

شماره
۴۵۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

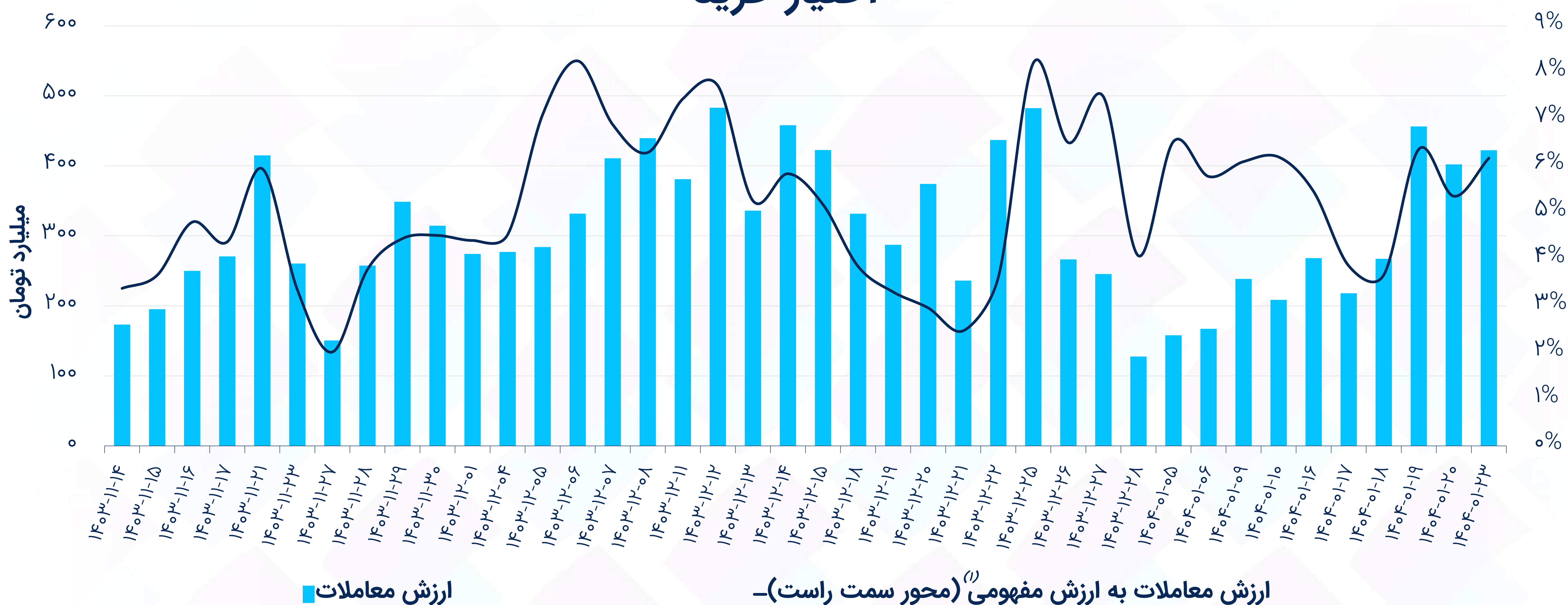




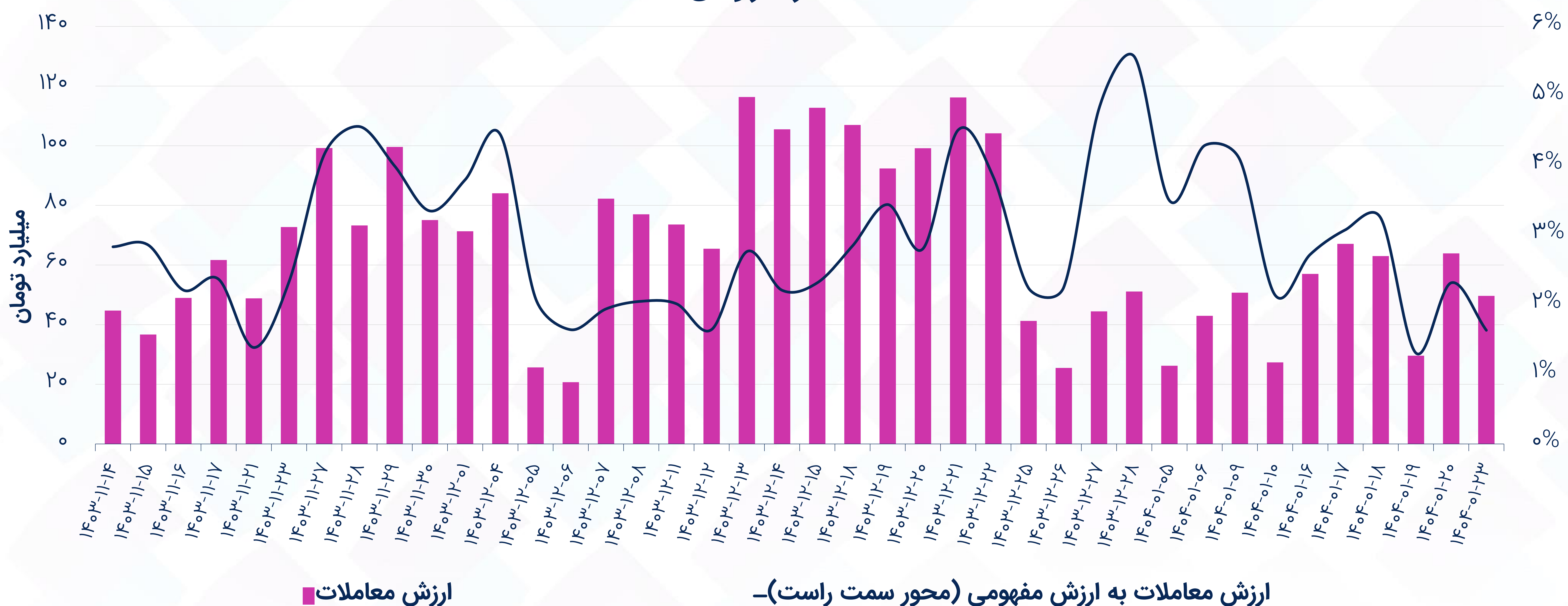
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



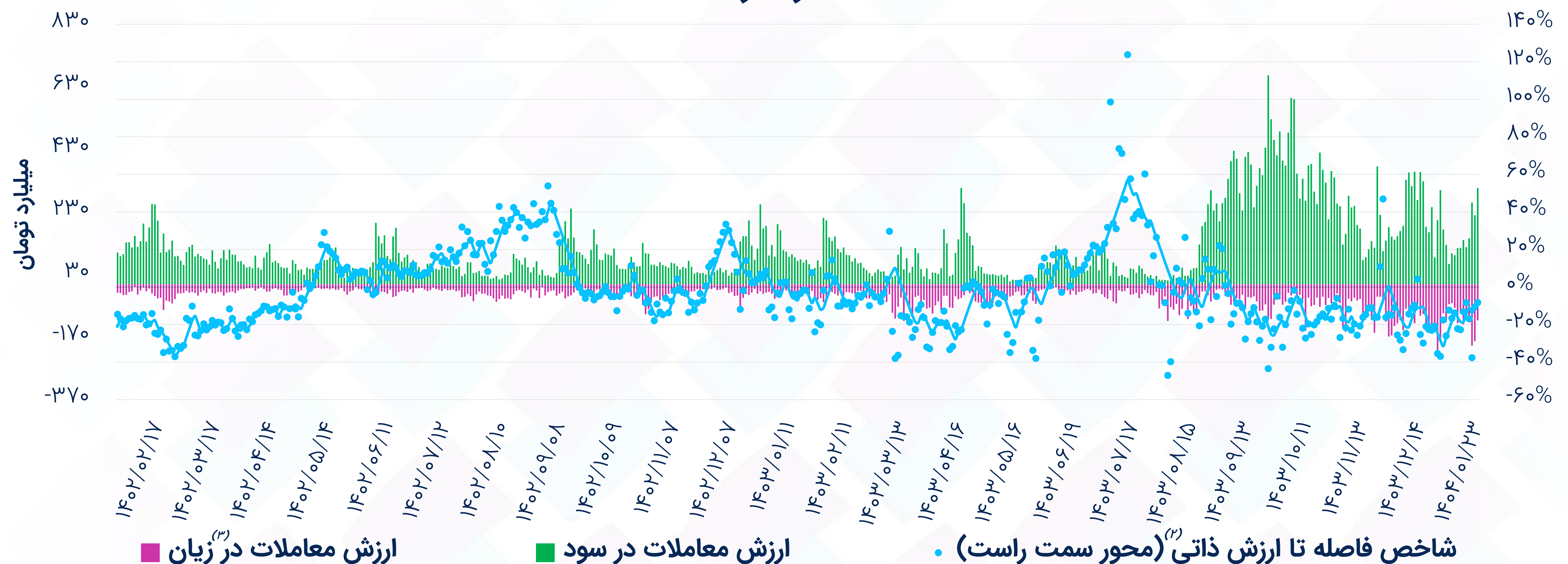
اختیار فروش



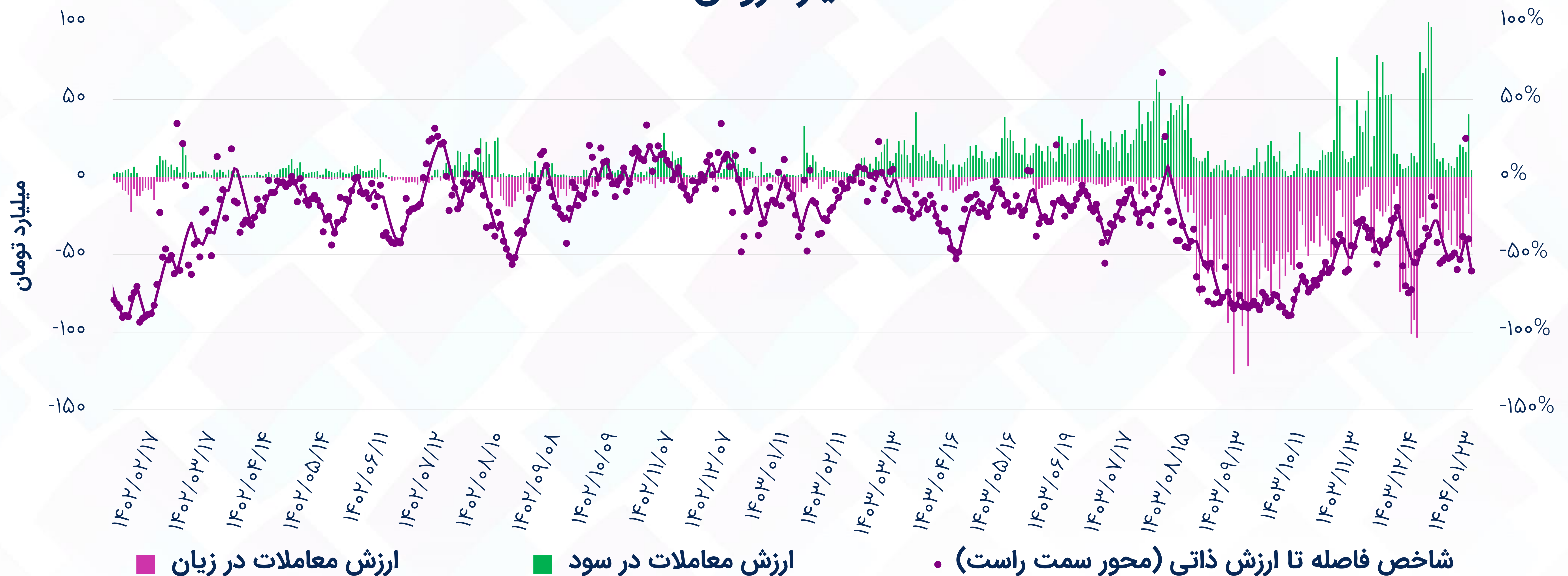
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۷	۳۰۰.۲	۵,۴۸۲.۰	۲۰۹.۳	۹۰.۹	(۹.۸%)
وبملت	۲۳	۴۶.۲	۴۱۷.۷	۴۴.۹	۱.۳	۱۰.۱%
شستا	۴۲	۳۱.۷	۶۳۵.۳	۱۷.۱	۱۴.۷	(۱۶.۶%)
شتاب	۸	۱۳.۰	۶۲.۴	۱۱.۶	۱.۳	۱.۴%
ذوب	۱۶	۱۱.۵	۹۸.۲	۹.۰	۲.۵	(۱۶.۷%)
وبصادر	۱۳	۶.۹	۴۶.۹	۴.۰	۲.۹	(۲۱.۲%)
وتجارت	۱۷	۶.۱	۴۲.۹	۴.۷	۱.۳	(۲۵.۵%)

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	۴۸,۵۳۲.۳	۲,۹۵۵,۱۰۰.۵	۴,۰۸۶.۸	۴۴,۴۴۵.۵	(۶۰.۸%)
شستا	۵	۱,۰۴۶.۲	۷۴,۸۵۲.۸	۴۶۵.۵	۵۸۰.۷	(۴۷.۶%)
توان	۴	۵۲.۷	۶۳۰.۷	۴۵.۰	۷.۷	(۳۵.۲%)
شپنا	۱	۱۴.۱	۲۴۲.۰	۱۴.۱	۰.۰	(۳۱.۴%)
خودران	۱	۴.۴	۱۰۶.۹	۴.۴	۰.۰	(۲۰.۳%)
وبملت	۴	۳.۹	۸,۱۵۶.۲	۰.۰	۳.۹	(۹۹.۵%)
ذوب	۲	۳.۵	۱۰۷.۸	۰.۰	۳.۵	(۹۰.۳%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۸۸,۳۱۶

شتاب ۵۲,۰۶۲

وبصادر ۳۵,۳۸۲

ذوب ۲۵,۳۲۰

فولاد ۱۸,۲۹۹

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۹,۸۹۹

شستا ۱,۶۸۵

وبملت ۱,۰۹۳

ذوب ۶۸۲

خودرو ۴۴۵

وتجارت ۱۸۷

شتاب ۱۶۲

وبصادر ۱۴۴

شپنا ۱۲۹

فملی ۱۲۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۴۵۵,۱۴۷.۳)

وبملت (۶۴,۵۸۰.۲)

خودران | (۱,۵۶۶.۷)

موج | (۱,۱۳۳.۶)

فملی | (۱,۱۱۱.۸)

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 ۳,۴۸۹

شستا ۹۹

وبملت ۳۴

بساما ۸

وتعاون ۴

خودرو ۳

خودران ۲

فملی ۲.۰۷

توان ۱.۹۵

شپنا ۱.۳۴

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۶۶۸,۹۳۳.۴

شستا ۲۲,۲۰۴.۱

توان ۵۴۹.۲

ذوب ۶۶.۱

وتجارت ۴۰.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

وبملت (۳,۷۳۴.۳)

وتعاون (۵۶۵.۰)

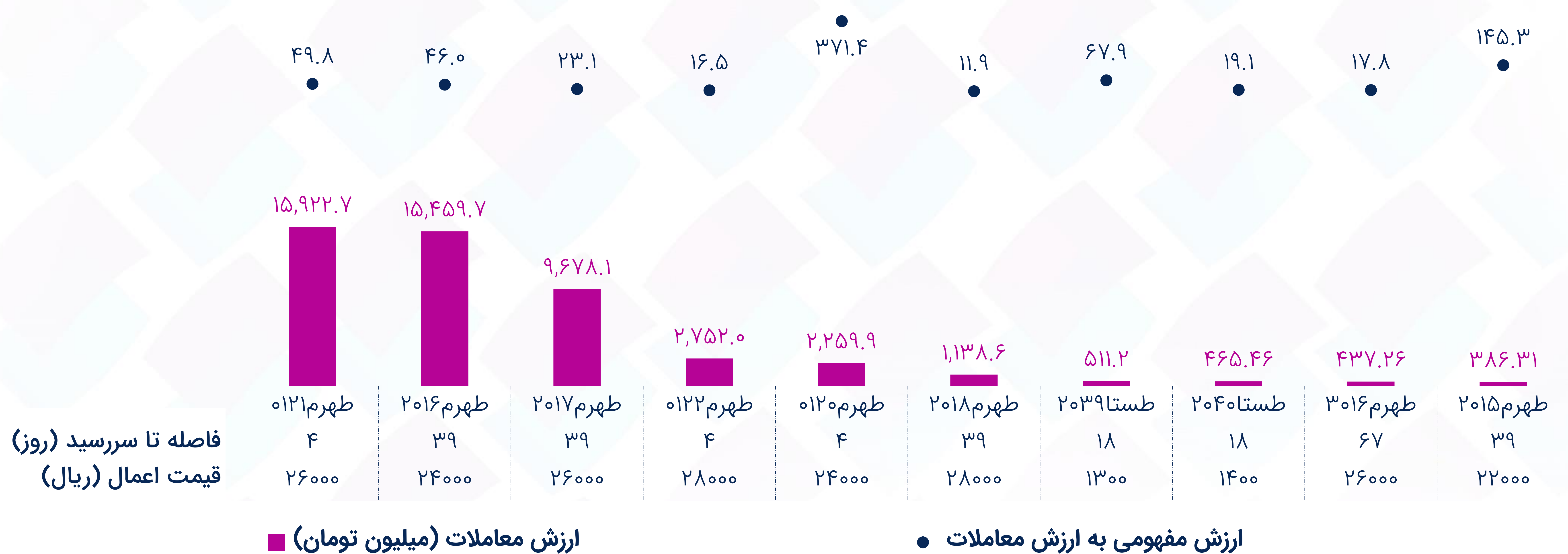
میلیون تومان

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
ضرویین ۱۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۸	۳۱.۷	۴۷۱	۱۲,۶۶۸	۱۲,۴۷۱	(۱.۶%)	۲۶.۵	۰.۹۵	۷۹۵	۶۹%
ضملت ۰۱۲۰	وبملت	۲,۳۴۷	۴	۴,۰۲۷.۱	۱۴۳	۲,۵۲۰	۲,۴۹۰	(۱.۲%)	۱۷.۴	۰.۹۶	۱۹۱	۳۴%
ضتیام ۲۰۰	تیام	۹,۰۰۰	۳۶	۳.۲	۴,۰۰۰	۱۳,۸۲۳	۱۳,۰۰۰	(۶.۰%)	۳.۳	۱.۰۰	۵,۱۵۵	۲۹%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۸	۴۸.۲	۱,۴۰۰	۱۲,۶۶۸	۱۲,۴۰۰	(۲.۱%)	۸.۹	۱.۰۰	۱,۷۷۵	۲۷%
ضملت ۰۱۱۹	وبملت	۲,۲۰۰	۴	۶,۲۶۹.۱	۲۷۵	۲,۵۲۰	۲,۴۷۵	(۱.۸%)	۹.۰	۱.۰۰	۳۳۵	۲۲%

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	۳۲	۱.۰	۴	۴۵۱	۸۰۴	۷۸%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۱۹.۷	۹	۲۶,۷۴۰	۳۴,۰۰۹	۲۷%	۳,۷۷۸.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۵۲	۱۵.۴	۱۱	۱,۳۵۷	۲,۲۱۱	۶۳%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۱۸	۱.۵	۴	۱,۳۵۷	۱,۸۰۴	۳۳%	۴۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۵	وبصادر	۹۰۰	۶۰	۱.۷	۱۳	۵۶۷	۹۱۳	۶۱%	۷۰.۲	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 ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۱.۳	۶,۵۰۰	۲۶,۷۴۰	۲۷,۵۰۰	۲.۸%	۴.۲	-۱.۰۰	۷,۰۲۴	۸.۱%
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴	۱.۷	۳,۳۸۰	۲۶,۷۴۰	۲۶,۶۲۰	(۰.۴%)	۷.۹	-۰.۹۸	۳,۰۶۱	(۹.۴%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۹	۴۱.۵	۶,۷۰۰	۲۶,۷۴۰	۲۷,۳۰۰	۲.۱%	۴.۱	-۰.۹۳	۵,۹۶۰	(۱۱.۰%)
ط‌موج ۲۱۹	موج	۲۶,۰۰۰	۲۹	۱.۵	۱,۶۵۰	۲۴,۸۶۴	۲۴,۳۵۰	(۲.۱%)	۱۴.۸	-۰.۵۲	۱,۳۸۷	(۱۶.۰%)
ط‌ران ۰۱۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۴	۴.۴	۴۴۰	۱۰,۶۹۰	۱۰,۵۶۰	(۱.۲%)	۲۴.۰	-۰.۶۶	۳۵۱	(۲۰.۳%)

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
طهرم ۰۱۱۷	اهرم	۱۸,۰۰۰	۴	۰.۰	۱	۲۶,۷۴۰	۱۷,۹۹۹	(۳۲.۷%)	۱۷,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
ط‌ملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۴	۱.۷	۱	۲,۵۲۰	۱,۹۰۶	(۲۴.۴%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۴	۱۰.۰	۱۱	۲۶,۷۴۰	۱۹,۹۸۹	(۲۵.۲%)	۱,۸۱۷.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
ط‌ملت ۰۱۱۸	وبملت	۲,۰۵۴	۴	۰.۹	۱	۲,۵۲۰	۲,۰۵۳	(۱۸.۵%)	۲,۰۵۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
ط‌ذوب ۲۰۰۱	ذوب	۳۰۰	۳۲	۰.۰	۱	۴۵۱	۲۹۹	(۳۳.۷%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

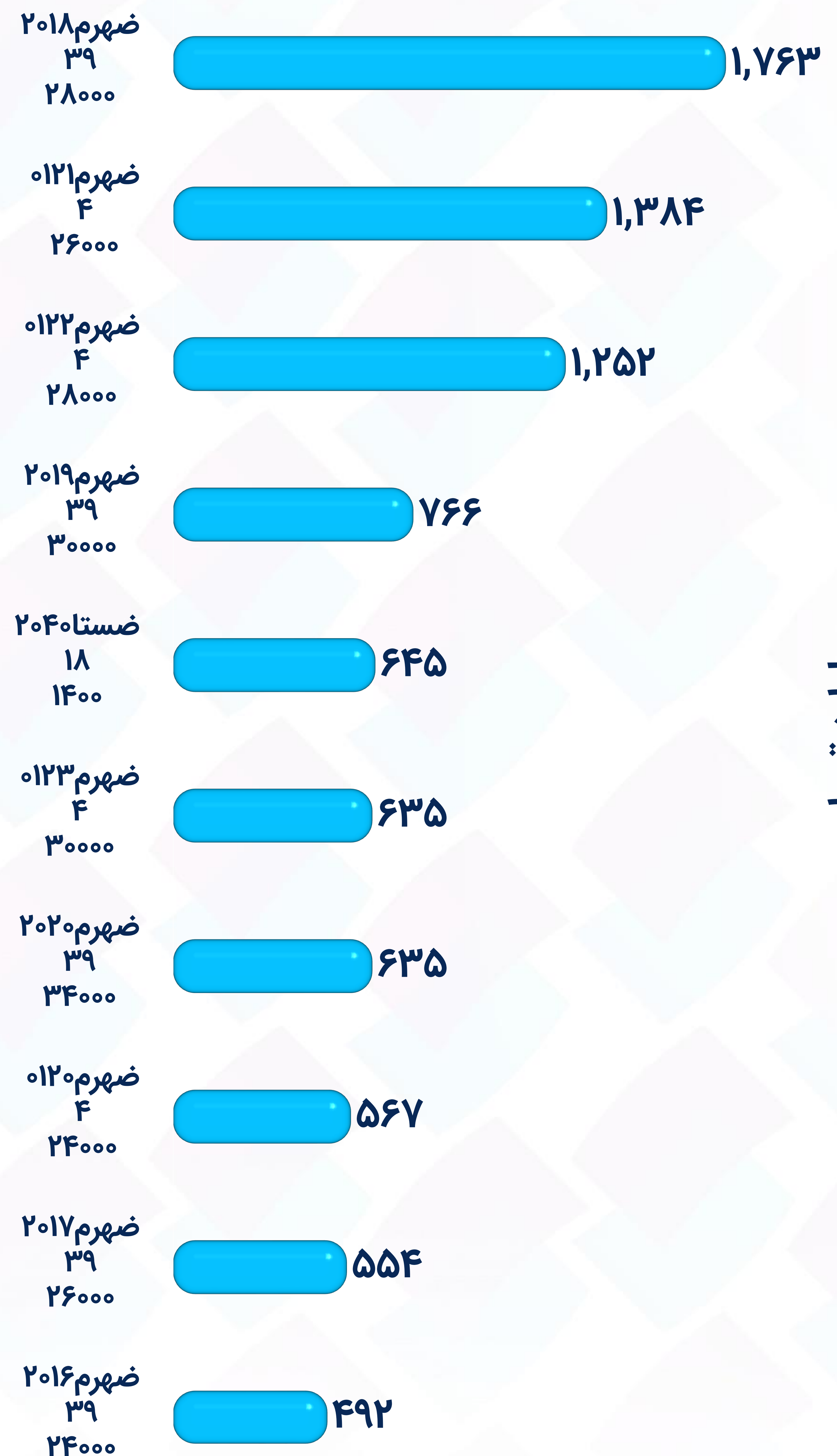
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

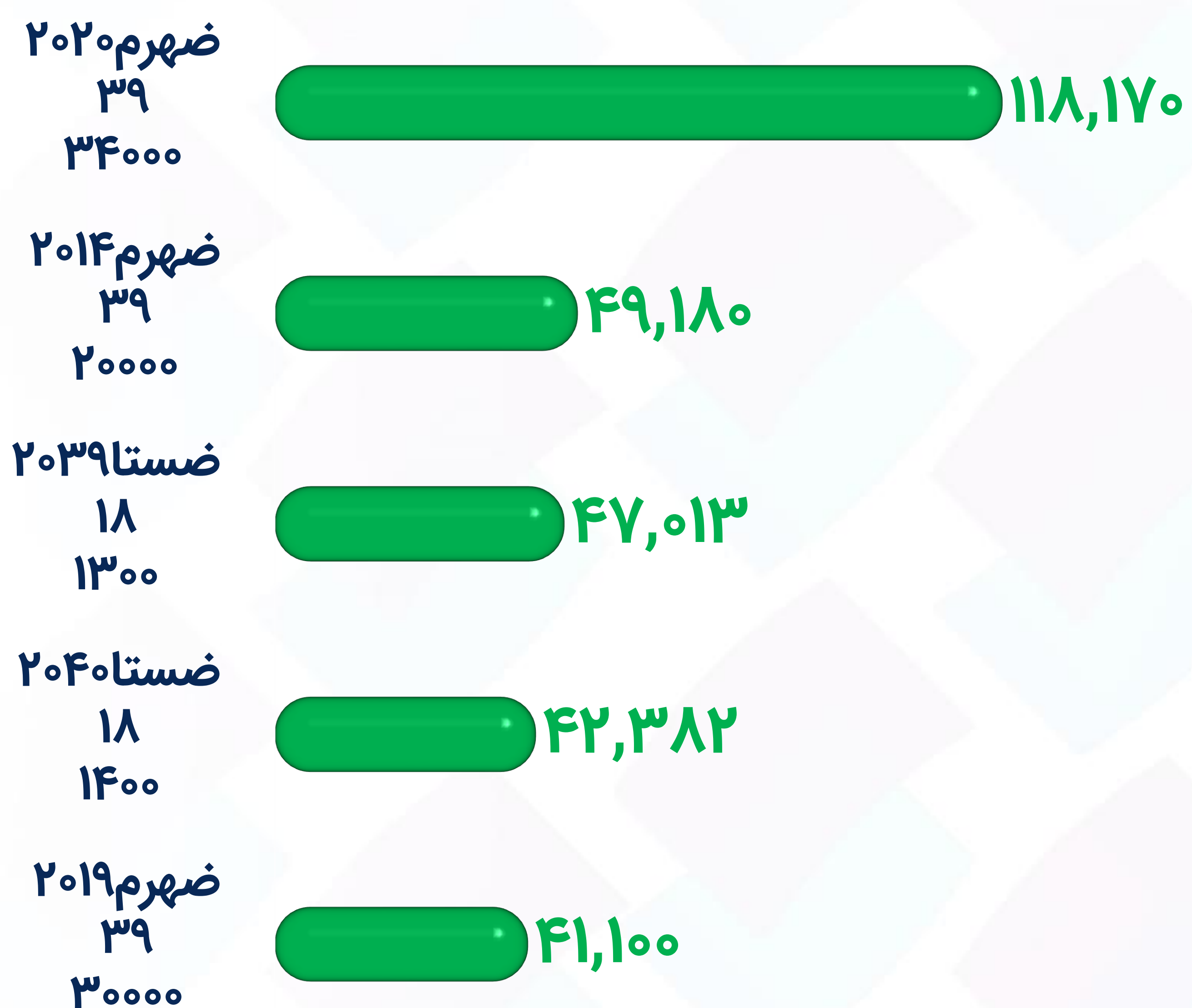
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

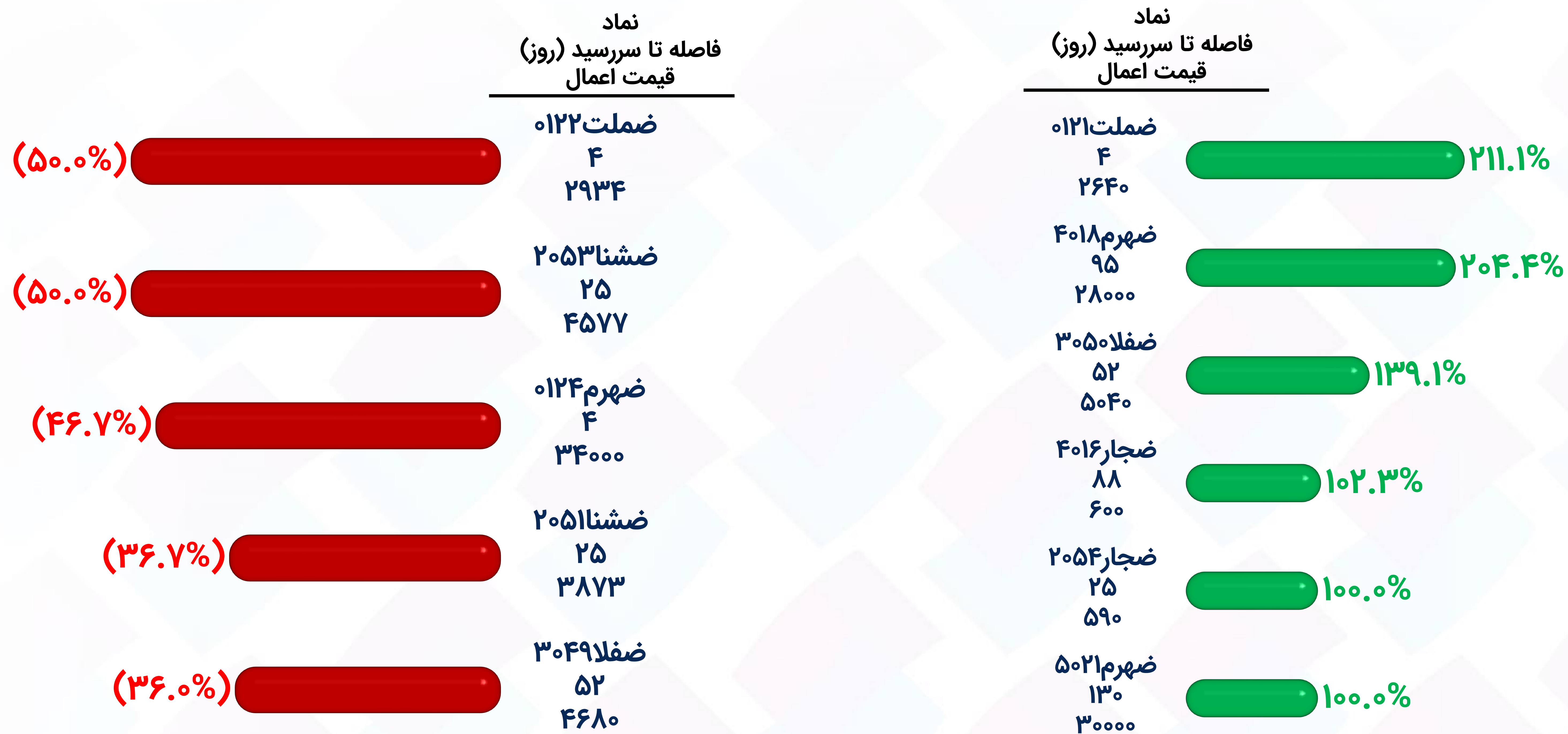
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



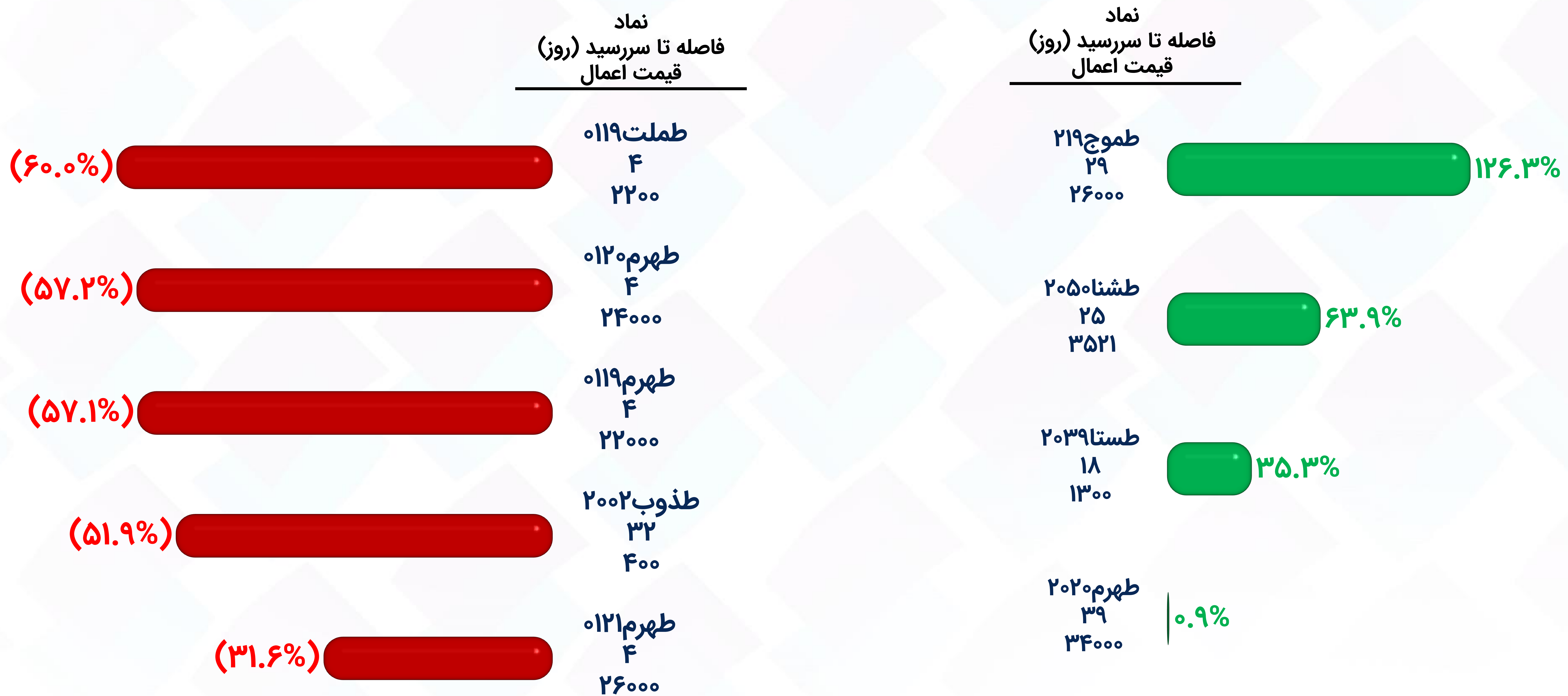
میلیون تومان

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

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.