

شماره
۴۴۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

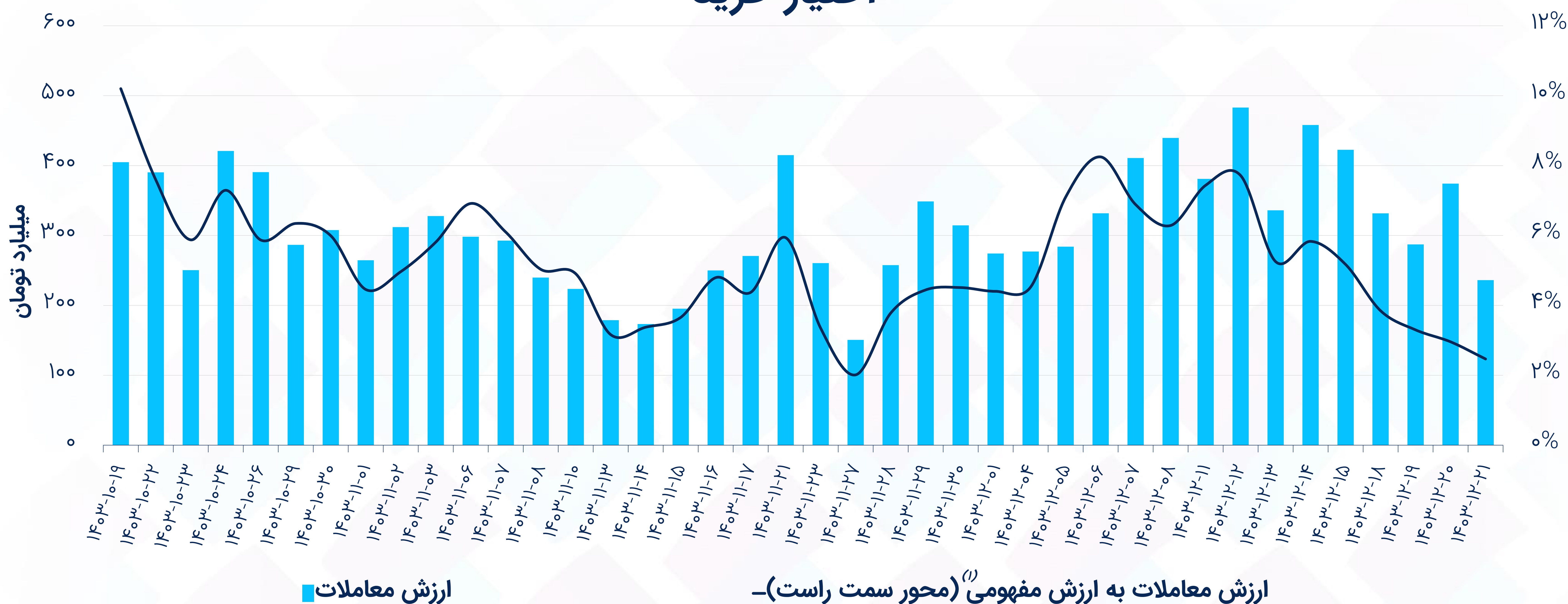




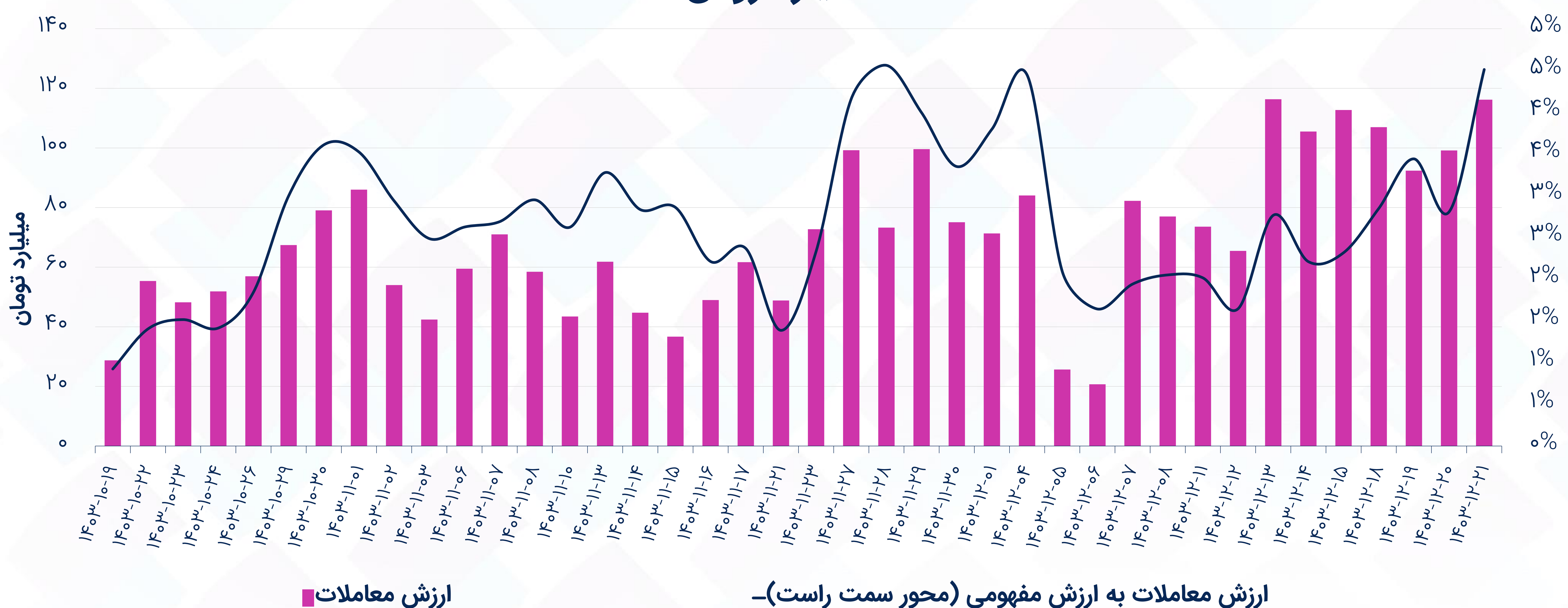
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



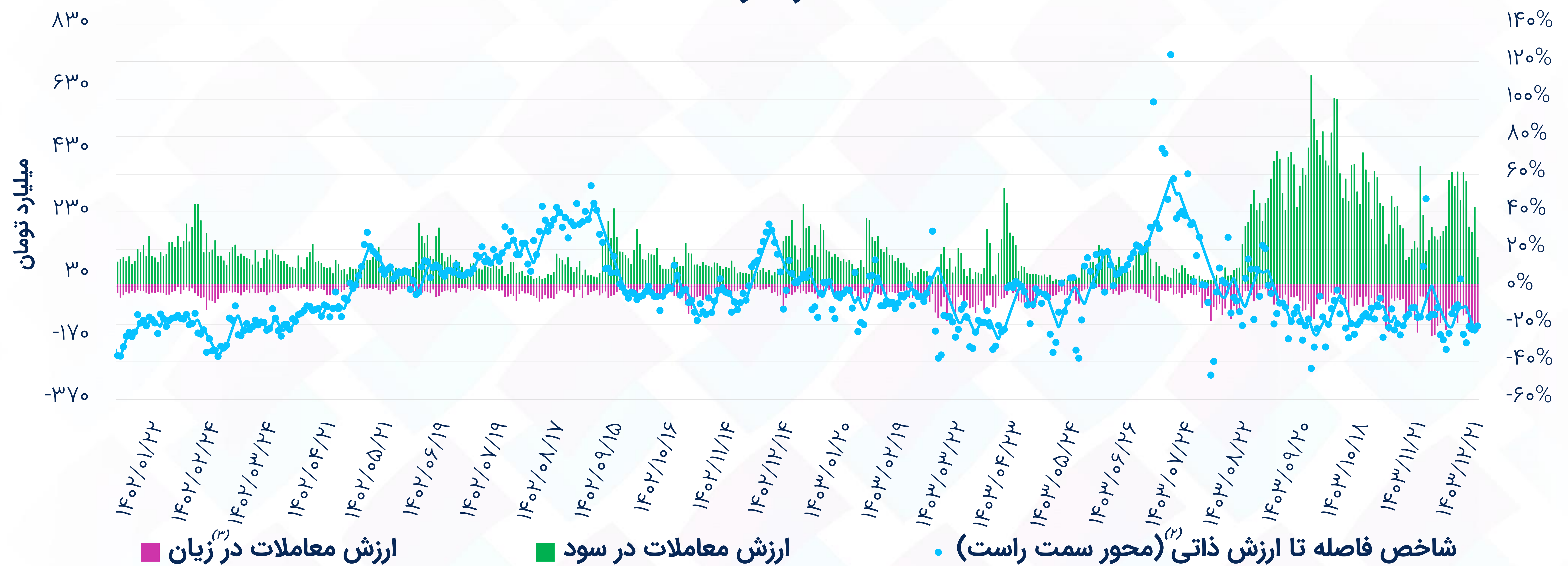
اختیار فروش



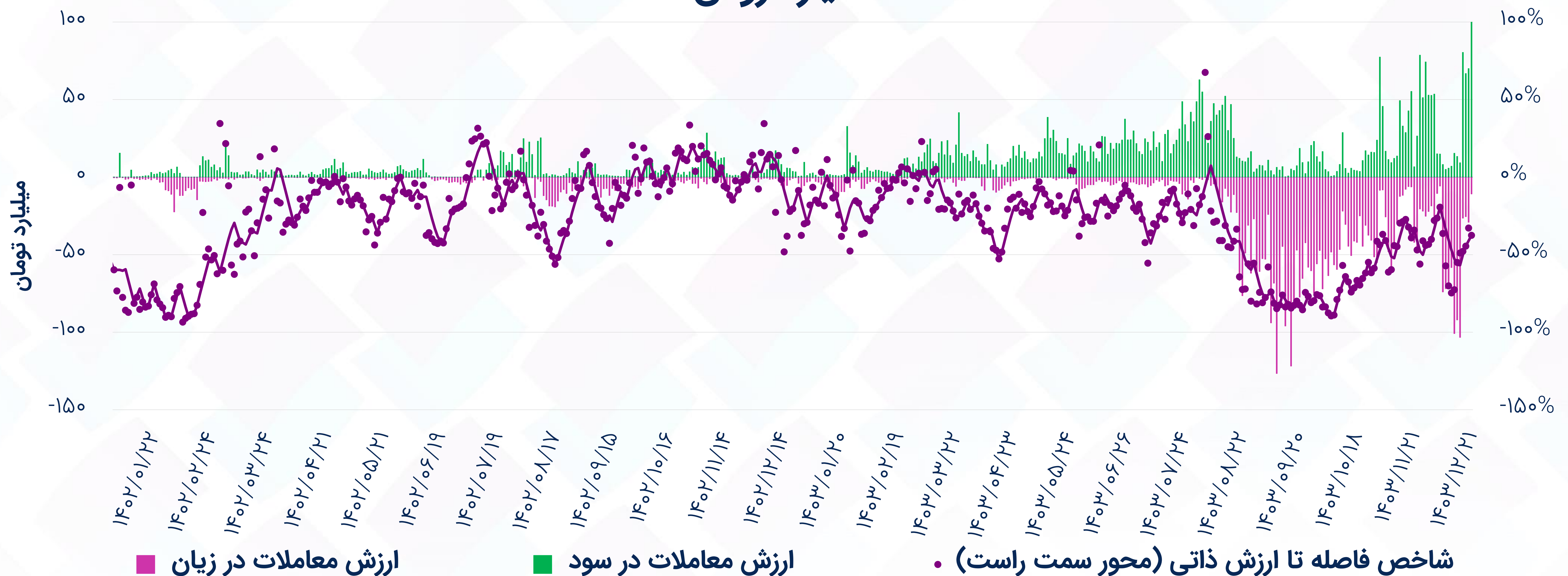
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

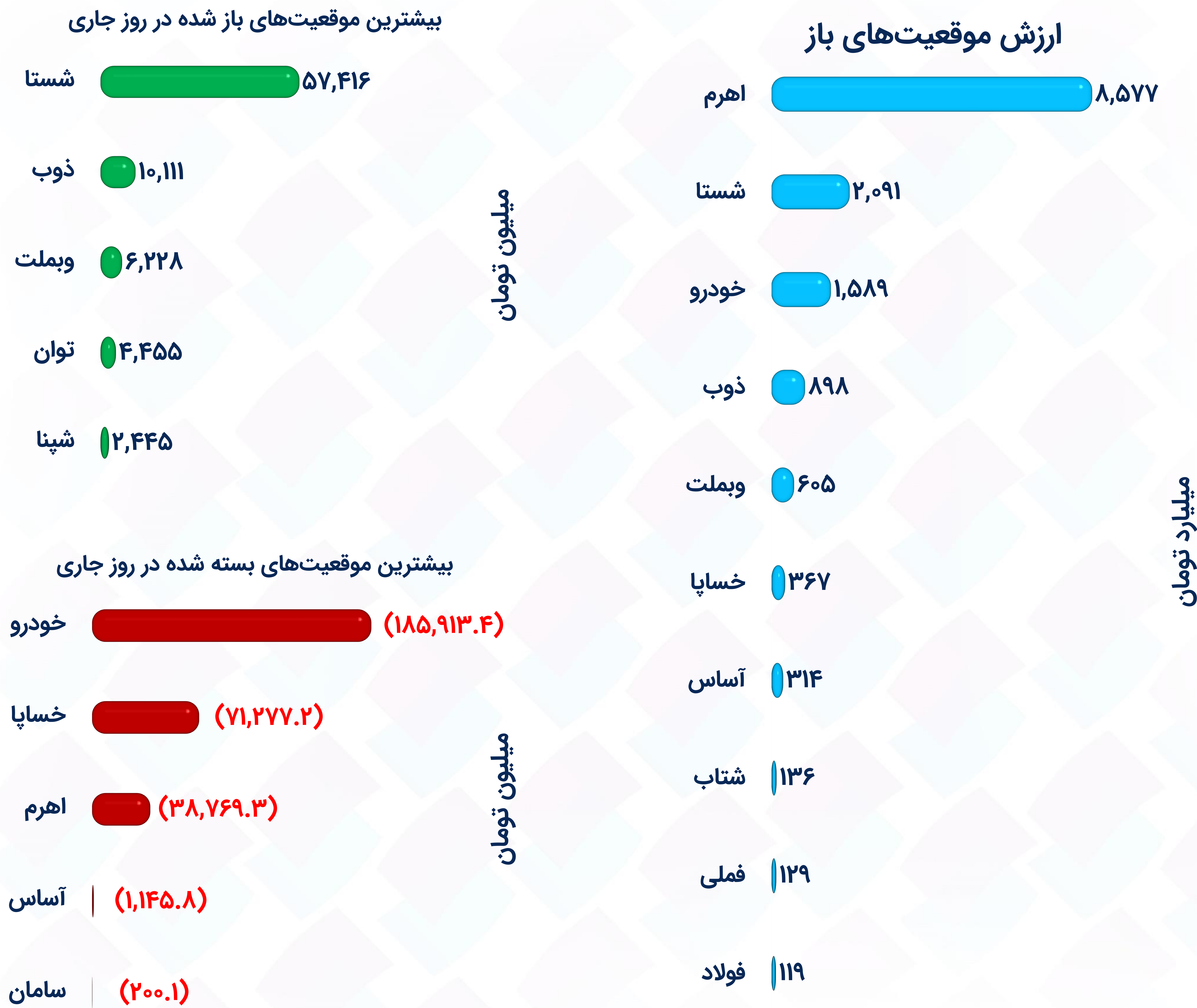
اختیار خرید

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	۴۵	۱۵۶.۷	۷,۶۱۰.۹	۳۱.۹	۱۲۴.۸	(۳۴.۰%)
خودرو	۳۷	۳۸.۸	۱,۱۱۳.۱	۲۷.۷	۱۱.۱	۳۶.۸%
شستا	۳۸	۱۵.۲	۳۴۷.۳	۳.۳	۱۱.۹	(۶۴.۲%)
ذوب	۲۲	۱۱.۳	۱۲۹.۱	۸.۷	۲.۷	(۲۹.۸%)
خسپا	۲۲	۴.۵	۲۹۸.۲	۳.۹	۰.۶	۷۹.۶%
وبملت	۱۹	۳.۳	۳۵.۳	۳.۱	۰.۲	(۱۱.۷%)
توان	۸	۱.۶	۹.۰	۱.۵	۰.۱	(۷.۰%)

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	۱۰۳,۴۸۸.۵	۱,۷۰۶,۰۹۷.۵	۱۰۰,۵۸۰.۹	۲,۹۰۷.۶	(۳۳.۸%)
خودرو	۱۱	۸,۶۵۵.۵	۷۶۰,۸۲۵.۵	۱,۳۴۶.۵	۷,۳۰۹.۰	(۷۷.۹%)
شستا	۴	۳,۹۵۹.۷	۱۰۲,۸۸۶.۵	۳,۳۳۰.۵	۶۲۹.۲	(۴۶.۴%)
ذوب	۲	۲۸.۴	۴,۴۲۰.۰	۱۸.۲	۱۰.۳	(۳۱.۸%)
خسپا	۱	۲۷.۵	۷۶۲.۰	۰.۰	۲۷.۵	(۸۹.۹%)
توان	۲	۲۰.۴	۲۷۰.۵	۱۵.۳	۵.۱	(۲۹.۲%)
وبملت	۳	۹.۲	۳۶۸.۸	۰.۰	۹.۲	(۷۷.۲%)

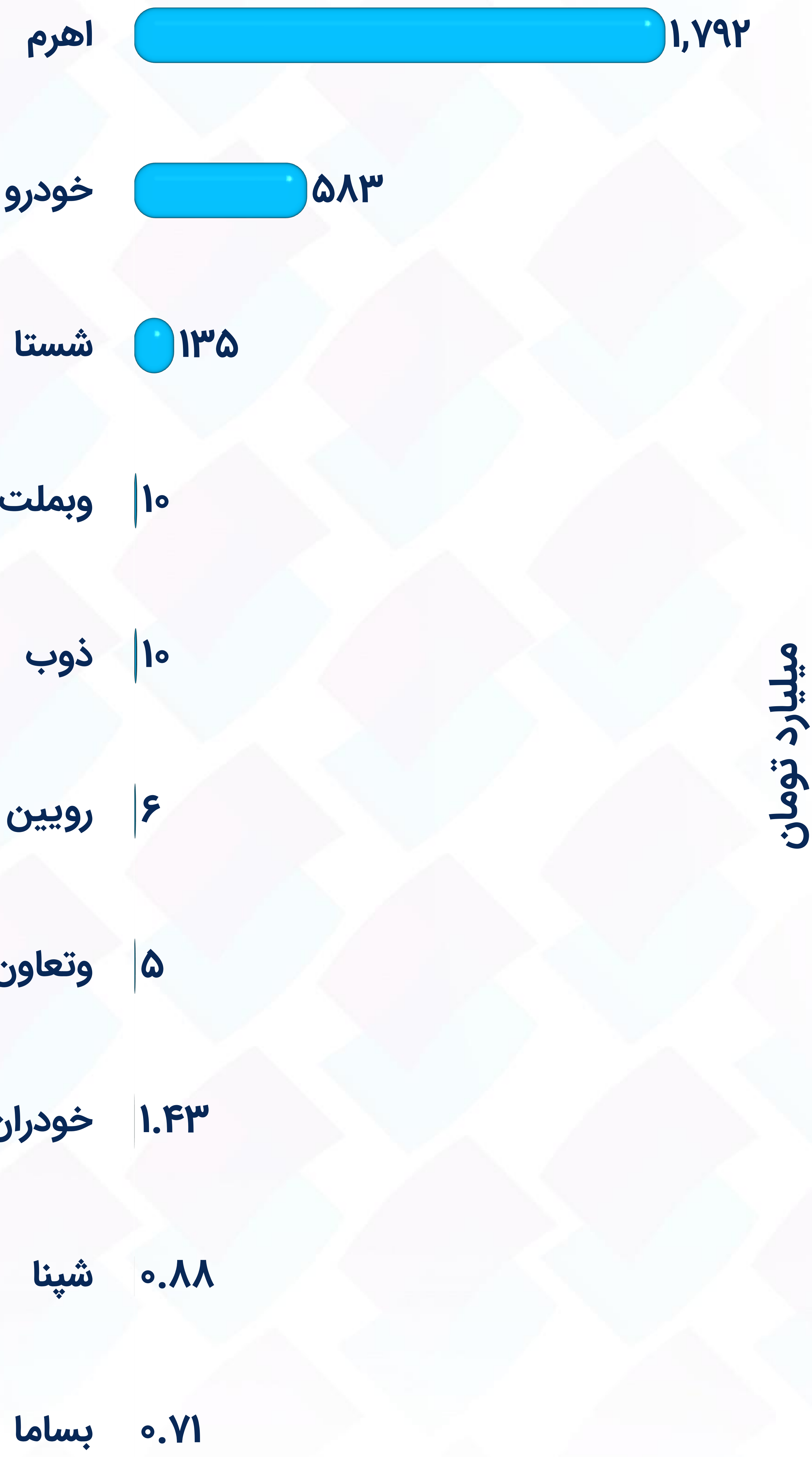
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

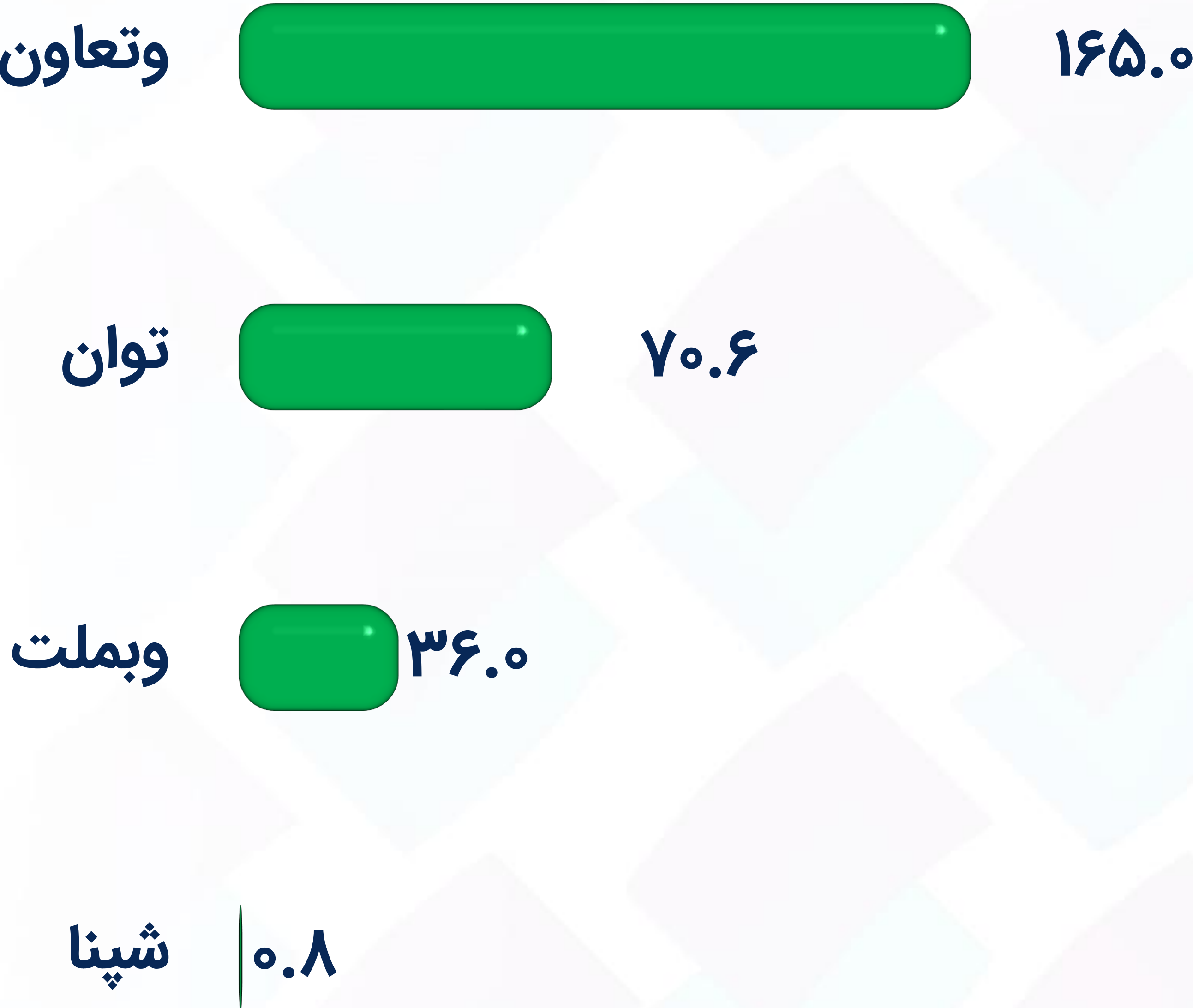
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



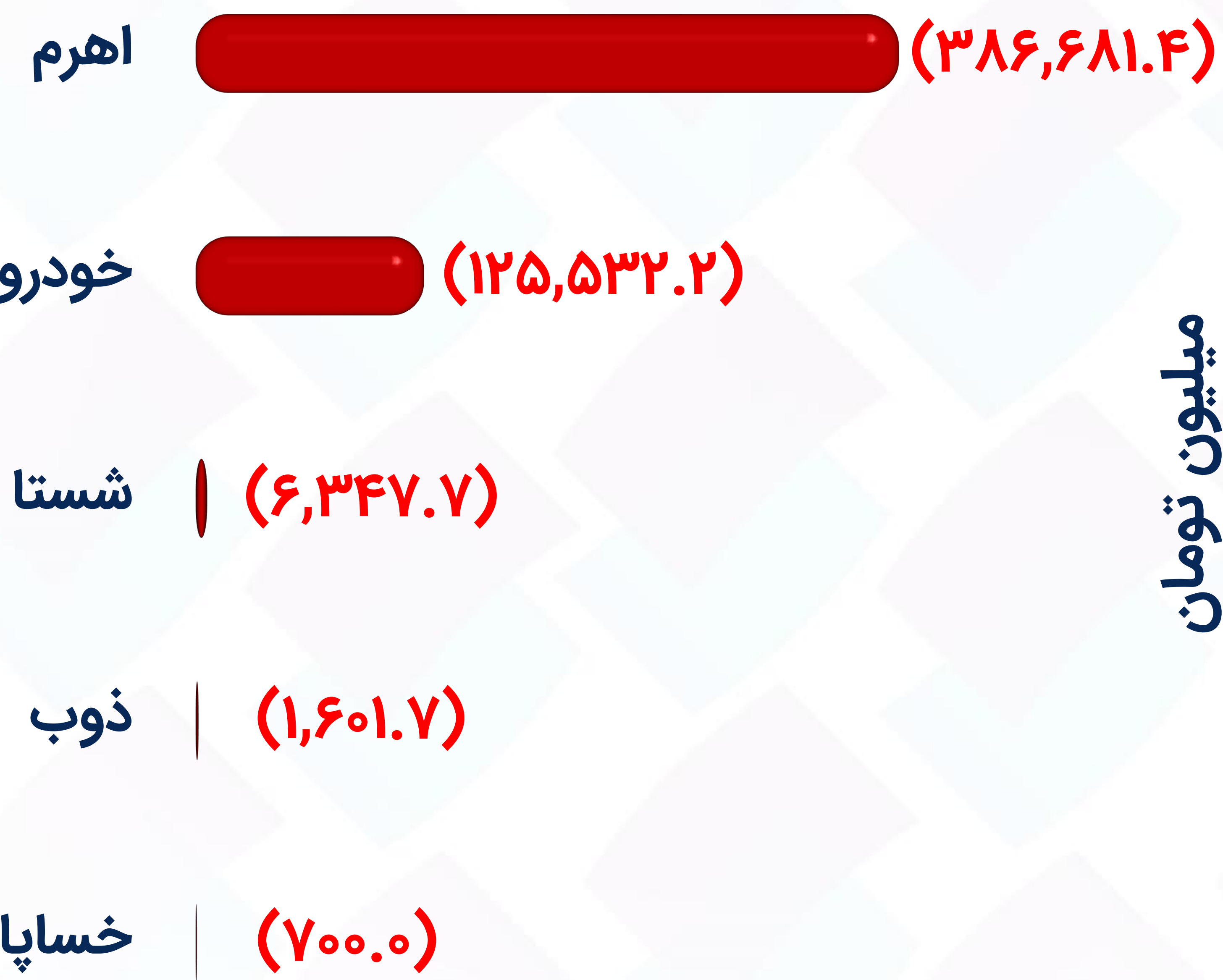
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



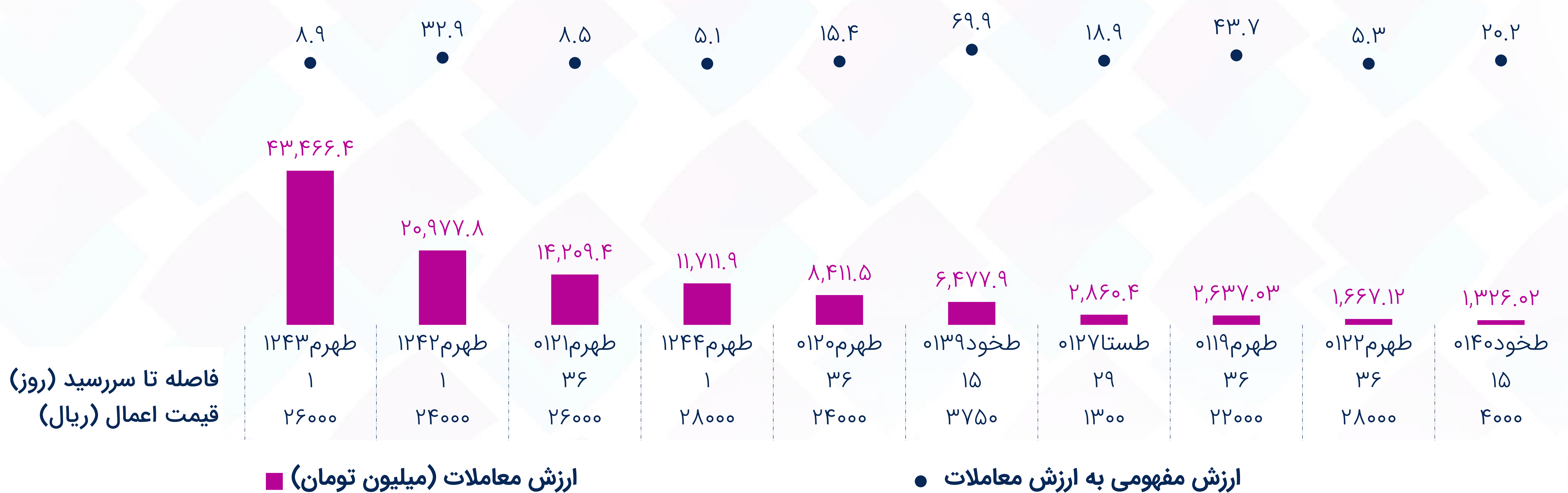
میلیون تومان

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
ضرویین ۱۲۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۵	۲.۷	۱۰۱	۱۲,۰۱۵	۱۲,۱۰۱	۰.۷%	۱۱۹.۸	۰.۶۰	۱۸۹	۸۷%
ضخود ۰۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۱۵	۲,۵۸۳.۲	۱۵۶	۳,۹۸۲	۳,۹۰۶	(۱.۹%)	۲۵.۰	۰.۹۰	۲۸۷	۸۴%
ضخود ۰۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۵	۹,۶۵۸.۷	۶۱	۳,۹۸۲	۴,۰۶۱	۲.۰%	۶۶.۶	۰.۵۶	۱۰۷	۷۵%
ضخود ۲۰۵۴	خودرو	۲,۸۰۰	۴۳	۱.۰	۹۳۱	۳,۹۸۲	۳,۷۳۱	(۶.۳%)	۴.۰	۱.۰۰	۱,۲۸۱	۳۸%
ضخود ۲۰۵۷	خودرو	۳,۵۰۰	۴۳	۲۳۷.۴	۴۵۶	۳,۹۸۲	۳,۹۵۶	(۰.۷%)	۸.۷	۰.۹۵	۶۱۴	۳۵%

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 ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۲۹	۴.۶	۳	۴۲۲	۷۰۳	۶۷%	۲۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۶۴	۱.۰	۱۰	۴۲۲	۸۱۰	۹۲%	۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲۹	۸۰.۴	۵	۱,۲۶۹	۱,۷۰۵	۳۴%	۳۴۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۸۴	۱.۴	۳۵	۱,۲۶۹	۲,۲۳۵	۷۶%	۶۳.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲۹	۷۱.۱	۵	۴۲۲	۶۰۵	۴۳%	۱۲۱.۰	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

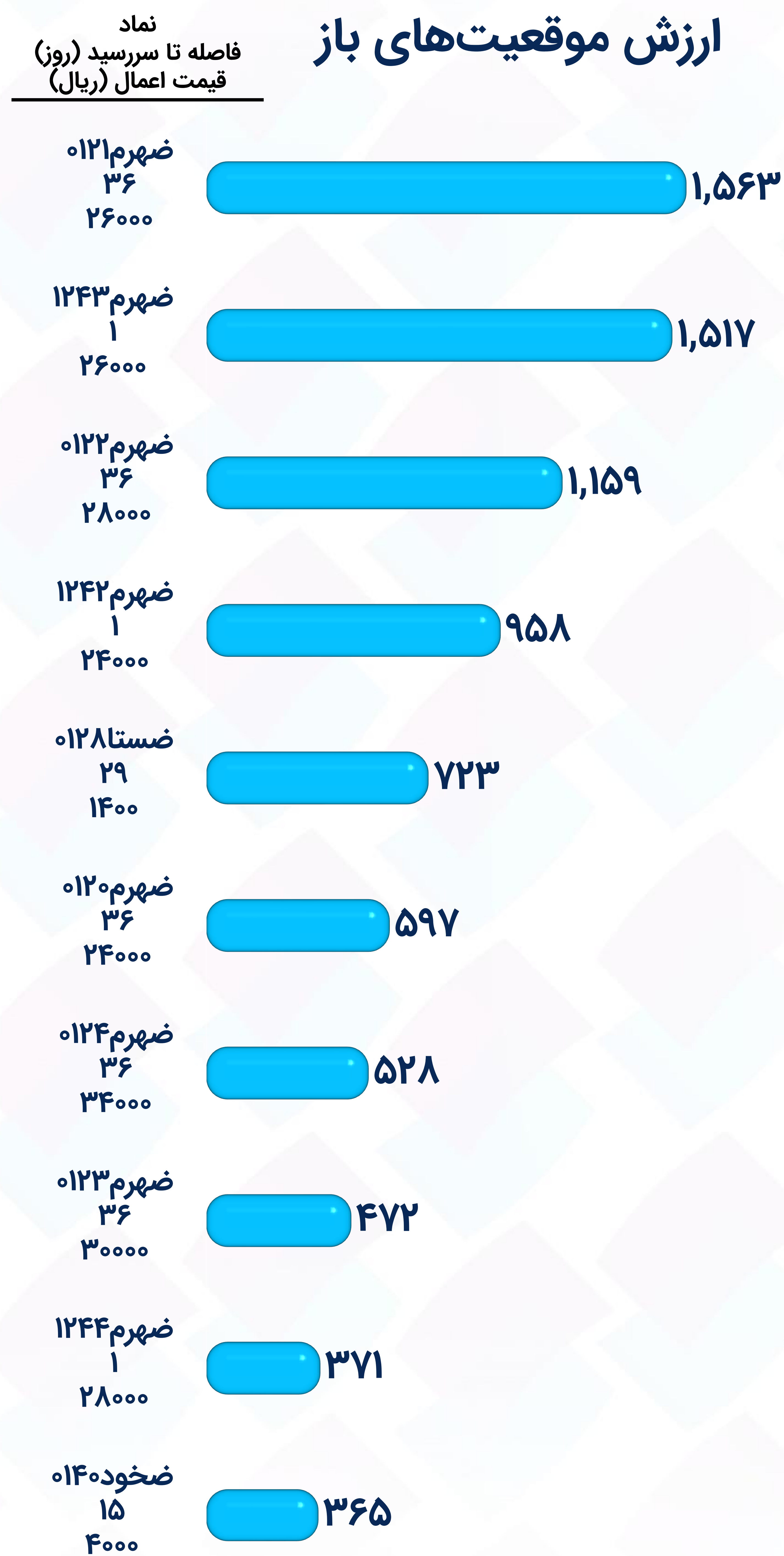
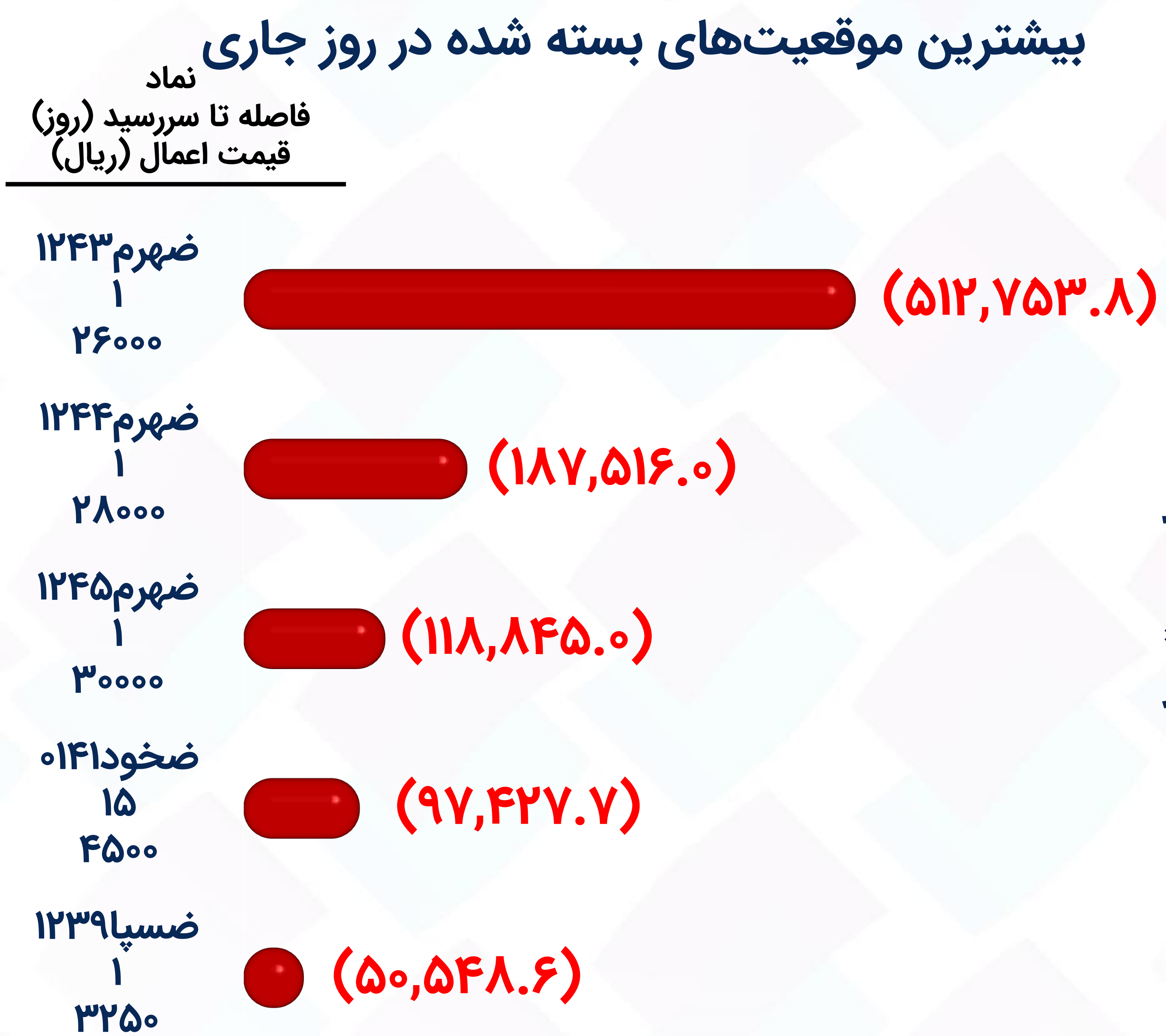
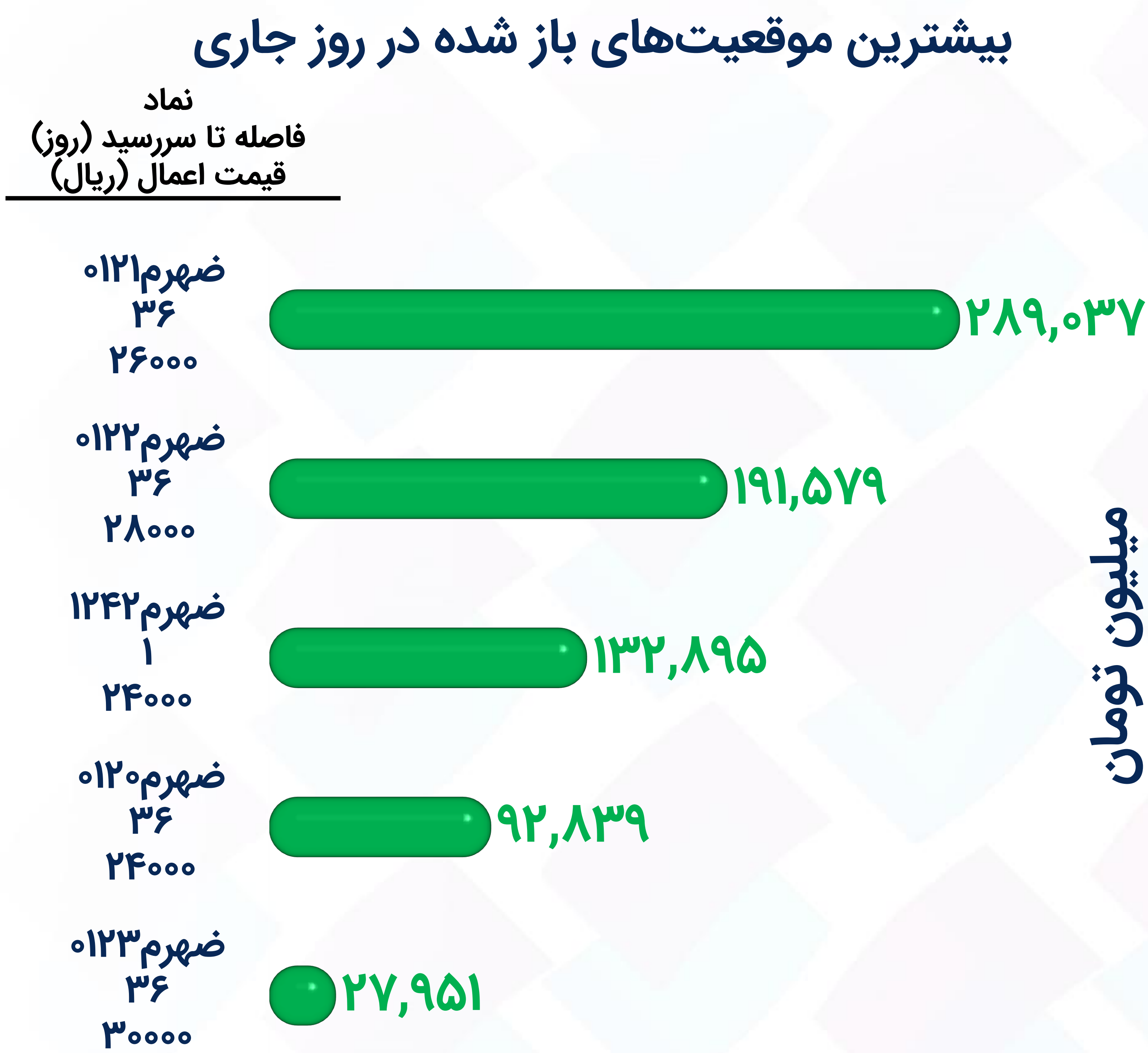
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۶	۷.۱	۶,۴۹۹	۲۳,۸۸۰	۲۳,۵۰۱	(۱.۶%)	۳.۶	-۰.۹۷	۵,۲۹۹	(۱۸.۵%)
طستا ۰۱۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۲۹	۴۷۰.۱	۱۳۷	۱,۲۶۹	۱,۲۶۳	(۰.۵%)	۹.۲	-۰.۸۶	۱۰۷	(۲۱.۷%)
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۶	۱,۶۶۷.۱	۴,۴۷۷	۲۳,۸۸۰	۲۳,۵۲۳	(۱.۵%)	۵.۳	-۰.۸۹	۳,۴۵۷	(۲۲.۸%)
طتوان ۲۰۷	توان	۲۴,۰۰۰	۶۱	۱۵.۳	۱,۹۶۴	۲۲,۳۴۵	۲۲,۰۳۶	(۱.۴%)	۱۱.۲	-۰.۵۲	۱,۵۰۳	(۲۳.۵%)
طخود ۰۱۴۱	خودرو	۴,۵۰۰	۱۵	۹.۳	۶۱۴	۳,۹۸۲	۳,۸۸۶	(۲.۴%)	۶.۳	-۰.۹۷	۴۶۹	(۲۳.۶%)

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	۱۵	۴.۰	۳	۳,۹۸۲	۲,۷۹۷	(۲۹.۸%)	۹۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۱۵	۵۲.۲	۷	۳,۹۸۲	۲,۹۹۳	(۲۴.۸%)	۴۲۷.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۷	خودرو	۳,۲۵۰	۱۵	۱۶۰.۳	۱۱	۳,۹۸۲	۳,۲۳۹	(۱۸.۷%)	۲۹۴.۵	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طرویین ۱۲۰	رویین	۱۱,۰۰۰	۵	۰.۰	۱۵	۱۲,۰۱۵	۱۰,۹۸۵	(۸.۶%)	۷۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۵%)
طخود ۲۰۵۶	خودرو	۳,۲۵۰	۴۳	۰.۰	۵۹	۳,۹۸۲	۳,۱۹۱	(۱۹.۹%)	۵۴.۱	-۰.۰۱	۱	(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



میلیارد تومان

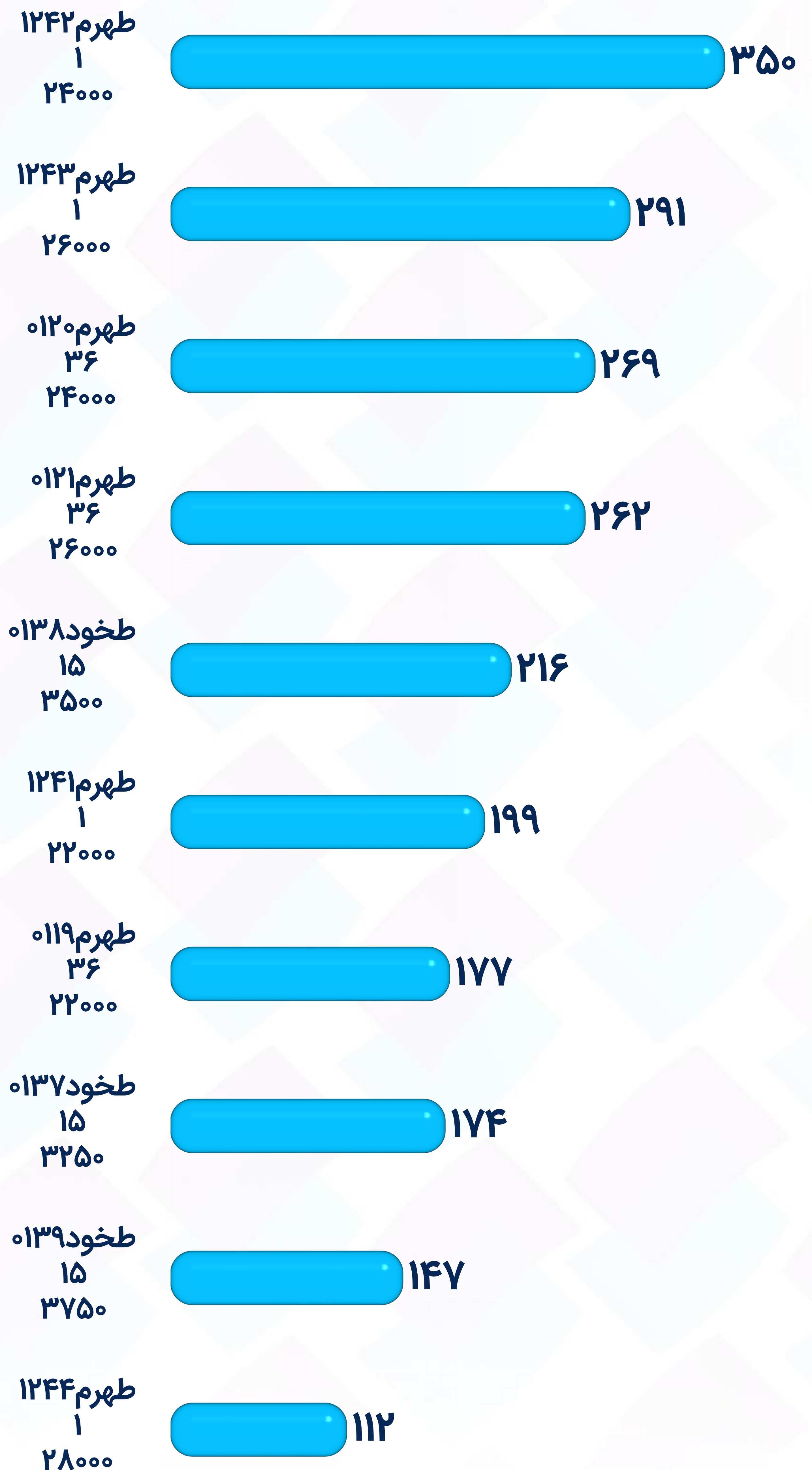
میلیون تومان

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

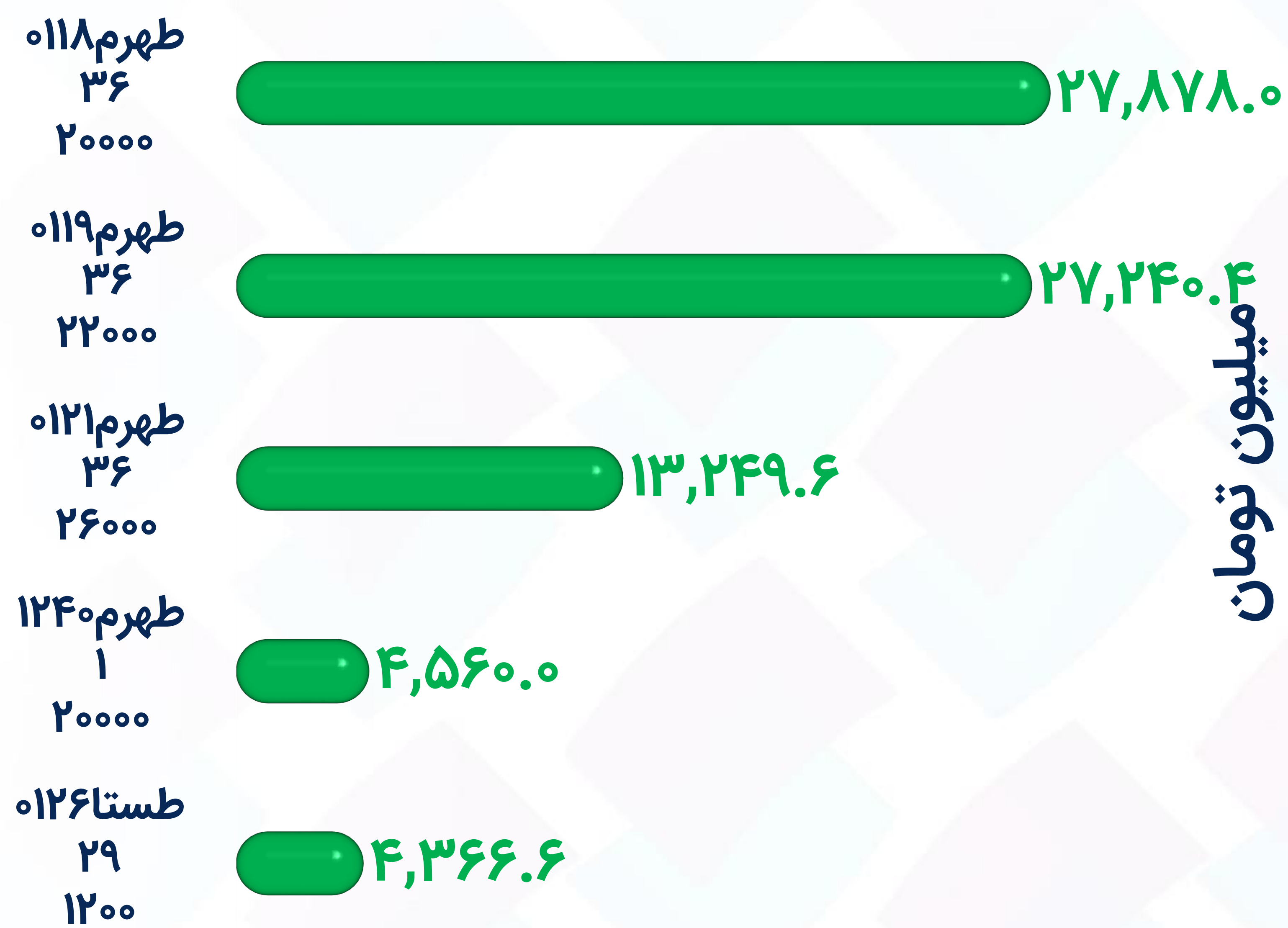
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

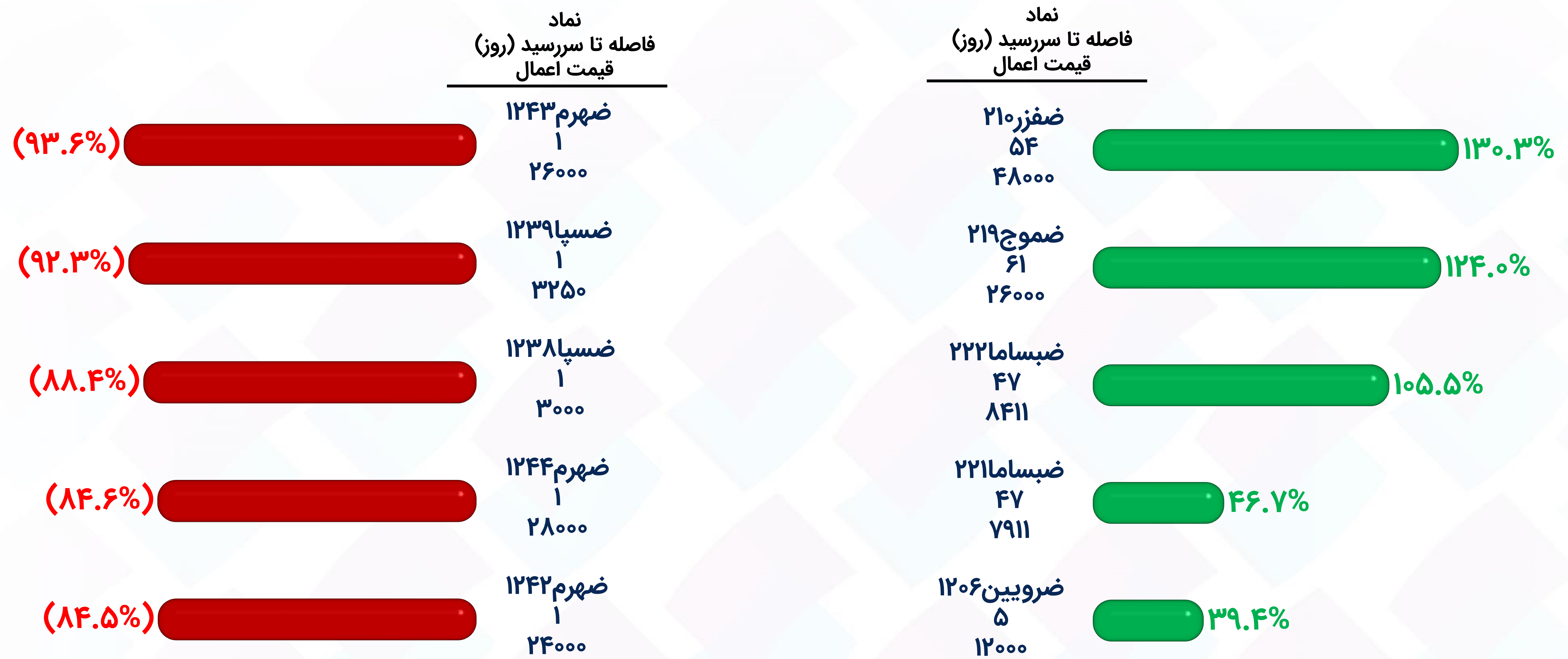
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.