

شماره
۴۵۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





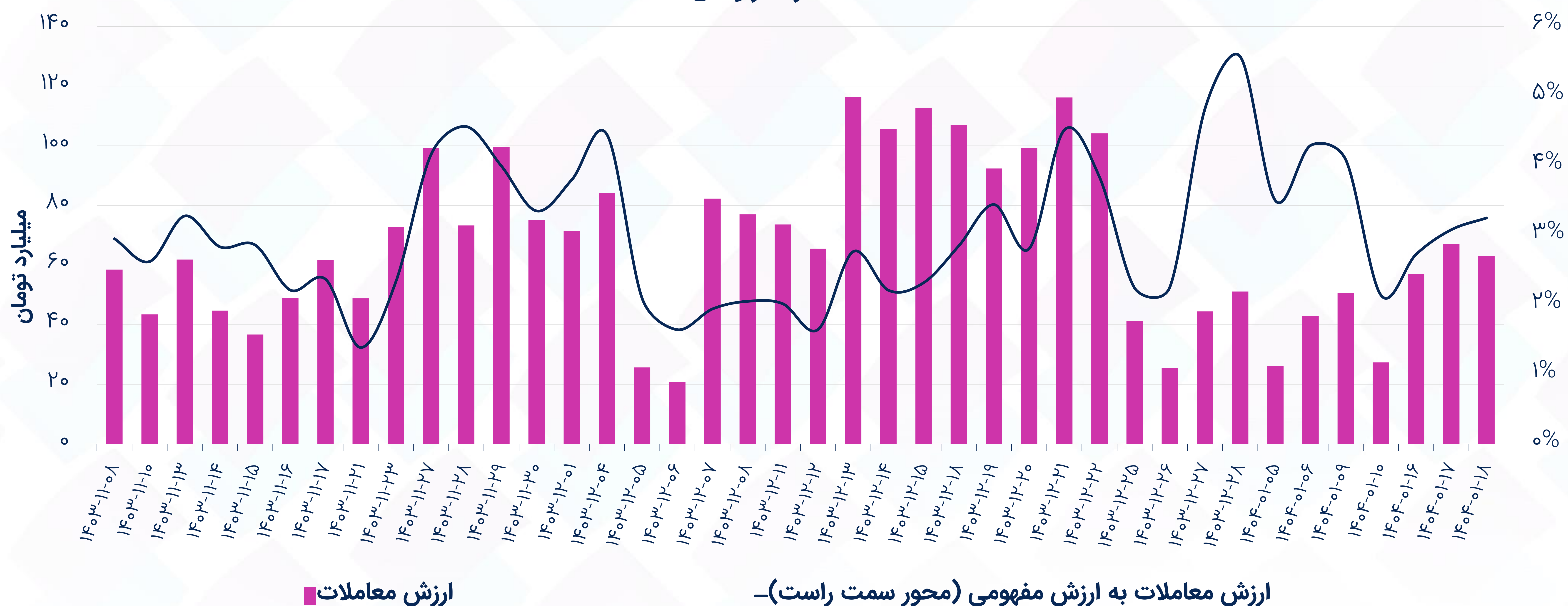
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



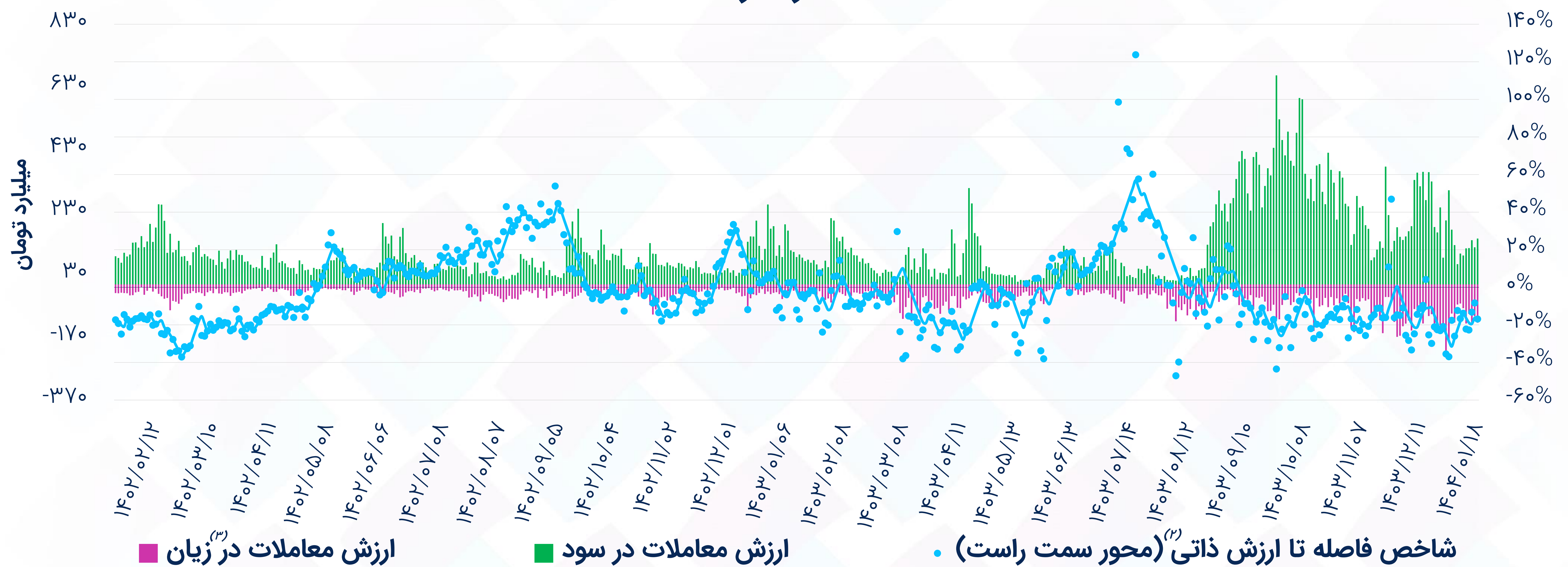
اختیار فروش



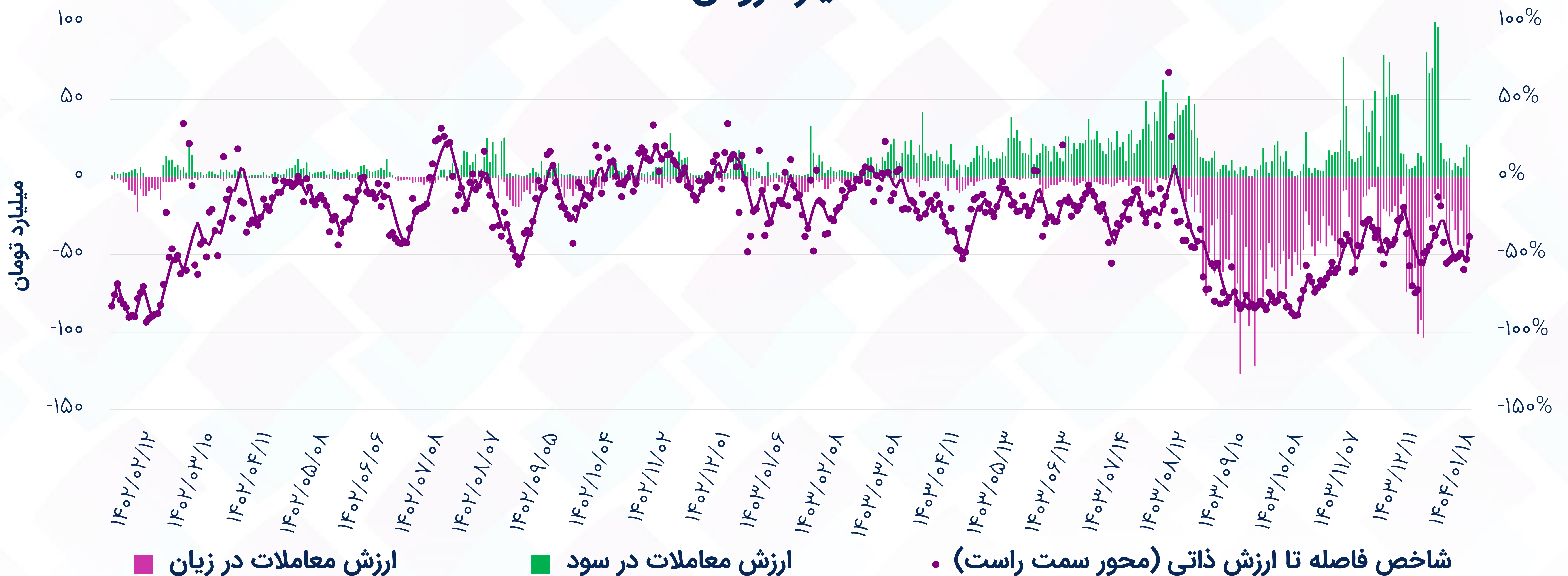
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۲	۲۱۶.۷	۵,۹۷۴.۰	۱۰۶.۴	۱۱۰.۲	(۲۰.۶%)
وبملت	۲۲	۱۴.۶	۱۶۲.۱	۱۲.۳	۲.۳	۲.۸%
شستا	۴۷	۱۲.۲	۸۷۰.۳	۸.۸	۳.۴	۶.۶%
ذوب	۲۴	۸.۵	۸۷.۵	۷.۷	۰.۸	(۱۱.۵%)
وتجارت	۱۱	۷.۷	۹۳.۷	۵.۲	۲.۶	(۳.۵%)
شتاب	۹	۲.۱	۵۴.۸	۰.۰	۲.۱	۲.۸%
وبصادر	۱۱	۱.۶	۸.۷	۱.۳	۰.۲	(۹.۳%)

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	۶۰,۲۶۱.۰	۱,۷۳۷,۲۵۸.۸	۱۷,۹۶۶.۴	۴۲,۲۹۴.۶	(۳۹.۱%)
شستا	۹	۲,۶۵۲.۸	۱۷۹,۲۳۷.۵	۱,۲۵۷.۸	۱,۳۹۵.۰	(۲۰.۷%)
وبملت	۵	۳۱.۸	۲۰,۱۴۳.۶	۰.۰	۳۱.۸	(۶۰.۱%)
فملی	۱	۲۴.۳	۱,۷۸۳.۸	۰.۰	۲۴.۳	(۱۱.۶%)
توان	۲	۹.۵	۲۰۸.۶	۶.۲	۳.۳	(۳۵.۵%)
بساما	۲	۸.۱	۱۲۳.۲	۸.۱	۰.۱	(۴۶.۶%)
فولاد	۲	۱.۳	۷۹۷.۷	۰.۰	۱.۳	(۹۹.۱%)

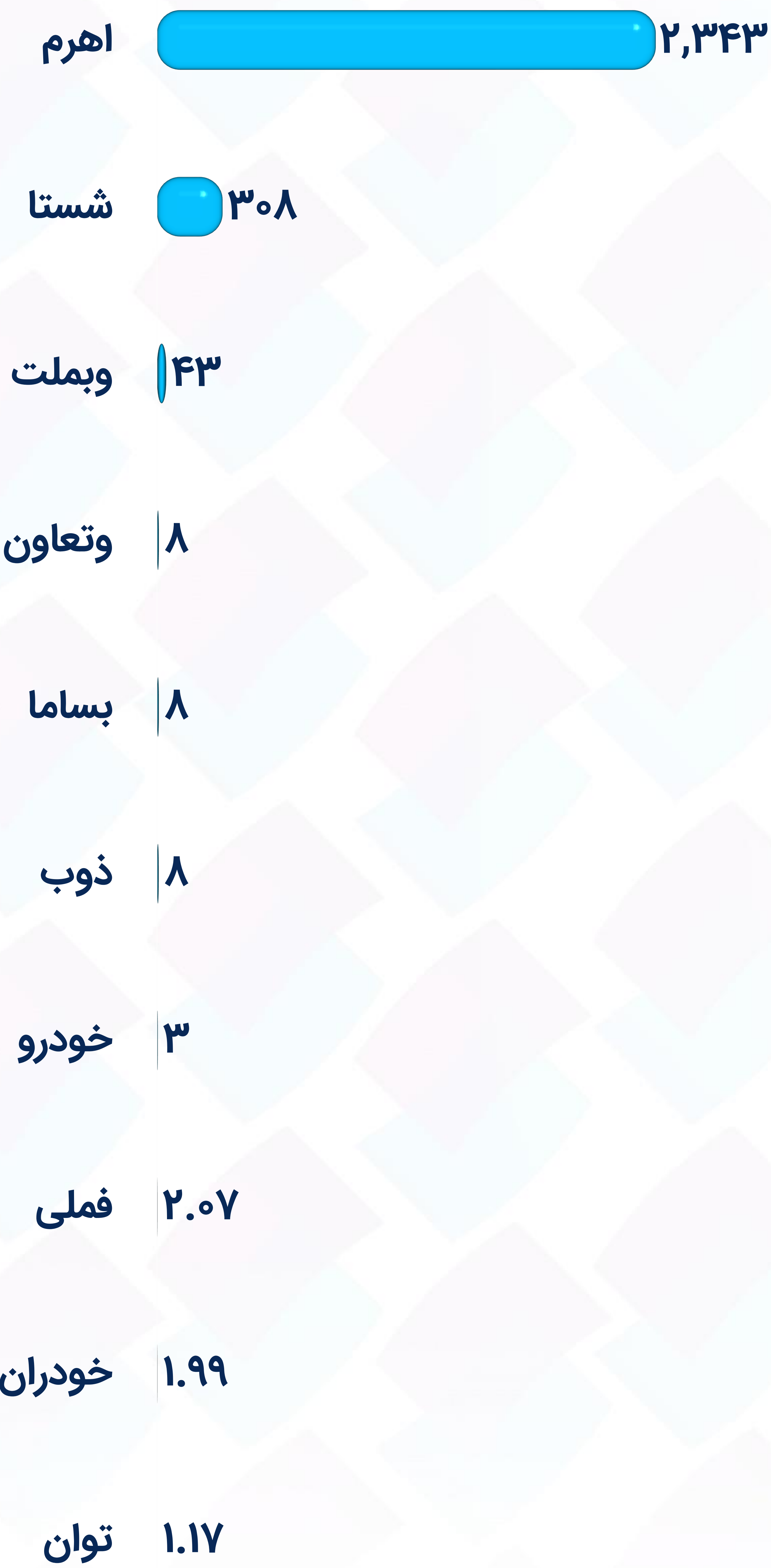
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



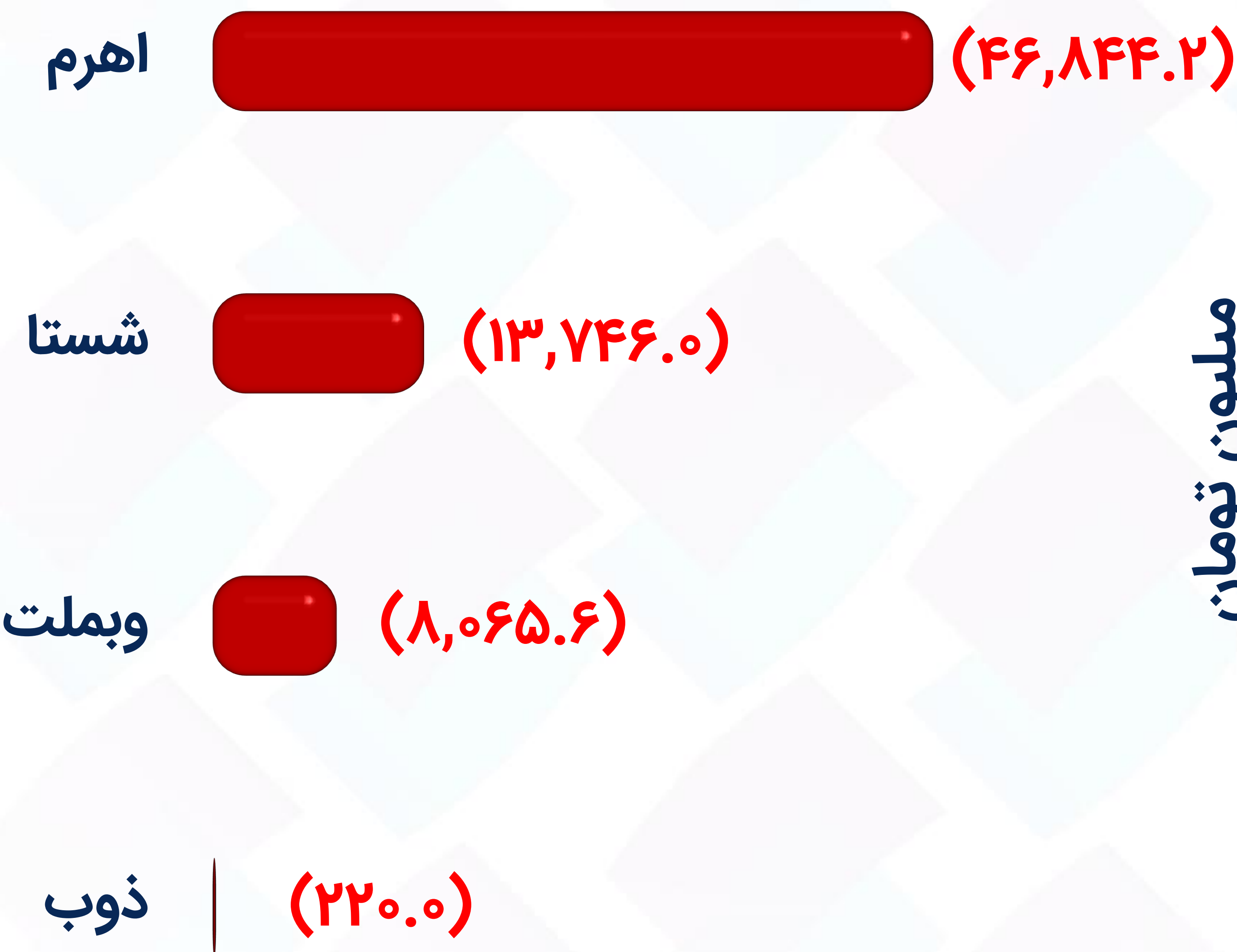
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



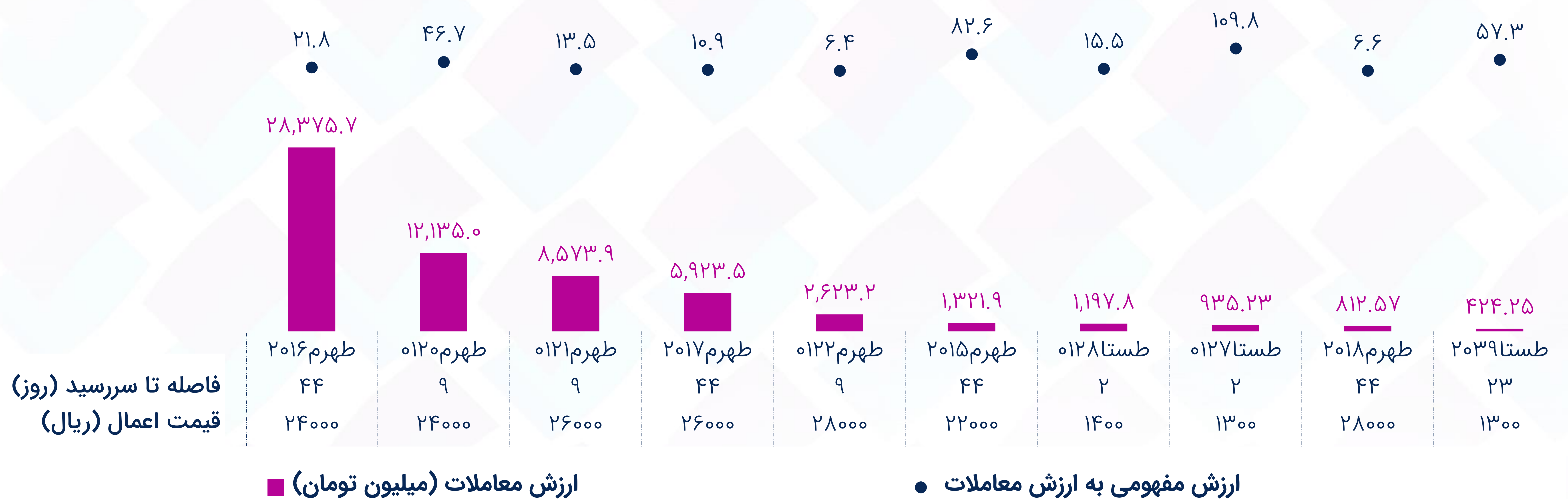
میلیون تومان

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
ضتاب ۱۰۵	شتاب	۱۳,۰۰۰	۲	۱۱۱.۰	۹۵	۱۲,۹۱۰	۱۳,۰۹۵	۱.۴%	۱۳۷.۸	۰.۴۸	۱۹۵	۱۰۵%
ضفلا ۱۱۸	فولاد	۳,۹۶۰	۲	۲۰.۴	۱۱	۳,۸۷۸	۳,۹۷۱	۲.۴%	۳۶۱.۰	۰.۳۰	۲۲	۱۰۵%
ضستا ۱۲۷	شتتا	۱,۳۰۰	۲	۳,۳۲۱.۵	۲۰	۱,۳۱۷	۱,۳۲۰	۰.۲%	۶۶.۰	۰.۷۱	۳۰	۵۰%
ضملی ۳۰۴۹	فملي	۸,۰۰۰	۵۱	۱.۲	۱,۲۰۴	۹,۳۴۰	۹,۲۰۴	(۱.۵%)	۷.۶	۰.۹۷	۱,۷۶۹	۴۷%
ضتاب ۲۰۰۴	شتاب	۱۳,۰۰۰	۲۳	۴۷.۶	۴۴۰	۱۲,۹۱۰	۱۳,۴۴۰	۴.۱%	۳۰.۵	۰.۵۹	۶۴۱	۴۶%

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 ۱۱۵	ذوب	۶۰۰	۲	۱۰.۴	۱	۴۳۳	۶۰۱	۳۹%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۳۱	شتتا	۱,۷۰۰	۲	۴.۳	۱	۱,۳۱۷	۱,۷۰۱	۲۹%	۱,۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۹	۷۸.۵	۲۸	۲۴,۵۳۰	۳۴,۰۲۸	۳۹%	۱,۲۱۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شتتا	۲,۲۰۰	۵۷	۵.۶	۱۰	۱,۳۱۷	۲,۲۱۰	۶۸%	۲۲۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۱۲۹	شتتا	۱,۵۰۰	۲	۲۸.۰	۱	۱,۳۱۷	۱,۵۰۱	۱۴%	۱,۵۰۱.۰	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
طستا ۰۱۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۲	۱,۱۹۷.۸	۸۵	۱,۳۱۷	۱,۳۱۵	(۰.۲%)	۱۵.۵	-۰.۹۶	۷۸	(۸.۶%)
طملی ۳۰۵۰	فملی	۹,۰۰۰	۵۱	۲۴.۳	۱۲۷	۹,۳۴۰	۸,۸۷۳	(۵.۰%)	۶۹.۹	-۰.۱۹	۱۱۲	(۱۱.۶%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۲۳	۴۲۴.۳	۲۳	۱,۳۱۷	۱,۲۷۷	(۳.۰%)	۵۵.۵	-۰.۳۰	۲۰	(۱۳.۹%)
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۹	۲,۶۲۳.۲	۳,۸۴۵	۲۴,۵۳۰	۲۴,۱۵۵	(۱.۵%)	۶.۳	-۰.۹۷	۳,۱۷۶	(۱۷.۴%)
طهرم ۳۰۱۶	اهرم	۲۶,۰۰۰	۷۲	۳۳.۲	۱,۷۷۶	۲۴,۵۳۰	۲۴,۲۲۴	(۱.۲%)	۱۳.۶	-۰.۴۴	۱,۴۴۰	(۱۸.۹%)

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
طفلا ۰۱۱۱	فولاد	۲,۱۶۰	۲	۰.۱	۱	۳,۸۷۸	۲,۱۵۹	(۴۴.۳%)	۲,۱۵۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۰۱۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۲	۰.۶	۱	۱,۳۱۷	۱,۰۹۹	(۱۶.۶%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۹	۳.۰	۱	۲,۳۱۰	۱,۹۰۶	(۱۷.۵%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۳%)
طفلا ۰۱۱۷	فولاد	۳,۶۰۰	۲	۱.۱	۱۹	۳,۸۷۸	۳,۵۸۱	(۷.۷%)	۱۸۸.۵	-۰.۰۱	۰	(۹۸.۹%)
طستا ۰۱۲۶	شستا	۱,۲۰۰	۲	۲۲.۸	۱	۱,۳۱۷	۱,۱۹۹	(۹.۰%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۹%)

(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

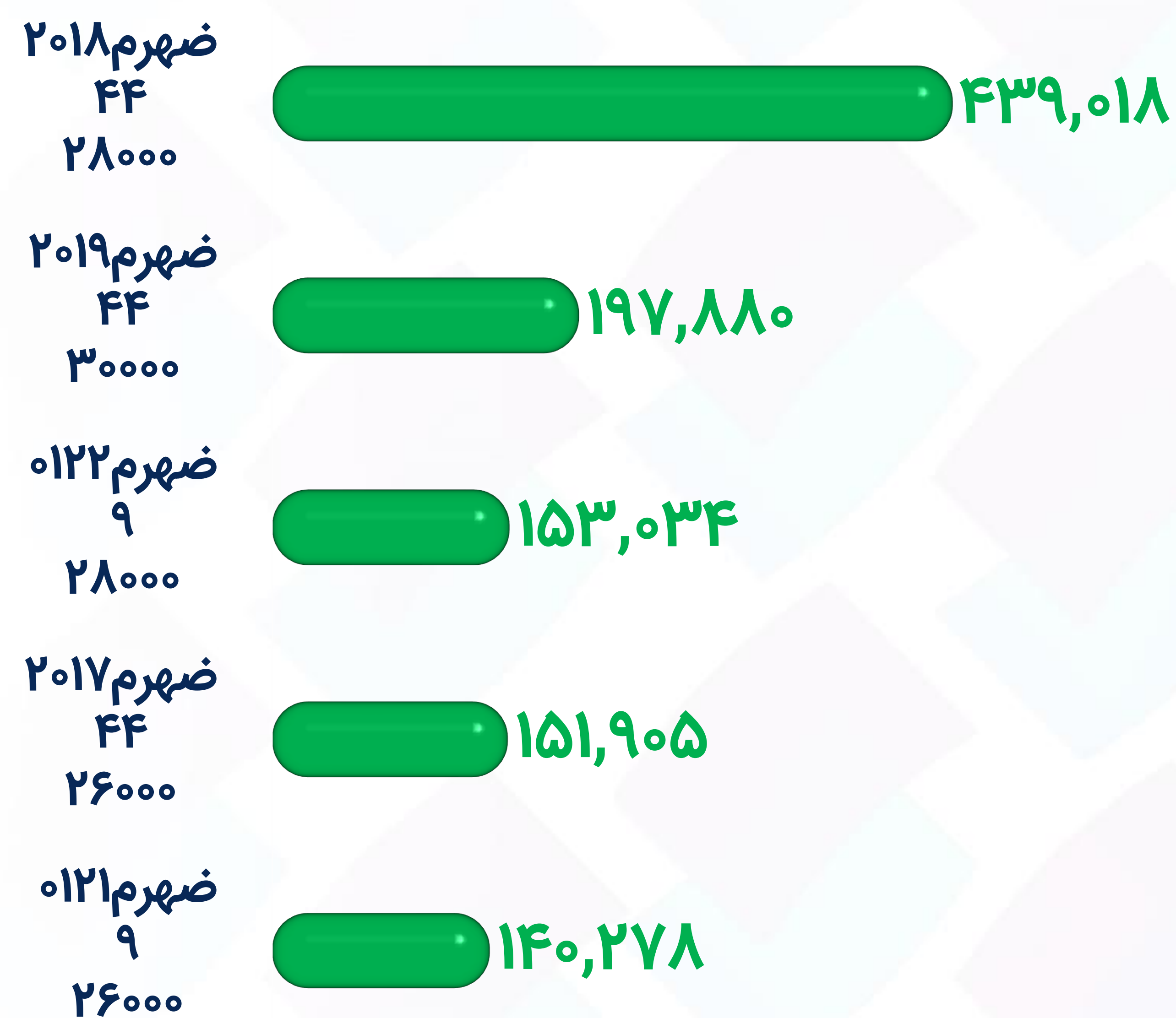
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

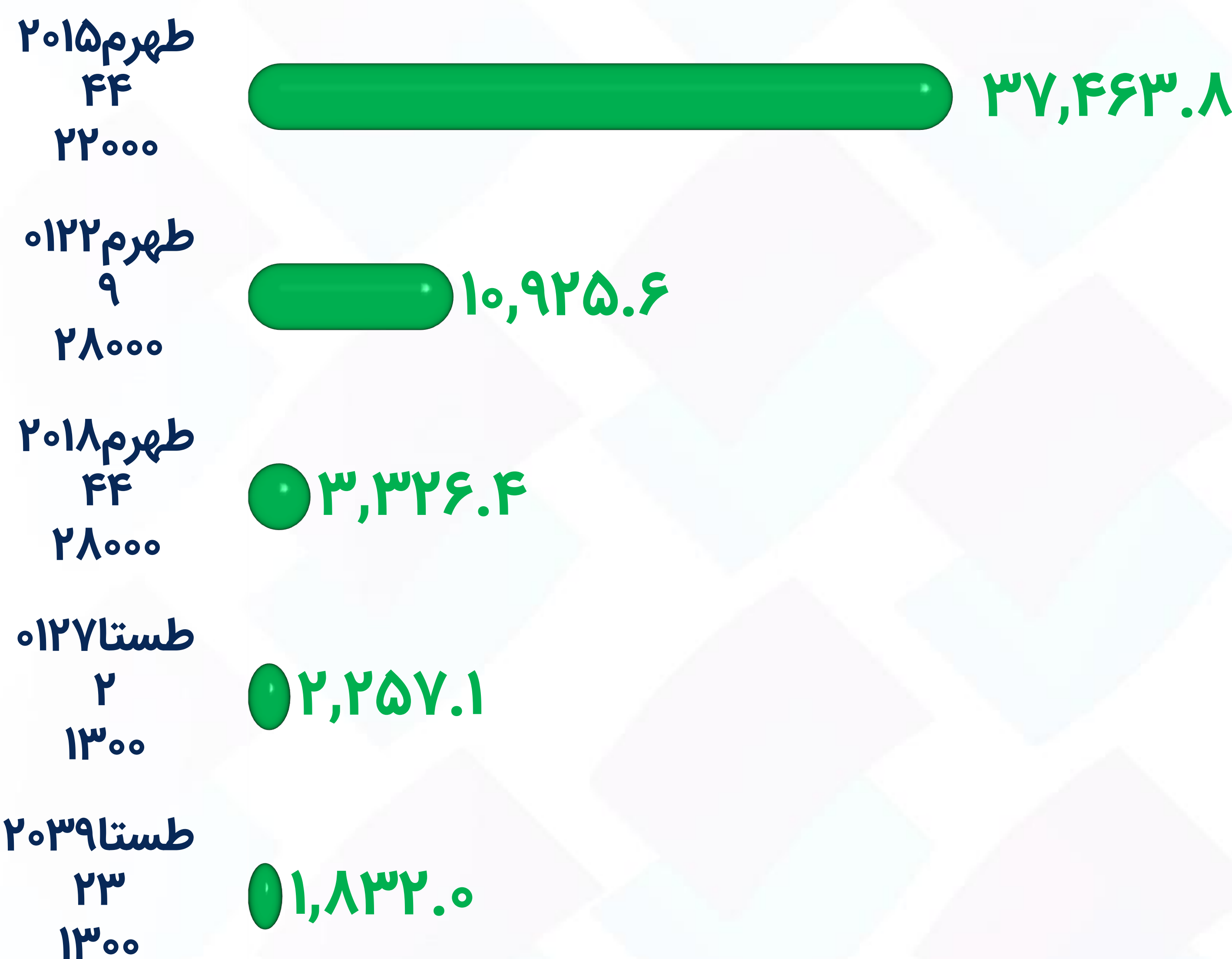
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

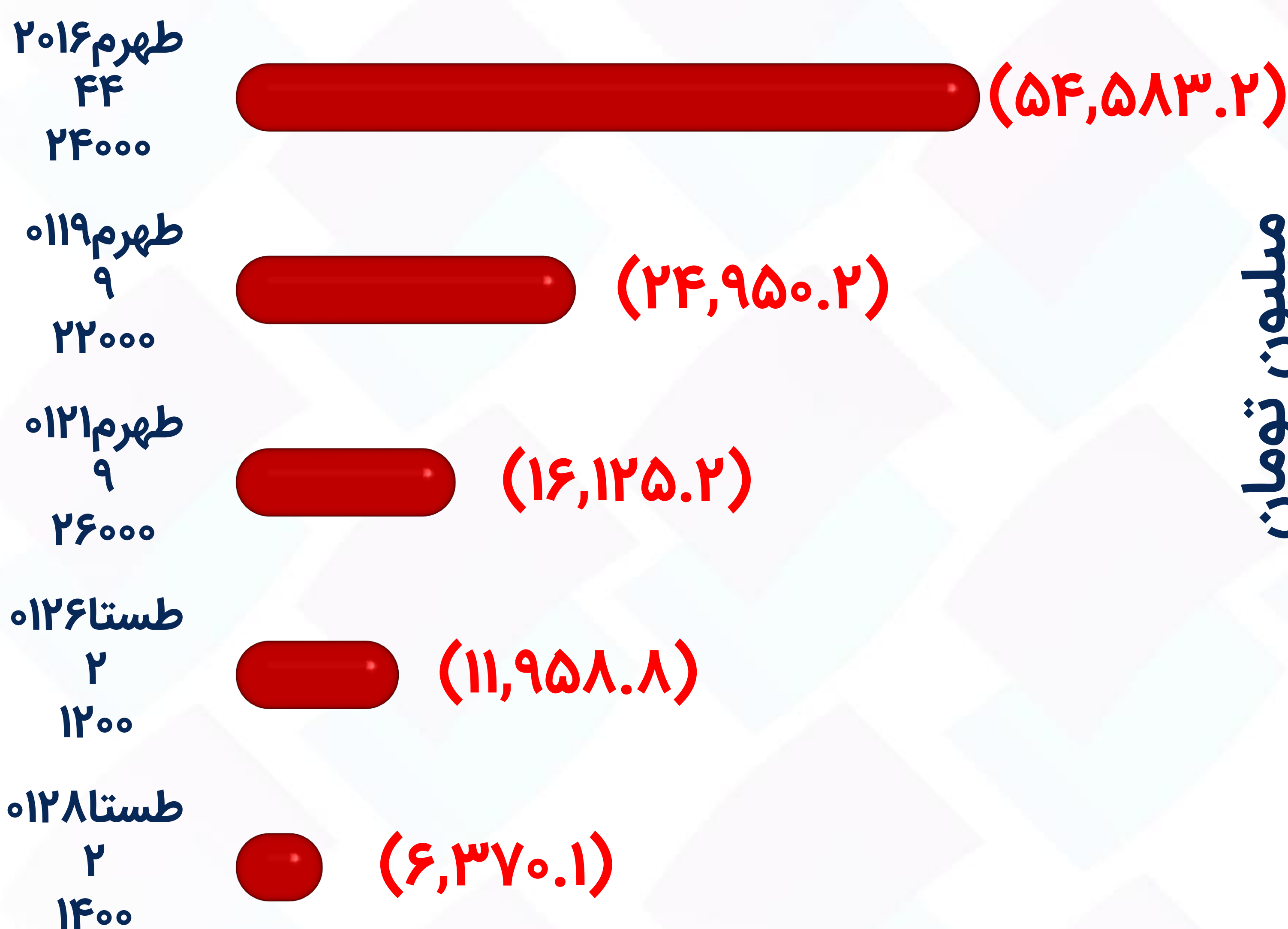
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

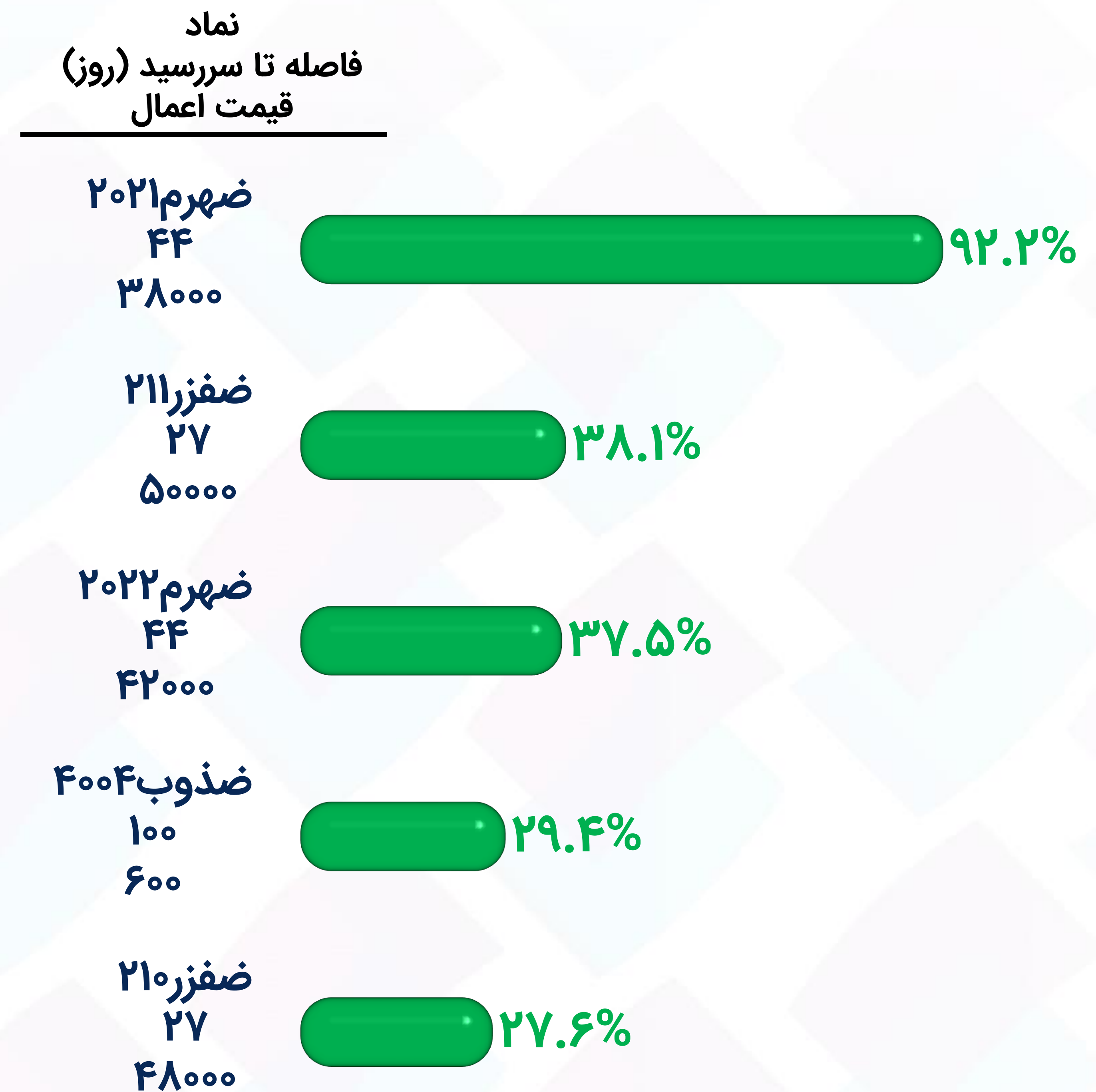
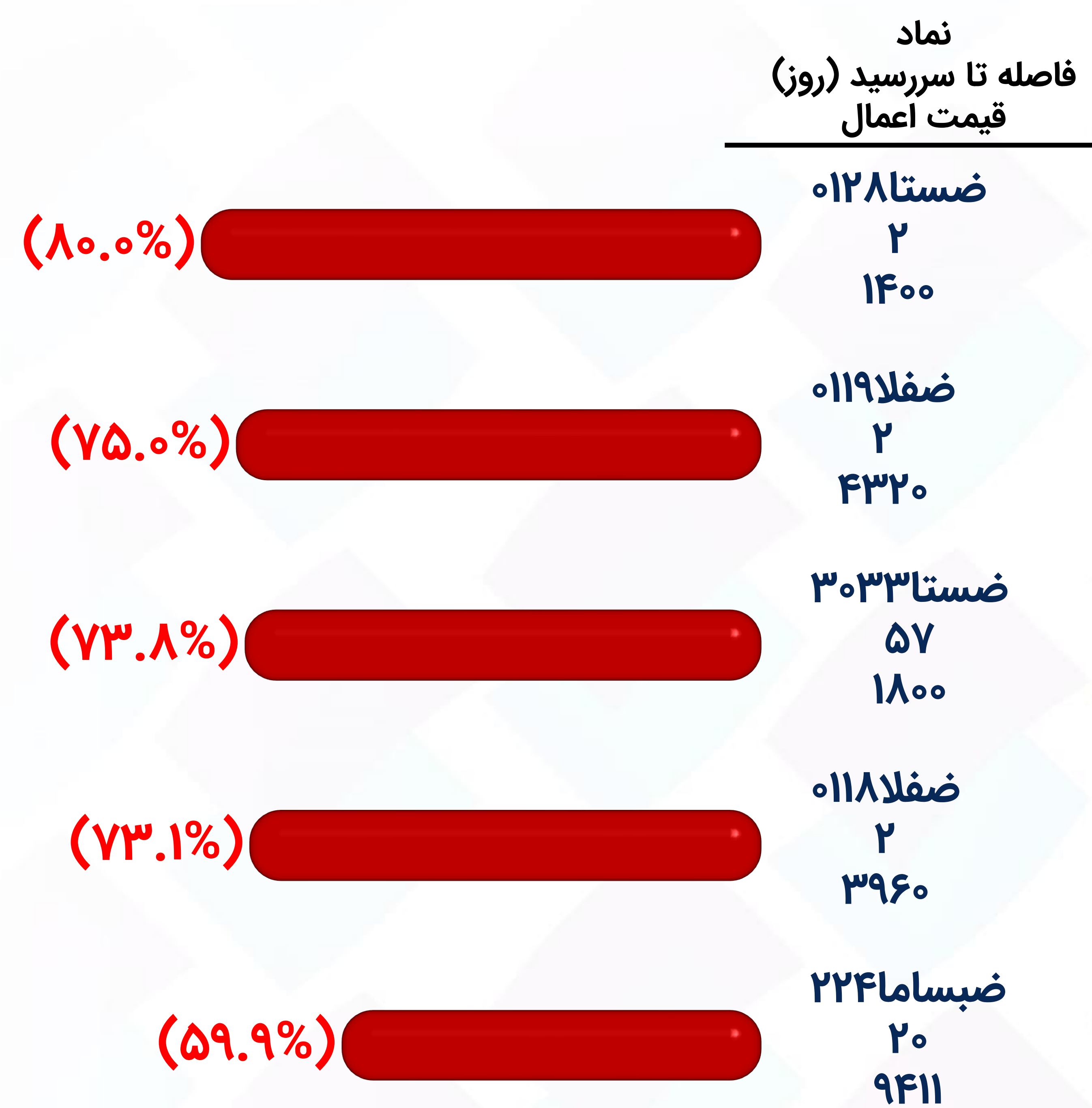
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



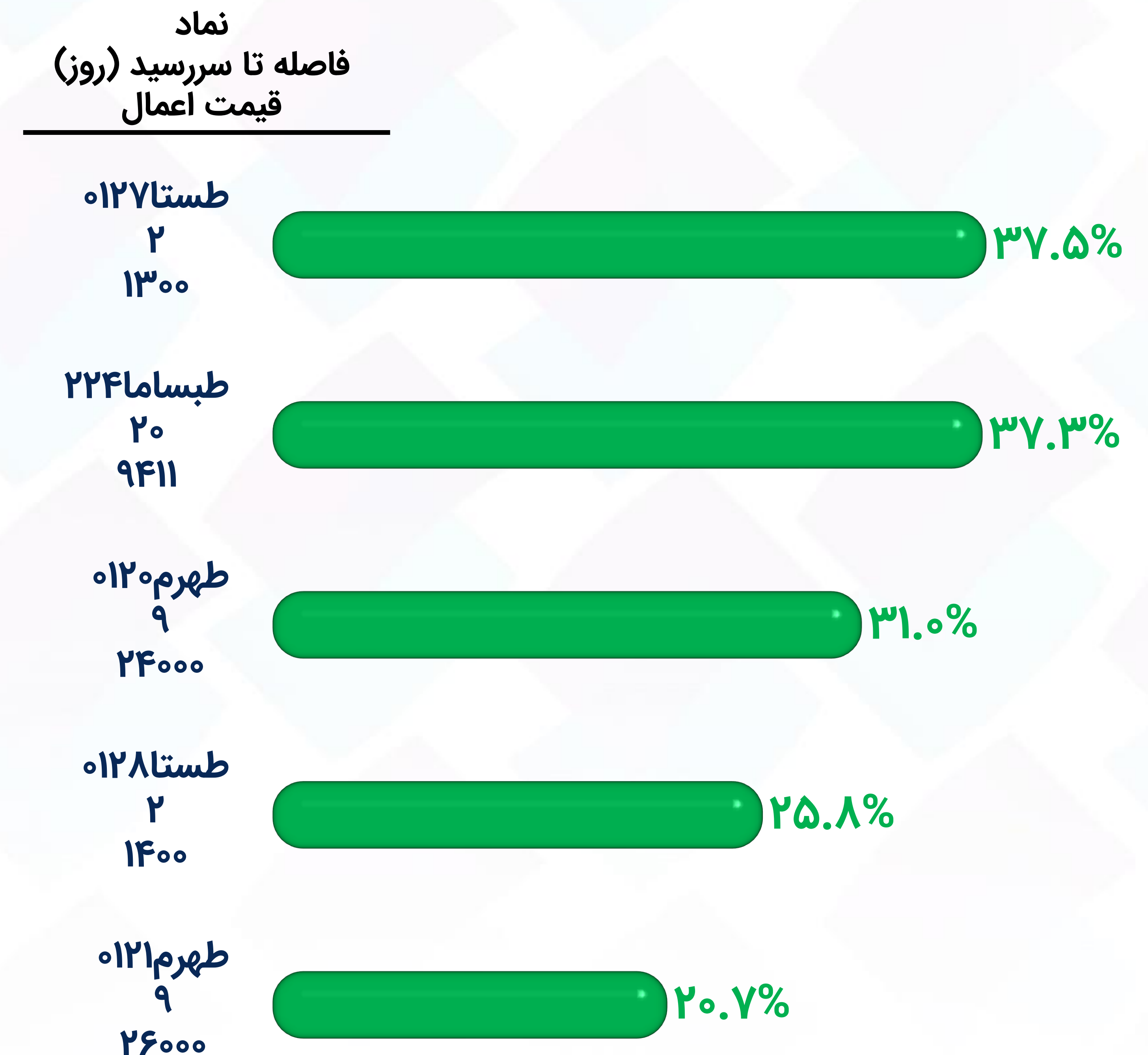
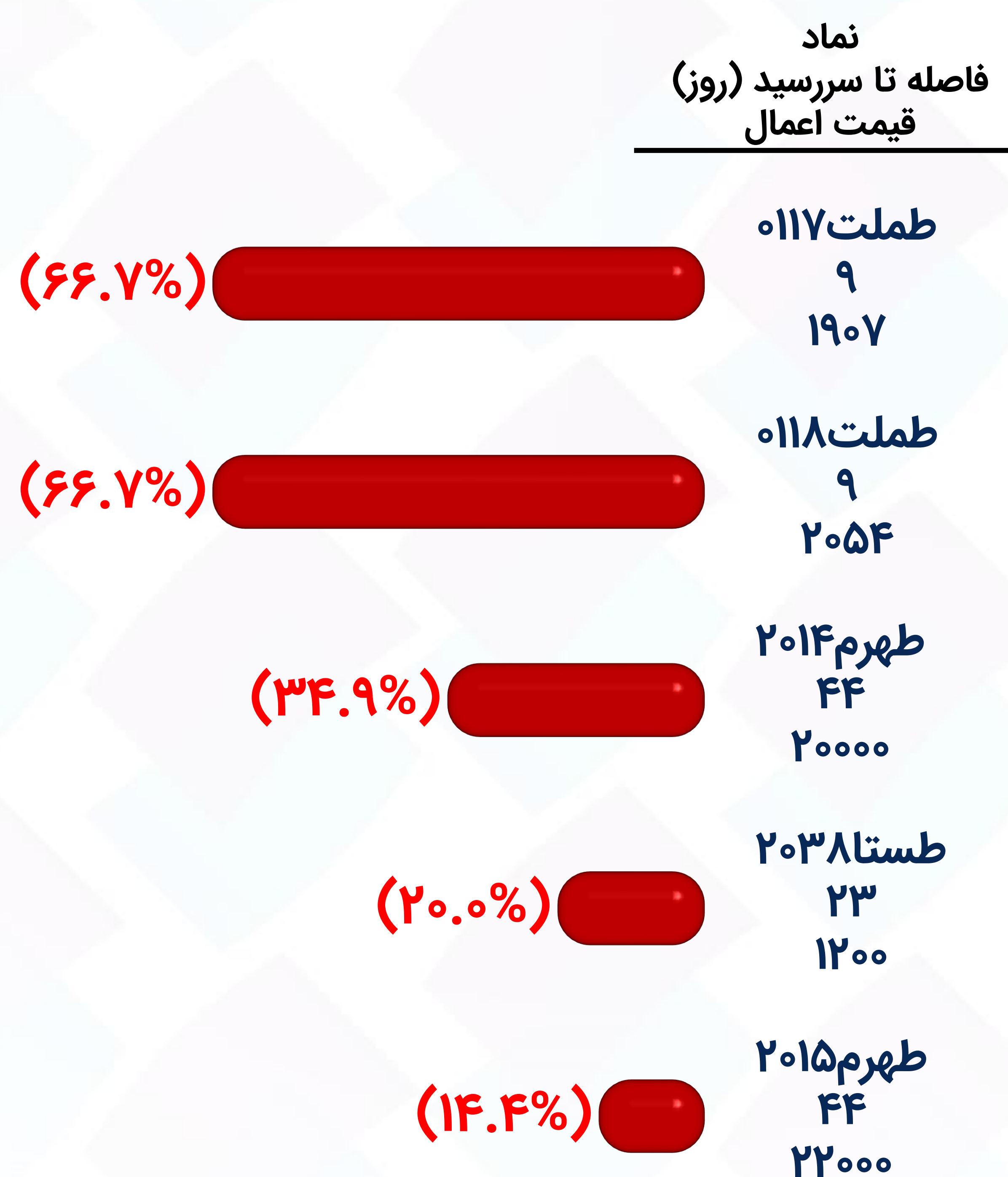
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

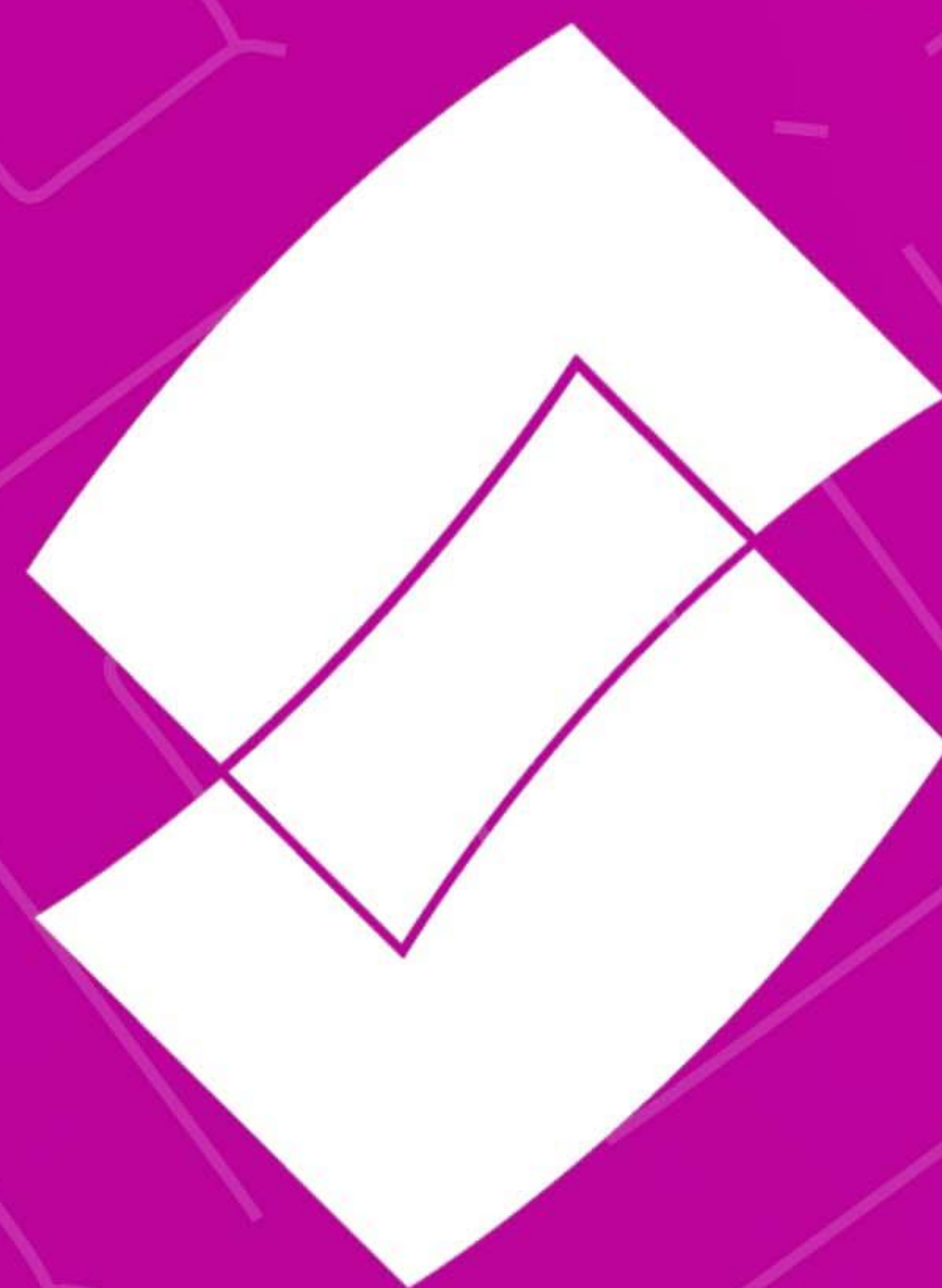
اختیار خرید



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

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.