

شماره
۴۴۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۷ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





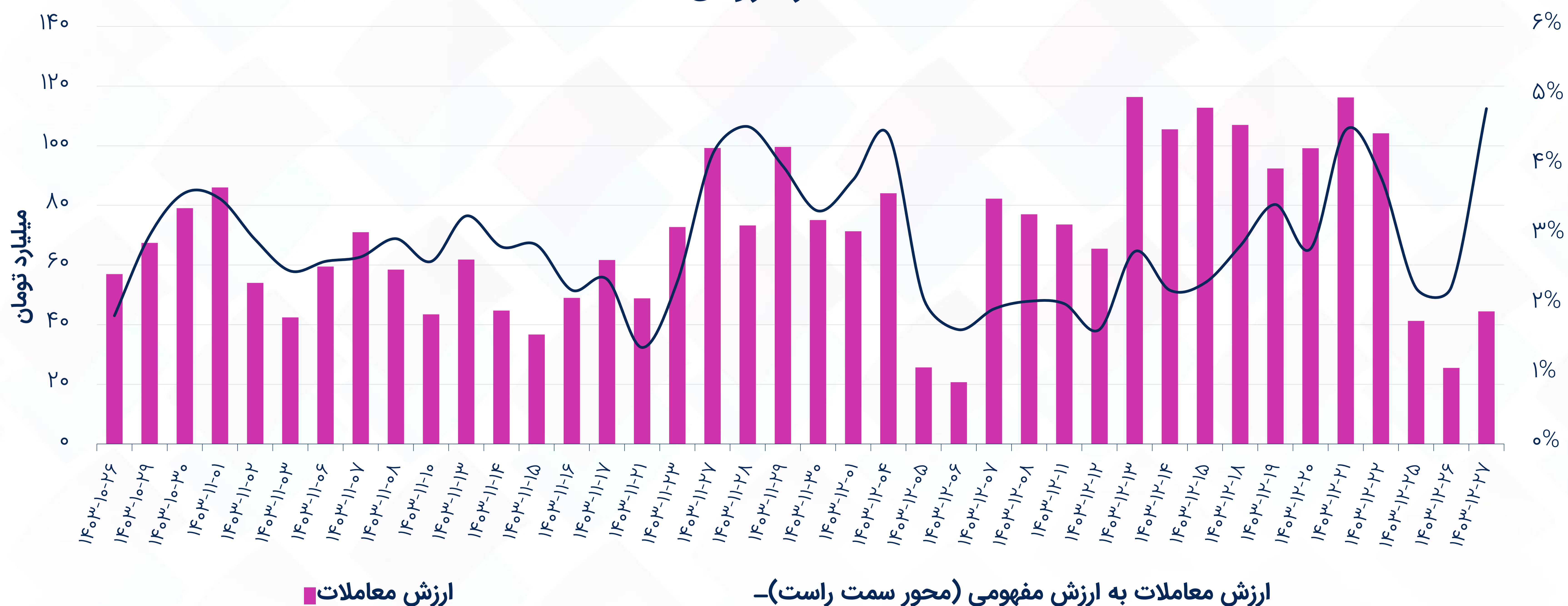
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



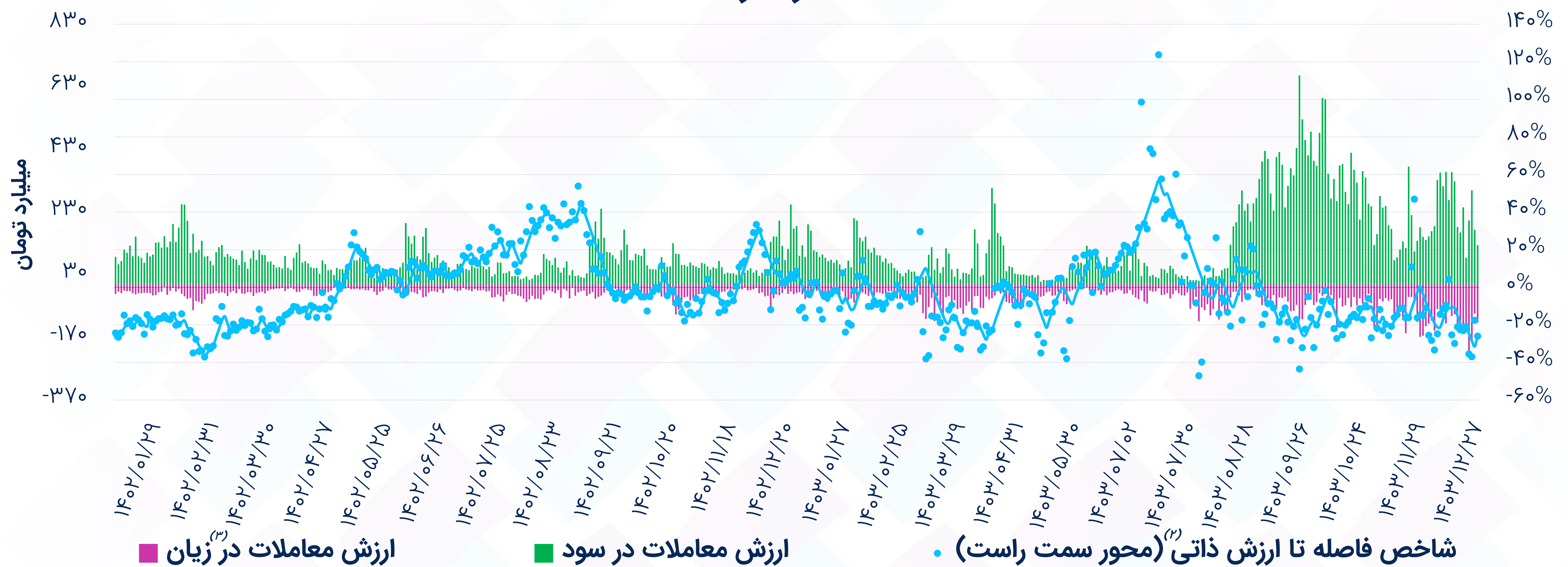
اختیار فروش



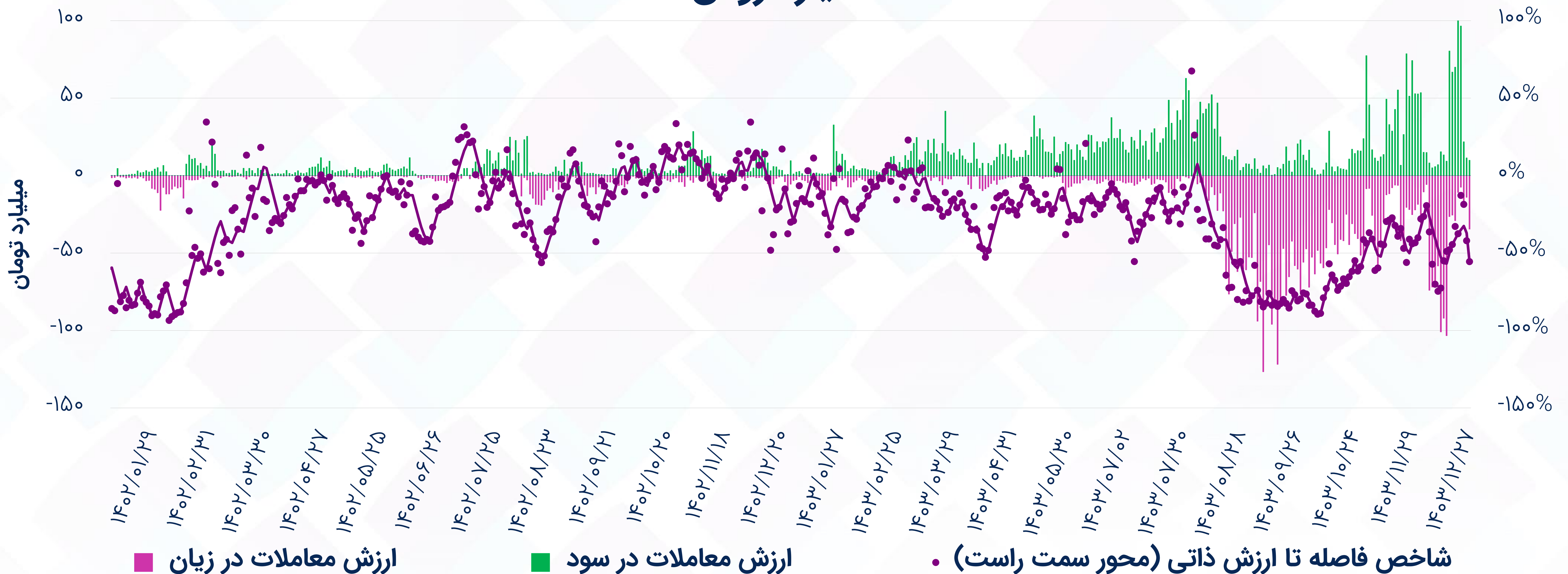
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۴۵.۶	۲,۰۴۸.۵	۴۶.۶	۹۹.۰	(۳۱.۶%)
فولاد	۱۰	۳۷.۰	۸۹.۴	۳۷.۰	۰.۱	(۲.۸%)
شستا	۴۰	۲۸.۳	۷۷۸.۶	۱۳.۴	۱۵.۰	(۳۶.۱%)
ذوب	۲۵	۱۹.۸	۲۱۹.۸	۱۴.۴	۵.۳	(۲۳.۶%)
وبملت	۲۰	۱۰.۲	۱۰۵.۴	۹.۱	۱.۱	(۱۲.۴%)
موج	۴	۱.۶	۱۱.۸	۱.۲	۰.۴	(۱۸.۲%)
فزر	۸	۱.۳	۶.۵	۱.۳	۰.۰	(۸.۳%)

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	۱۴	۳۶,۱۷۵.۸	۶۴۹,۲۲۳.۵	۵,۲۸۰.۷	۳۰,۸۹۵.۲	(۵۶.۰%)
شستا	۷	۸,۱۰۱.۳	۲۶۴,۱۲۵.۶	۴,۵۱۶.۹	۳,۵۸۴.۴	(۵۳.۷%)
وبملت	۳	۵۸.۸	۵,۴۹۶.۴	۰.۰	۵۸.۸	(۶۹.۹%)
توان	۲	۵۳.۴	۷۱۴.۵	۴۴.۸	۸.۶	(۴۱.۴%)
ذوب	۴	۴۳.۸	۲,۶۰۸.۰	۱۷.۸	۲۶.۰	(۷۱.۴%)
اطلس	۱	۱۳.۲	۲۳۳.۶	۱۳.۲	۰.۰	(۴۹.۹%)
خودران	۱	۸.۴	۱۹۸.۰	۸.۴	۰.۰	(۱۵.۱%)

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

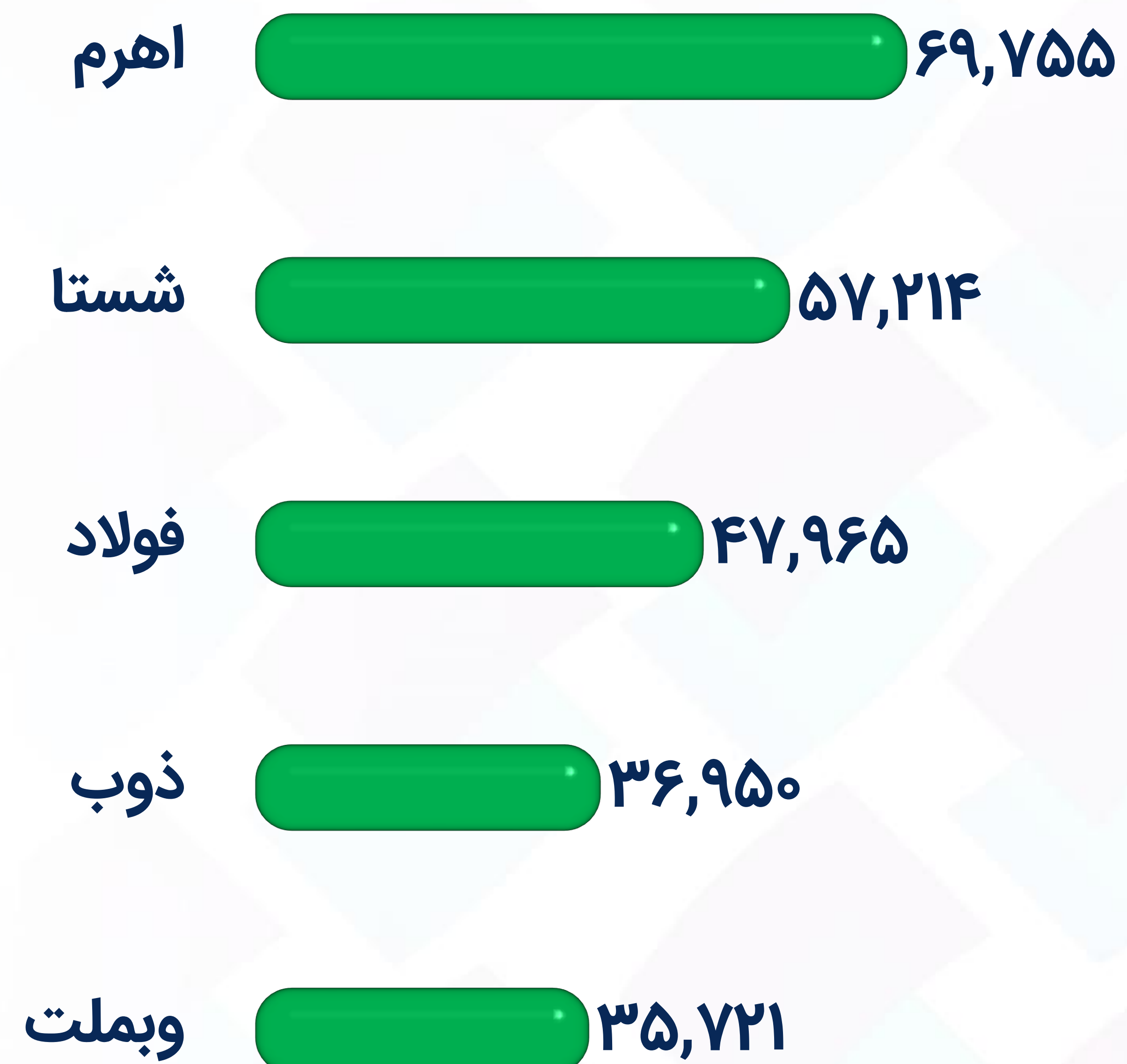
میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



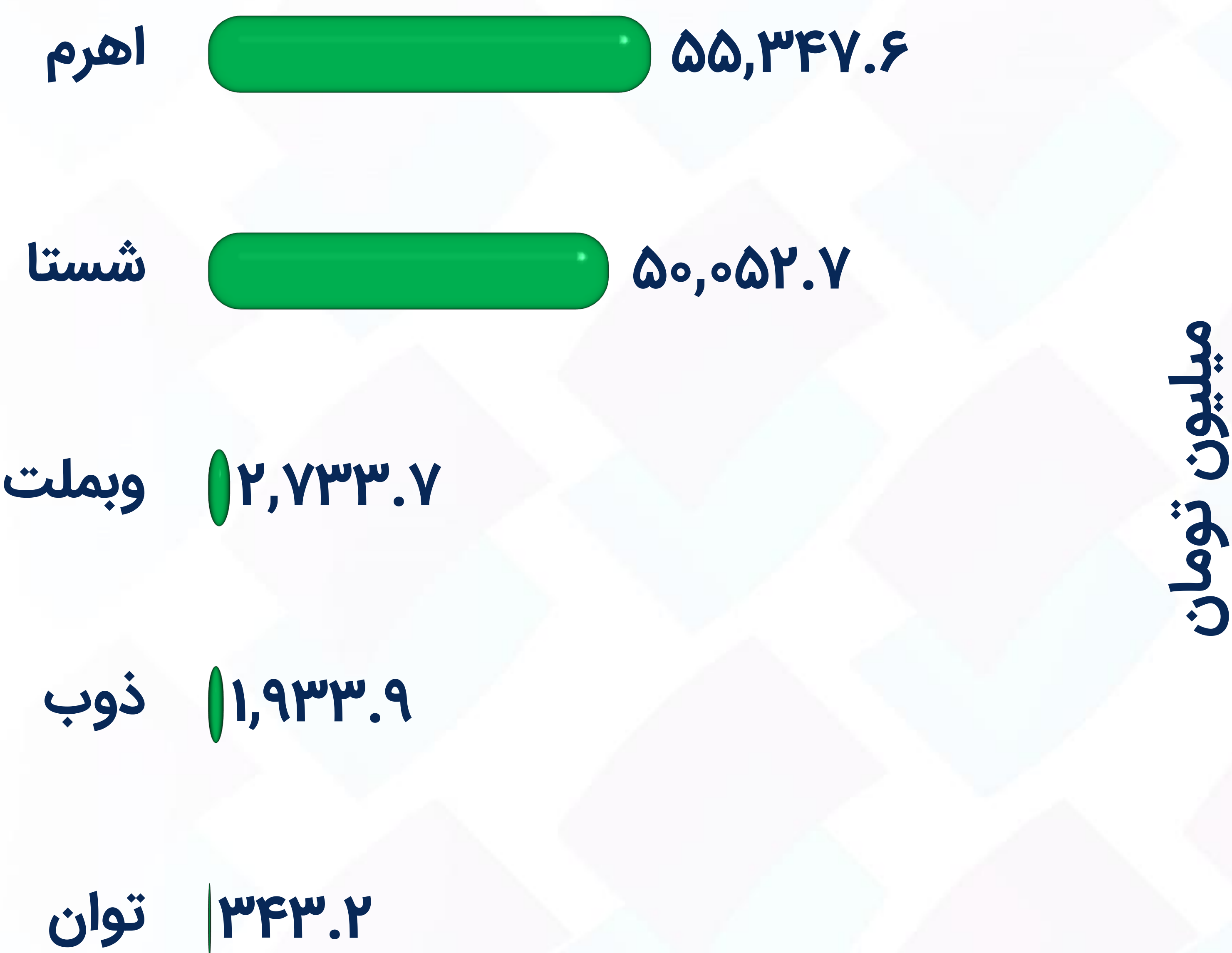
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



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
ضتاب ۳۰۰۵	شتاب	۱۴,۰۰۰	۷۸	۲.۵	۵۰	۱۲,۷۳۰	۱۴,۰۵۰	۱۰.۴%	۲۸۱.۰	۰.۴۸	۷۳۰	۱۳۶۰%
ضتاب ۳۰۰۲	شتاب	۱۱,۰۰۰	۷۸	۶.۲	۱,۵۳۷	۱۲,۷۳۰	۱۲,۵۳۷	(۱.۵%)	۸.۲	۰.۹۲	۲,۵۹۰	۶۸%
ضوتعاون ۱۰۶	وتعاون	۱,۳۰۰	۲۷	۱۳.۴	۲۶۲	۱,۶۱۰	۱,۵۶۲	(۳.۰%)	۶.۰	۱.۰۰	۳۳۴	۲۸%
ضپناه ۱۰۴	پناه	۱۴,۰۰۰	۲۷	۱۴.۳	۷۱۲	۱۴,۶۲۱	۱۴,۷۱۲	۰.۶%	۲۰.۷	۰.۹۵	۸۹۶	۲۶%
ضهرم ۰۱۱۲	اهرم	۱۲,۰۰۰	۳۰	۴.۶	۱۱,۳۷۵	۲۴,۸۱۰	۲۳,۳۷۵	(۵.۸%)	۲.۱	۱.۰۰	۱۳,۰۸۶	۱۵%

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 ۰۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲۳	۴۵.۴	۲	۴۵۶	۶۰۲	۳۲%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲۳	۴۸.۲	۲	۱,۳۴۱	۱,۷۰۲	۲۷%	۸۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۴۴	۴.۰	۱۱	۱,۳۴۱	۱,۹۱۱	۴۳%	۱۷۳.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۷۸	۷.۲	۱۸	۱,۳۴۱	۲,۲۱۸	۶۵%	۱۲۳.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضملت ۰۱۲۲	وبملت	۲,۹۳۴	۳۰	۵.۷	۶	۲,۱۵۹	۲,۹۴۰	۳۶%	۴۹۰.۰	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	۳۰	۷.۰	۴,۶۶۷	۲۴,۸۱۰	۲۵,۳۳۳	۲.۱%	۵.۴	-۰.۹۶	۴,۵۳۷	(۲.۸%)
طران ۳۰۰۶	خودران	۱۰,۰۰۰	۹۳	۸.۴	۴۲۲	۹,۹۰۰	۹,۵۷۸	(۳.۳%)	۲۲.۷	-۰.۳۰	۳۵۸	(۱۵.۰%)
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۰	۳۱۱.۵	۳,۴۶۱	۲۴,۸۱۰	۲۴,۵۳۹	(۱.۱%)	۷.۱	-۰.۸۴	۲,۷۲۸	(۲۱.۲%)
طهرم ۳۰۱۶	اهرم	۲۶,۰۰۰	۹۳	۱.۰	۲,۰۰۶	۲۴,۸۱۰	۲۳,۹۹۴	(۳.۳%)	۱۲.۰	-۰.۳۸	۱,۲۹۷	(۳۵.۳%)
طهرم ۲۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۶۵	۶۷۱.۴	۳,۷۵۹	۲۴,۸۱۰	۲۴,۲۴۱	(۲.۳%)	۶.۴	-۰.۶۳	۲,۴۲۸	(۳۵.۴%)

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	۲۳	۰.۰	۳	۱,۳۴۱	۵۹۷	(۵۵.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۰۱۱۱	ذوب	۲۰۰	۲۳	۰.۰	۱	۴۵۶	۱۹۹	(۵۶.۴%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۰۱۱۲	ذوب	۳۰۰	۲۳	۰.۳	۱	۴۵۶	۲۹۹	(۳۴.۴%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۳۰	۰.۳	۲۵۰	۲۴,۸۱۰	۱۷,۷۵۰	(۲۸.۵%)	۷۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۰۱۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۲۳	۸.۰	۷	۱,۳۴۱	۱,۰۹۳	(۱۸.۵%)	۱۵۶.۱	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)

ضهرم ۱۲۱
۳۰
۲۶۰۰۰ ۱,۶۰۸

ضهرم ۱۲۲
۳۰
۲۸۰۰۰ ۱,۲۰۰

ضستا ۱۲۸
۲۳
۱۴۰۰ ۸۴۶

ضهرم ۱۲۰
۳۰
۲۴۰۰۰ ۶۸۷

ضهرم ۱۲۳
۳۰
۳۰۰۰۰ ۶۷۸

ضهرم ۱۲۴
۳۰
۳۴۰۰۰ ۴۹۳

ضهرم ۲۰۱۸
۶۵
۲۸۰۰۰ ۴۲۷

ضستا ۱۲۹
۲۳
۱۵۰۰ ۳۸۱

ضستا ۲۰۴۰
۴۴
۱۴۰۰ ۳۵۲

ضخود ۱۴۰
۹
۴۰۰۰ ۳۴۶

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۲۰۱۸
۶۵
۲۸۰۰۰ ۱۸۶,۷۵۴

ضهرم ۲۰۱۷
۶۵
۲۶۰۰۰ ۶۷,۷۵۳

ضهرم ۲۰۱۶
۶۵
۲۴۰۰۰ ۴۴,۷۷۲

ضهرم ۲۰۲۰
۶۵
۳۴۰۰۰ ۳۶,۷۰۳

ضفلا ۱۱۱
۲۳
۲۱۶۰ ۳۰,۰۰۲

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضهرم ۱۲۱
۳۰
۲۶۰۰۰ (۹۹,۴۱۱.۰)

ضهرم ۱۲۳
۳۰
۳۰۰۰۰ (۶۹,۰۸۴.۰)

ضهرم ۱۲۲
۳۰
۲۸۰۰۰ (۵۸,۱۵۸.۸)

ضهرم ۱۲۴
۳۰
۳۴۰۰۰ (۵۳,۵۲۶.۲)

ضهرم ۱۲۰
۳۰
۲۴۰۰۰ (۴۲,۰۳۶.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

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

طهرم ۰۱۲۰
۳۰
۲۴۰۰۰ ۴۵۱

طهرم ۰۱۱۹
۳۰
۲۲۰۰۰ ۲۹۴

طهرم ۰۱۲۱
۳۰
۲۶۰۰۰ ۲۸۲

طستا ۰۱۲۷
۲۳
۱۳۰۰ ۱۴۶

طهرم ۰۲۰۱۶
۶۵
۲۴۰۰۰ ۱۴۳

طستا ۰۱۲۶
۲۳
۱۲۰۰ ۹۸

طخود ۰۱۳۸
۹
۳۵۰۰ ۹۲

طخود ۰۱۳۷
۹
۳۲۵۰ ۸۷

طهرم ۰۱۱۸
۳۰
۲۰۰۰۰ ۷۶

طخود ۰۱۳۹
۹
۳۷۵۰ ۷۲

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

طهرم ۰۲۰۱۶
۶۵
۲۴۰۰۰ ۶۶,۰۹۶.۰

طستا ۰۱۲۷
۲۳
۱۳۰۰ ۲۲,۳۶۰.۴

طستا ۰۱۲۶
۲۳
۱۲۰۰ ۱۸,۵۱۲.۳

طهرم ۰۲۰۱۷
۶۵
۲۶۰۰۰ ۱۴,۱۱۲.۸

طهرم ۰۲۰۱۵
۶۵
۲۲۰۰۰ ۹,۱۴۱.۰

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

طهرم ۰۱۱۹
۳۰
۲۲۰۰۰ (۱۳,۲۱۱.۰)

طهرم ۰۱۲۱
۳۰
۲۶۰۰۰ (۱۲,۷۲۹.۶)

طهرم ۰۱۲۰
۳۰
۲۴۰۰۰ (۱۱,۴۵۵.۲)

طهرم ۰۱۲۲
۳۰
۲۸۰۰۰ (۲,۵۲۰.۰)

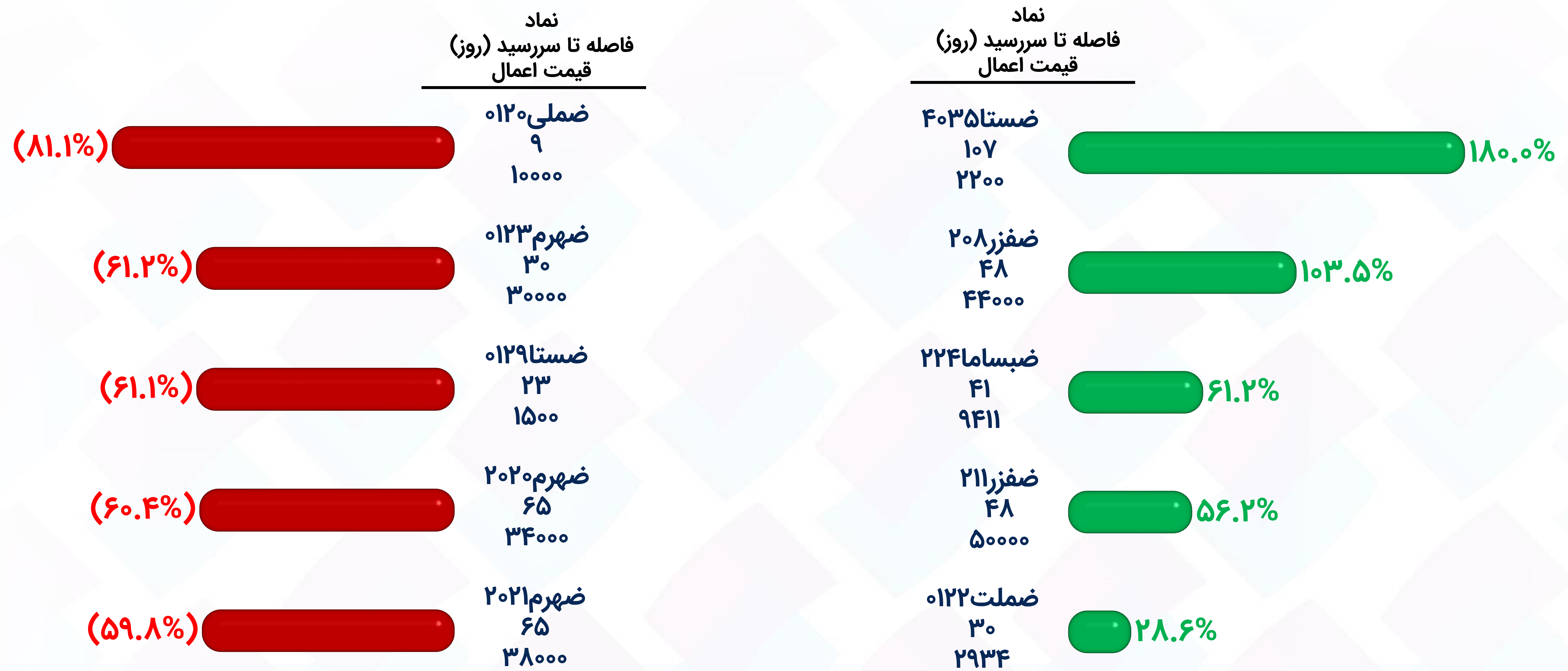
طهرم ۰۱۱۸
۳۰
۲۰۰۰۰ (۵۲۴.۰)

میلیون تومان

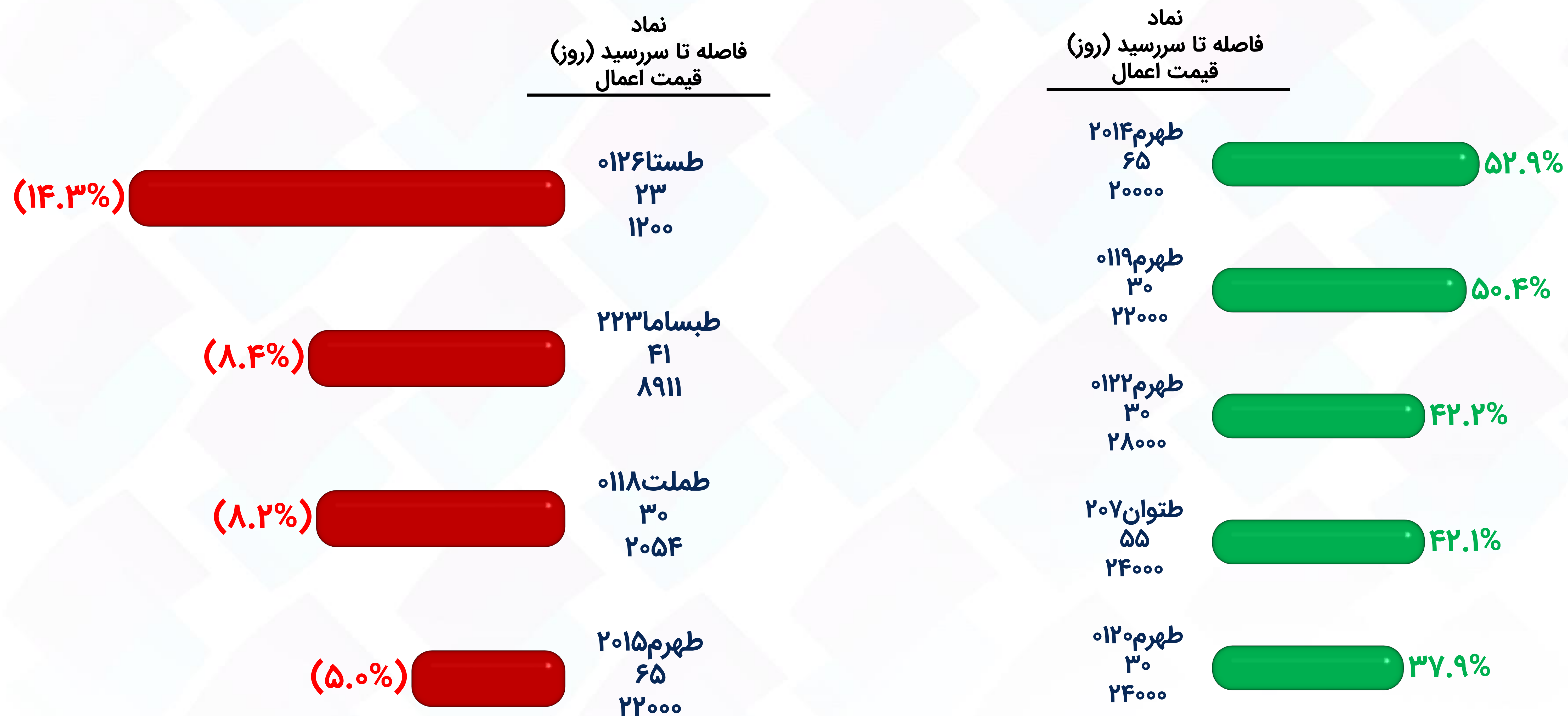
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

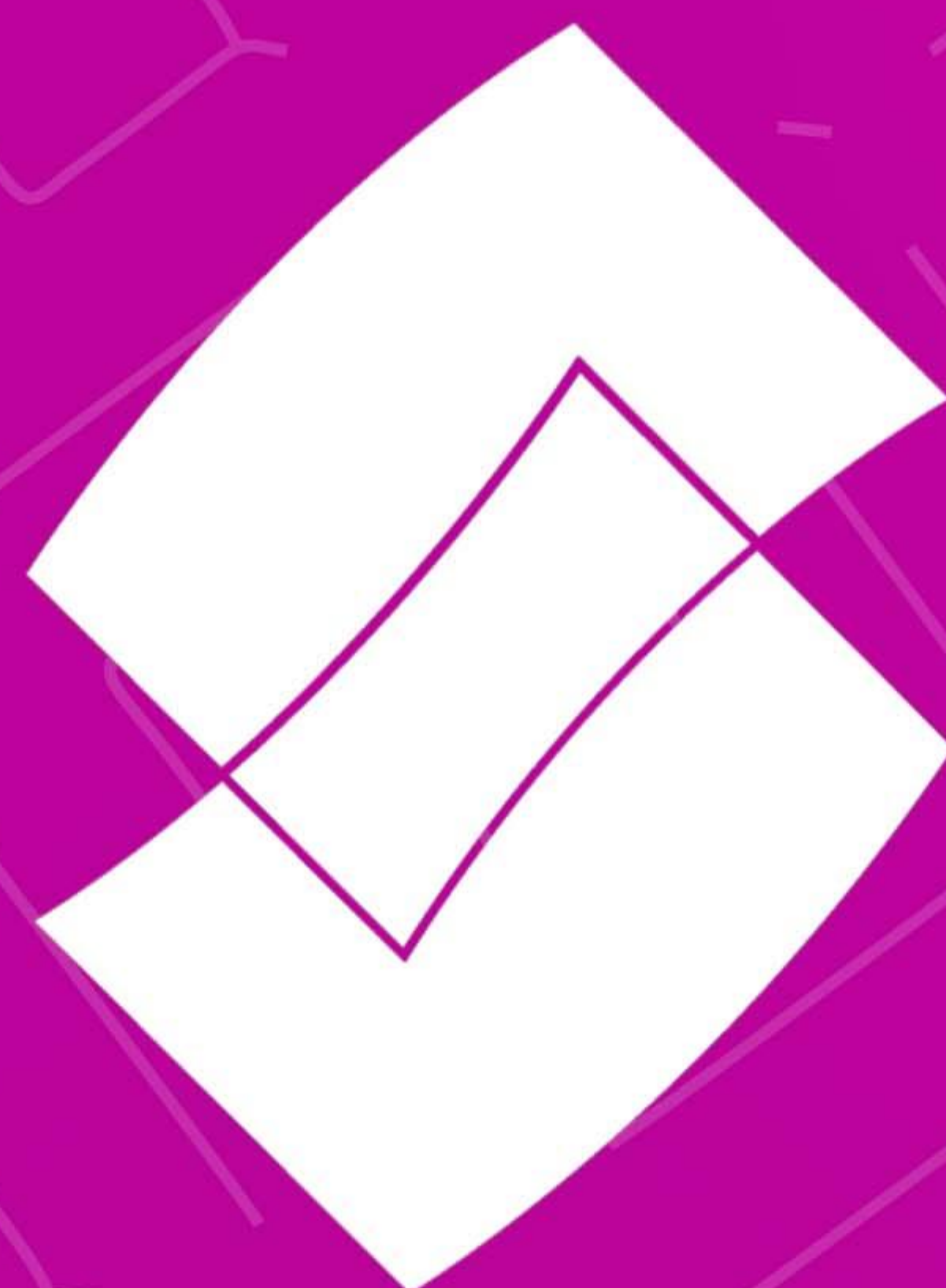
اختیار خرید



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.