

شماره
۴۳۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۵ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





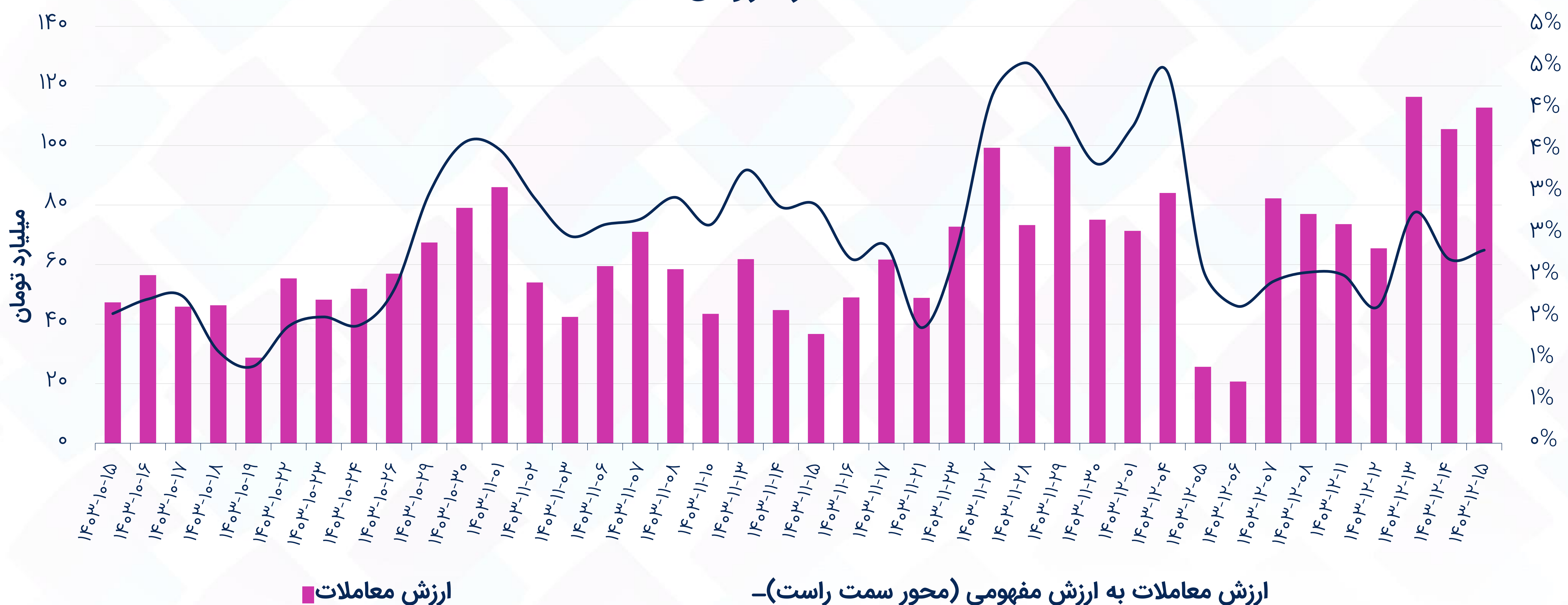
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



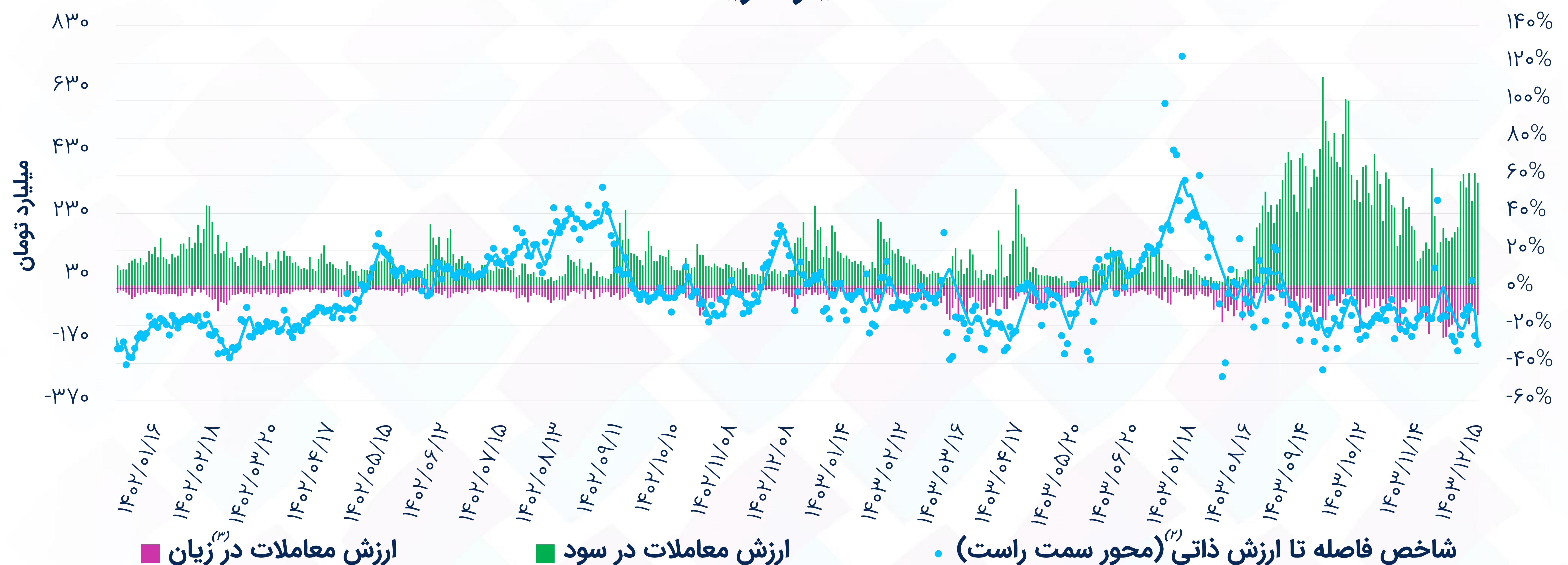
اختیار فروش



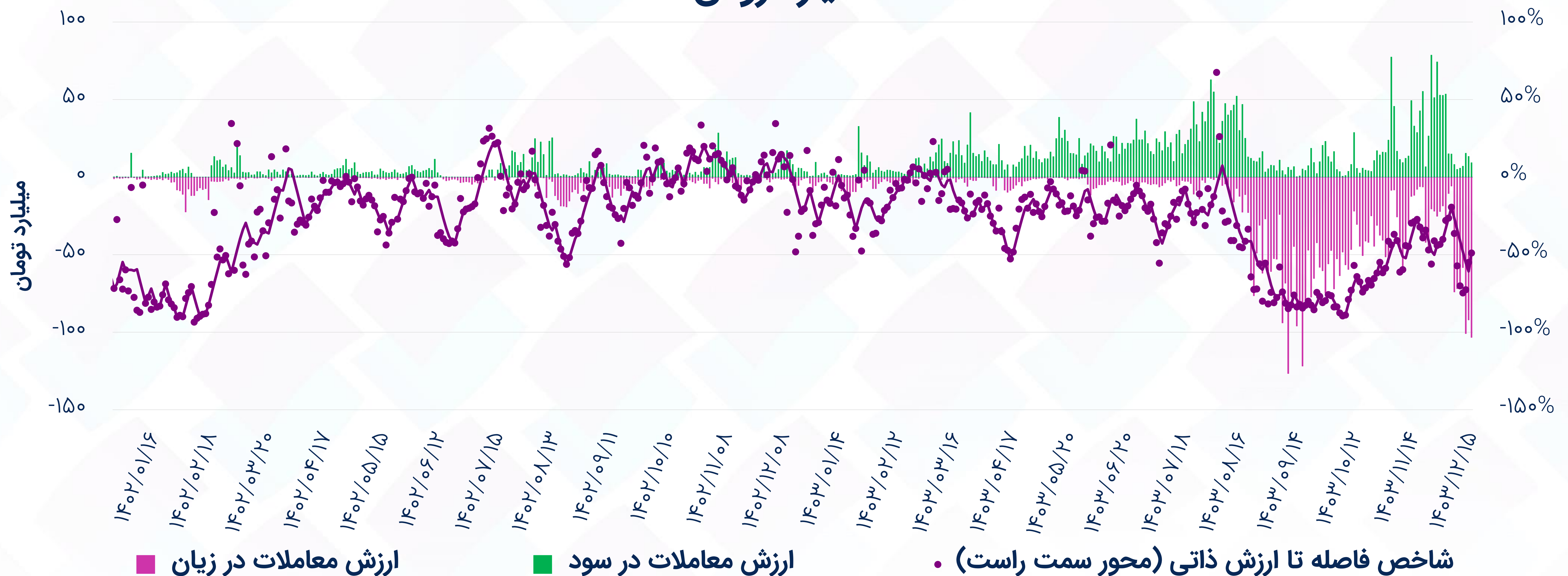
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۲۵۷.۱	۶,۲۲۷.۸	۲۱۰.۰	۴۷.۱	(۳۷.۳%)
خودرو	۳۶	۷۷.۶	۹۰۸.۹	۵۳.۳	۲۴.۳	(۱۹.۴%)
جهش	۹	۲۱.۲	۱۱۷.۵	۲۱.۲	۰.۰	۵.۸%
شستا	۳۸	۲۰.۲	۳۱۲.۰	۵.۷	۱۴.۵	(۴۳.۹%)
خسپا	۲۴	۱۱.۸	۲۷۳.۶	۹.۳	۲.۵	(۱۴.۷%)
وبملت	۲۲	۱۱.۷	۸۵.۶	۱۰.۲	۱.۵	(۱۵.۳%)
ذوب	۲۲	۱۰.۴	۱۵۵.۰	۶.۷	۳.۷	(۳۱.۶%)

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	۱۵	۹۵,۴۹۱.۱	۳,۷۵۵,۴۲۳.۲	۸,۷۰۳.۱	۸۶,۷۸۸.۰	(۴۲.۱%)
خودرو	۸	۱۴,۵۷۵.۱	۱,۰۰۴,۳۵۳.۴	۷۳.۶	۱۴,۵۰۱.۵	(۹۰.۱%)
شستا	۵	۲,۵۵۶.۹	۱۰۲,۳۲۲.۱	۵۲۸.۱	۲,۰۲۸.۸	(۷۱.۱%)
وبملت	۲	۴۲.۲	۲,۰۰۰.۶	۰.۰	۴۲.۲	(۸۸.۴%)
توان	۵	۲۲.۰	۶۷۵.۹	۱۱.۹	۱۰.۱	(۲۱.۵%)
خودران	۲	۱۴.۶	۳۰۸.۷	۷.۰	۷.۶	(۱۹.۰%)
ذوب	۳	۹.۲	۱,۷۲۷.۱	۵.۵	۳.۷	(۵۲.۳%)

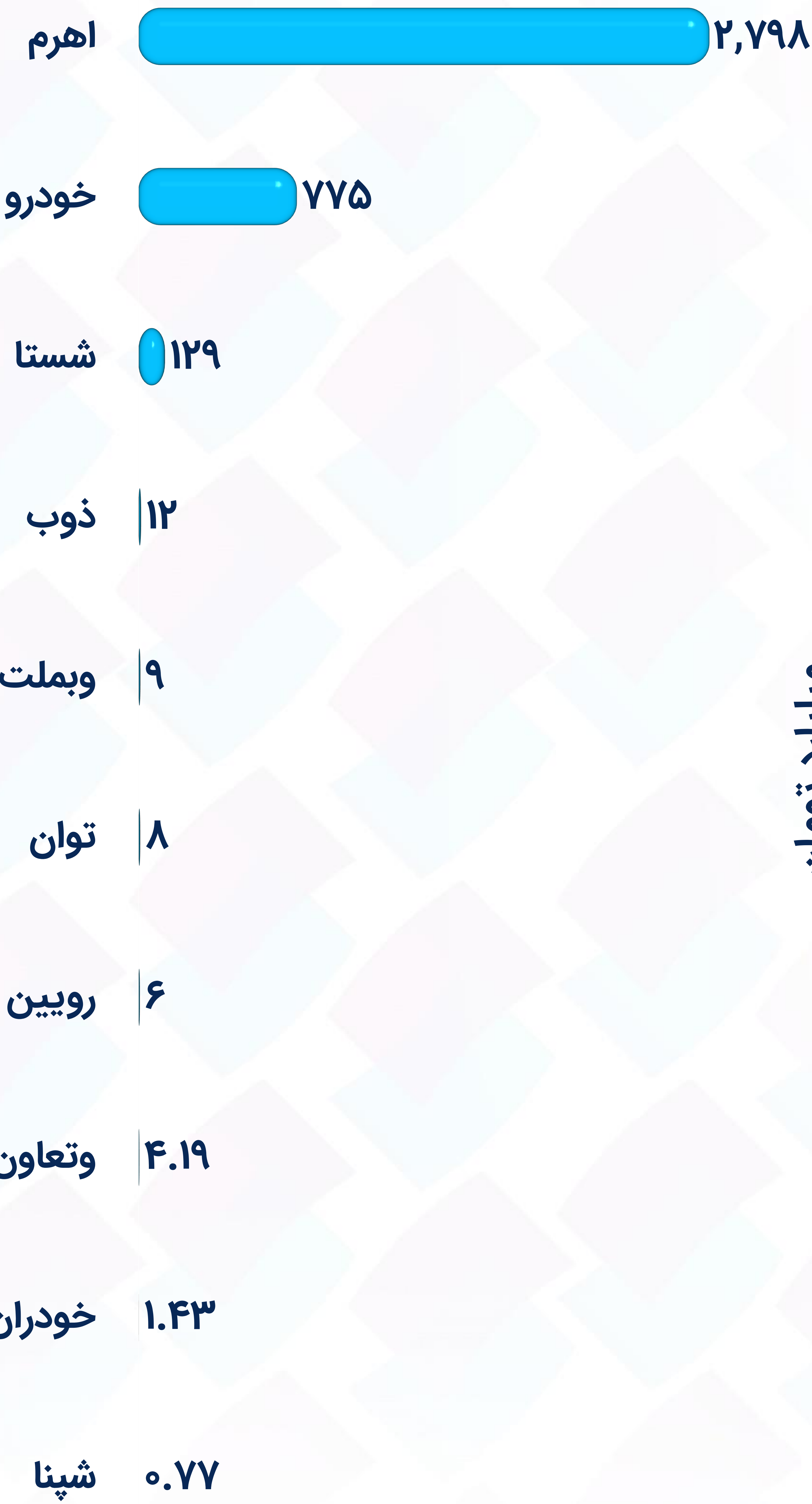
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

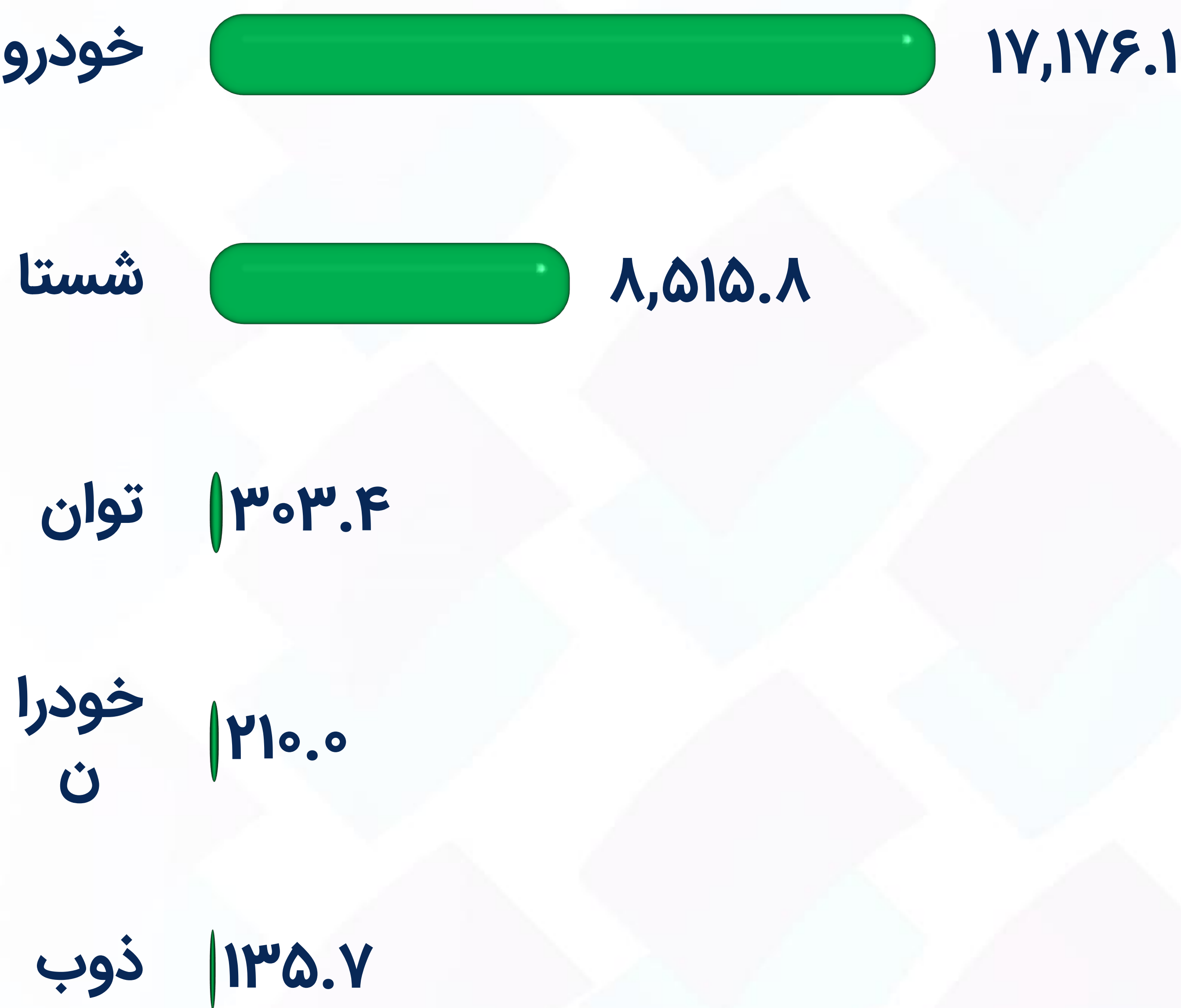
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



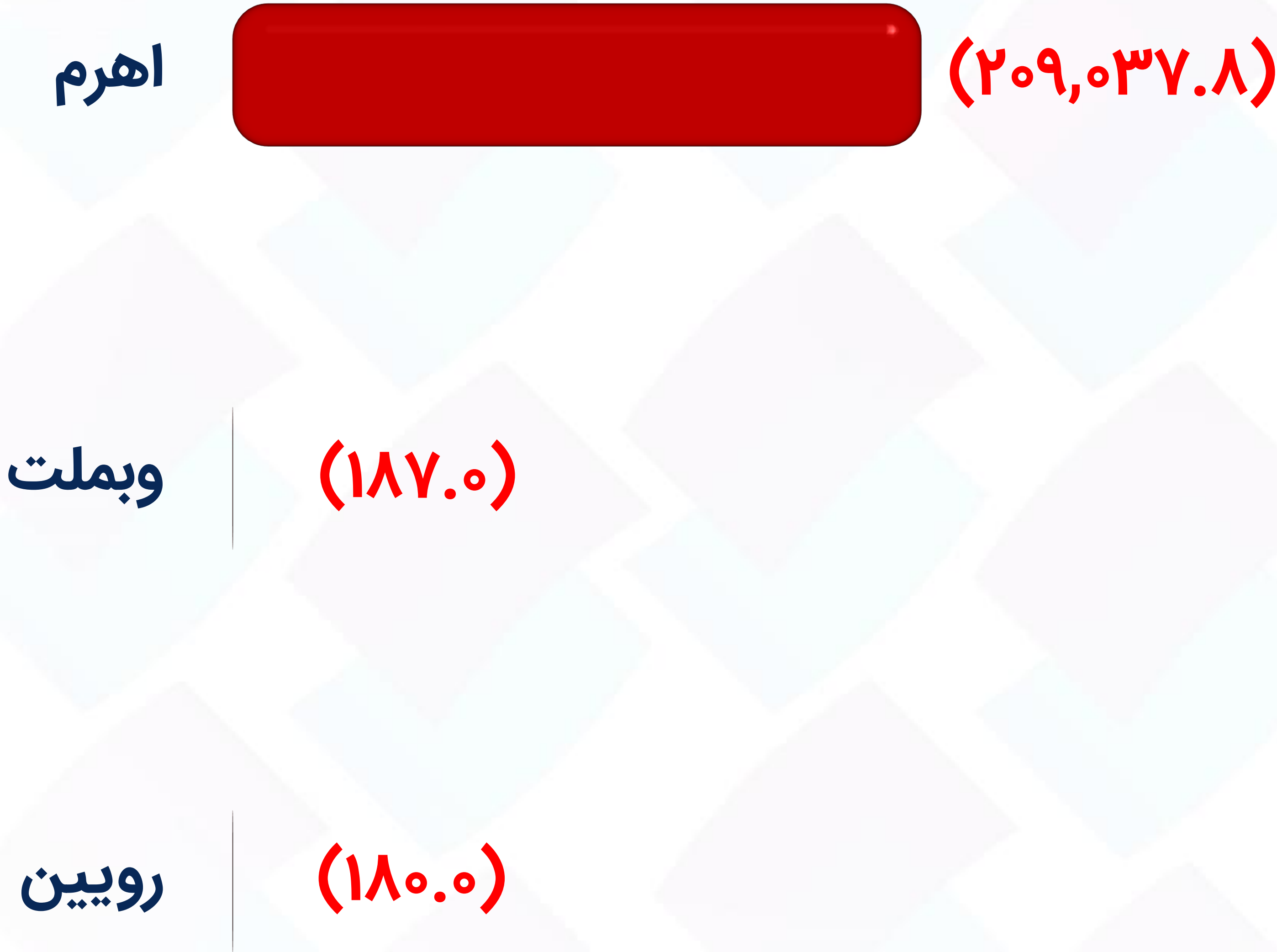
میلیارد تومان

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
ضتیام ۱۲۰۶	تیام	۱۴,۰۰۰	۱۱	۲.۲	۶۹	۱۳,۵۹۵	۱۴,۰۶۹	۳.۵%	۲۰۳.۹	۰.۳۵	۱۳۸	۹۹%
ضستا ۳۰۲۸	شستا	۱,۳۰۰	۹۰	۱۰.۸	۹۰	۱,۳۵۶	۱,۳۹۰	۲.۵%	۱۵.۴	۰.۸۴	۱۷۵	۹۵%
ضتوان ۱۲۱۷	توان	۱۹,۰۰۰	۴	۳.۶	۳,۵۷۲	۲۴,۸۷۱	۲۲,۵۷۲	(۹.۲%)	۶.۳	۱.۰۰	۵,۹۵۲	۶۷%
ضاساس ۱۲۰۰	آساس	۳۲,۰۰۰	۱۱	۱.۹	۹,۵۵۰	۴۷,۰۸۰	۴۱,۵۵۰	(۱۱.۷%)	۴.۴	۱.۰۰	۱۵,۴۴۱	۶۲%
ضتیام ۱۲۰۵	تیام	۱۳,۰۰۰	۱۱	۲۳.۰	۴۷۷	۱۳,۵۹۵	۱۳,۴۷۷	(۰.۹%)	۲۸.۳	۰.۹۰	۷۷۰	۶۱%

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
ضهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۱۴.۴	۲۵	۲۶,۰۶۰	۳۴,۰۲۵	۳۱%	۱,۳۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۷۰	۸.۴	۱۰	۴۵۷	۸۱۰	۷۷%	۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹۰	۳.۸	۵۱	۱,۳۵۶	۲,۲۵۱	۶۶%	۴۴.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۵۶	۱.۳	۲۹	۱,۳۵۶	۱,۹۲۹	۴۲%	۶۶.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۱	۴۱.۴	۲۴	۳,۹۵۹	۵,۰۲۴	۲۷%	۲۰۹.۳	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
طخود ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۲۱	۳.۸	۱۹۱	۳,۹۵۹	۴,۳۰۹	۸.۸%	۲۲.۶	-۰.۹۴	۴۷۳	۱۴۷.۵%
طتوان ۱۲۲۳	توان	۳۰,۰۰۰	۴	۴.۲	۴,۱۶۰	۲۴,۸۷۱	۲۵,۸۴۰	۳.۹%	۶.۲	-۱.۰۰	۵,۰۰۲	۲۰.۲%
طهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۷	۲۰۴.۰	۳,۸۶۳	۲۶,۰۶۰	۲۶,۱۳۷	۰.۳%	۶.۸	-۰.۹۹	۳,۶۹۰	(۴.۵%)
طران ۱۰۷۰	خودران	۱۱,۰۰۰	۴۲	۷.۰	۷۰۳	۱۰,۲۹۰	۱۰,۲۹۷	۰.۱%	۱۴.۶	-۰.۶۰	۶۵۱	(۷.۴%)
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۷	۸,۰۵۸.۴	۲,۱۳۲	۲۶,۰۶۰	۲۵,۸۶۸	(۰.۷%)	۱۲.۱	-۰.۸۶	۱,۸۰۱	(۱۵.۵%)

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
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۲۱	۱۳.۲	۶	۳,۹۵۹	۲,۷۹۴	(۲۹.۴%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷	۵.۴	۱۶	۲۶,۰۶۰	۱۹,۹۸۴	(۲۳.۳%)	۱,۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۲۱	۶۱.۴	۸	۳,۹۵۹	۲,۹۹۲	(۲۴.۴%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۷۰	خودرو	۳,۲۵۰	۲۱	۷۲۸.۳	۱۷	۳,۹۵۹	۳,۲۳۳	(۱۸.۳%)	۱۹۰.۲	۰.۰۰	۰	(۹۹.۴%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷	۹۷.۷	۱۷	۲۶,۰۶۰	۲۱,۹۸۳	(۱۵.۶%)	۱,۲۹۳.۱	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

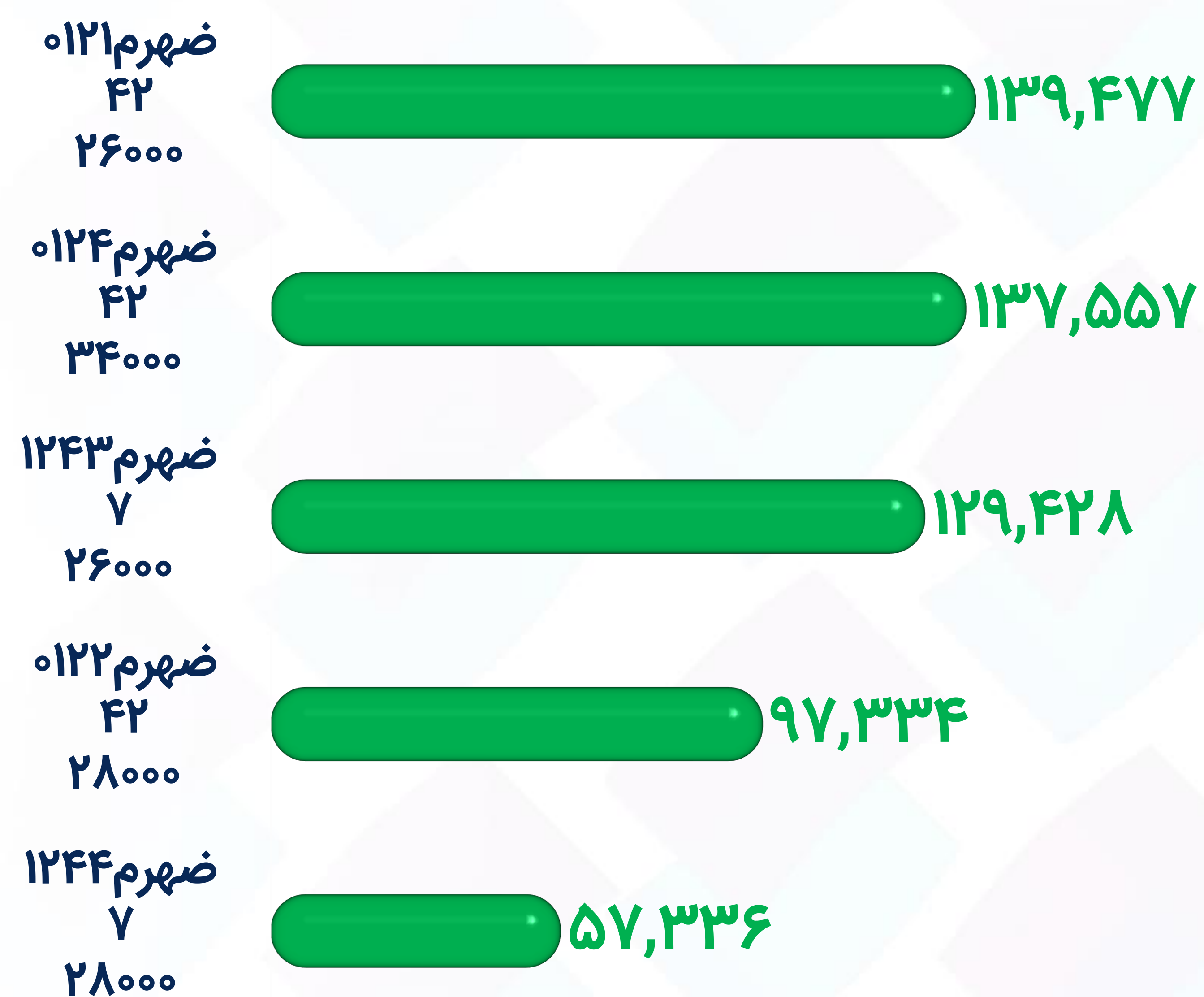
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

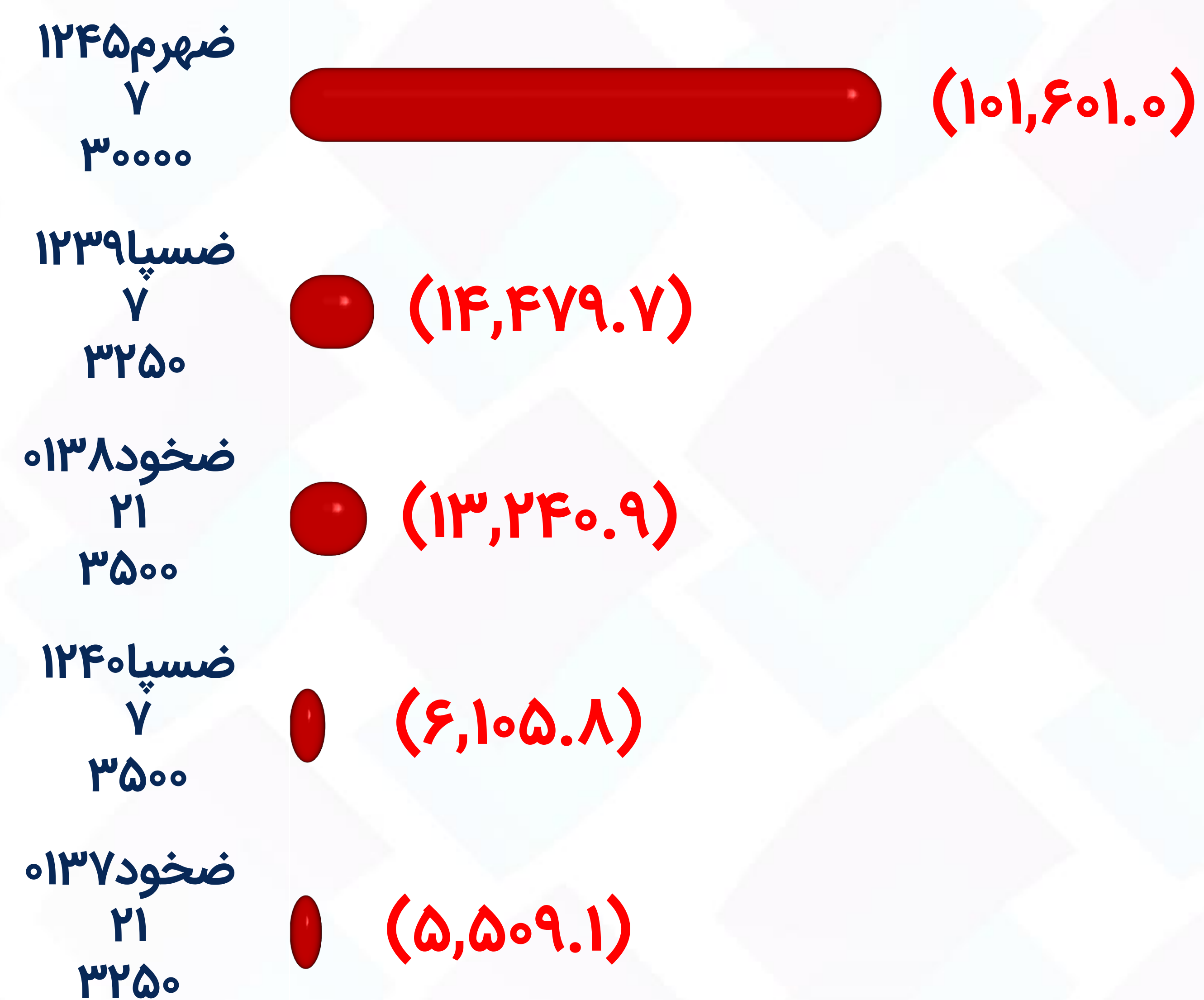
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

طهرم ۱۲۴۳
۷
۲۶۰۰۰ ۱,۰۶۷

طهرم ۱۲۴۲
۷
۲۴۰۰۰ ۶۴۱

طهرم ۱۲۴۱
۷
۲۲۰۰۰ ۳۶۷

طخود ۱۳۸
۲۱
۳۵۰۰ ۳۲۶

طخود ۱۳۷
۲۱
۳۲۵۰ ۳۰۶

طهرم ۱۲۱
۴۲
۲۶۰۰۰ ۲۳۷

طهرم ۱۲۰
۴۲
۲۴۰۰۰ ۱۹۶

طهرم ۱۲۴۴
۷
۲۸۰۰۰ ۱۴۴

طخود ۱۳۹
۲۱
۳۷۵۰ ۸۴

طستا ۱۲۷
۳۵
۱۳۰۰ ۷۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

طخود ۱۳۸
۲۱
۳۵۰۰ ۳۱,۰۴۷.۵

طخود ۱۳۹
۲۱
۳۷۵۰ ۲۵,۱۱۷.۵

طهرم ۱۲۱
۴۲
۲۶۰۰۰ ۲۰,۹۷۴.۲

طستا ۱۲۶
۳۵
۱۲۰۰ ۱۱,۲۳۳.۰

طهرم ۱۲۰
۴۲
۲۴۰۰۰ ۳,۰۰۷.۲

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

طهرم ۱۲۴۲
۷
۲۴۰۰۰ (۱۰۹,۲۶۷.۲)

طهرم ۱۲۴۳
۷
۲۶۰۰۰ (۷۷,۴۸۵.۲)

طهرم ۱۲۴۱
۷
۲۲۰۰۰ (۴۵,۵۸۸.۴)

طخود ۱۳۷
۲۱
۳۲۵۰ (۳۳,۹۴۵.۹)

طخود ۱۳۶
۲۱
۳۰۰۰ (۴,۹۴۶.۷)

میلیون تومان

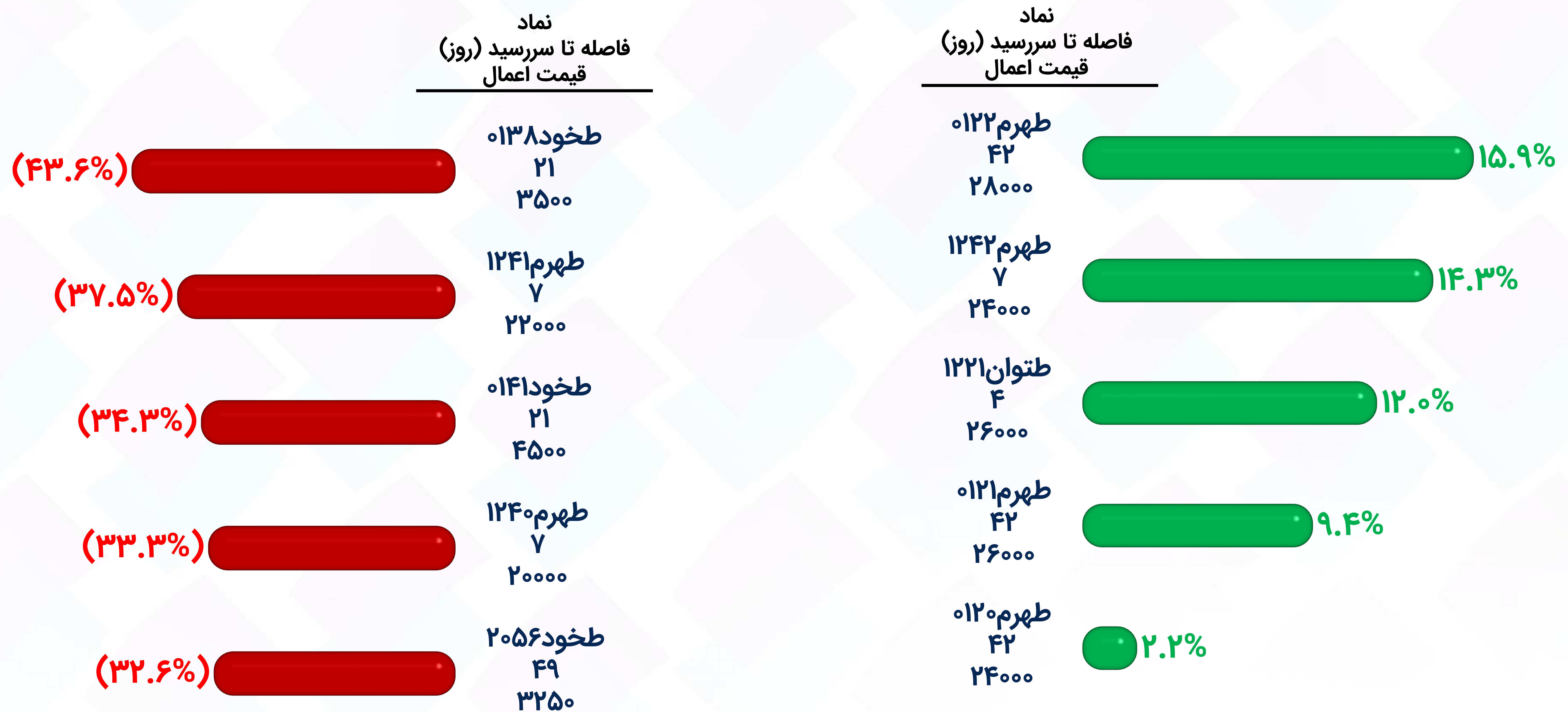
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

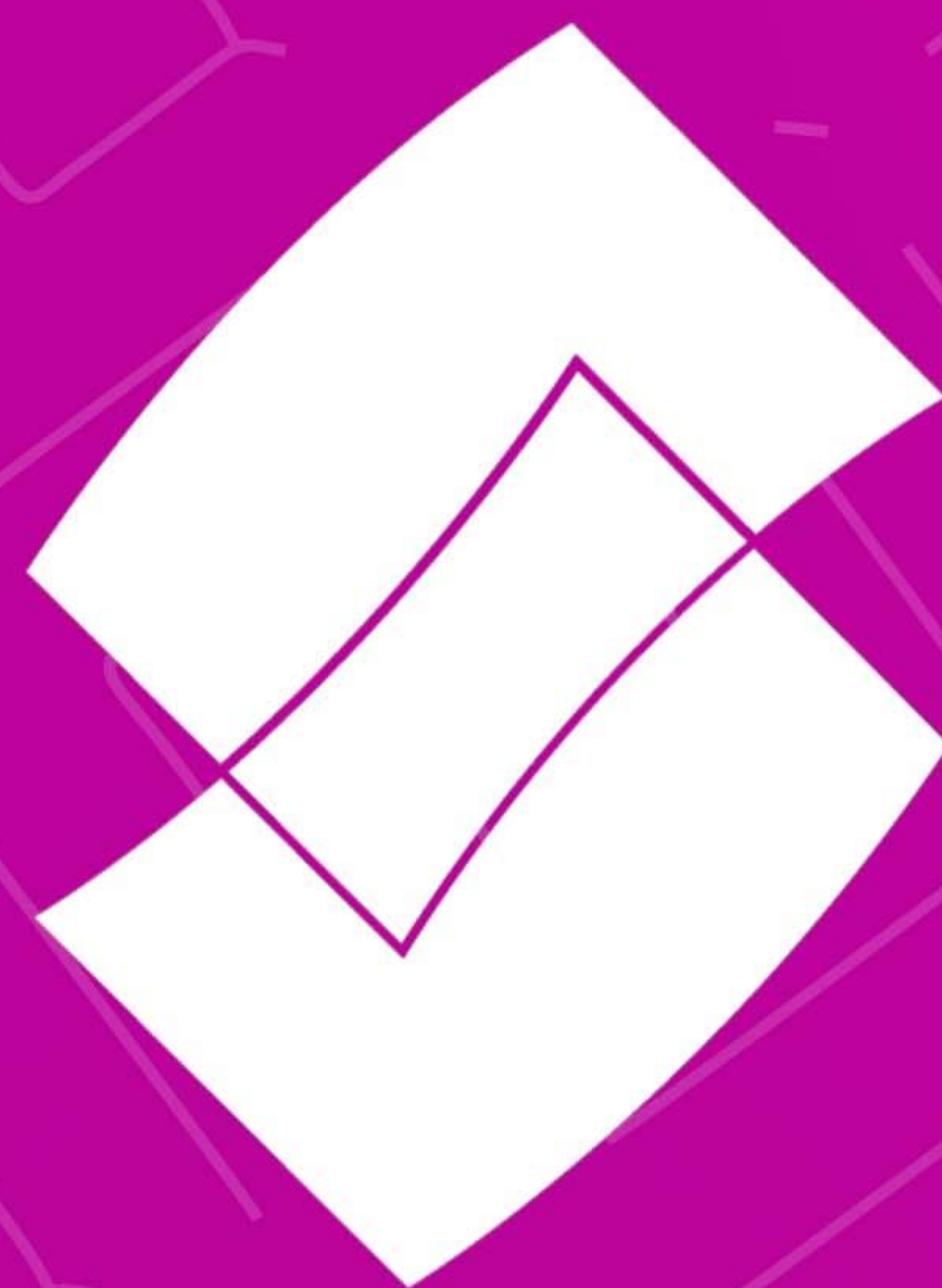
اختیار خرید



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.