

شماره
۴۴۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۲ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





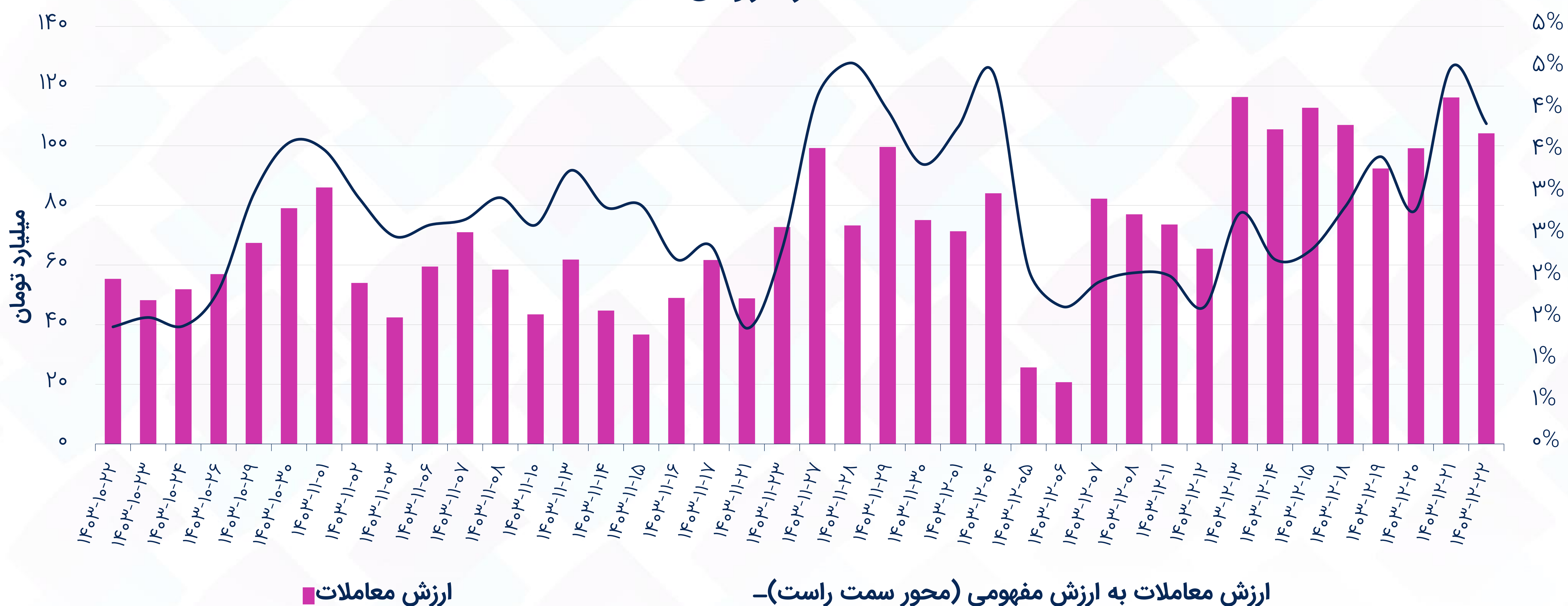
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



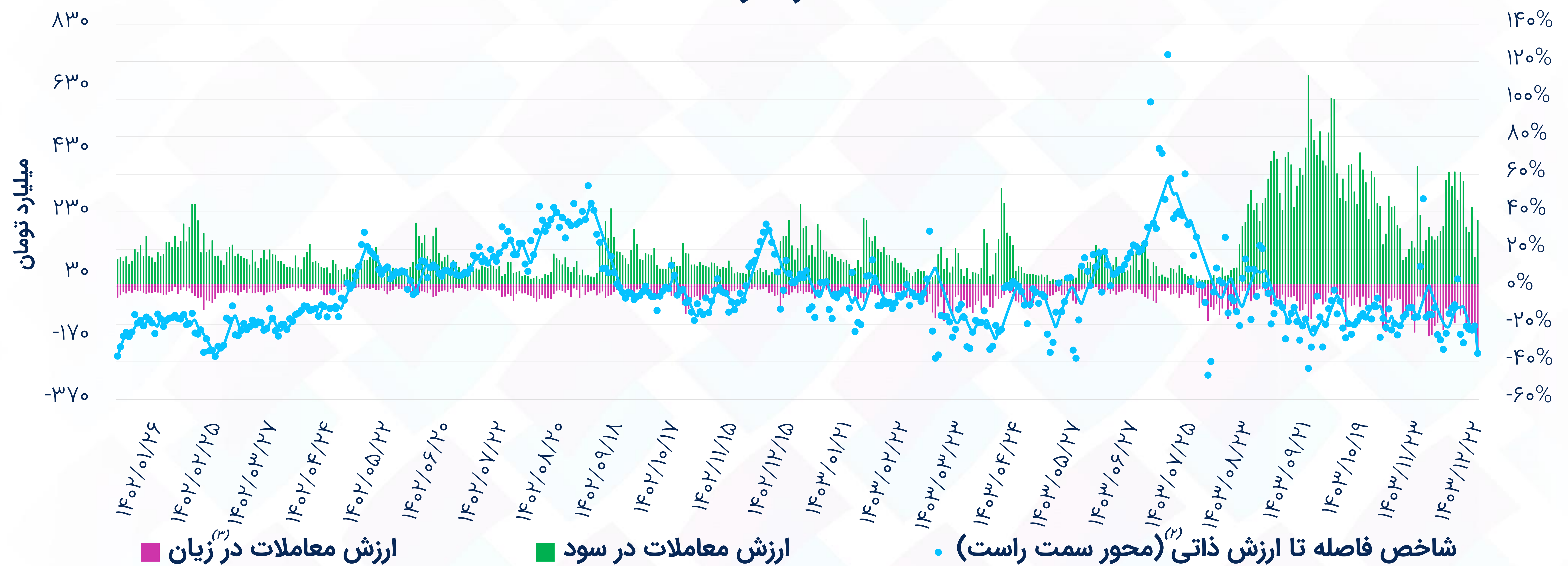
اختیار فروش



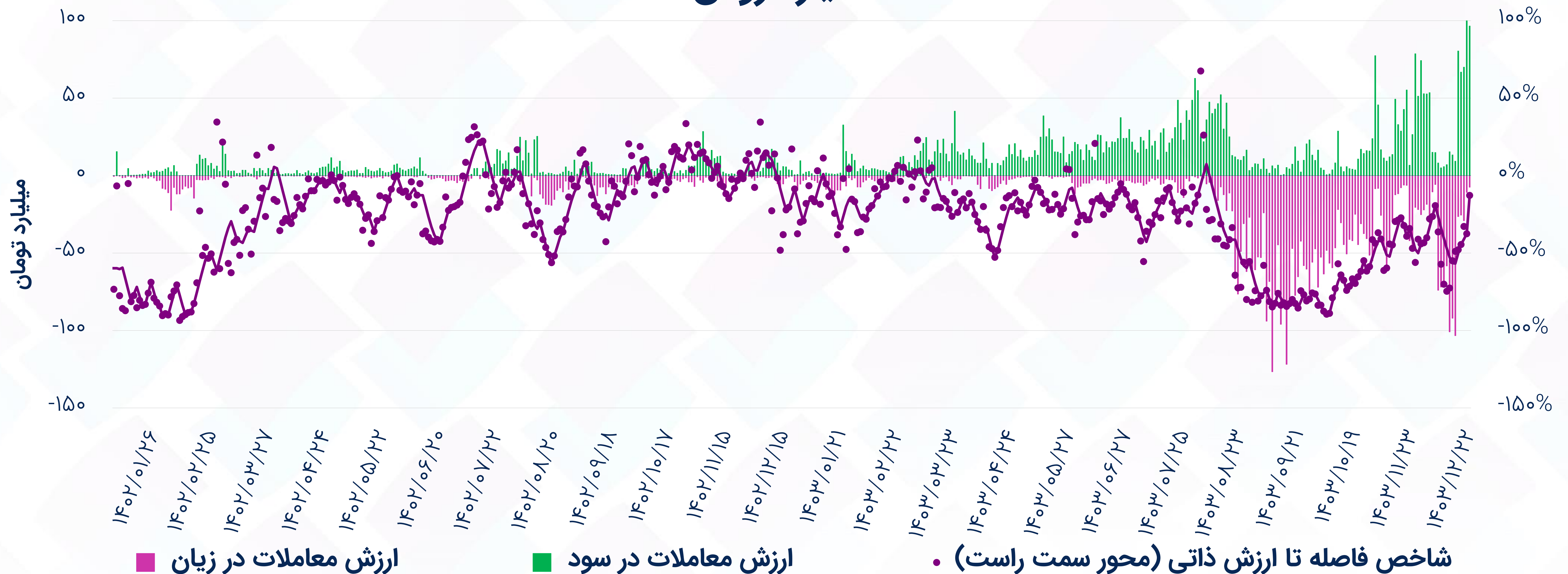
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۵۲	۲۷۸.۰	۹,۸۲۵.۲	۷۳.۷	۲۰۴.۳	(۵۰.۱%)
خودرو	۳۵	۴۷.۹	۱,۲۱۸.۷	۳۶.۷	۱۱.۲	۱.۳%
فملی	۸	۳۴.۱	۱۱۰.۰	۳۳.۹	۰.۱	(۵.۸%)
آساس	۱۰	۲۶.۱	۸۶.۸	۲۶.۱	۰.۰	۰.۳%
شستا	۴۰	۱۸.۲	۳۶۹.۵	۴.۵	۱۳.۷	(۶۲.۵%)
ذوب	۲۳	۱۵.۳	۱۳۹.۳	۱۳.۳	۲.۰	(۲۸.۸%)
خسپا	۲۳	۹.۲	۲۹۱.۹	۸.۷	۰.۵	۳۵.۴%

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	۹۷,۸۲۶.۱	۲,۲۰۵,۹۱۵.۶	۹۴,۴۴۲.۹	۳,۳۸۳.۲	(۱۰.۷%)
خودرو	۱۰	۴,۲۲۰.۷	۴۳۵,۴۴۷.۹	۴۴۱.۳	۳,۷۷۹.۴	(۴۸.۵%)
شستا	۴	۲,۰۴۶.۳	۷۱,۸۵۶.۵	۱,۶۶۰.۸	۳۸۵.۴	(۳۹.۰%)
ذوب	۳	۲۴.۲	۱,۰۳۶.۳	۲۲.۱	۲.۱	(۸.۵%)
اطلس	۲	۱۷.۰	۲۵۹.۳	۱۷.۰	۰.۰	۳۳.۲%
وبملت	۲	۱۶.۳	۷۶۳.۷	۰.۰	۱۶.۳	(۷۵.۴%)
خودران	۱	۴.۶	۳۹.۲	۴.۶	۰.۰	(۲۶.۹%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۶۳۷,۶۶۵

شستا ۱۰۲,۴۳۲

فملی ۵۷,۷۱۵

ذوب ۴۷,۷۸۲

شپنا ۴,۱۷۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

آساس (۳۷,۴۶۵.۶)

فولاد (۱۰,۲۷۹.۵)

خودرو (۱,۱۸۵.۰)

تیام (۷۵۳.۶)

ثمین (۴۷.۰)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۷,۶۵۴

شستا ۲,۱۹۴

خودرو ۱,۵۸۸

ذوب ۹۳۵

وبملت ۶۰۹

خسپا ۳۰۱

آساس ۲۷۶

فملی ۱۸۷

شتاب ۱۳۷

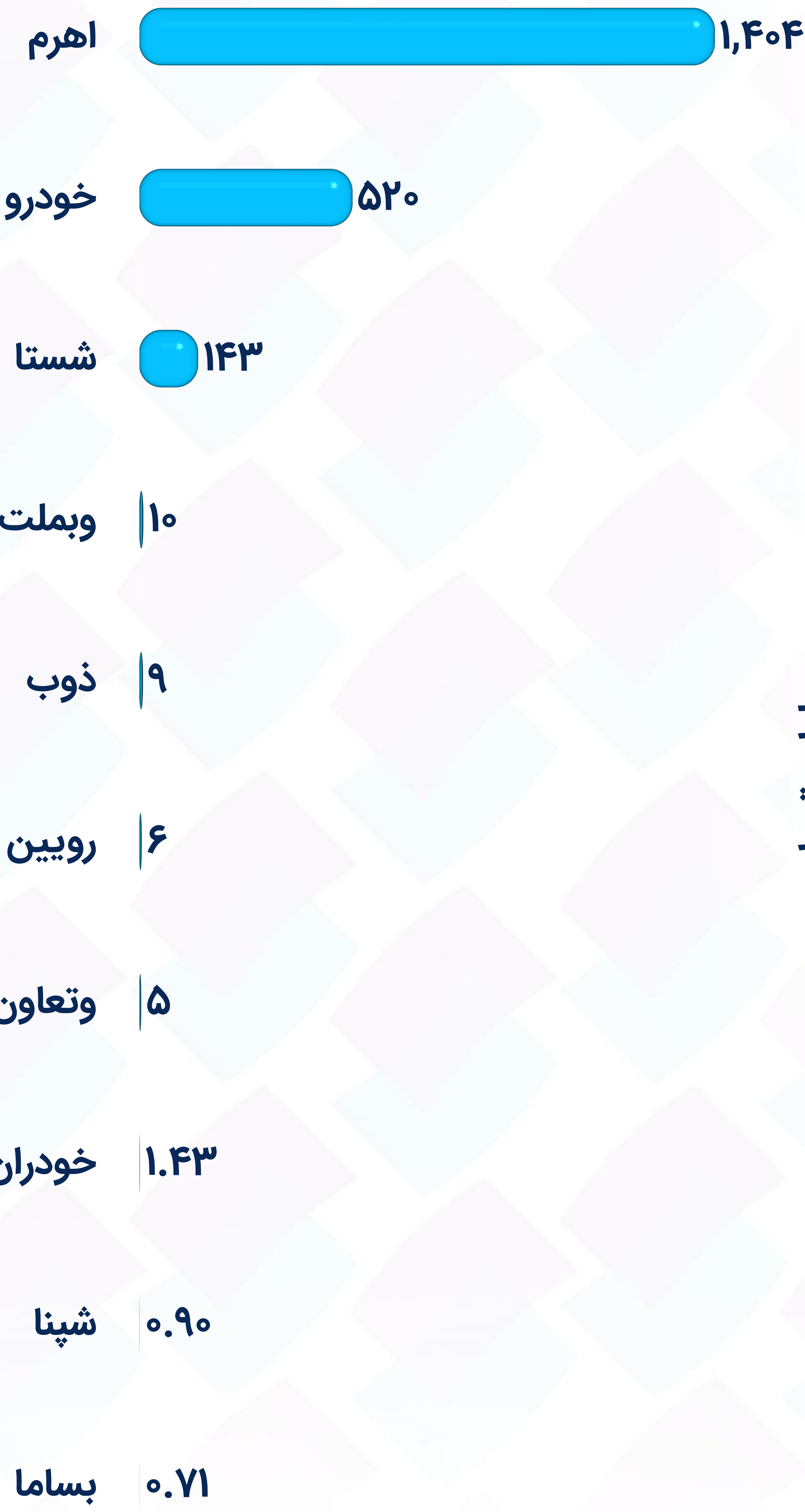
شپنا ۱۱۶

میلیارد تومان

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

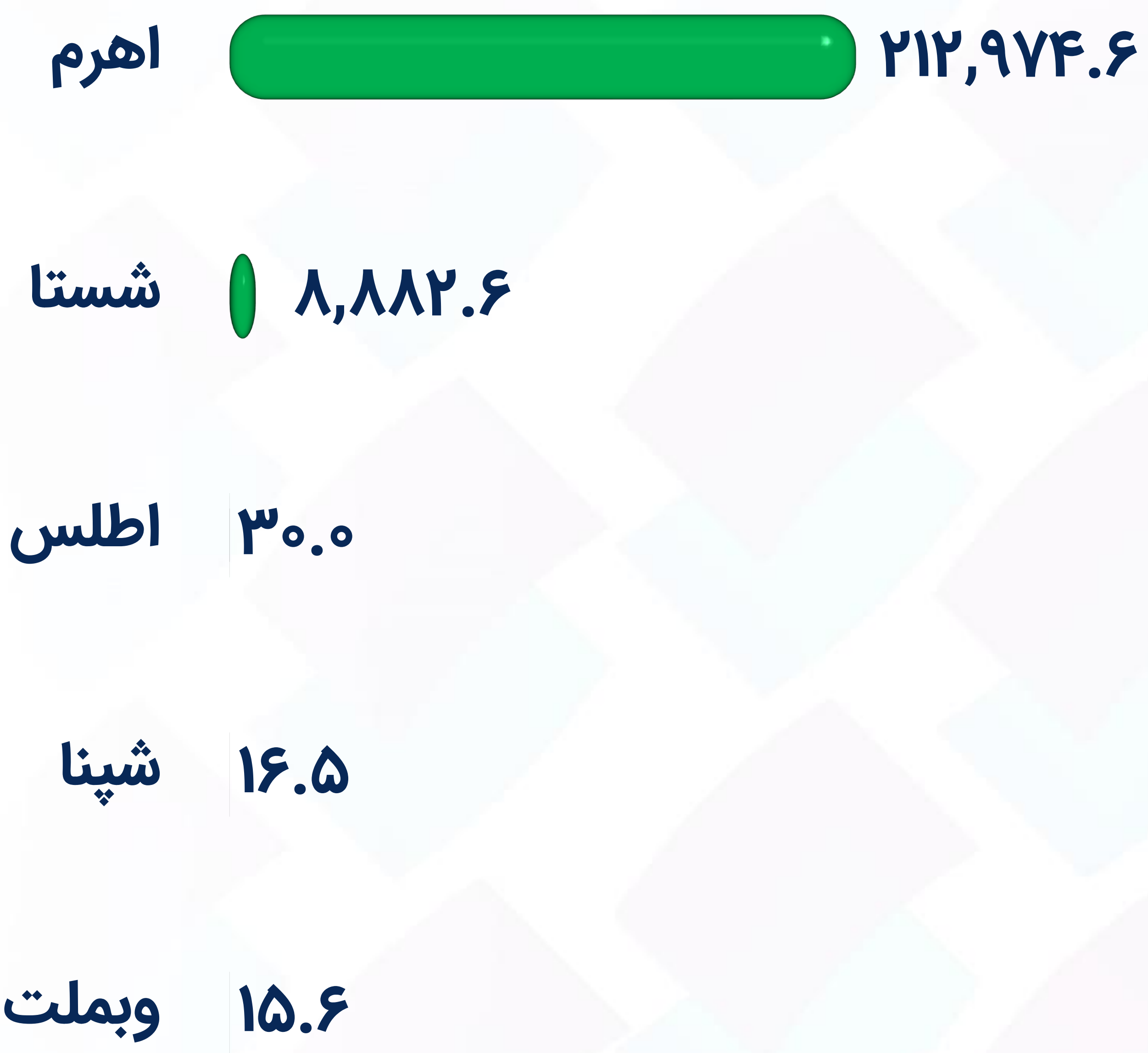
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



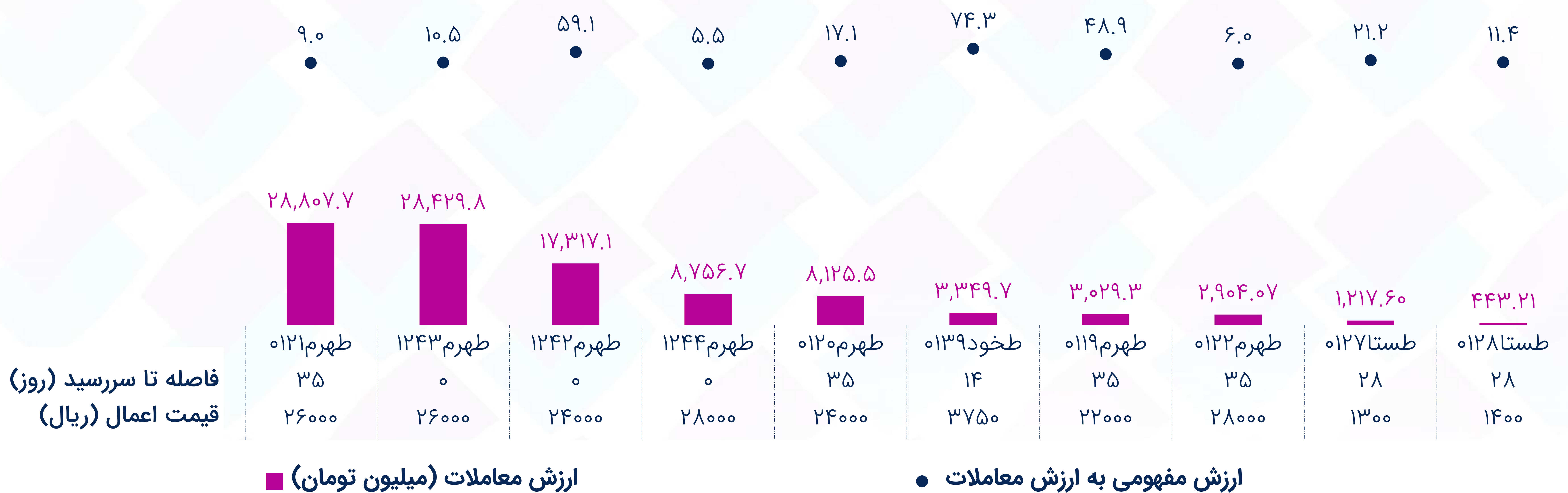
میلیون تومان

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	۴	۲۸.۸	۴۵۹	۴۵,۲۲۳	۴۵,۴۵۹	۰.۵%	۹۹.۰	۰.۶۴	۷۱۵	۵۶%
ضپناه ۱۰۴	پناه	۱۴,۰۰۰	۳۲	۵.۲	۳۴۷	۱۴,۱۳۴	۱۴,۳۴۷	۱.۵%	۴۱.۳	۰.۷۷	۵۳۹	۵۵%
ضخود ۲۰۵۲	خودرو	۲,۴۰۰	۴۲	۲.۰	۱,۱۸۸	۳,۸۶۵	۳,۵۸۸	(۷.۲%)	۳.۰	۱.۰۰	۱,۵۴۷	۳۰%
ضرویین ۱۲۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۴	۳.۱	۹۴۴	۱۲,۱۳۳	۱۱,۹۴۴	(۱.۶%)	۱۲.۷	۱.۰۰	۱,۱۸۱	۲۵%
ضفلا ۰۱۱۱	فولاد	۲,۱۶۰	۲۸	۲۰.۸	۱,۵۰۰	۳,۹۲۲	۳,۶۶۰	(۶.۷%)	۲.۴	۱.۰۰	۱,۸۰۵	۲۰%

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
ضتیام ۱۲۰۷	تیام	۱۵,۰۰۰	۴	۱۸.۵	۳۷۰	۱۲,۸۲۷	۱۵,۳۷۰	۲۰%	۴۱.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۲۸	۲.۱	۳	۴۲۴	۷۰۳	۶۶%	۲۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۱۴	۱۱.۰	۵	۳,۸۶۵	۵,۰۰۵	۲۹%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۴۹	۳.۱	۳۱	۱,۲۷۴	۱,۹۳۱	۵۲%	۶۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲۸	۱۰۲.۸	۵	۱,۲۷۴	۱,۷۰۵	۳۴%	۳۴۱.۰	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
طاطلس ۲۰۶	اطلس	۶۵,۰۰۰	۴۶	۱۵.۵	۳,۸۷۵	۵۷,۶۱۵	۶۱,۱۲۵	۶.۱%	۱۵.۸	-۰.۸۳	۵,۴۰۸	۳۹.۶%
طخود ۱۴۱	خودرو	۴,۵۰۰	۱۴	۱۲.۷	۶۲۶	۳,۸۶۵	۳,۸۷۴	۰.۲%	۶.۲	-۱.۰۰	۵۹۰	(۵.۸%)
طهرم ۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۵	۲,۹۰۴.۱	۳,۹۳۹	۲۳,۶۴۰	۲۴,۰۶۱	۱.۸%	۶.۱	-۰.۹۱	۳,۶۹۴	(۶.۲%)
طستا ۱۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۲۸	۴۴۳.۲	۱۱۲	۱,۲۷۴	۱,۲۸۸	۱.۱%	۱۱.۵	-۰.۸۶	۱۰۴	(۷.۲%)
طهرم ۲۰۱۷	اهرم	۲۶,۰۰۰	۷۰	۱۳.۸	۲,۳۷۹	۲۳,۶۴۰	۲۳,۶۲۱	(۰.۱%)	۹.۹	-۰.۵۵	۱,۸۷۹	(۲۱.۰%)

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 ۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۱۴	۰.۸	۲	۳,۸۶۵	۲,۷۹۸	(۲۷.۶%)	۱,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۱۴	۱۳.۲	۵	۳,۸۶۵	۲,۹۹۵	(۲۲.۵%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طوتعاون ۱۰۵	وتعاون	۱,۲۰۰	۳۲	۲.۰	۱۰	۱,۵۵۷	۱,۱۹۰	(۲۳.۶%)	۱۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۳۵	۰.۵	۴۵۷	۲۳,۶۴۰	۱۷,۵۴۳	(۲۵.۸%)	۳۸.۴	۰.۰۰	۱	(۹۹.۸%)
طخود ۱۳۷	خودرو	۳,۲۵۰	۱۴	۵۷.۷	۵	۳,۸۶۵	۳,۲۴۵	(۱۶.۰%)	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)

(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)

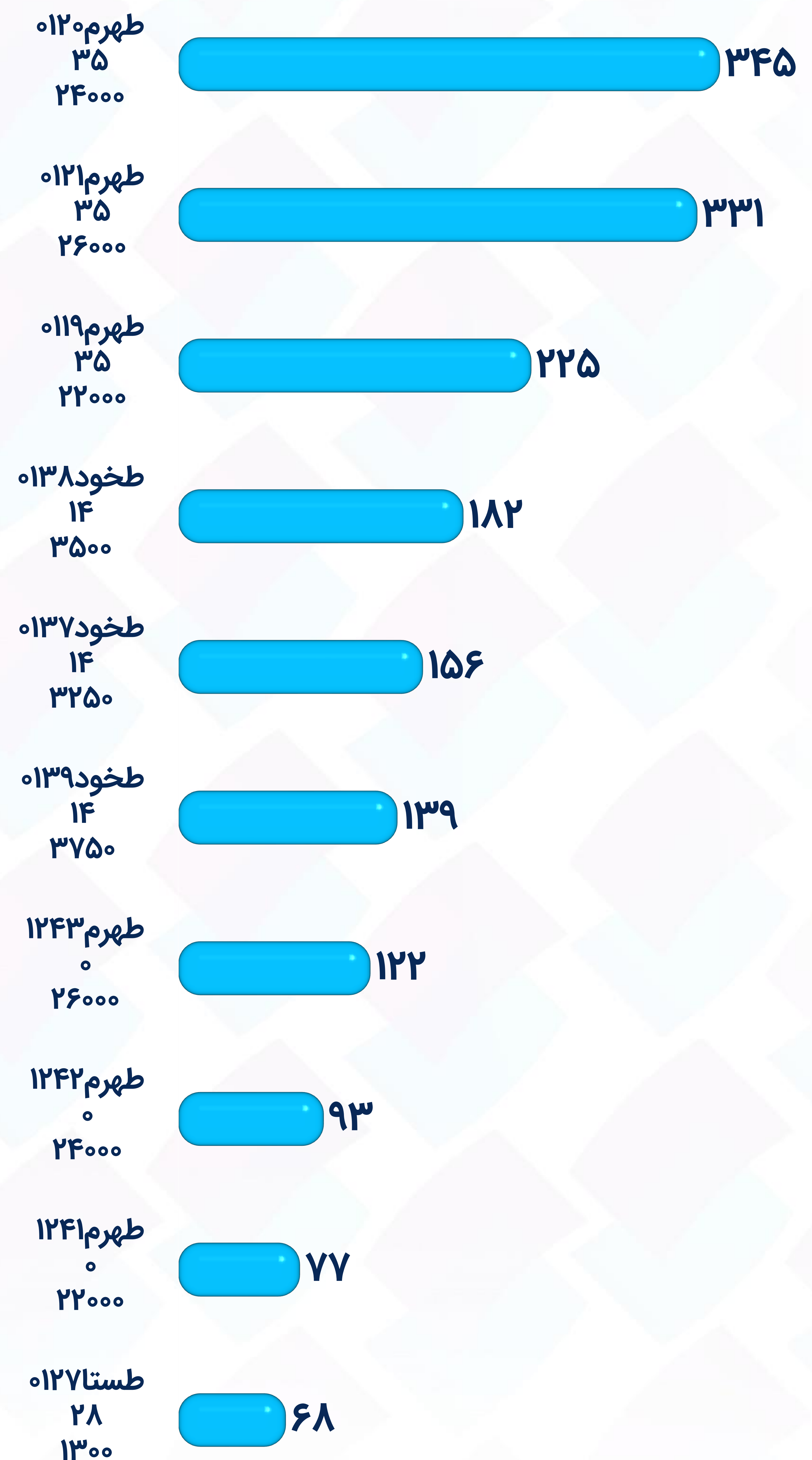


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

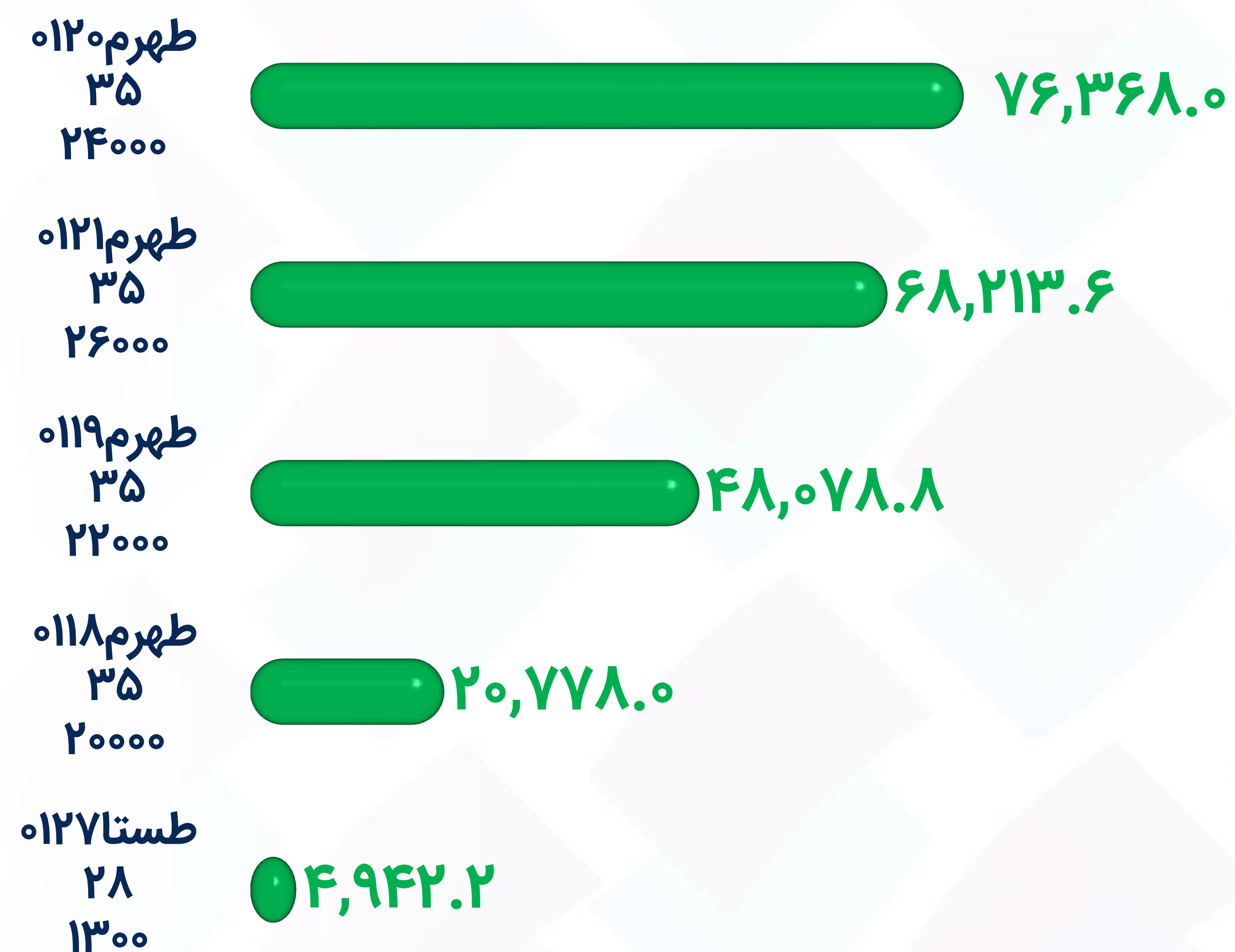
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

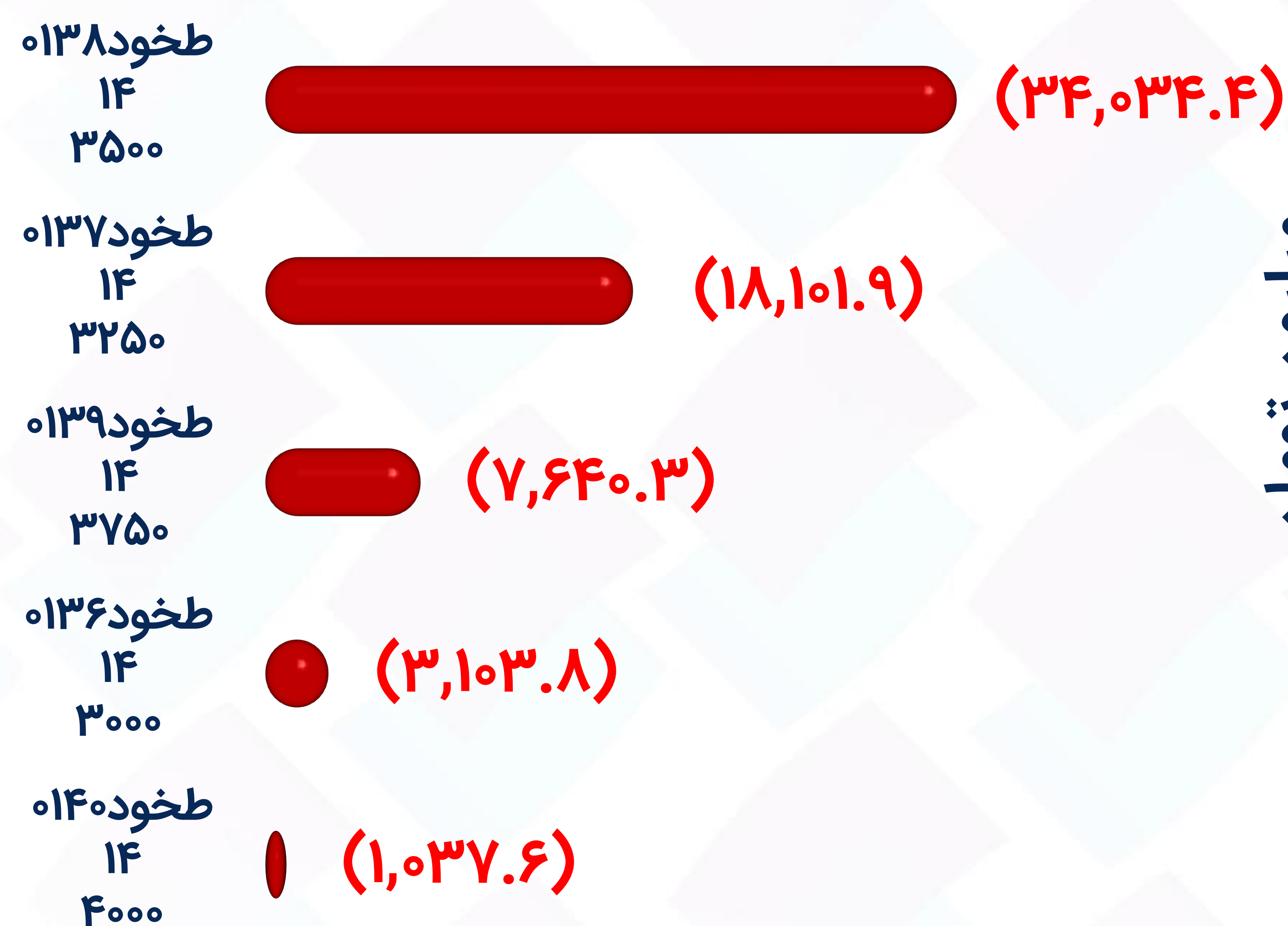
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

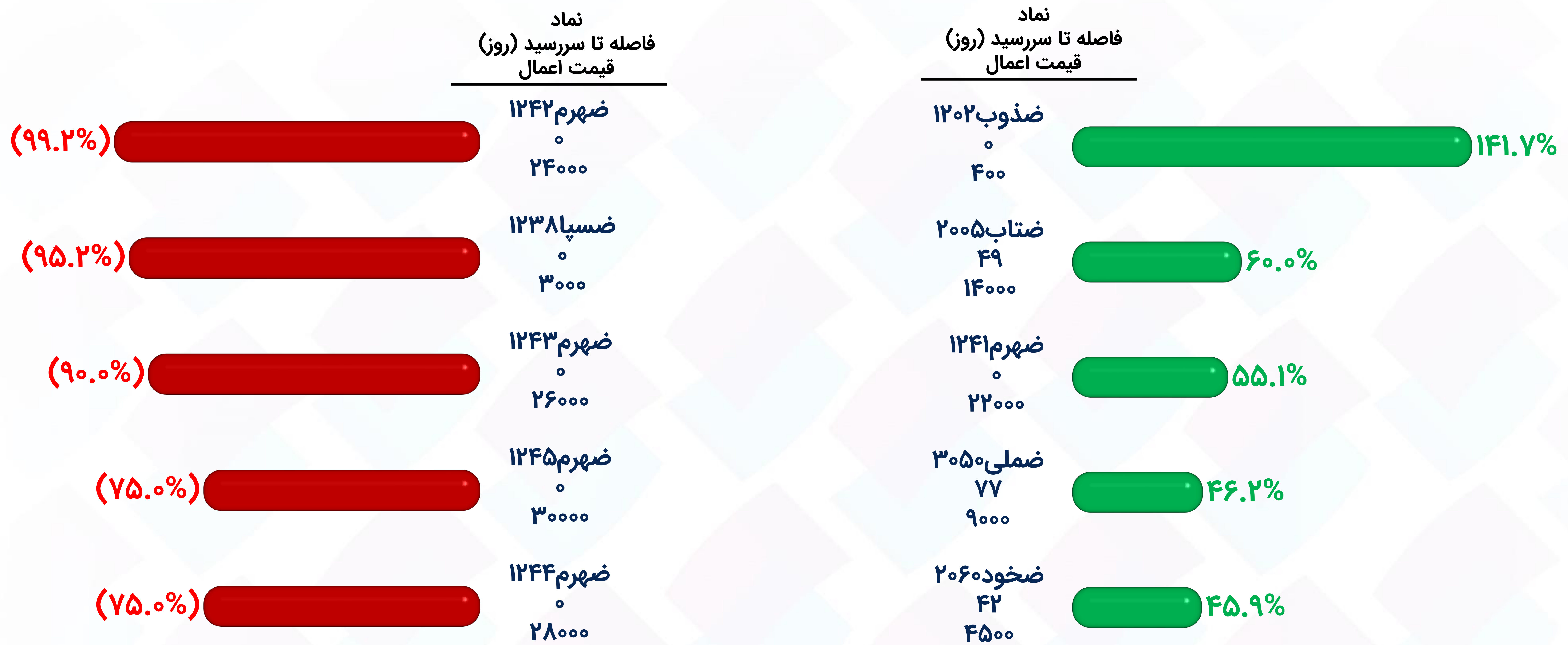
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



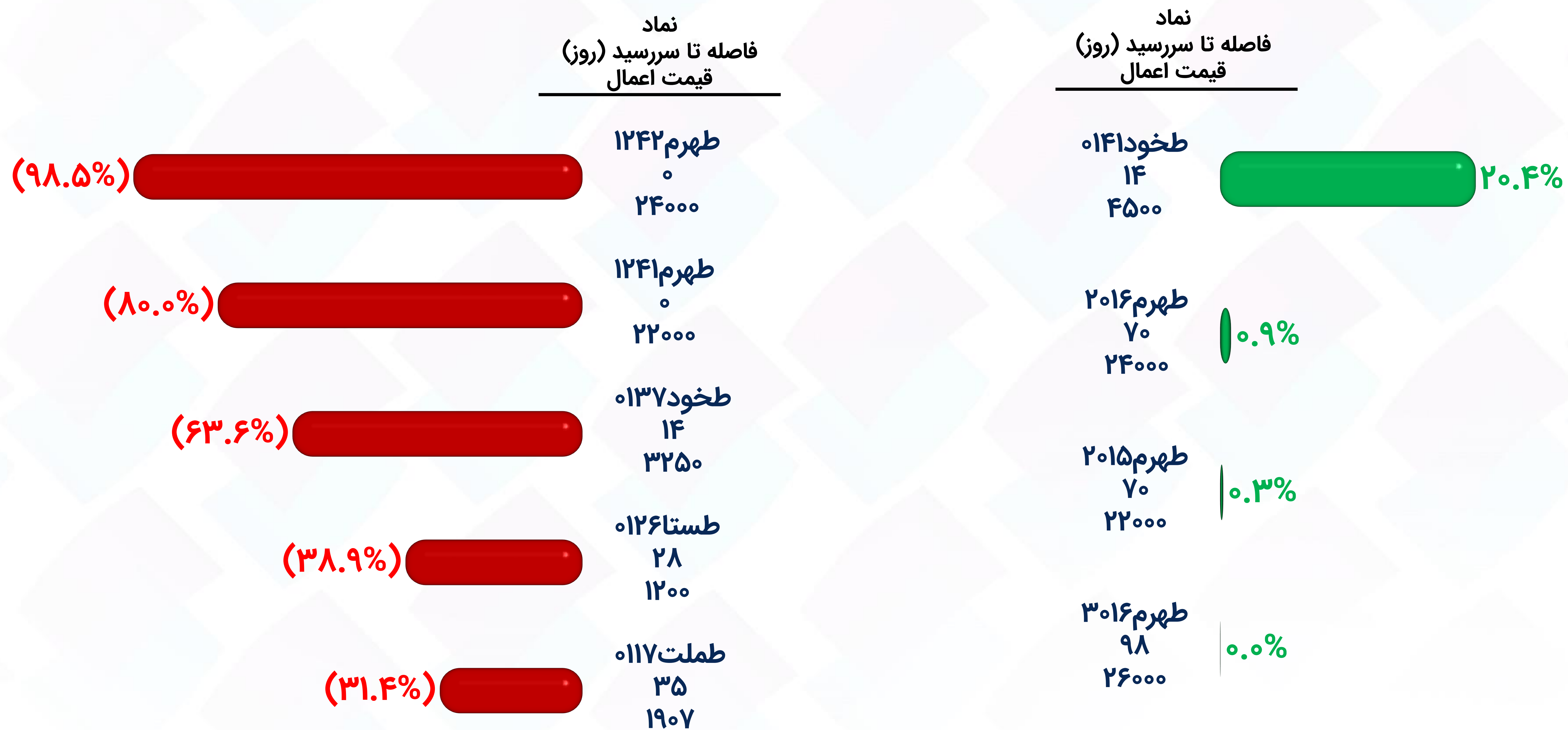
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

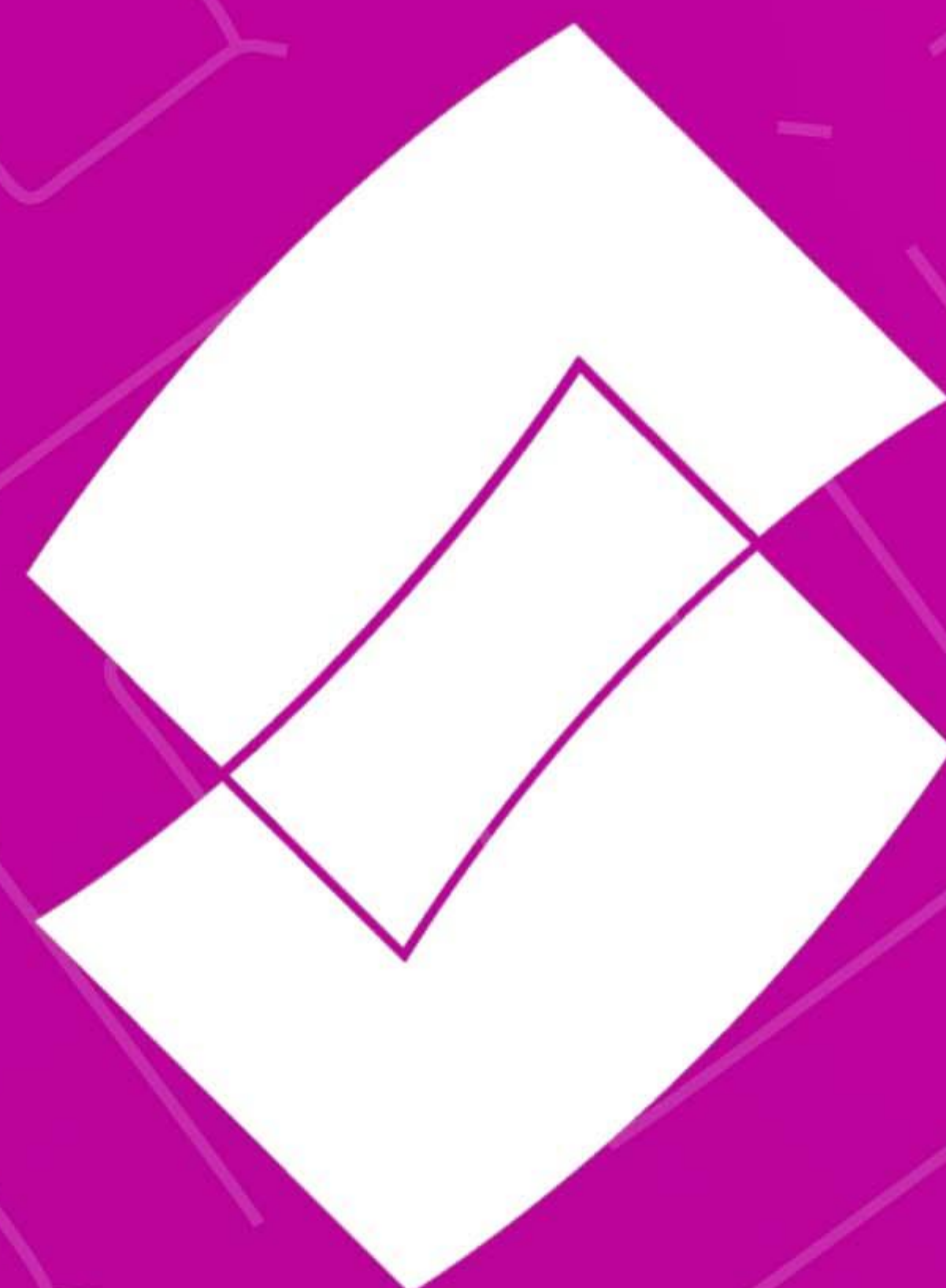
اختیار خرید



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.