

شماره
۴۵۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۹ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

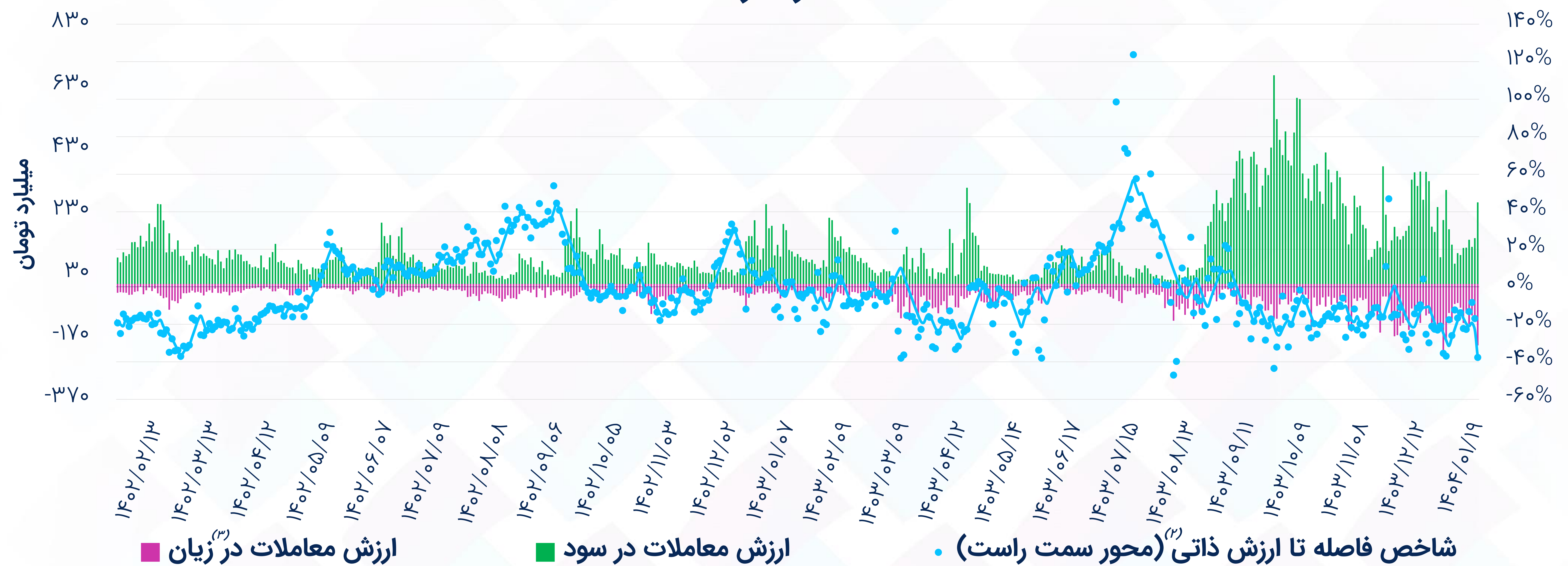




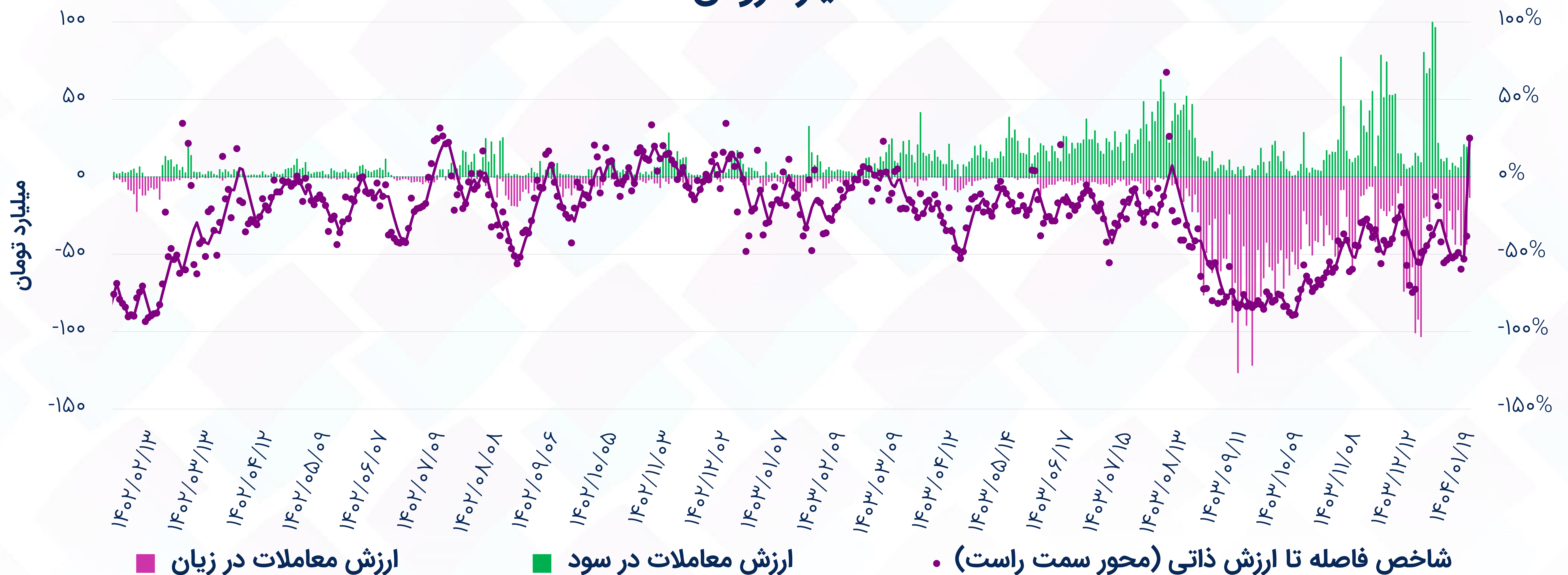
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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	۴۳	۳۱۳.۰	۵,۰۶۲.۲	۱۳۹.۱	۱۷۴.۰	(۴۶.۰%)
شستا	۴۶	۵۴.۹	۱,۳۰۸.۳	۴۰.۷	۱۴.۳	(۱۸.۱%)
وبملت	۲۴	۳۷.۷	۳۱۱.۰	۳۷.۲	۰.۵	(۱۹.۴%)
ذوب	۲۴	۲۲.۵	۱۶۵.۸	۱۹.۳	۳.۲	(۲۰.۲%)
وتجارت	۱۵	۸.۵	۷۷.۶	۷.۵	۱.۰	(۳۰.۵%)
وبصادر	۱۰	۵.۶	۳۷.۴	۳.۵	۲.۱	(۲۵.۳%)
فولاد	۱۵	۴.۴	۱۱۷.۷	۴.۴	۰.۰	(۳.۳%)

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	۱۶	۲۸,۶۰۵.۸	۲,۰۲۷,۱۲۹.۳	۱۵,۳۳۱.۸	۱۳,۲۷۳.۹	۲۴.۰%
شستا	۸	۹۴۰.۵	۲۲۲,۴۳۴.۸	۷۰۳.۴	۲۳۷.۱	۵۷.۷%
وبملت	۴	۱۲.۲	۱۳,۲۹۳.۹	۰.۰	۱۲.۲	(۹۶.۲%)
خودران	۴	۱۰.۹	۲۵۶.۳	۷.۳	۳.۷	(۹.۵%)
توان	۱	۱۰.۸	۲۵۷.۸	۱۰.۸	۰.۰	(۲۱.۰%)
بساما	۱	۹.۲	۱۷۰.۱	۹.۲	۰.۰	(۲۸.۱%)
اطلس	۱	۲.۵	۲۴۵.۱	۰.۰	۲.۵	(۸.۲%)

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 ۲,۴۹۰

شستا ۲۳۱

وبملت ۴۰

وتعاون ۸

بساما ۸

ذوب ۸

خودرو ۳

خودران ۲.۰۹

فملی ۲.۰۷

توان ۱.۴۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۴۷,۵۱۰.۰

توان ۲۵۶.۸

خودران ۱۰۰.۰

شپنا ۹۹.۰

وتجارت ۵۱.۲

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۷۷,۰۰۳.۷)

وبملت (۲,۵۸۲.۳)

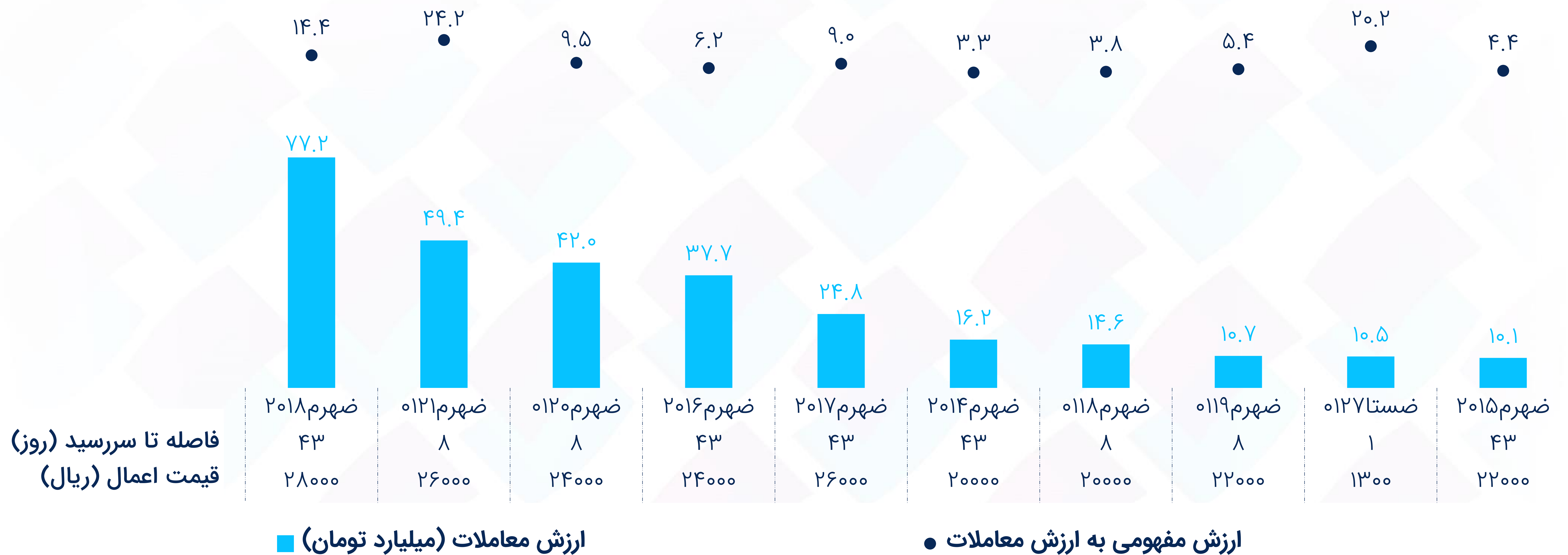
فولاد (۳۱۵.۰)

اطلس (۲۴۰.۰)

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
ضفر ۲۰۷	فزر	۴۲,۰۰۰	۲۶	۳.۸	۷,۵۰۰	۵۳,۳۰۰	۴۹,۵۰۰	(۷.۱%)	۶.۶	۱.۰۰	۱۲,۳۹۹	۶۵%
ضفر ۲۱۱	فزر	۵۰,۰۰۰	۲۶	۱۳۲.۷	۳,۱۳۶	۵۳,۳۰۰	۵۳,۱۳۶	(۰.۳%)	۱۶.۹	۰.۸۷	۴,۹۰۹	۵۷%
ضفر ۲۱۰	فزر	۴۸,۰۰۰	۲۶	۱۲۹.۱	۴,۶۲۷	۵۳,۳۰۰	۵۲,۶۲۷	(۱.۳%)	۱۱.۴	۰.۹۵	۶,۶۵۸	۴۴%
ضشنا ۲۰۴	شپنا	۳,۱۶۹	۲۹	۲.۹	۳۳۰	۳,۵۳۲	۳,۴۹۹	(۰.۹%)	۱۰.۶	۰.۹۳	۴۷۱	۴۳%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۱۹	۵.۵	۲,۳۰۰	۸,۹۷۰	۸,۵۴۶	(۴.۷%)	۳.۷	۱.۰۰	۲,۸۴۵	۲۴%

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
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۳۶	۳.۸	۴	۴۴۵	۸۰۴	۸۱%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۱۳۵.۶	۳۴	۲۵,۲۶۰	۳۴,۰۳۴	۳۵%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۲۲	۱.۵	۵	۱,۳۵۶	۱,۹۰۵	۴۰%	۳۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۵۶	۱۱.۲	۱۶	۱,۳۵۶	۲,۲۱۶	۶۳%	۱۳۸.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۳	۲۱۲.۷	۲۰۱	۲۵,۲۶۰	۴۲,۲۰۱	۶۷%	۲۱۰.۰	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
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۳	۲۵.۰	۲,۵۰۰	۲۵,۲۶۰	۳۱,۵۰۰	۲۴.۷%	۱۲.۶	-۰.۹۷	۷,۲۹۶	۱۹۱.۸%
طهرم ۰۱۲۱	اهرم	۲۶,۰۰۰	۸	۶,۰۹۶.۳	۴۲۹	۲۵,۲۶۰	۲۵,۵۷۱	۱.۲%	۵۹.۶	-۰.۶۱	۸۹۸	۱۰۹.۳%
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۸	۱,۷۳۳.۸	۱,۵۸۵	۲۵,۲۶۰	۲۶,۴۱۵	۴.۶%	۱۶.۷	-۰.۹۳	۲,۵۱۴	۵۸.۶%
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۸	۳۴.۶	۳,۳۲۵	۲۵,۲۶۰	۲۶,۶۷۵	۵.۶%	۸.۰	-۱.۰۰	۴,۴۵۱	۳۳.۹%
طهرم ۰۱۲۰	اهرم	۲۴,۰۰۰	۸	۲,۴۰۳.۹	۹۵	۲۵,۲۶۰	۲۳,۹۰۵	(۵.۴%)	۲۵۱.۶	-۰.۱۵	۱۲۷	۳۳.۴%

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
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۸	۱.۶	۱	۲,۳۷۹	۱,۹۰۶	(۱۹.۹%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۸	۵.۶	۱۴	۲۵,۲۶۰	۱۹,۹۸۶	(۲۰.۹%)	۱,۴۲۷.۶	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهمن ۰۱۱۷	خبهن	۱,۷۰۰	۸	۰.۰	۱۱۰	۱,۸۸۳	۱,۵۹۰	(۱۵.۶%)	۱۴.۵	-۰.۰۲	۱	(۹۹.۴%)
طستر ۰۳۰	خگستر	۳,۷۵۰	۱۵	۰.۴	۷	۴,۷۲۱	۳,۷۴۳	(۲۰.۷%)	۵۳۴.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۲%)
طملت ۰۱۱۸	وبملت	۲,۰۵۴	۸	۷.۸	۲	۲,۳۷۹	۲,۰۵۲	(۱۳.۷%)	۱,۰۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۹۶.۴%)

(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

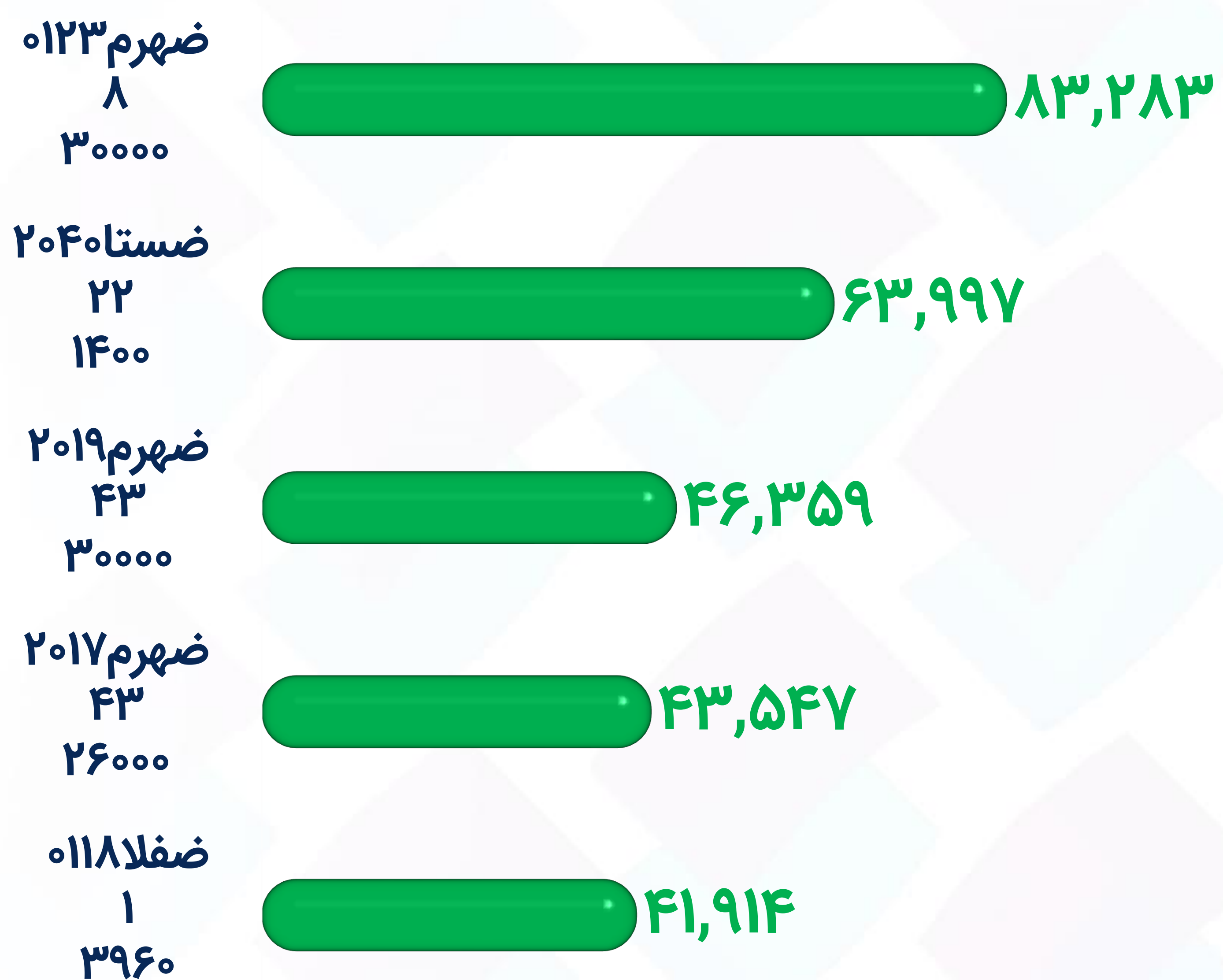
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

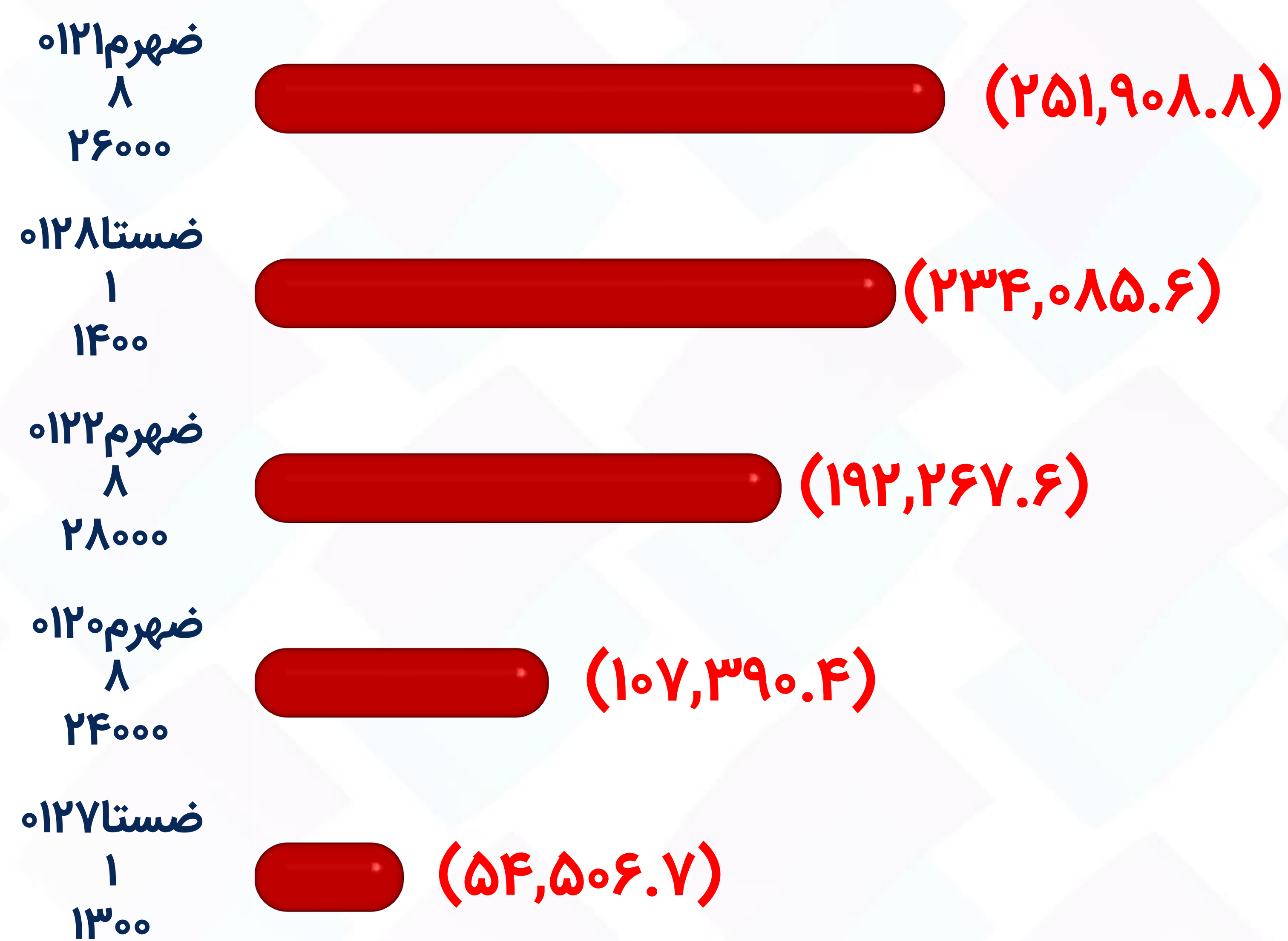
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

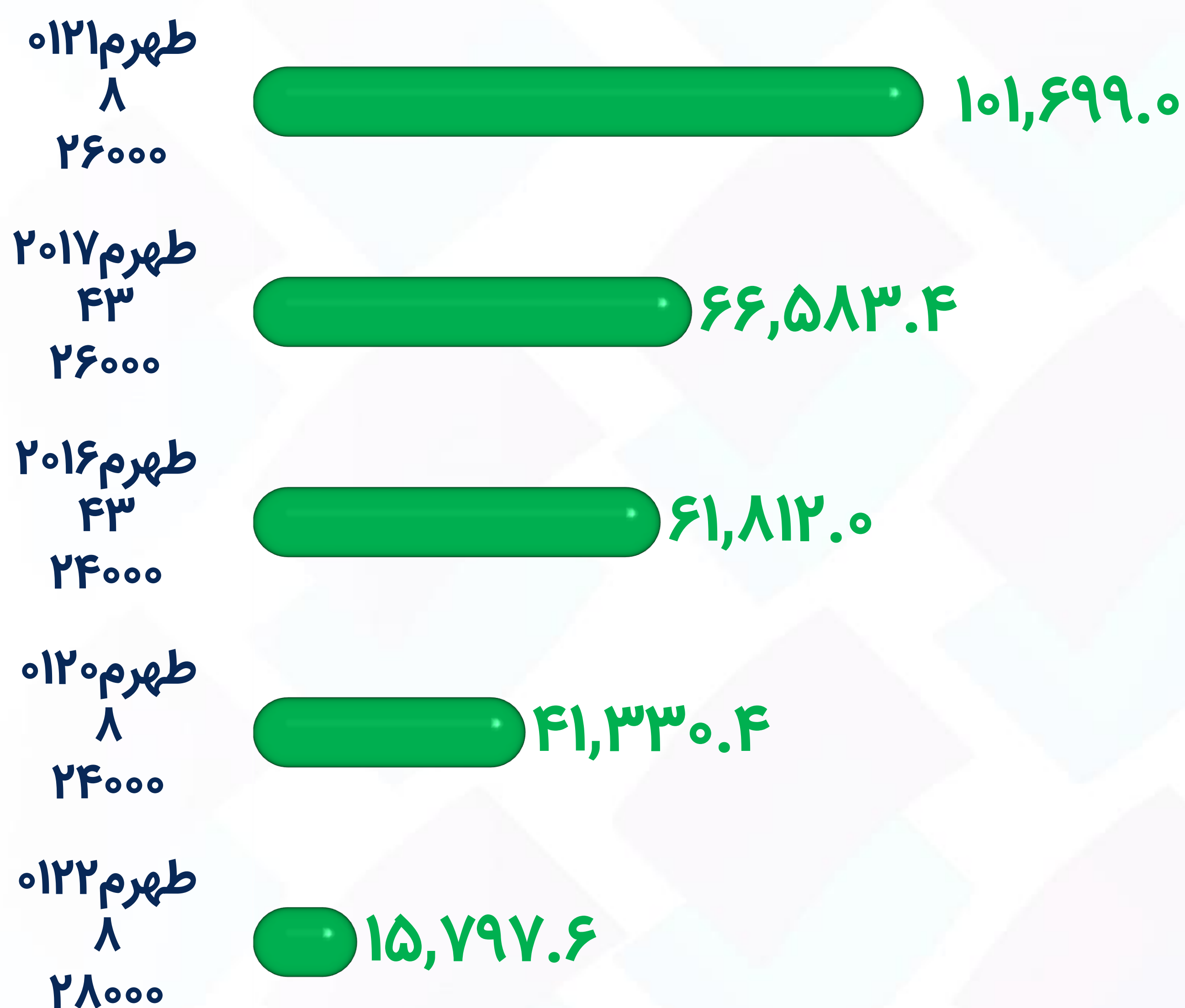
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

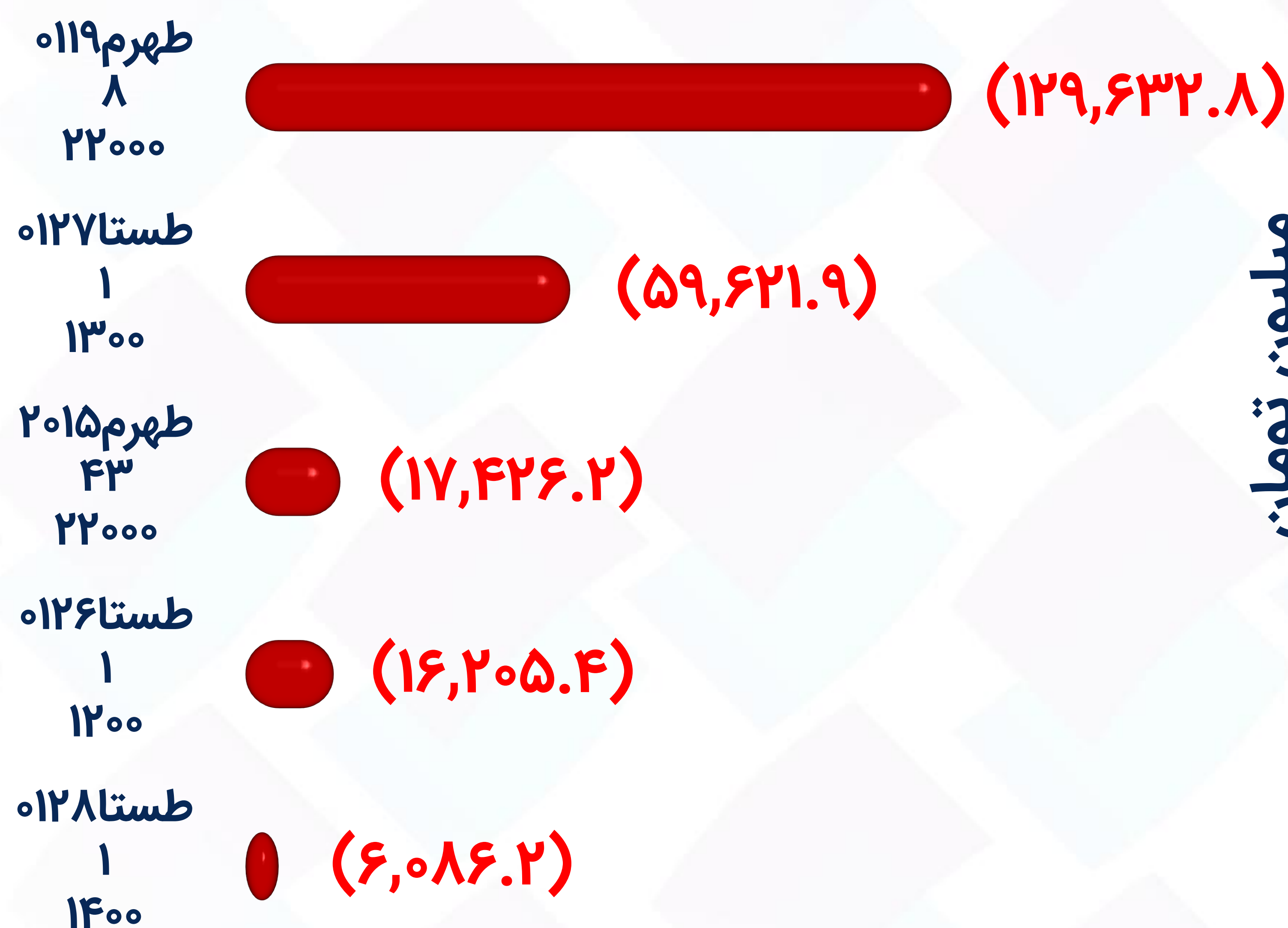
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.