

شماره
۴۴۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۸ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





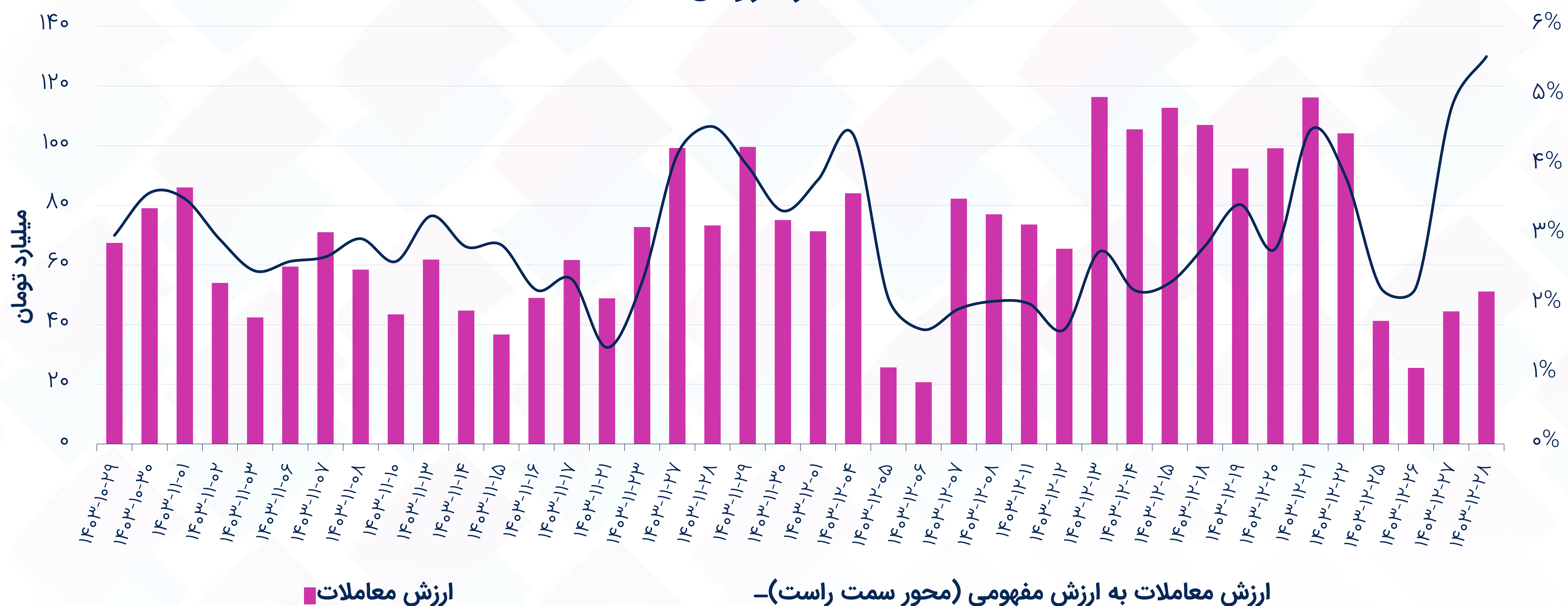
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



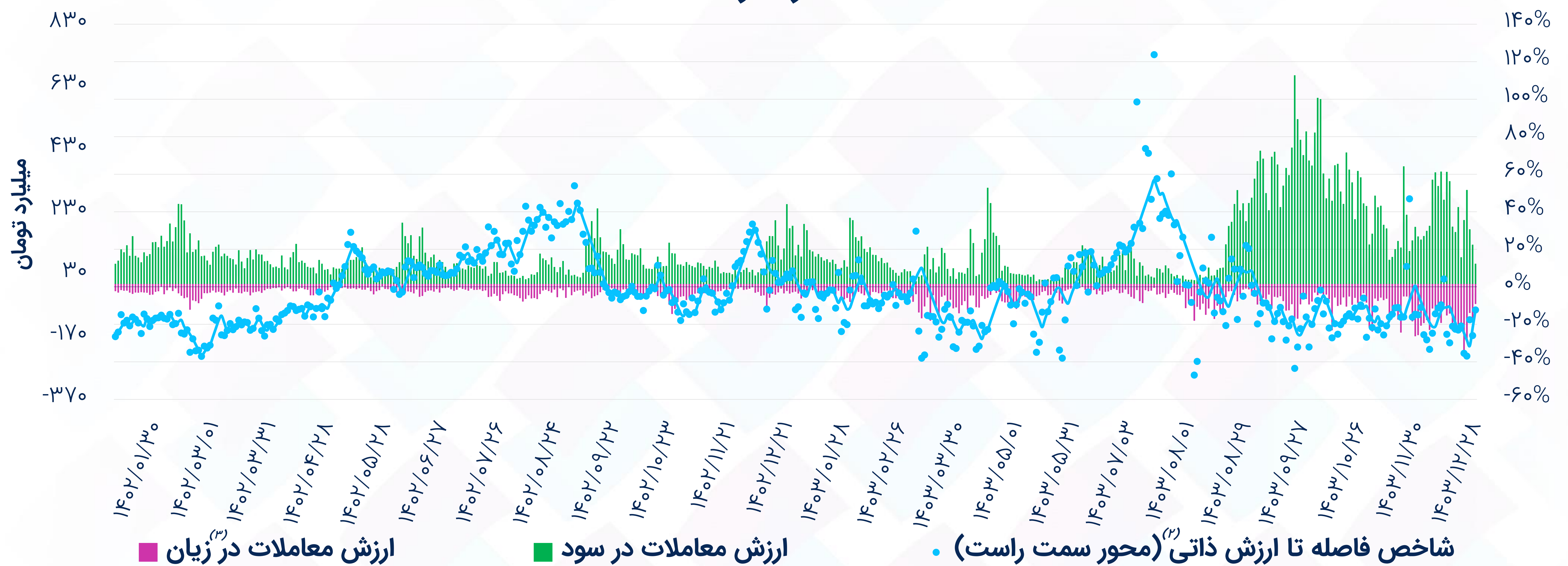
اختیار فروش



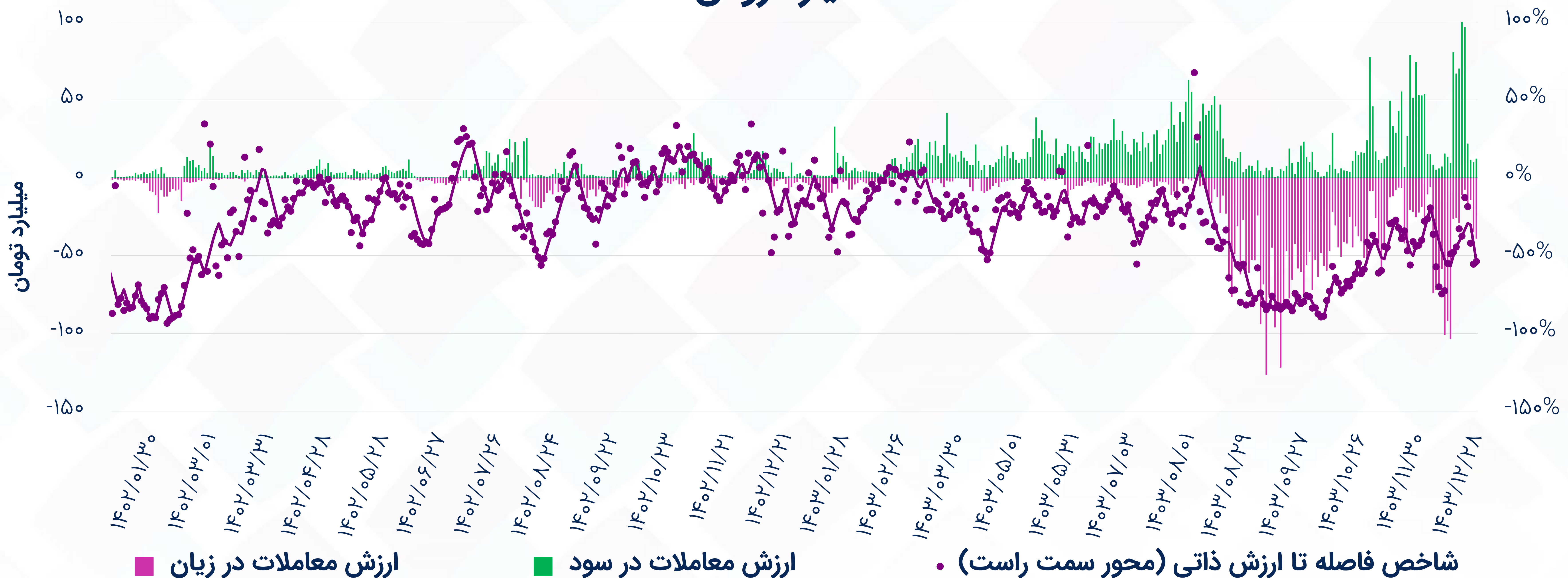
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

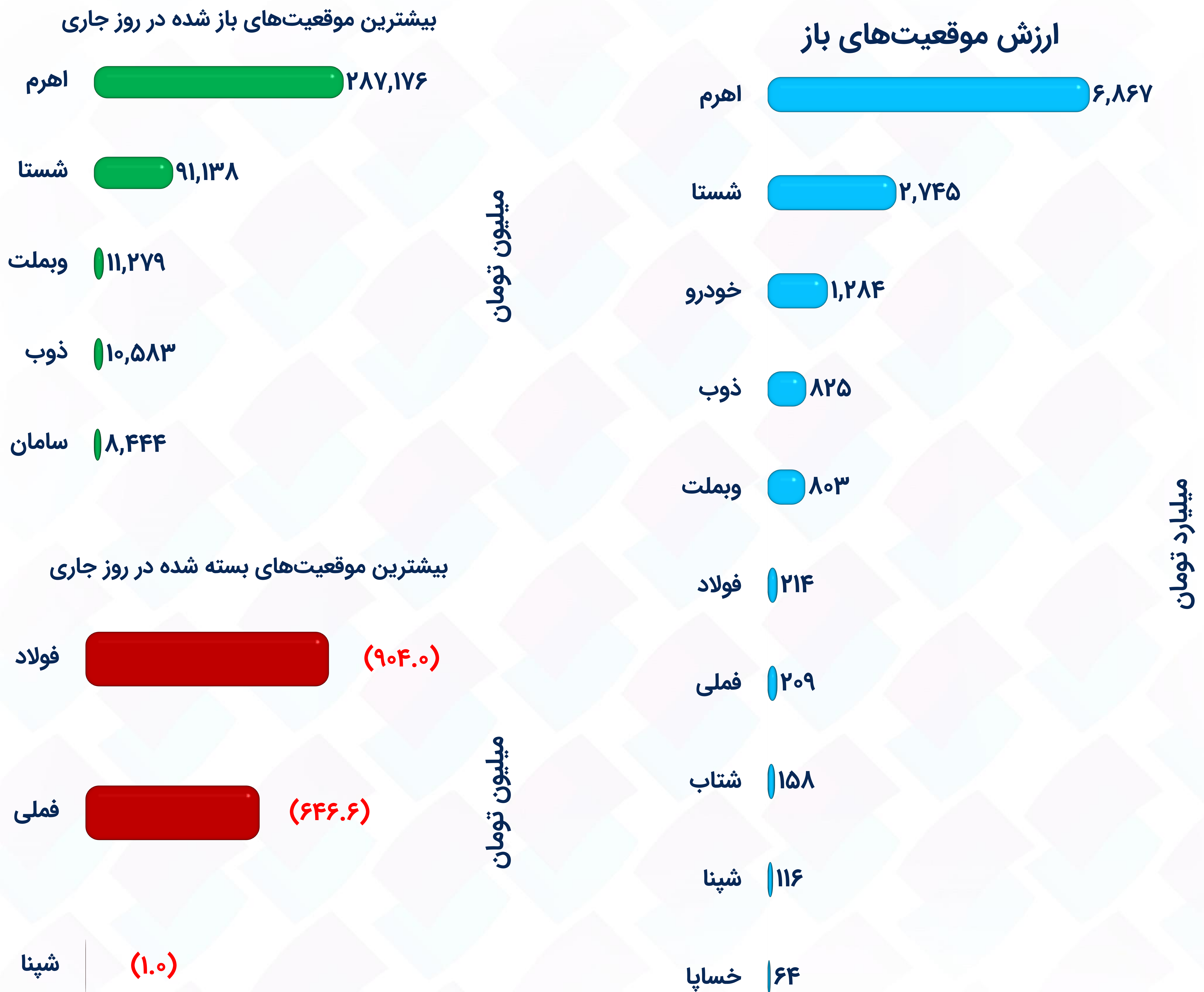
اختیار خرید

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	۳۵	۹۰.۹	۲,۰۹۱.۳	۳۵.۶	۵۵.۲	(۱۱.۰%)
شستا	۳۹	۱۵.۹	۷۴۶.۶	۹.۳	۶.۶	(۲۶.۴%)
وبملت	۲۱	۸.۳	۱۲۰.۵	۷.۶	۰.۷	(۱.۲%)
ذوب	۲۵	۷.۴	۱۳۰.۲	۶.۱	۱.۴	(۸.۶%)
سامان	۱	۲.۴	۱۱.۴	۲.۴	۰.۰	(۱۶.۲%)
فملی	۱۱	۰.۸	۸.۱	۰.۸	۰.۰	(۶.۴%)
فولاد	۷	۰.۶	۱۱.۲	۰.۵	۰.۱	(۱۵.۶%)

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	۱۲	۳۹,۷۵۱.۷	۶۳۵,۸۵۹.۷	۶,۸۴۳.۱	۳۲,۹۰۸.۷	(۵۵.۳%)
شستا	۶	۱۱,۰۹۲.۱	۲۶۴,۱۷۴.۱	۵,۲۶۸.۸	۵,۸۲۳.۳	(۴۸.۲%)
وبملت	۳	۱۶۸.۴	۱۱,۸۲۰.۱	۰.۰	۱۶۸.۴	(۷۳.۲%)
ذوب	۳	۵۴.۹	۲,۶۰۳.۸	۷.۶	۴۷.۳	(۸۵.۴%)
توان	۲	۲۷.۴	۳۰۲.۱	۲۴.۲	۳.۲	(۲۹.۴%)
وتعاون	۱	۲۶.۷	۳,۴۷۵.۸	۰.۰	۲۶.۷	(۱۷.۷%)
خودران	۱	۵.۷	۹۶.۱	۵.۷	۰.۰	(۲۳.۶%)

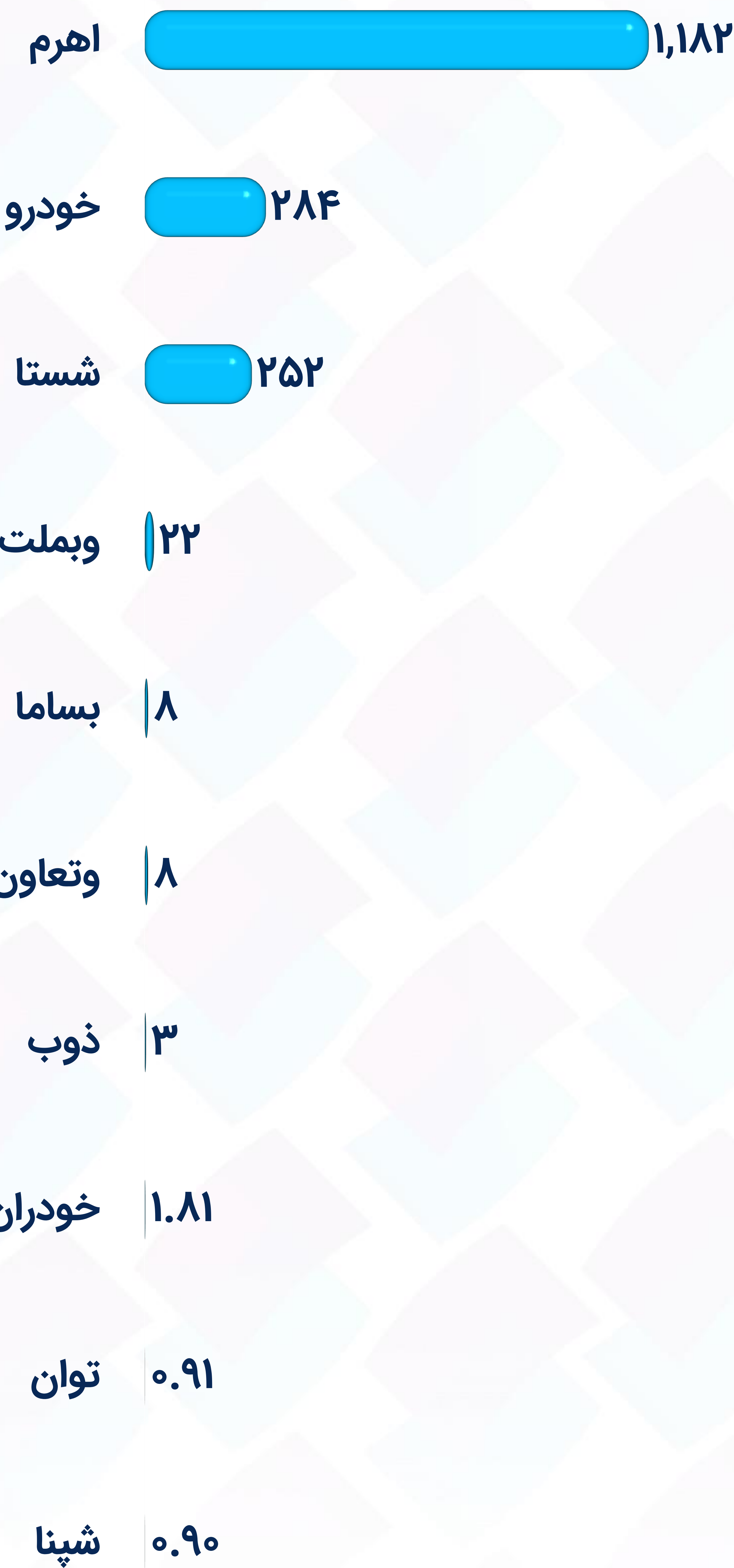
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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



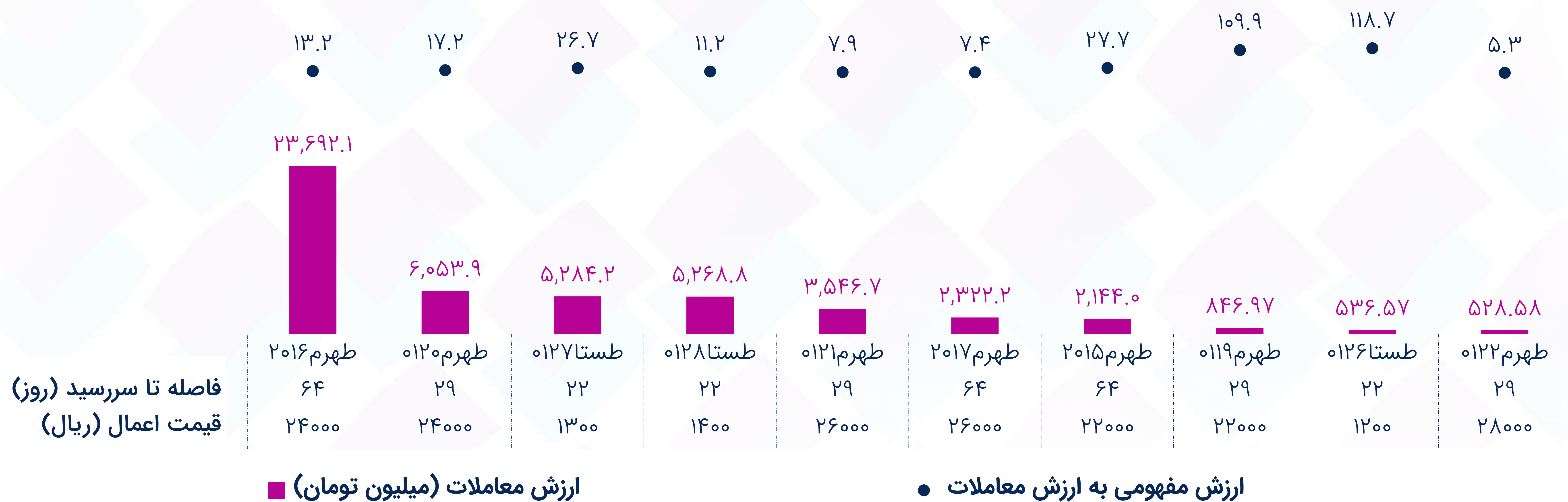
میلیون تومان

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
ضوتعاون ۱۰۶	وتعاون	۱,۳۰۰	۲۶	۱۰.۴	۱۷۶	۱,۵۶۲	۱,۴۷۶	(۵.۵%)	۸.۴	۱.۰۰	۲۸۴	۶۱%
ضهرم ۰۱۱۹	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲۹	۹۷۱.۶	۱,۶۶۱	۲۴,۰۷۰	۲۳,۶۶۱	(۱.۷%)	۱۴.۲	۰.۹۰	۲,۶۳۴	۵۹%
ضهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۵۵	۲.۳	۹۵۰	۲۴,۰۷۰	۳۰,۹۵۰	۲۸.۶%	۳۲.۶	۰.۴۱	۱,۴۴۵	۵۲%
ضکرومیت ۲۱۱	کرومیت	۵,۰۰۰	۵۴	۳.۶	۱,۱۱۰	۶,۳۶۰	۶,۱۱۰	(۳.۹%)	۵.۵	۰.۹۷	۱,۵۹۲	۴۳%
ضهرم ۰۱۲۰	اهرم	۲۴,۰۰۰	۲۹	۱,۱۷۹.۶	۸۵۰	۲۴,۰۷۰	۲۴,۸۵۰	۳.۲%	۲۹.۲	۰.۶۲	۱,۱۶۶	۳۷%

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
ضصاد ۰۱۲۱	وبصادر	۷۱۶	۸	۹.۸	۴۹	۵۵۶	۷۶۵	۳۸%	۱۵.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۶	ذوب	۷۰۰	۲۲	۱.۱	۱	۴۴۶	۷۰۱	۵۷%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۵۷	۲۲.۱	۵	۴۴۶	۸۰۵	۸۰%	۱۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲۲	۲۲.۱	۲	۱,۳۰۶	۱,۷۰۲	۳۰%	۸۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۰۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲۲	۲۱.۰	۱	۴۴۶	۶۰۱	۳۵%	۶۰۱.۰	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
طوتعاون ۱۰۸	وتعاون	۱,۵۰۰	۲۶	۲۶.۷	۱۲	۱,۵۶۲	۱,۴۸۸	(۴.۷%)	۱۲۴.۰	-۰.۱۸	۱۰	(۱۷.۷%)
طران ۱۰۶	خودران	۱۰,۰۰۰	۲۹	۵.۷	۵۷۱	۹,۶۱۰	۹,۴۲۹	(۱.۹%)	۱۶.۵	-۰.۵۷	۴۳۶	(۲۳.۶%)
طهرم ۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۹	۵۲۸.۶	۴,۵۰۶	۲۴,۰۷۰	۲۳,۴۹۴	(۲.۴%)	۵.۲	-۰.۹۲	۳,۴۲۱	(۲۴.۱%)
طتوان ۲۰۷	توان	۲۴,۰۰۰	۵۴	۲۴.۲	۲,۲۰۰	۲۲,۲۱۰	۲۱,۸۰۰	(۱.۸%)	۹.۹	-۰.۵۷	۱,۶۰۶	(۲۷.۰%)
طذوب ۱۱۴	ذوب	۵۰۰	۲۲	۷.۶	۶۶	۴۴۶	۴۳۴	(۲.۷%)	۶.۶	-۰.۹۳	۴۸	(۲۷.۳%)

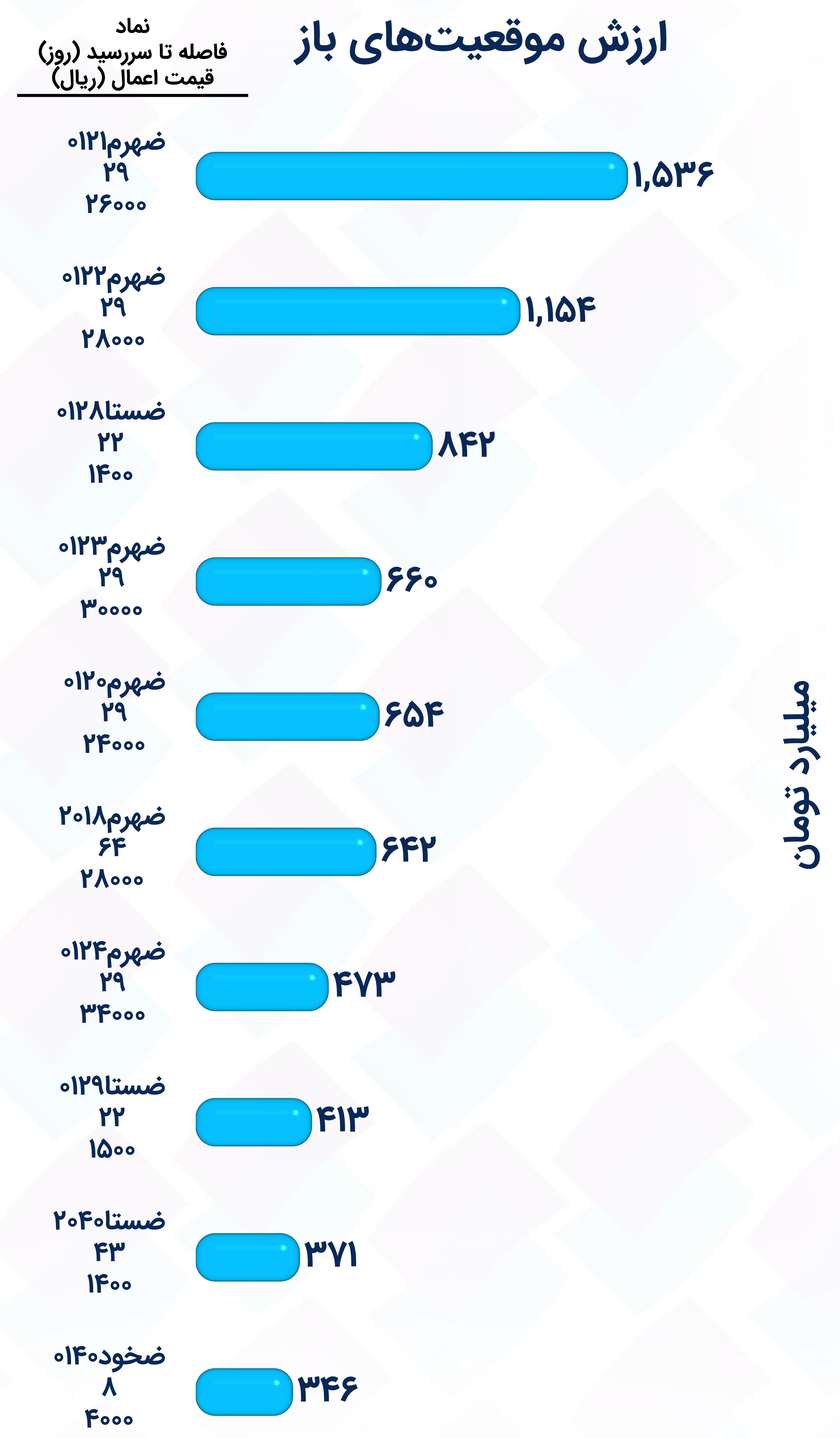
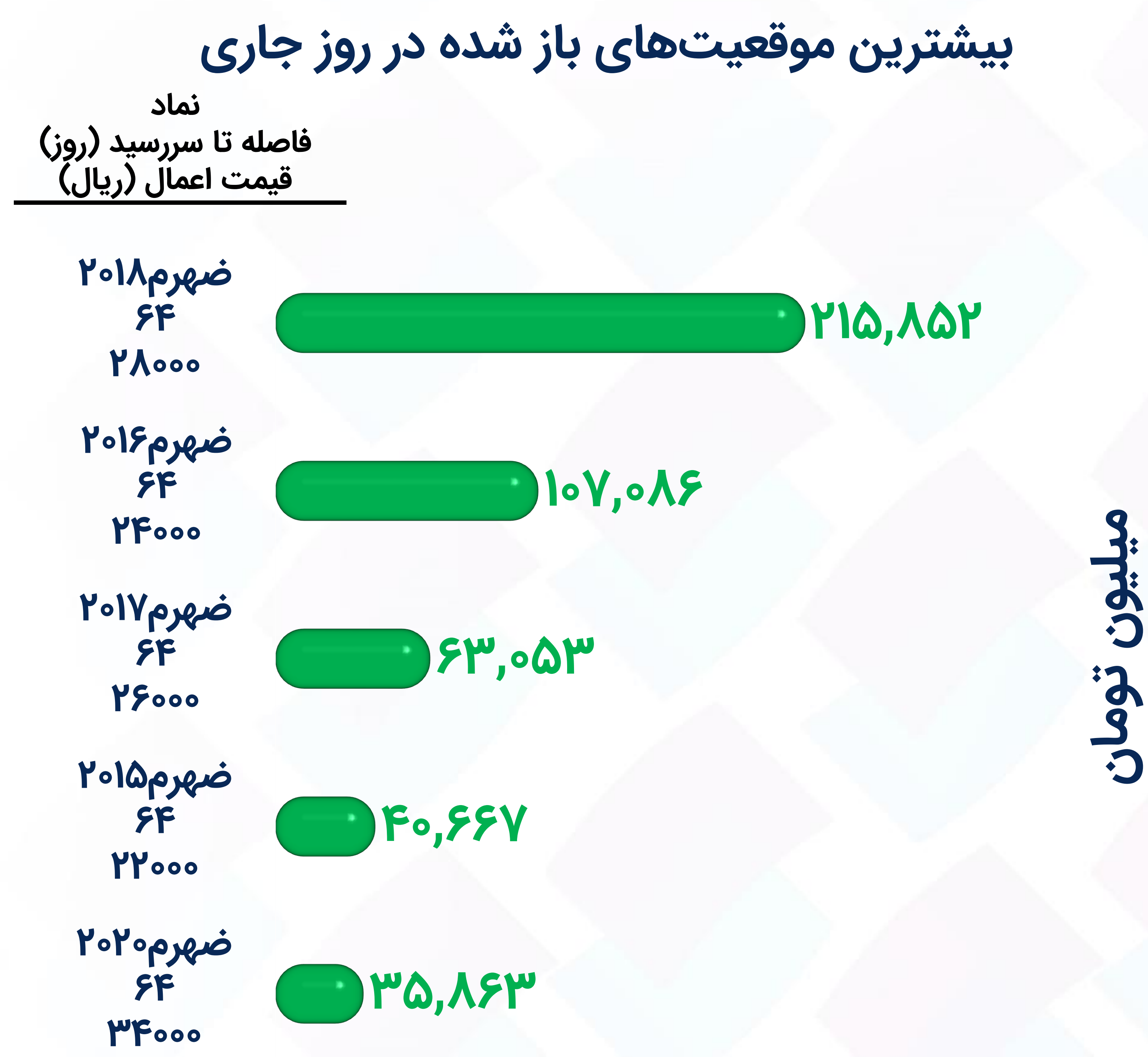
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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 ۱۲۰	شستا	۶۰۰	۲۲	۰.۰	۴	۱,۳۰۶	۵۹۶	(۵۴.۴%)	۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۱۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۲۲	۲.۵	۴	۱,۳۰۶	۱,۰۹۶	(۱۶.۱%)	۲۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طملت ۱۱۶	وبملت	۱,۷۶۰	۲۹	۰.۴	۱۶	۲,۱۰۱	۱,۷۴۴	(۱۷.۰%)	۱۰۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۷.۹%)
طخپارس ۲۱۱	خپارس	۶۵۰	۴۷	۰.۰	۱۹	۷۵۶	۶۳۱	(۱۶.۵%)	۳۳.۲	-۰.۰۲	۱	(۹۷.۴%)
طهرم ۱۱۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۹	۰.۰	۴	۲۴,۰۷۰	۱۷,۹۹۶	(۲۵.۲%)	۴,۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۷.۰%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



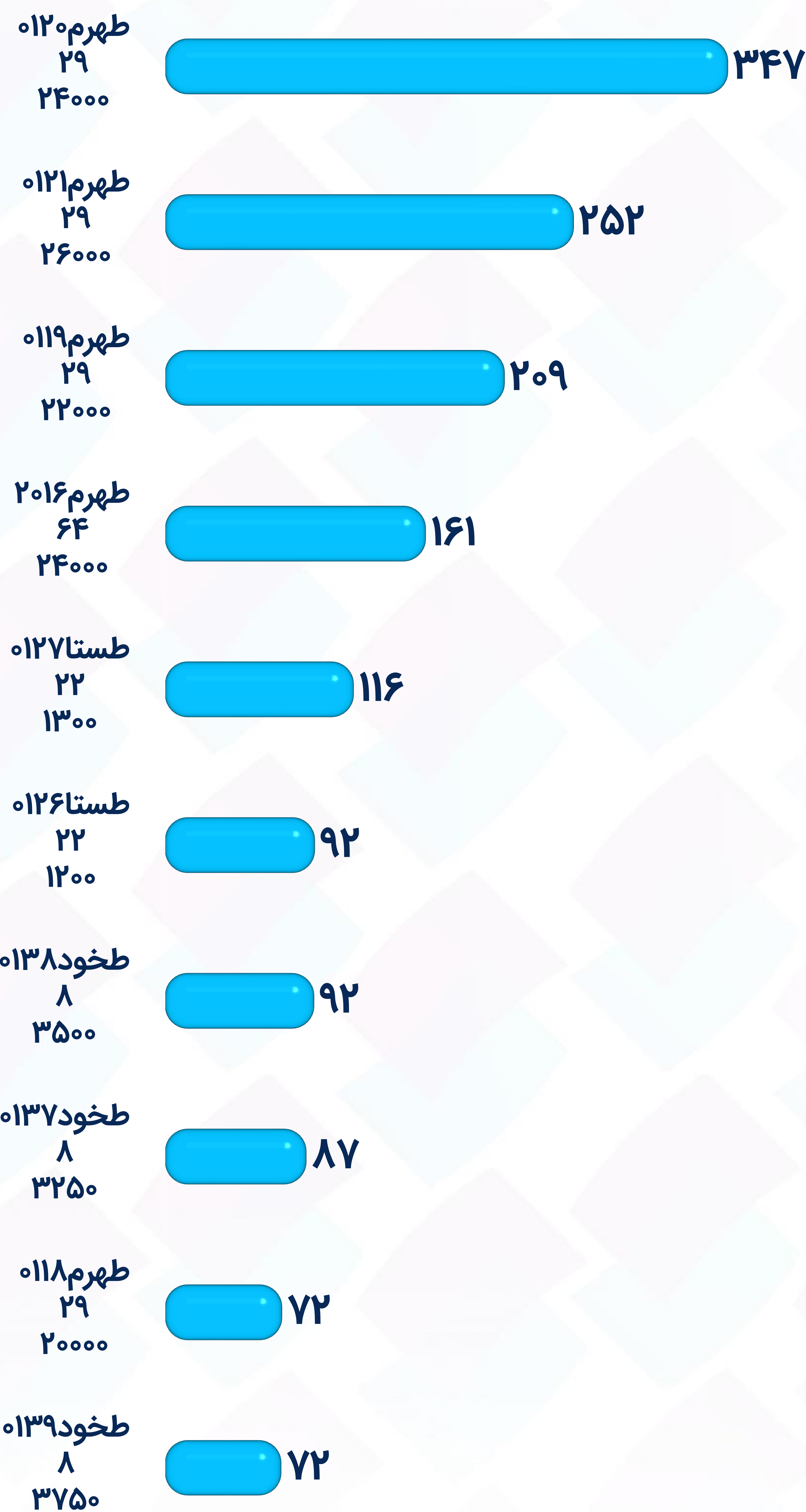
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

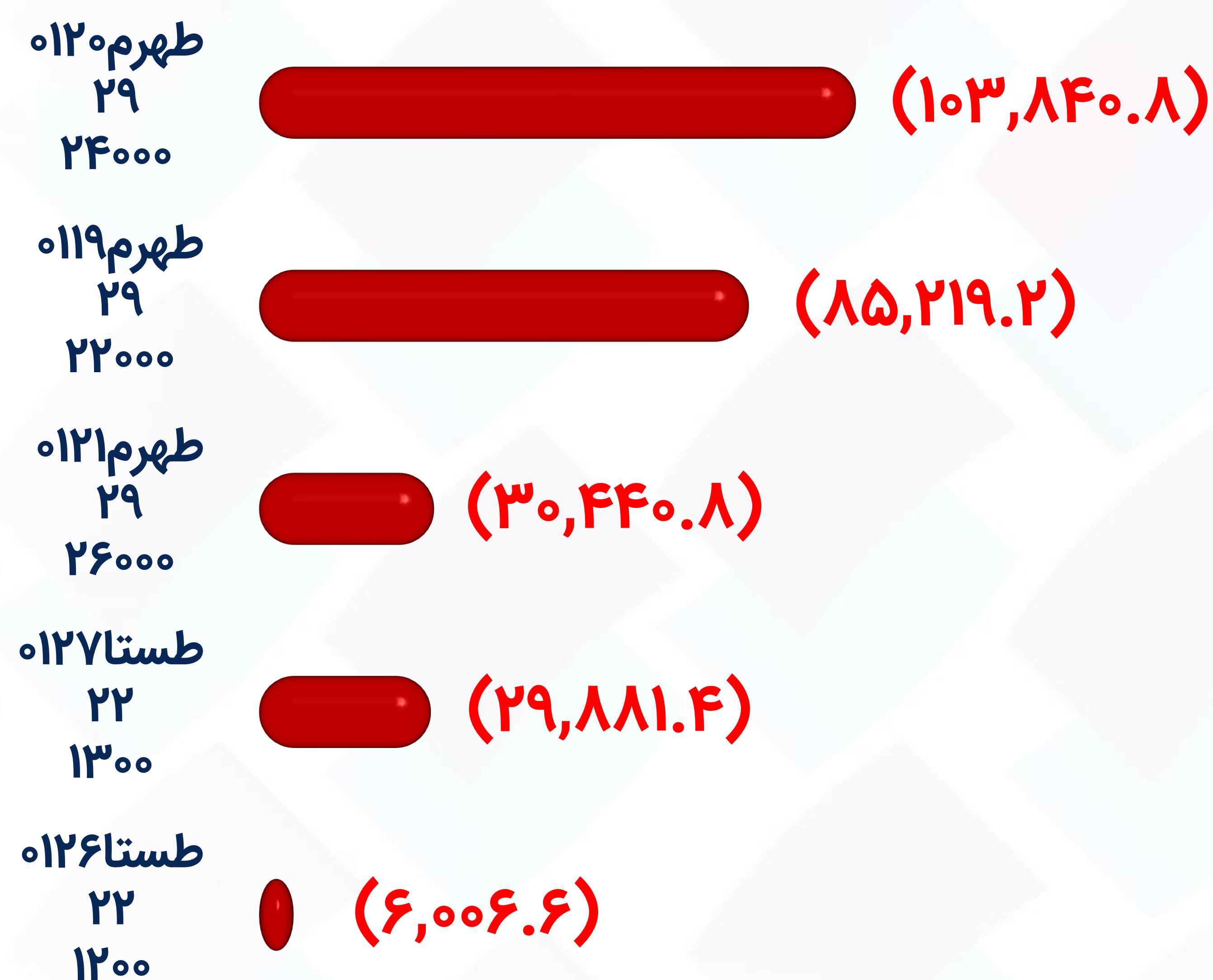
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

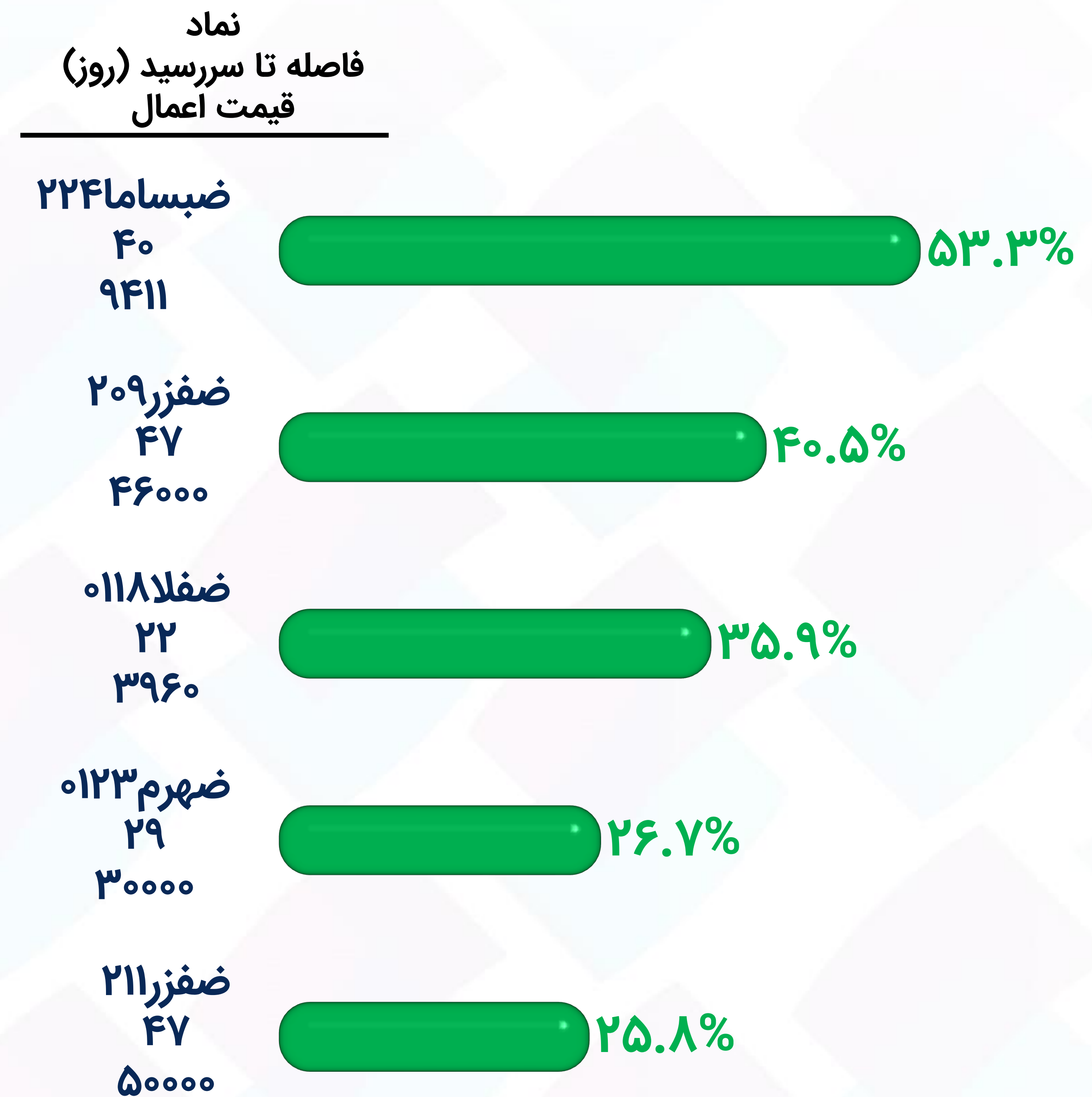
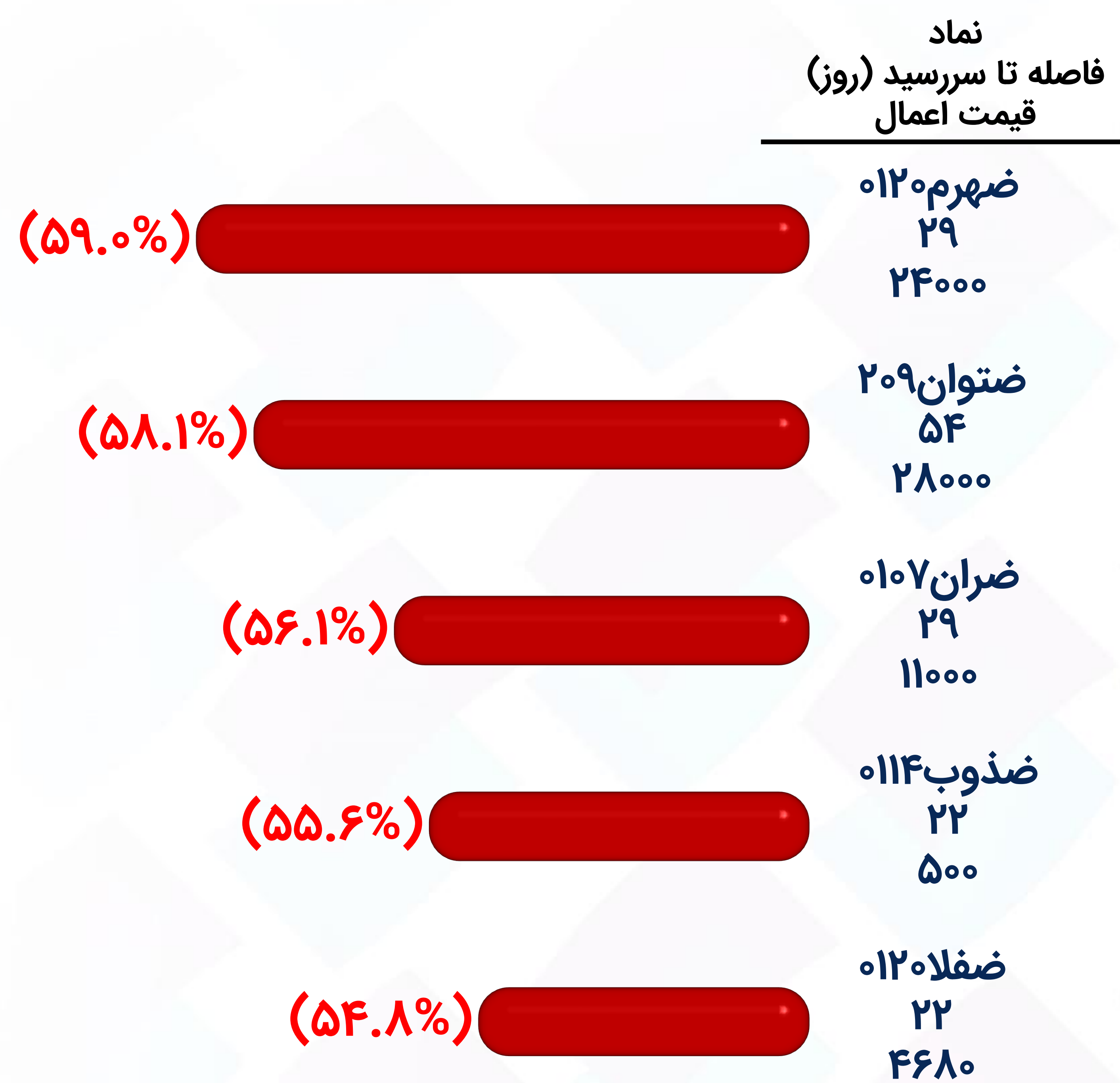
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



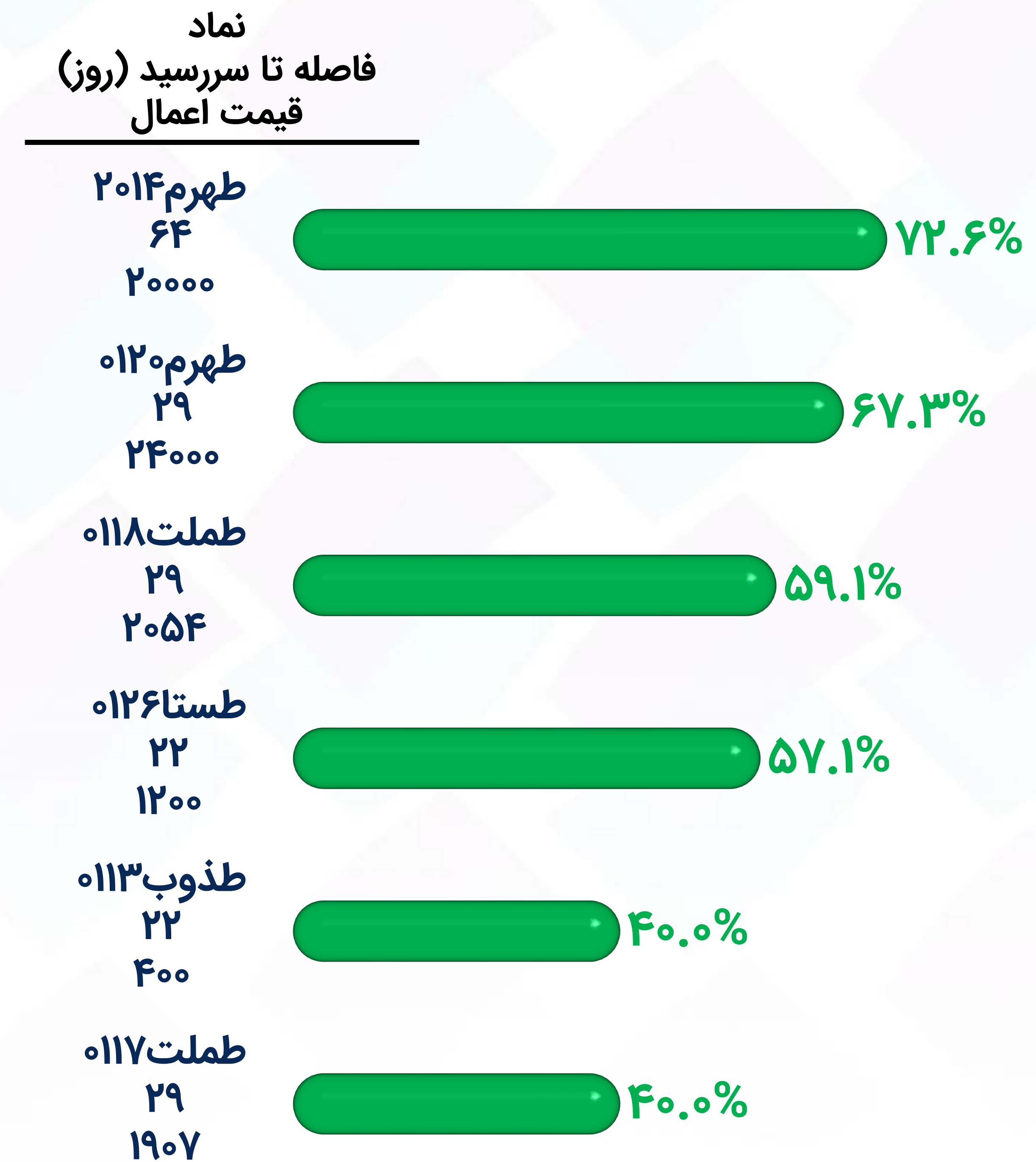
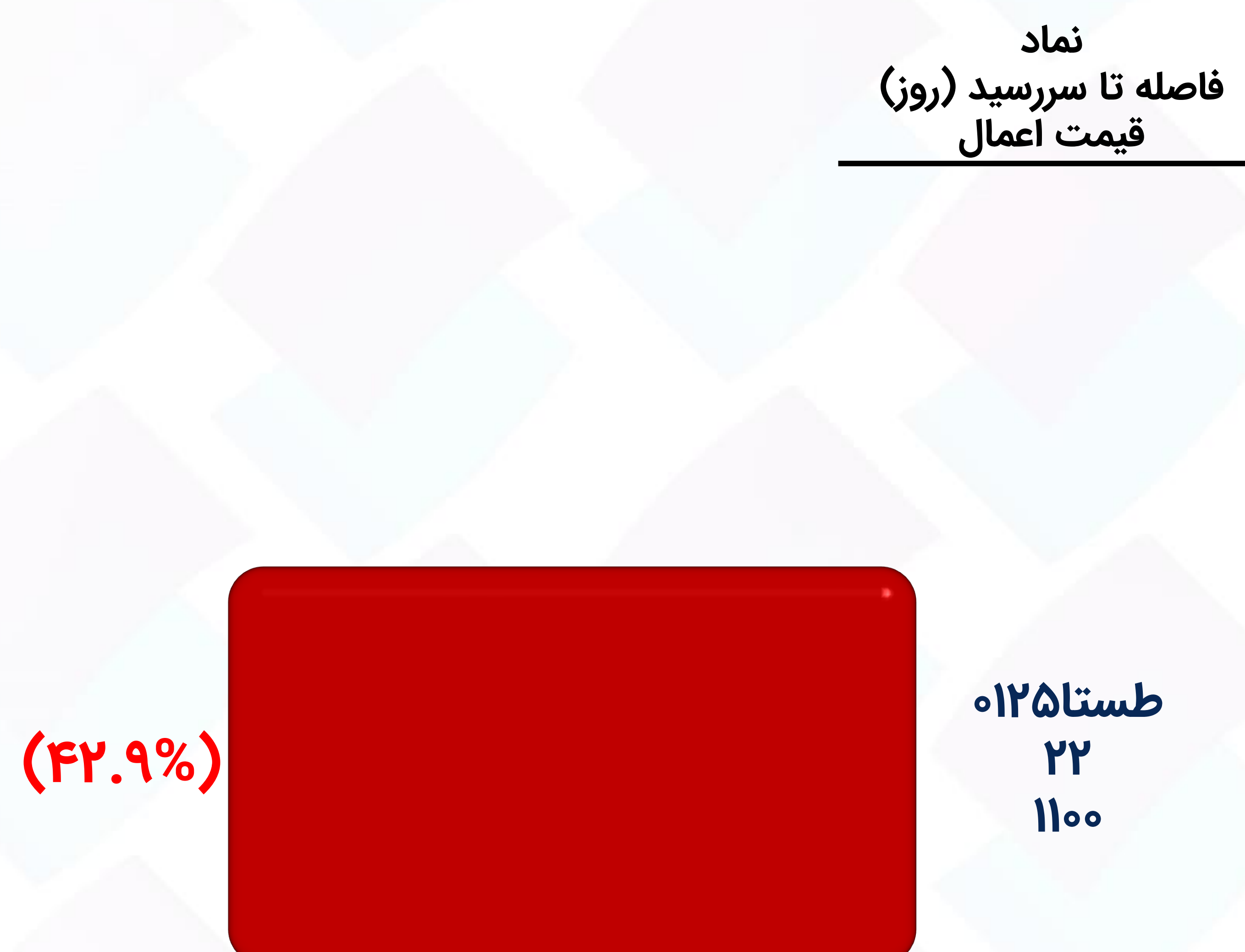
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

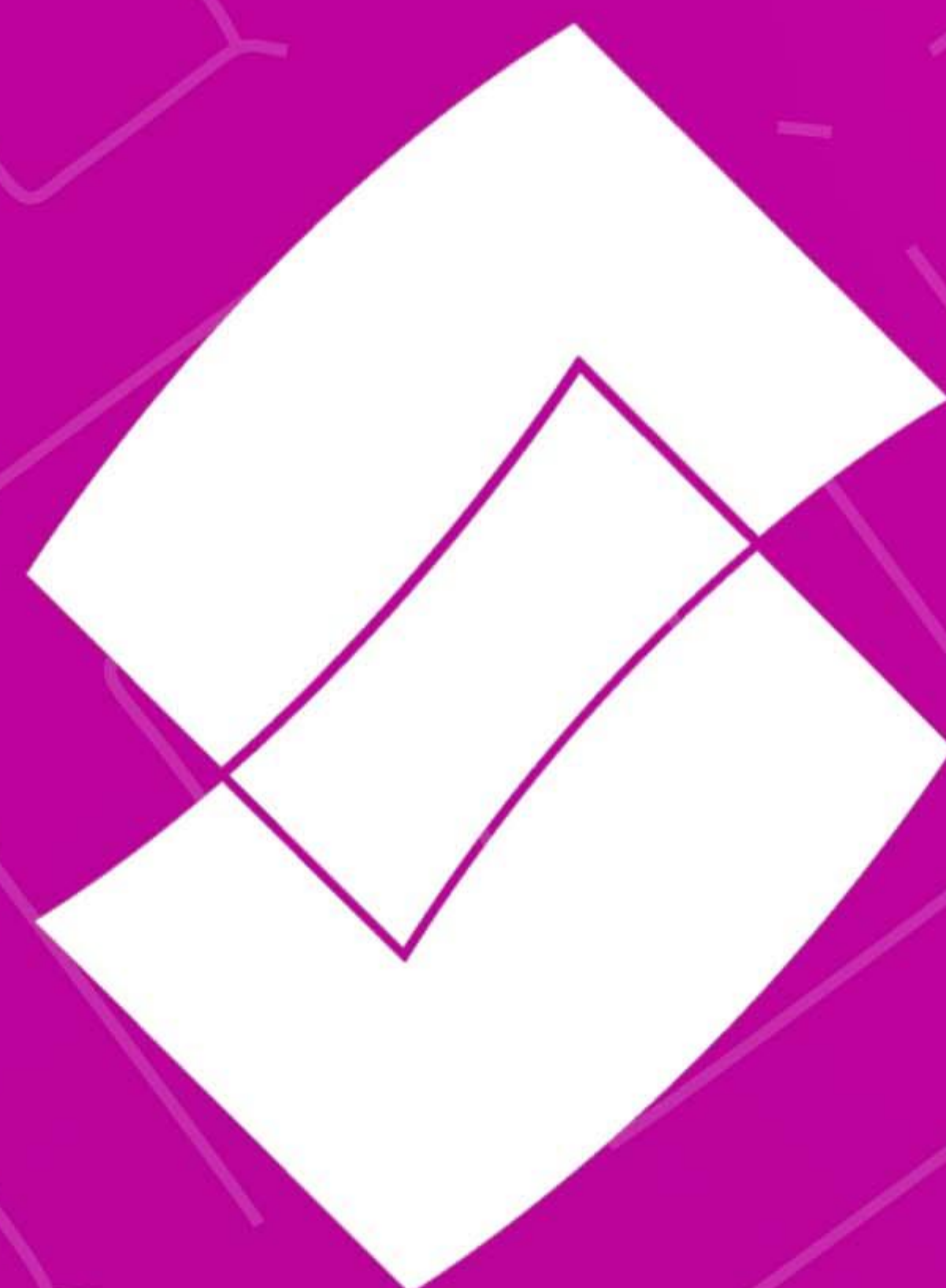
اختیار خرید



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.