

شماره
۴۴۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۵ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





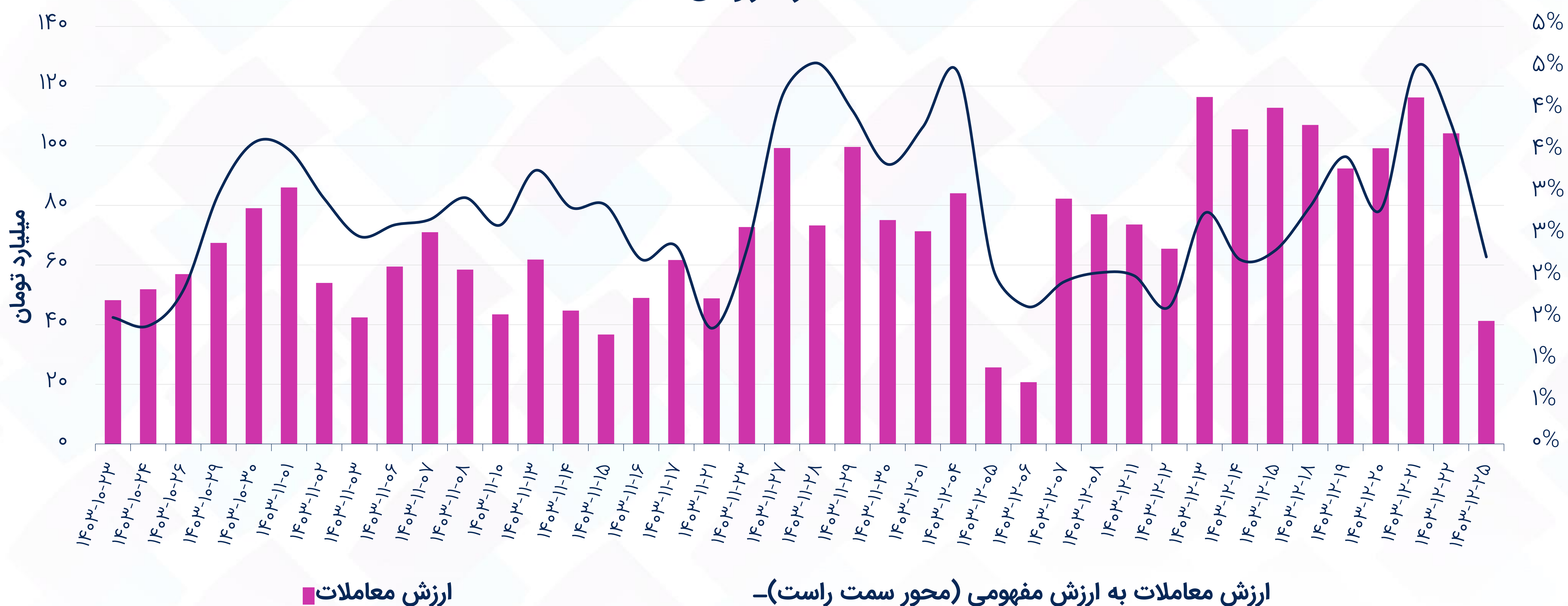
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



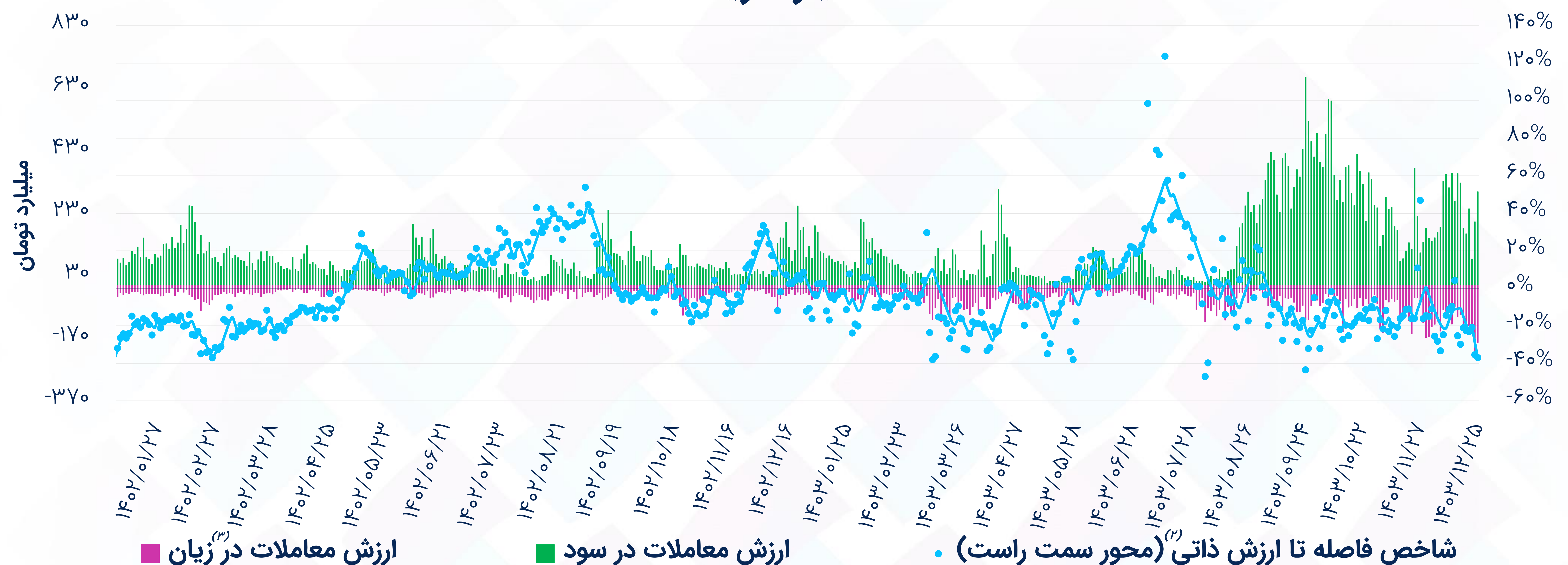
اختیار فروش



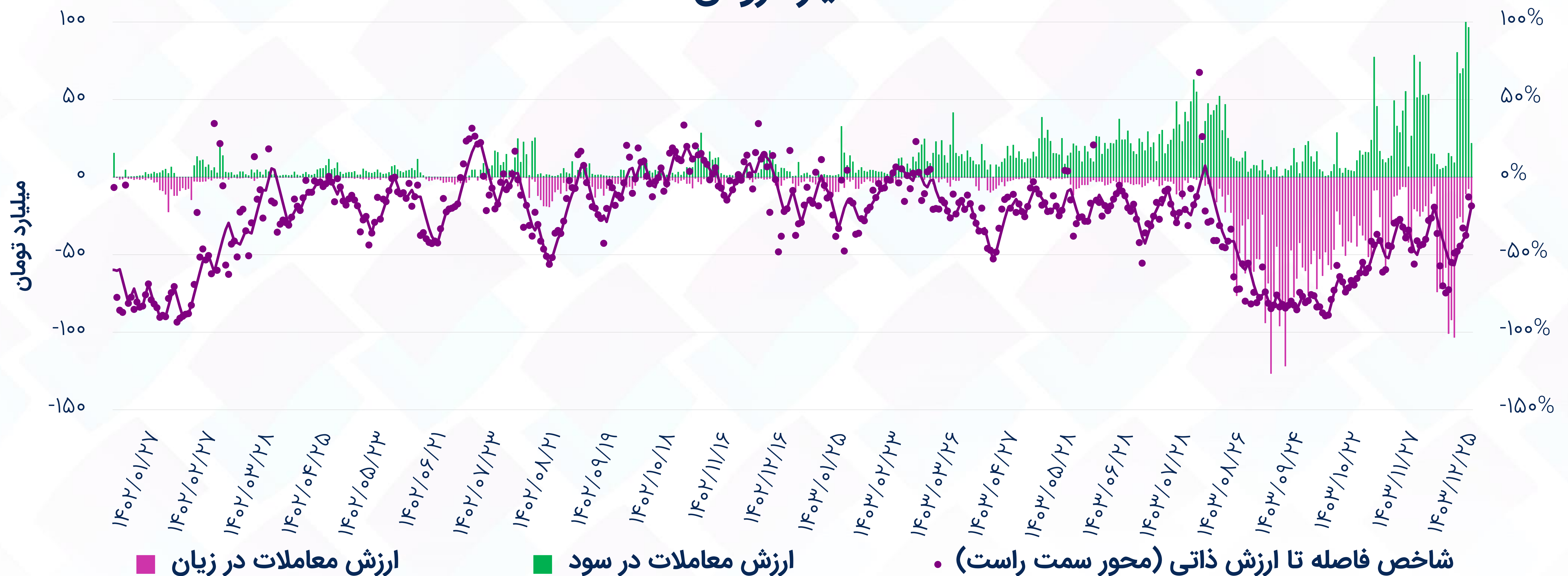
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

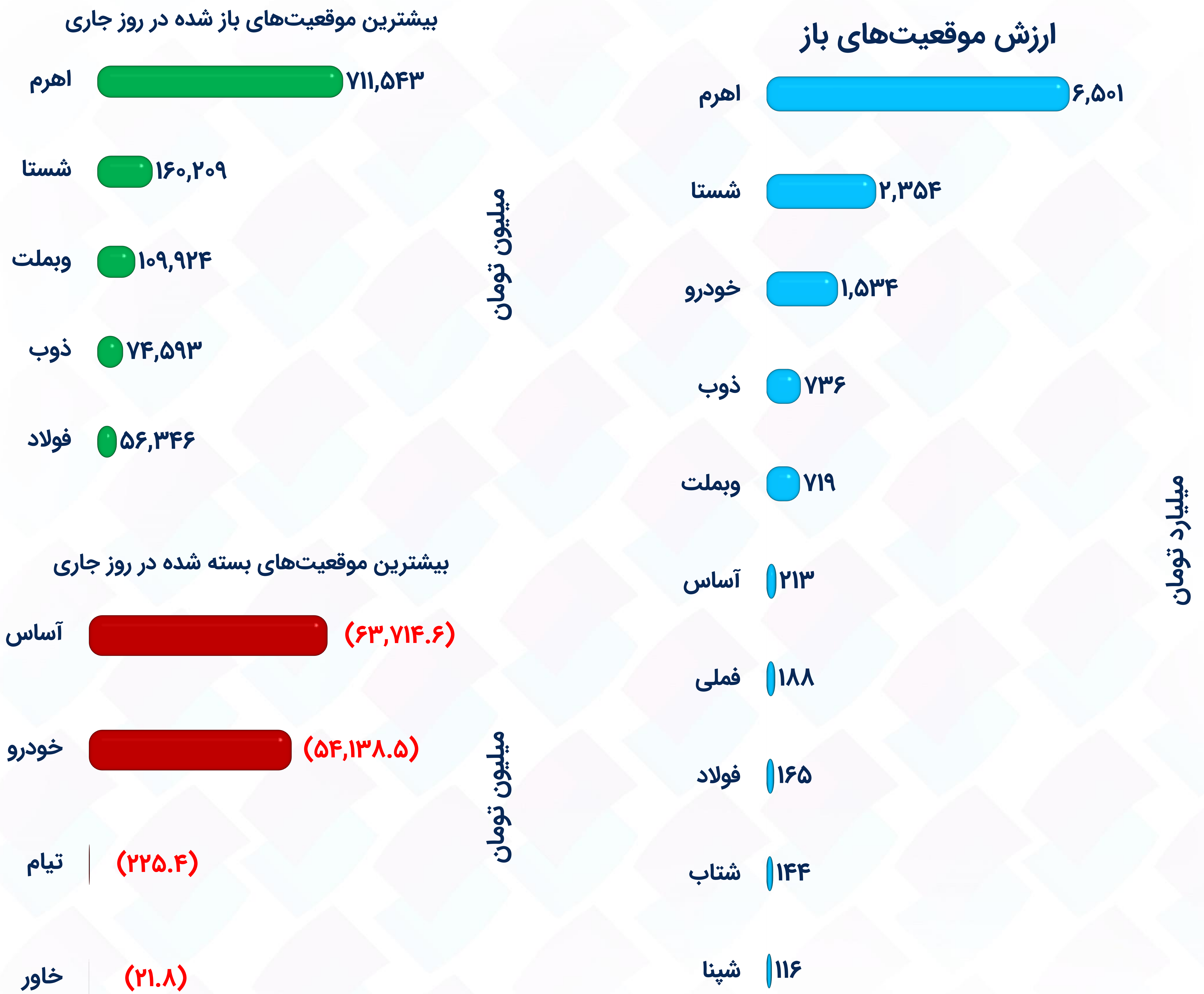
اختیار خرید

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	۴۰	۲۷۲.۷	۳,۱۳۵.۳	۱۲۸.۸	۱۴۳.۹	(۵۶.۱%)
خودرو	۳۸	۵۳.۹	۱,۵۶۶.۴	۴۴.۰	۹.۹	۲۰.۴%
آساس	۱۰	۴۴.۳	۱۲۳.۴	۴۴.۲	۰.۱	۰.۵%
شستا	۴۲	۳۱.۸	۵۳۸.۷	۱۵.۰	۱۶.۸	(۶۰.۳%)
فولاد	۱۲	۲۹.۷	۸۷.۸	۲۹.۴	۰.۳	(۳.۳%)
وبملت	۲۲	۲۱.۵	۱۸۷.۱	۱۸.۹	۲.۷	(۲۴.۷%)
ذوب	۲۴	۱۸.۲	۱۶۶.۷	۱۱.۷	۶.۵	(۵۳.۲%)

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	۱۱	۳۵,۸۷۹.۵	۱,۰۷۷,۶۷۵.۶	۲۰,۲۰۹.۲	۱۵,۶۷۰.۴	(۱۷.۷%)
خودرو	۱۰	۲,۸۰۱.۱	۶۵۴,۴۰۱.۱	۶۶۴.۶	۲,۱۳۶.۵	(۱۸.۰%)
شستا	۵	۲,۳۰۲.۶	۹۳,۹۸۵.۰	۷۸۶.۴	۱,۵۱۶.۲	(۳۲.۶%)
بساما	۲	۱۹۳.۱	۸,۴۷۳.۰	۱۵۸.۳	۳۴.۸	(۹.۰%)
وبملت	۲	۳۲.۸	۳,۰۲۴.۴	۰.۰	۳۲.۸	(۷۷.۷%)
ذوب	۲	۲۱.۶	۱۵۷.۴	۲۱.۶	۰.۰	(۷.۴%)
خودران	۱	۱۰.۰	۱۰۰.۸	۱۰.۰	۰.۰	(۳۰.۲%)

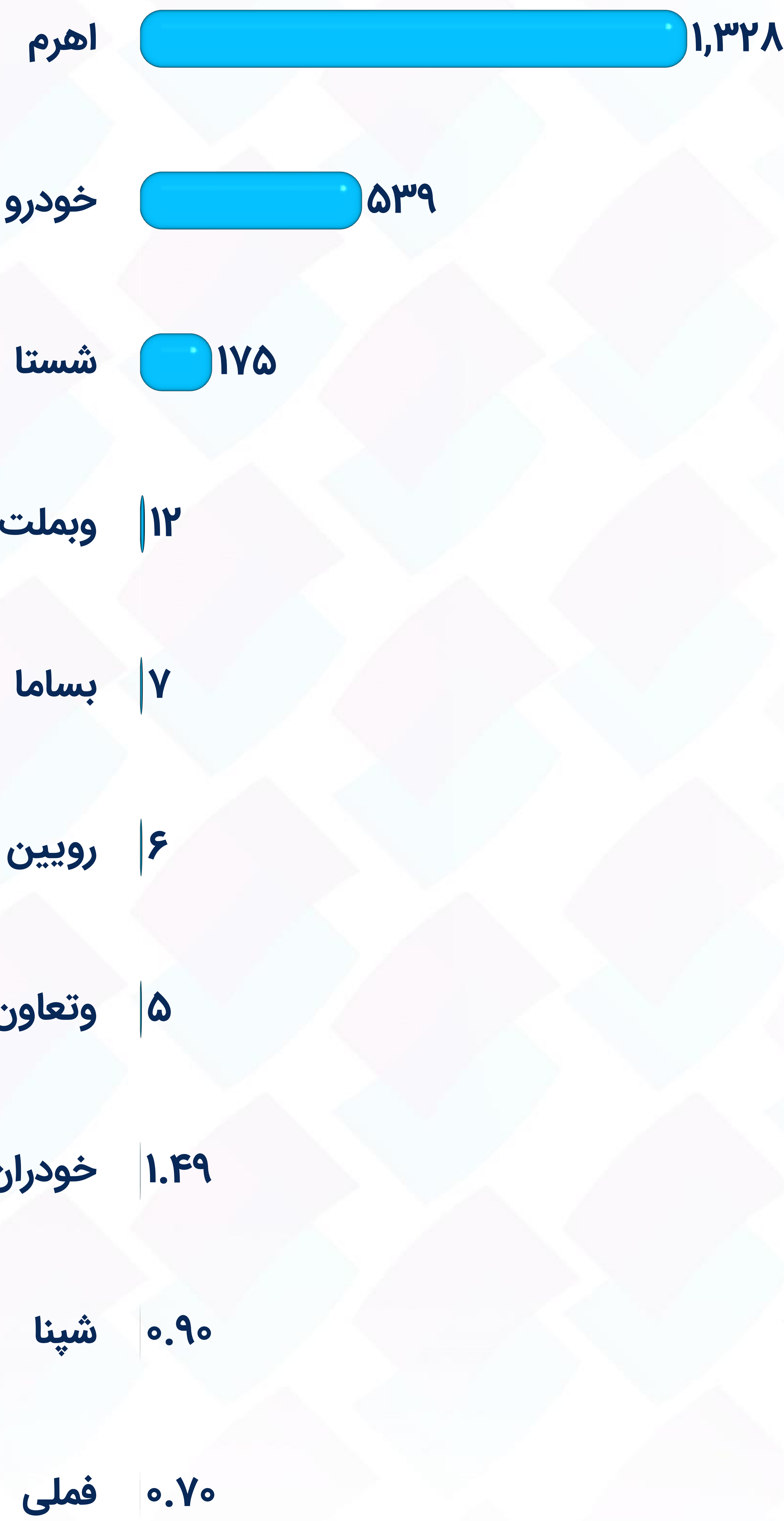
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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
ضسپا ۲۰۱۷	خسپا	۳,۰۰۰	۶۷	۱.۱	۱۰۵	۲,۹۷۵	۳,۱۰۵	۴.۴%	۲۹.۶	۰.۶۹	۲۴۰	۱۲۹%
ضخود ۰۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۱	۷,۵۳۸.۹	۳۱	۳,۹۱۴	۴,۰۳۱	۳.۰%	۱۳۰.۰	۰.۴۱	۵۷	۸۳%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۴۳	۷۵۵.۲	۲,۶۶۷	۹,۱۴۰	۸,۰۸۰	(۱۱.۶%)	۳.۰	۱.۰۰	۳,۹۲۱	۴۷%
ضخود ۰۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۱۱	۵,۶۲۲.۶	۱۵۰	۳,۹۱۴	۳,۹۰۰	(۰.۴%)	۲۶.۰	۰.۸۵	۲۱۲	۴۲%
ضتیام ۴۰۷	تیام	۱۵,۰۰۰	۱۲۷	۶.۸	۴۵۵	۱۳,۱۴۵	۱۵,۴۵۵	۱۷.۶%	۳۴.۰	۰.۴۸	۶۴۲	۴۱%

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	۲۵	۱.۲	۲	۴۳۶	۷۰۲	۶۱%	۳۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۱۱	۴.۹	۳	۳,۹۱۴	۵,۰۰۳	۲۸%	۱,۶۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۶۰	۶.۰	۹	۴۳۶	۸۰۹	۸۶%	۸۹.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهمن ۰۱۲۴	خبهمن	۲,۸۰۰	۳۲	۱.۰	۱۵	۱,۸۸۹	۲,۸۱۵	۴۹%	۱۸۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲۵	۱۰۲.۴	۴	۴۳۶	۶۰۴	۳۹%	۱۵۱.۰	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	۳۲	۲۳.۴	۴,۳۳۵	۲۴,۳۴۰	۲۵,۶۶۵	۵.۴%	۵.۹	-۰.۹۷	۴,۹۱۲	۱۳.۳%
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۲	۳,۵۵۷.۱	۲,۹۲۲	۲۴,۳۴۰	۲۵,۰۷۸	۳.۰%	۸.۶	-۰.۸۷	۳,۰۸۶	۵.۶%
طبساما ۲۲۴	بساما	۹,۴۱۱	۴۳	۱۵۸.۳	۲۲۴	۹,۱۴۰	۹,۱۸۷	۰.۵%	۴۱.۰	-۰.۴۴	۲۲۸	۱.۶%
طذوب ۰۱۱۴	ذوب	۵۰۰	۲۵	۲۱.۶	۶۰	۴۳۶	۴۴۰	۰.۹%	۷.۳	-۰.۹۳	۵۶	(۷.۴%)
طهرم ۰۱۲۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۳۲	۱۶,۶۰۸.۲	۱,۶۷۸	۲۴,۳۴۰	۲۴,۳۲۲	(۰.۱%)	۱۴.۵	-۰.۶۴	۱,۵۴۱	(۸.۱%)

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
طستا ۰۱۲۰	شستا	۶۰۰	۲۵	۰.۰	۳	۱,۳۱۲	۵۹۷	(۵۴.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۰۱۱۱	ذوب	۲۰۰	۲۵	۰.۰	۲	۴۳۶	۱۹۸	(۵۴.۶%)	۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۵	خودرو	۲,۸۰۰	۱۱	۳.۱	۱	۳,۹۱۴	۲,۷۹۹	(۲۸.۵%)	۲,۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۰۱۳۶	خودرو	۳,۰۰۰	۱۱	۱۵.۲	۳	۳,۹۱۴	۲,۹۹۷	(۲۳.۴%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طوتعاون ۱۰۵	وتعاون	۱,۲۰۰	۲۹	۷.۰	۱۰	۱,۶۰۲	۱,۱۹۰	(۲۵.۷%)	۱۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

(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

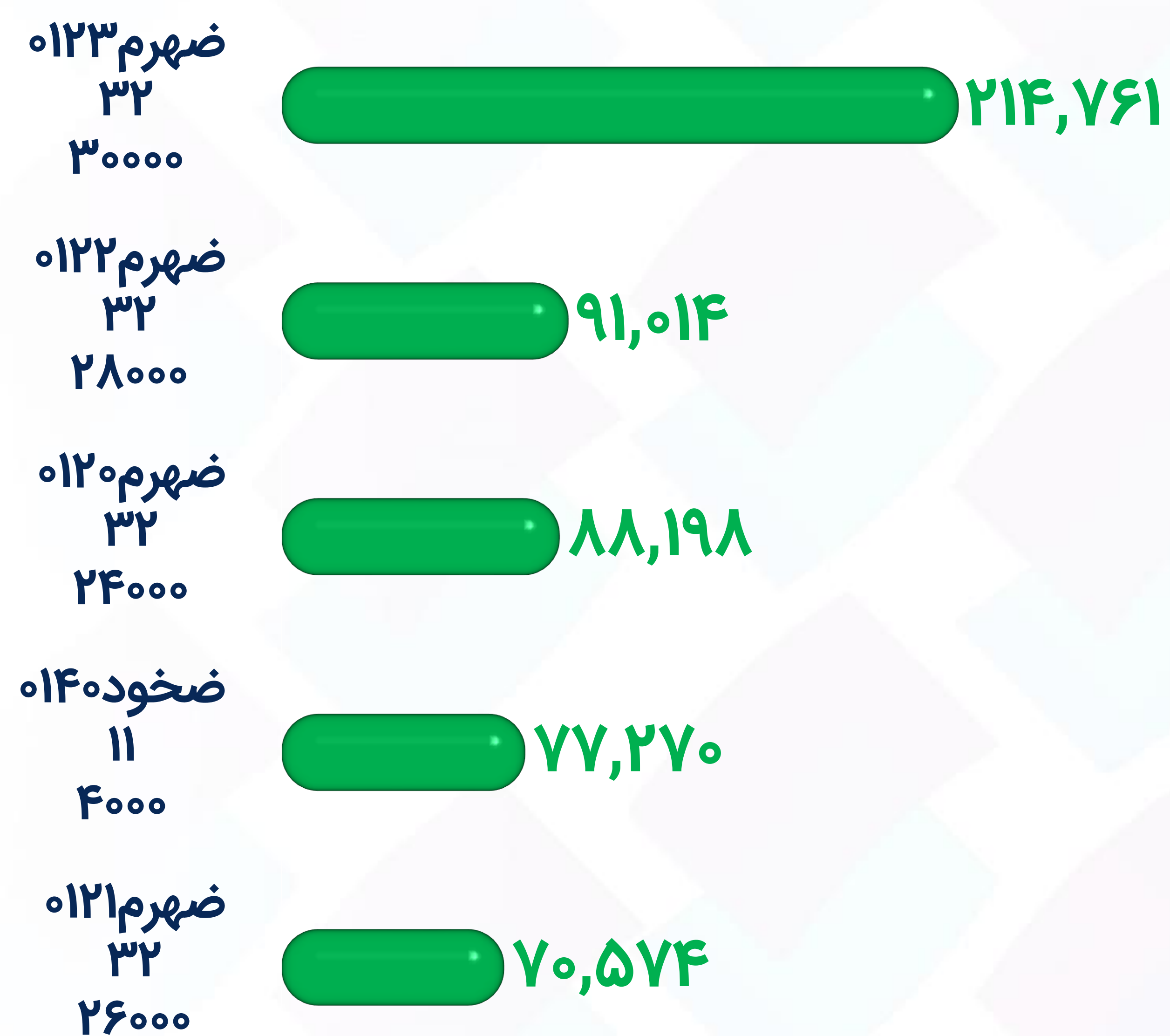
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

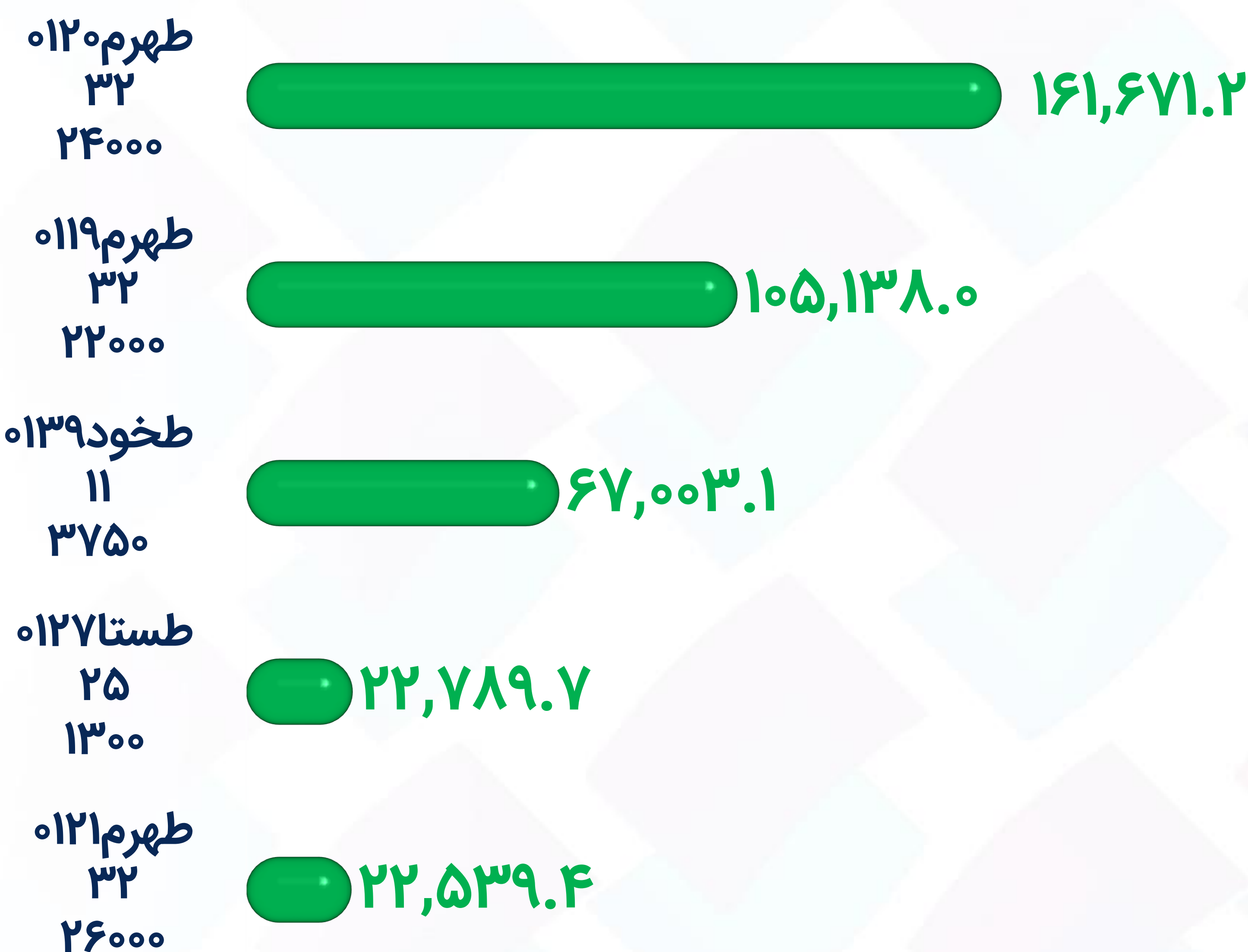
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

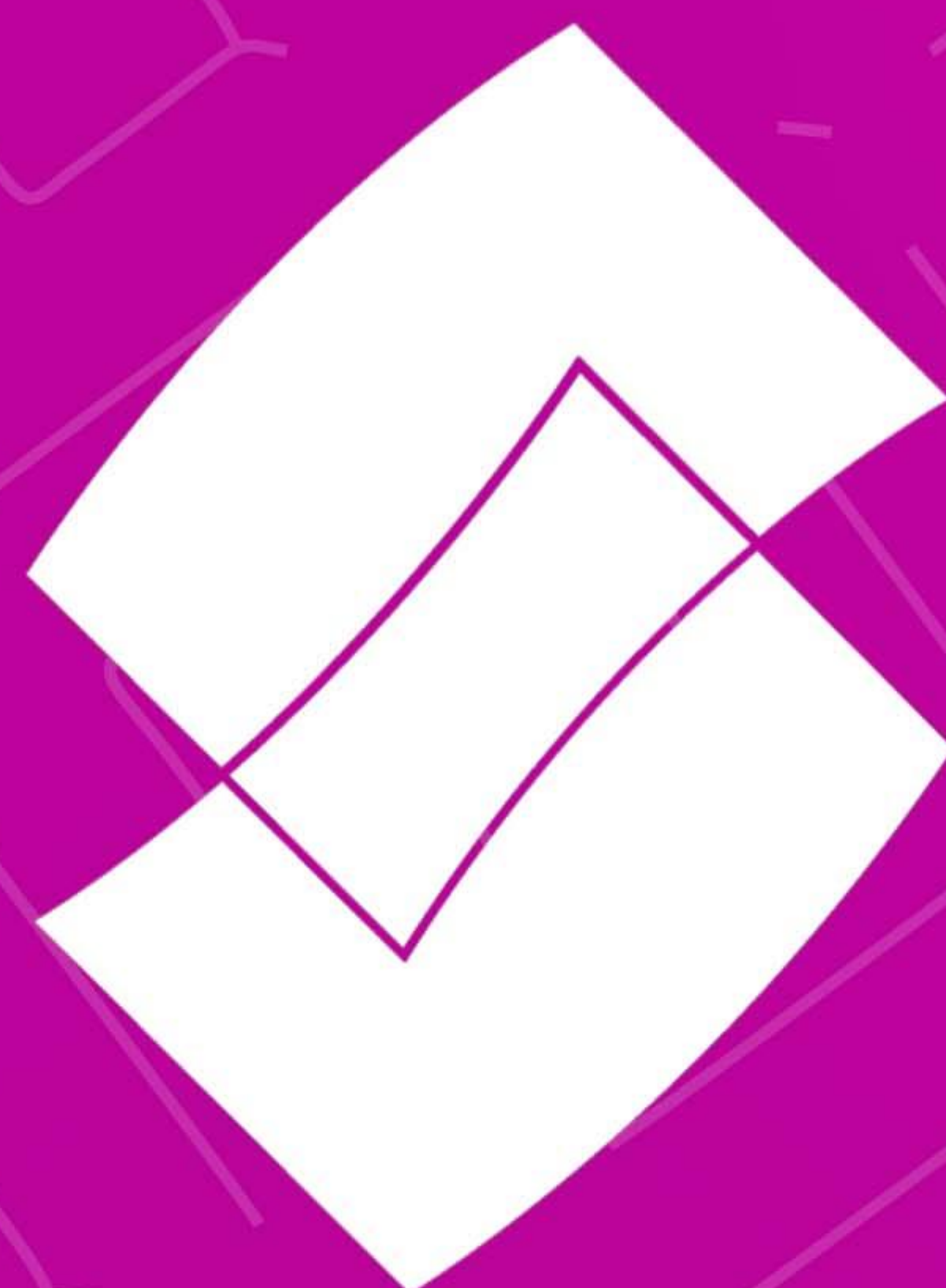
اختیار خرید



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.