

شماره
۴۵۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۰ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

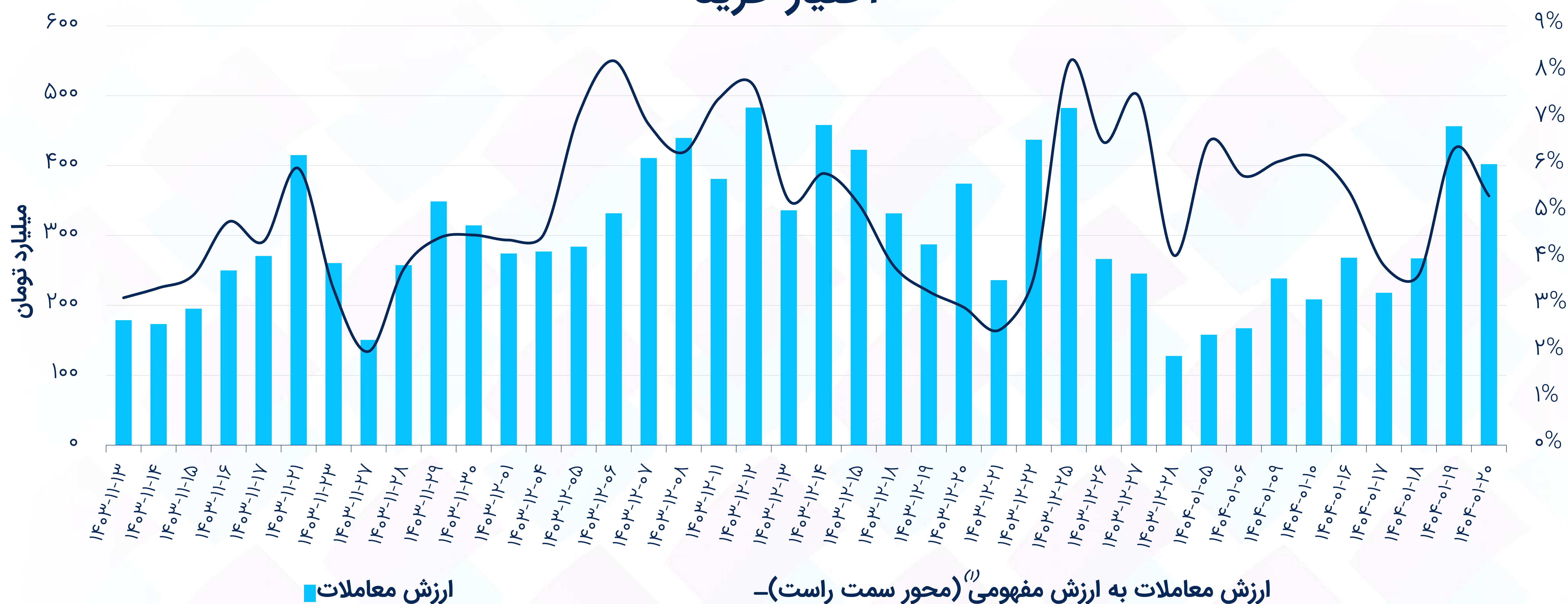




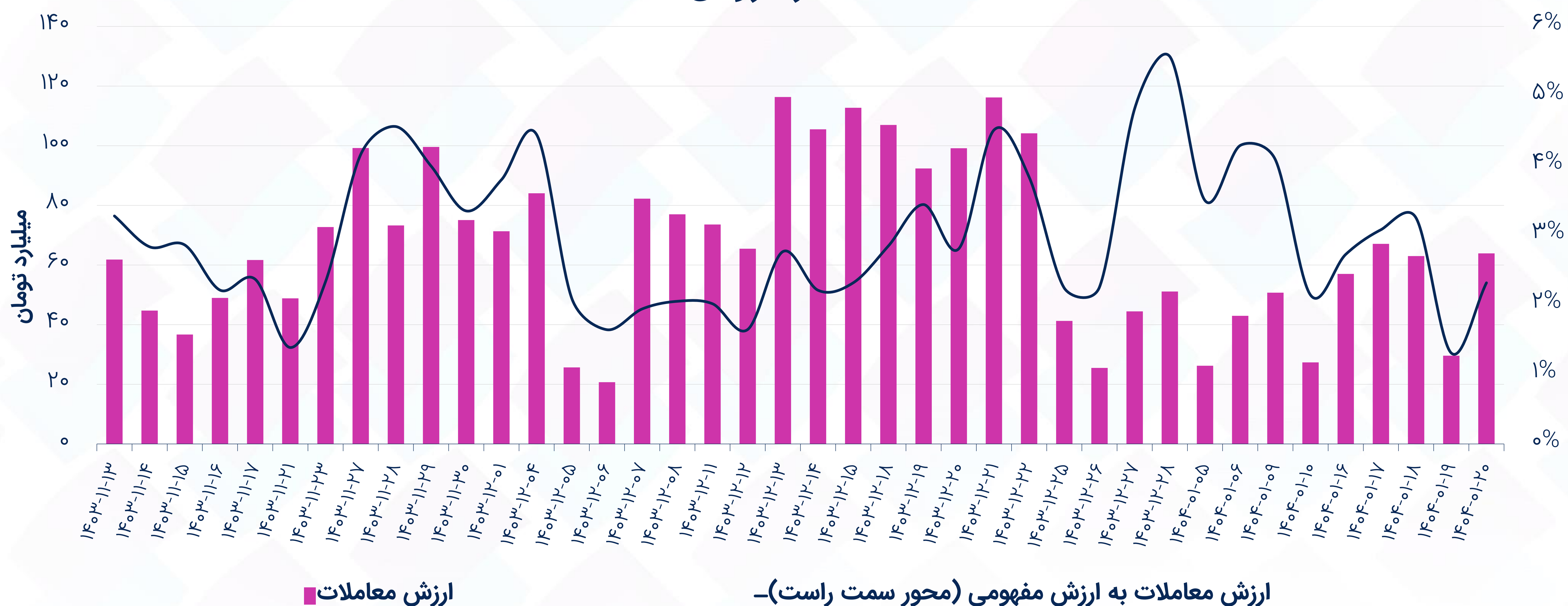
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



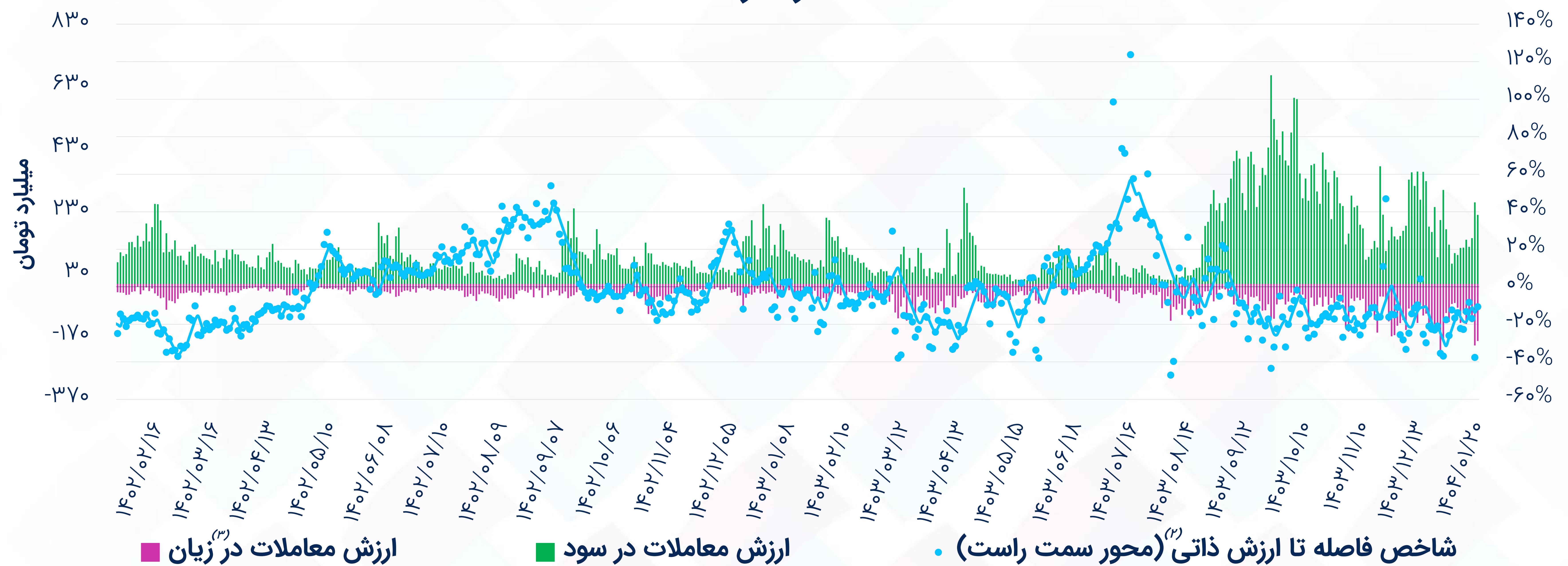
اختیار فروش



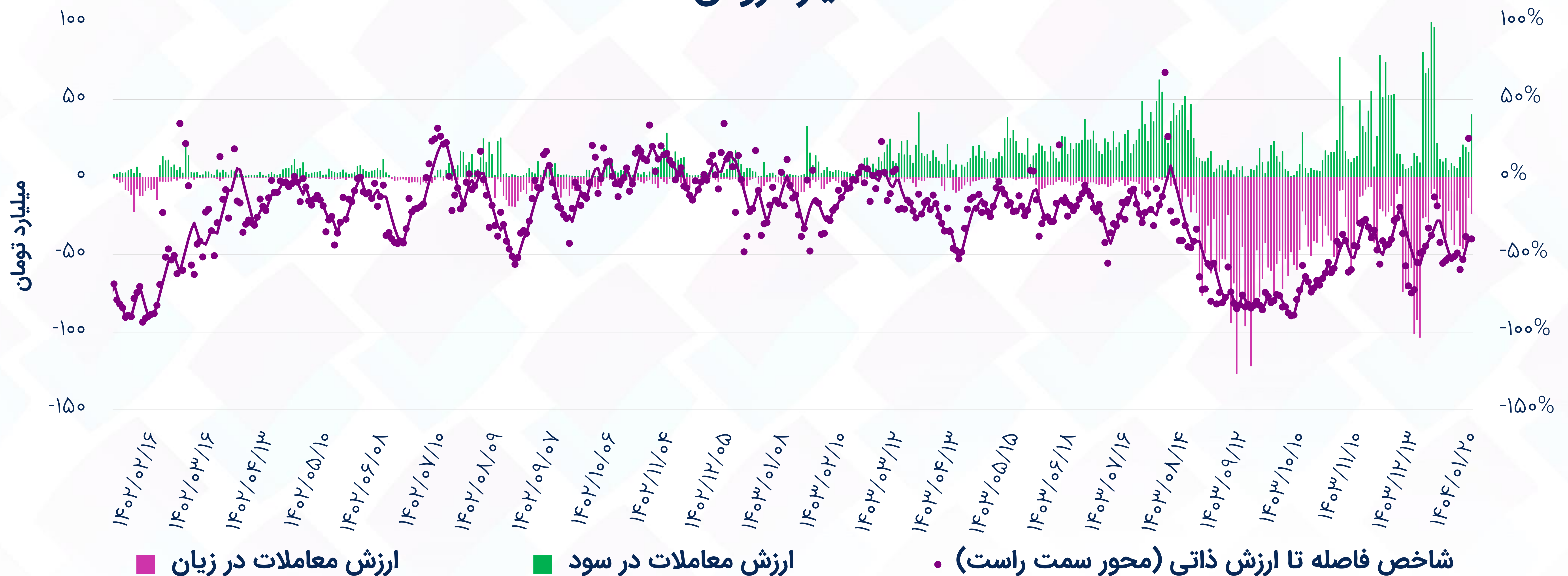
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

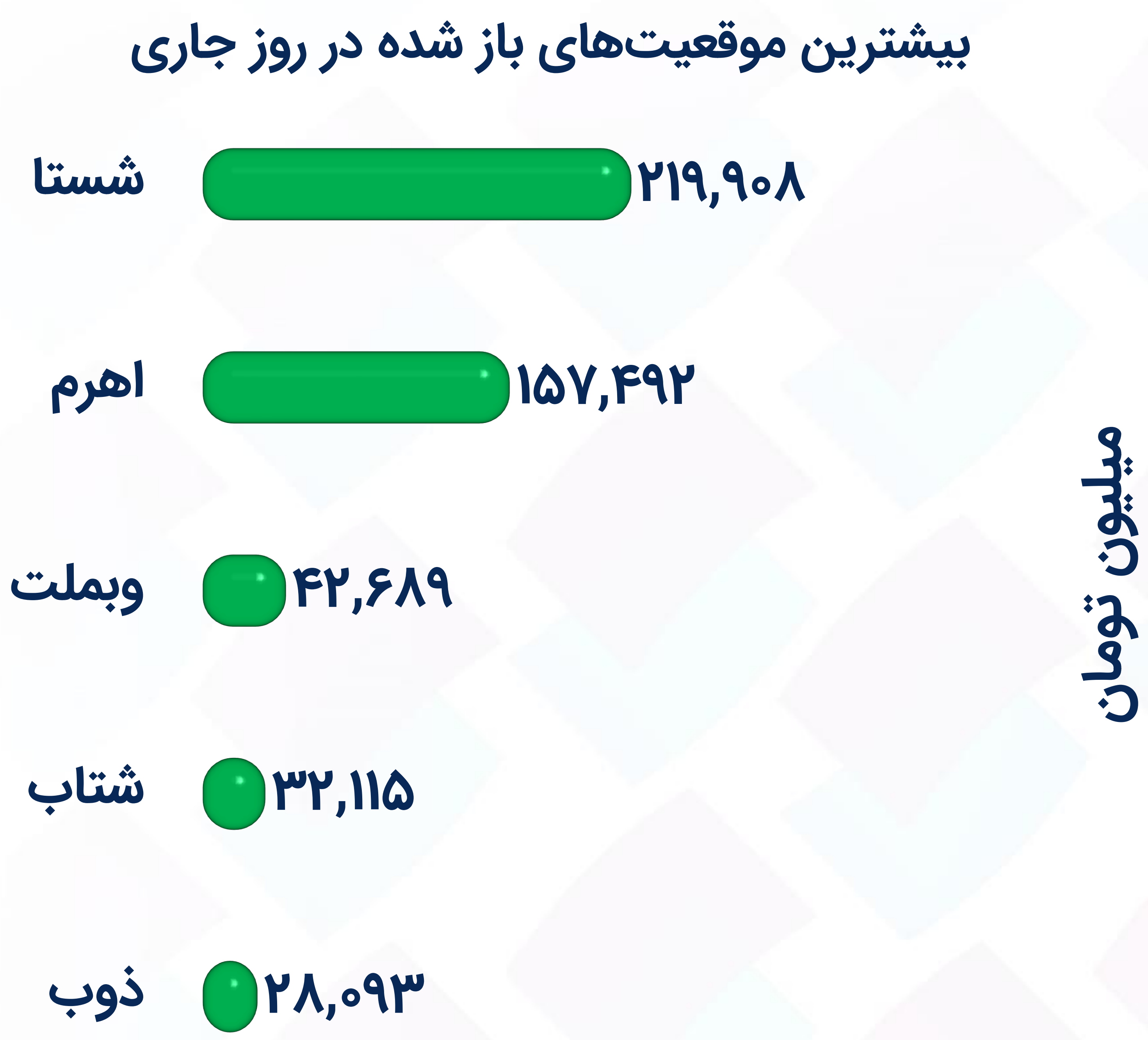
اختیار خرید

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	۴۶	۲۸۶.۸	۵,۷۹۲.۱	۱۱۸.۵	۱۶۸.۳	(۱۸.۹%)
شستا	۴۵	۳۷.۸	۱,۰۱۹.۹	۲۹.۲	۸.۶	۲۵.۳%
وبملت	۲۴	۳۴.۱	۳۰۵.۶	۳۳.۲	۰.۹	۸.۸%
ذوب	۲۲	۱۴.۶	۱۲۵.۳	۱۳.۲	۱.۴	(۷.۱%)
شتاب	۱۵	۱۲.۳	۹۳.۴	۱۰.۶	۱.۸	۱.۷%
وتجارت	۱۵	۵.۹	۵۳.۹	۵.۳	۰.۶	(۱۴.۴%)
وبصادر	۱۲	۱.۹	۱۳.۰	۱.۴	۰.۴	(۱۷.۸%)

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	۱۸	۶۱,۹۵۴.۶	۲,۶۲۱,۶۸۳.۱	۳۹,۲۱۶.۱	۲۲,۷۳۸.۶	(۳۹.۹%)
شستا	۸	۱,۸۹۹.۱	۱۲۴,۹۹۷.۶	۱,۰۹۳.۴	۸۰۵.۶	(۳۹.۹%)
شپنا	۲	۱۱.۳	۳۲۱.۵	۱۱.۳	۰.۰	(۷.۷%)
ذوب	۴	۱۰.۲	۴۹۱.۷	۶.۴	۳.۸	(۳۳.۱%)
وبملت	۷	۹.۵	۶,۱۸۰.۴	۰.۰	۹.۵	(۹۰.۷%)
وتعاون	۱	۲.۹	۵,۱۶۷.۸	۰.۰	۲.۹	(۱۰۰.۰%)
موج	۱	۱.۴	۴۵.۹	۱.۴	۰.۰	۱۴۹.۲%

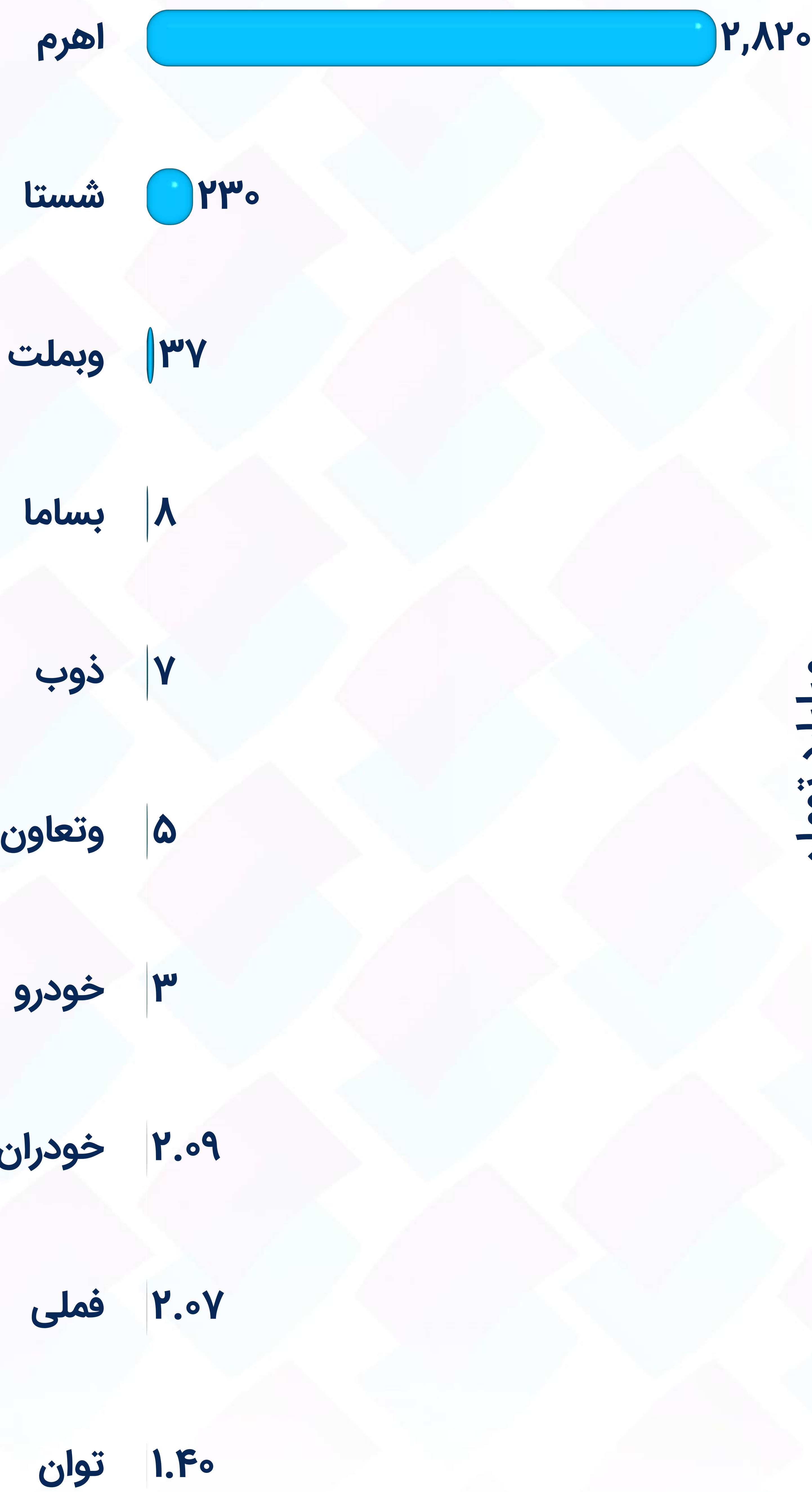
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



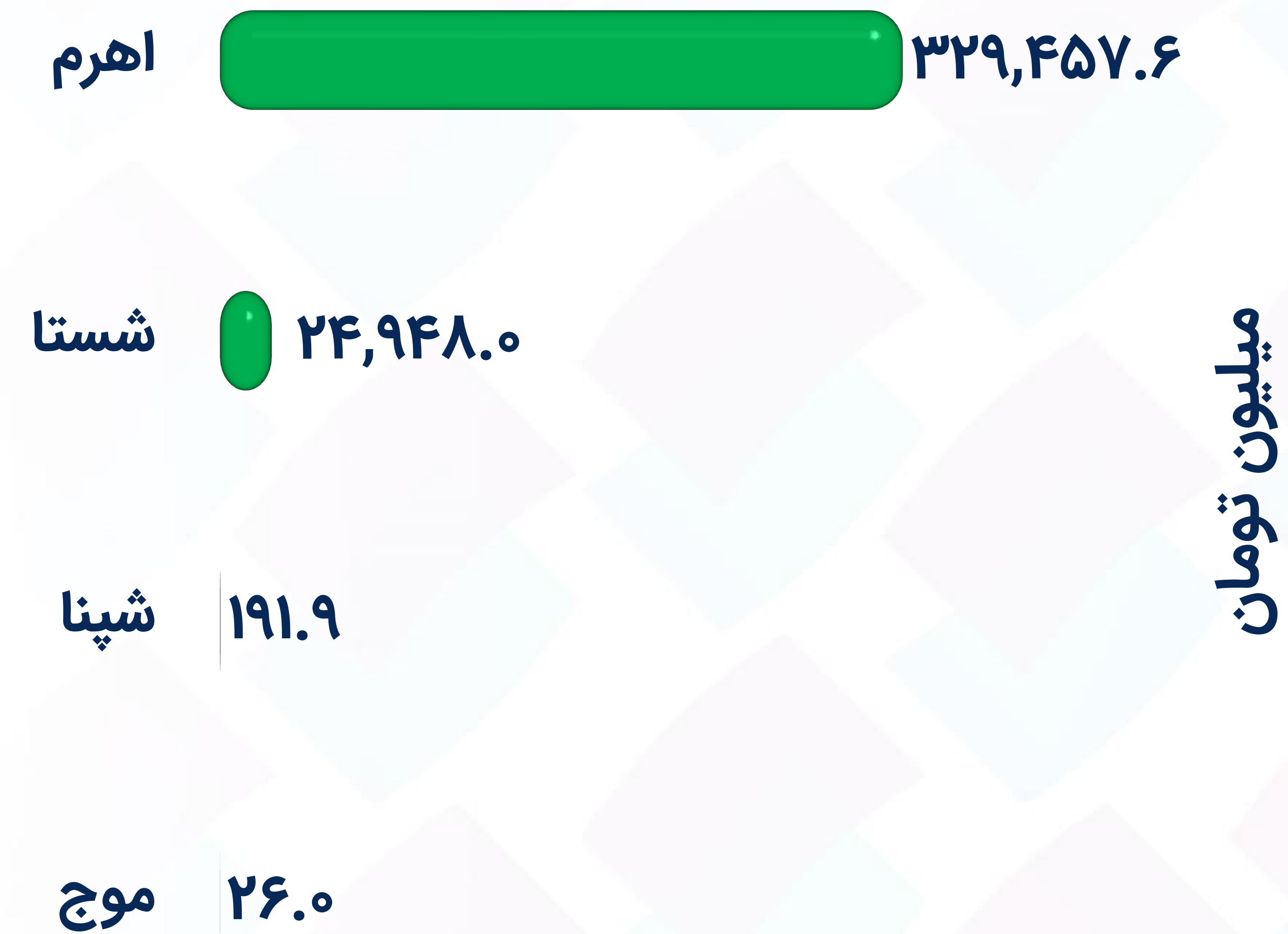
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

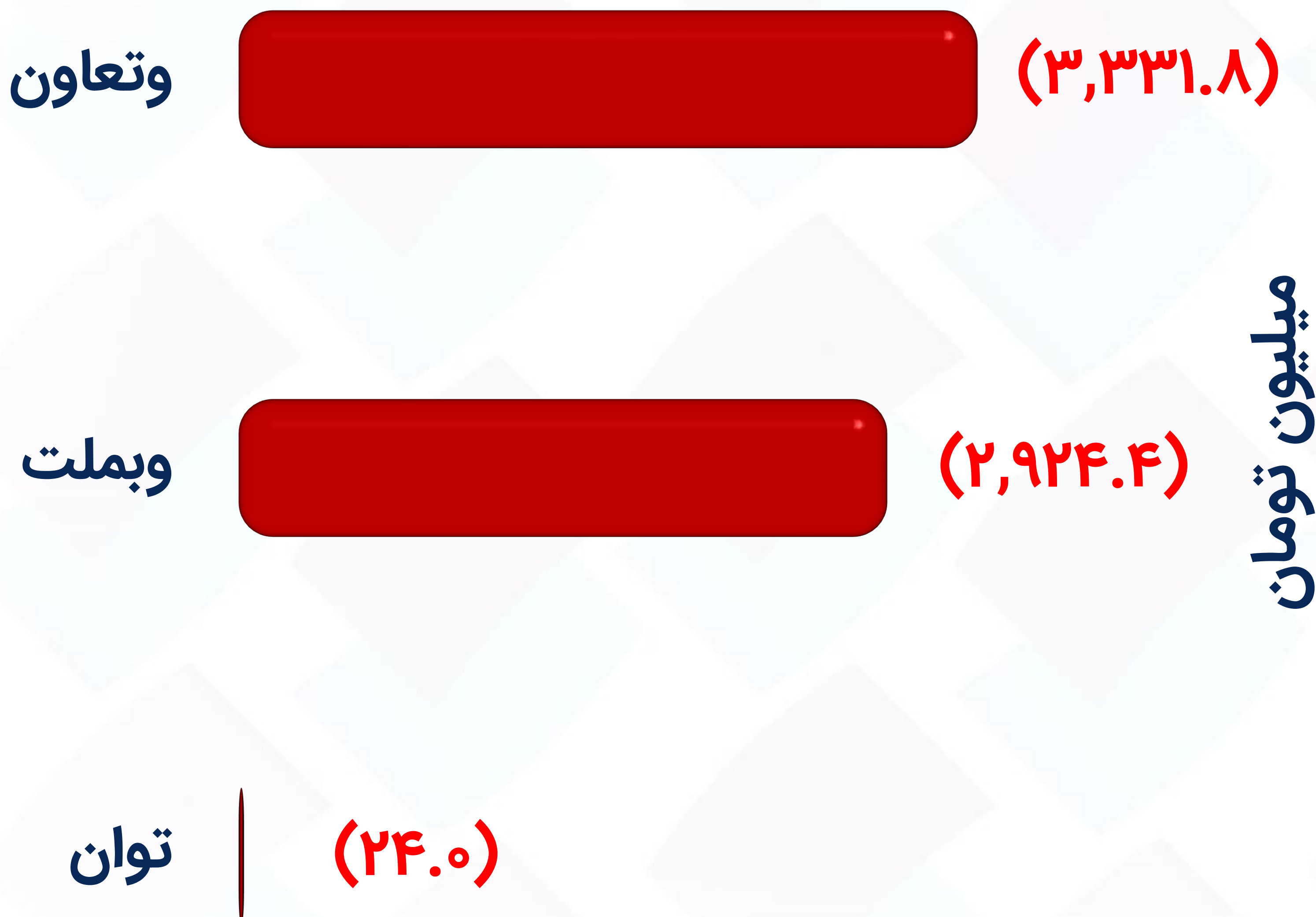
ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته 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
ضرویین ۱۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۱۱	۶۷.۰	۴۸۸	۱۲,۶۳۴	۱۲,۴۸۸	(۱.۲%)	۲۵.۶	۰.۹۳	۷۸۱	۶۰%
ضبساما ۵۰۳	بساما	۸,۰۰۰	۱۰۹	۱۲۴.۷	۱,۱۰۱	۸,۸۹۰	۹,۱۰۱	۲.۴%	۸.۳	۰.۹۶	۱,۶۷۲	۵۲%
ضوتعاون ۱۰۸	وتعاون	۱,۵۰۰	۴	۱۱.۳	۱۸۴	۱,۷۶۹	۱,۶۸۴	(۴.۸%)	۹.۲	۱.۰۰	۲۷۵	۵۰%
ضبساما ۵۰۲	بساما	۷,۵۰۰	۱۰۹	۵۶۶.۳	۱,۵۵۲	۸,۸۹۰	۹,۰۵۲	۱.۸%	۵.۸	۰.۹۹	۲,۱۱۱	۳۶%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۱۱	۱۳.۰	۱,۳۰۰	۱۲,۶۳۴	۱۲,۳۰۰	(۲.۶%)	۹.۵	۱.۰۰	۱,۷۵۵	۳۵%

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 ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۳۵	۴.۰	۴	۴۴۴	۸۰۴	۸۱%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۴۶.۵	۱۵	۲۵,۹۹۰	۳۴,۰۱۵	۳۱%	۲,۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۲۱	۱.۳	۳	۱,۳۶۵	۱,۹۰۳	۳۹%	۶۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۲۱	۲.۰	۵	۱,۳۶۵	۱,۸۰۵	۳۲%	۳۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۲	۱۷۸.۰	۱۸۱	۲۵,۹۹۰	۴۲,۱۸۱	۶۲%	۲۳۳.۰	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
طموج ۲۱۹	موج	۲۶,۰۰۰	۳۲	۱.۴	۷۲۹	۲۴,۱۴۶	۲۵,۲۷۱	۴.۷%	۳۴.۷	-۰.۶۱	۱,۸۱۷	۱۴۹.۲%
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۲	۸۱.۰	۶,۶۳۹	۲۵,۹۹۰	۲۷,۳۶۱	۵.۳%	۴.۱	-۰.۹۵	۶,۶۵۰	۰.۲%
طهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۲۴.۰	۸,۰۰۰	۲۵,۹۹۰	۲۶,۰۰۰	۰.۰%	۳.۳	-۱.۰۰	۷,۷۳۰	(۳.۴%)
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۷	۴,۴۴۱.۱	۱,۹۴۶	۲۵,۹۹۰	۲۶,۰۵۴	۰.۲%	۱۳.۴	-۰.۸۷	۱,۸۷۲	(۳.۸%)
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۳,۵۲۱	۲۸	۱۱.۳	۱۲۲	۳,۴۶۵	۳,۳۹۹	(۱.۹%)	۲۷.۹	-۰.۴۳	۱۱۳	(۷.۷%)

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 ۰۱۱۶	وبملت	۱,۷۶۰	۷	۰.۰	۱	۲,۴۴۸	۱,۷۵۹	(۲۸.۱%)	۱,۷۵۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۴۴	وبملت	۱,۱۷۴	۶۳	۰.۰	۱	۲,۴۴۸	۱,۱۷۳	(۵۲.۱%)	۱,۱۷۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طوتعاون ۱۰۸	وتعاون	۱,۵۰۰	۴	۲.۹	۱	۱,۷۶۹	۱,۴۹۹	(۱۵.۳%)	۱,۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۷	۰.۳	۲	۲,۴۴۸	۱,۹۰۵	(۲۲.۲%)	۹۵۲.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷	۰.۸	۹	۲۵,۹۹۰	۱۹,۹۹۱	(۲۳.۱%)	۲,۲۲۱.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

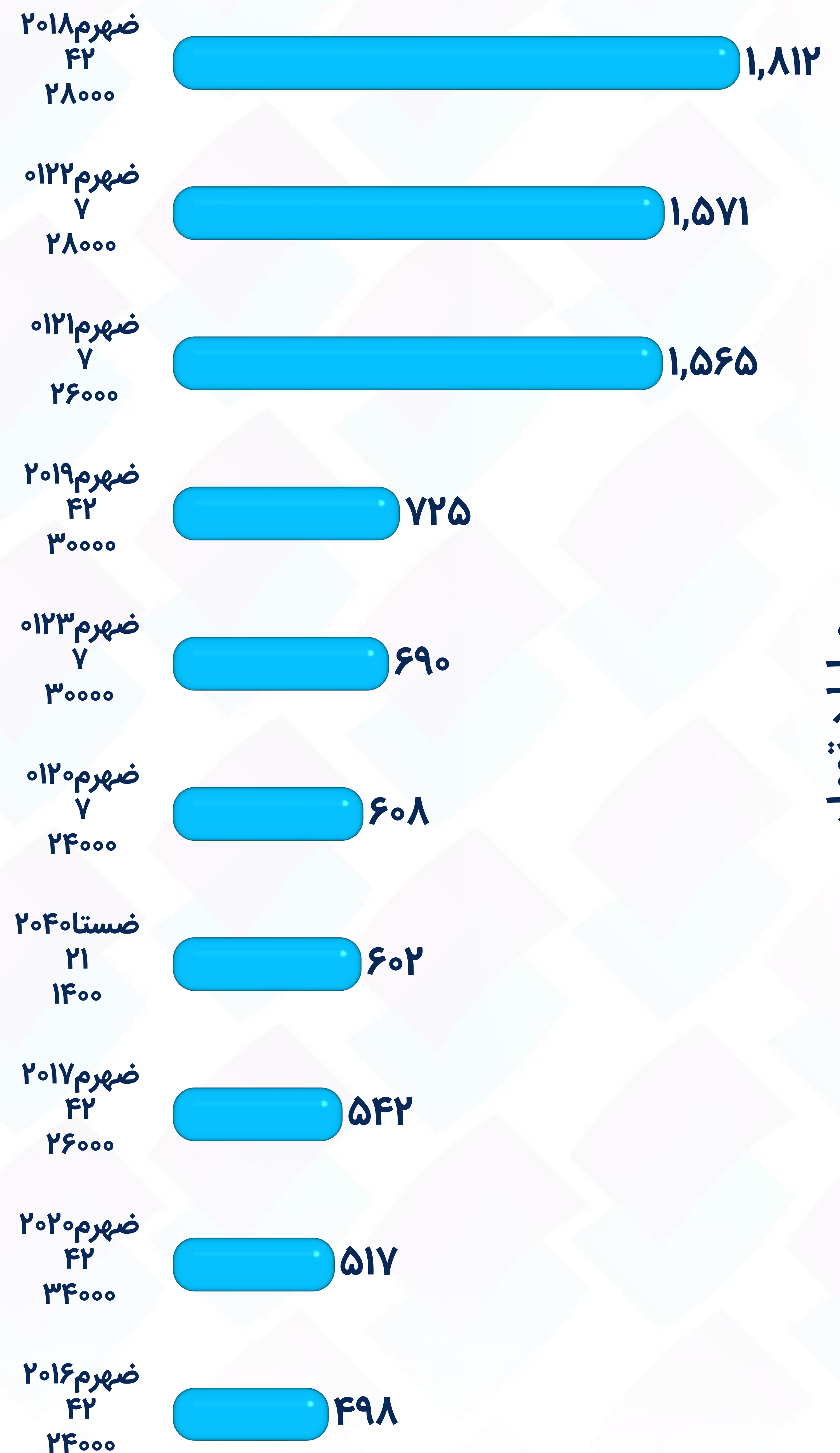
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

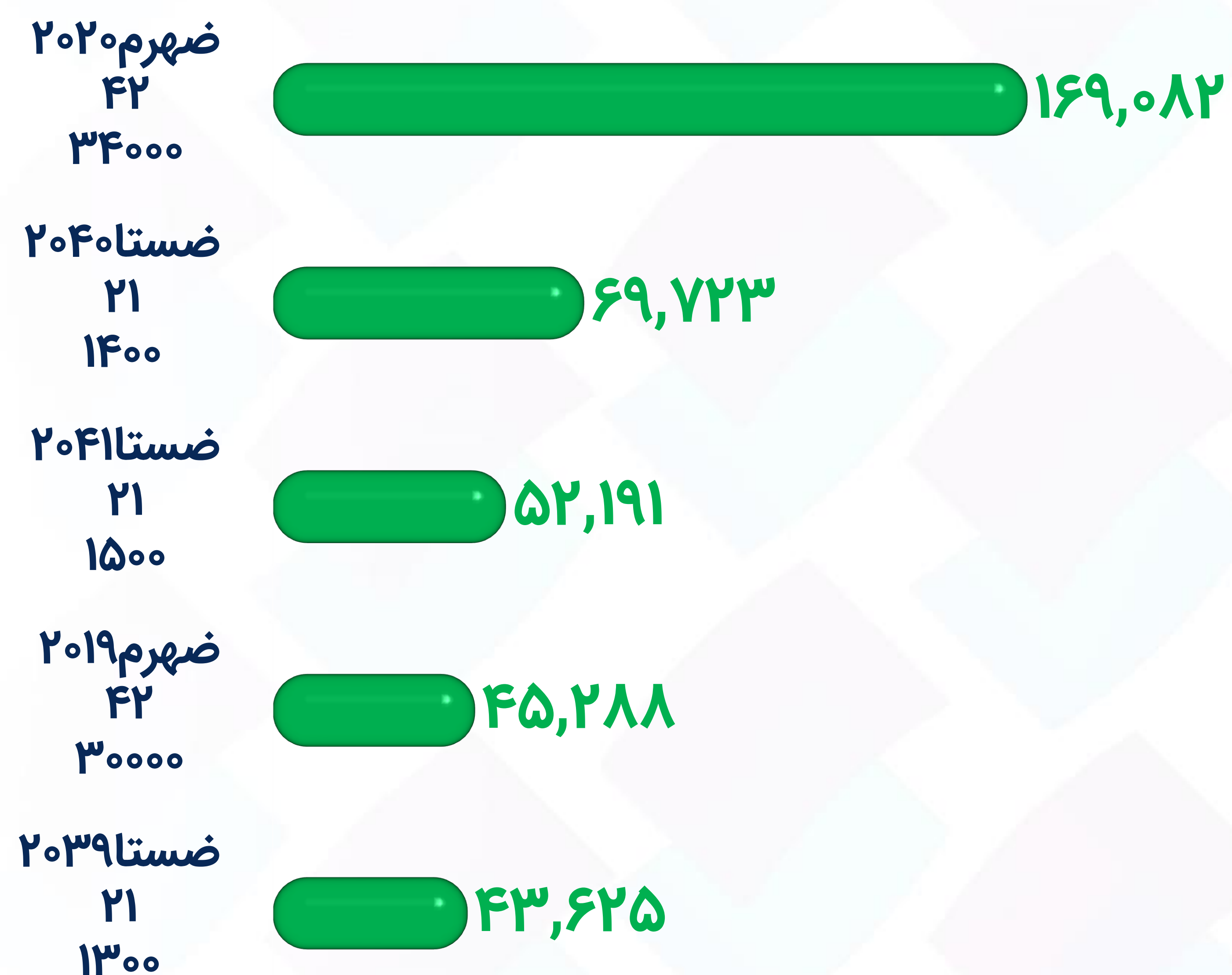
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

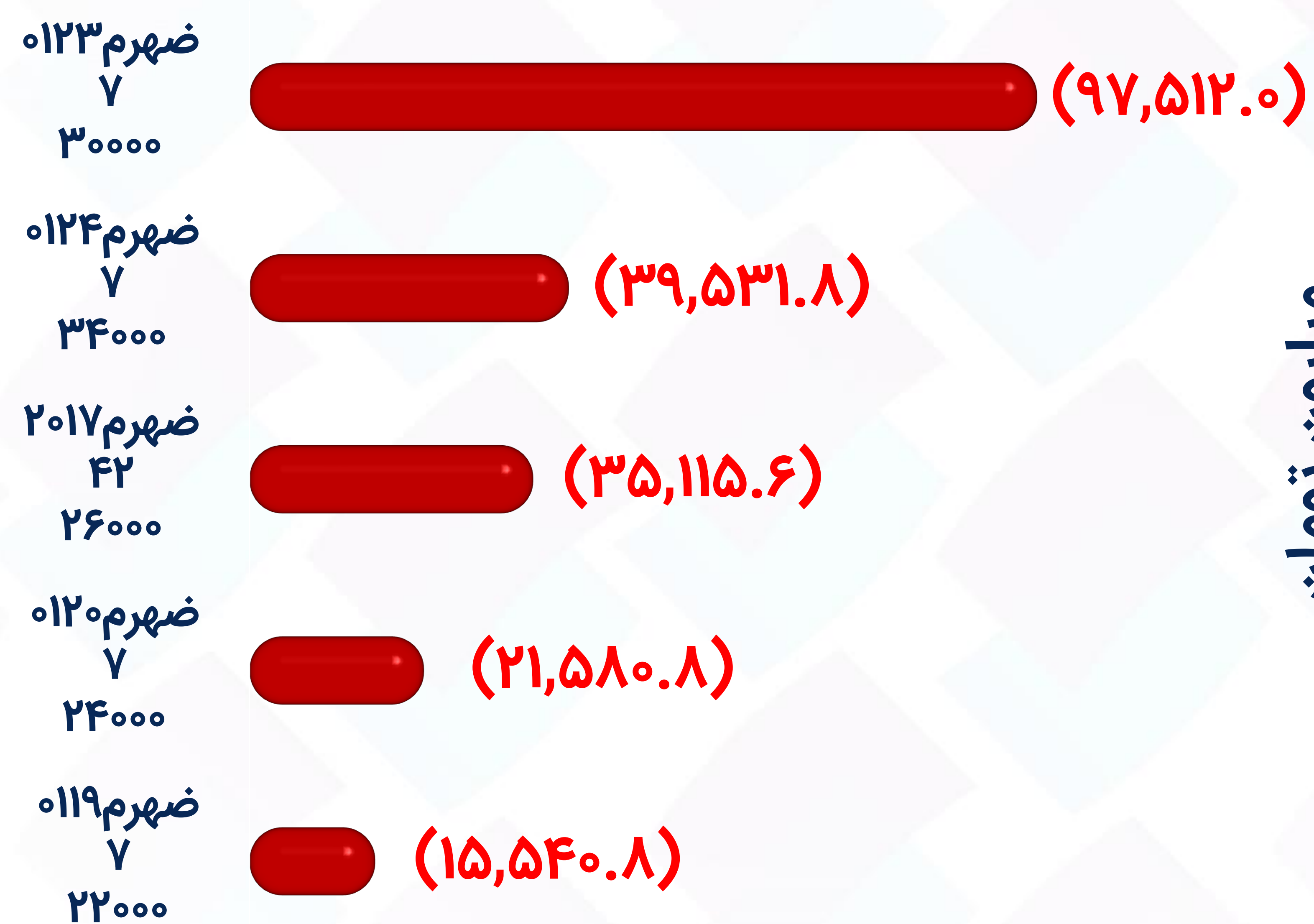
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

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.