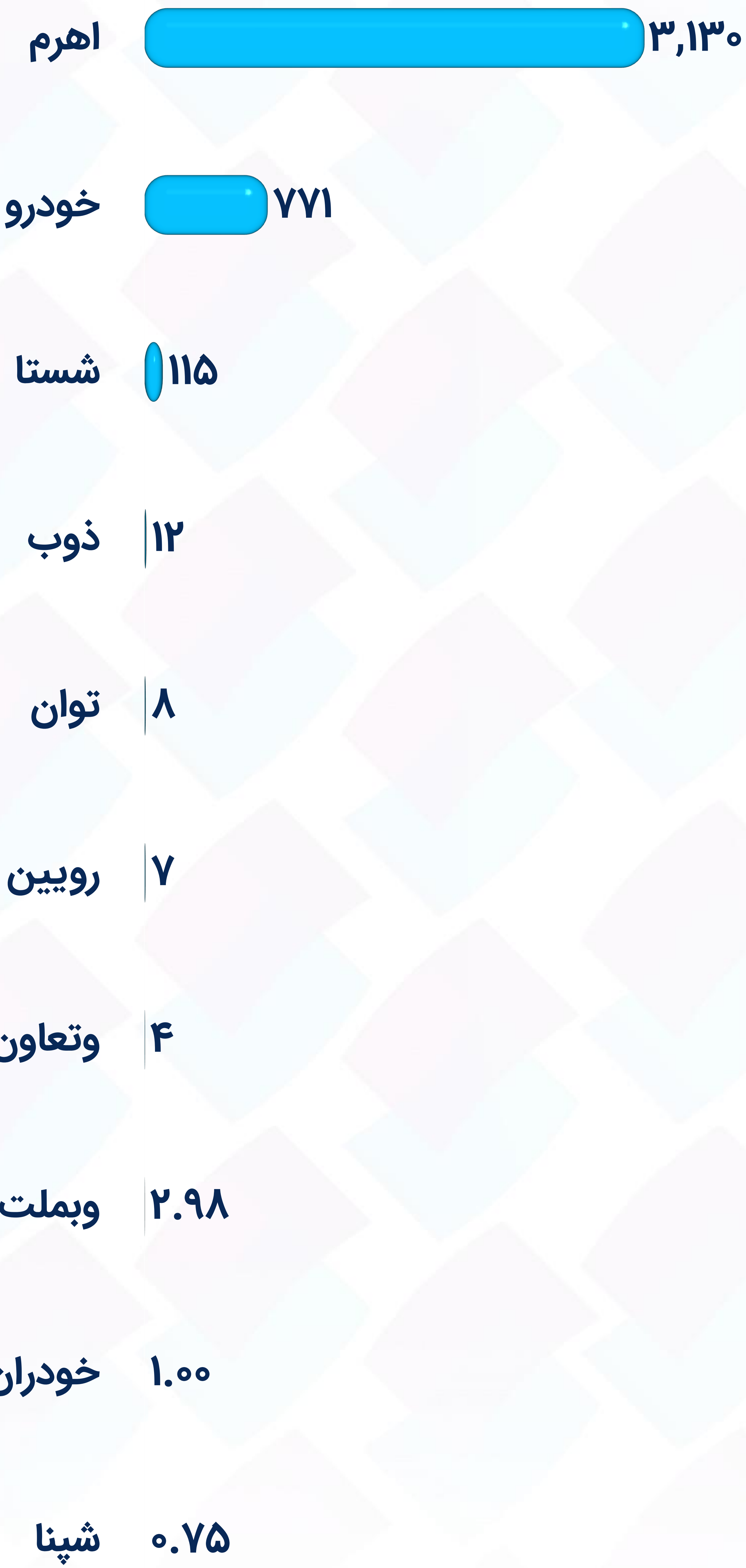


میلیارد تومان

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

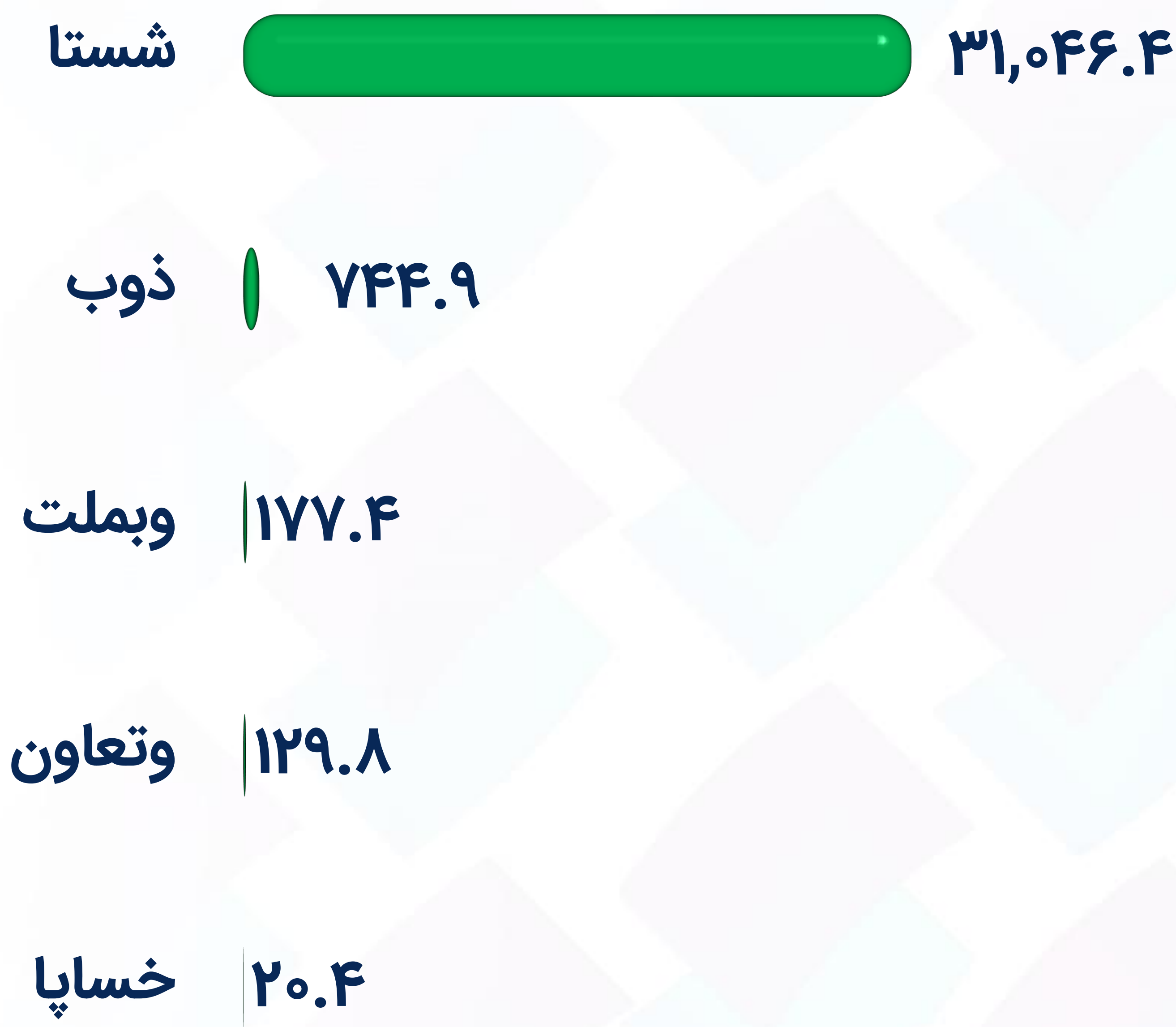
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



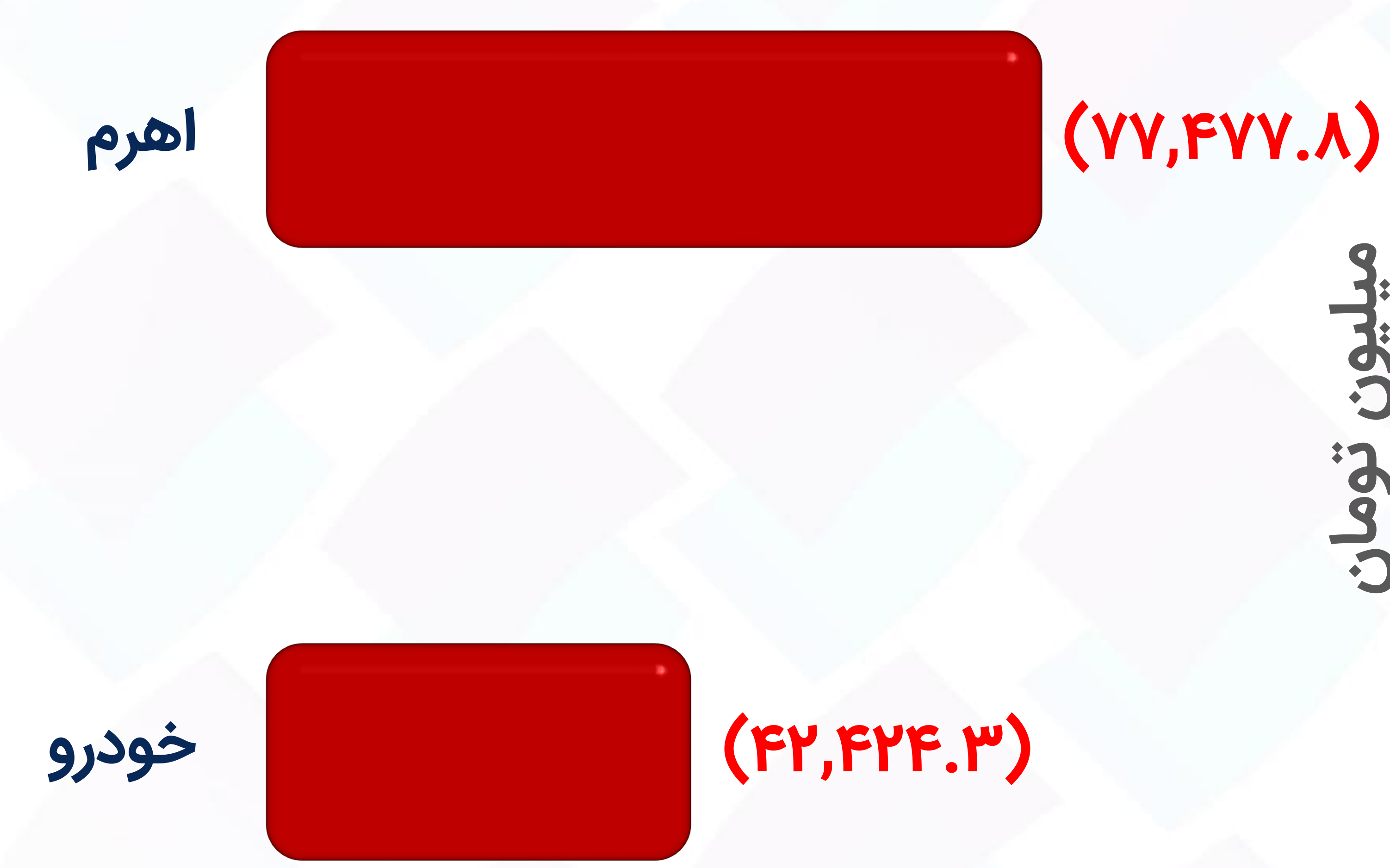
میلیارد تومان

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
ضوتعاون ۱۰۶	وتعاون	۱,۳۰۰	۴۱	۱.۳	۱۳	۱,۵۹۱	۱,۳۱۳	(۱۷.۵%)	۱۰۱.۰	۱.۰۰	۳۳۳	۲۴۶۴%
ضتاب ۱۲۰۹	شتاب	۱۴,۰۰۰	۲	۹.۵	۱۸۵	۱۴,۵۰۰	۱۴,۱۸۵	(۲.۲%)	۷۶.۷	۰.۸۴	۶۱۱	۲۳۰%
ضجهش ۱۲۰۶	جهش	۱۲,۰۰۰	۲	۲۳.۱	۱۸۵	۱۲,۴۵۰	۱۲,۱۸۵	(۲.۱%)	۶۵.۹	۰.۸۴	۵۴۹	۱۹۷%
ضجهش ۱۲۰۷	جهش	۱۳,۰۰۰	۲	۱.۳	۲۰	۱۲,۴۵۰	۱۳,۰۲۰	۴.۶%	۶۵۱.۰	۰.۱۹	۵۵	۱۷۳%
ضجهش ۱۲۰۵	جهش	۱۱,۰۰۰	۲	۲۵۰.۱	۶۰۹	۱۲,۴۵۰	۱۱,۶۰۹	(۶.۸%)	۱۹.۱	۱.۰۰	۱,۴۹۷	۱۴۶%

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	۹	۱.۵	۱	۴۶۹	۷۰۱	۴۹%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۹	۱۰.۸	۱	۴۶۹	۶۰۱	۲۸%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹۲	۴.۵	۵۸	۱,۳۵۸	۲,۲۵۸	۶۶%	۳۸.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۳	۲۱.۸	۱۶	۳,۷۸۰	۵,۰۱۶	۳۳%	۳۱۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۷۲	۳.۷	۱۵	۴۶۹	۸۱۵	۷۴%	۵۴.۳	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
طخودا ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۲۳	۵۴.۴	۷۲۰	۳,۷۸۰	۳,۷۸۰	۰.۰%	۵.۳	-۰.۹۷	۶۳۴	(۱۲.۰%)
طذوب ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۹	۱.۵	۱۵۰	۴۶۹	۴۵۰	(۴.۱%)	۳.۰	-۱.۰۰	۱۲۴	(۱۷.۲%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۴	۳۱.۷	۷,۲۰۰	۲۶,۹۷۰	۲۶,۸۰۰	(۰.۶%)	۳.۷	-۰.۹۵	۵,۸۵۷	(۱۸.۷%)
طذوب ۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۹	۲۷.۴	۴۱	۴۶۹	۴۵۹	(۲.۱%)	۱۱.۲	-۰.۷۸	۲۹	(۲۹.۰%)
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۹	۷۳۲.۹	۴,۱۵۳	۲۶,۹۷۰	۲۵,۸۴۷	(۴.۲%)	۶.۲	-۰.۹۲	۲,۷۴۶	(۳۳.۹%)

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	۹	۹.۸	۲۶	۲۶,۹۷۰	۱۹,۹۷۴	(۲۵.۹%)	۷۶۸.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخودا ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۲۳	۲۶.۰	۷	۳,۷۸۰	۲,۷۹۳	(۲۶.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۹	۵۵۲.۰	۵۸	۲۶,۹۷۰	۲۱,۹۴۲	(۱۸.۶%)	۳۷۸.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طخودا ۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۲۳	۹۵.۰	۸	۳,۷۸۰	۲,۹۹۲	(۲۰.۸%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۵%)
طهرم ۱۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۴۴	۲.۷	۱۵۷	۲۶,۹۷۰	۱۹,۸۴۳	(۲۶.۴%)	۱۲۶.۴	۰.۰۰	۲	(۹۹.۰%)

(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

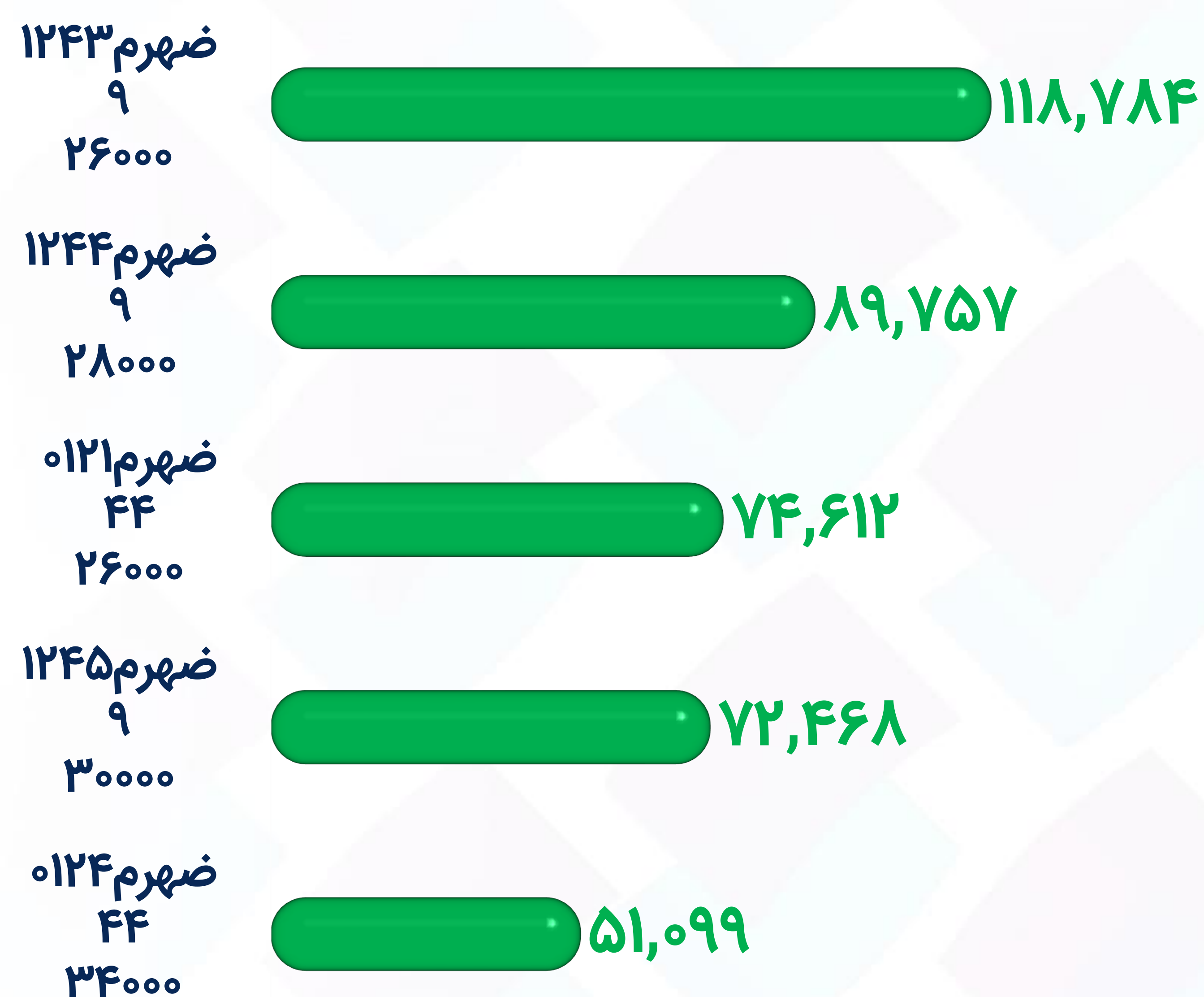
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

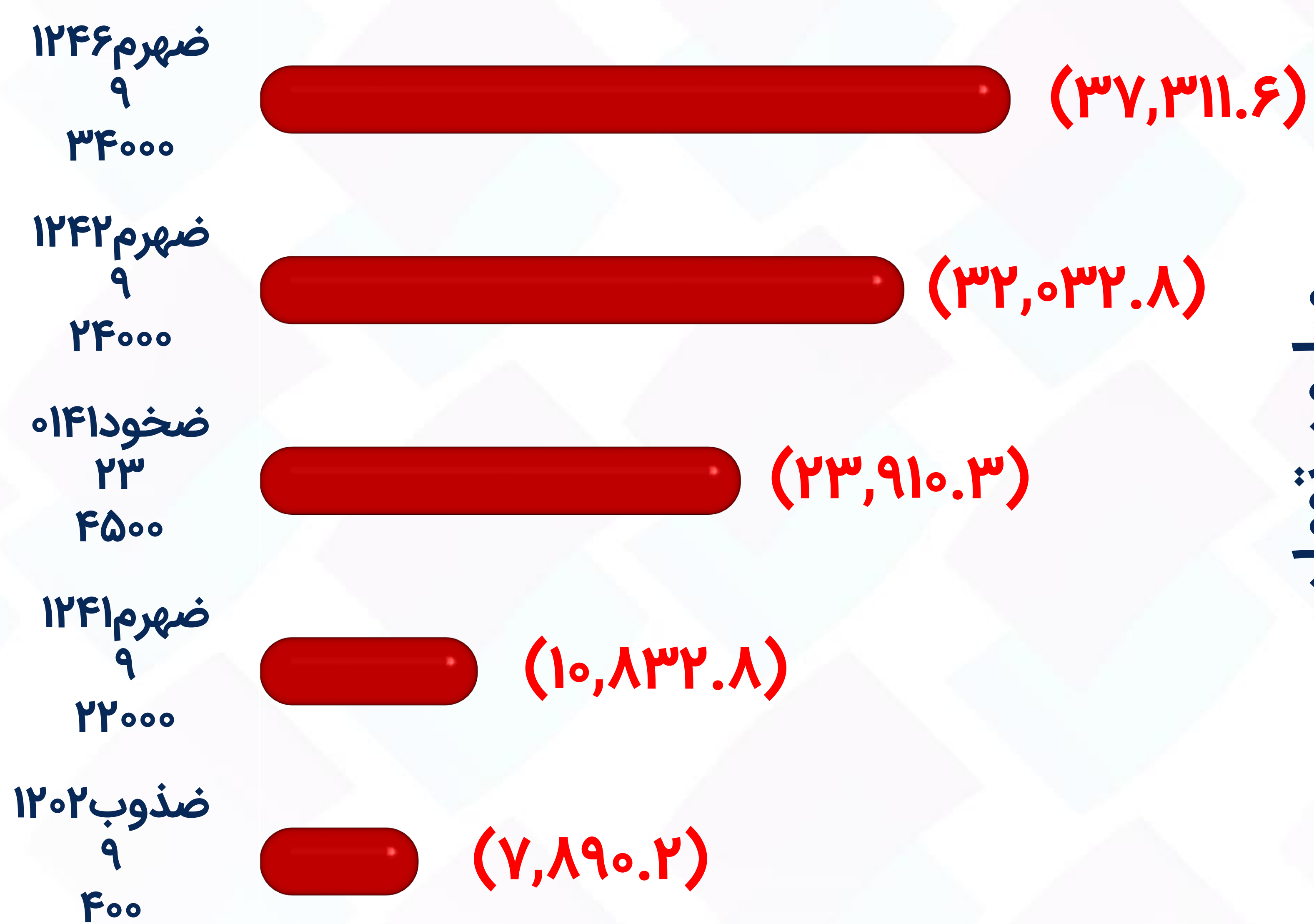
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)



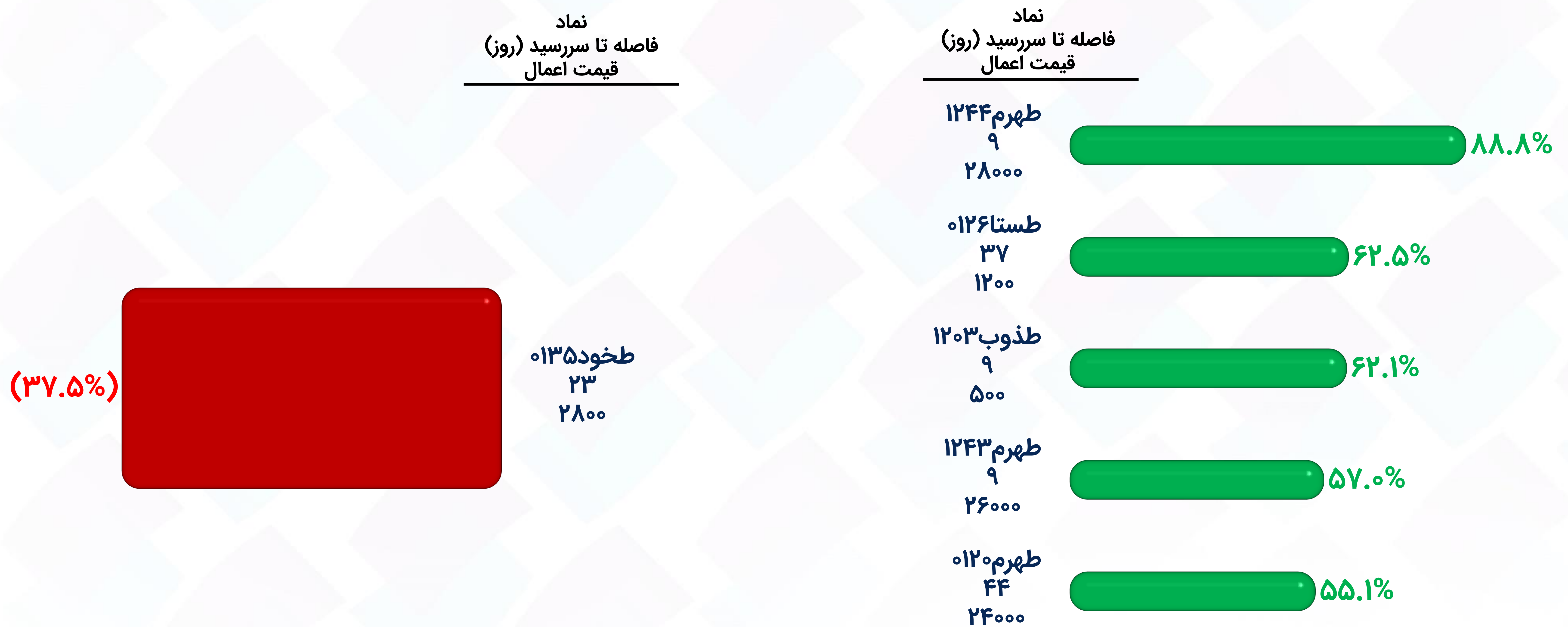
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

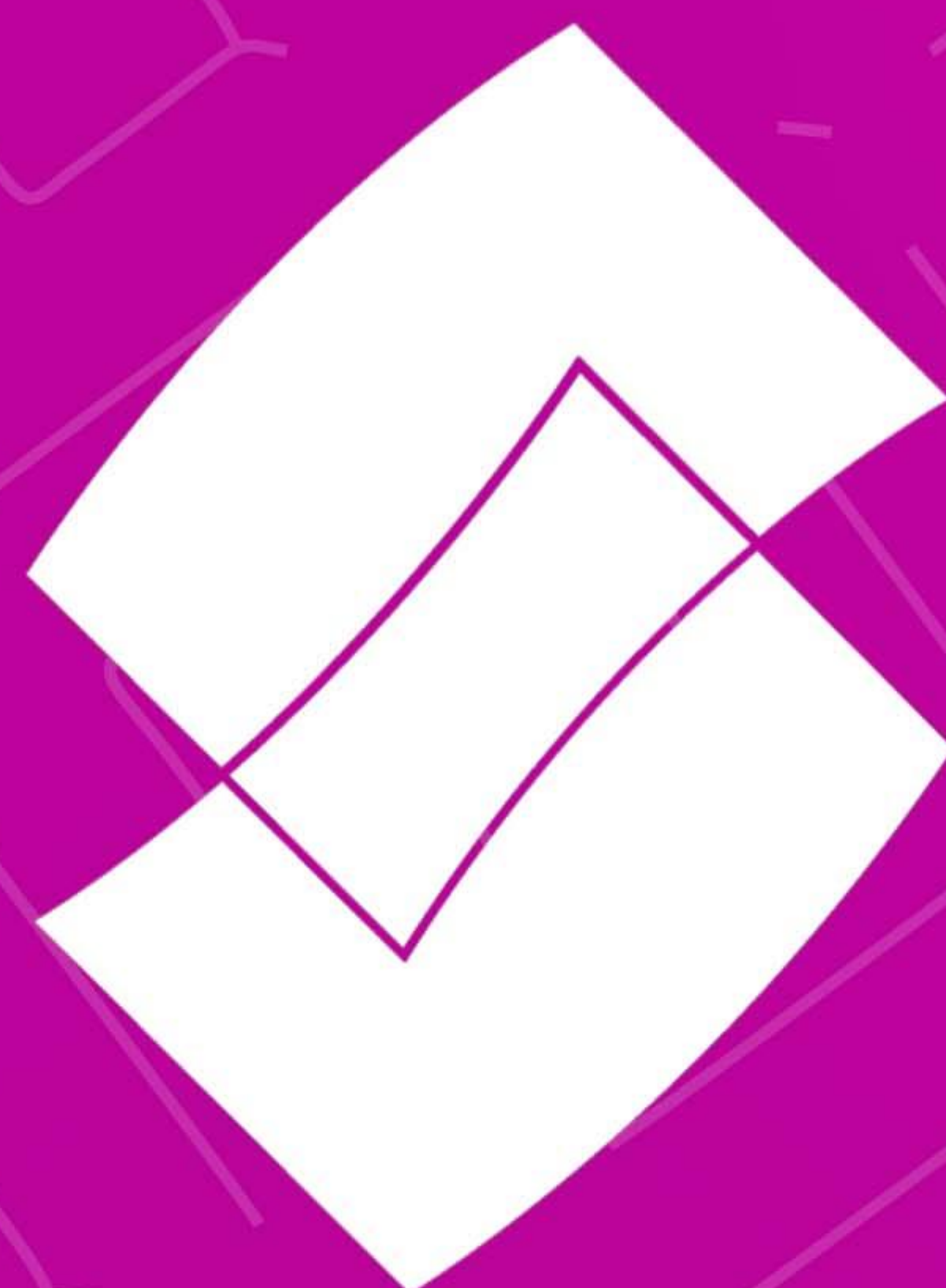
اختیار خرید



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.