

شماره
۴۴۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

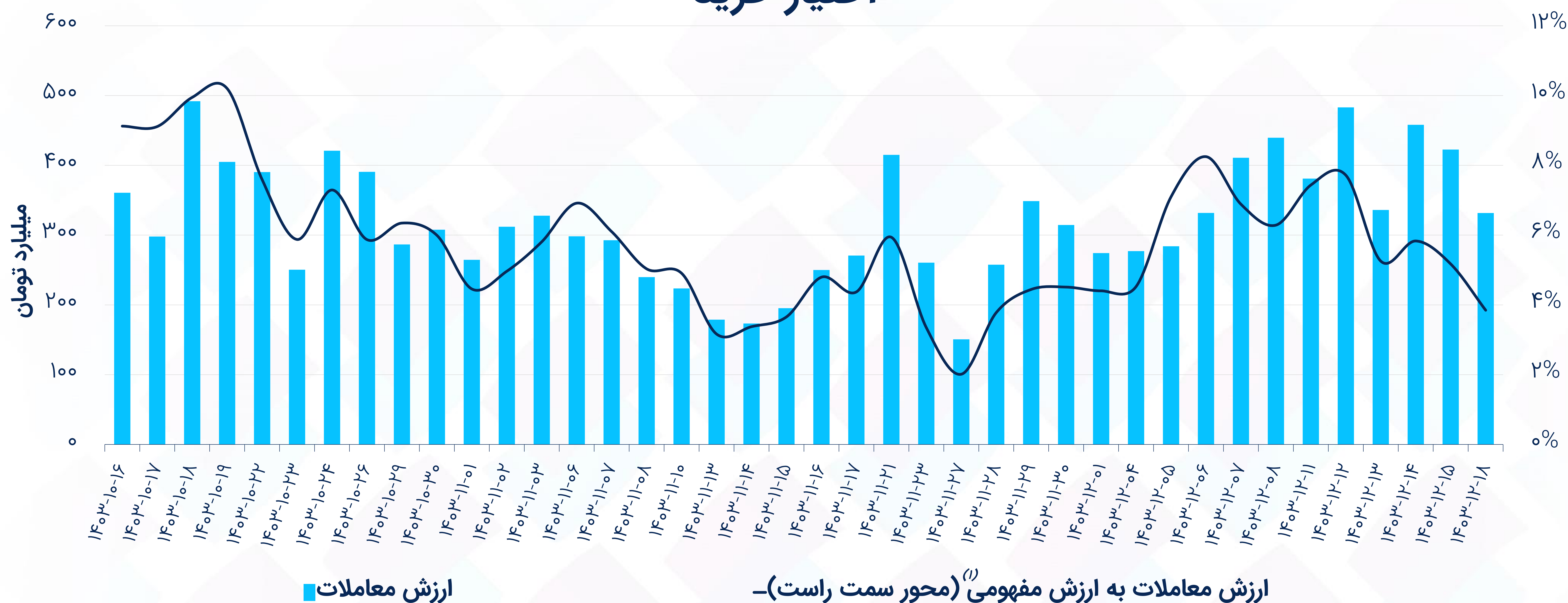




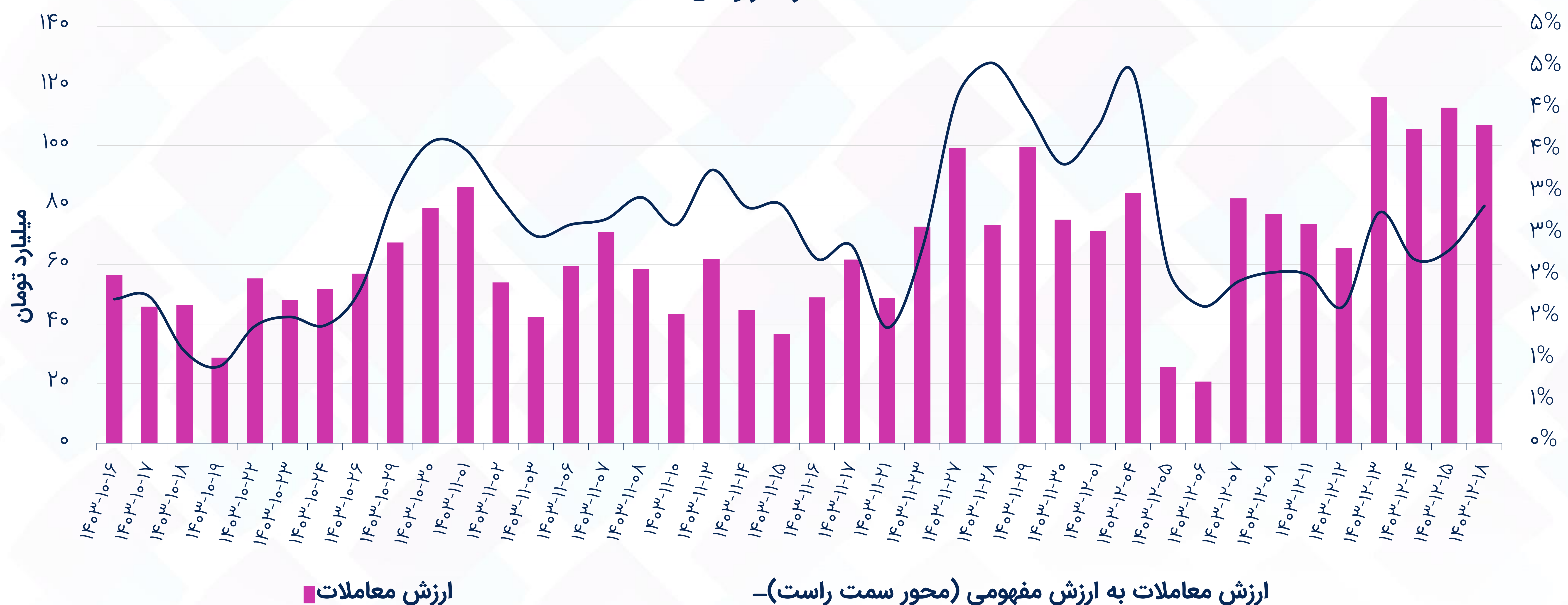
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



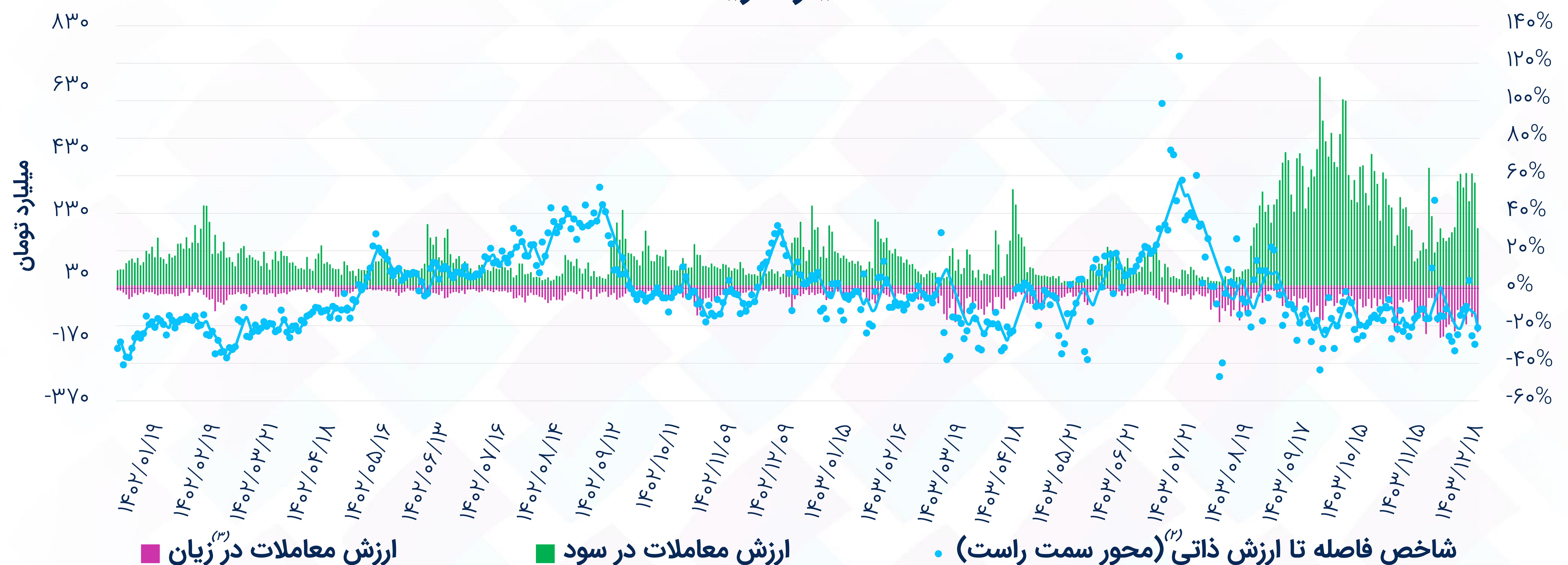
اختیار فروش



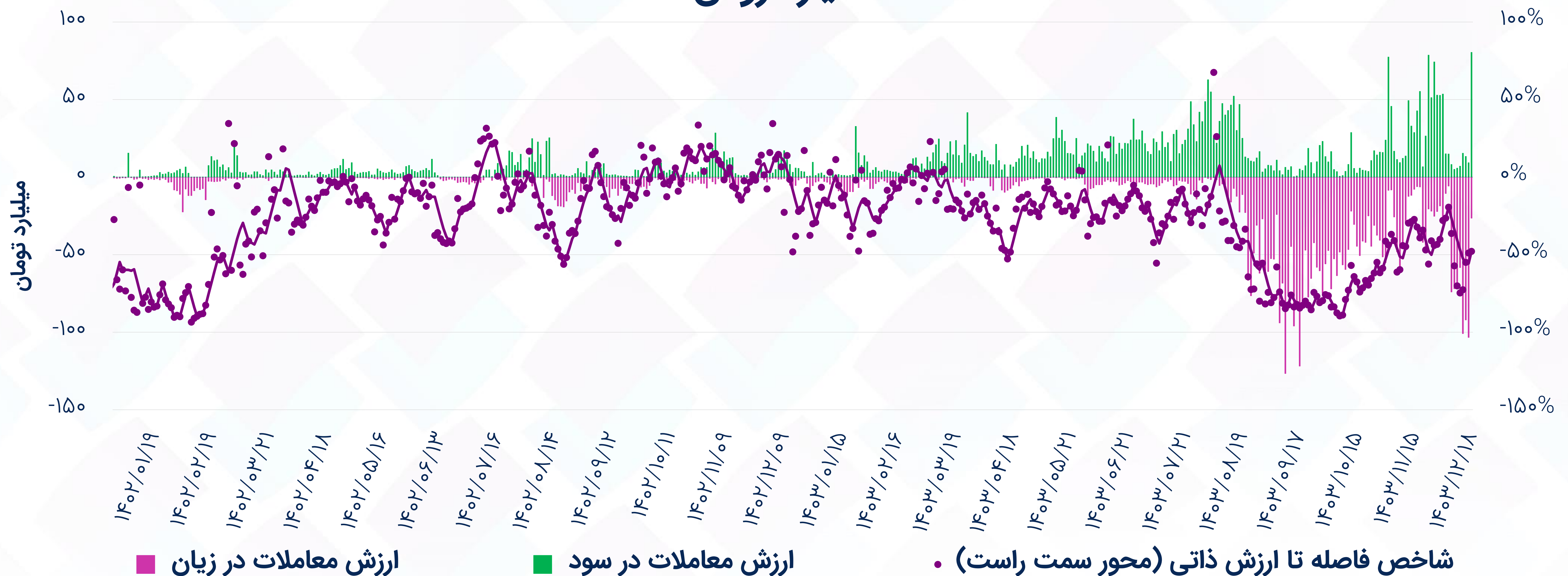
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

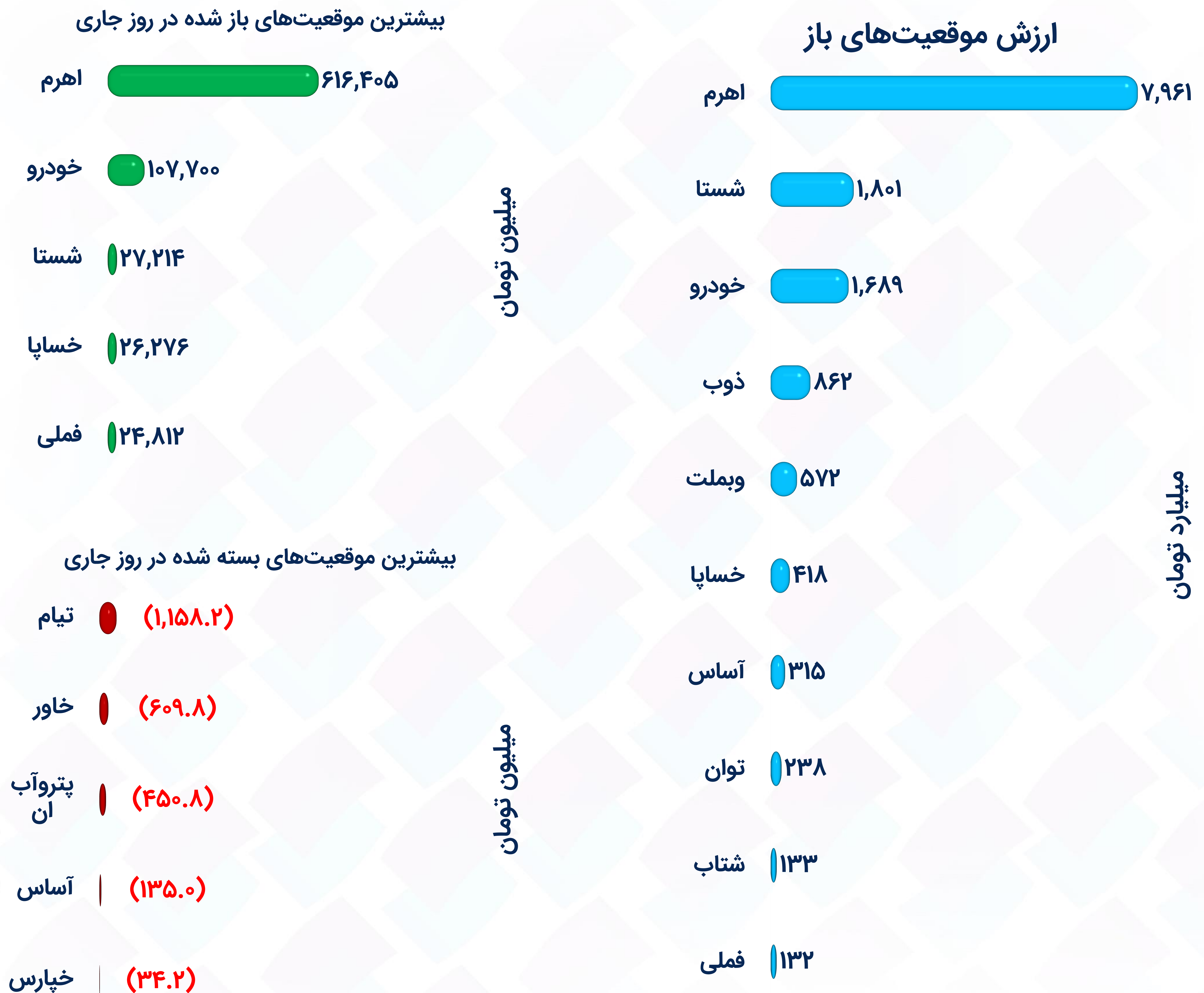
اختیار خرید

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	۵۰	۱۶۰.۹	۶,۵۰۱.۶	۳۷.۹	۱۲۳.۰	(۲۶.۹%)
خودرو	۳۸	۱۰۵.۰	۱,۱۵۸.۸	۹۸.۰	۷.۰	(۱۰.۹%)
شستا	۴۱	۲۰.۴	۳۵۵.۸	۶.۰	۱۴.۴	(۵۴.۲%)
ذوب	۲۳	۱۱.۸	۱۹۴.۸	۸.۶	۳.۱	(۲۹.۳%)
فملی	۸	۷.۴	۳۱.۷	۷.۴	۰.۰	(۶.۸%)
وبملت	۲۱	۷.۰	۵۷.۲	۶.۵	۰.۶	(۳.۹%)
توان	۲۰	۶.۸	۴۰.۱	۶.۷	۰.۰	۲۰.۵%

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	۱۷	۸۸,۳۳۰.۳	۲,۵۵۳,۱۳۷.۰	۷۹,۴۱۰.۴	۸,۹۱۹.۹	(۴۰.۰%)
خودرو	۹	۱۵,۰۶۱.۸	۱,۱۰۰,۳۶۴.۷	۷.۳	۱۵,۰۵۴.۵	(۹۱.۳%)
شستا	۵	۳,۳۶۴.۳	۹۷,۱۴۸.۲	۹۸۸.۹	۲,۳۷۵.۴	(۵۸.۲%)
توان	۳	۱۲۳.۷	۵,۳۰۳.۳	۱۲.۲	۱۱۱.۴	(۶۷.۲%)
وبملت	۳	۴۳.۱	۱,۸۹۱.۳	۰.۰	۴۳.۱	(۸۳.۱%)
خودران	۲	۱۸.۶	۲۰۴.۰	۱۸.۶	۰.۰	(۲۰.۵%)
وتعاون	۱	۹.۲	۳۴۹.۰	۰.۰	۹.۲	(۳۰.۵%)

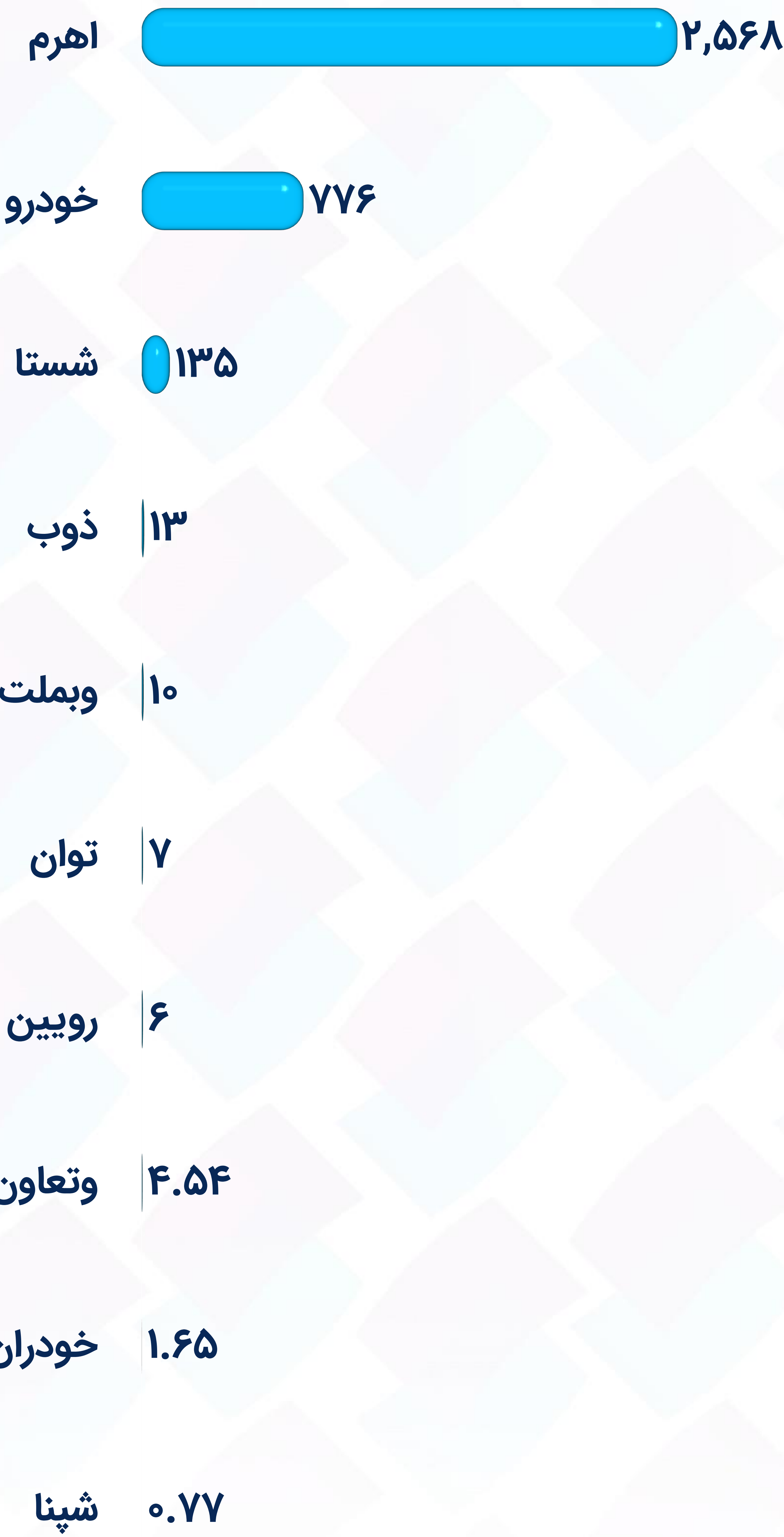
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



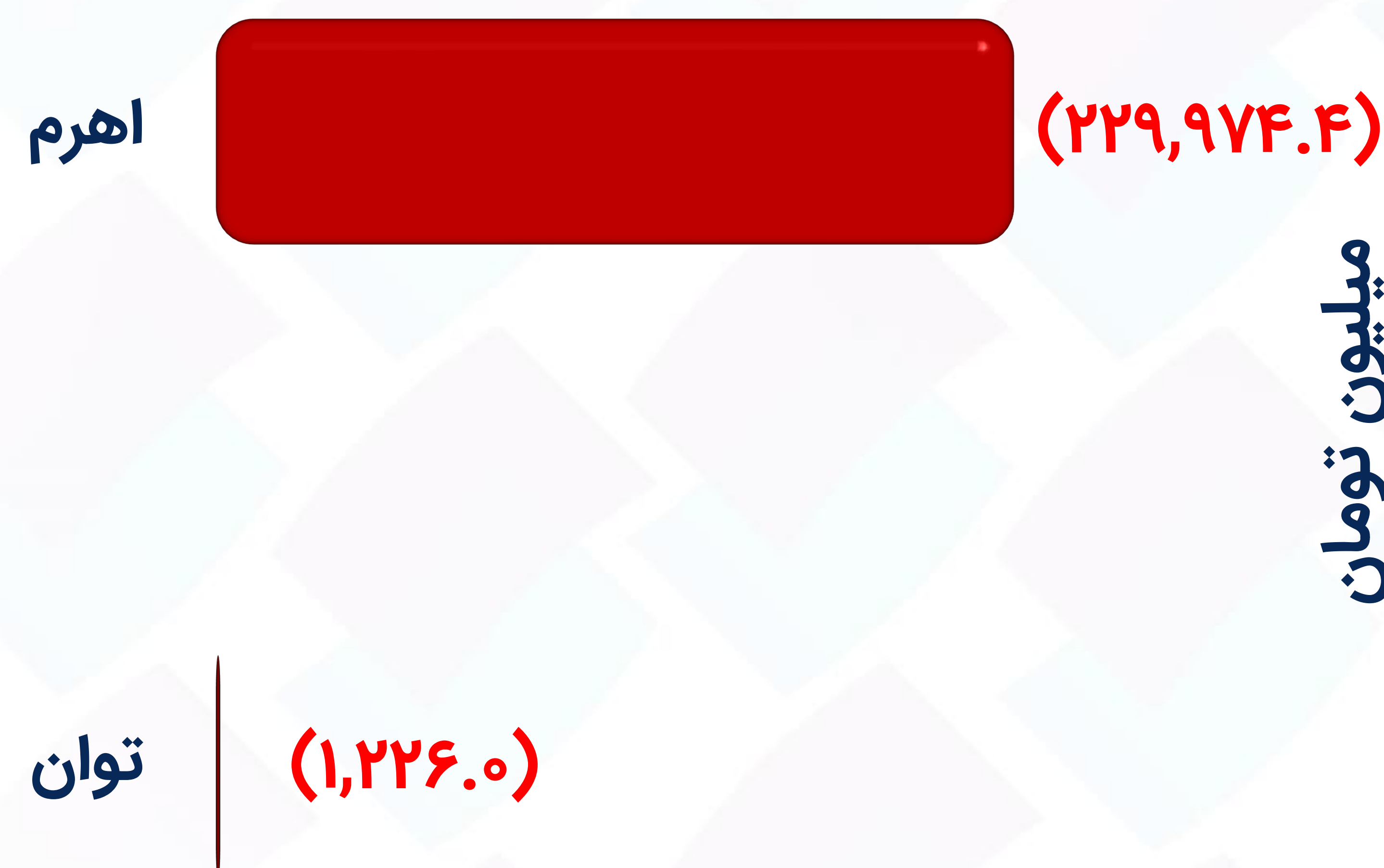
میلیارد تومان

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
ضاساس ۱۲۰۵	آساس	۴۵,۰۰۰	۸	۳.۸	۳۷۶	۴۶,۲۸۶	۴۵,۳۷۶	(۲.۰%)	۱۲۰.۷	۰.۸۳	۱,۹۰۲	۴۰۶%
ضرویین ۱۲۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۸	۲.۰	۲۰۰	۱۲,۲۲۹	۱۲,۲۰۰	(۰.۲%)	۶۱.۰	۰.۷۷	۴۱۳	۱۰۶%
ضبساما ۲۱۸	بساما	۶,۶۶۲	۵۰	۱۸.۳	۱,۹۰۰	۸,۸۵۰	۸,۵۶۲	(۳.۳%)	۴.۵	۱.۰۰	۲,۴۶۶	۳۰%
ضهرم ۱۲۴۲	اهرم	۲۴,۰۰۰	۴	۱۳,۷۰۵.۲	۱,۳۸۳	۲۵,۵۰۰	۲۵,۳۸۳	(۰.۵%)	۱۸.۴	۰.۹۱	۱,۷۲۵	۲۵%
ضموج ۲۱۶	موج	۲۰,۰۰۰	۶۴	۳.۱	۳,۱۰۰	۲۲,۵۰۷	۲۳,۱۰۰	۲.۶%	۷.۵	۰.۸۷	۳,۸۶۳	۲۵%

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 ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۴	۷.۵	۱	۴۴۶	۶۰۱	۳۵%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۱۷.۹	۱۸	۲۵,۵۰۰	۳۴,۰۱۸	۳۳%	۱,۸۸۹.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۳۲	۲.۰	۴	۴۴۶	۷۰۴	۵۸%	۱۷۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۶۷	۳.۱	۱۲	۴۴۶	۸۱۲	۸۲%	۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۵۳	۳.۵	۲۴	۱,۳۲۳	۱,۹۲۴	۴۵%	۸۰.۲	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 ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴	۱۹۱.۶	۴,۴۴۶	۲۵,۵۰۰	۲۵,۵۵۴	۰.۲%	۵.۷	-۱.۰۰	۴,۲۸۹	(۳.۵%)
طذوب ۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۴	۶.۵	۵۷	۴۴۶	۴۴۳	(۰.۷%)	۷.۸	-۰.۹۸	۵۱	(۱۱.۲%)
طهرم ۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۴	۸,۷۵۱.۶	۲,۸۷۹	۲۵,۵۰۰	۲۵,۱۲۱	(۱.۵%)	۸.۷	-۰.۹۵	۲,۳۲۸	(۱۹.۱%)
طران ۰۱۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۳۹	۱۸.۶	۹۳۰	۱۰,۱۵۰	۱۰,۰۷۰	(۰.۸%)	۱۰.۸	-۰.۶۵	۷۳۹	(۲۰.۵%)
طوتعاون ۱۰۸	وتعاون	۱,۵۰۰	۳۶	۹.۲	۴۰	۱,۵۱۱	۱,۴۶۰	(۳.۴%)	۳۶.۵	-۰.۳۲	۲۸	(۳۰.۵%)

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 ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۱۸	۱۱.۱	۴	۴,۰۲۳	۲,۷۹۶	(۳۰.۵%)	۶۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۴	۲.۷	۱۳	۲۵,۵۰۰	۱۹,۹۸۷	(۲۱.۶%)	۱,۵۳۷.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۱۸	۵۳.۲	۸	۴,۰۲۳	۲,۹۹۲	(۲۵.۶%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۷	خودرو	۳,۲۵۰	۱۸	۴۷۴.۱	۱۳	۴,۰۲۳	۳,۲۳۷	(۱۹.۵%)	۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۴	۱۳۴.۸	۲۰	۲۵,۵۰۰	۲۱,۹۸۰	(۱۳.۸%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۷%)

(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

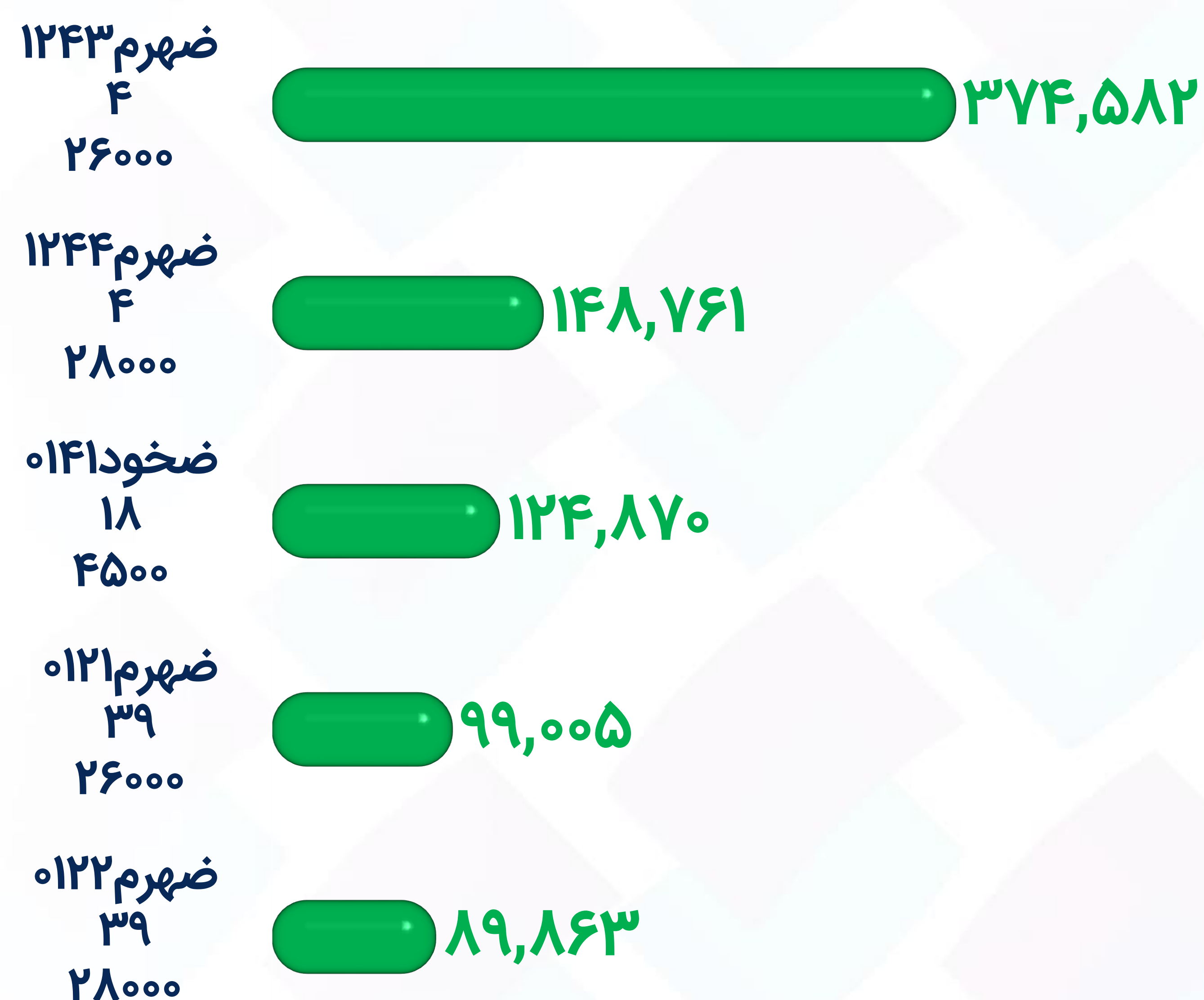
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

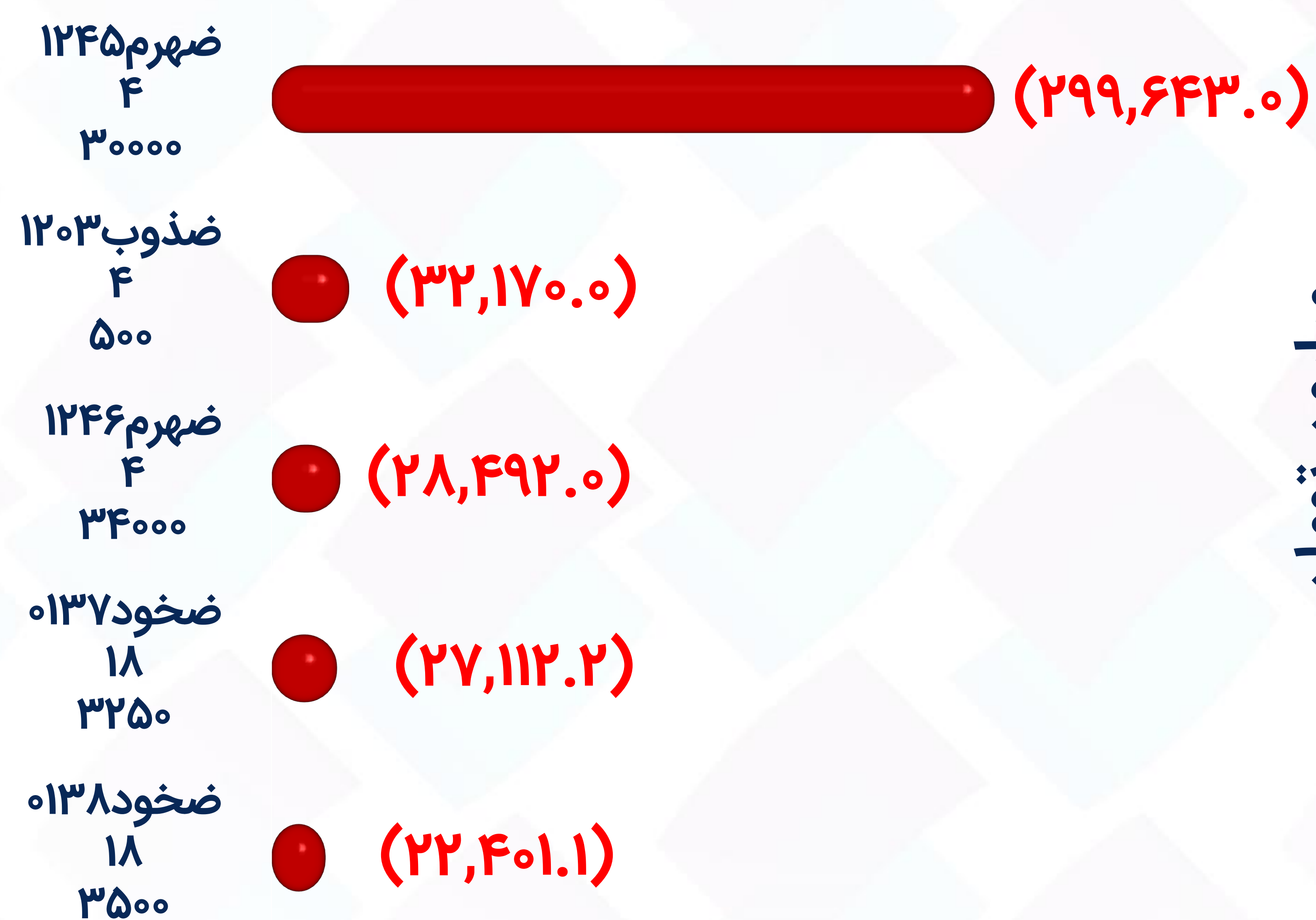
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

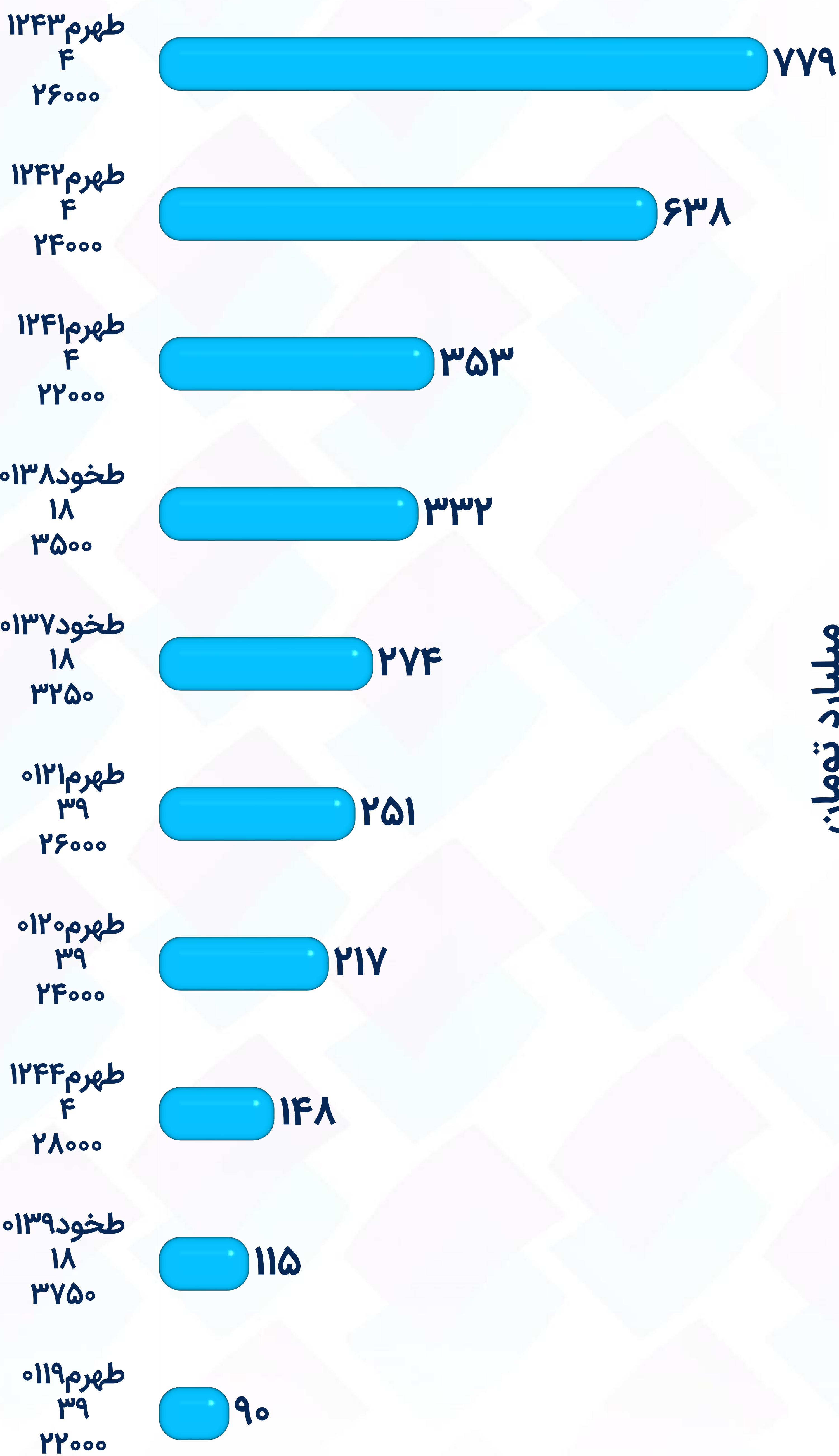


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

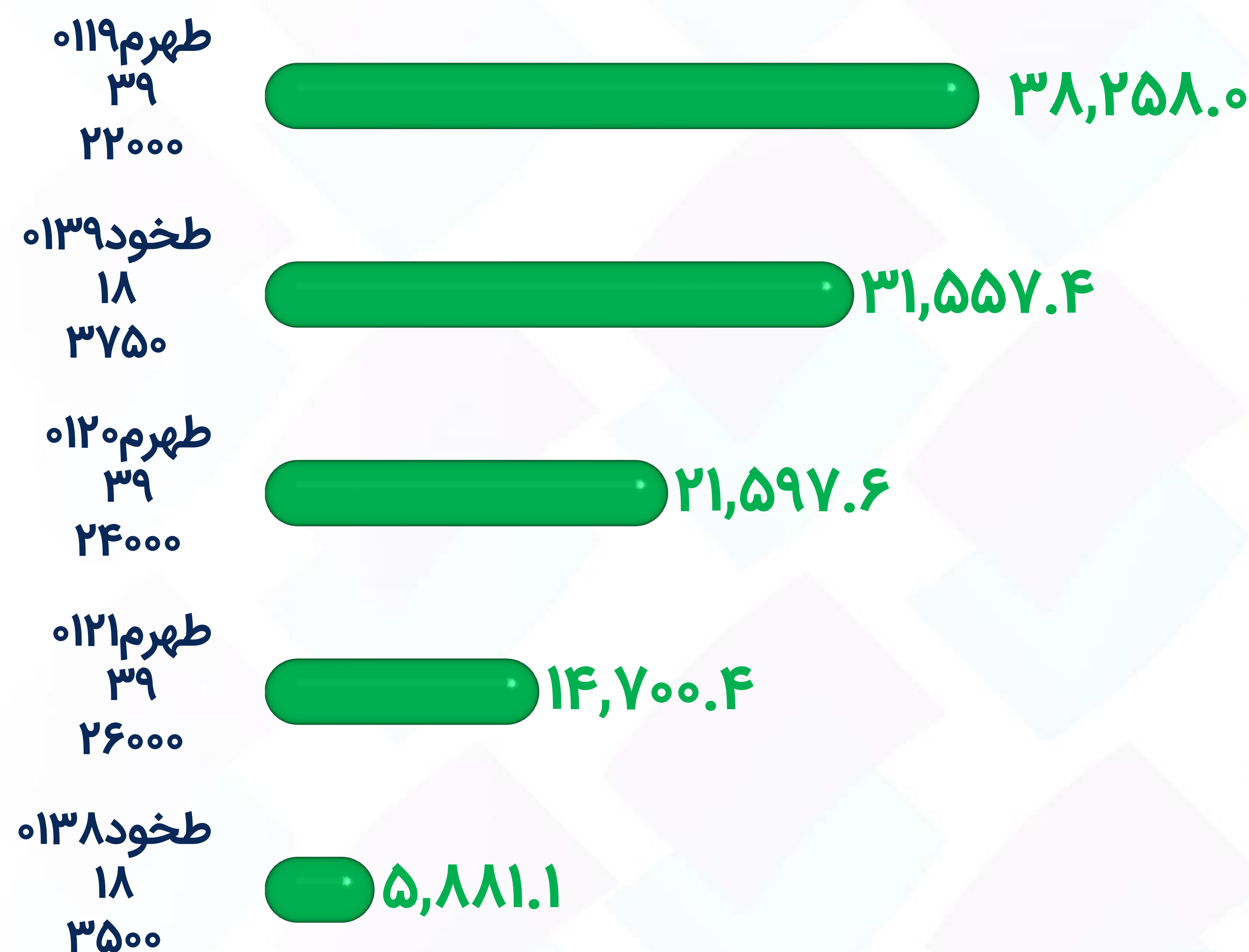
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

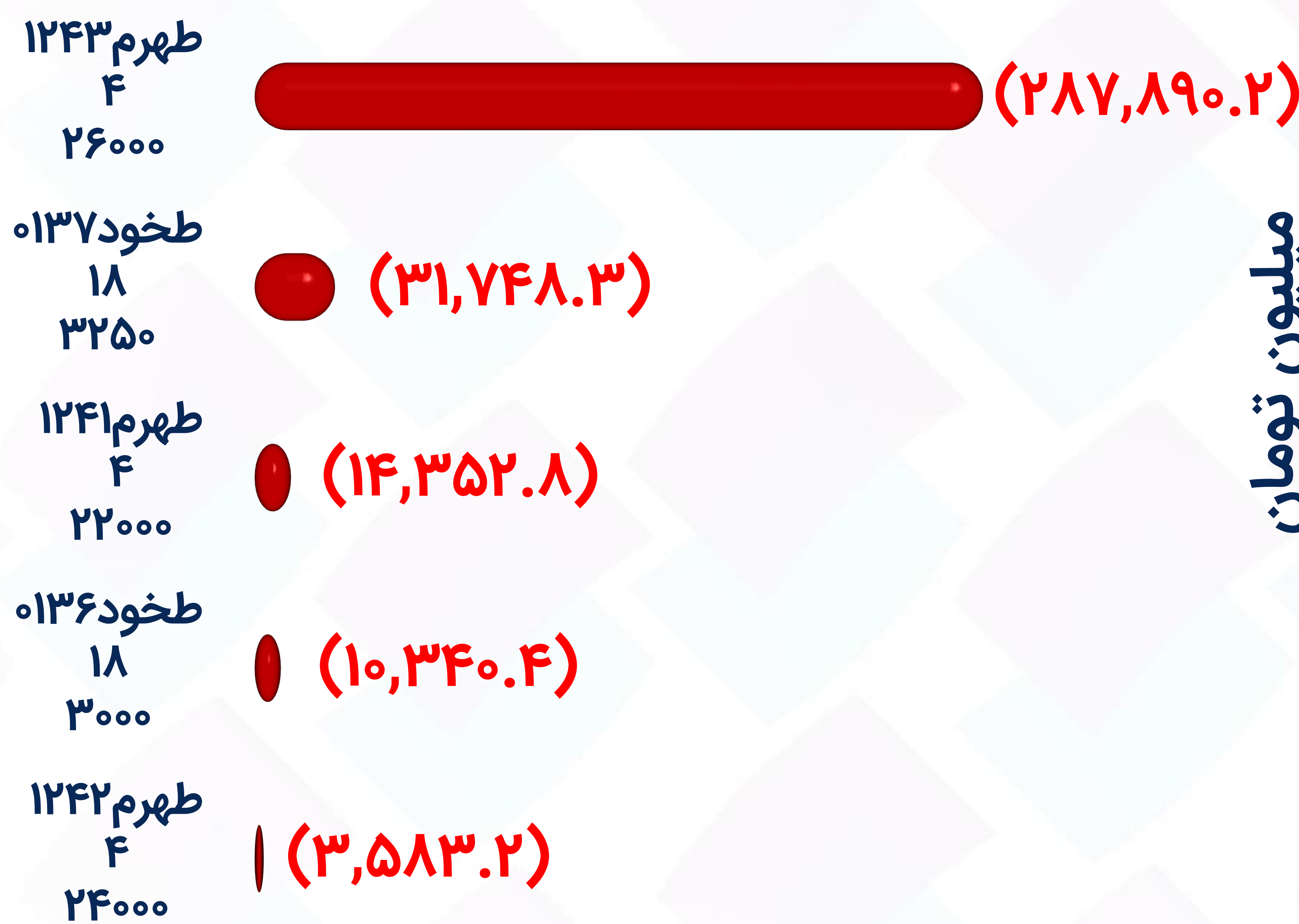
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

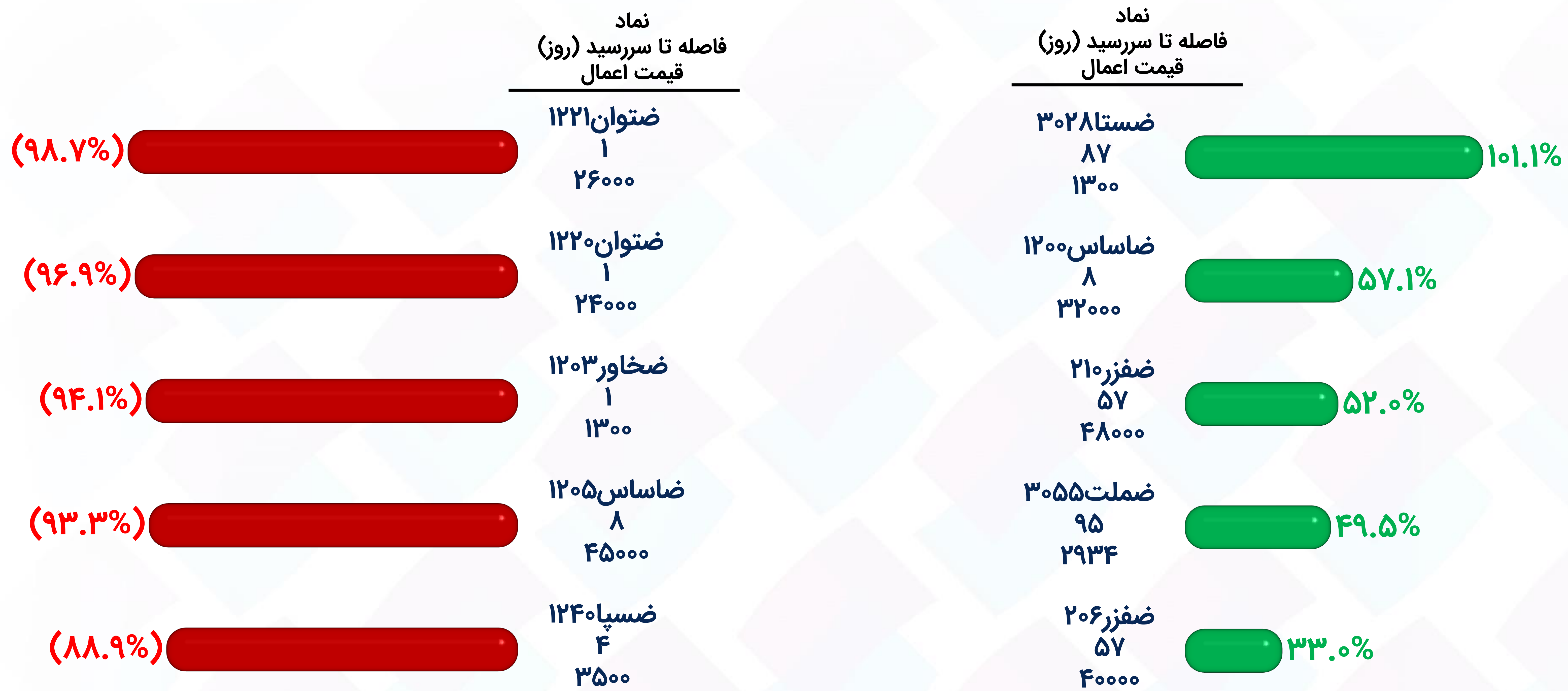
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

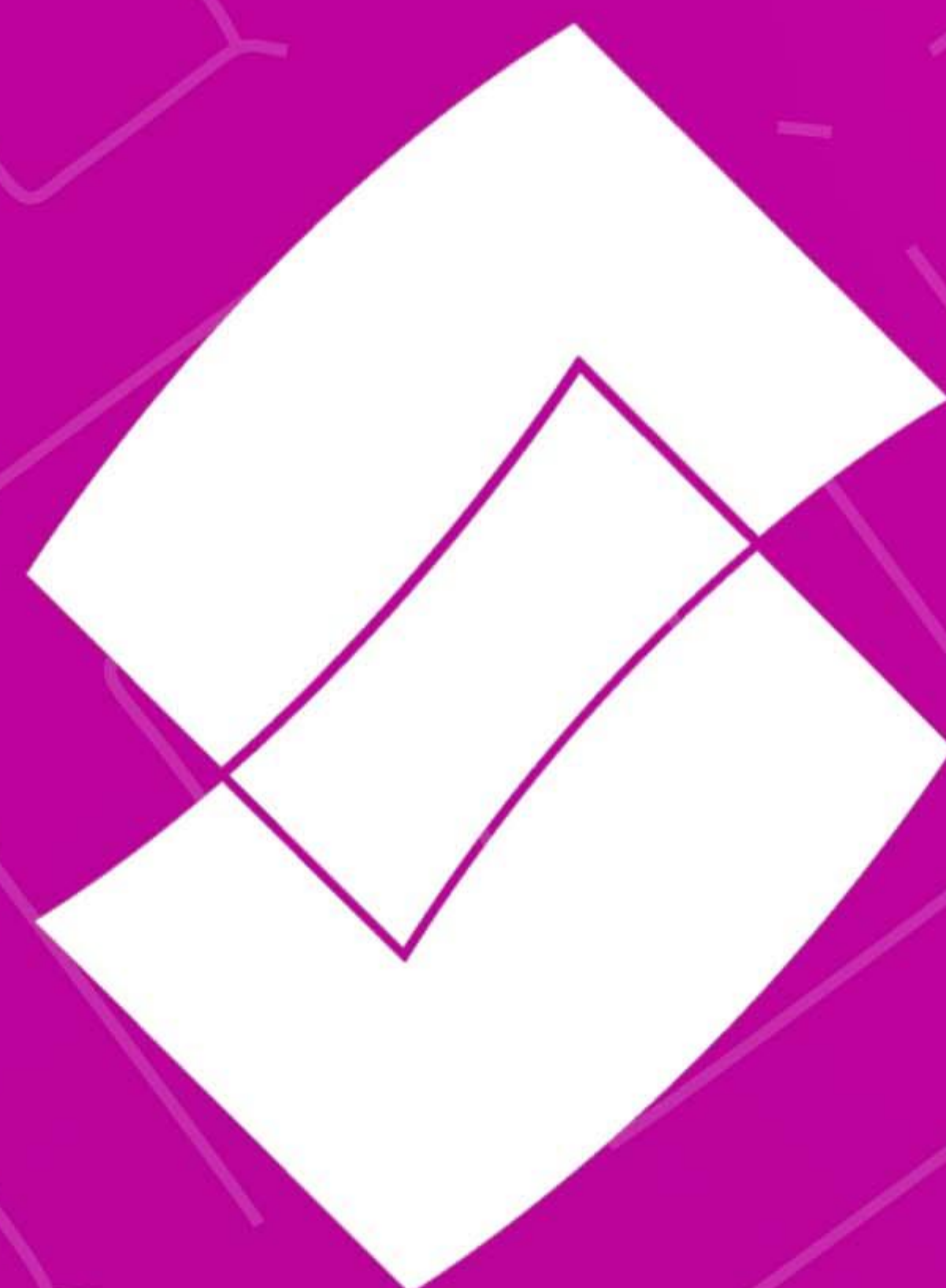
اختیار خرید



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.