

شماره
۴۴۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۶ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





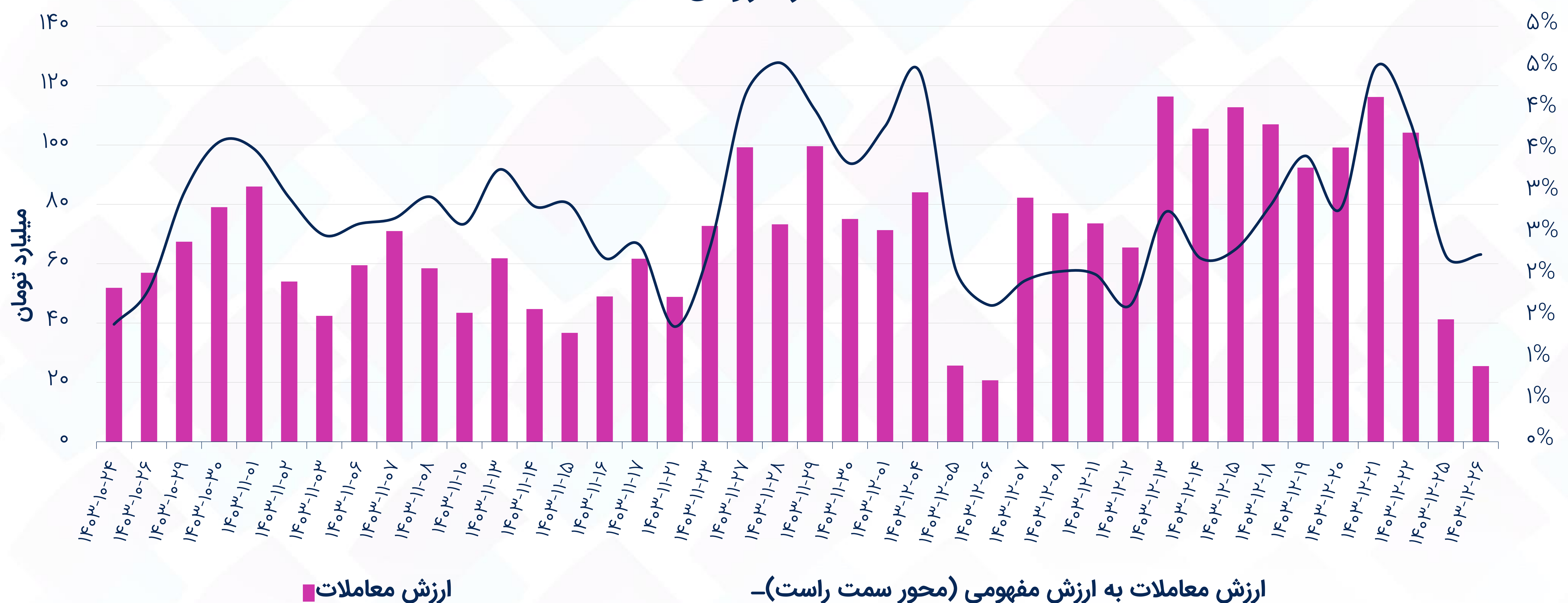
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



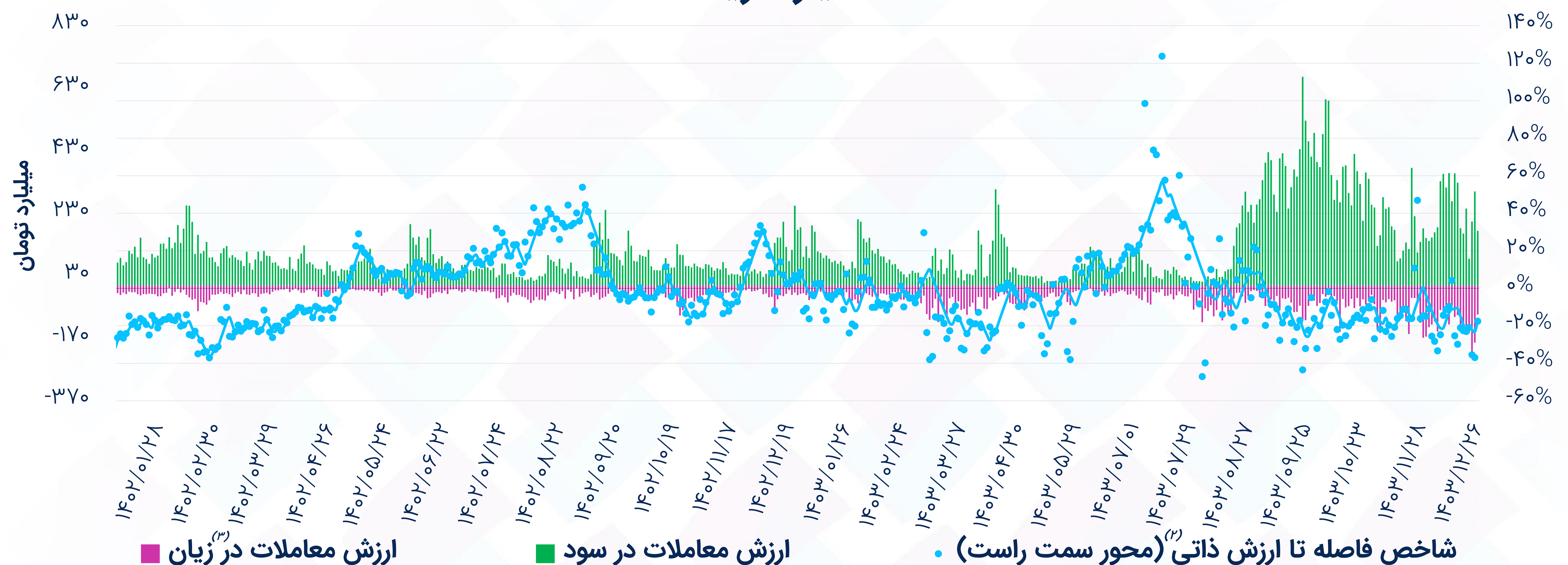
اختیار فروش



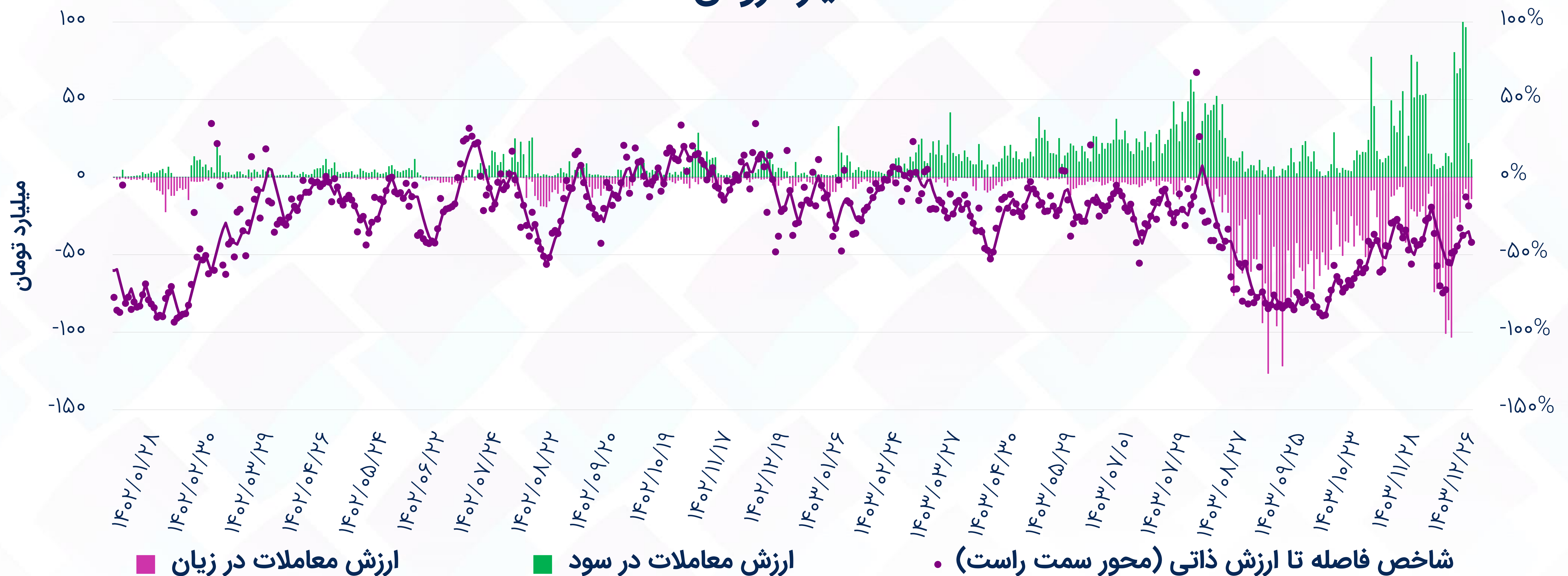
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۸	۱۰۶.۳	۱,۱۳۴.۷	۴۶.۶	۵۹.۷	(۳۷.۰%)
خودرو	۳۹	۵۸.۵	۱,۶۵۲.۶	۵۴.۵	۴.۰	۳۳.۱%
شستا	۴۲	۴۰.۶	۷۷۷.۱	۱۹.۳	۲۱.۴	(۴۳.۳%)
ذوب	۲۴	۲۰.۳	۱۹۰.۷	۱۵.۰	۵.۳	(۳۵.۷%)
وبملت	۱۹	۱۵.۰	۱۳۱.۱	۱۴.۰	۱.۰	(۱۱.۷%)
آساس	۱۲	۸.۰	۱۰۲.۲	۷.۹	۰.۱	۳.۸%
فملی	۹	۷.۸	۳۲.۵	۷.۸	۰.۰	۰.۳%

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	۱۳	۱۶,۱۴۸.۳	۳۴۸,۲۸۰.۰	۶,۸۵۴.۰	۹,۲۹۴.۳	(۴۳.۶%)
شستا	۶	۷,۲۶۴.۷	۲۴۳,۶۳۳.۴	۳,۳۹۷.۵	۳,۸۶۷.۲	(۵۸.۰%)
خودرو	۱۰	۱,۸۱۵.۸	۵۲۱,۶۸۲.۸	۱,۰۴۹.۴	۷۶۶.۴	۳۸.۱%
وبملت	۳	۹۹.۱	۱۳,۰۳۱.۷	۰.۰	۹۹.۱	(۸۵.۳%)
بساما	۲	۹۵.۴	۲,۱۸۱.۳	۸۶.۳	۹.۱	(۵۱.۲%)
توان	۲	۴۶.۳	۸۱۳.۹	۳۸.۱	۸.۱	(۳۸.۹%)
خودران	۱	۲۳.۶	۲۰۱.۴	۲۳.۶	۰.۰	(۳۹.۸%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۲۴۲,۹۲۰

ذوب ۴۱,۰۰۶

وبملت ۳۷,۰۵۶

فملی ۲۳,۱۴۷

اهرم ۸,۳۳۳

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۲۴۹,۶۹۸.۴)

نارنج
اهرم (۱۶۳.۰)

وتجارت (۱۱.۰)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۶,۵۱۰

شستا ۲,۵۹۷

خودرو ۱,۲۸۴

ذوب ۷۷۷

وبملت ۷۵۶

فملی ۲۱۱

فولاد ۱۶۷

شتاب ۱۵۱

آساس ۱۲۶

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

اهرم ۱,۲۸۹

خودرو ۲۸۴

شستا ۲۴۰

وبملت ۱۶

بساما ۸

رویین ۶

وتعاون ۵

خودران ۱.۷۱

شپنا ۰.۹۰

فملی ۰.۷۰

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۶۴,۴۹۶.۰

وبملت ۳,۹۵۱.۲

بساما ۱,۲۸۸.۸

توان ۳۴۸.۶

خودران ۲۲۰.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۲۵۴,۱۰۴.۸)

اهرم (۳۸,۹۲۸.۲)

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
ضخود ۰۱۴۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۰	۱,۴۶۷.۱	۷	۳,۸۶۸	۴,۰۰۷	۳.۶%	۵۷۲.۴	۰.۲۹	۳۲	۳۵۸%
ضهرم ۴۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۲۲	۵.۸	۵۰۰	۲۵,۰۶۰	۲۸,۵۰۰	۱۳.۷%	۵۷.۰	۰.۵۴	۲,۰۳۴	۳۰۷%
ضخود ۰۱۳۹	خودرو	۳,۷۵۰	۱۰	۷,۴۵۹.۱	۷۹	۳,۸۶۸	۳,۸۲۹	(۱.۰%)	۴۸.۵	۰.۸۰	۱۶۵	۱۰۹%
ضفرز ۲۰۸	فرز	۴۴,۰۰۰	۴۹	۵.۱	۵,۱۱۰	۴۹,۸۰۰	۴۹,۱۱۰	(۱.۴%)	۹.۶	۰.۹۴	۷,۷۵۰	۵۲%
ضخود ۰۱۳۸	خودرو	۳,۵۰۰	۱۰	۱۵,۸۷۸.۰	۳۰۲	۳,۸۶۸	۳,۸۰۲	(۱.۷%)	۱۲.۶	۰.۹۹	۳۹۴	۳۰%

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	۲۴	۱.۵	۱	۴۴۸	۷۰۱	۵۶%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۱۰	۹.۴	۳	۳,۸۶۸	۵,۰۰۳	۲۹%	۱,۶۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۵۹	۵.۹	۸	۴۴۸	۸۰۸	۸۰%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲۴	۳۰.۵	۲	۴۴۸	۶۰۲	۳۴%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲۴	۲۳.۴	۳	۱,۳۴۵	۱,۷۰۳	۲۷%	۵۶۷.۷	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
طخود ۱۳۹۰	خودرو	۳,۷۵۰	۱۰	۶۴۵.۱	۸	۳,۸۶۸	۳,۷۴۲	(۳.۳%)	۴۶۷.۸	-۰.۲۰	۲۰	۱۵۰.۶%
طهرم ۱۲۳۰	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۱	۳.۴	۴,۳۰۰	۲۵,۰۶۰	۲۵,۷۰۰	۲.۶%	۶.۰	-۰.۹۴	۴,۲۶۶	(۰.۸%)
طخود ۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۱۰	۸۳.۰	۶۳۴	۳,۸۶۸	۳,۸۶۶	(۰.۱%)	۶.۱	-۱.۰۰	۶۰۰	(۵.۴%)
طهرم ۱۲۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۱	۱,۱۲۵.۷	۲,۸۱۴	۲۵,۰۶۰	۲۵,۱۸۶	۰.۵%	۹.۰	-۰.۸۰	۲,۵۰۷	(۱۰.۹%)
طخود ۱۴۰۰	خودرو	۴,۰۰۰	۱۰	۹۵۷.۷	۱۶۵	۳,۸۶۸	۳,۸۳۵	(۰.۹%)	۲۳.۲	-۰.۷۱	۱۳۵	(۱۸.۱%)

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 ۱۲۰۰	شستا	۶۰۰	۲۴	۰.۰	۱	۱,۳۴۵	۵۹۹	(۵۵.۵%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۱۰	۱.۰	۱	۳,۸۶۸	۲,۷۹۹	(۲۷.۶%)	۲,۷۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۱۰	۱۰.۸	۳	۳,۸۶۸	۲,۹۹۷	(۲۲.۵%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۱۳۷۰	خودرو	۳,۲۵۰	۱۰	۱۷.۲	۱	۳,۸۶۸	۳,۲۴۹	(۱۶.۰%)	۳,۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طملت ۱۱۶۰	وبملت	۱,۷۶۰	۳۱	۰.۱	۵	۲,۱۸۰	۱,۷۵۵	(۱۹.۵%)	۳۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۳%)

(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

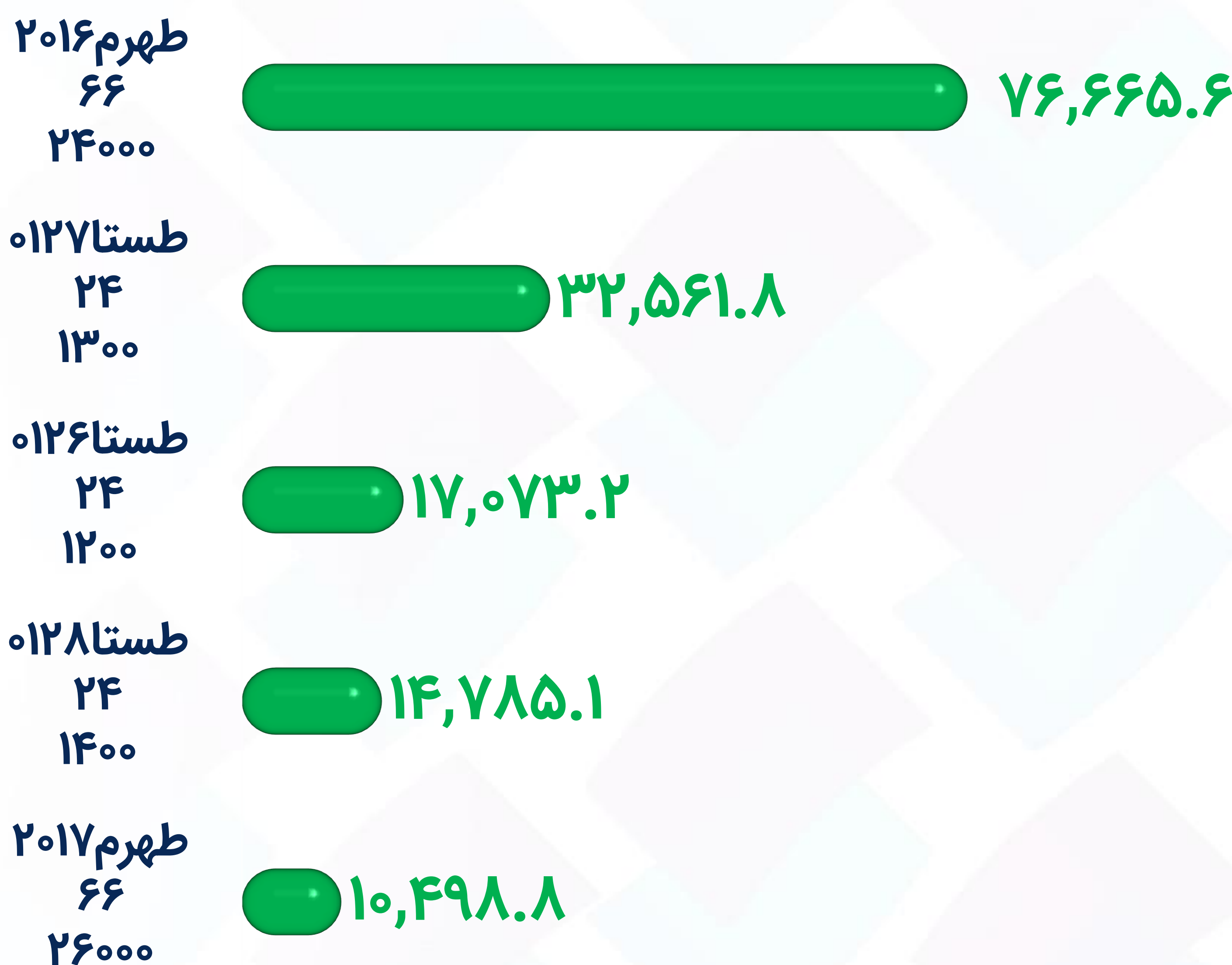
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

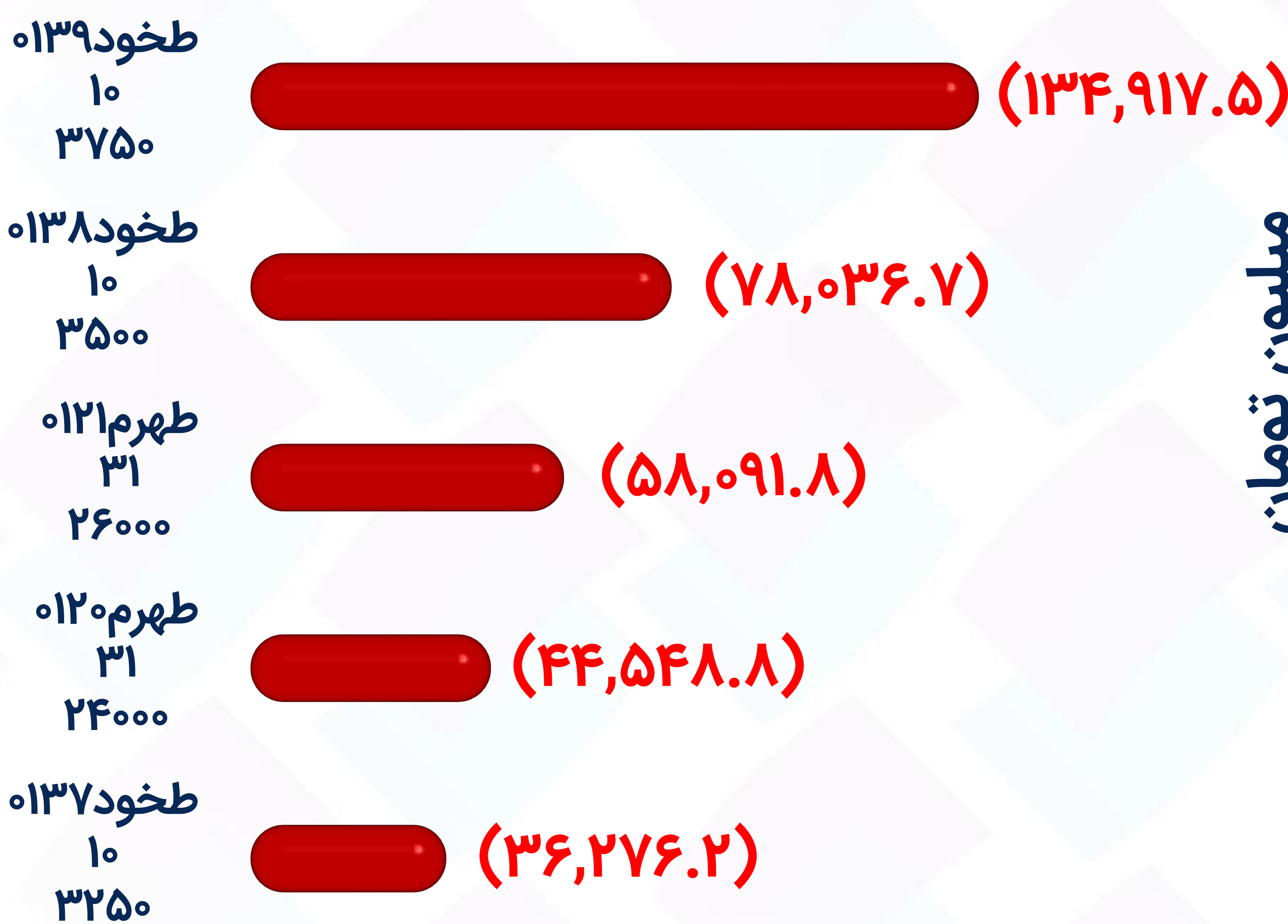
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

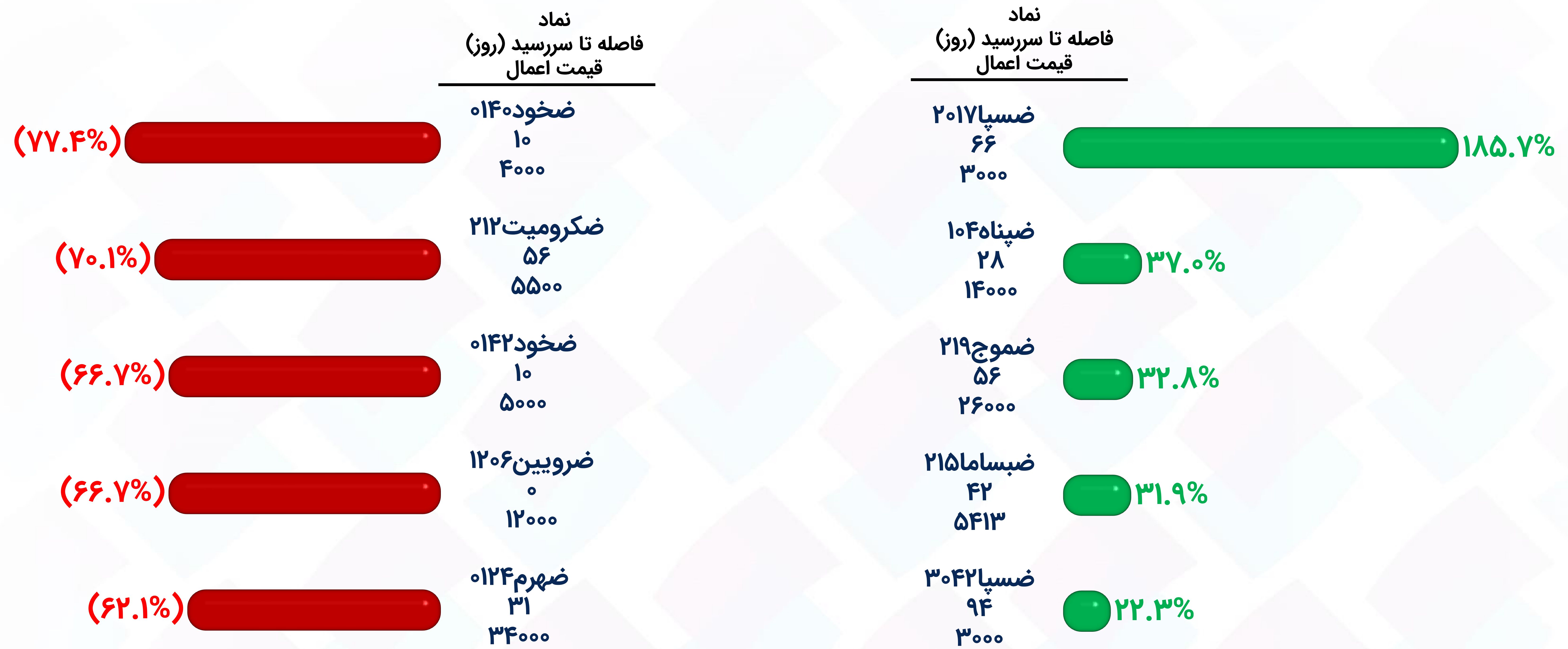
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

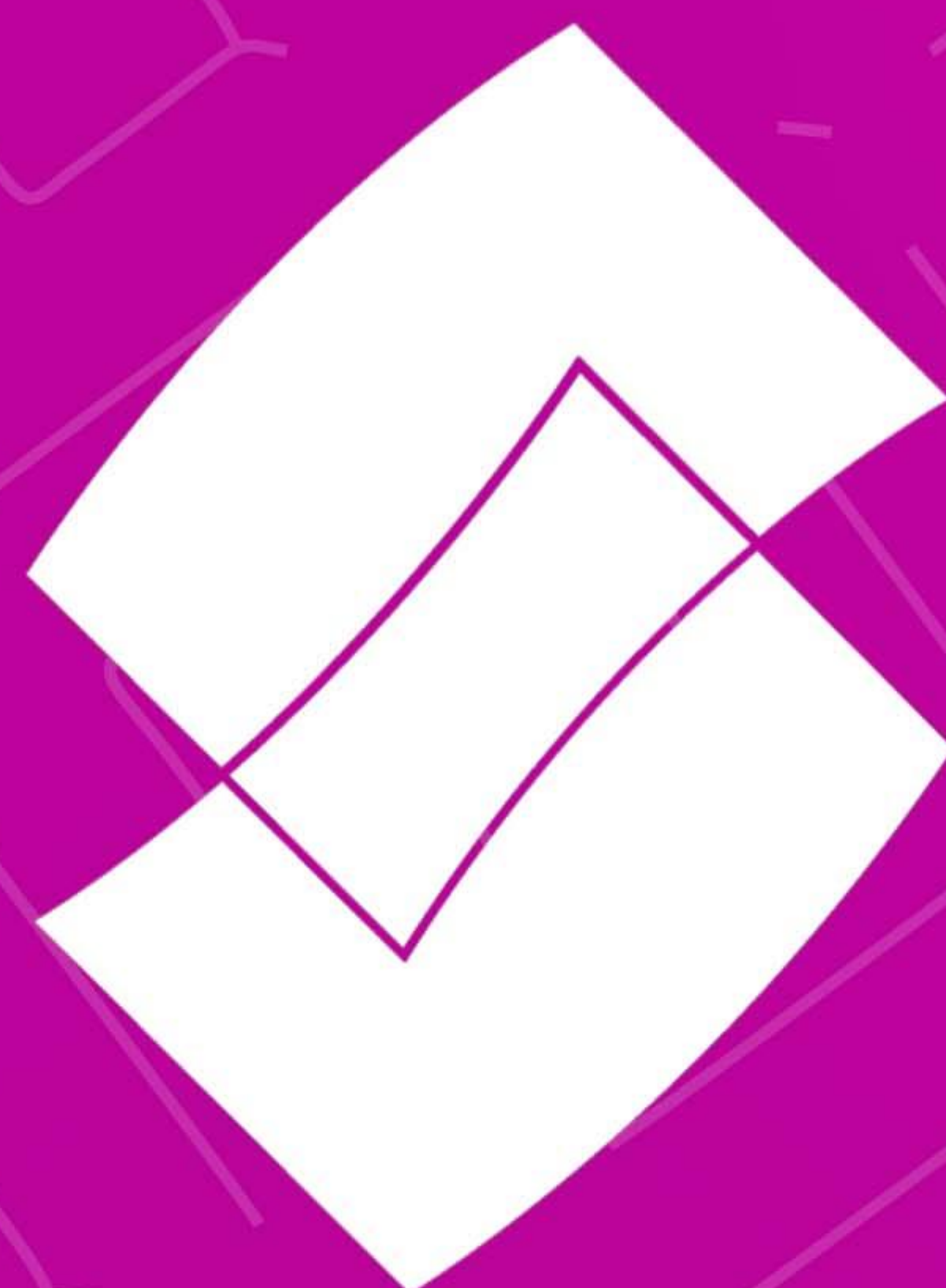
اختیار خرید



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.