

شماره
۴۵۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۴ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





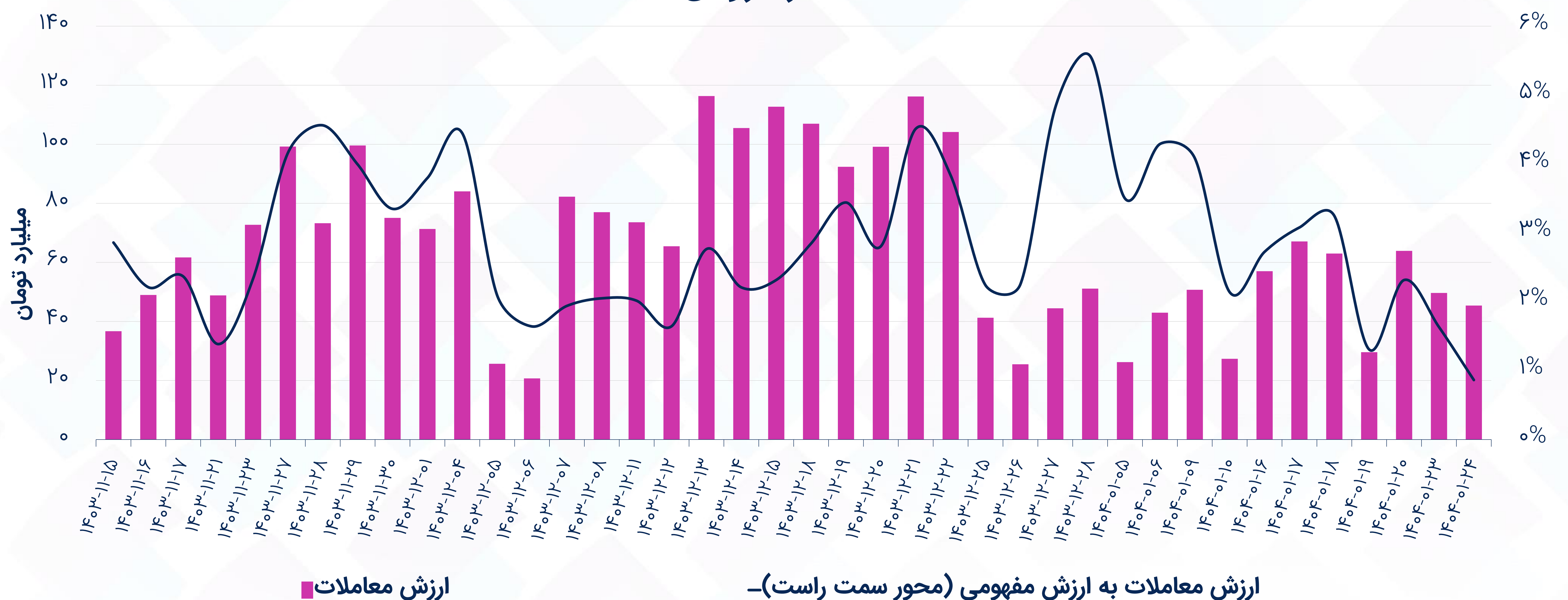
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



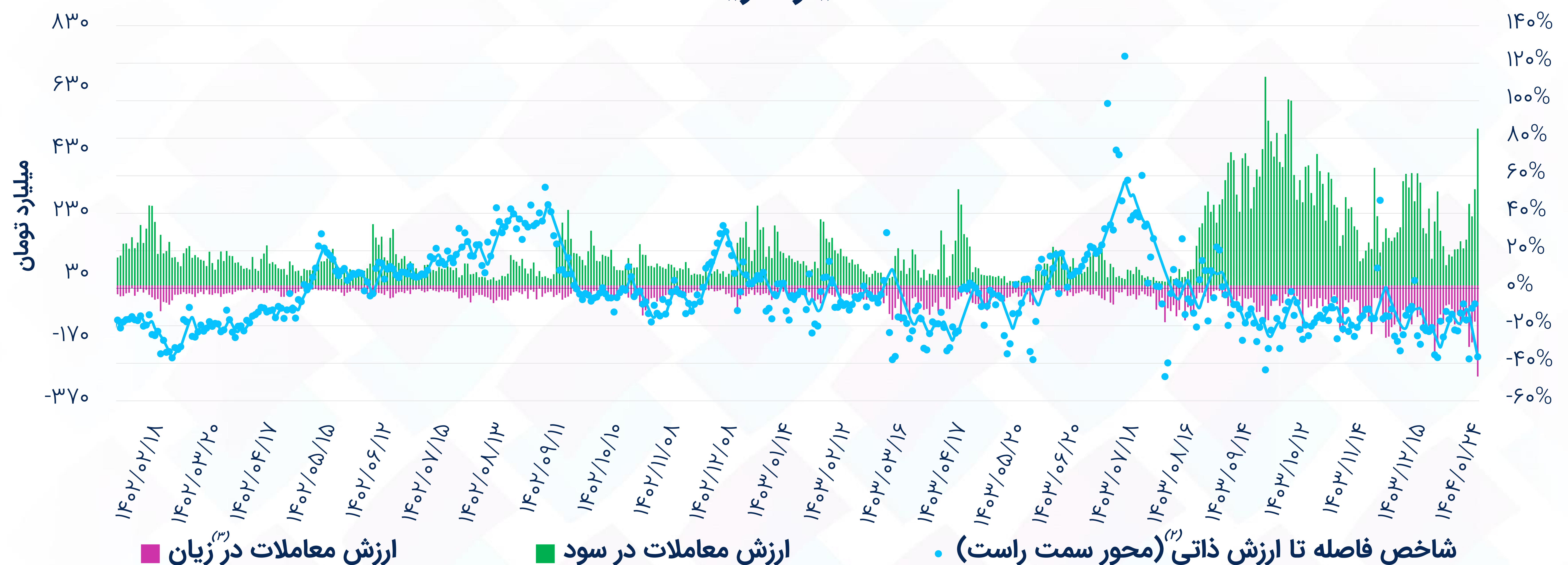
اختیار فروش



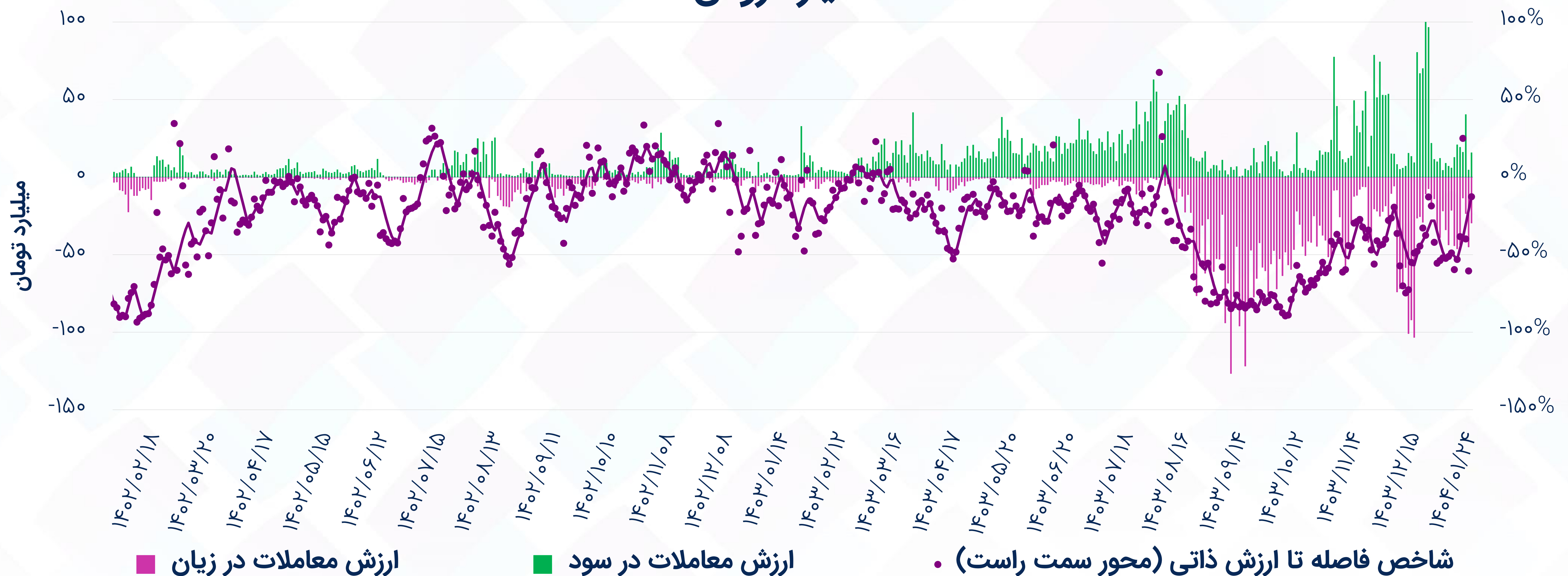
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

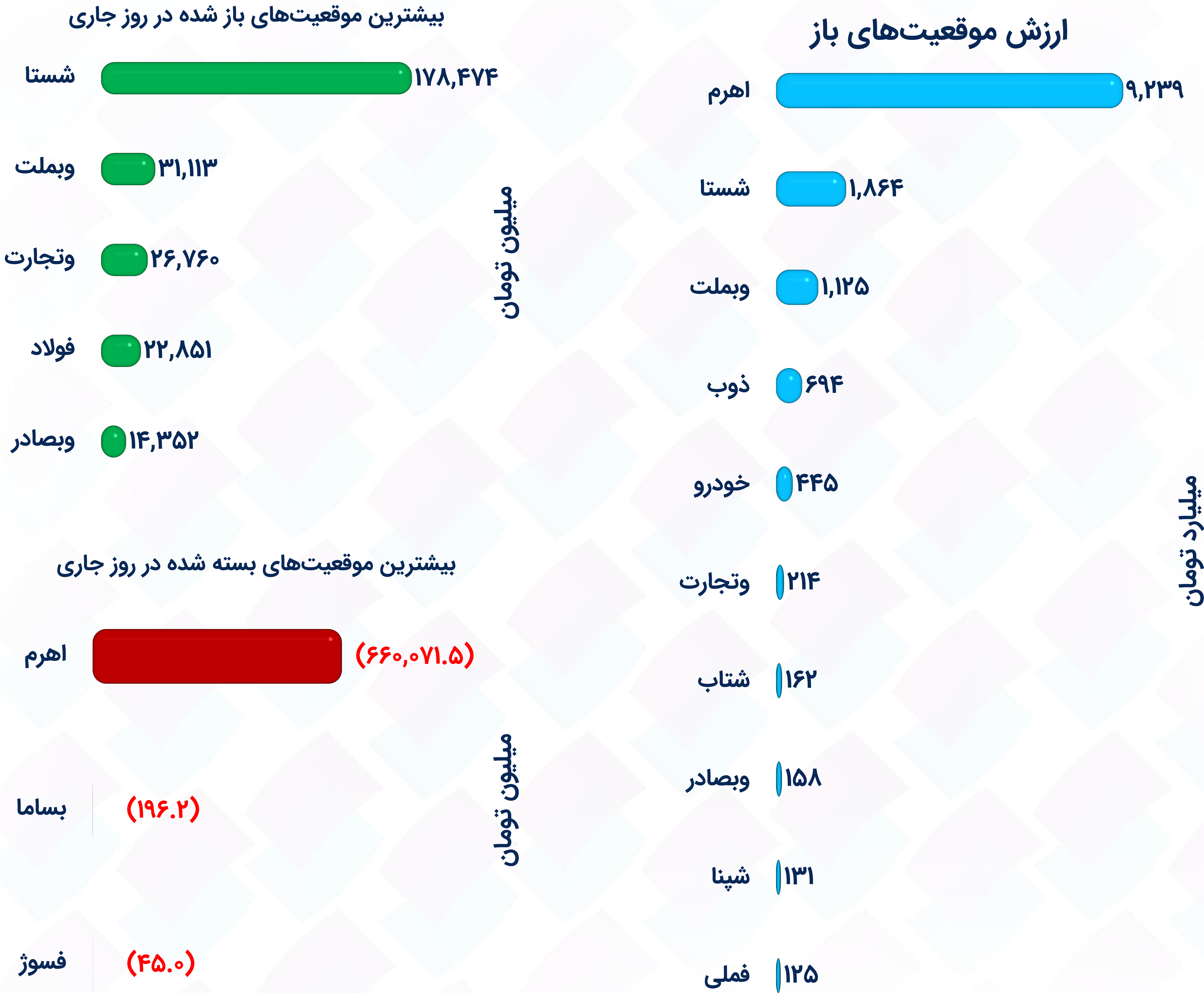
اختیار خرید

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	۵۴	۵۶۷.۴	۶,۱۸۴.۵	۳۴۲.۶	۲۲۴.۸	(۳۸.۹%)
وبملت	۲۳	۸۵.۲	۴۴۷.۲	۸۱.۳	۳.۹	(۱۹.۱%)
شستا	۴۴	۷۴.۸	۱,۰۶۳.۸	۲۳.۲	۵۱.۵	(۴۲.۳%)
ذوب	۲۶	۳۰.۹	۱۷۸.۳	۲۶.۲	۴.۸	(۲۷.۵%)
وتجارت	۱۷	۱۴.۶	۶۵.۴	۱۳.۱	۱.۶	(۴۹.۸%)
وبصادر	۱۲	۷.۴	۳۵.۳	۵.۰	۲.۴	(۳۹.۱%)
موج	۷	۱.۹	۱۱.۹	۱.۵	۰.۴	(۳۰.۵%)

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	۱۶	۴۴,۱۸۴.۵	۵,۱۲۵,۷۷۶.۸	۱۵,۰۱۵.۶	۲۹,۱۶۸.۹	(۱۲.۰%)
شستا	۶	۱,۱۳۳.۸	۱۱۳,۳۶۲.۰	۶۹۷.۷	۴۳۶.۱	(۳۶.۶%)
توان	۲	۲۶.۱	۴۵۲.۹	۲۵.۰	۱.۱	۱۲.۳%
ذوب	۱	۱۲.۵	۹۷۰.۰	۰.۰	۱۲.۵	(۸۷.۸%)
خودران	۱	۱۰.۲	۳۳۱.۶	۰.۰	۱۰.۲	۴.۶%
وبملت	۶	۸.۴	۱۱,۳۰۹.۸	۰.۰	۸.۴	(۹۸.۶%)
وتعاون	۱	۲.۸	۲۲۵.۸	۰.۰	۲.۸	۱۹.۳%

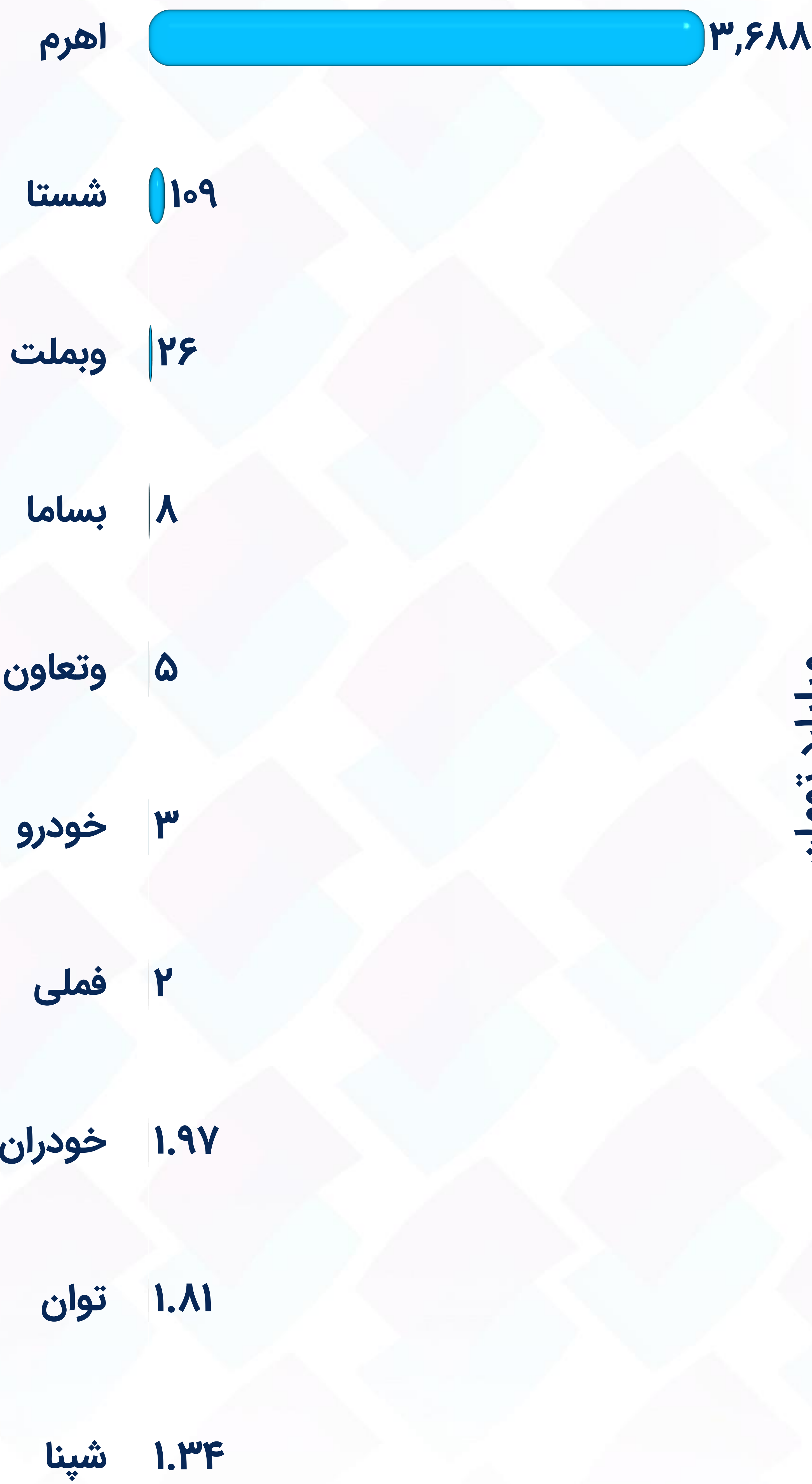
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



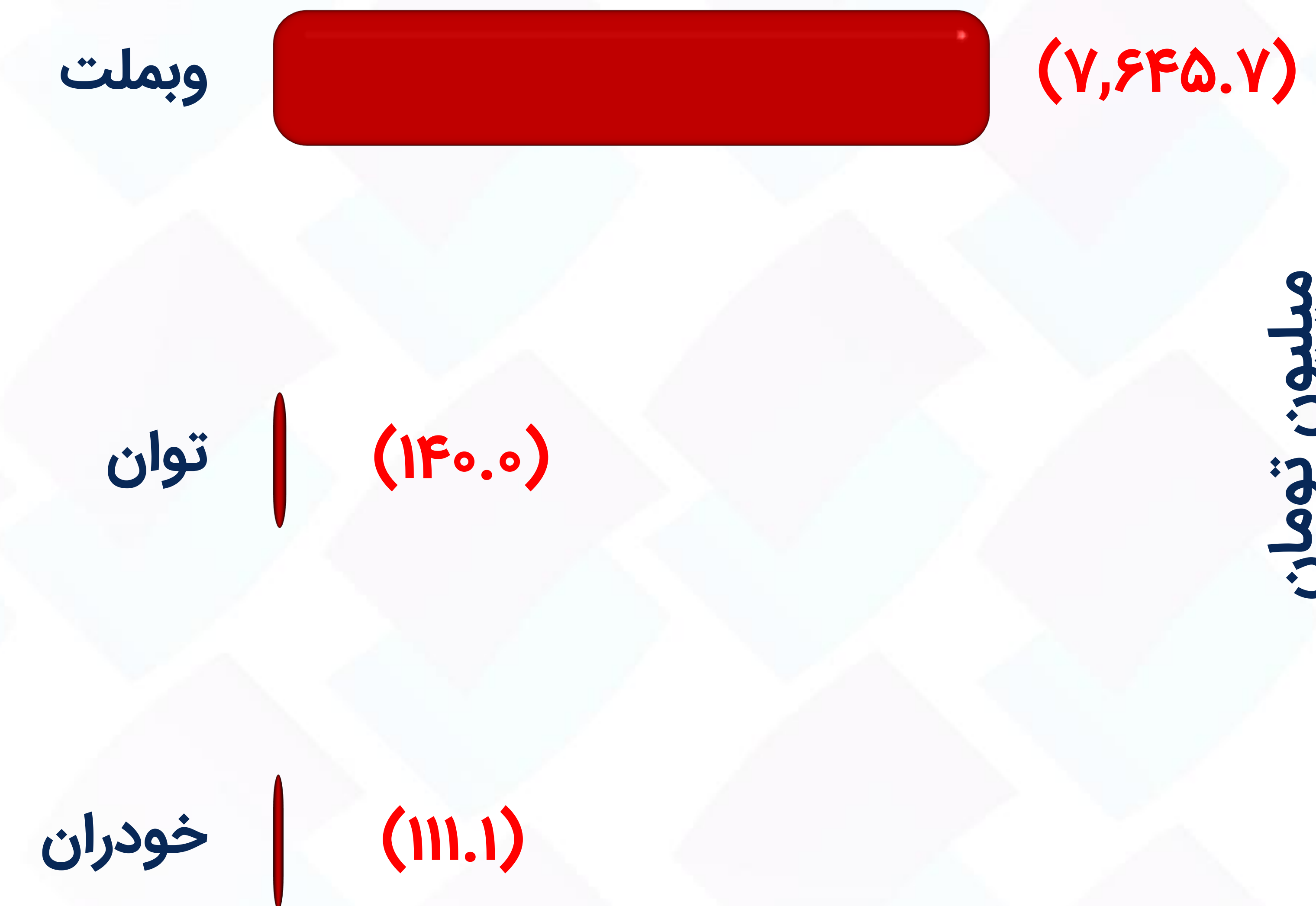
میلیارد تومان

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
ضفلا ۵۰۲۰	فولاد	۵,۰۰۰	۱۱۵	۱۵.۳	۹۳	۴,۱۶۹	۵,۰۹۳	۲۲.۲%	۵۴.۸	۰.۳۵	۱۴۵	۵۶%
ضبساما ۲۲۴	بساما	۹,۴۱۱	۱۴	۱.۱	۵۰	۹,۰۱۰	۹,۴۶۱	۵.۰%	۱۸۹.۲	۰.۲۷	۶۸	۳۶%
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۱۴	۱۰۳.۲	۱,۲۳۱	۹,۰۱۰	۸,۷۲۶	(۳.۲%)	۷.۱	۱.۰۰	۱,۶۲۸	۳۲%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۴	۵۹۴.۰	۳,۰۰۱	۹,۰۱۰	۸,۴۱۴	(۶.۶%)	۲.۸	۱.۰۰	۳,۶۷۸	۲۳%
ضهرم ۴۰۱۷	اهرم	۲۶,۰۰۰	۹۴	۲۵۴.۶	۳,۵۱۷	۲۷,۵۴۰	۲۹,۵۱۷	۷.۲%	۸.۴	۰.۸۱	۴,۳۰۷	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	۳۱	۵.۴	۴	۴۶۴	۸۰۴	۷۳%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۷	۲۴.۳	۸	۱,۳۹۷	۱,۹۰۸	۳۷%	۲۳۸.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۳۲.۷	۱۲	۲۷,۵۴۰	۳۴,۰۱۲	۲۴%	۲,۸۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۵۱	۴.۰	۲۰	۱,۳۹۷	۲,۲۲۰	۵۹%	۱۱۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۱۷	۳۳.۸	۹	۱,۳۹۷	۱,۸۰۹	۲۹%	۲۰۱.۰	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
طشنا ۲۰۵۰	شپنا	۳,۵۲۱	۲۴	۱.۴	۴۴	۳,۵۱۰	۳,۴۷۷	(۰.۹%)	۷۹.۰	-۰.۳۸	۹۱	۱۰۶.۴%
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳	۱,۸۳۹.۱	۱,۳۷۴	۲۷,۵۴۰	۲۸,۶۲۶	۳.۹%	۲۰.۸	-۰.۹۶	۲,۳۱۷	۶۸.۶%
طهرم ۰۱۲۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳	۸,۳۳۱.۸	۴۱۱	۲۷,۵۴۰	۲۷,۵۸۹	۰.۲%	۶۷.۱	-۰.۵۹	۶۷۶	۶۴.۴%
طهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۱۰.۵	۵,۰۰۰	۲۷,۵۴۰	۲۹,۰۰۰	۵.۳%	۵.۸	-۱.۰۰	۶,۲۷۳	۲۵.۵%
طوتعاون ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۶۴	۲.۸	۲۲	۱,۷۵۰	۱,۶۷۸	(۴.۱%)	۷۶.۳	-۰.۲۱	۲۶	۱۹.۳%

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
طملت ۰۱۱۷	وبملت	۱,۹۰۷	۳	۱.۳	۱	۲,۵۹۵	۱,۹۰۶	(۲۶.۶%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳	۳.۷	۶	۲۷,۵۴۰	۱۹,۹۹۴	(۲۷.۴%)	۳,۳۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۸	وبملت	۲,۰۵۴	۳	۲.۳	۱	۲,۵۹۵	۲,۰۵۳	(۲۰.۹%)	۲,۰۵۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۹	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳	۳۸.۴	۱۲	۲۷,۵۴۰	۲۱,۹۸۸	(۲۰.۲%)	۱,۸۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۹	وبملت	۲,۲۰۰	۳	۱.۲	۲	۲,۵۹۵	۲,۱۹۸	(۱۵.۳%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

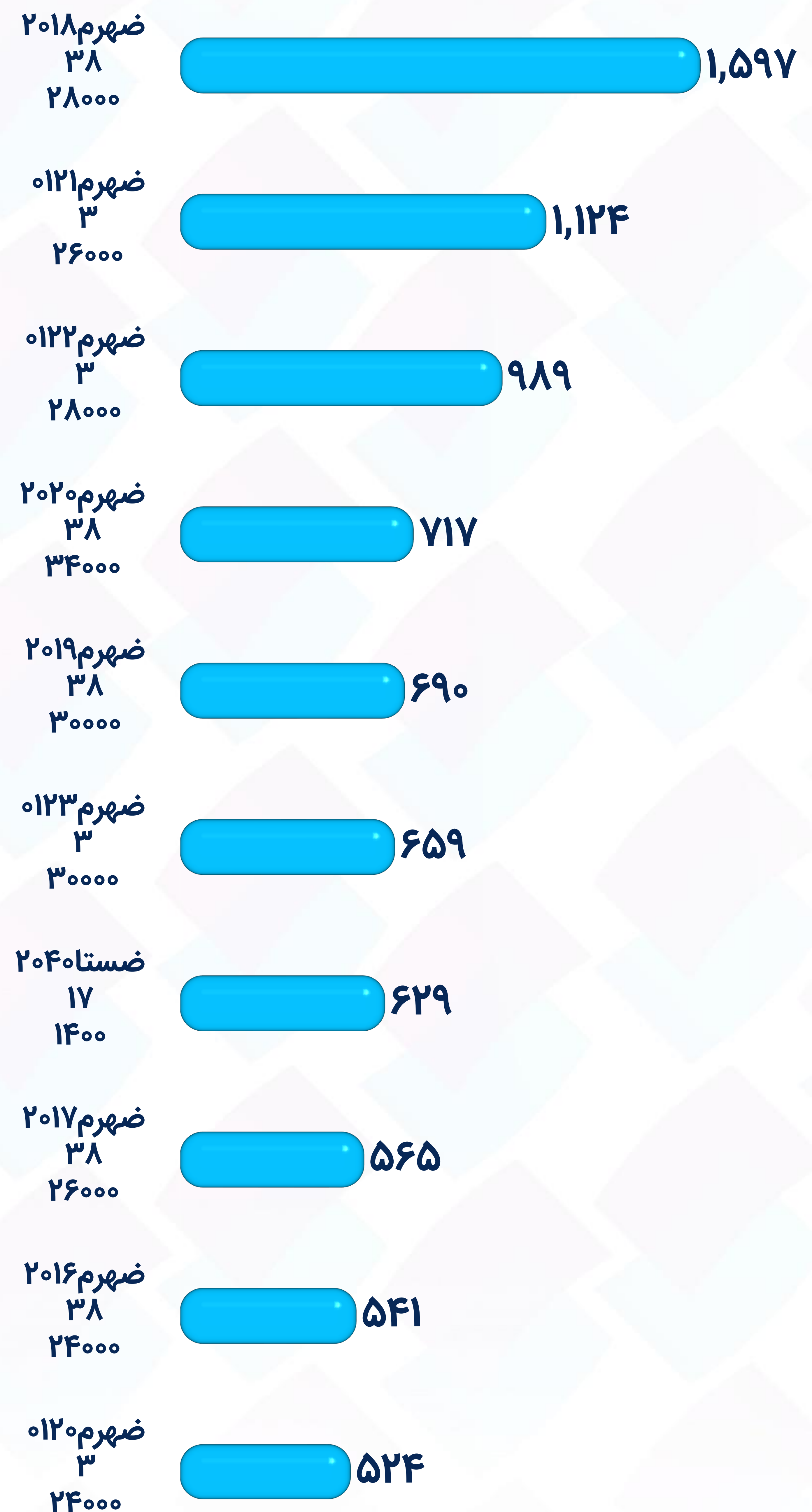
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

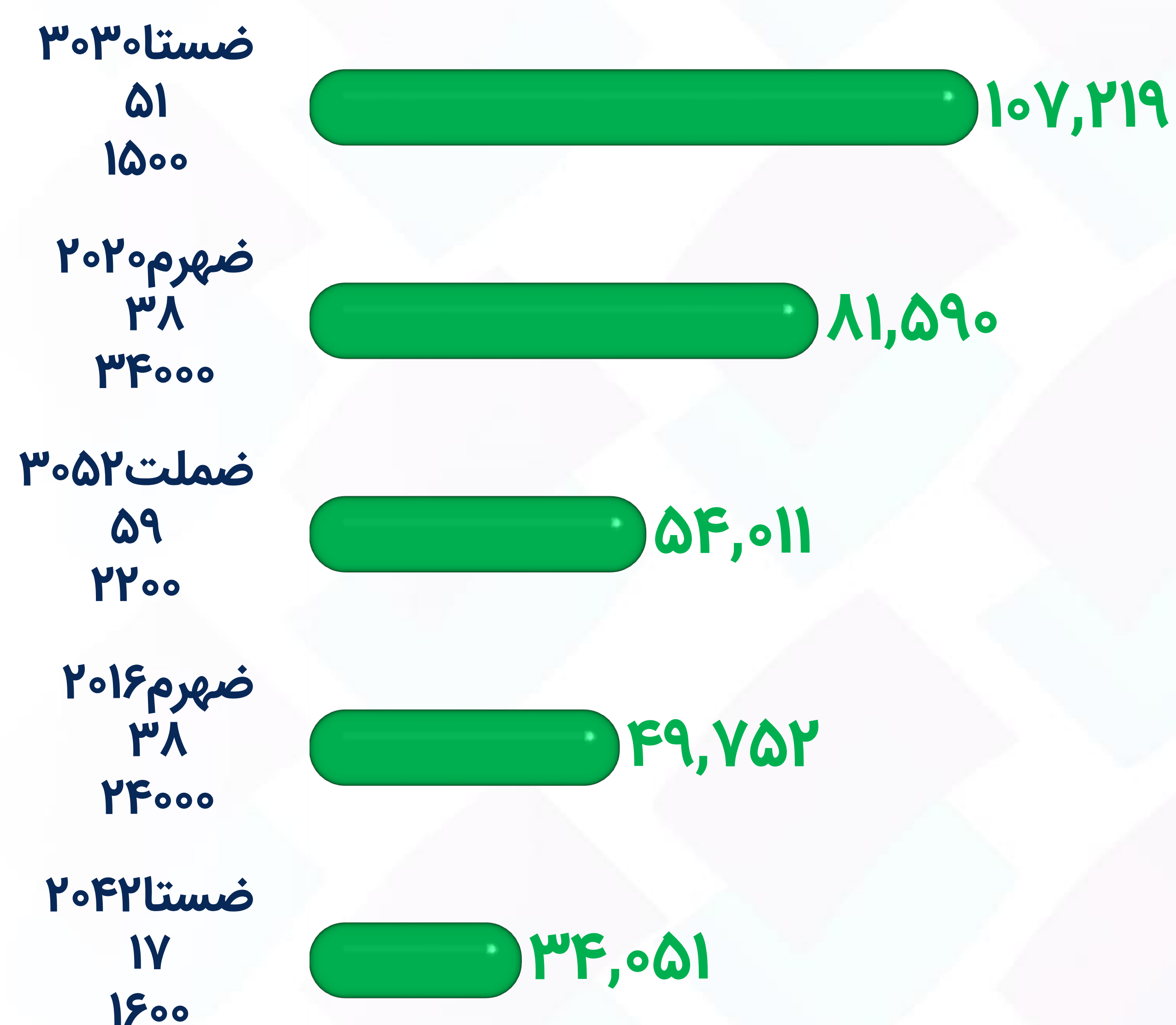
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

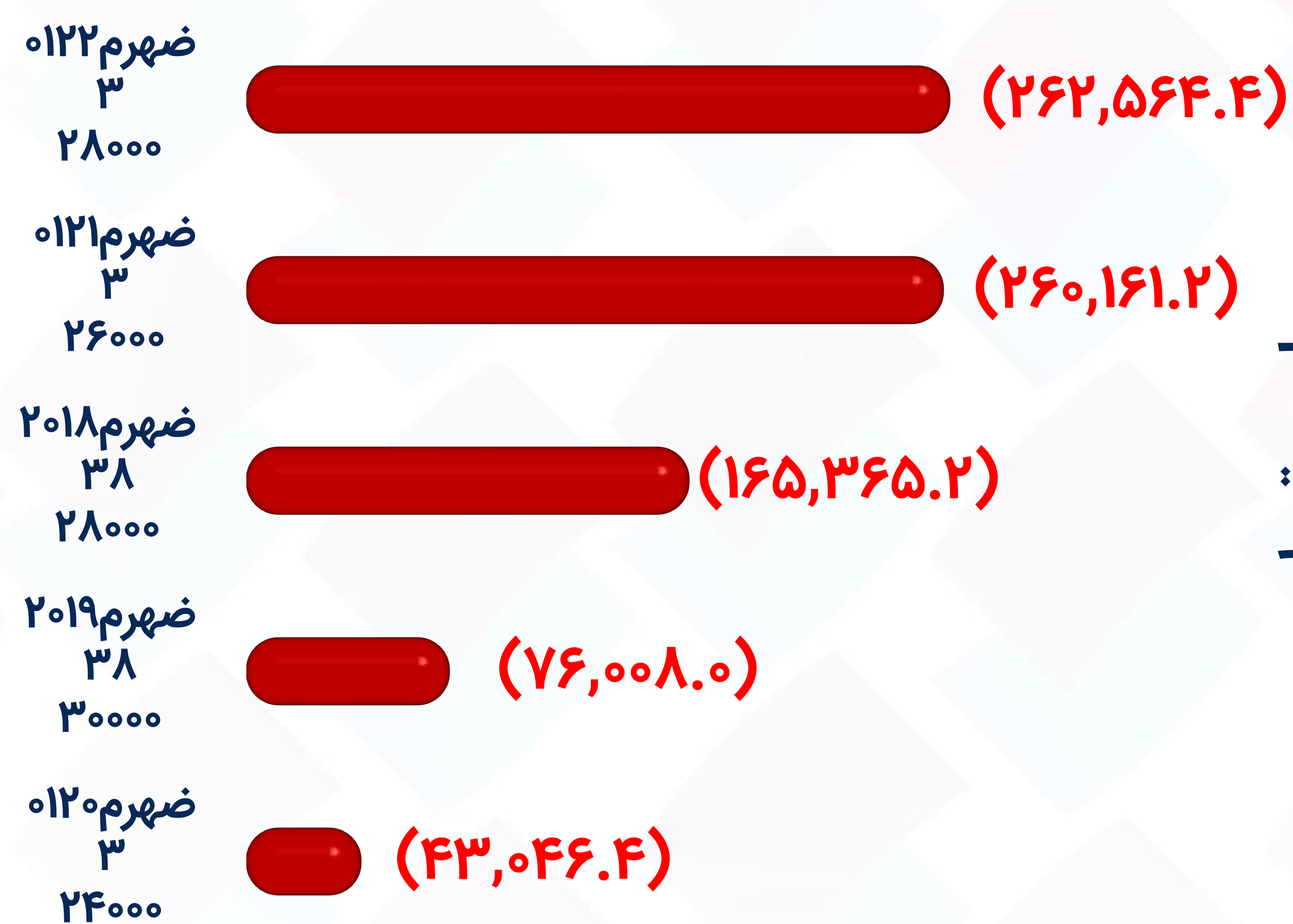
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

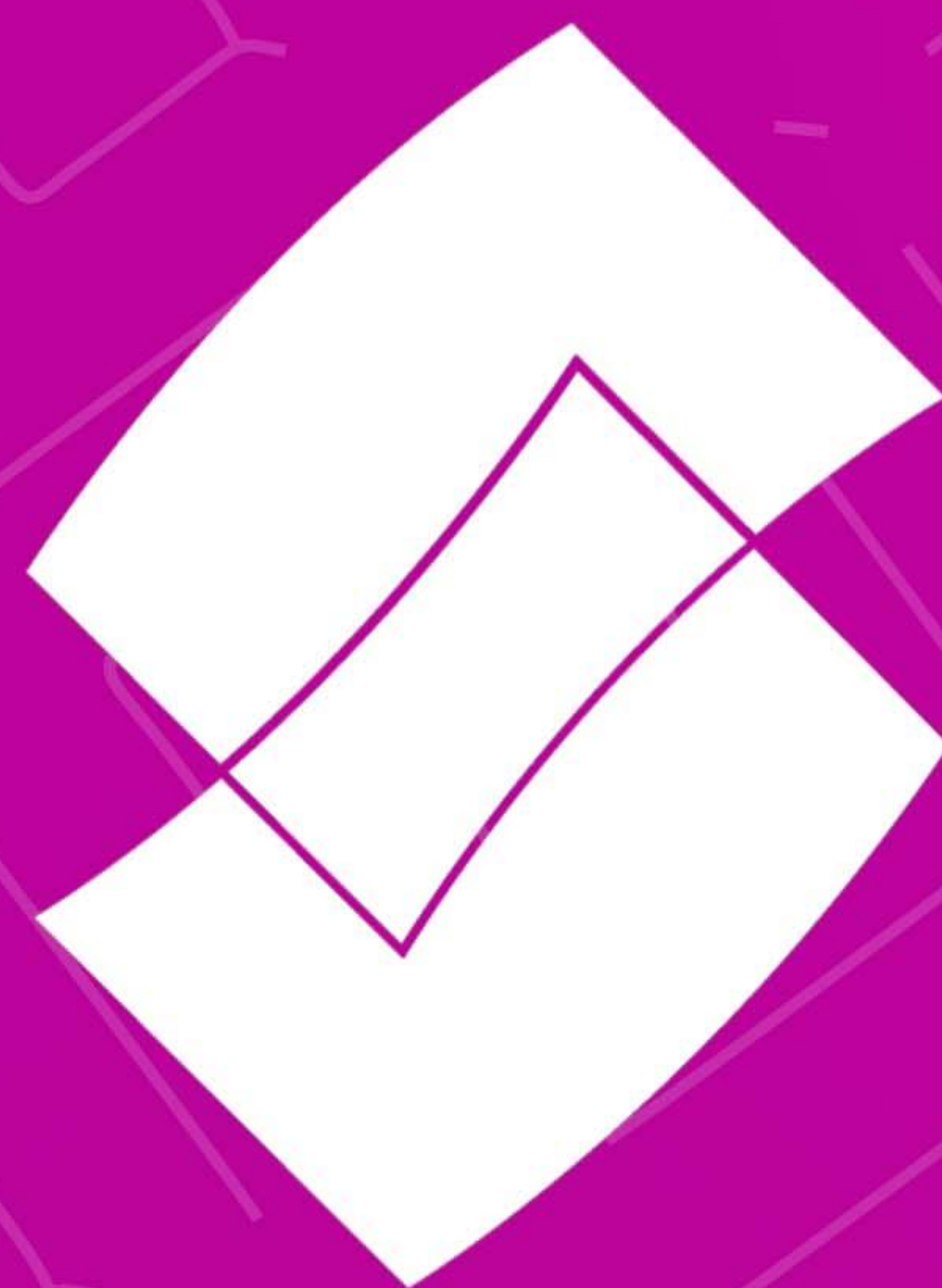
اختیار خرید



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.