

شماره
۴۴۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۹ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





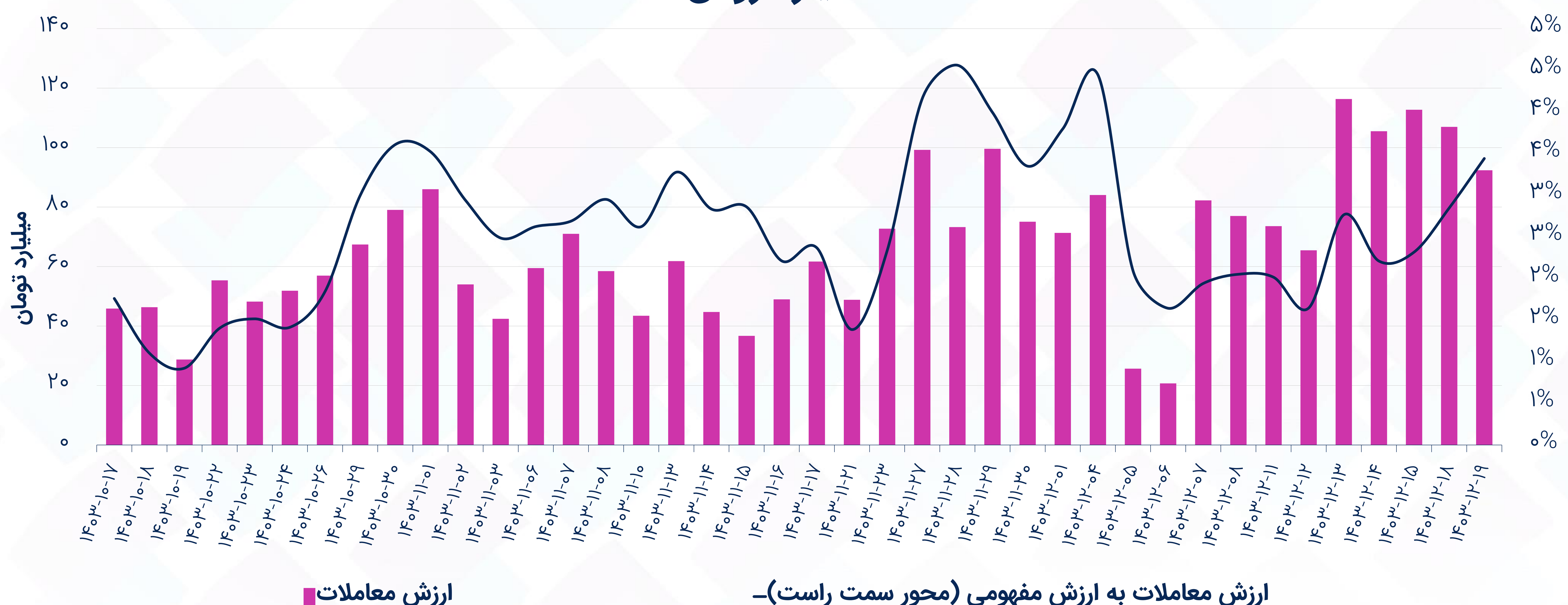
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



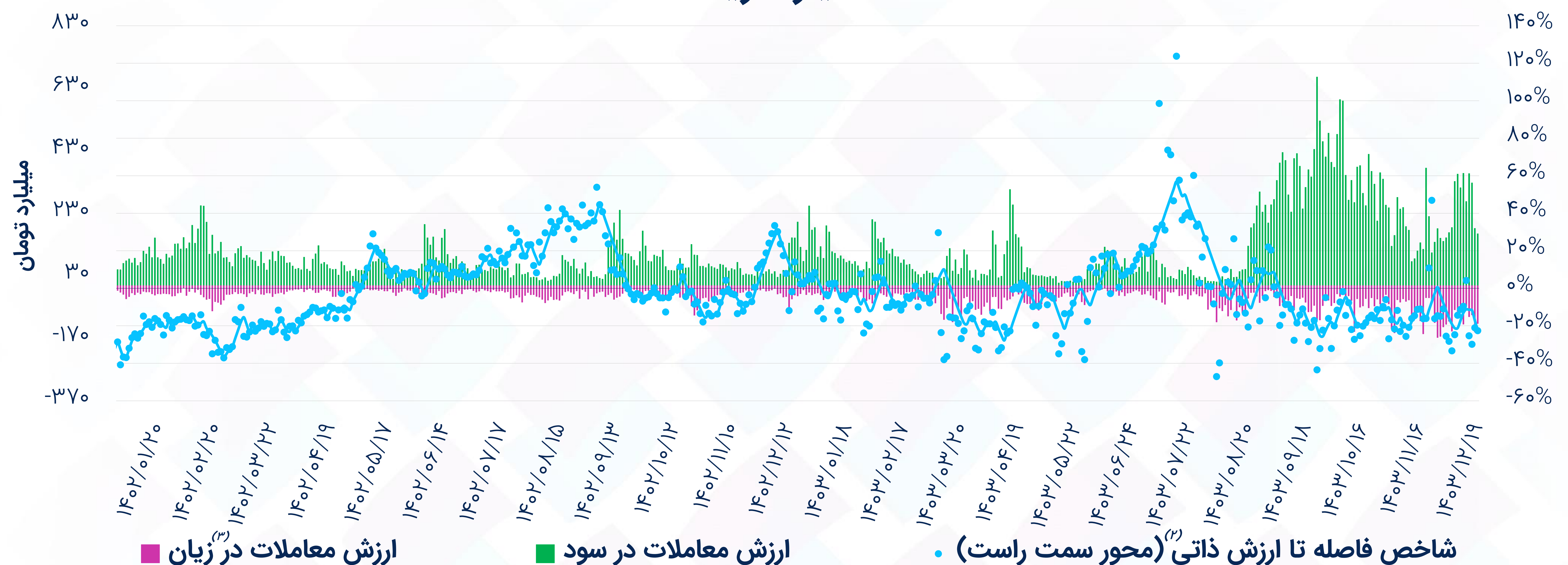
اختیار فروش



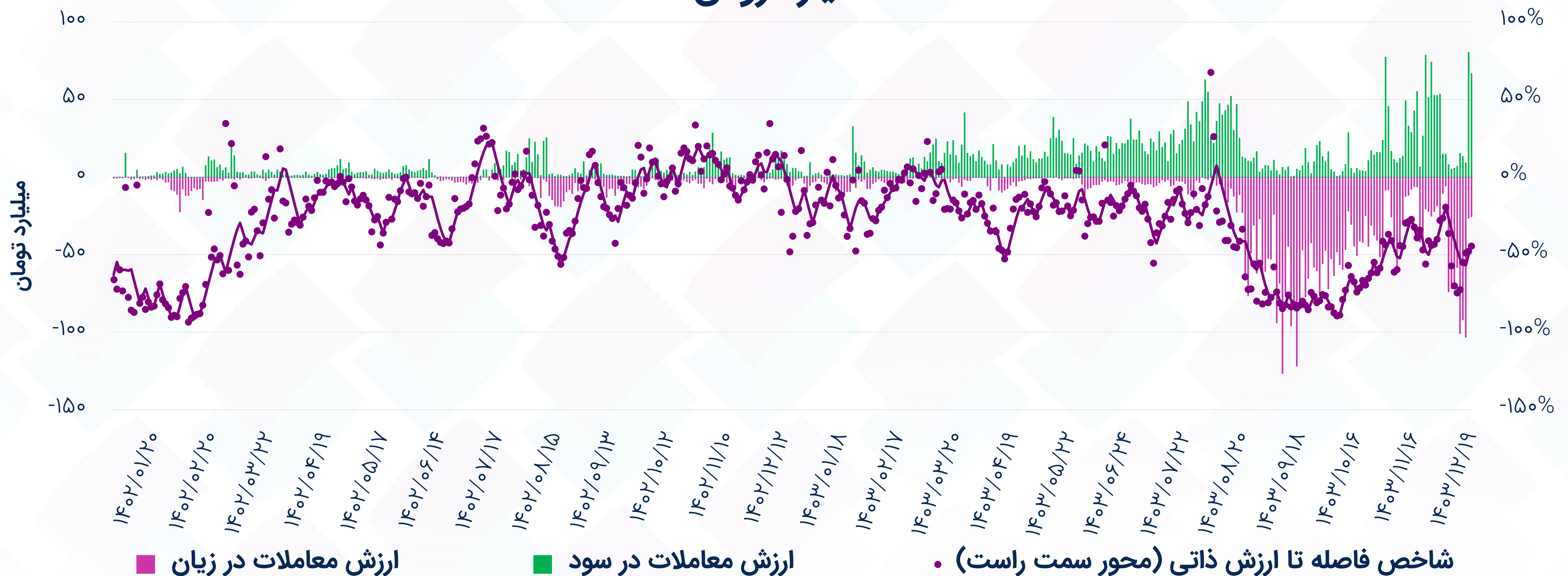
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

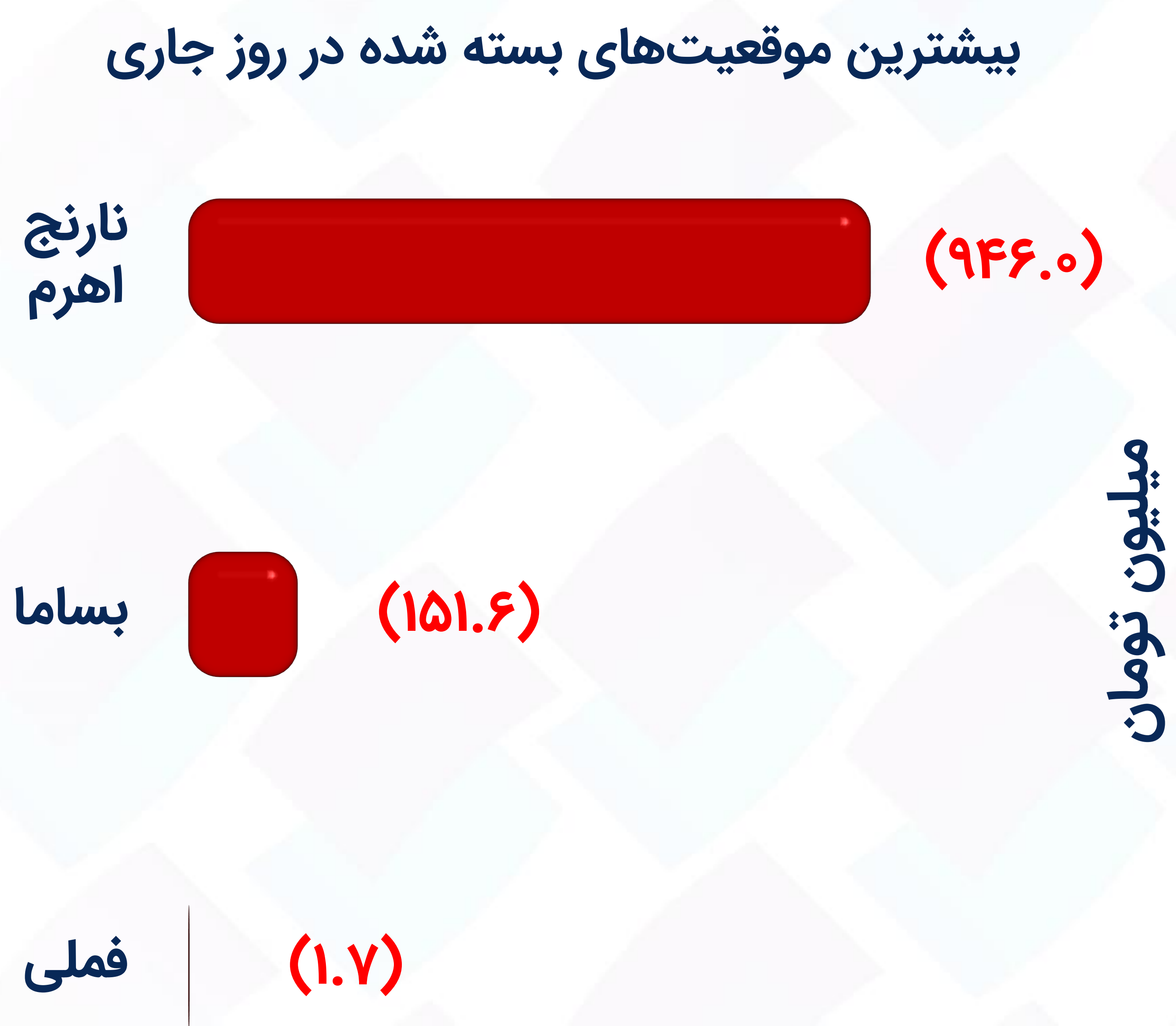
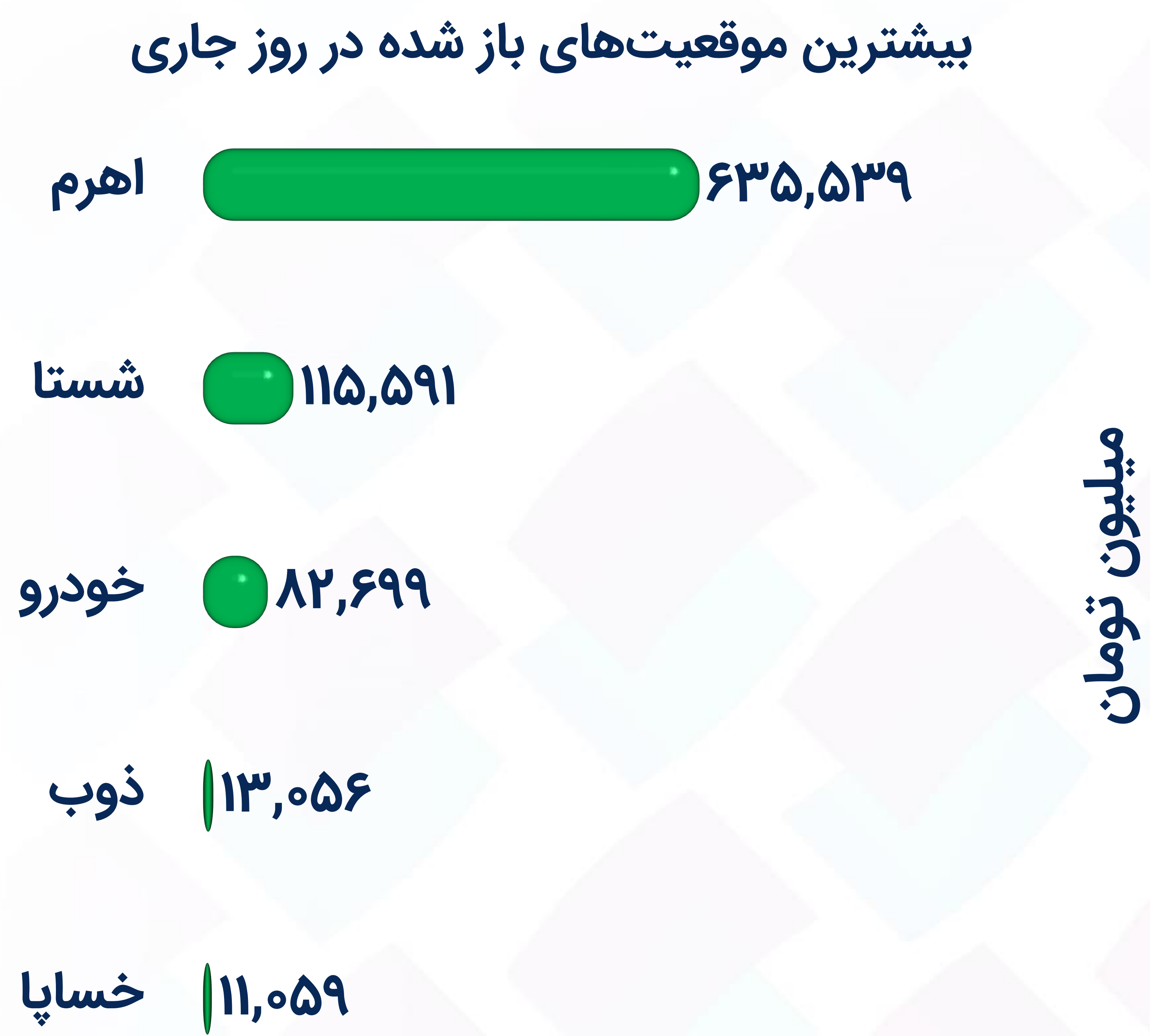
اختیار خرید

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	۱۴۹.۹	۶,۹۷۲.۱	۶۰.۴	۸۹.۴	(۳۲.۲%)
خودرو	۳۶	۶۶.۴	۸۹۳.۱	۵۱.۹	۱۴.۵	(۱۰.۷%)
توان	۲۱	۲۲.۴	۹۰.۱	۲۲.۳	۰.۱	۱۸.۹%
شستا	۴۰	۱۹.۵	۳۲۱.۲	۴.۲	۱۵.۳	(۵۶.۶%)
ذوب	۲۲	۹.۹	۱۰۳.۰	۸.۲	۱.۷	(۲۵.۶%)
خسپا	۲۴	۶.۷	۲۴۶.۸	۵.۹	۰.۸	۶.۳%
وبملت	۱۹	۴.۷	۳۷.۲	۴.۴	۰.۳	(۱۴.۸%)

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	۱۶	۸۰,۶۶۶.۰	۱,۸۴۸,۷۶۹.۷	۶۳,۰۷۸.۷	۱۷,۵۸۷.۴	(۴۰.۲%)
خودرو	۸	۷,۸۲۴.۱	۷۴۰,۳۳۲.۱	۸۸.۹	۷,۷۳۵.۲	(۸۷.۵%)
شستا	۵	۳,۶۷۴.۶	۸۸,۹۰۰.۲	۳,۴۸۸.۵	۱۸۶.۱	(۴۶.۸%)
توان	۳	۱۳۲.۱	۲,۱۶۹.۴	۱۳۲.۰	۰.۱	(۶۴.۷%)
ذوب	۳	۴۴.۳	۲,۶۹۸.۳	۳۸.۶	۵.۷	(۱۲.۷%)
وبملت	۲	۳۰.۲	۱,۳۸۸.۲	۰.۰	۳۰.۲	(۷۳.۴%)
خسپا	۱	۵.۳	۷۶۸.۳	۰.۰	۵.۳	(۴۹.۲%)

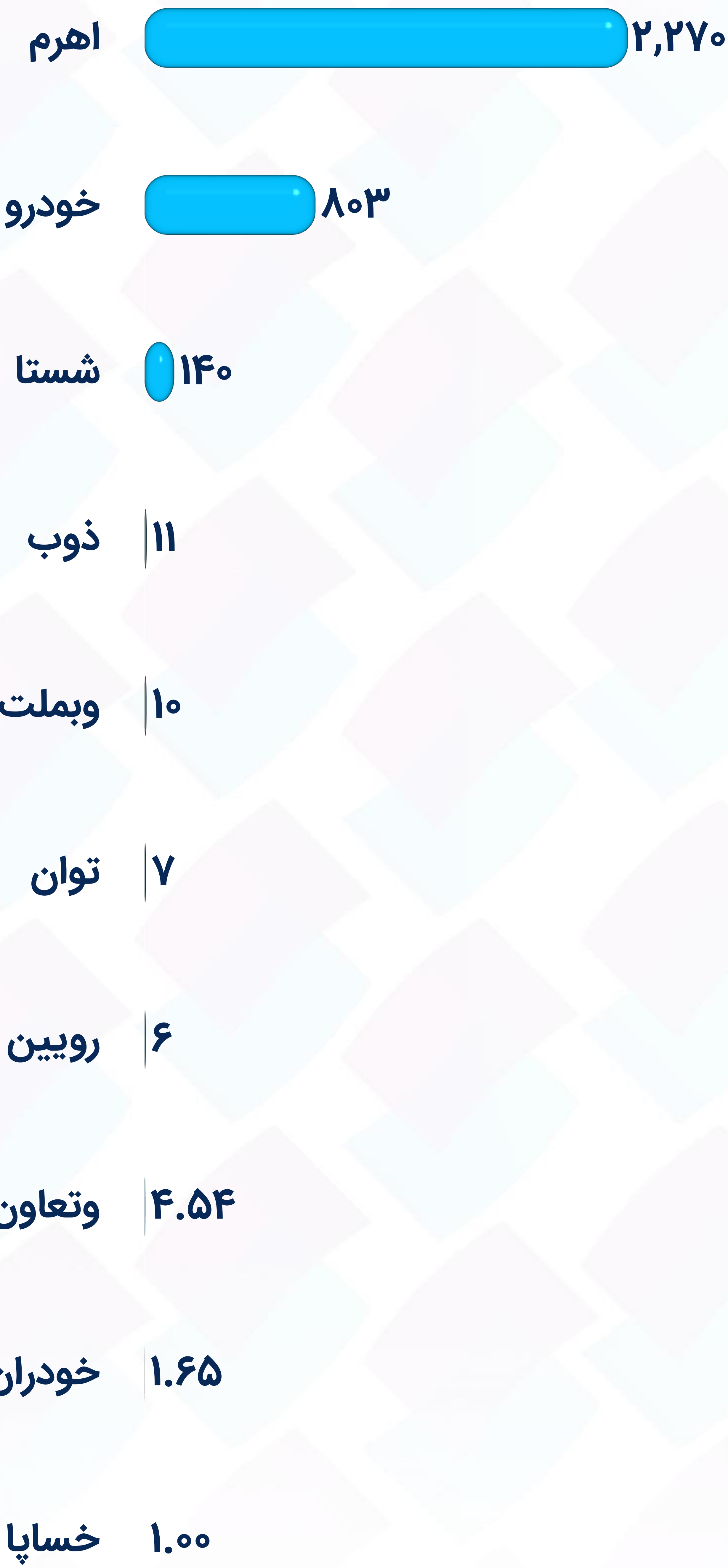
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



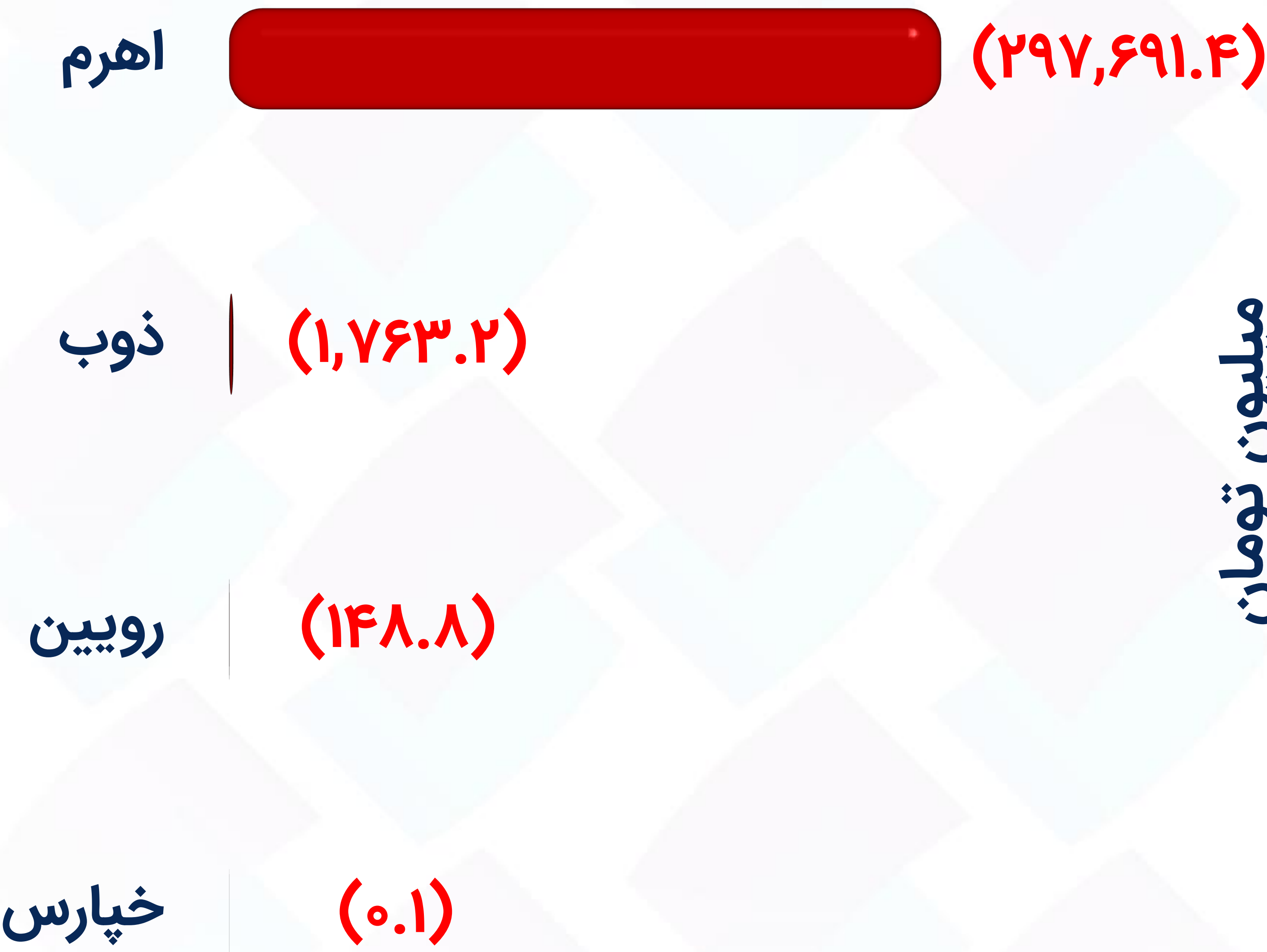
میلیارد تومان

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
ضهرم ۱۲۴۲	اهرم	۲۴,۰۰۰	۳	۲۹,۷۸۳.۵	۷۹۱	۲۴,۷۴۰	۲۴,۷۹۱	۰.۲%	۳۱.۳	۰.۷۹	۱,۰۱۴	۲۸%
ضهرم ۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳	۱,۶۳۴.۹	۲,۳۲۳	۲۴,۷۴۰	۲۴,۳۲۳	(۱.۷%)	۱۰.۵	۱.۰۰	۲,۸۶۵	۲۳%
ضبساما ۲۱۶	بساما	۵,۸۲۹	۴۹	۱۷۶.۸	۲,۷۲۶	۸,۹۳۰	۸,۵۵۵	(۴.۲%)	۳.۱	۱.۰۰	۳,۳۳۵	۲۲%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۴۹	۲.۹	۲,۴۰۰	۸,۹۳۰	۸,۶۴۶	(۳.۲%)	۳.۶	۱.۰۰	۲,۹۳۴	۲۲%
ضتوان ۲۰۶	توان	۲۲,۰۰۰	۶۳	۲۹۵.۰	۲,۵۲۳	۲۳,۴۴۹	۲۴,۵۲۳	۴.۶%	۹.۷	۰.۸۱	۳,۰۰۷	۱۹%

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	۳	۵.۲	۱	۴۳۴	۶۰۱	۳۸%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴۶	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۱۳.۸	۱۵	۲۴,۷۴۰	۳۴,۰۱۵	۳۷%	۲,۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۶۶	۱۱.۵	۱۱	۴۳۴	۸۱۱	۸۷%	۷۳.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳	۱۹۶.۹	۲۱	۲۴,۷۴۰	۳۰,۰۲۱	۲۱%	۱,۴۲۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۵۲	۲۳.۹	۲۹	۱,۲۹۹	۱,۹۲۹	۴۸%	۶۶.۵	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
طخود۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۱۷	۱۳.۶	۴۲۵	۳,۹۷۴	۴,۰۷۵	۲.۵%	۹.۶	-۰.۹۵	۴۶۸	۱۰.۲%
طذوب۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۳	۳۰.۱	۶۵	۴۳۴	۴۳۵	۰.۲%	۶.۷	-۱.۰۰	۶۳	(۲.۸%)
طذوب۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۳	۸.۵	۱۷۰	۴۳۴	۴۳۰	(۰.۹%)	۲.۵	-۱.۰۰	۱۶۳	(۴.۳%)
طهرم۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳	۱۹۶.۱	۵,۴۴۶	۲۴,۷۴۰	۲۴,۵۵۴	(۰.۸%)	۴.۵	-۱.۰۰	۵,۰۹۱	(۶.۵%)
طهرم۱۲۴۴	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳	۶,۱۰۸.۲	۳,۷۱۱	۲۴,۷۴۰	۲۴,۲۸۹	(۱.۸%)	۶.۵	-۰.۹۹	۳,۱۰۴	(۱۶.۳%)

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
طخود۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۱۷	۵.۷	۶	۳,۹۷۴	۲,۷۹۴	(۲۹.۷%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۱۷	۲۰.۲	۸	۳,۹۷۴	۲,۹۹۲	(۲۴.۷%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳	۱.۶	۹	۲۴,۷۴۰	۱۹,۹۹۱	(۱۹.۲%)	۲,۲۲۱.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۱۳۷۰	خودرو	۳,۲۵۰	۱۷	۴۱۰.۳	۱۱	۳,۹۷۴	۳,۲۳۹	(۱۸.۵%)	۲۹۴.۵	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طخود۲۰۵۶	خودرو	۳,۲۵۰	۴۵	۸.۲	۵۹	۳,۹۷۴	۳,۱۹۱	(۱۹.۷%)	۵۴.۱	-۰.۰۱	۲	(۹۷.۱%)

(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

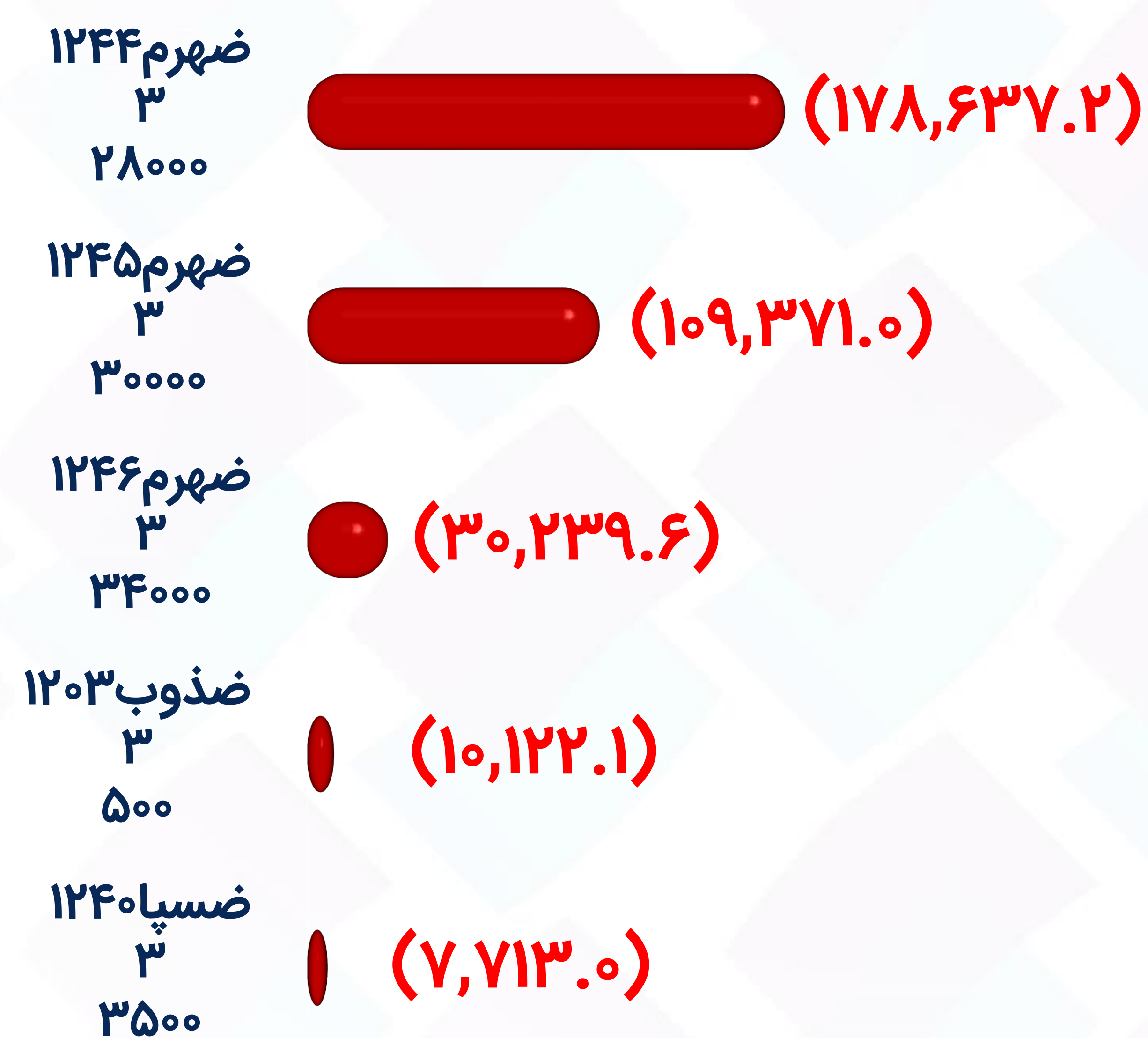
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

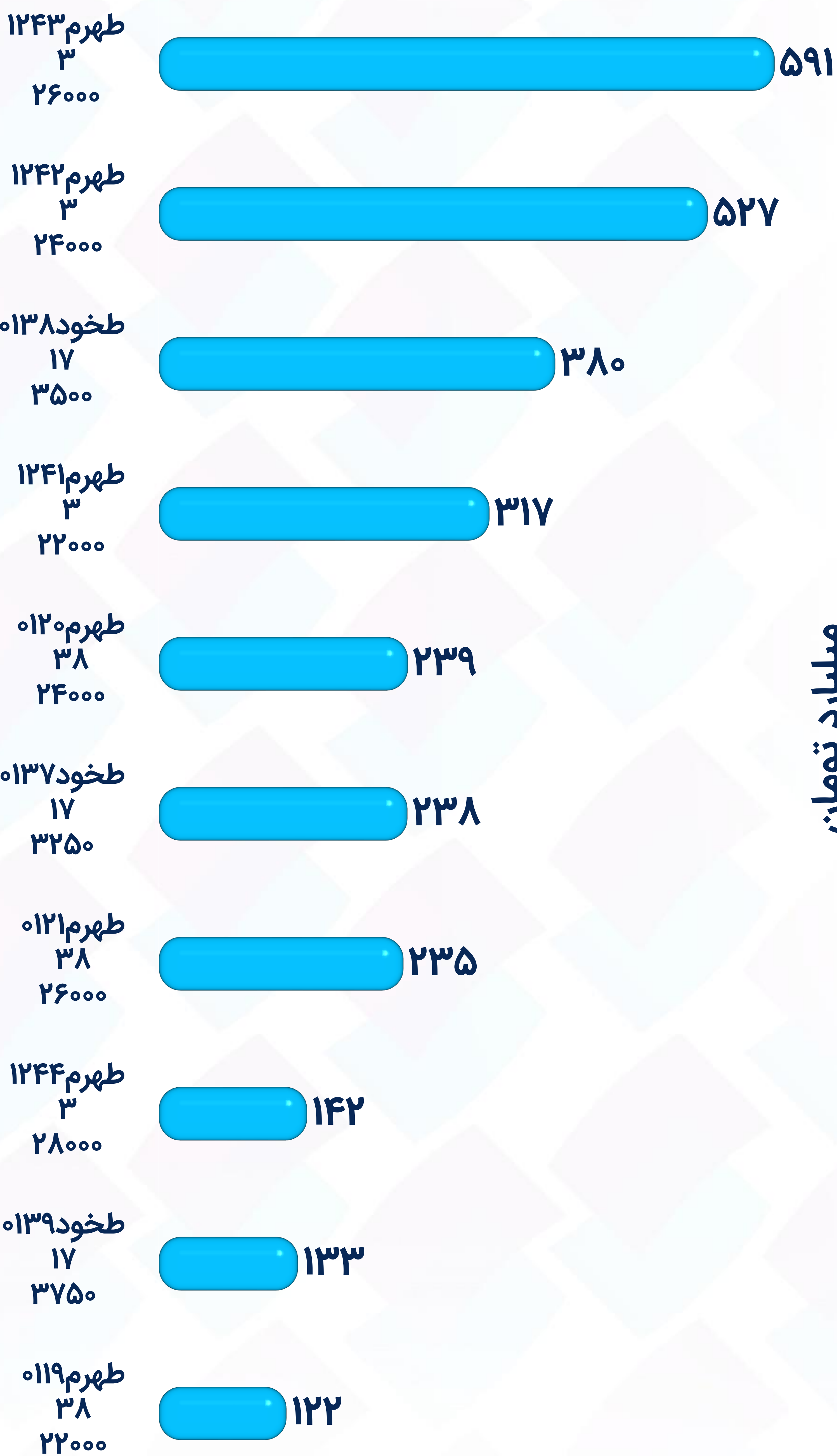


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

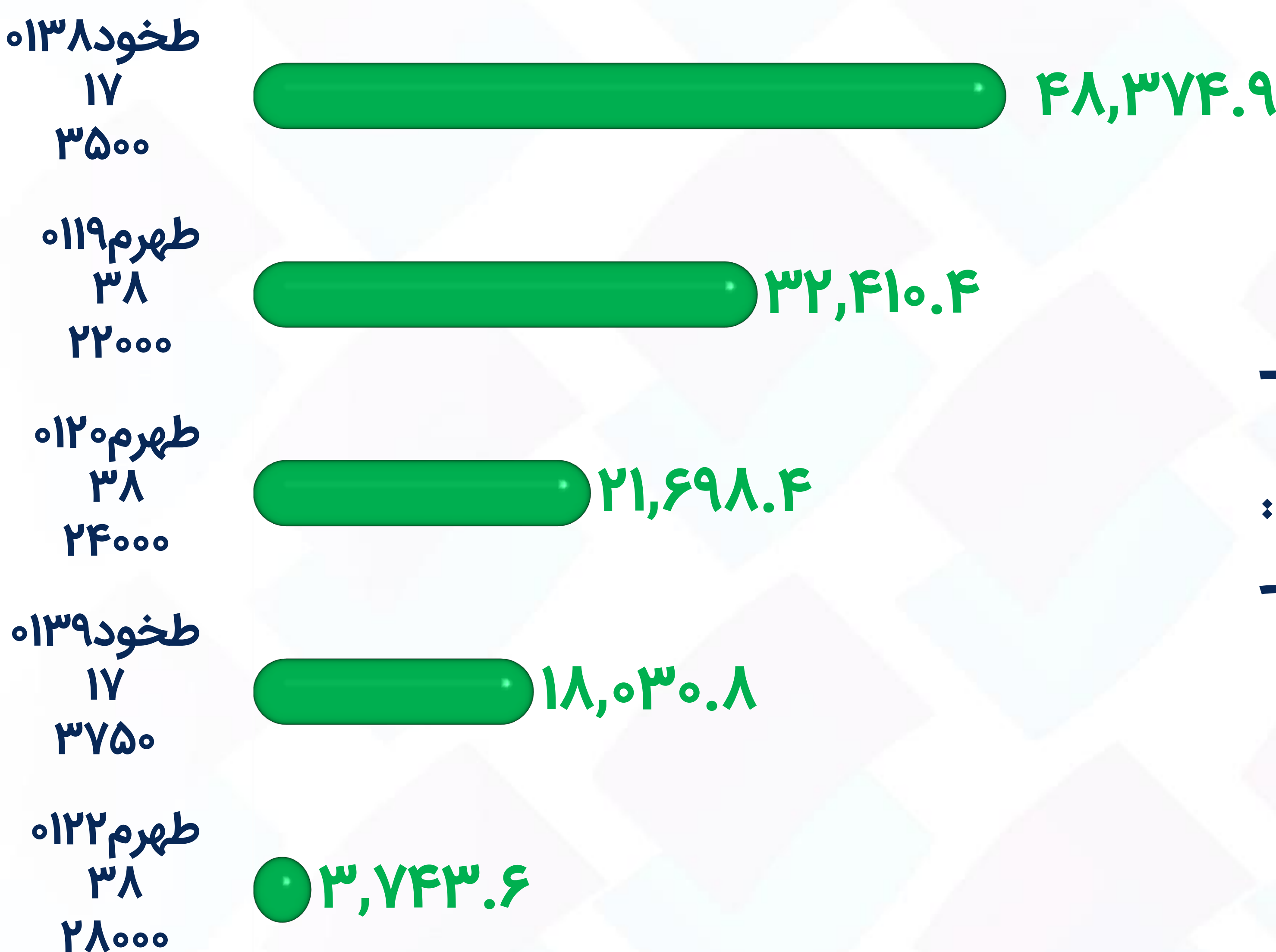
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

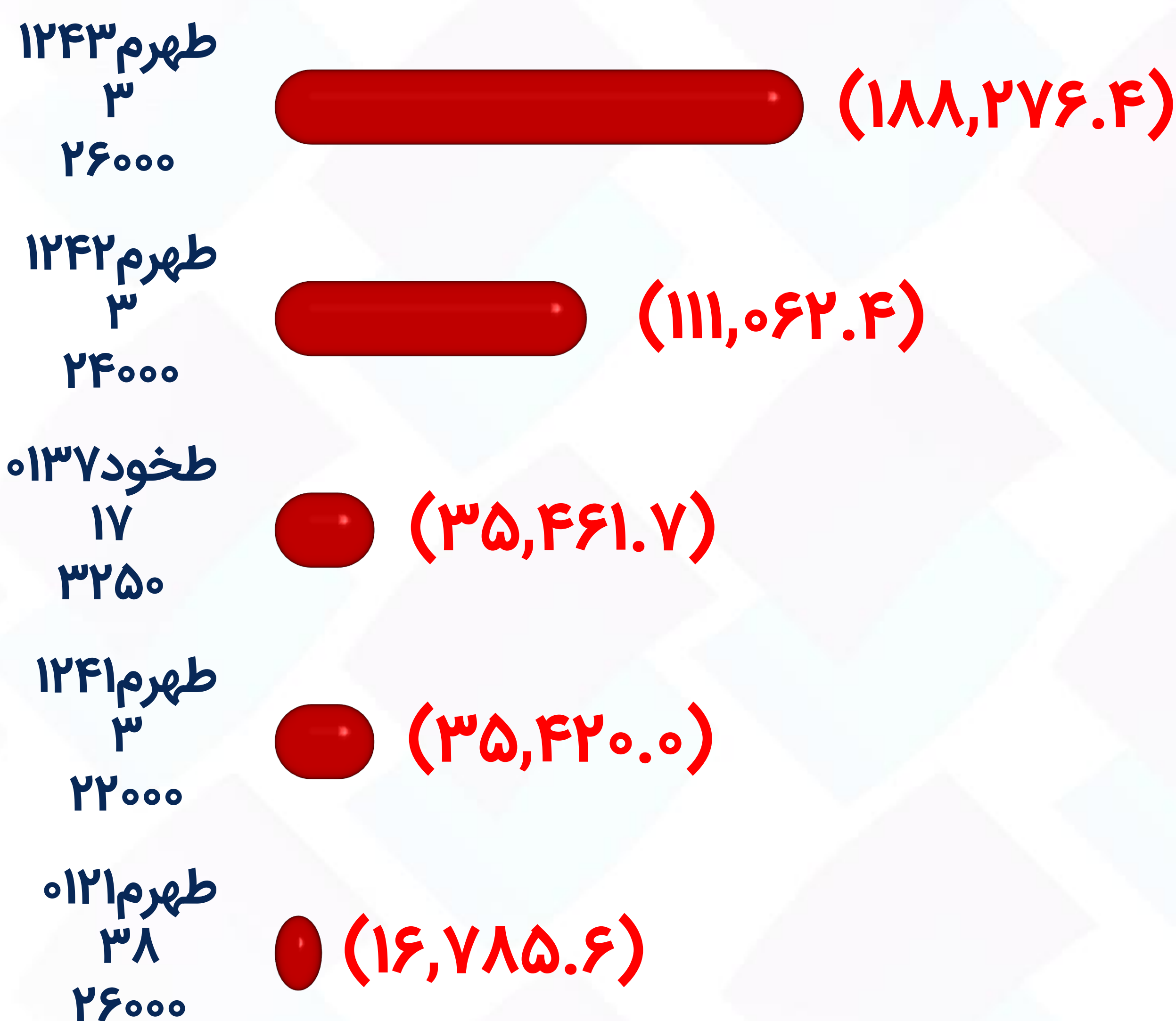
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

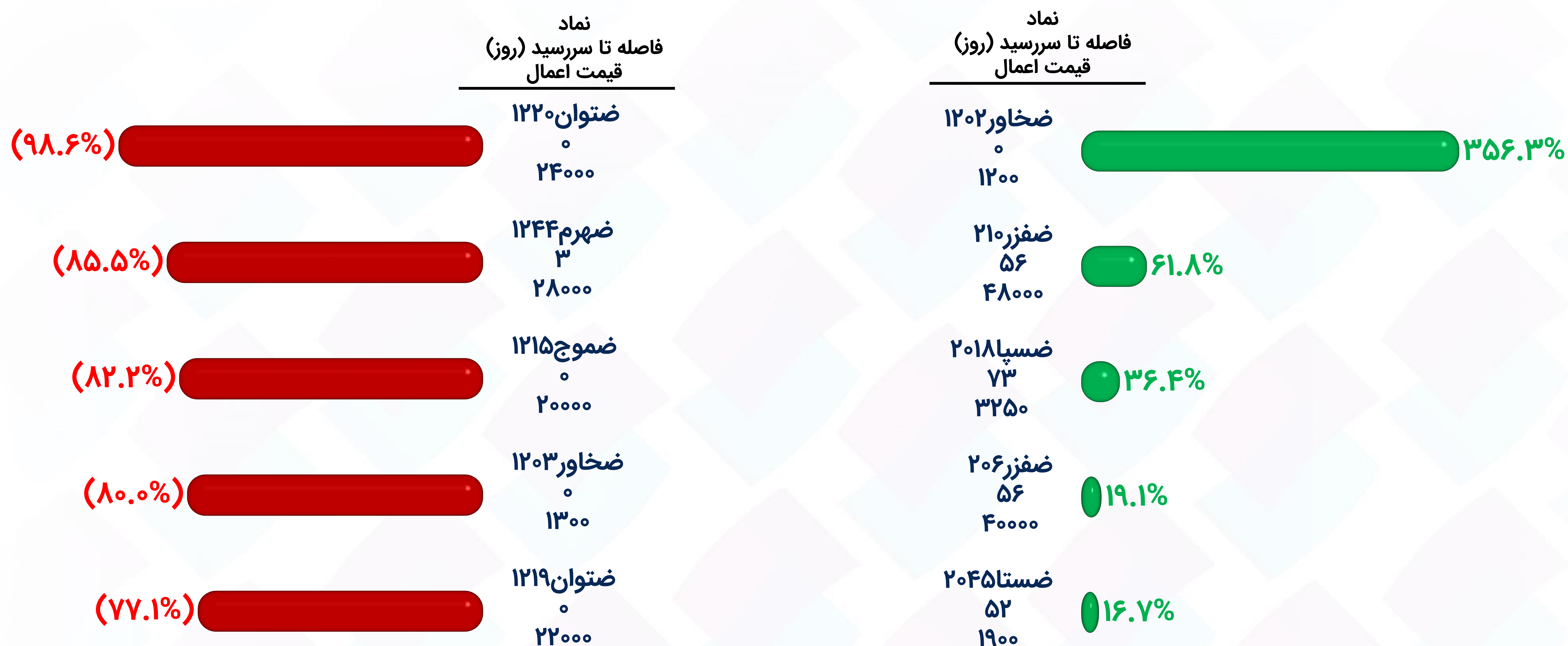
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

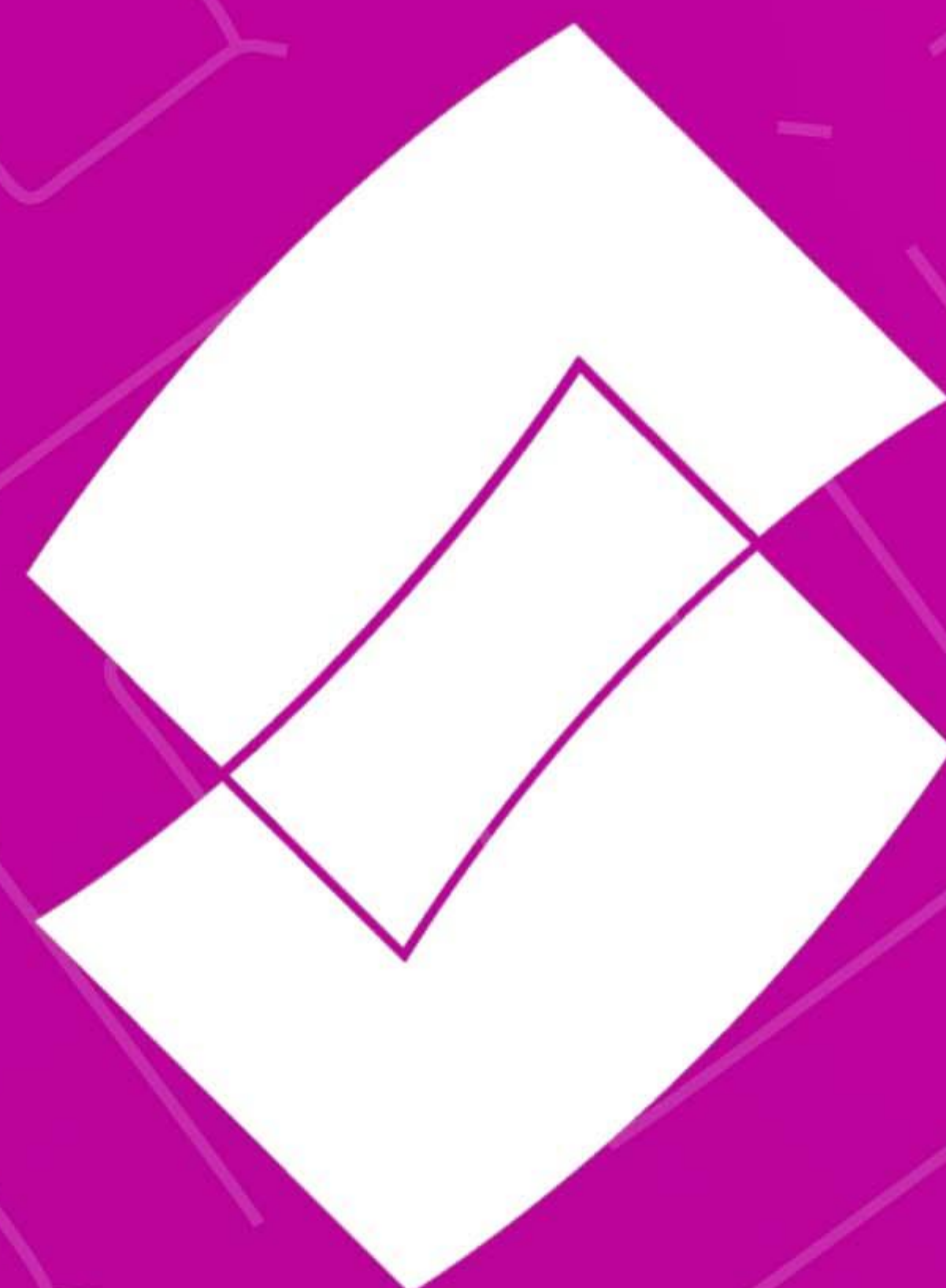
اختیار خرید



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.