

شماره
۴۵۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۵ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





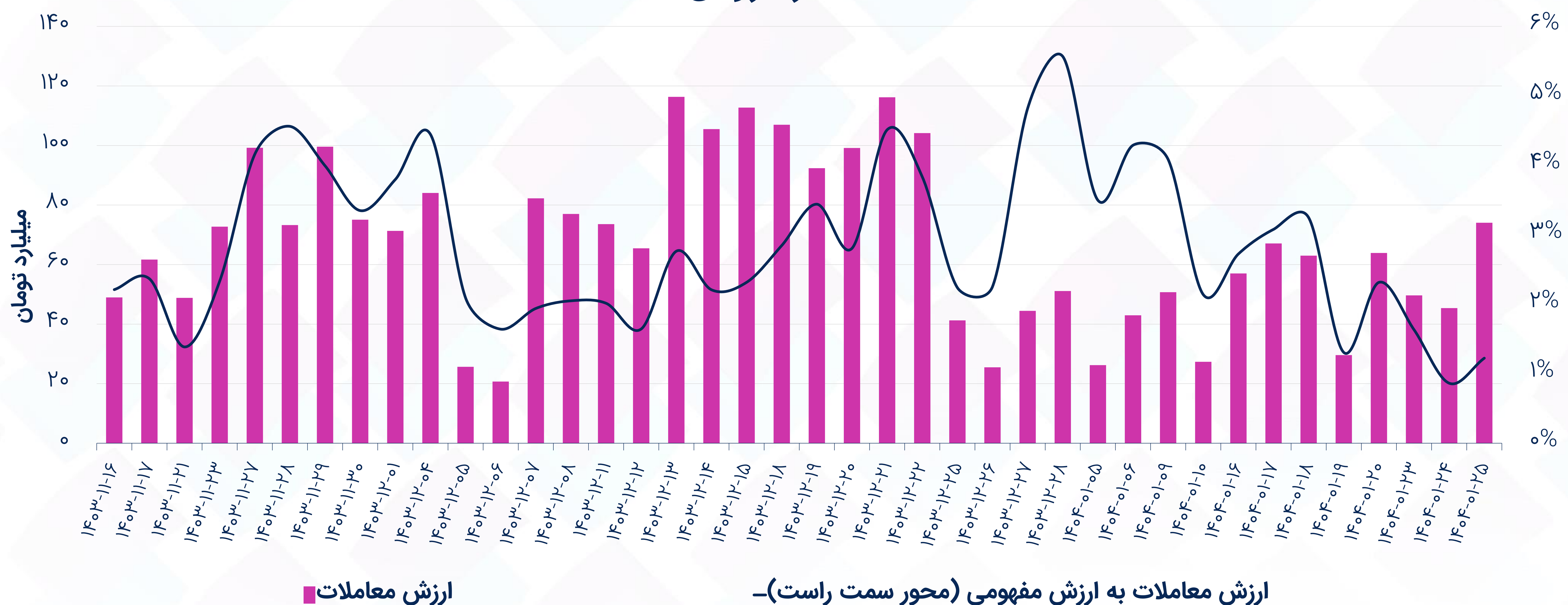
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



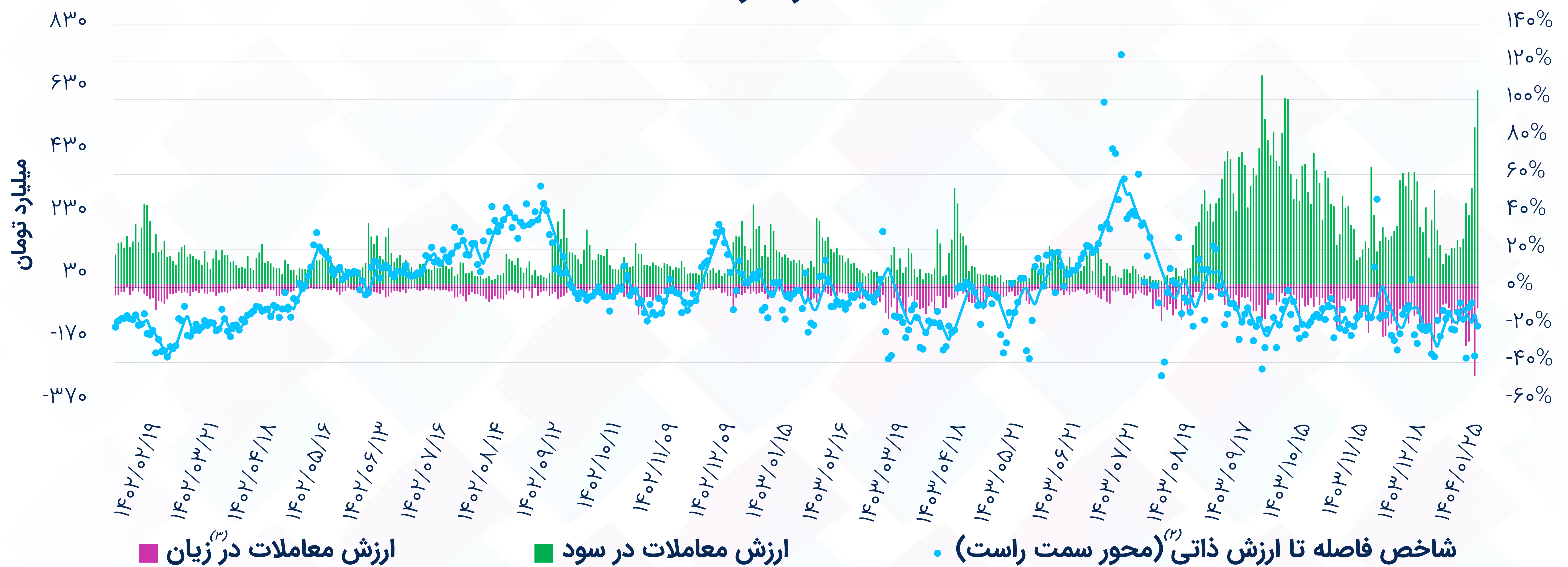
اختیار فروش



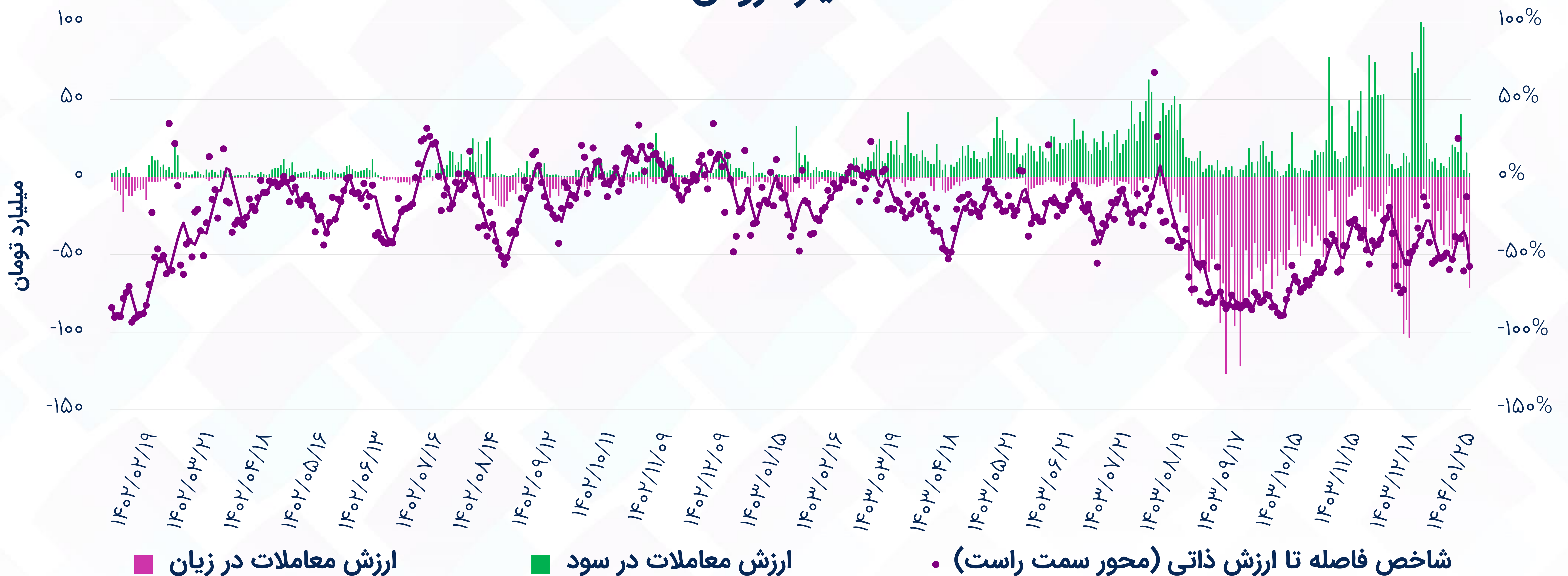
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

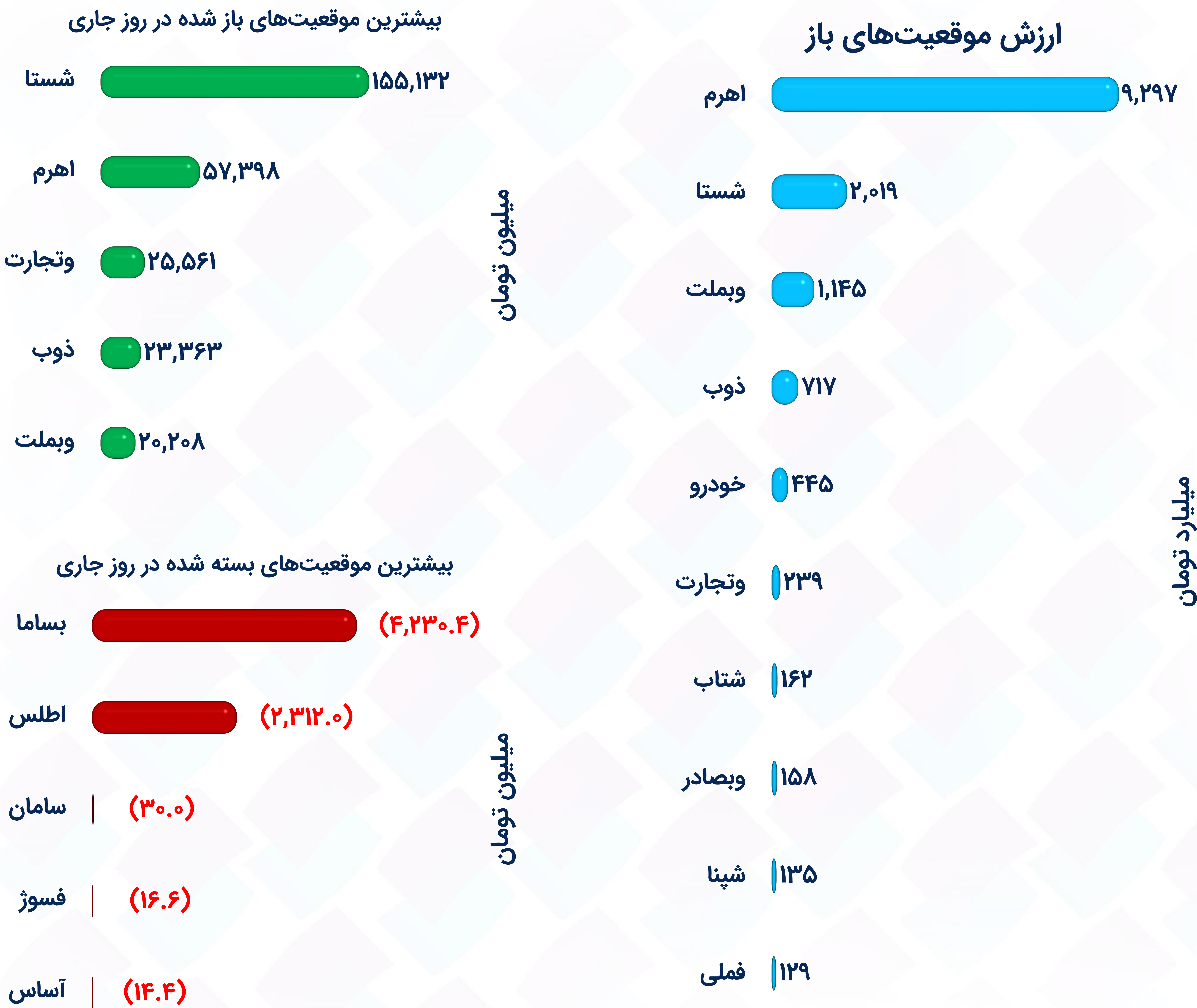
اختیار خرید

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	۵۵	۴۹۱.۹	۵,۰۵۴.۰	۴۴۱.۶	۵۰.۴	(۲۲.۷%)
شستا	۴۰	۷۰.۳	۱,۰۲۴.۴	۵۵.۷	۱۴.۶	(۲۱.۶%)
ویملت	۲۴	۶۹.۵	۳۴۸.۵	۶۹.۱	۰.۵	(۴.۴%)
ذوب	۲۴	۲۹.۹	۱۷۸.۸	۲۴.۱	۵.۹	(۱۸.۳%)
وتجارت	۱۷	۱۵.۶	۷۱.۸	۱۴.۰	۱.۷	(۴۱.۲%)
بساما	۱۳	۵.۸	۱۸.۵	۵.۸	۰.۰	۹.۵%
توان	۱۳	۱.۹	۹.۳	۱.۹	۰.۰	(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	۱۷	۷۰,۶۱۱.۱	۵,۸۳۶,۳۲۰.۰	۲,۵۵۵.۱	۶۸,۰۵۶.۰	(۵۶.۸%)
شستا	۸	۳,۳۱۷.۶	۱۹۷,۱۵۰.۲	۰.۱	۳,۳۱۷.۵	(۷۳.۱%)
ذوب	۲	۵۵.۹	۴,۴۴۴.۱	۰.۰	۵۵.۹	(۹۴.۲%)
خودران	۵	۴۰.۰	۱,۲۲۵.۵	۳۰.۰	۱۰.۰	(۳۹.۴%)
شپنا	۱	۱۴.۳	۳۰۵.۹	۰.۰	۱۴.۳	(۴۷.۵%)
توان	۲	۷.۵	۲۶۶.۶	۲.۵	۵.۰	۳۲.۱%
فملی	۱	۵.۰	۹۹۹.۰	۰.۰	۵.۰	(۴۰.۲%)

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 ۴,۴۵۹

شستا ۱۷۹

وبملت ۲۰

بساما ۸

خودرو ۳

ذوب ۳

خودران ۲

توان ۱.۶۷

فملی ۱.۶۳

شپنا ۱.۵۴

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۷۷۰,۶۱۷.۴

شستا ۷۰,۰۳۷.۷

ذوب ۲,۱۳۸.۰

خودران ۳۸۳.۰

شپنا ۲۰۰.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

وبملت (۵,۷۸۲.۲)

فملی (۴۴۸.۲)

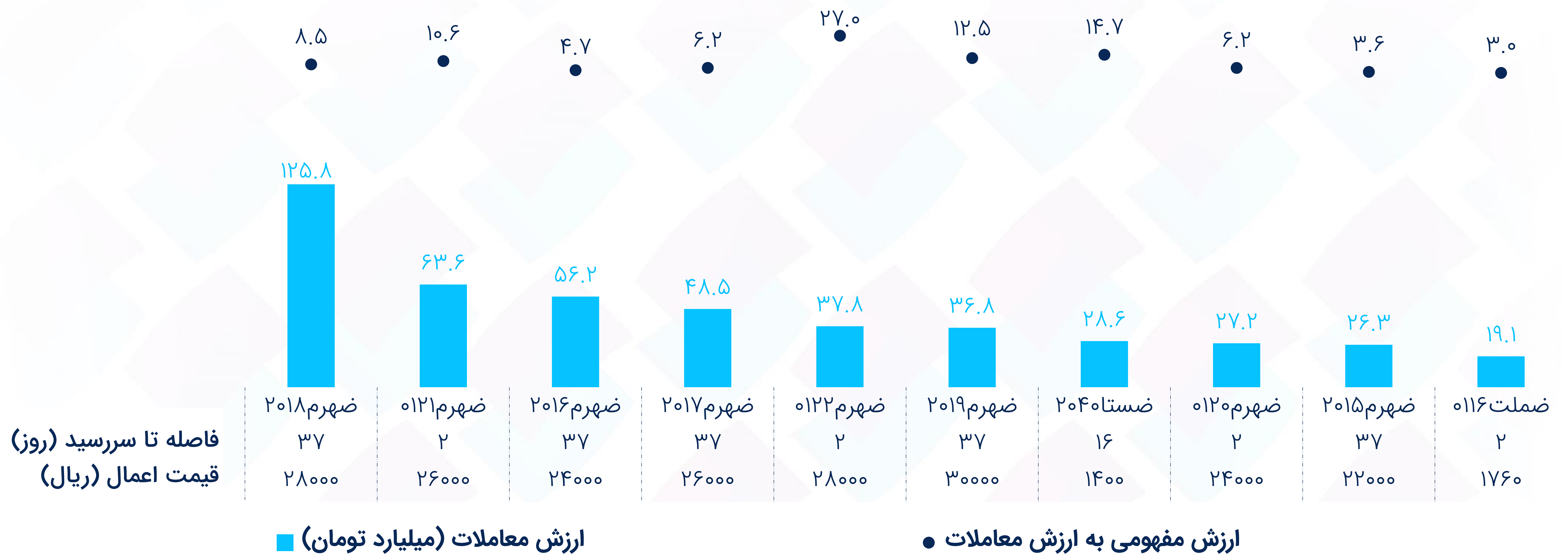
توان (۱۴۰.۰)

موج (۲.۶)

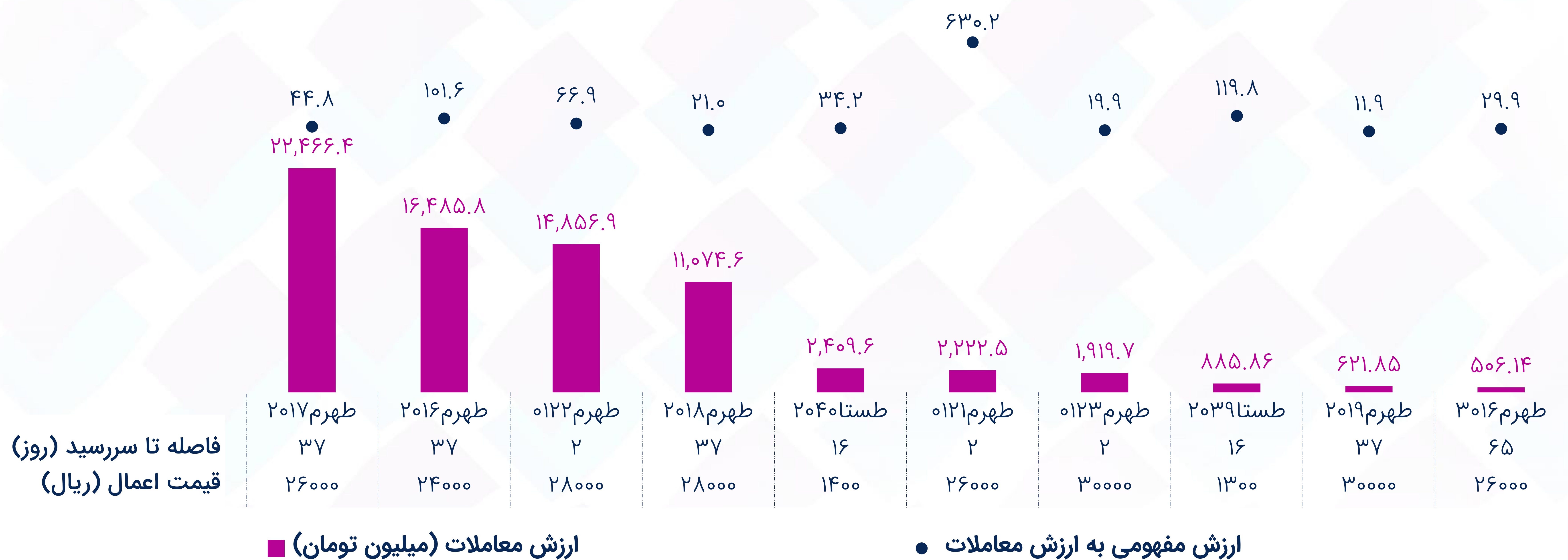
میلیون تومان

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
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۱۳	۶۸.۶	۱,۱۳۸	۸,۹۸۰	۸,۶۳۳	(۳.۹%)	۷.۶	۱.۰۰	۱,۵۸۸	۴۰%
ضبساما ۲۲۲	بساما	۸,۴۱۱	۱۳	۵.۳	۵۵۰	۸,۹۸۰	۸,۹۶۱	(۰.۲%)	۱۶.۳	۰.۹۷	۶۸۹	۲۵%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۶	۳.۶	۱,۸۹۵	۱۳,۲۴۶	۱۲,۸۹۵	(۲.۶%)	۶.۸	۱.۰۰	۲,۳۲۲	۲۳%
ضملی ۳۰۴۹	فملی	۸,۰۰۰	۴۴	۱۹.۲	۱,۹۳۴	۱۰,۰۱۰	۹,۹۳۴	(۰.۸%)	۵.۱	۱.۰۰	۲,۳۶۷	۲۲%
ضبساما ۲۱۷	بساما	۶,۲۴۶	۱۳	۴۷۷.۳	۲,۳۴۱	۸,۹۸۰	۸,۵۸۷	(۴.۴%)	۳.۷	۱.۰۰	۲,۸۱۹	۲۰%

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	۳۰	۴.۳	۵	۴۷۷	۸۰۵	۶۹%	۱۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۰۱۲۴	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲	۴۱.۲	۱۳	۲۸,۳۶۰	۳۴,۰۱۳	۲۰%	۲,۶۱۶.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۶	۳۱.۵	۵	۱,۴۳۷	۱,۹۰۵	۳۳%	۳۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۳۰	۴.۰	۶	۴۷۷	۷۰۶	۴۸%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۵۰	۱۴.۰	۱۷	۱,۴۳۷	۲,۲۱۷	۵۴%	۱۳۰.۴	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
طتوان ۲۰۹	توان	۲۸,۰۰۰	۲۷	۲.۵	۵۰۰	۲۶,۶۶۰	۲۷,۵۰۰	۳.۲%	۵۵.۰	-۰.۵۶	۱,۴۴۳	۱۸۸.۵%
طهرم ۰۱۲۳	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲	۱,۹۱۹.۷	۱,۴۲۵	۲۸,۳۶۰	۲۸,۵۷۵	۰.۸%	۲۰.۱	-۰.۹۰	۱,۵۶۹	۱۰.۱%
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۷	۱۳.۵	۴,۵۰۰	۲۸,۳۶۰	۲۹,۵۰۰	۴.۰%	۶.۶	-۰.۸۷	۴,۵۷۵	۱.۷%
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۷	۶۲۱.۹	۲,۳۹۲	۲۸,۳۶۰	۲۷,۶۰۸	(۲.۷%)	۱۱.۵	-۰.۵۳	۱,۶۵۹	(۳۰.۷%)
طران ۳۰۰۸	خودران	۱۲,۰۰۰	۶۵	۳۰.۰	۱,۰۰۰	۱۱,۳۴۰	۱۱,۰۰۰	(۳.۰%)	۱۱.۰	-۰.۴۶	۶۴۲	(۳۵.۸%)

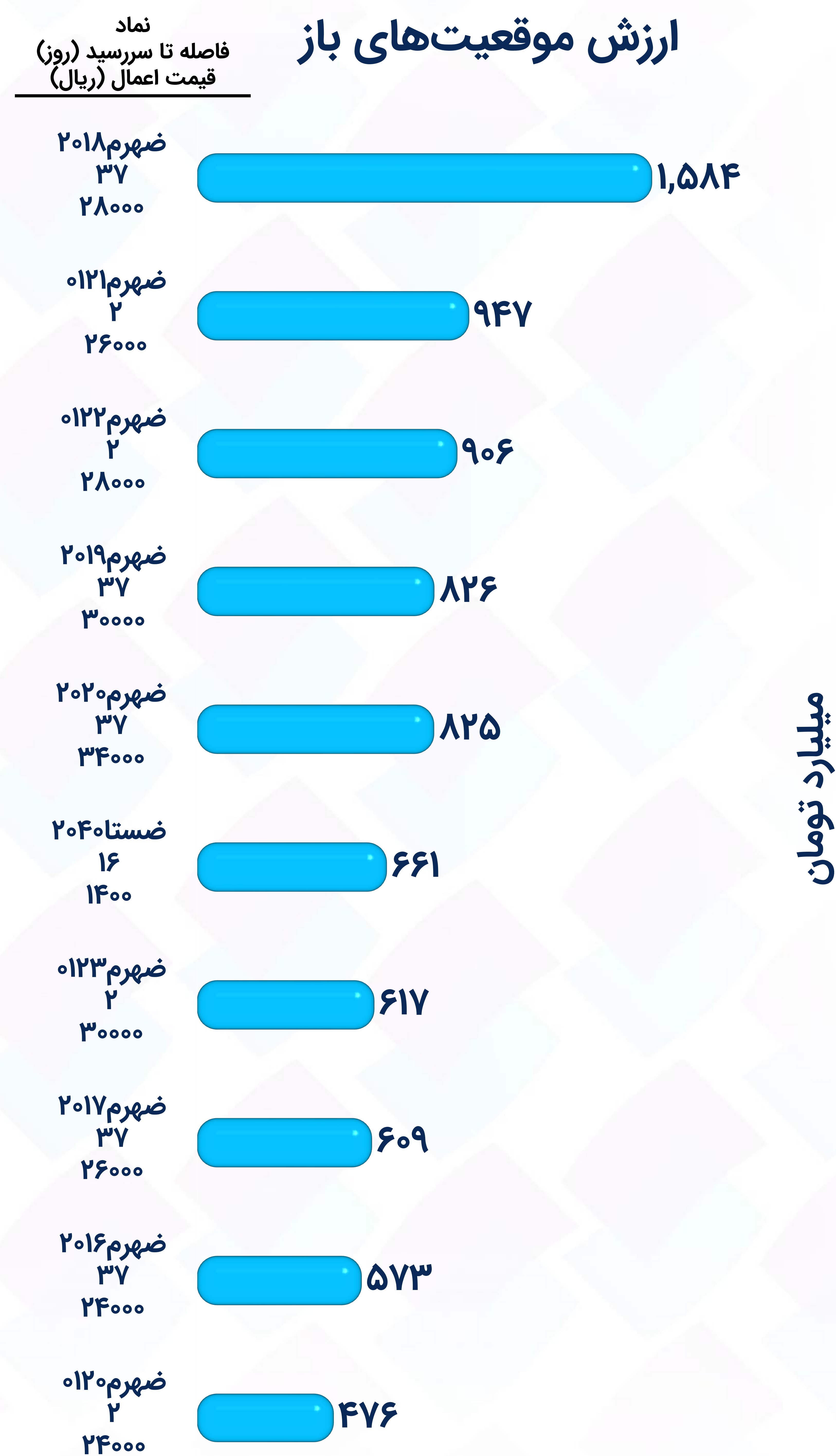
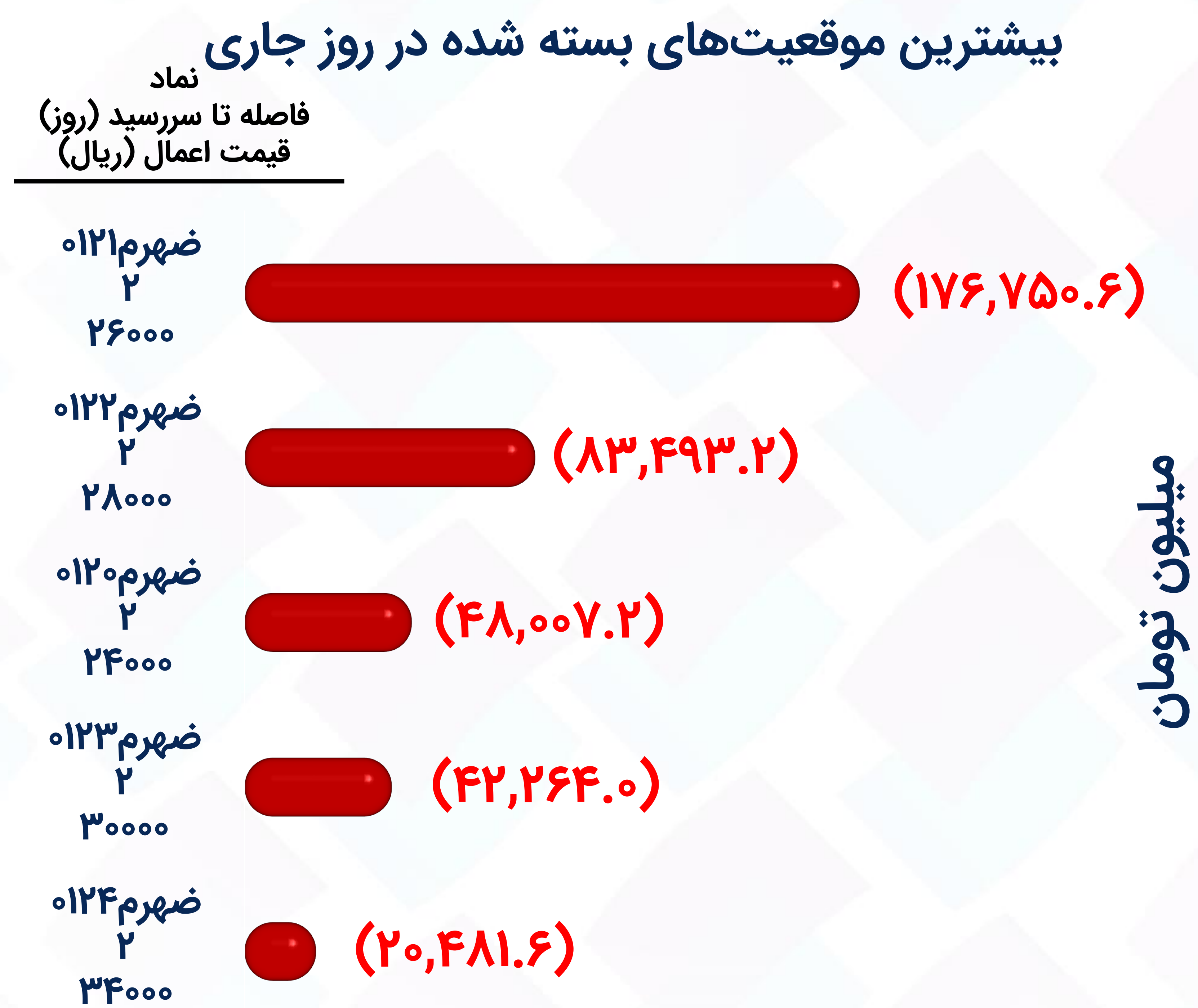
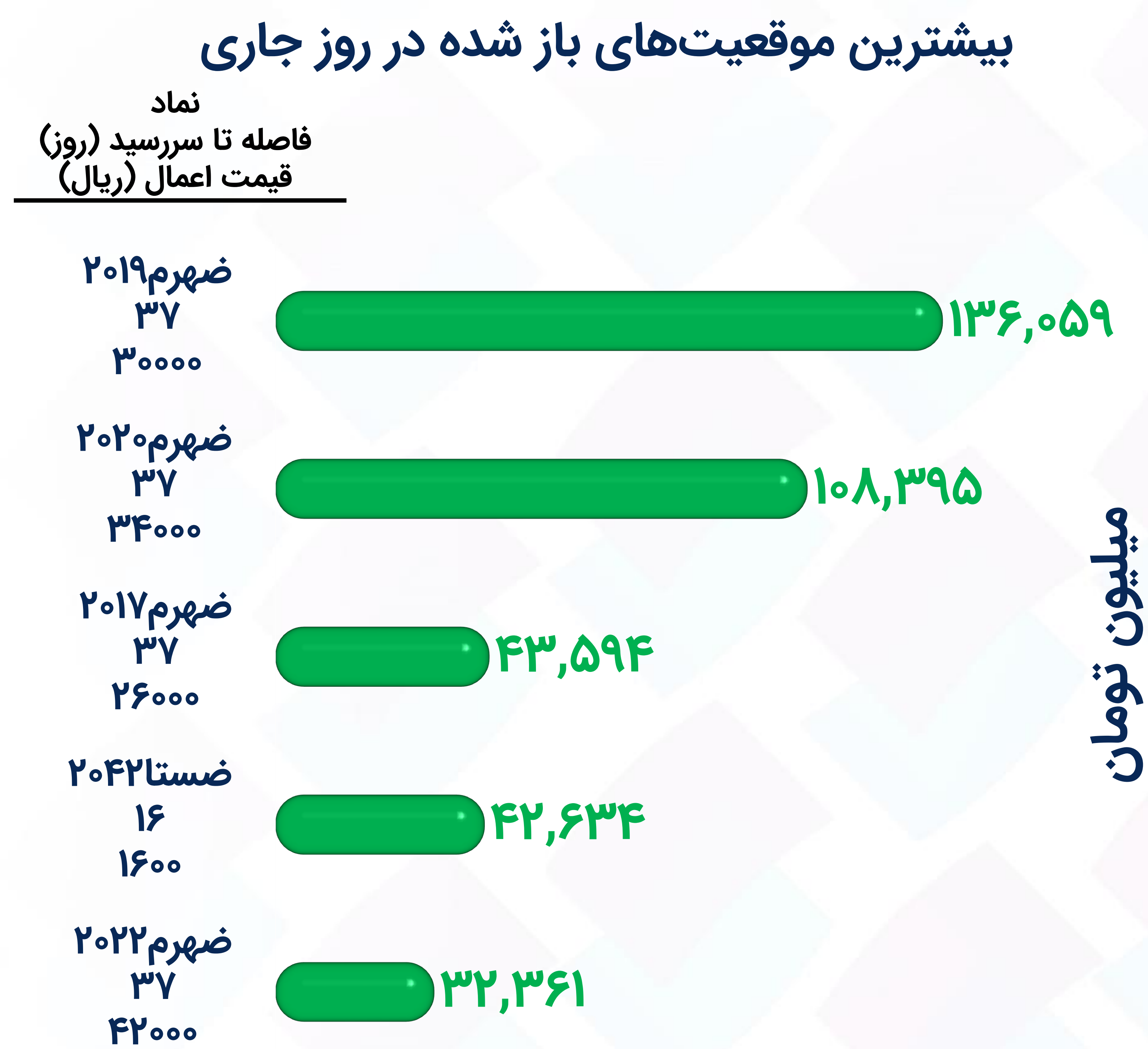
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۲	۱.۴	۱	۲,۶۷۲	۱,۹۰۶	(۲۸.۷%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۸	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲	۰.۶	۳	۲۸,۳۶۰	۱۹,۹۹۷	(۲۹.۵%)	۶,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۰۱۱۸	وبملت	۲,۰۵۴	۲	۱.۴	۱	۲,۶۷۲	۲,۰۵۳	(۲۳.۲%)	۲,۰۵۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۰۱۱۹	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲	۳۴.۳	۷	۲۸,۳۶۰	۲۱,۹۹۳	(۲۲.۵%)	۳,۱۴۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طران ۰۱۰۵	خودران	۹,۰۰۰	۲	۰.۱	۵	۱۱,۳۴۰	۸,۹۹۵	(۲۰.۷%)	۱,۷۹۹.۰	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



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

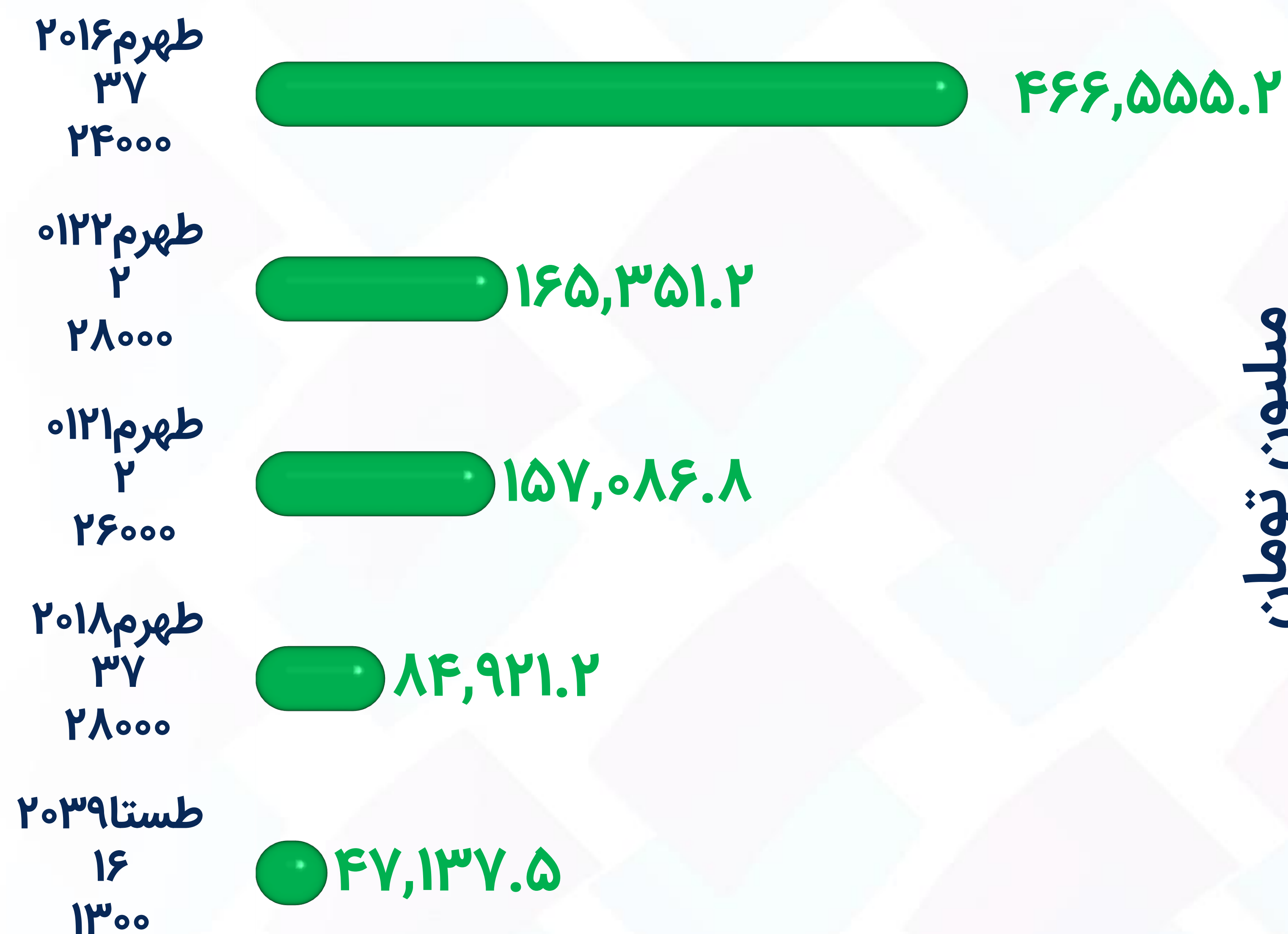
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

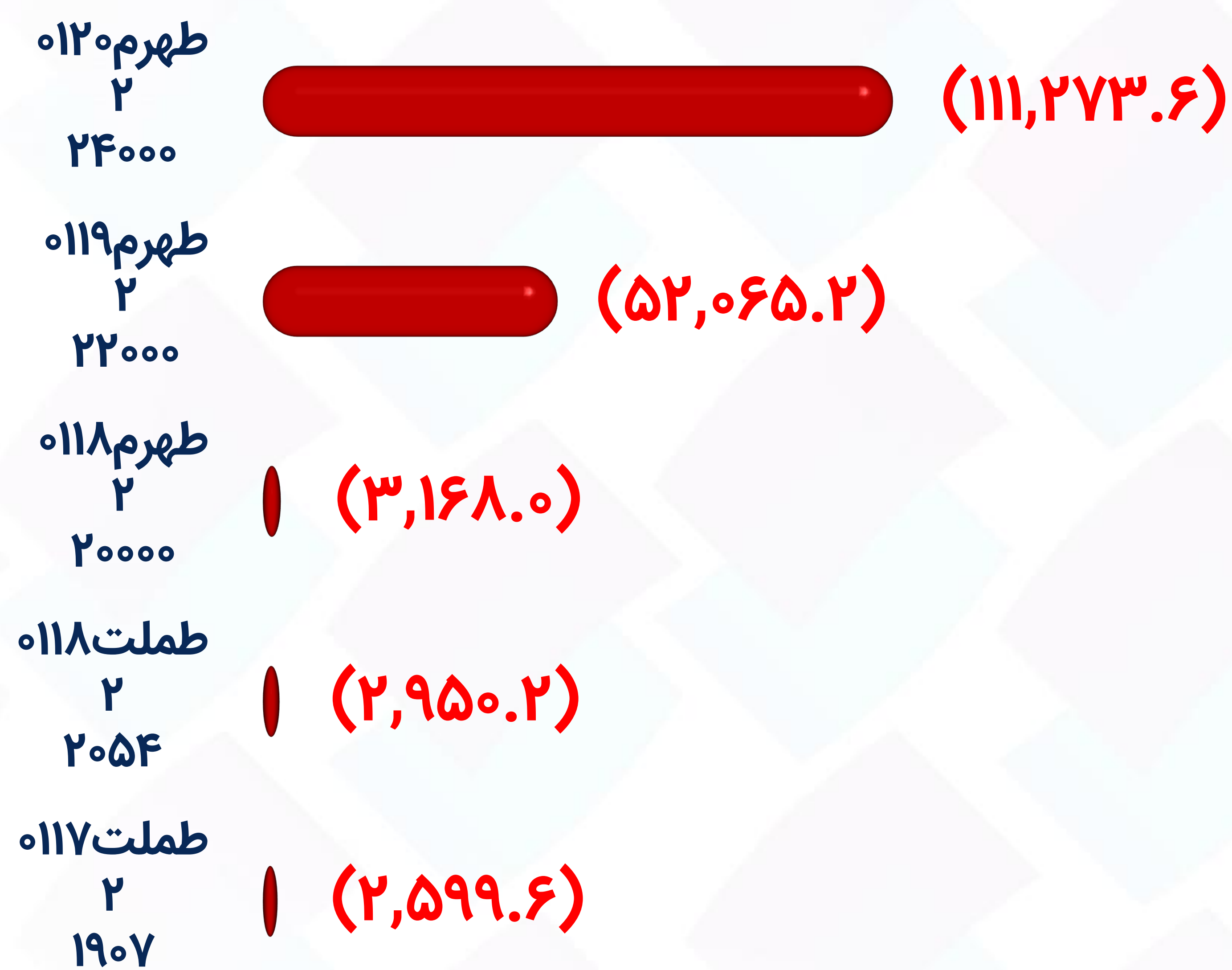
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

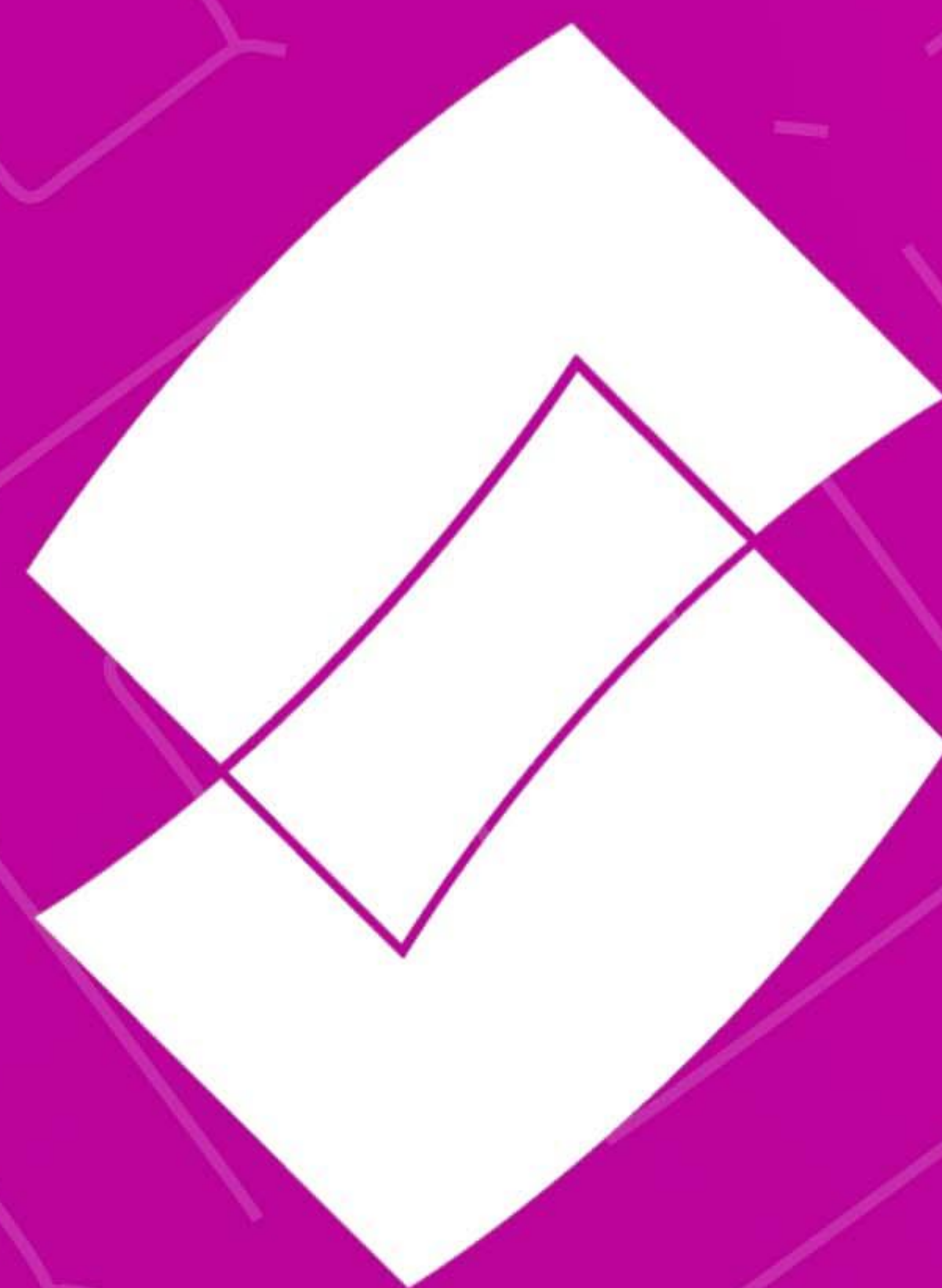
اختیار خرید



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.