

شماره
۴۳۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۴ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





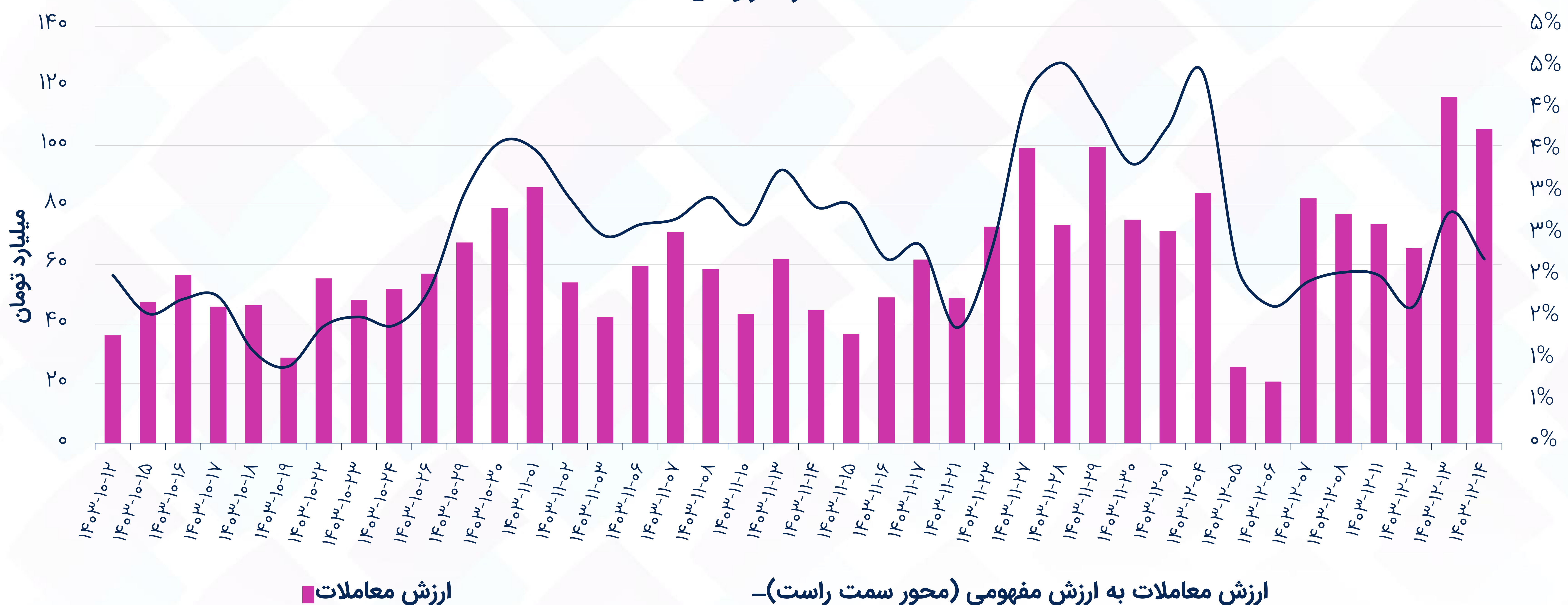
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



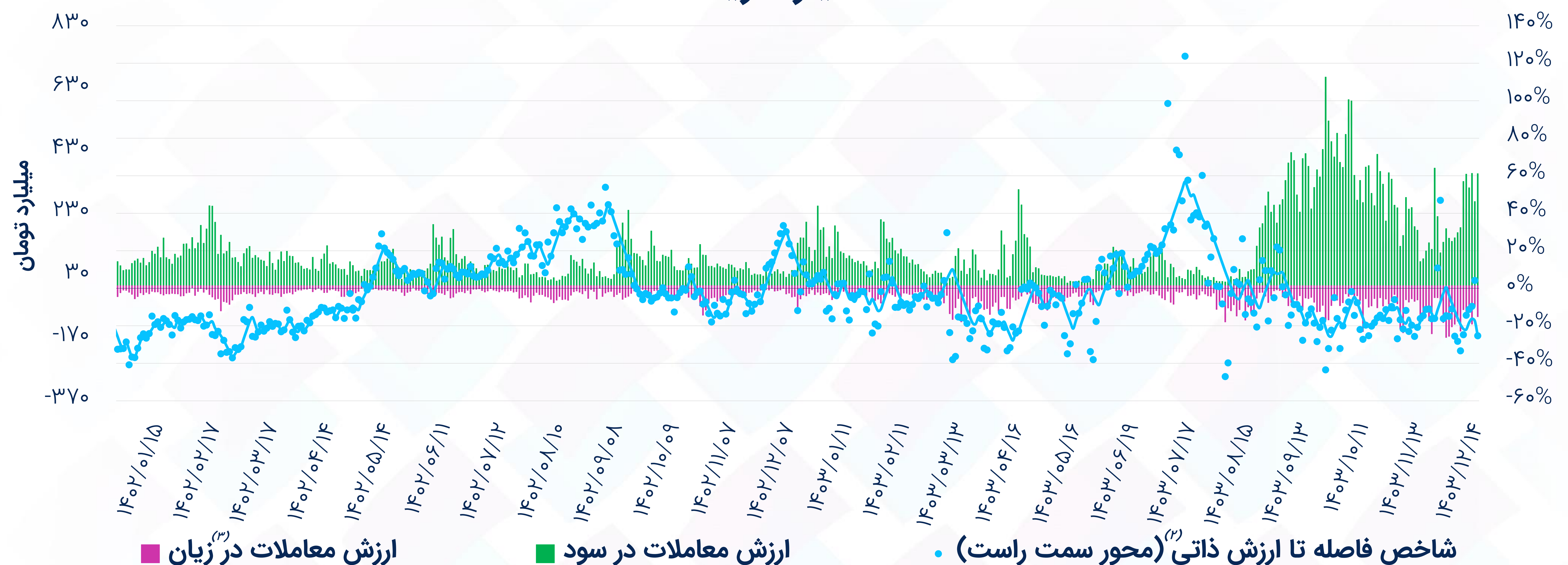
اختیار فروش



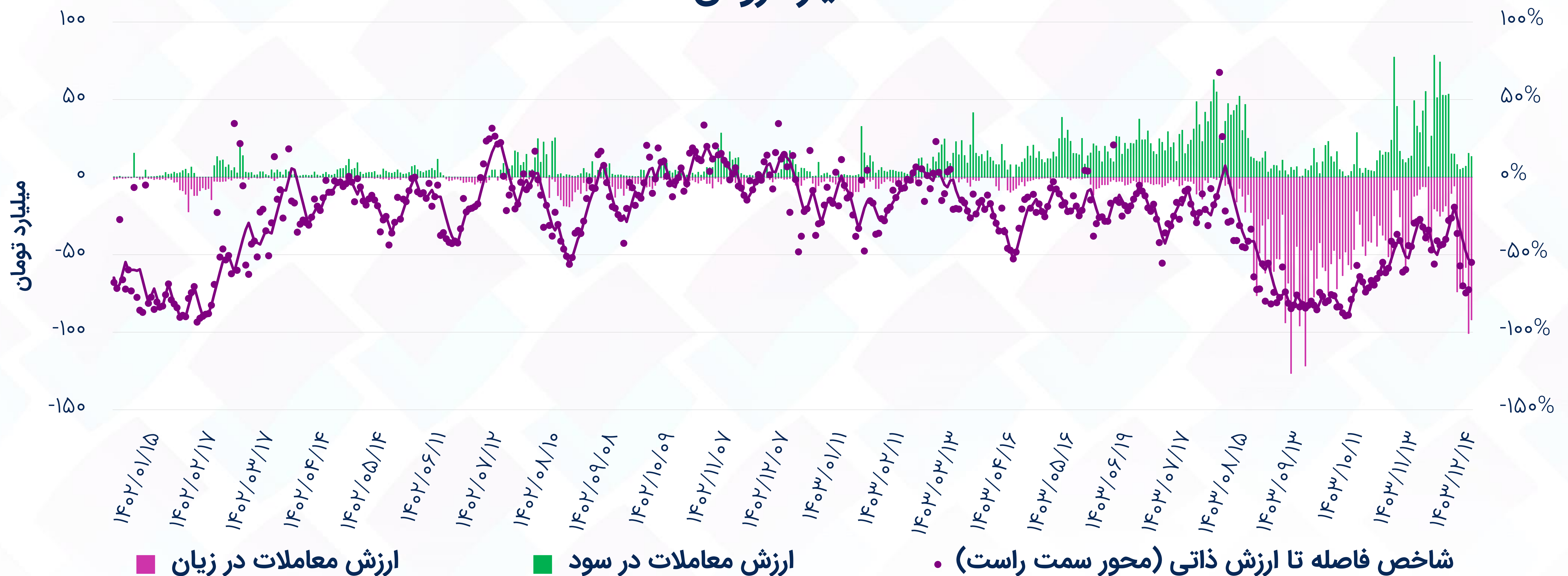
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۷	۲۸۲.۹	۵,۹۳۳.۹	۲۳۳.۴	۴۹.۴	(۲۹.۰%)
خودرو	۳۸	۶۶.۸	۷۵۹.۳	۴۸.۹	۱۷.۸	(۲۳.۴%)
شستا	۳۶	۳۱.۰	۴۵۳.۳	۸.۵	۲۲.۵	(۳۶.۱%)
ذوب	۲۵	۱۵.۰	۱۷۵.۱	۹.۹	۵.۱	(۲۸.۵%)
وبملت	۲۲	۱۳.۵	۹۴.۶	۱۱.۵	۲.۱	(۲۰.۳%)
خسپا	۱۸	۱۱.۲	۲۱۵.۳	۹.۹	۱.۳	(۳.۲%)
جهش	۷	۹.۹	۵۴.۵	۹.۹	۰.۰	۱۵.۱%

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	۹۰,۰۸۶.۴	۳,۷۵۶,۱۷۳.۹	۱۲,۷۹۴.۱	۷۷,۲۹۲.۳	(۵۰.۴%)
خودرو	۸	۱۳,۶۸۰.۷	۹۵۳,۹۸۴.۹	۵۸.۶	۱۳,۶۲۲.۰	(۸۳.۰%)
شستا	۵	۱,۴۸۵.۸	۵۷,۶۳۸.۴	۴۸۲.۹	۱,۰۰۲.۹	(۷۲.۴%)
وبملت	۳	۲۱۰.۳	۷,۸۱۸.۳	۰.۰	۲۱۰.۳	(۸۶.۲%)
ذوب	۵	۱۸.۶	۵۵۷.۸	۱۷.۷	۰.۸	(۳۱.۱%)
خودران	۱	۱۷.۱	۲۰۶.۷	۱۷.۱	۰.۰	(۲۶.۳%)
وتعاون	۱	۶.۷	۳۷۴.۳	۰.۰	۶.۷	(۴۳.۲%)

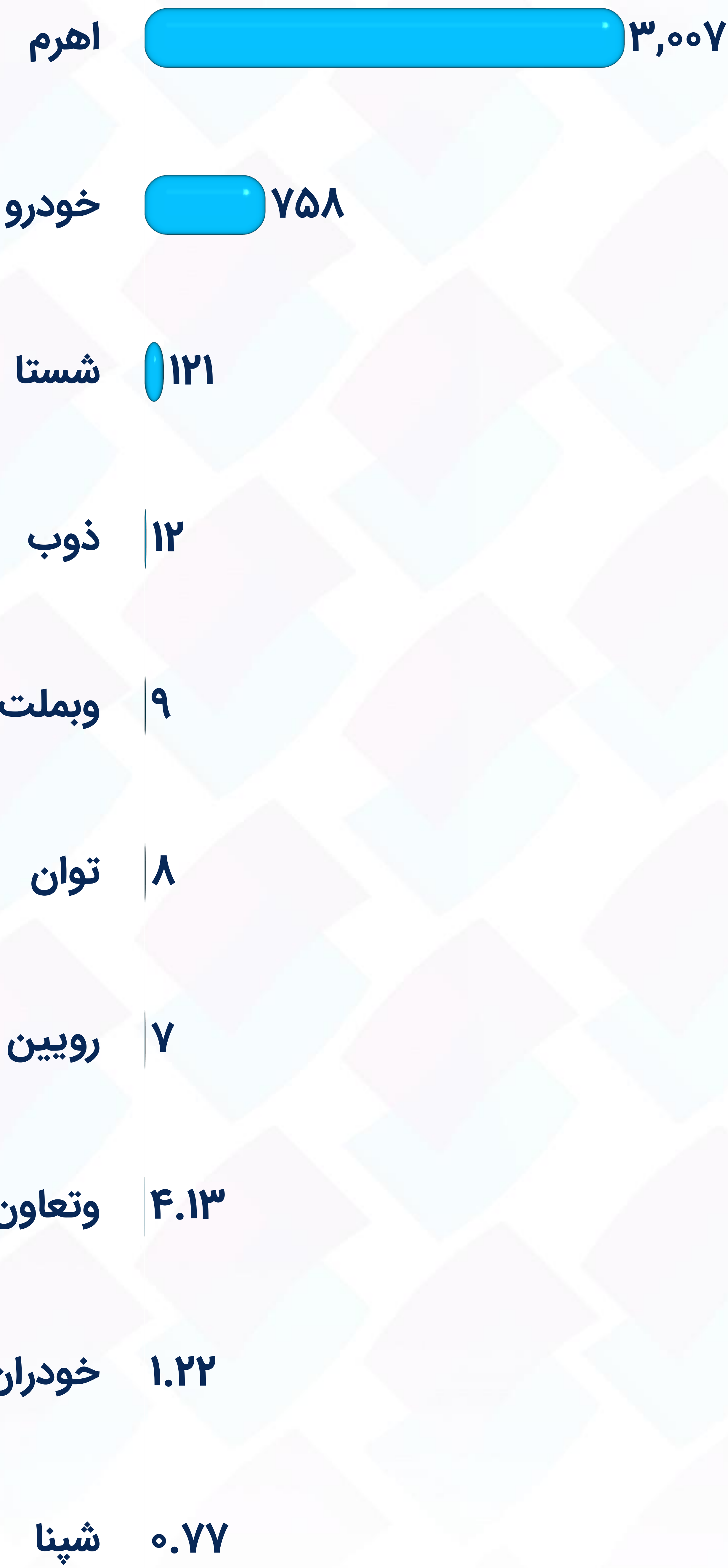
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

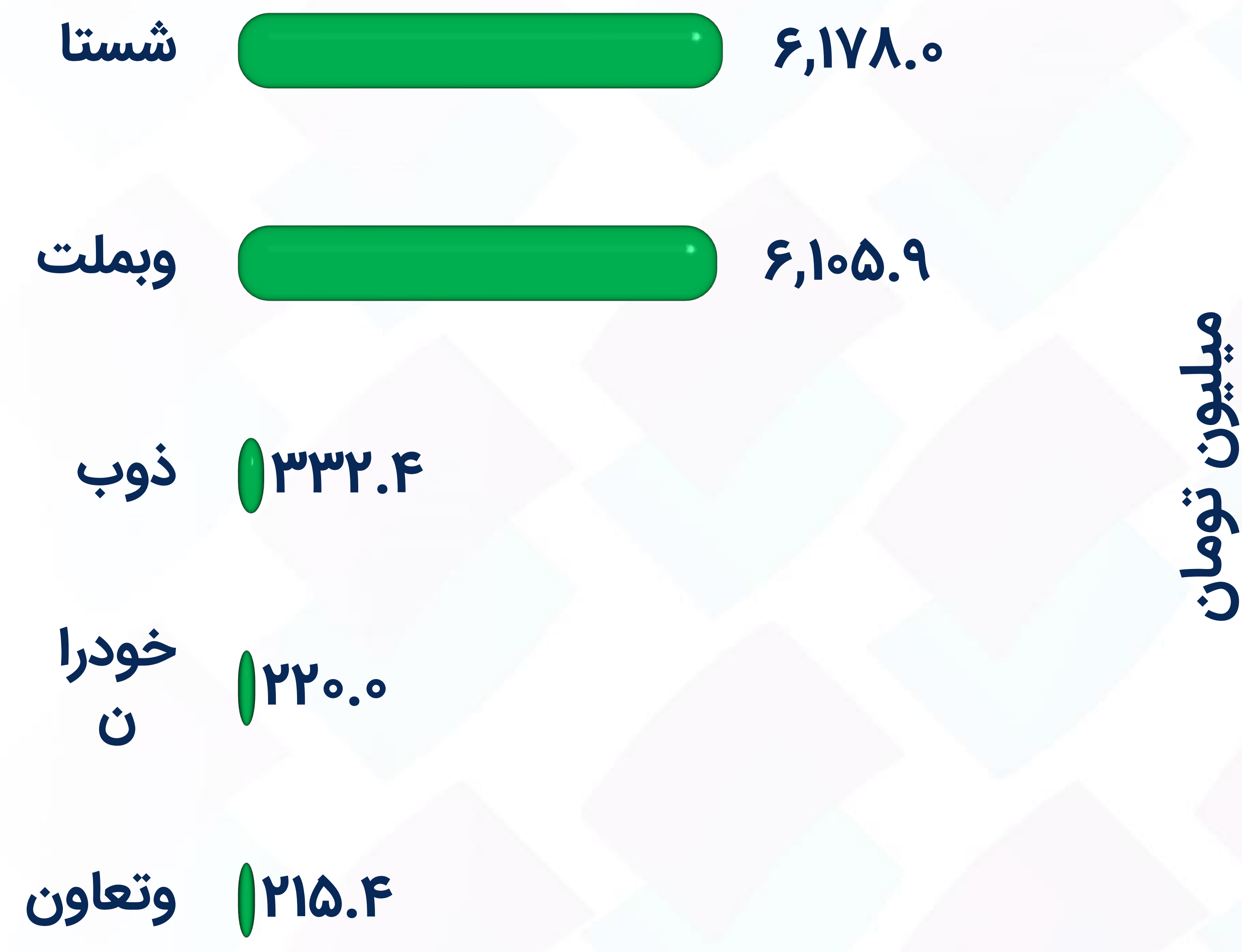
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



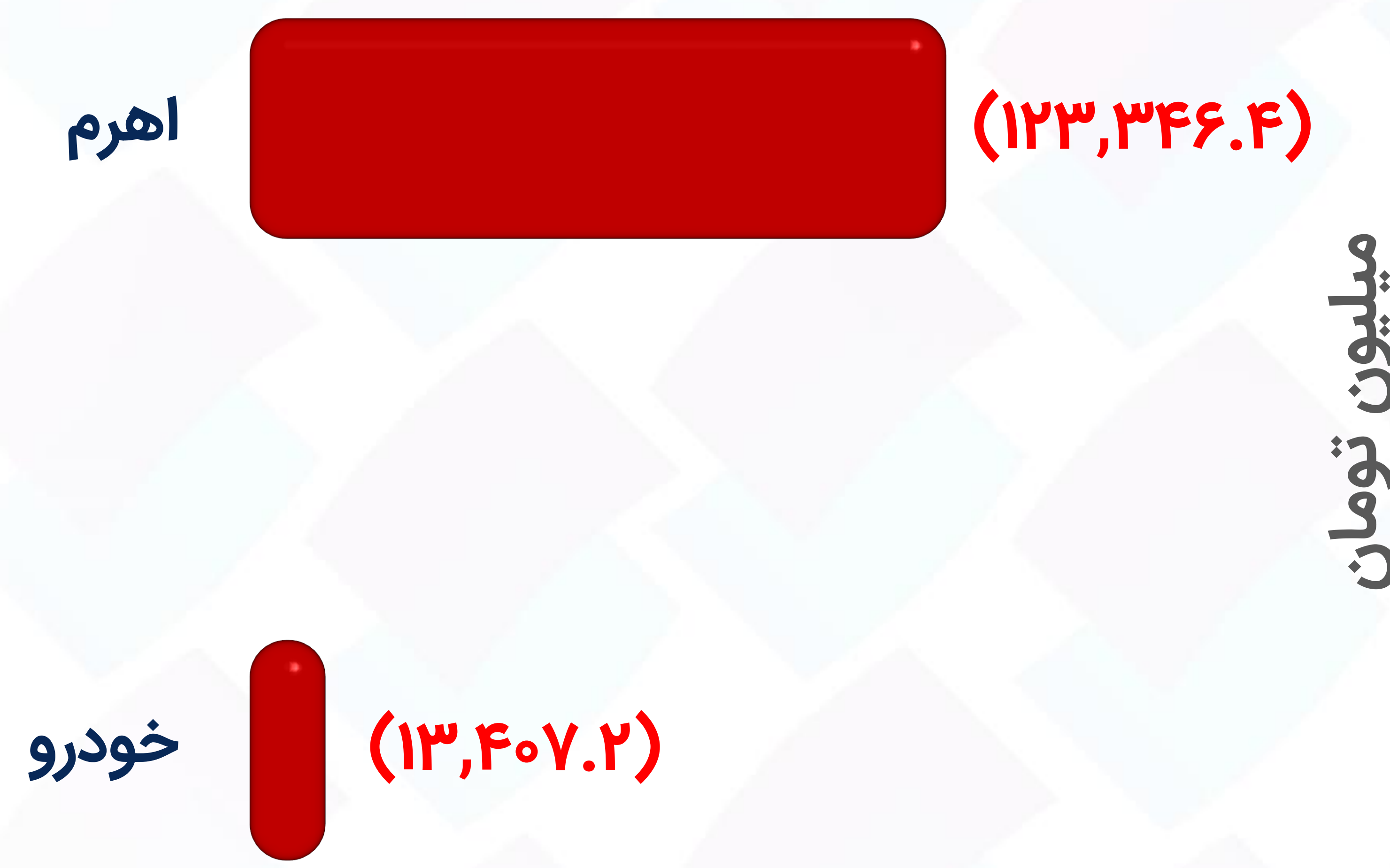
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



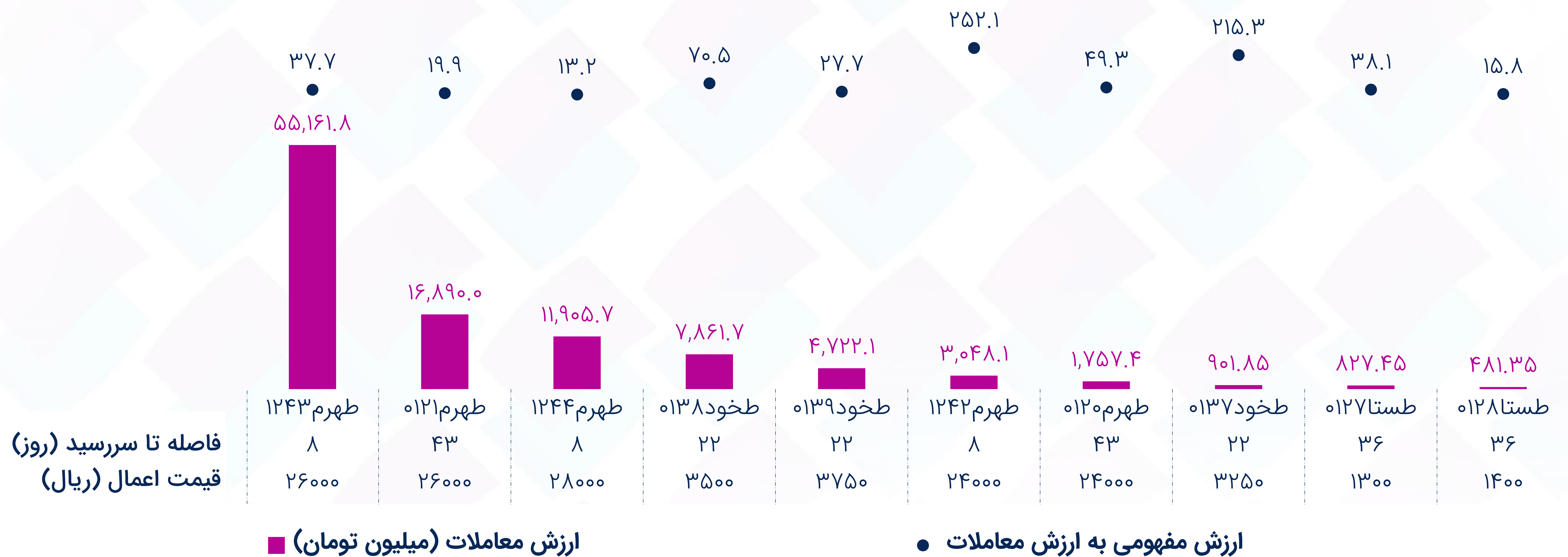
میلیون تومان

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 ۱۲۲۰	توان	۲۴,۰۰۰	۵	۳۳.۶	۹۳۷	۲۵,۶۲۳	۲۴,۹۳۷	(۲.۷%)	۲۶.۶	۰.۹۴	۱,۷۹۰	۹۱%
ضتوان ۱۲۱۹	توان	۲۲,۰۰۰	۵	۳۲.۴	۲,۴۱۷	۲۵,۶۲۳	۲۴,۴۱۷	(۴.۷%)	۱۰.۱	۱.۰۰	۳,۷۴۸	۵۵%
ضخاور ۱۲۰۳	خاور	۱,۳۰۰	۵	۲۰.۲	۴۱	۱,۳۵۱	۱,۳۴۱	(۰.۷%)	۳۲.۷	۰.۸۴	۶۳	۵۵%
ضاساس ۱۲۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۱۲	۲.۰	۱۸۴	۴۷,۵۳۹	۵۰,۱۸۴	۵.۶%	۲۷۲.۷	۰.۲۱	۲۵۷	۴۰%
ضتوان ۱۲۱۸	توان	۲۰,۰۰۰	۵	۸.۸	۴,۲۰۵	۲۵,۶۲۳	۲۴,۲۰۵	(۵.۵%)	۵.۸	۱.۰۰	۵,۷۳۶	۳۶%

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	۸	۱.۱	۱	۴۶۳	۷۰۱	۵۱%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۸	۱۰.۹	۱	۴۶۳	۶۰۱	۳۰%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۳۶	۲.۳	۶	۴۶۳	۷۰۶	۵۲%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۷۴.۵	۳۲	۲۶,۴۷۰	۳۴,۰۳۲	۲۹%	۱,۰۶۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹۱	۱.۴	۶۰	۱,۳۷۱	۲,۲۶۰	۶۵%	۳۷.۷	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
طهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۱.۵	۷,۵۰۰	۲۶,۴۷۰	۲۶,۵۰۰	۰.۱%	۳.۵	-۱.۰۰	۷,۱۹۴	(۴.۱%)
طخود ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۲۲	۲۰.۶	۶۲۷	۳,۸۷۵	۳,۸۷۳	(۰.۱%)	۶.۲	-۰.۹۶	۵۴۸	(۱۲.۶%)
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۸	۴۳۹.۰	۳,۷۲۴	۲۶,۴۷۰	۲۶,۲۷۶	(۰.۷%)	۷.۱	-۰.۹۷	۳,۲۵۳	(۱۲.۷%)
طذوب ۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۸	۸.۷	۴۴	۴۶۳	۴۵۶	(۱.۵%)	۱۰.۴	-۰.۸۶	۳۴	(۲۲.۵%)
طفلا ۱۱۸۰	فولاد	۵,۵۰۰	۳۶	۲.۲	۱۰۹	۵,۵۷۰	۵,۳۹۱	(۳.۲%)	۴۹.۵	-۰.۲۹	۸۲	(۲۴.۷%)

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	۸	۹.۷	۲۱	۲۶,۴۷۰	۱۹,۹۷۹	(۲۴.۵%)	۹۵۱.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۲۲	۱۴.۴	۷	۳,۸۷۵	۲,۷۹۳	(۲۷.۹%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۲۲	۱۲۰.۲	۷	۳,۸۷۵	۲,۹۹۳	(۲۲.۸%)	۴۲۷.۶	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۸	۲۵۸.۱	۲۴	۲۶,۴۷۰	۲۱,۹۷۶	(۱۷.۰%)	۹۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۸.۹%)
طخود ۱۳۷۰	خودرو	۳,۲۵۰	۲۲	۹۰۱.۹	۱۸	۳,۸۷۵	۳,۲۳۲	(۱۶.۶%)	۱۷۹.۶	۰.۰۰	۰	(۹۷.۹%)

(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

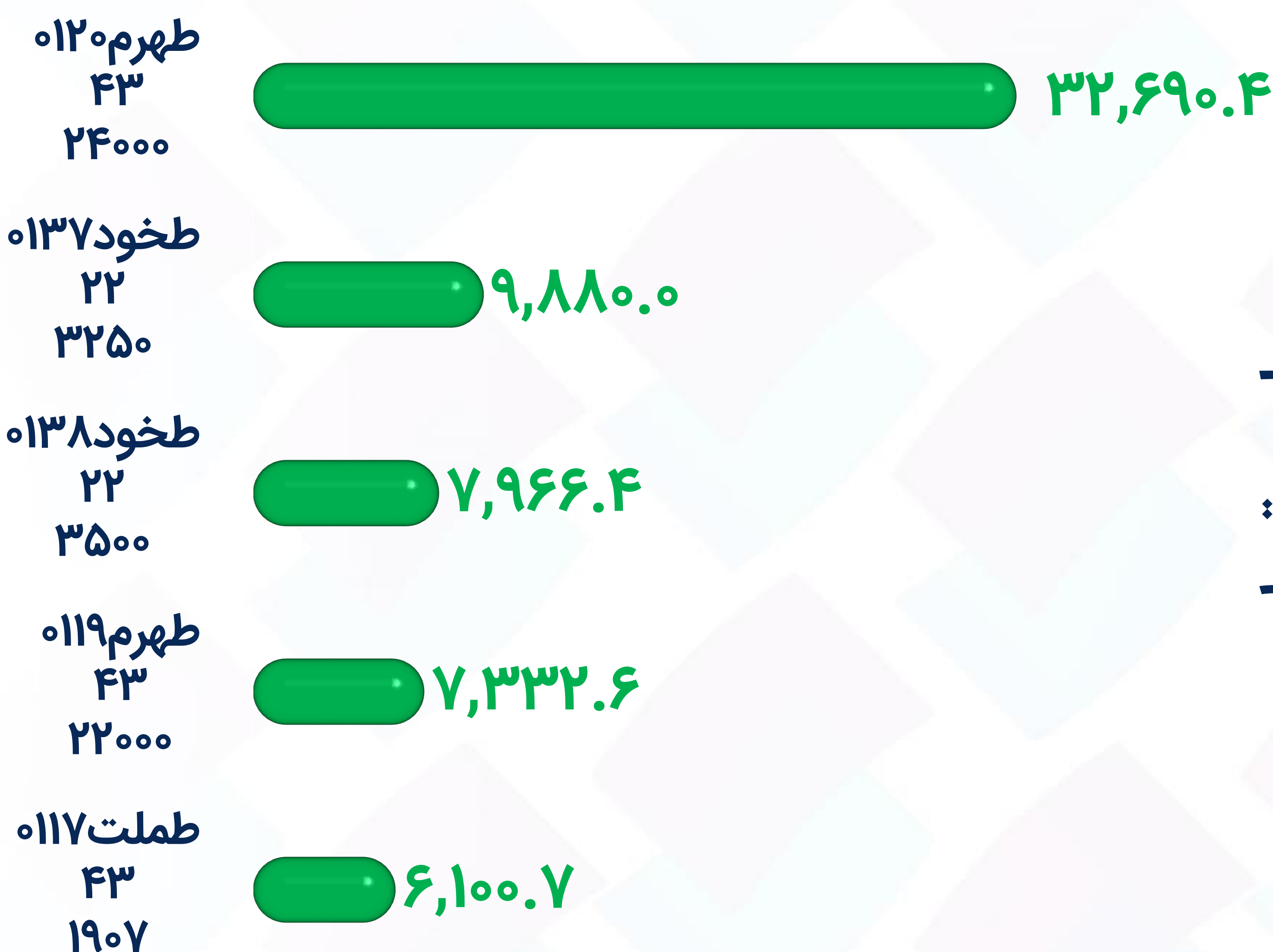
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)



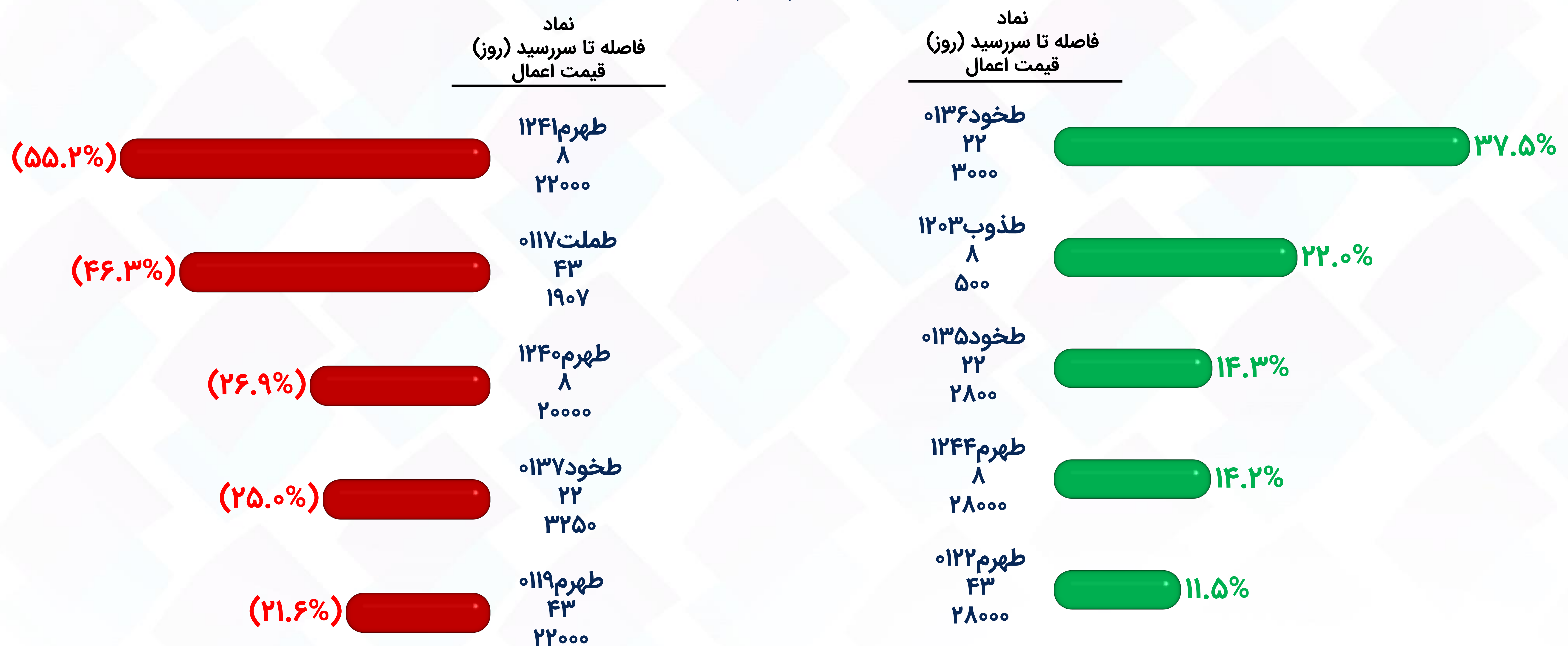
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

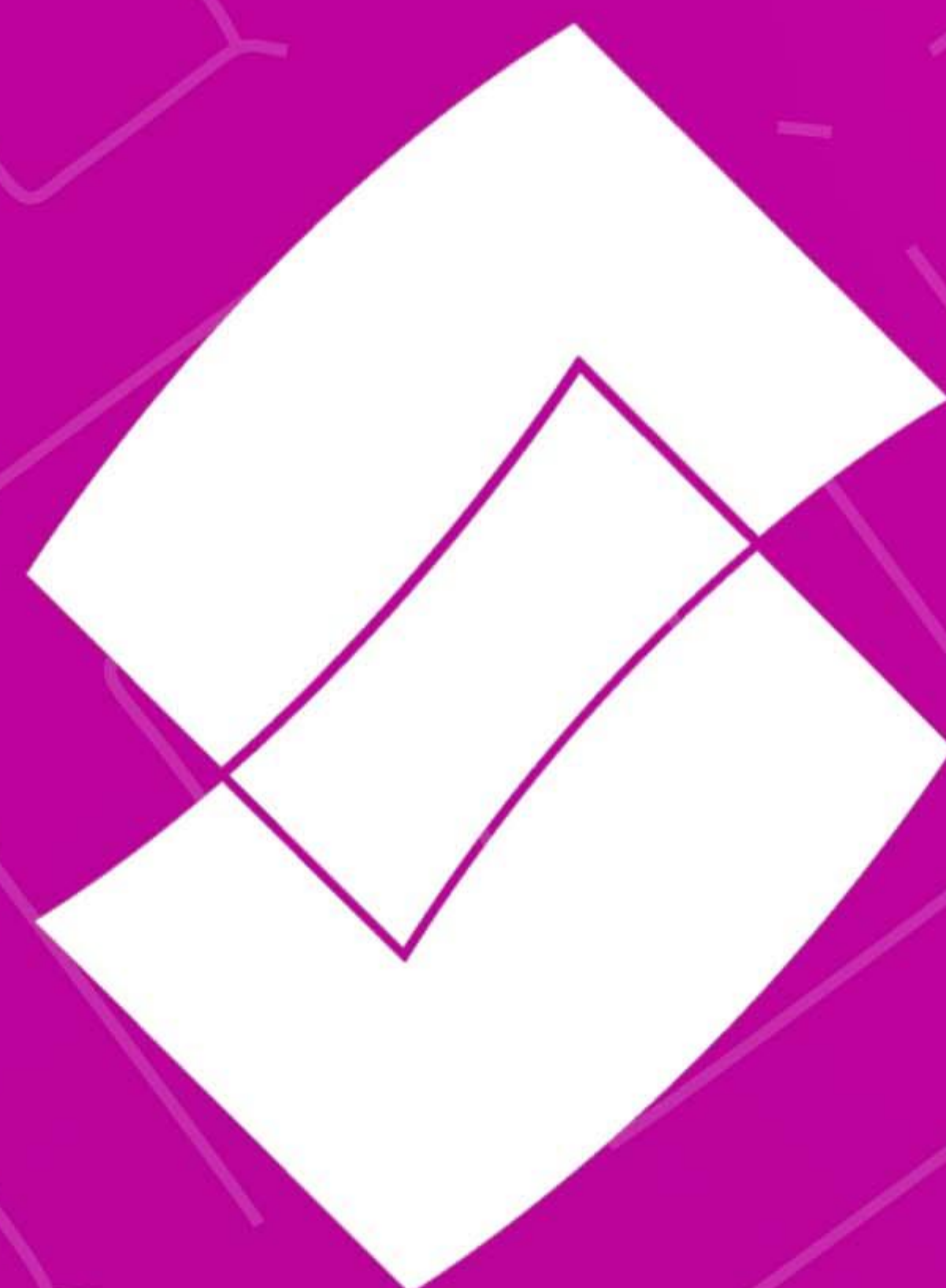
اختیار خرید



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.