

شماره
۴۴۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۶ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





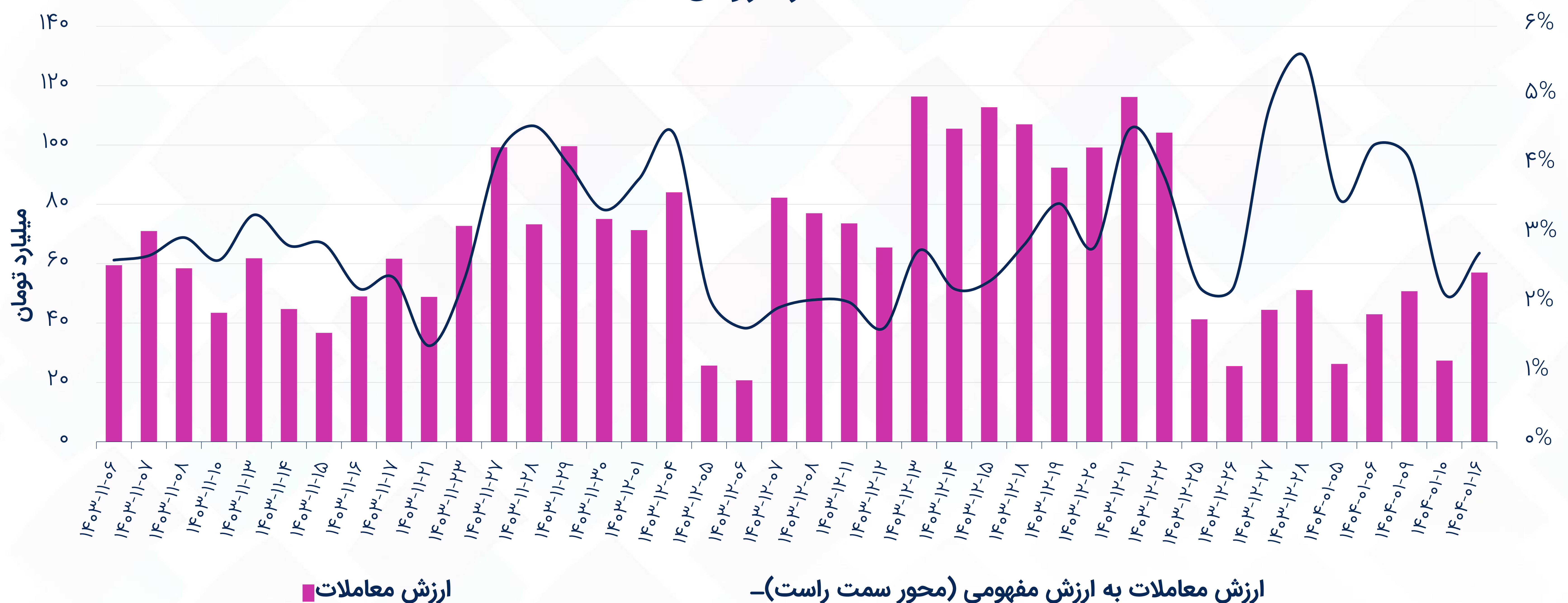
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



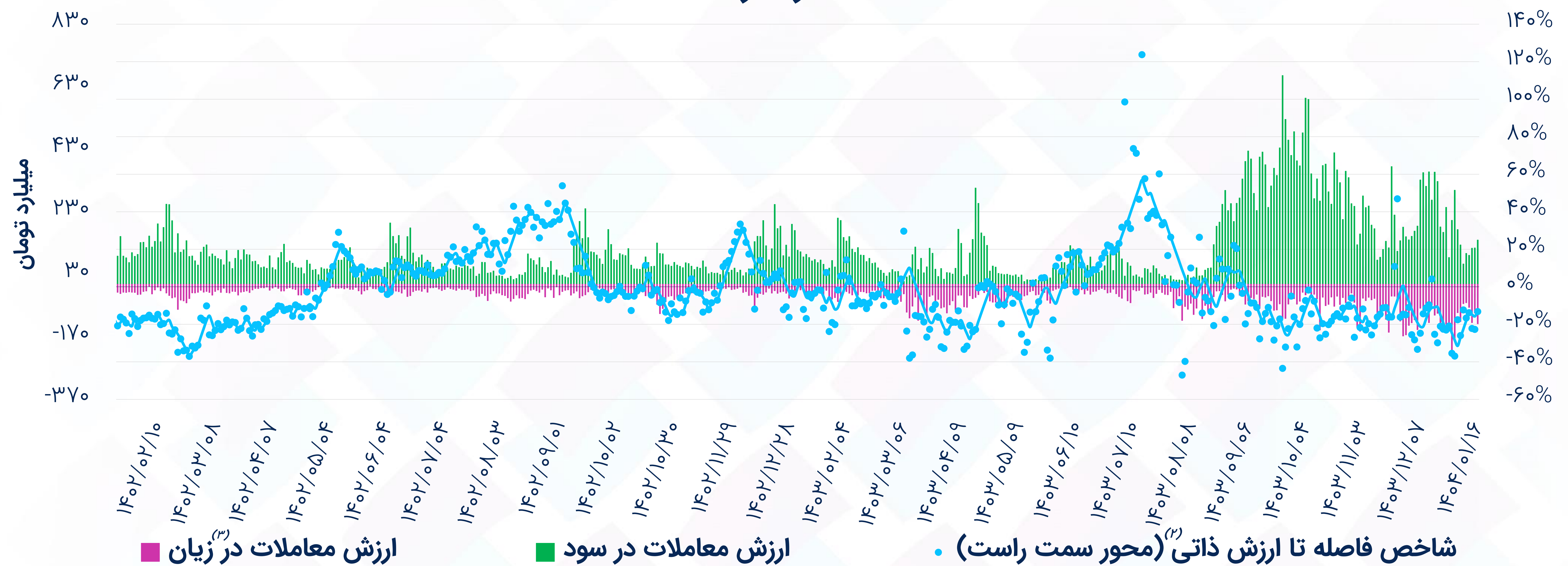
اختیار فروش



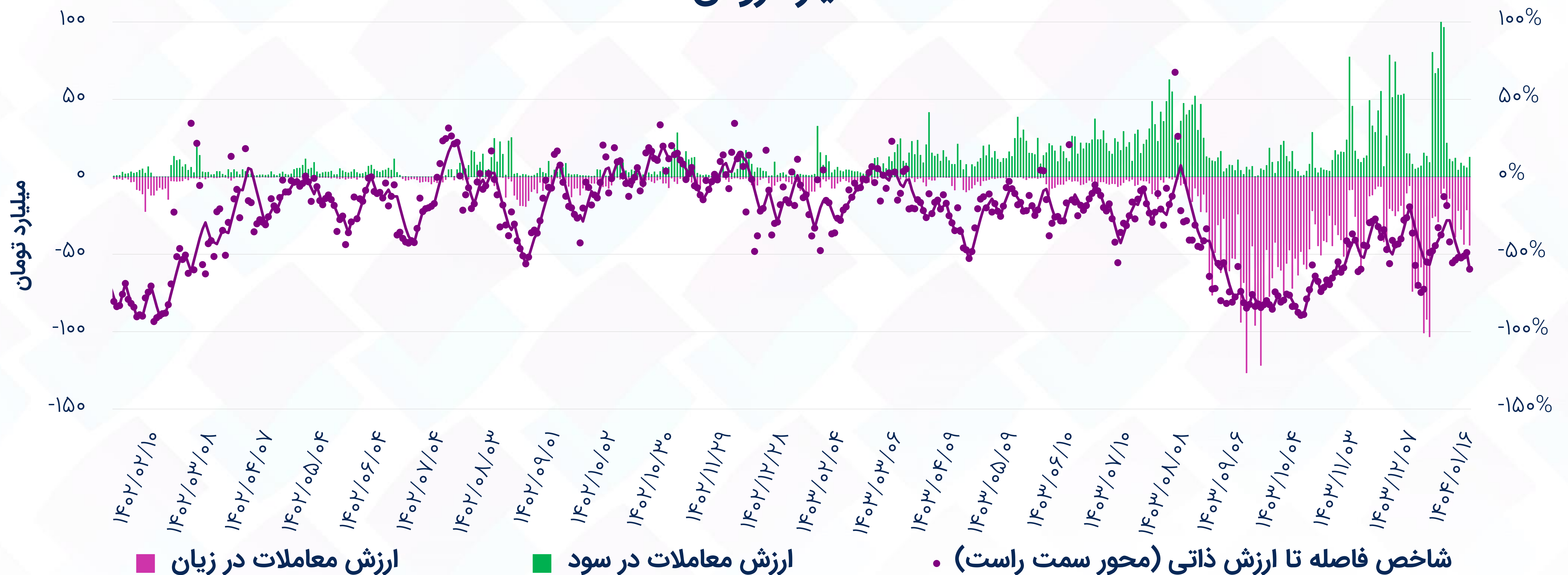
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۴	۱۸۸.۶	۳,۵۸۳.۸	۷۱.۲	۱۱۷.۴	(۲۰.۵%)
وبملت	۲۴	۳۴.۹	۳۴۱.۶	۳۴.۴	۰.۵	۱۱.۵%
شستا	۴۲	۱۶.۷	۷۱۹.۶	۱۱.۳	۵.۴	۷.۶%
ذوب	۲۲	۱۰.۱	۱۱۴.۴	۸.۷	۱.۳	(۹.۹%)
وبصادر	۹	۶.۶	۳۷.۹	۴.۶	۲.۰	(۱۸.۰%)
وتجارت	۸	۲.۰	۲۴.۴	۰.۷	۱.۳	(۵۰.۰%)
موج	۶	۱.۹	۱۲.۲	۱.۸	۰.۱	(۱.۴%)

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	۵۵,۰۹۵.۲	۱,۹۰۶,۱۲۹.۳	۱۱,۴۵۰.۵	۴۳,۶۴۴.۷	(۶۰.۱%)
شستا	۹	۱,۸۴۸.۳	۱۶۸,۹۶۹.۲	۱,۲۴۴.۹	۶۰۳.۴	(۴۵.۵%)
وبملت	۳	۳۳.۹	۱۶,۱۱۸.۳	۰.۰	۳۳.۹	(۹۷.۹%)
بساما	۱	۲۴.۰	۴۴۲.۹	۲۴.۰	۰.۰	(۶۰.۹%)
وبصادر	۲	۶.۹	۱۹۳.۸	۰.۰	۶.۹	(۸۸.۳%)
ذوب	۴	۳.۷	۴۰۰.۲	۲.۰	۱.۷	(۴۹.۵%)
فولاد	۲	۱.۹	۴۱۶.۸	۰.۰	۱.۹	(۸۰.۲%)

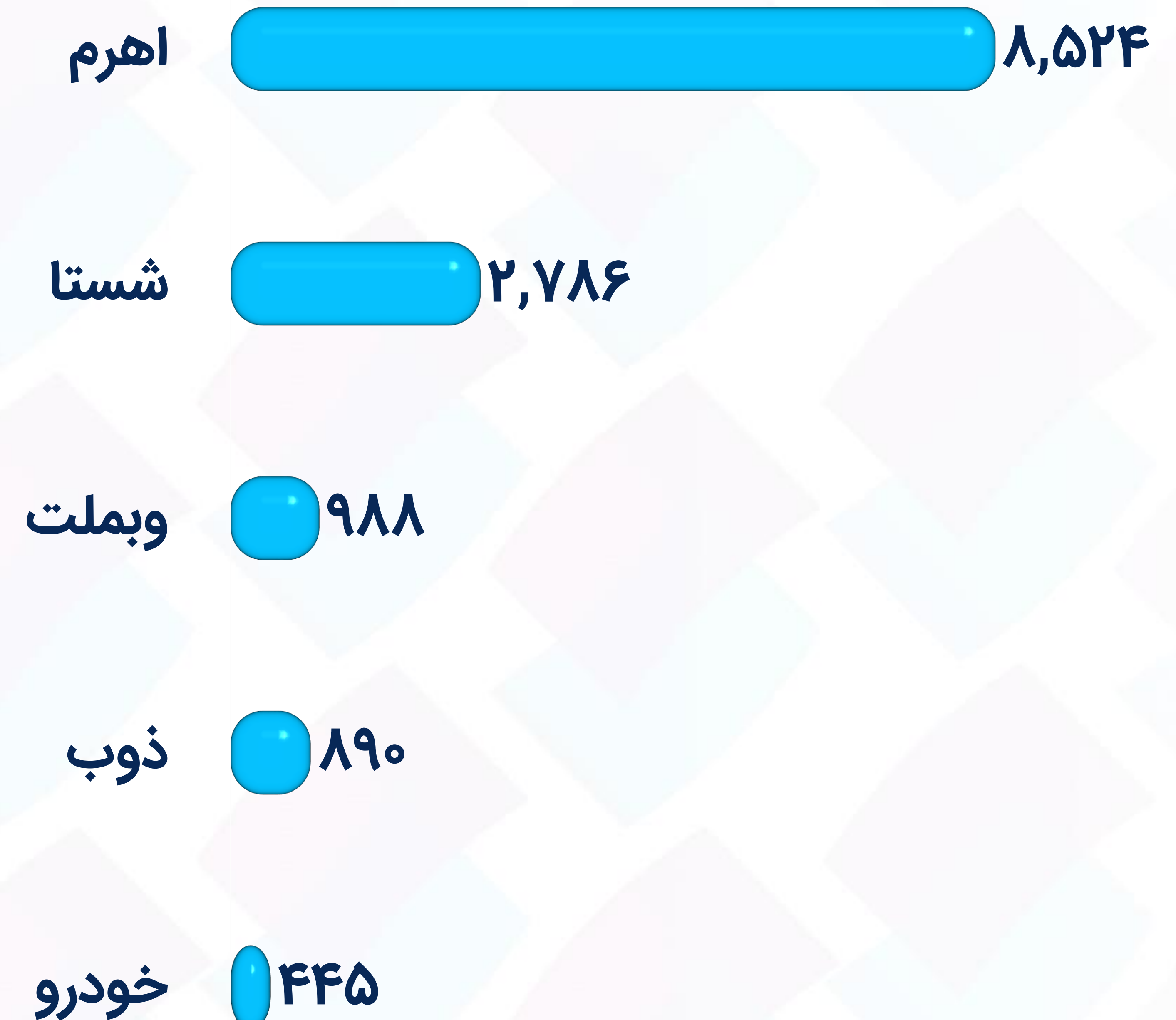
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۲,۲۷۲

شستا ۳۶۵

وبملت ۴۷

وتعاون ۸

بساما ۸

ذوب ۸

نارنج اهرم ۵

خودرو ۳.۳۰

خودران ۱.۹۰

توان ۱.۱۷

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۳۶۷,۲۲۵.۴

شستا ۹,۳۵۱.۲

وبملت ۵,۶۰۲.۰

وبصادر ۱۷۰.۰

ذوب ۱۳۰.۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

توان (۱۲.۰)

خودران (۱.۰)

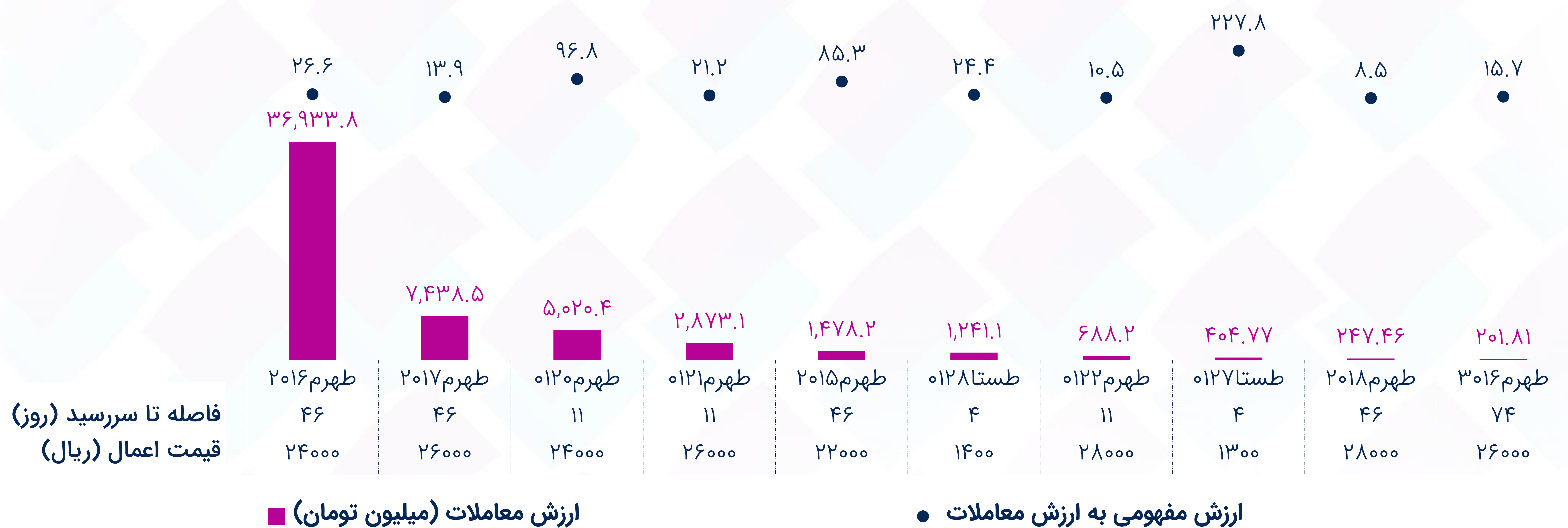
میلیون تومان

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
ضبساما ۲۲۱	بساما	۷,۹۱۱	۲۲	۱۷.۲	۷۰۲	۹,۲۲۰	۸,۶۱۳	(۶.۶%)	۱۲.۳	۱.۰۰	۱,۴۹۷	۱۱۳%
ضتاب ۱۰۷	شتاب	۱۵,۰۰۰	۴	۱.۳	۶	۱۳,۵۴۰	۱۵,۰۰۶	۱۰.۸%	۲,۵۰۱.۰	۰.۰۴	۱۱	۸۳%
ضبساما ۲۱۹	بساما	۷,۰۷۸	۲۲	۱,۰۹۸.۴	۱,۵۲۴	۹,۲۲۰	۸,۶۰۲	(۶.۷%)	۵.۶	۱.۰۰	۲,۳۱۰	۵۲%
ضران ۱۰۶	خودران	۱۰,۰۰۰	۱۱	۱.۱	۳۳۱	۱۰,۱۸۰	۱۰,۳۳۱	۱.۵%	۳۱.۲	۰.۶۹	۴۷۲	۴۳%
ضملت ۱۲۰	وبملت	۲,۳۴۷	۱۱	۳,۰۷۵.۵	۸۹	۲,۴۱۲	۲,۴۳۶	۱.۰%	۲۷.۴	۰.۷۴	۱۲۳	۳۹%

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
ضستا ۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۴	۴.۱	۱	۱,۳۶۷	۱,۷۰۱	۲۴%	۱,۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴	شستا	۱,۹۰۰	۲۵	۱.۳	۴	۱,۳۶۷	۱,۹۰۴	۳۹%	۴۷۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۳۰	شستا	۱,۶۰۰	۴	۴.۷	۱	۱,۳۶۷	۱,۶۰۱	۱۷%	۱,۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۱	۱۱۴.۹	۲۱	۲۵,۷۵۰	۳۴,۰۲۱	۳۲%	۱,۶۲۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۶	۴۹.۳	۱۳۳	۲۵,۷۵۰	۴۲,۱۳۳	۶۴%	۳۱۶.۸	۰.۰۰	۱	(۹۹%)

(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
طذوب ۱۱۴۰	ذوب	۵۰۰	۴	۲۰	۴۸	۴۵۵	۴۵۲	(۰.۷%)	۹.۴	-۰.۹۶	۴۲	(۱۳.۰%)
طهرم ۱۲۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۱	۶۸۸.۲	۲,۴۶۱	۲۵,۷۵۰	۲۵,۵۳۹	(۰.۸%)	۱۰.۴	-۰.۸۲	۲,۰۳۴	(۱۷.۳%)
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴۶	۱.۳	۴,۴۰۰	۲۵,۷۵۰	۲۵,۶۰۰	(۰.۶%)	۵.۸	-۰.۷۵	۳,۲۸۳	(۲۵.۴%)
طستا ۲۰۴۰	شستا	۱,۴۰۰	۲۵	۳.۷	۶۴	۱,۳۶۷	۱,۳۳۶	(۲.۳%)	۲۰.۹	-۰.۴۶	۴۱	(۳۵.۴%)
طستا ۱۲۸۰	شستا	۱,۴۰۰	۴	۱,۲۴۱.۱	۵۶	۱,۳۶۷	۱,۳۴۴	(۱.۷%)	۲۴.۰	-۰.۶۵	۳۶	(۳۶.۰%)

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	۴	۰.۰	۱	۱,۳۶۷	۵۹۹	(۵۶.۲%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۱۱۱۰	ذوب	۲۰۰	۴	۰.۵	۱	۴۵۵	۱۹۹	(۵۶.۳%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۱۱۷۰	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۱	۰.۴	۶	۲۵,۷۵۰	۱۷,۹۹۴	(۳۰.۱%)	۲,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۱۱۶۰	وبملت	۱,۷۶۰	۱۱	۰.۰	۱	۲,۴۱۲	۱,۷۵۹	(۲۷.۱%)	۱,۷۵۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۶	شستا	۱,۰۰۰	۲۵	۰.۱	۱۰	۱,۳۶۷	۹۹۰	(۲۷.۶%)	۹۹.۰	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

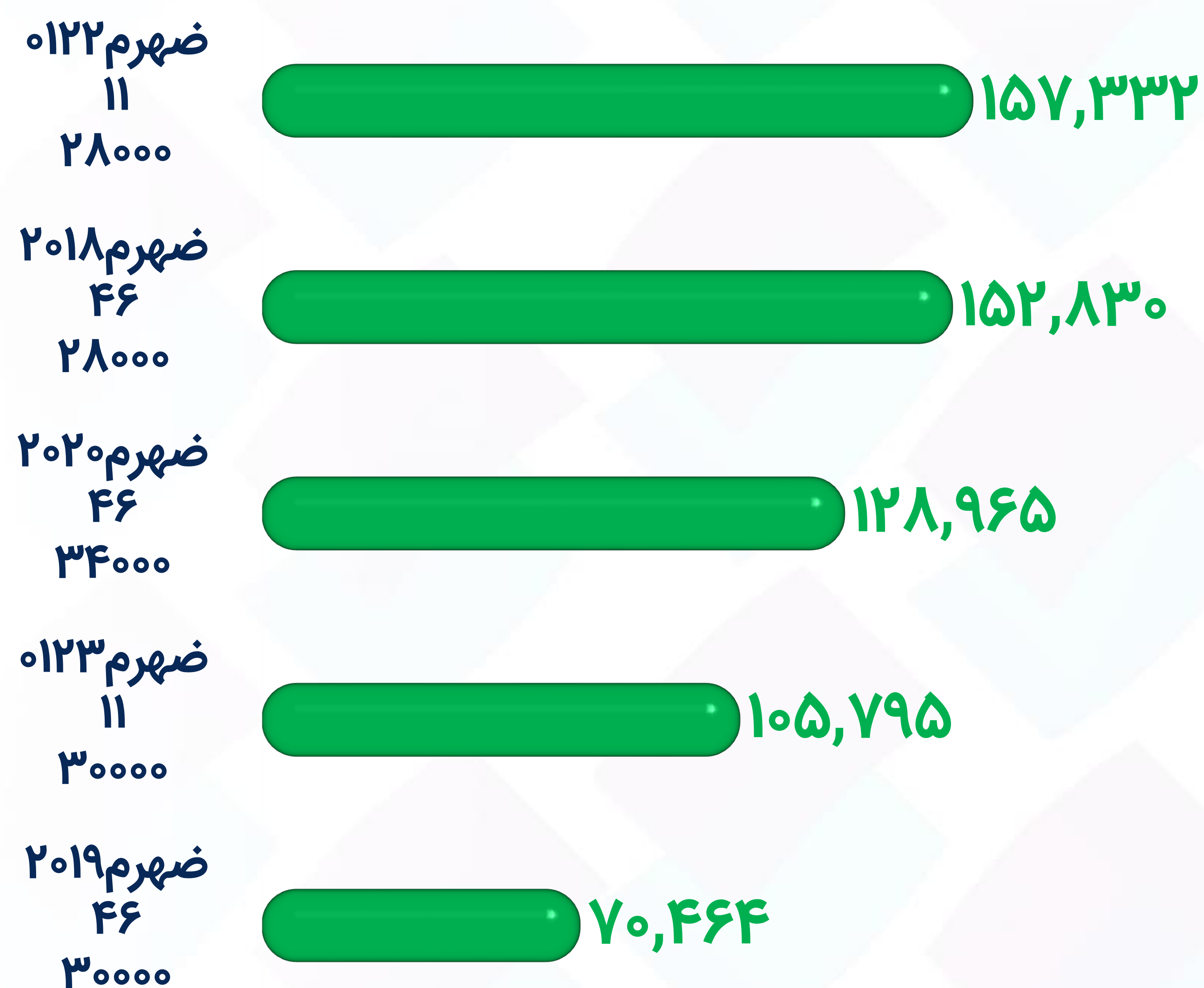
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

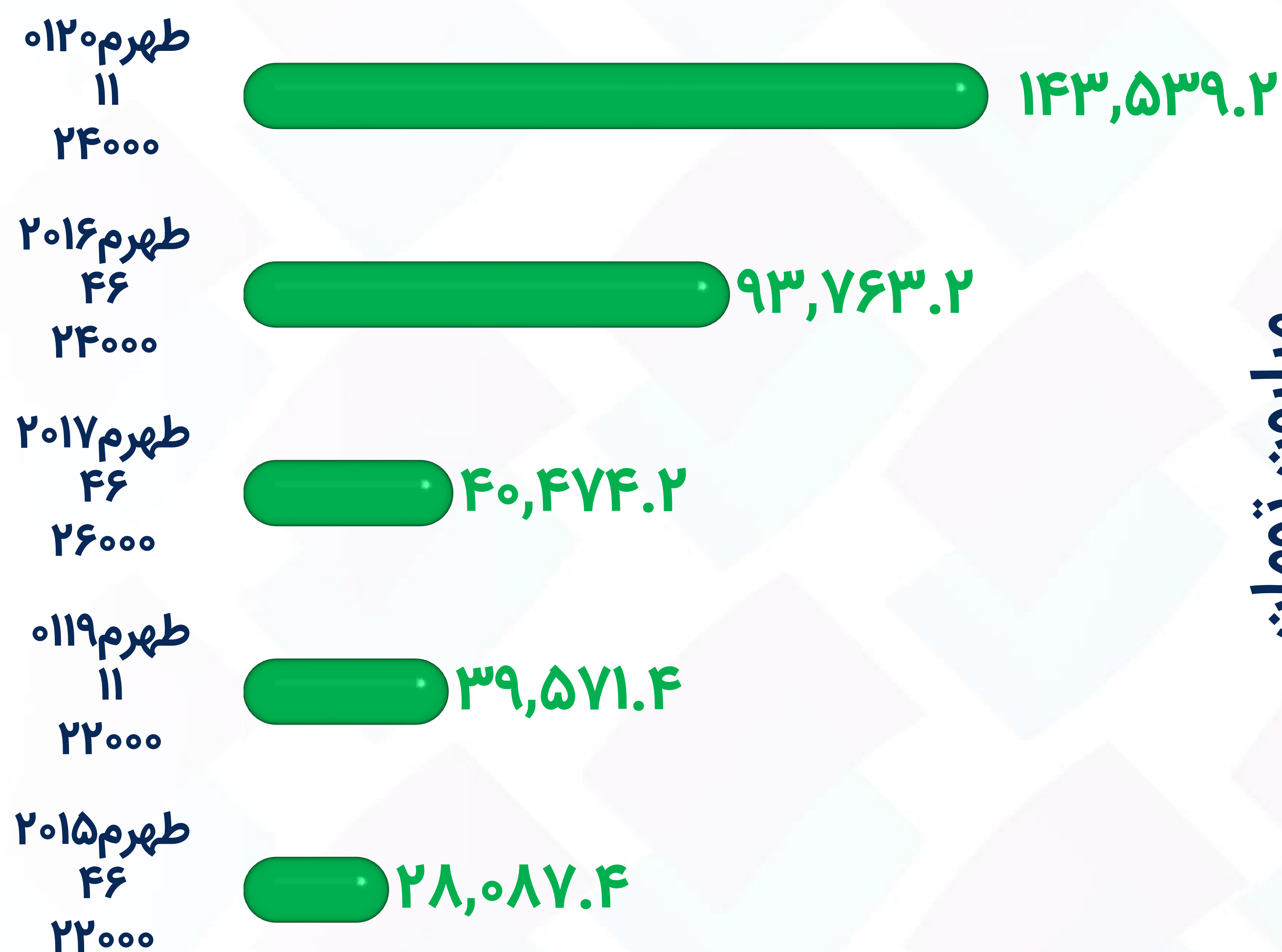
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

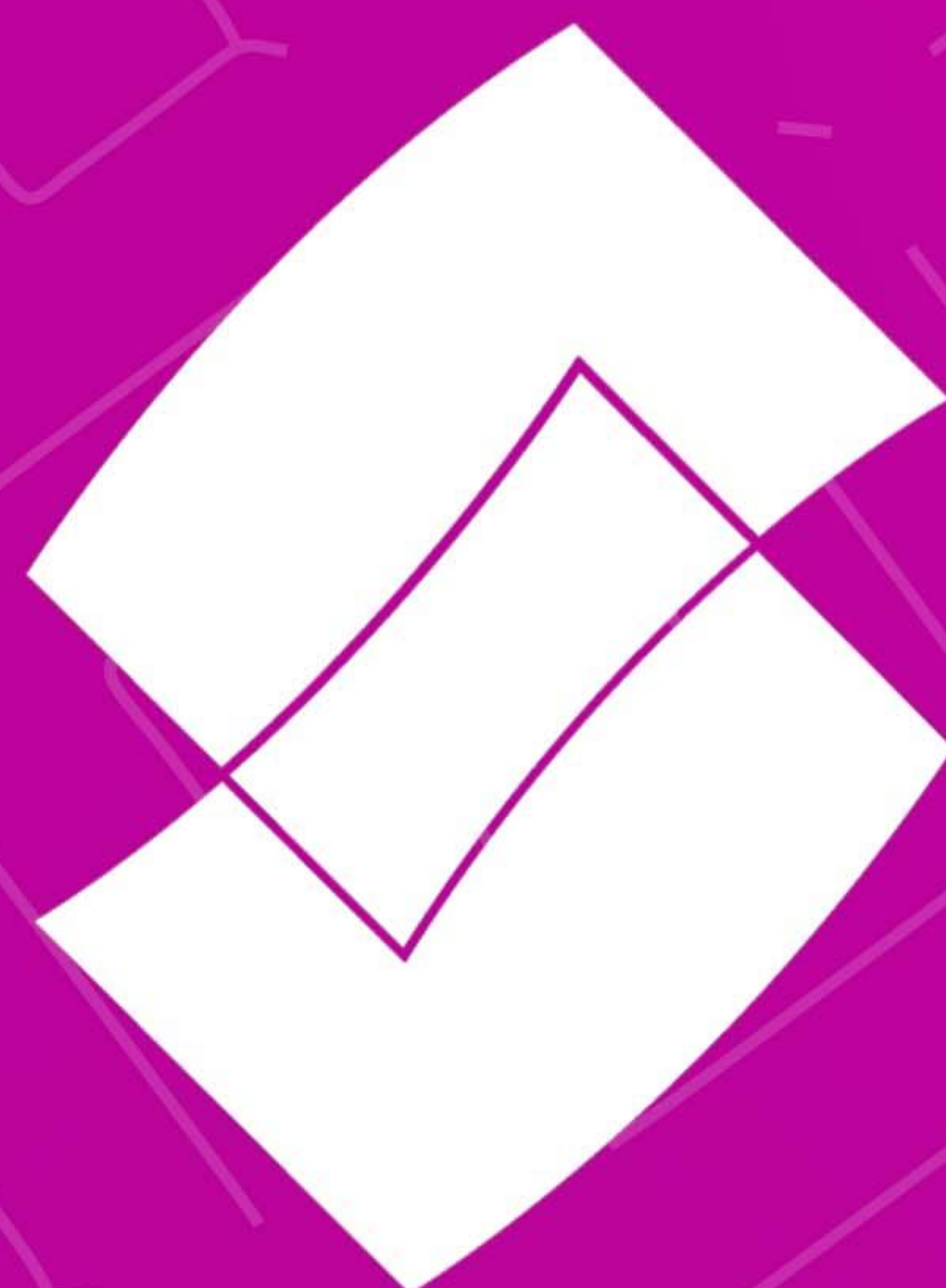
اختیار خرید



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.