

شماره
۴۳۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۱ اسفند ۱۴۰۳

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





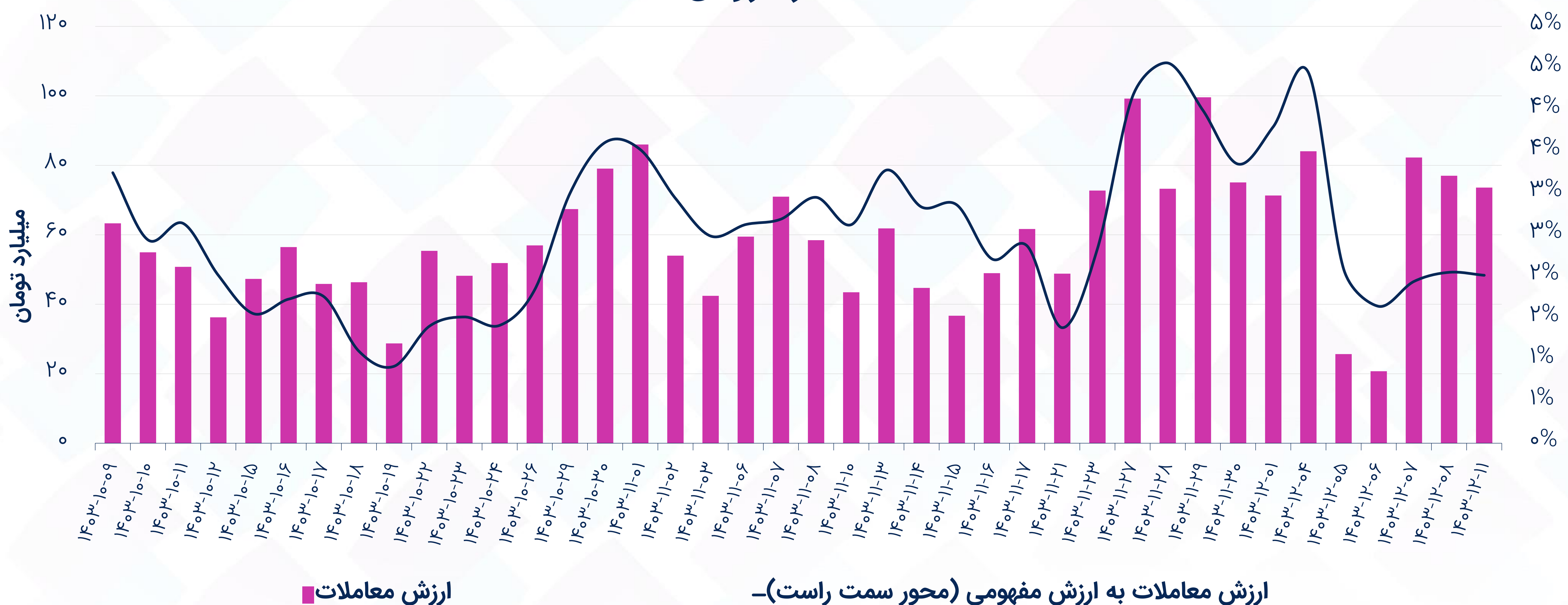
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



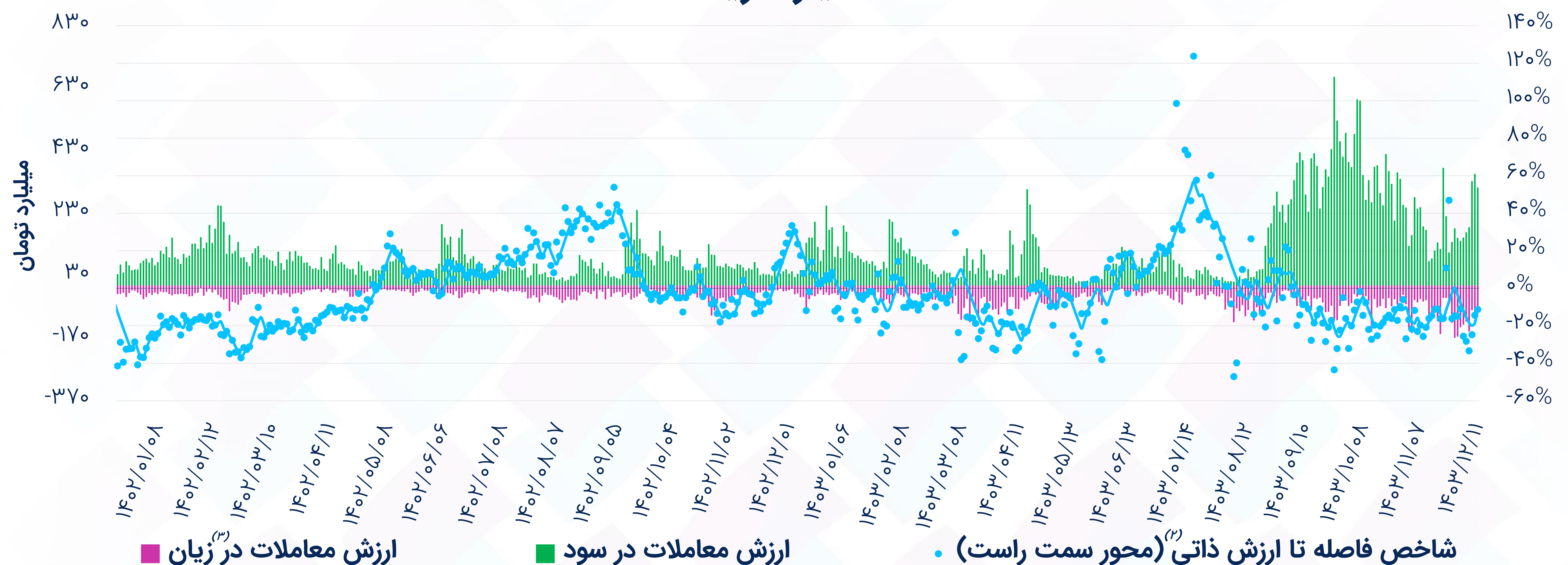
اختیار فروش



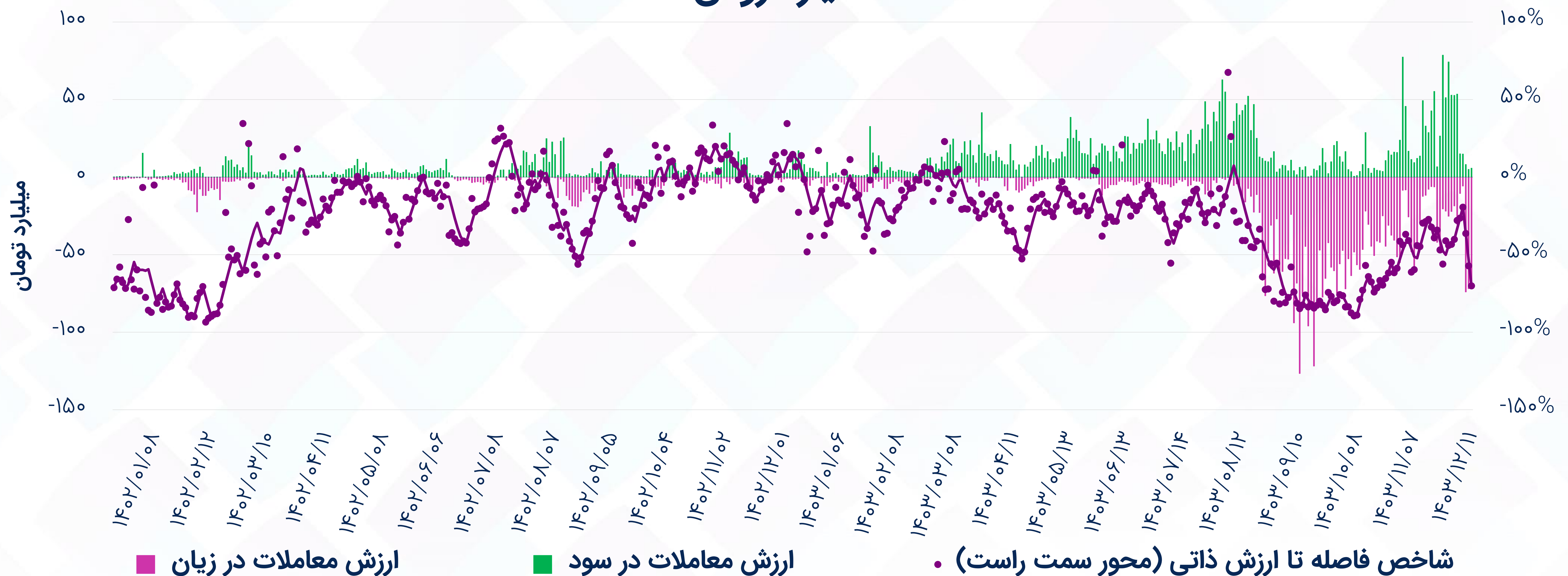
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۵۰	۲۳۰.۳	۳,۵۱۹.۷	۱۹۰.۳	۴۰.۰	(۸.۷%)
خودرو	۳۷	۶۹.۶	۷۱۶.۷	۶۲.۹	۶.۸	(۱۴.۹%)
شستا	۳۵	۲۹.۲	۳۷۹.۸	۱۲.۳	۱۶.۹	(۲۷.۸%)
خسپا	۲۳	۱۱.۴	۱۵۹.۸	۱۰.۶	۰.۸	(۱.۸%)
ذوب	۲۶	۱۰.۴	۱۴۴.۵	۷.۰	۳.۴	(۲۲.۰%)
وبملت	۱۹	۱۰.۱	۶۷.۲	۹.۷	۰.۴	(۲۰.۹%)
شپنا	۱۰	۵.۲	۲۵.۷	۵.۰	۰.۳	(۵.۷%)

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	۵۷,۹۲۷.۹	۲,۷۰۶,۲۳۳.۷	۵,۴۰۷.۱	۵۲,۵۲۰.۸	(۶۷.۶%)
خودرو	۸	۱۴,۲۴۶.۱	۸۸۶,۴۵۹.۴	۲۲.۸	۱۴,۲۲۳.۳	(۸۰.۹%)
شستا	۵	۱,۳۸۳.۸	۵۴,۸۳۴.۵	۳۴۸.۹	۱,۰۳۴.۸	(۶۵.۳%)
ذوب	۴	۱۴.۸	۴,۳۹۰.۱	۵.۶	۹.۲	(۷۱.۲%)
فزر	۱	۵.۵	۲۵۵.۵	۰.۰	۵.۵	(۱۰۰.۰%)
وتعاون	۱	۴.۴	۲۷۷.۹	۰.۰	۴.۴	(۷۶.۷%)
وبملت	۳	۳.۴	۷۸.۱	۰.۰	۳.۴	(۳۹.۸%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

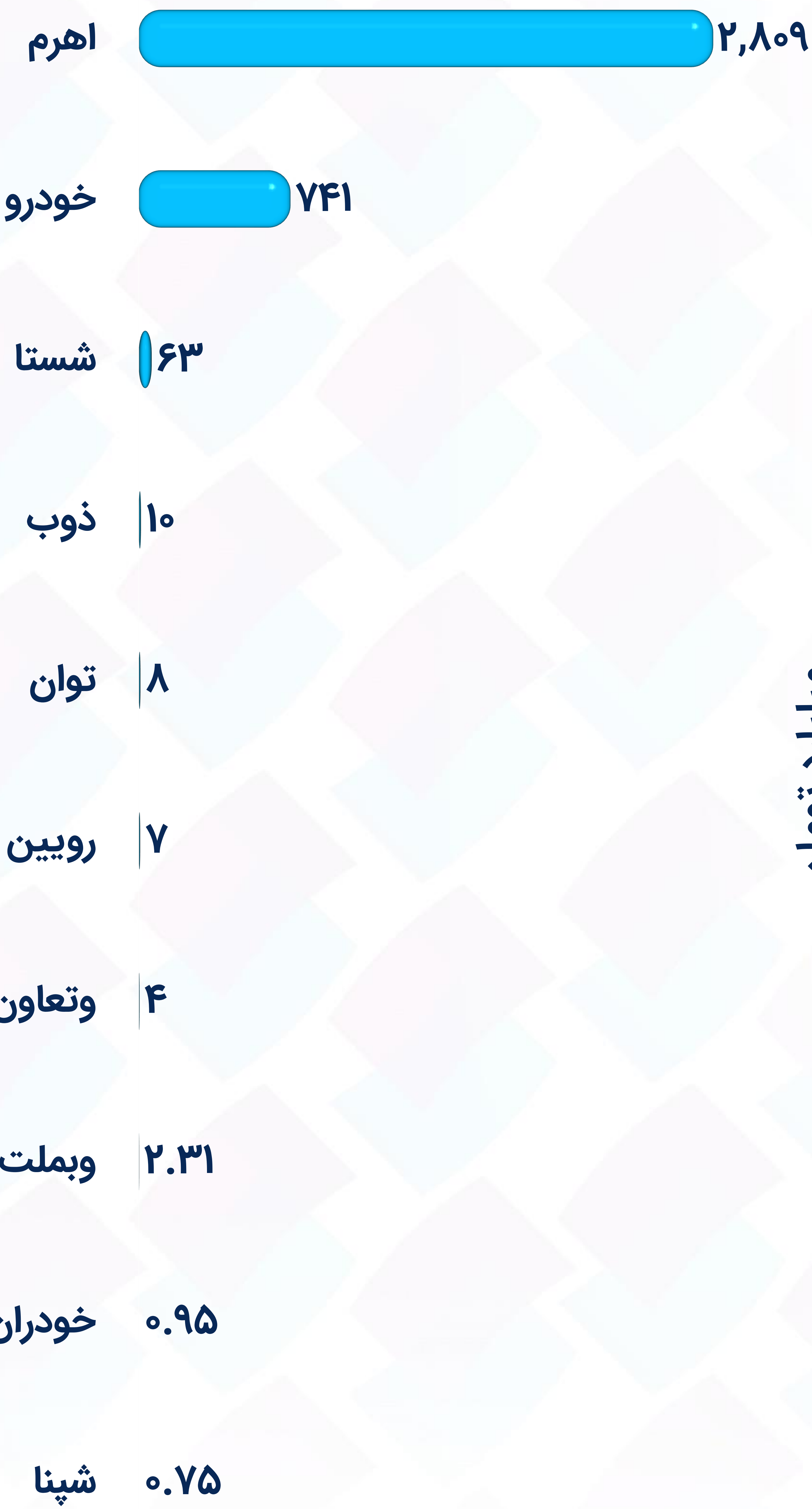


میلیارد تومان

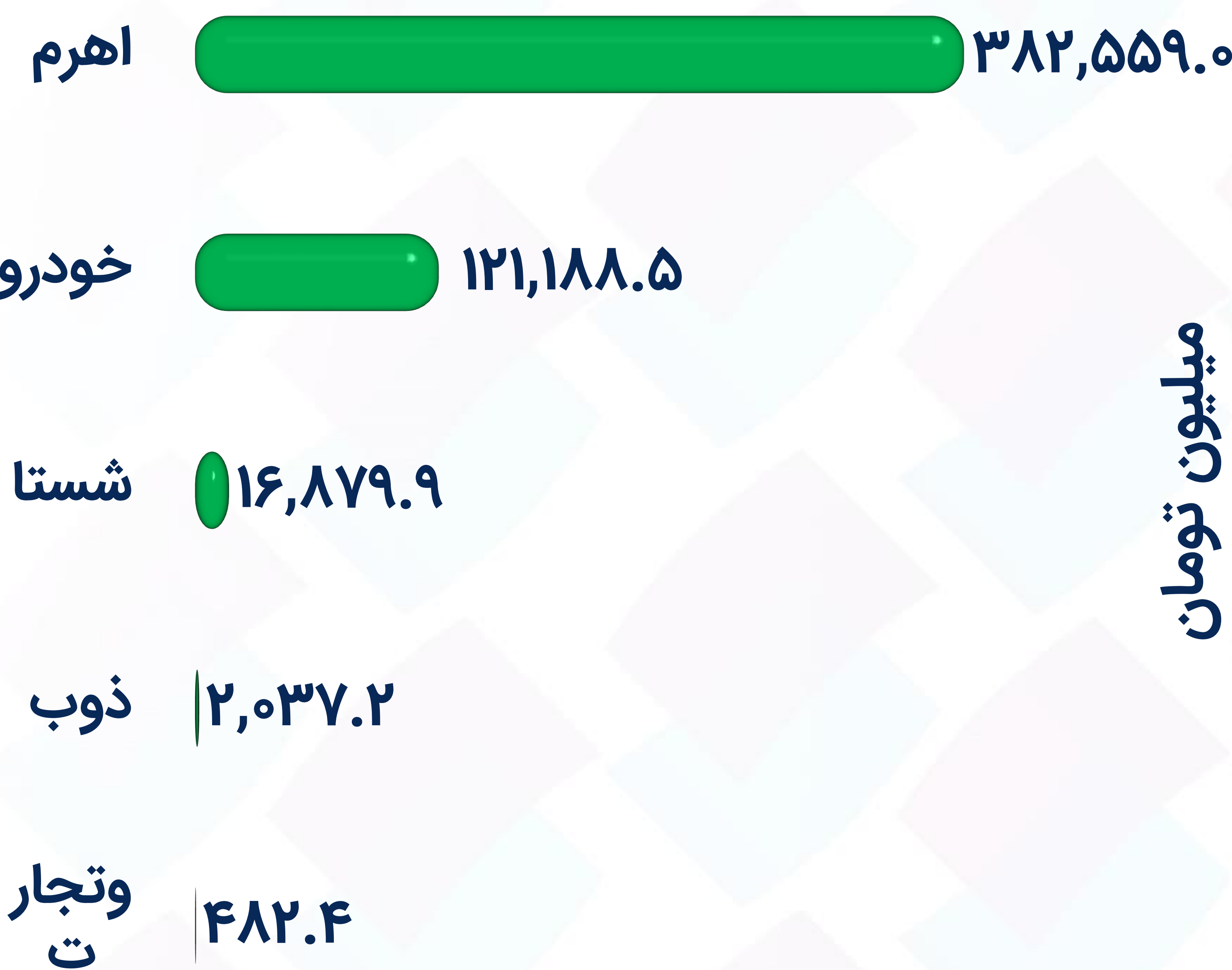
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

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 ۰۱۰۸	شتاب	۱۶,۰۰۰	۳۹	۲.۴	۳۰	۱۴,۶۷۰	۱۶,۰۳۰	۹.۳%	۵۳۴.۳	۰.۳۴	۳۴۸	۱۰۵۹%
ضجار ۱۲۲۲	وتجارت	۱,۹۰۰	۴	۱۰.۴	۴	۱,۸۲۶	۱,۹۰۴	۴.۳%	۴۷۶.۰	۰.۲۵	۱۲	۲۰۸%
ضجار ۱۲۲۱	وتجارت	۱,۸۰۰	۴	۱۶۱.۹	۲۲	۱,۸۲۶	۱,۸۲۲	(۰.۲%)	۸۲.۸	۰.۶۹	۵۶	۱۵۶%
ضاساس ۱۲۰۶	آساس	۵۰,۰۰۰	۱۵	۳.۰	۵۰۰	۴۸,۶۸۸	۵۰,۵۰۰	۳.۷%	۱۰۱.۰	۰.۴۴	۸۳۱	۶۶%
ضرویین ۱۲۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۱۵	۶۳.۶	۶۱۸	۱۲,۷۲۷	۱۲,۶۱۸	(۰.۹%)	۲۰.۴	۰.۹۳	۹۴۹	۵۴%

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 ۱۲۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۱	۱.۲	۱	۴۷۱	۷۰۱	۴۹%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۰۱۴۲	خودرو	۵,۰۰۰	۲۵	۲۹.۸	۱۵	۳,۷۸۰	۵,۰۱۵	۳۳%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۶۰	۶.۱	۳۱	۱,۳۶۳	۱,۹۳۱	۴۲%	۶۲.۳	۰.۰۱	۰	(۹۹%)
ضذوب ۱۲۰۴	ذوب	۶۰۰	۱۱	۴۲.۲	۱	۴۷۱	۶۰۱	۲۸%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸۱	۴۱۱.۶	۸۸۲	۲۷,۲۳۰	۴۲,۸۸۲	۵۷%	۴۸.۶	۰.۰۲	۳۲	(۹۶%)

(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
طجار۱۲۲۱	وتجارت	۱,۸۰۰	۴	۳.۳	۱۲	۱,۸۲۶	۱,۷۸۸	(۲.۱%)	۱۴۹.۰	-۰.۳۱	۱۸	۴۷.۷%
طخود۱۴۱۰	خودرو	۴,۵۰۰	۲۵	۲۰.۷	۶۰۳	۳,۷۸۰	۳,۸۹۷	۳.۱%	۶.۵	-۰.۹۶	۶۲۴	۳.۵%
طهرم۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۰۹	۱.۵	۷,۷۱۰	۲۷,۲۳۰	۳۰,۲۹۰	۱۱.۲%	۳.۹	-۰.۸۷	۷,۵۱۴	(۲.۵%)
طهرم۱۲۴۵	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۱	۱۰۷.۱	۳,۱۰۳	۲۷,۲۳۰	۲۶,۸۹۷	(۱.۲%)	۸.۷	-۰.۸۶	۲,۴۸۲	(۲۰.۰%)
طذوب۱۲۰۳	ذوب	۵۰۰	۱۱	۵.۶	۴۴	۴۷۱	۴۵۶	(۳.۲%)	۱۰.۴	-۰.۷۲	۲۸	(۳۶.۹%)

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
طهرم۱۲۴۰	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۱	۲۰.۸	۲۰	۲۷,۲۳۰	۱۹,۹۸۰	(۲۶.۶%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۱۳۵۰	خودرو	۲,۸۰۰	۲۵	۱۶.۶	۸	۳,۷۸۰	۲,۷۹۲	(۲۶.۱%)	۳۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۱۲۴۱	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۱	۱۹۵.۱	۴۲	۲۷,۲۳۰	۲۱,۹۵۸	(۱۹.۴%)	۵۲۲.۸	۰.۰۰	۰	(۹۸.۹%)
طخود۱۳۶۰	خودرو	۳,۰۰۰	۲۵	۹۹.۷	۸	۳,۷۸۰	۲,۹۹۲	(۲۰.۸%)	۳۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۸%)
طخود۱۳۷۰	خودرو	۳,۲۵۰	۲۵	۲,۴۹۹.۷	۲۹	۳,۷۸۰	۳,۲۲۱	(۱۴.۸%)	۱۱۱.۱	-۰.۰۲	۲	(۹۳.۰%)

(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)

۱۲۴۳ ضهرم ۱۱ ۲۶۰۰۰ ۱,۲۷۴

۱۲۴۴ ضهرم ۱۱ ۲۸۰۰۰ ۸۷۸

۱۲۴۵ ضهرم ۱۱ ۳۰۰۰۰ ۸۱۷

۱۲۴۲ ضهرم ۱۱ ۲۴۰۰۰ ۶۲۲

۰۱۲۸ ضستا ۳۹ ۱۴۰۰ ۵۵۸

۰۱۲۱ ضهرم ۴۶ ۲۶۰۰۰ ۴۷۲

۰۱۲۲ ضهرم ۴۶ ۲۸۰۰۰ ۴۰۵

۰۱۴۰ ضخود ۲۵ ۴۰۰۰ ۳۶۰

۱۲۴۱ ضهرم ۱۱ ۲۲۰۰۰ ۳۰۵

۰۱۳۸ ضخود ۲۵ ۳۵۰۰ ۲۷۷

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

۰۱۲۱ ضهرم ۴۶ ۲۶۰۰۰ ۶۲,۲۲۸

۲۰۴۰ ضستا ۶۰ ۱۴۰۰ ۴۳,۷۰۶

۰۱۲۲ ضهرم ۴۶ ۲۸۰۰۰ ۲۹,۵۸۸

۰۱۲۸ ضستا ۳۹ ۱۴۰۰ ۲۴,۵۴۶

۱۲۰۳ ضذوب ۱۱ ۵۰۰ ۲۳,۳۴۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

۱۲۴۳ ضهرم ۱۱ ۲۶۰۰۰ (۵۶,۱۱۵.۸)

۱۲۴۴ ضهرم ۱۱ ۲۸۰۰۰ (۱۴,۱۹۶.۰)

۰۱۳۷ ضخود ۲۵ ۳۲۵۰ (۱۱,۸۱۷.۳)

۱۲۴۱ ضهرم ۱۱ ۲۲۰۰۰ (۷,۲۳۸.۰)

۱۲۴۰ ضهرم ۱۱ ۲۰۰۰۰ (۵,۹۰۸.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

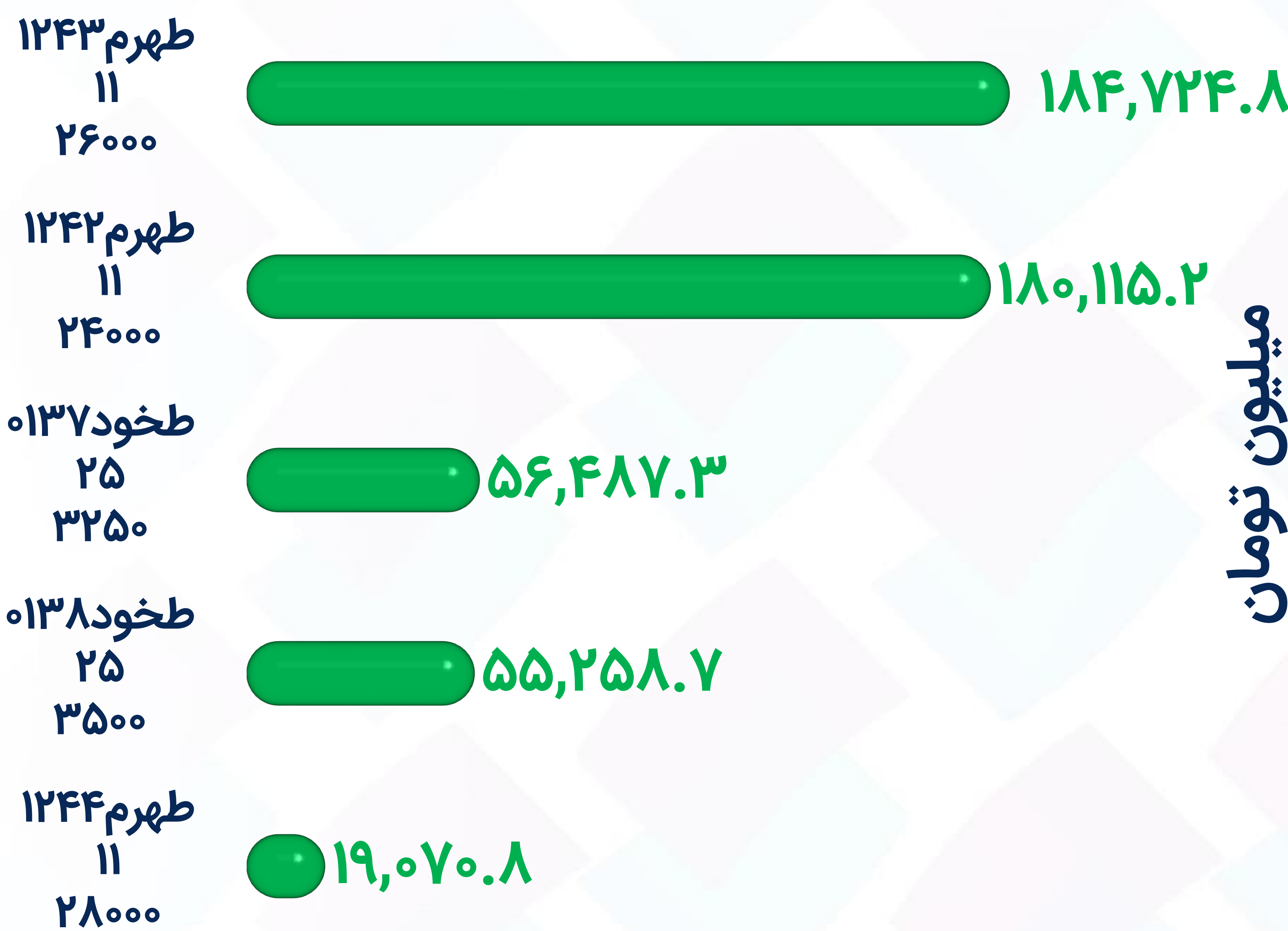
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

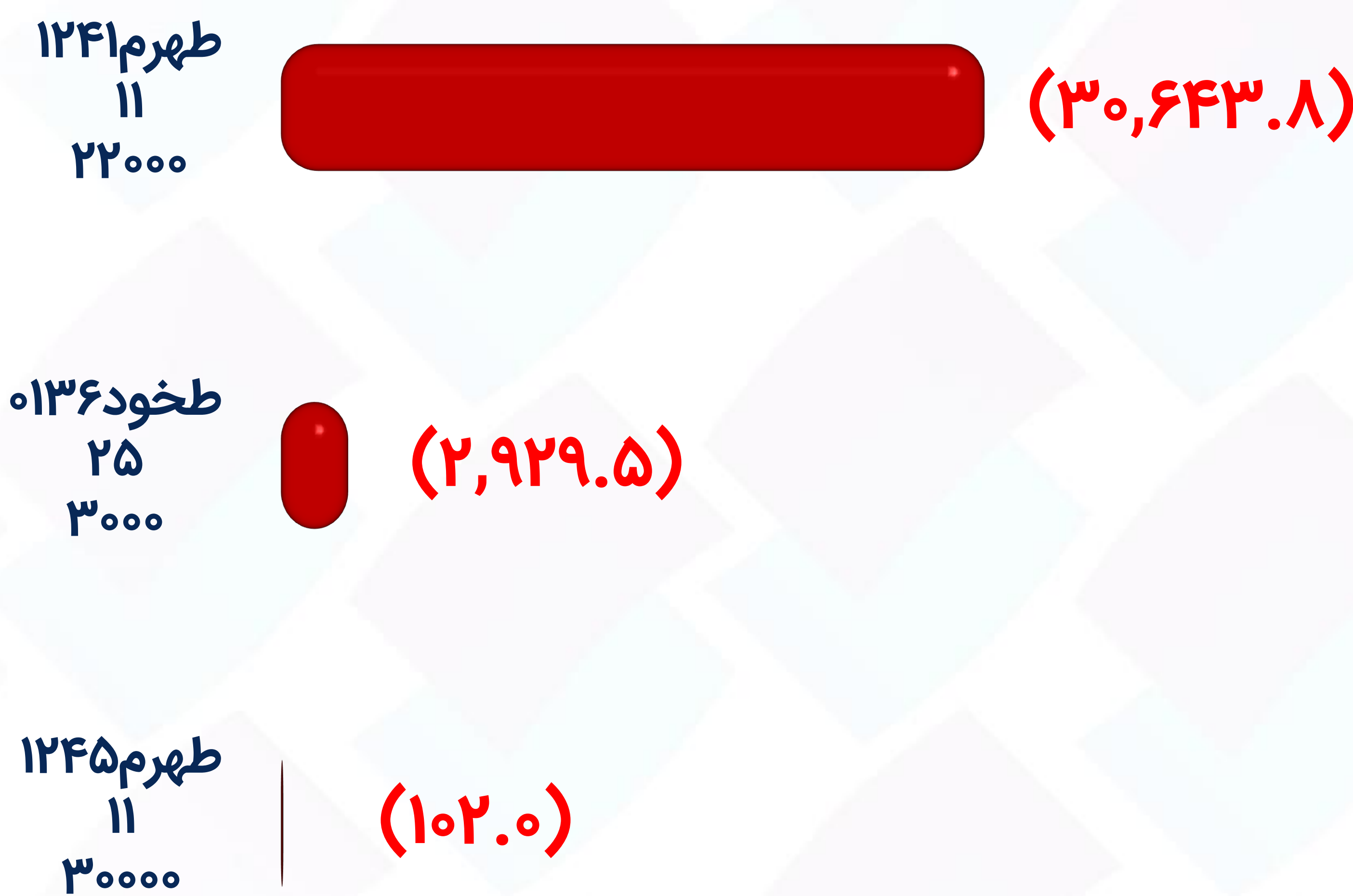
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



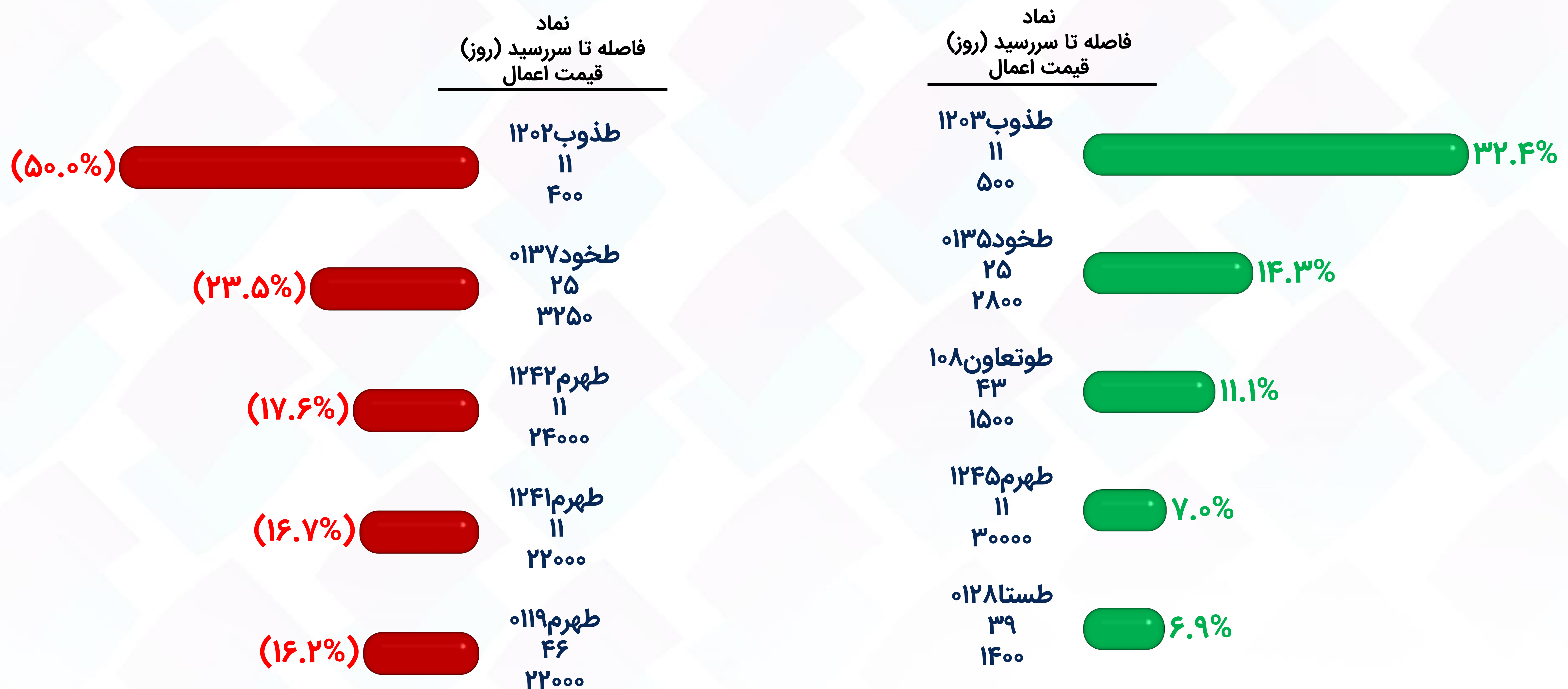
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

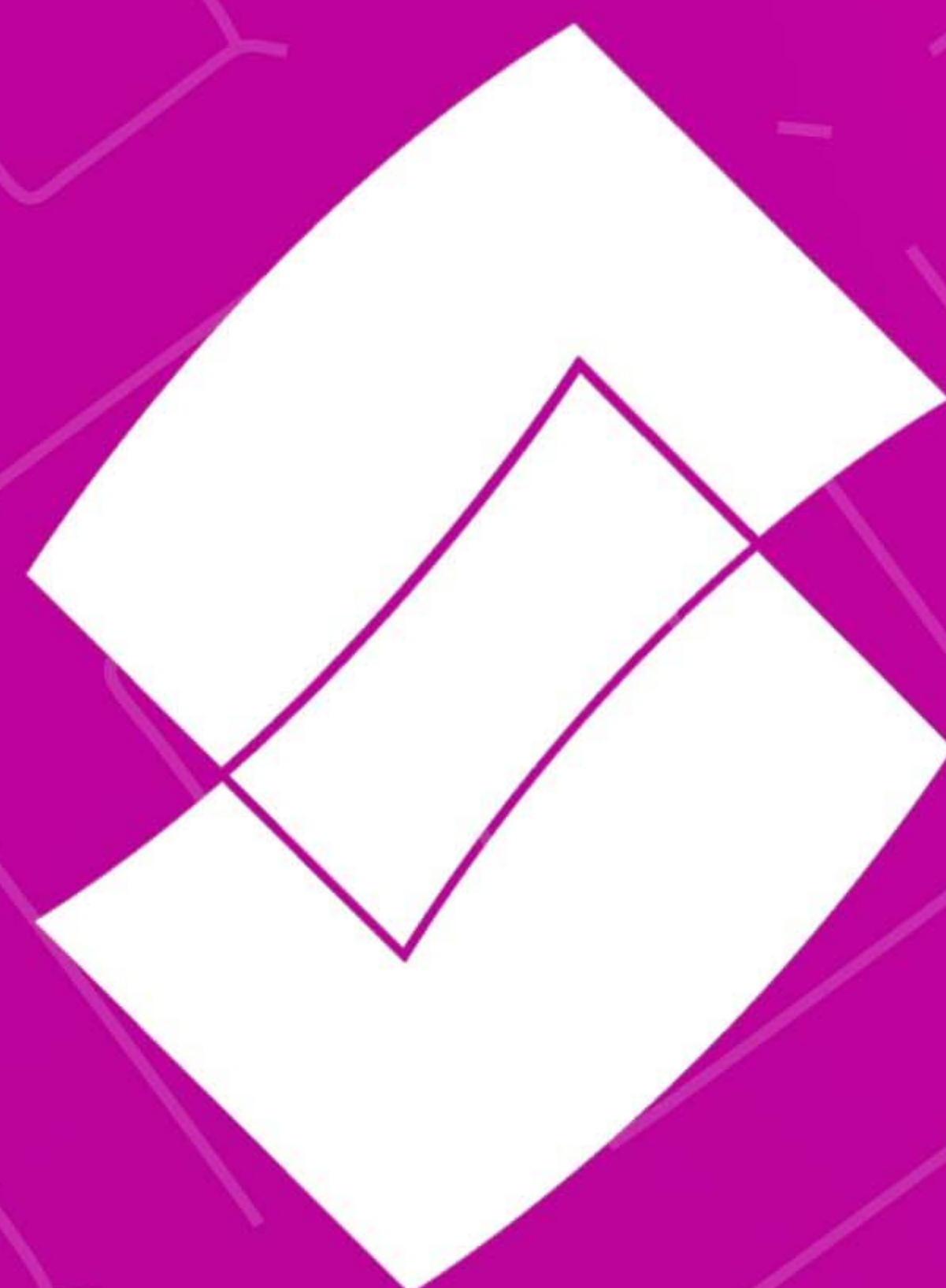
اختیار خرید



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.