

شماره
۴۵۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

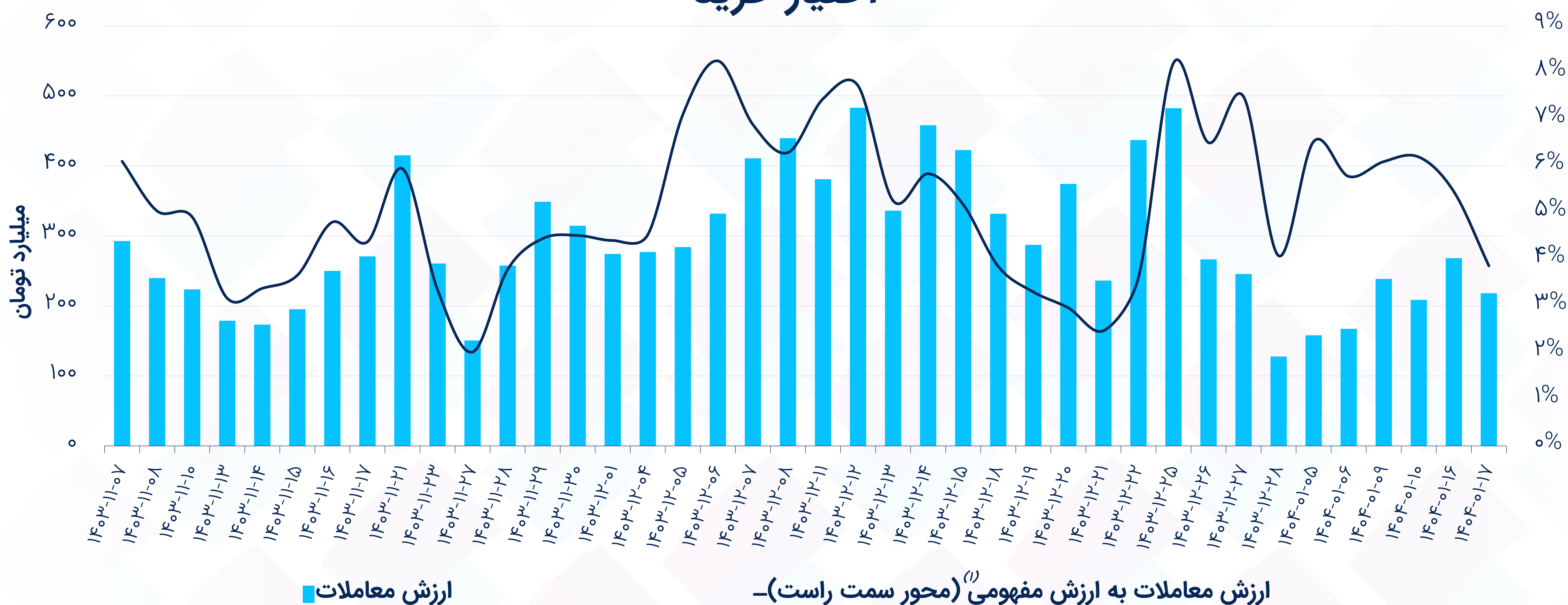




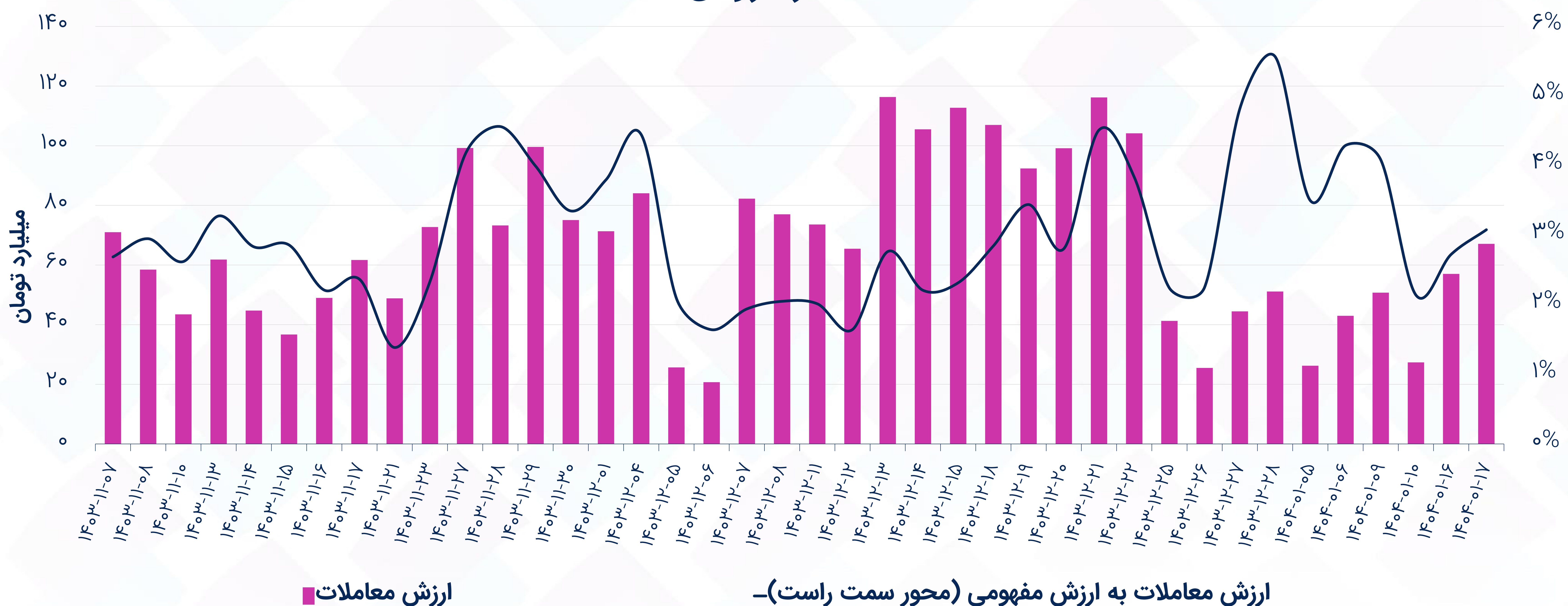
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



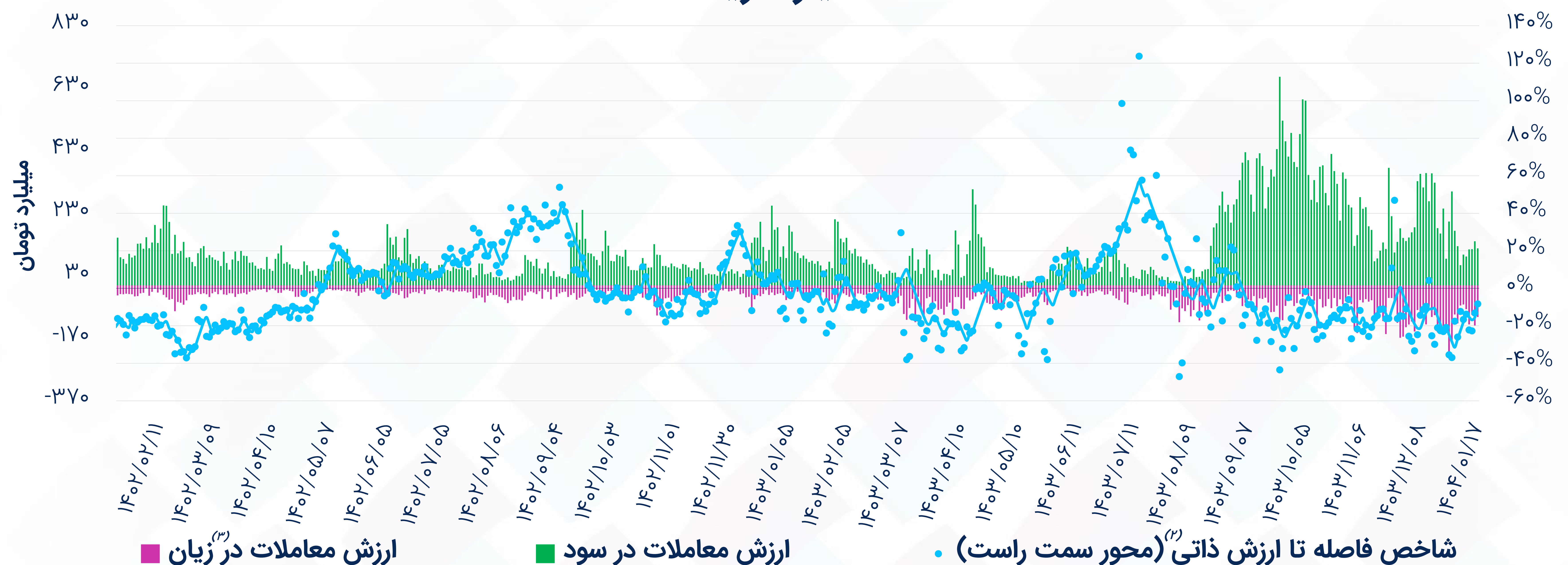
اختیار فروش



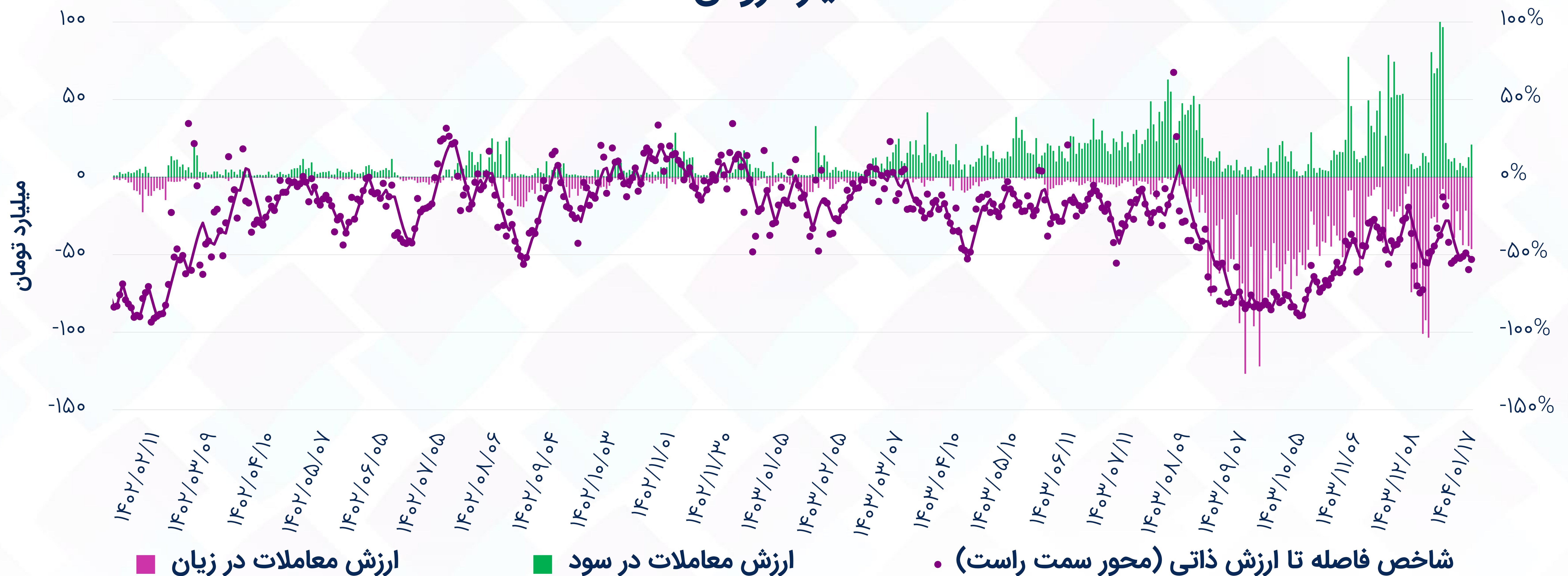
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

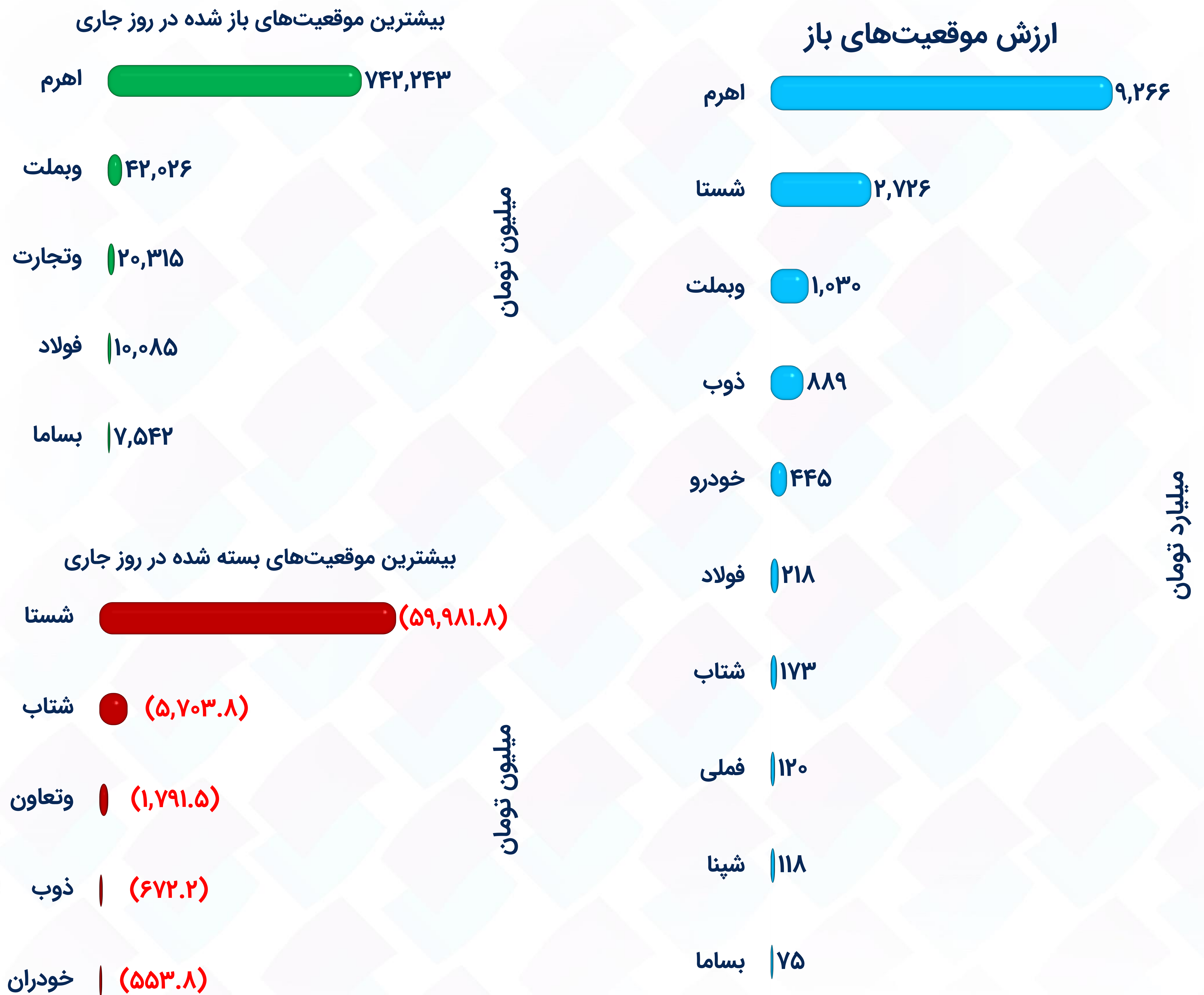
اختیار خرید

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	۴۵	۱۵۴.۲	۴,۳۳۲.۳	۶۰.۶	۹۳.۶	(۱۴.۳%)
وبملت	۲۲	۲۴.۱	۲۷۳.۸	۲۳.۹	۰.۳	۱۴.۶%
شستا	۴۶	۱۵.۰	۸۰۲.۹	۱۱.۰	۴.۱	۶.۰%
ذوب	۲۲	۸.۶	۸۸.۱	۷.۳	۱.۳	(۹.۷%)
بساما	۱۶	۶.۵	۲۱.۱	۶.۴	۰.۱	۵.۲%
وتجارت	۱۰	۳.۲	۳۰.۶	۲.۶	۰.۶	(۱۶.۸%)
نارنج اهرم	۱۵	۱.۰	۱۹.۰	۱.۰	۰.۰	۴۳.۸%

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	۶۴,۹۷۴.۴	۲,۰۰۸,۱۸۶.۶	۱۹,۶۷۷.۷	۴۵,۲۹۶.۷	(۵۳.۷%)
شستا	۱۱	۲,۰۵۳.۰	۱۶۰,۶۴۵.۷	۱,۱۴۲.۴	۹۱۰.۵	(۳۲.۱%)
وبملت	۴	۴۲.۱	۱۰,۲۱۱.۸	۰.۰	۴۲.۱	(۷۸.۸%)
بساما	۲	۱۶.۹	۳۶۰.۰	۱۶.۹	۰.۰	(۵۹.۷%)
خودران	۲	۱۰.۵	۲۹۴.۶	۰.۰	۱۰.۵	(۳۰.۳%)
توان	۱	۲.۶	۴۷.۸	۲.۶	۰.۰	(۴۰.۲%)
وبصادر	۱	۱.۸	۴۵.۰	۰.۰	۱.۸	(۸۹.۱%)

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

اهرم ۲,۳۹۰

شستا ۳۲۱

وبملت ۵۱

وتعاون ۸

بساما ۸

ذوب ۸

نارنج اهرم ۵

خودرو ۳.۳۰

خودران ۱.۹۹

توان ۱.۱۵

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۱۷,۱۸۹.۰

وبملت ۳,۵۵۸.۱

خودران ۹۱.۰

وبصادر ۴۰.۰

خبهمن ۱۸.۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۴۳,۸۵۳.۱)

توان (۱۲.۰)

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
ضتاب ۰۱۰۵	شتاب	۱۳,۰۰۰	۳	۱۴۹.۱	۲۵۵	۱۳,۲۹۰	۱۳,۲۵۵	(۰.۳%)	۵۲.۰	۰.۷۳	۴۷۱	۸۵%
ضبیید ۲۰۰۴	بیدار	۱۳,۰۰۰	۴۵	۸.۰	۸۰۰	۱۳,۱۵۰	۱۳,۸۰۰	۴.۹%	۱۷.۳	۰.۶۸	۱,۲۰۷	۵۱%
ضبیید ۲۰۰۵	بیدار	۱۴,۰۰۰	۴۵	۲.۵	۵۰۰	۱۳,۱۵۰	۱۴,۵۰۰	۱۰.۳%	۲۹.۰	۰.۴۹	۷۰۳	۴۱%
ضملت ۰۱۲۰	وبملت	۲,۳۴۷	۱۰	۱,۴۸۷.۴	۶۳	۲,۳۶۸	۲,۴۱۰	۱.۸%	۳۸.۳	۰.۶۵	۸۸	۳۹%
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۲۱	۱۶۷.۴	۱,۴۴۰	۹,۲۶۰	۸,۹۳۵	(۳.۵%)	۶.۲	۱.۰۰	۱,۹۳۴	۳۴%

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	۳	۱.۴	۱	۴۴۵	۶۰۱	۳۵%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۳	۱.۰	۱	۱,۳۴۳	۱,۷۰۱	۲۷%	۱,۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۳۸	۴.۵	۳	۴۴۵	۸۰۳	۸۰%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۰۱۳۰	شستا	۱,۶۰۰	۳	۶.۰	۱	۱,۳۴۳	۱,۶۰۱	۱۹%	۱,۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۰۱۲۰	فولاد	۴,۶۸۰	۳	۲.۵	۲	۳,۹۵۲	۴,۶۸۲	۱۸%	۲,۳۴۱.۰	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
طران ۰۱۰۶	خودران	۱۰,۰۰۰	۱۰	۱.۵	۱۵۲	۱۰,۱۱۰	۹,۸۴۸	(۲.۶%)	۶۴.۸	-۰.۳۵	۱۶۶	۹.۱%
طهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۰	۲۰.۷	۹,۰۰۳	۲۵,۲۵۰	۲۴,۹۹۷	(۱.۰%)	۲.۸	-۱.۰۰	۸,۳۱۸	(۷.۶%)
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۰	۱۱.۵	۵,۰۱۹	۲۵,۲۵۰	۲۴,۹۸۱	(۱.۱%)	۵.۰	-۰.۹۹	۴,۳۷۵	(۱۲.۸%)
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۰	۱,۱۵۷.۴	۳,۰۲۷	۲۵,۲۵۰	۲۴,۹۷۳	(۱.۱%)	۸.۳	-۰.۹۰	۲,۴۷۶	(۱۸.۲%)
طستا ۰۱۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۳	۱,۱۱۰.۲	۶۶	۱,۳۴۳	۱,۳۳۴	(۰.۷%)	۲۰.۲	-۰.۸۳	۵۳	(۱۹.۲%)

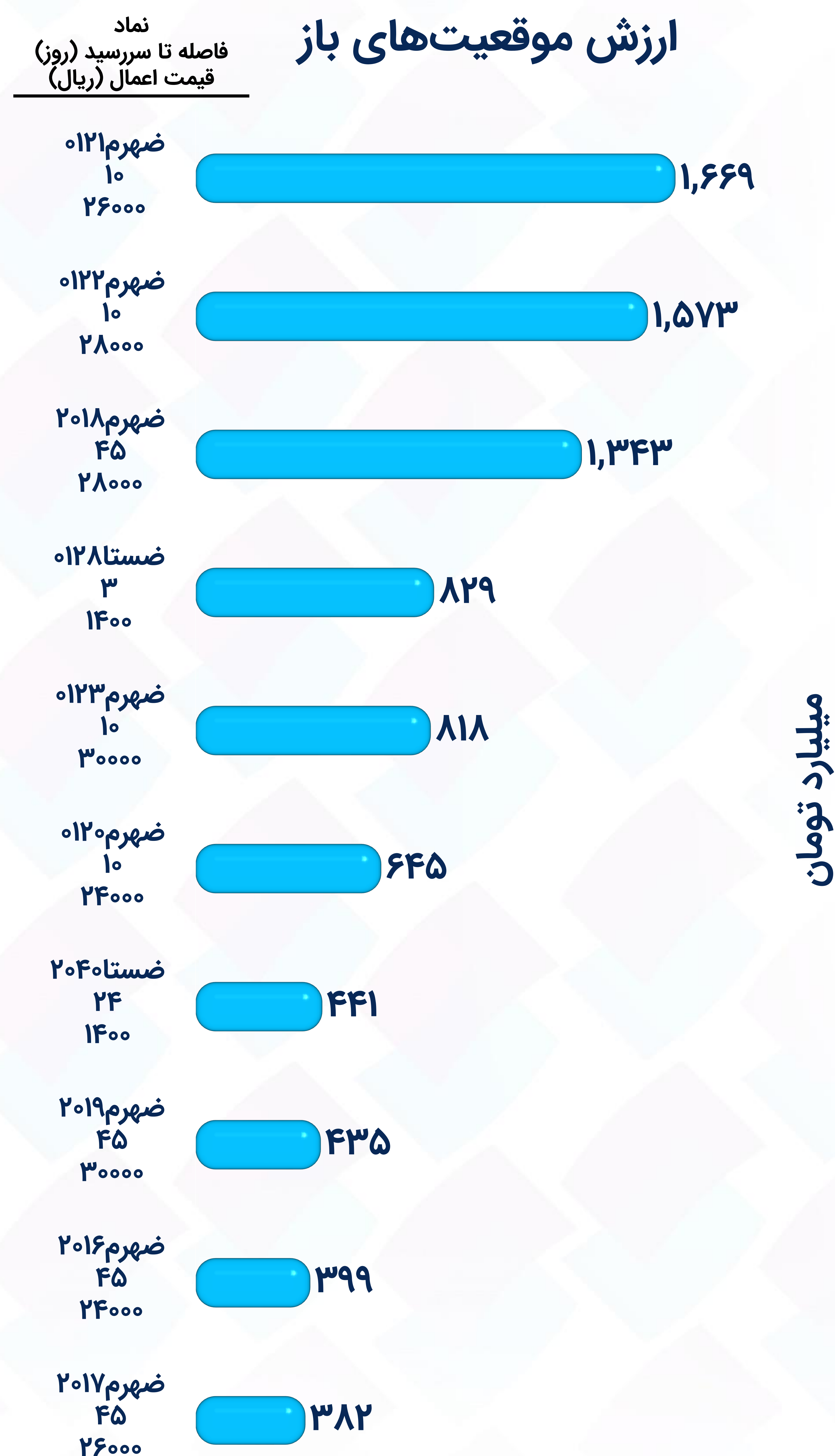
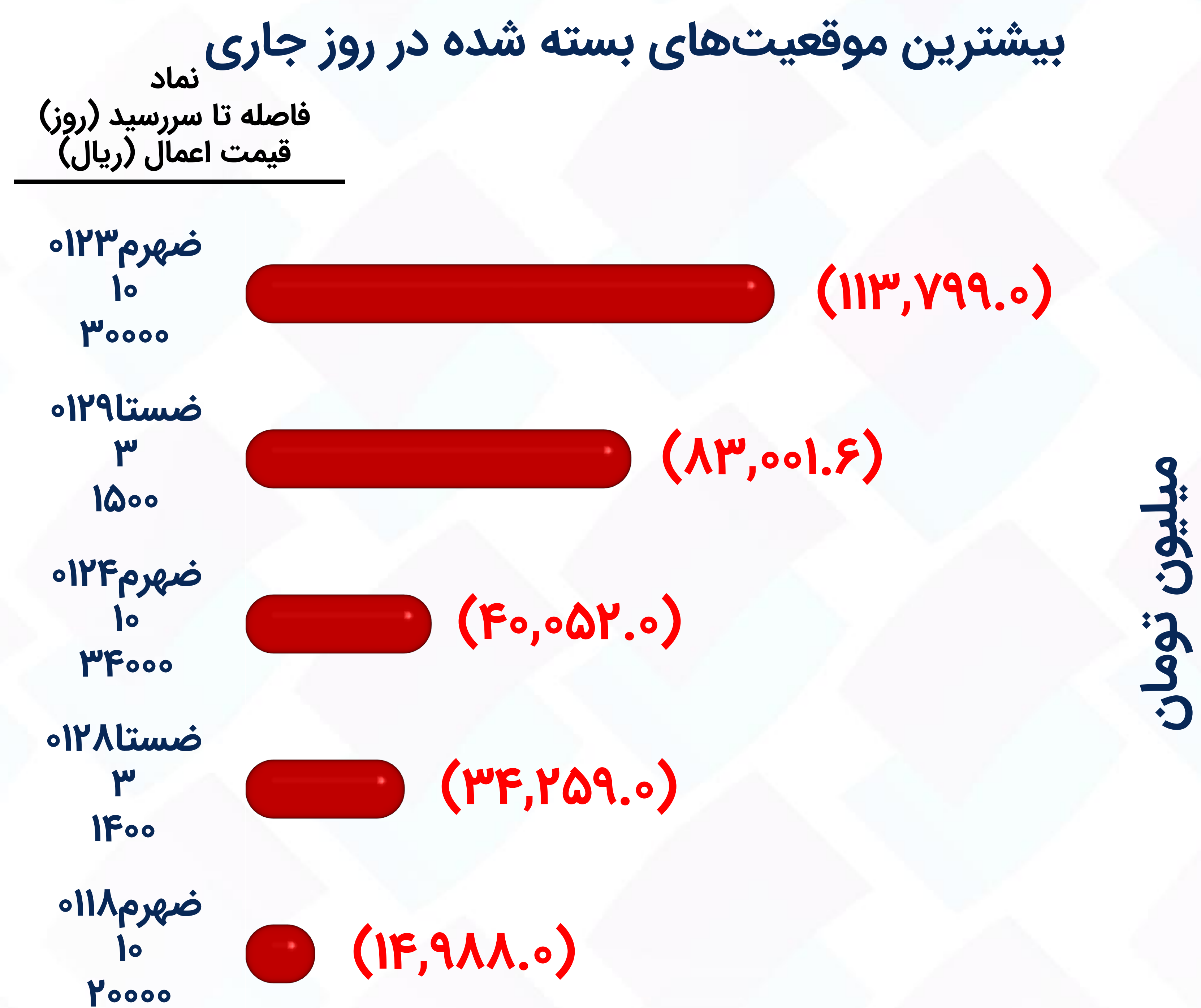
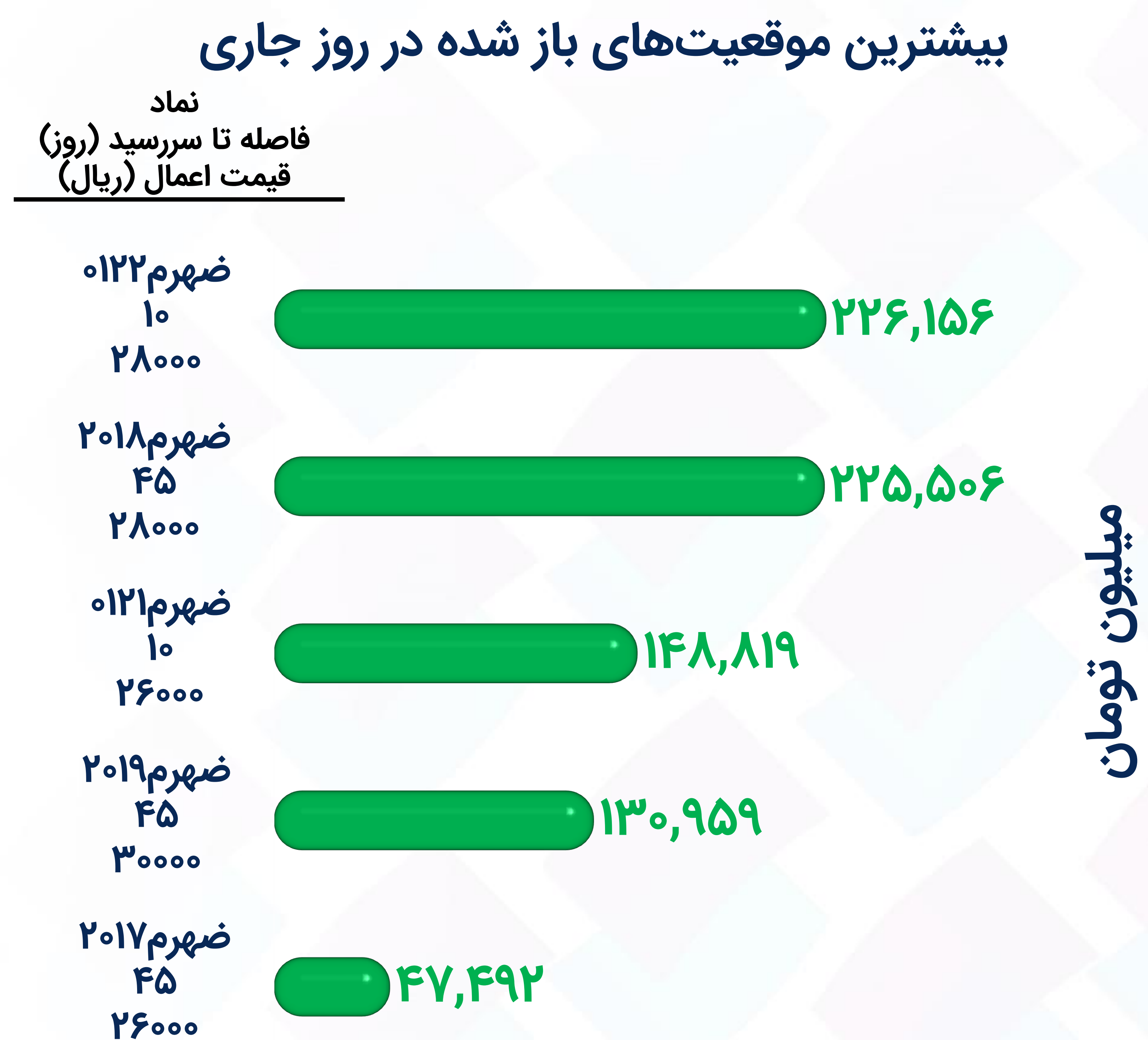
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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 ۰۱۲۳	شستا	۹۰۰	۳	۰.۳	۱	۱,۳۴۳	۸۹۹	(۳۳.۱%)	۸۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۰۱۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۳	۰.۶	۱	۱,۳۴۳	۱,۰۹۹	(۱۸.۲%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۰	۰.۰	۲	۲۵,۲۵۰	۱۷,۹۹۸	(۲۸.۷%)	۸,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۱۰	۳.۷	۳	۲,۳۶۸	۱,۹۰۴	(۱۹.۶%)	۶۳۴.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۰	۲۰.۱	۱۹	۲۵,۲۵۰	۱۹,۹۸۱	(۲۰.۹%)	۱,۰۵۱.۶	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)

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



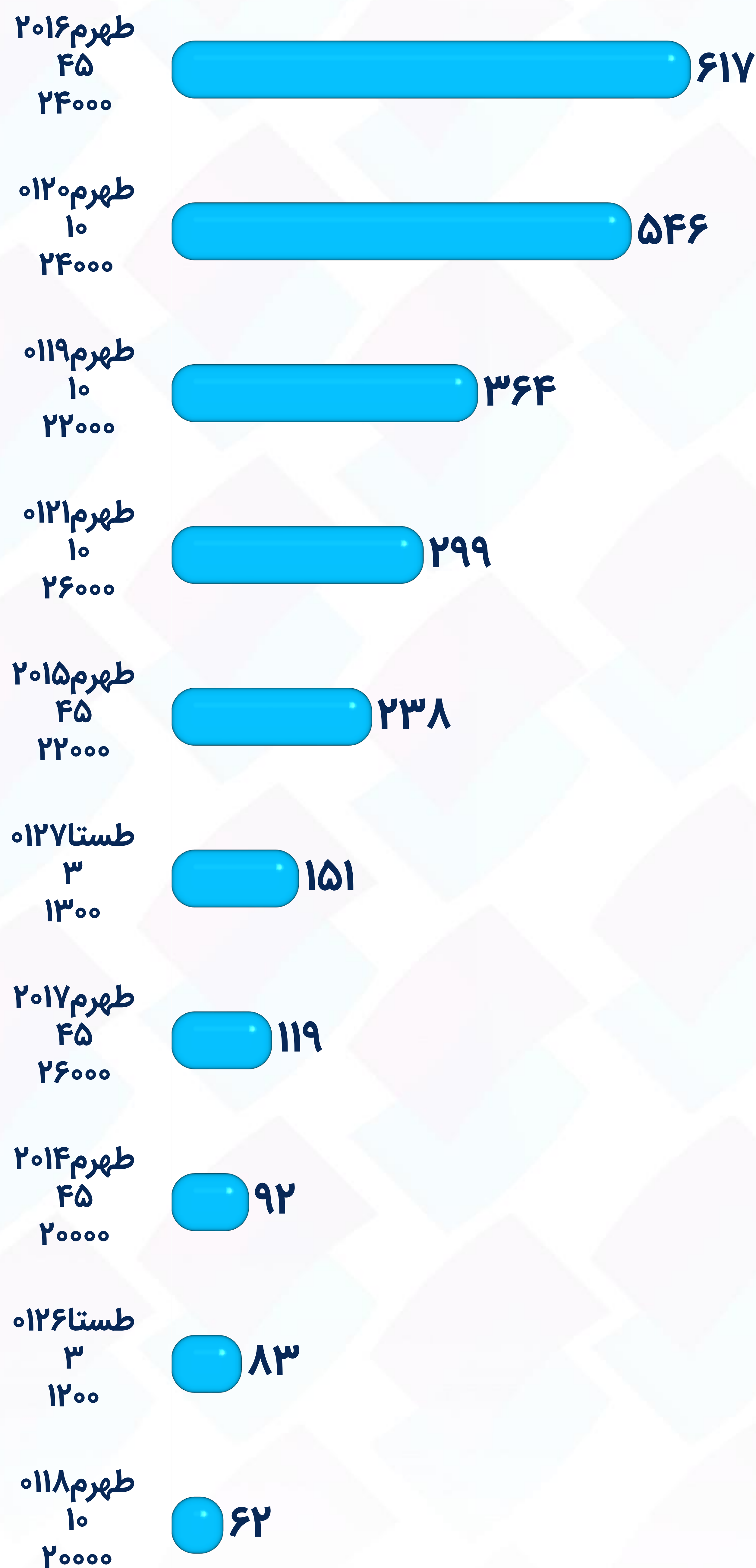
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

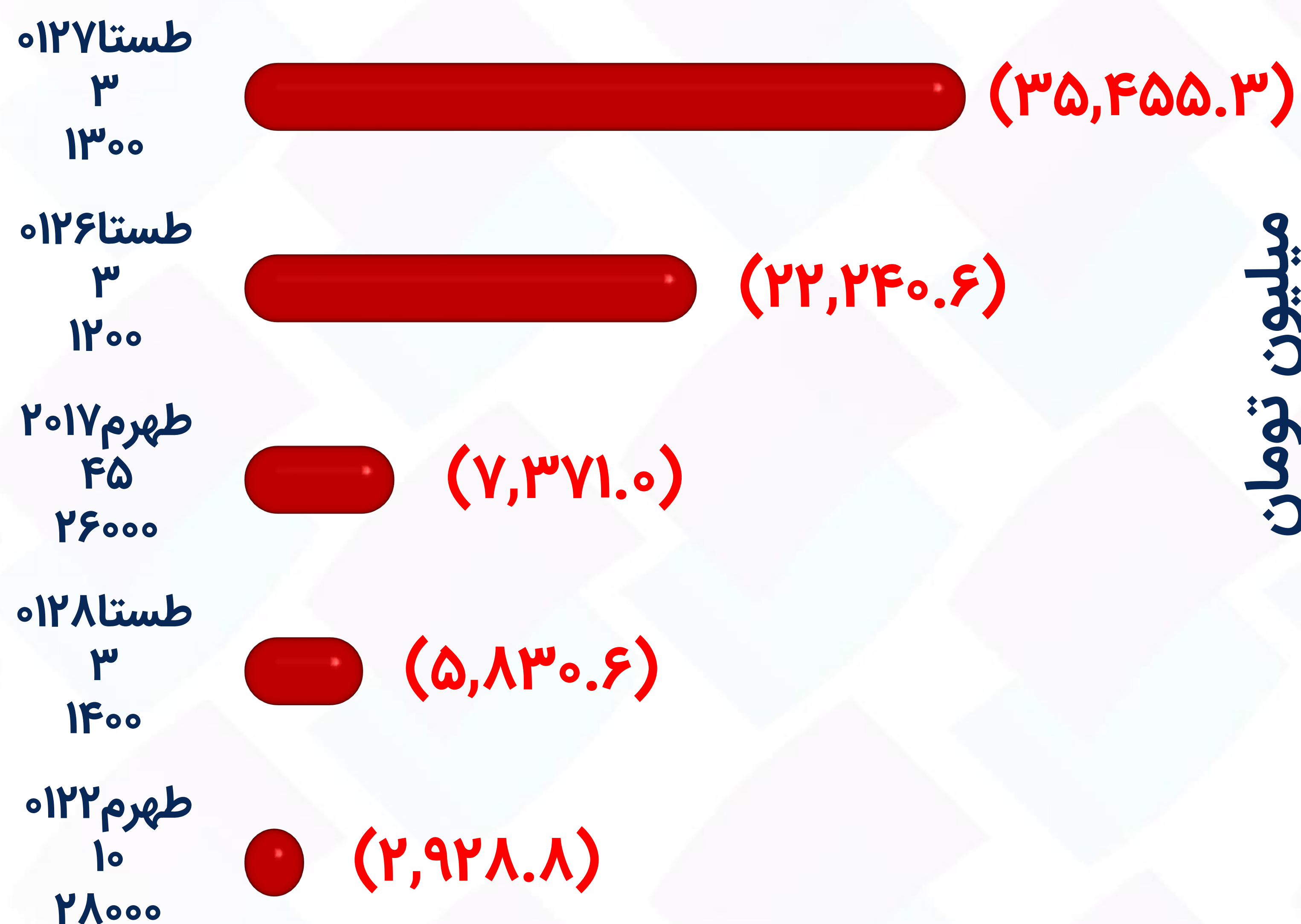
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

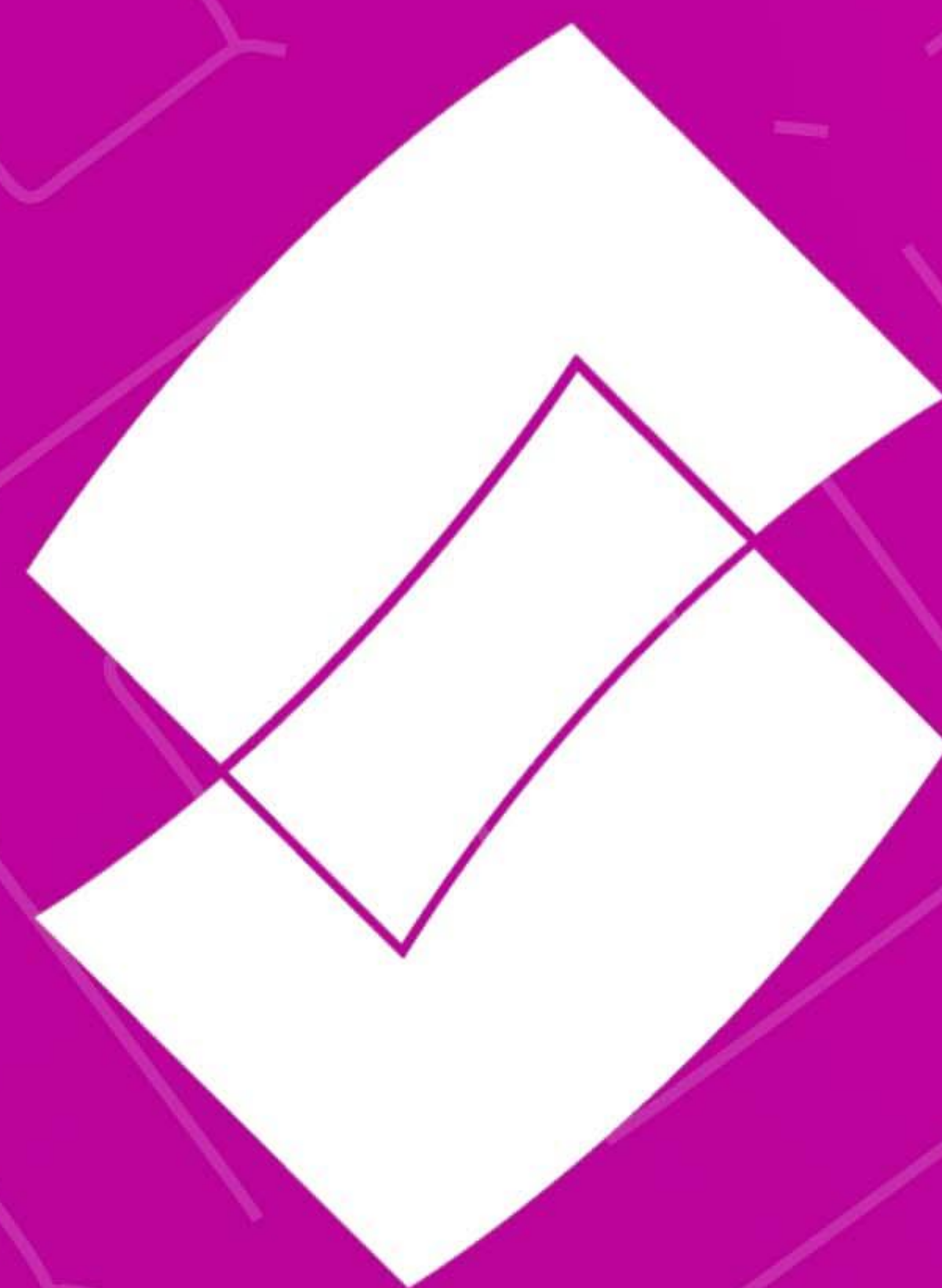
اختیار خرید



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

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.