

شماره
۴۵۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۶ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





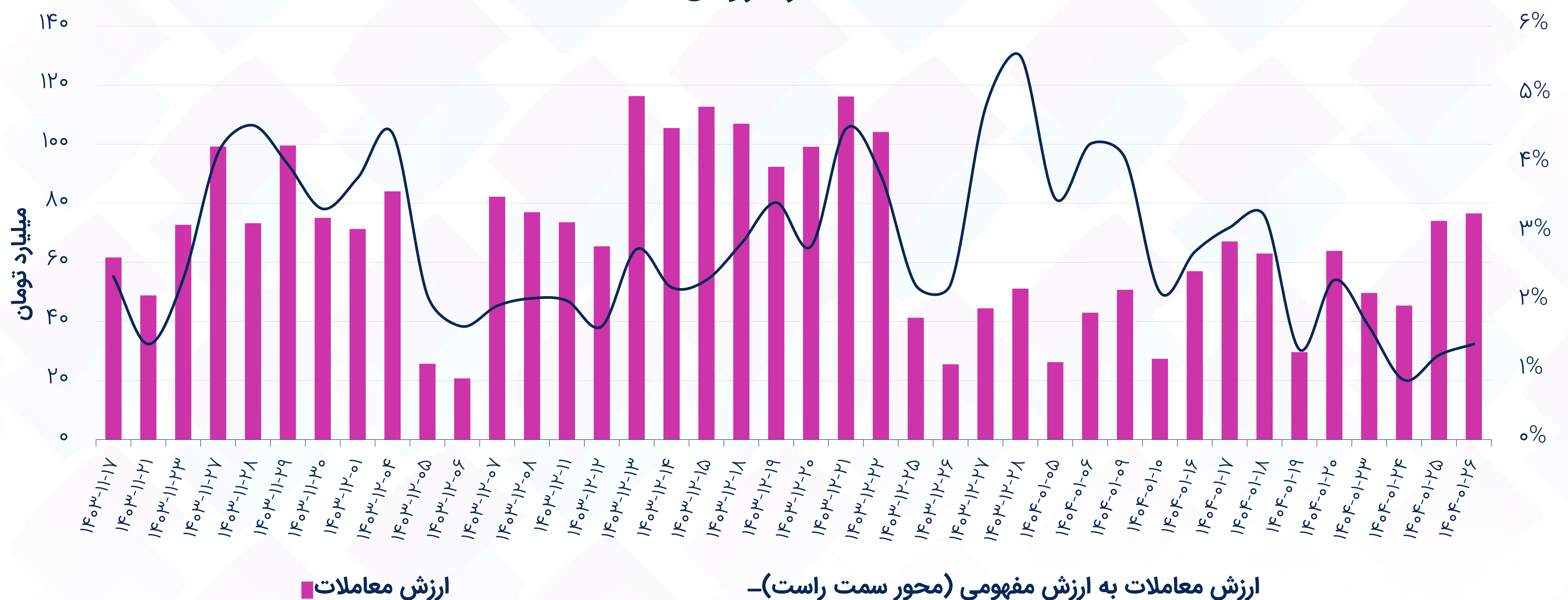
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



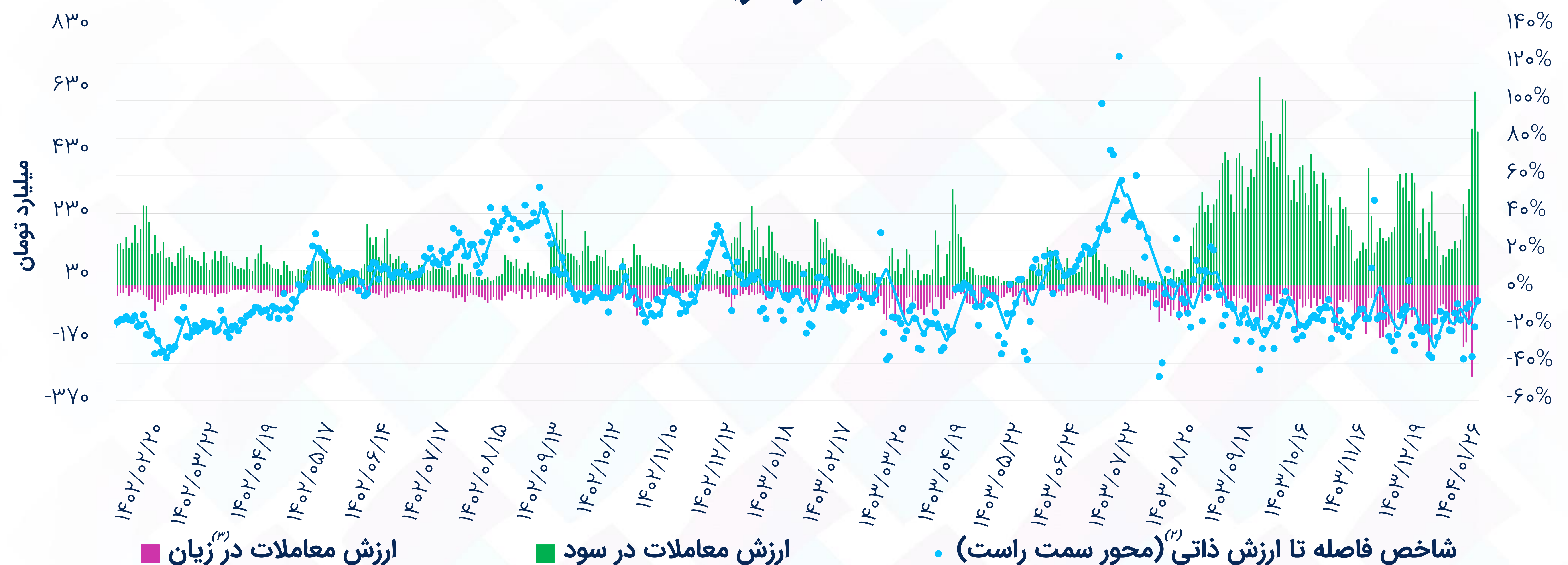
اختیار فروش



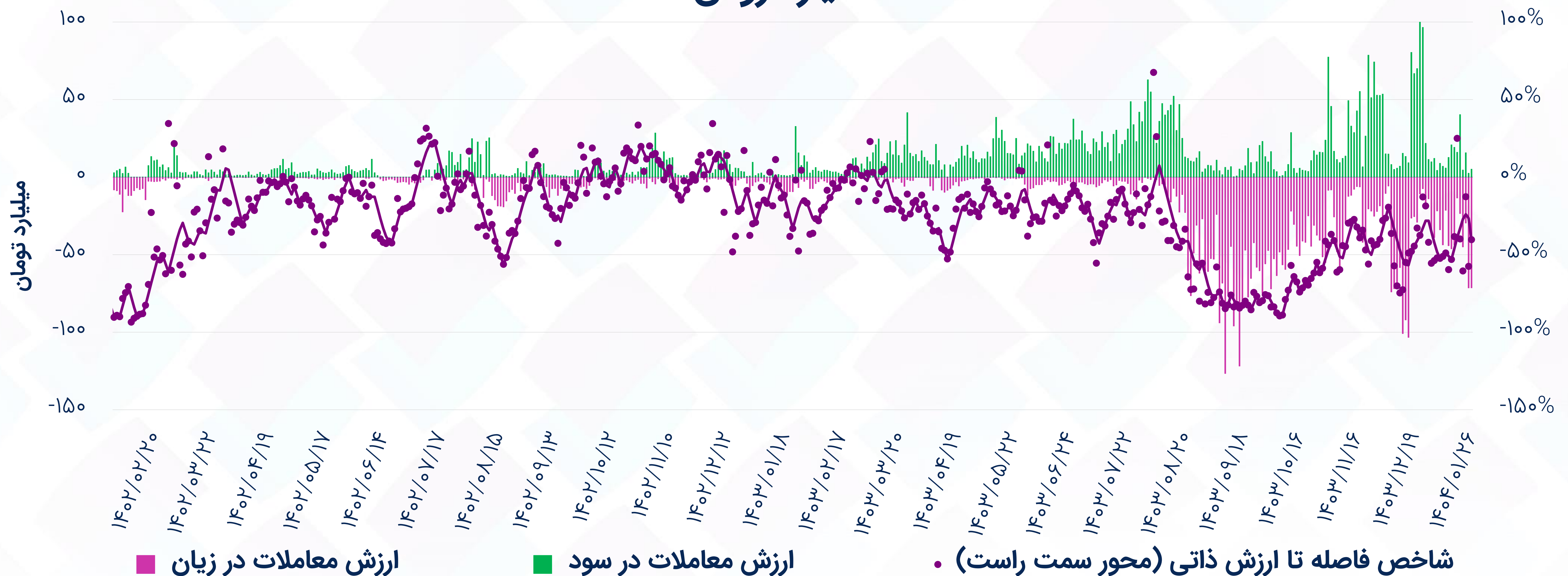
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

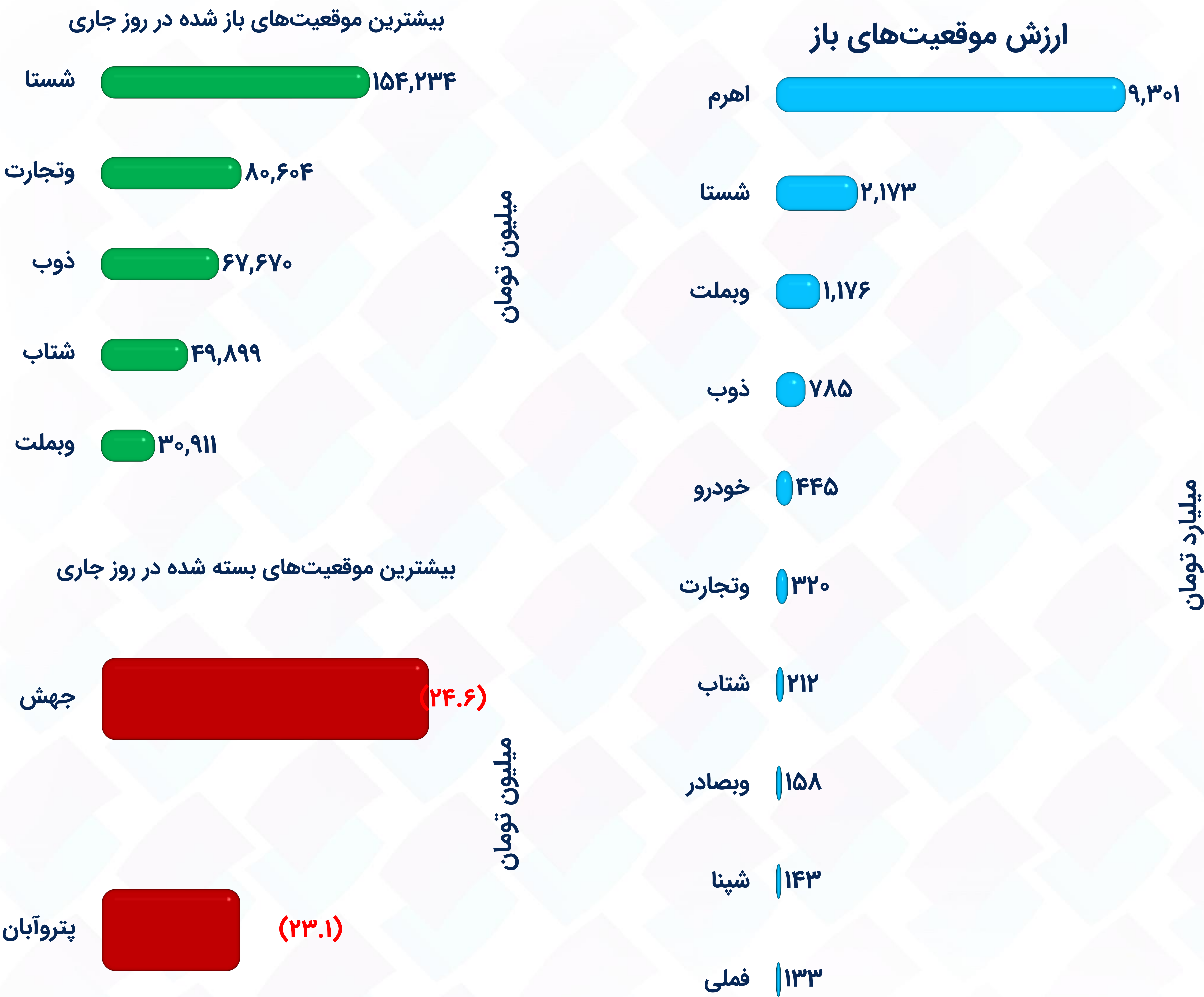
اختیار خرید

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	۳۳۵.۶	۷,۱۱۰.۶	۲۹۱.۴	۴۴.۲	(۴.۰%)
وبملت	۲۴	۸۶.۹	۵۰۹.۴	۸۴.۹	۲.۰	۲.۱%
شستا	۴۲	۴۲.۸	۷۴۲.۱	۳۵.۸	۷.۰	(۳۰.۳%)
وتجارت	۱۹	۲۶.۰	۱۴۳.۲	۲۳.۵	۲.۵	(۲۰.۶%)
ذوب	۲۴	۲۳.۷	۱۶۸.۴	۱۸.۷	۵.۰	(۱۹.۹%)
شتاب	۱۱	۱۹.۶	۷۲.۶	۱۷.۹	۱.۷	(۳.۳%)
موج	۸	۴.۹	۲۴.۳	۴.۸	۰.۲	(۵.۱%)

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	۶۹,۵۱۰.۸	۵,۲۲۵,۴۸۰.۹	۵,۰۷۲.۴	۶۴,۴۳۸.۳	(۳۸.۳%)
شستا	۷	۶,۸۷۶.۲	۲۸۴,۱۰۳.۰	۳.۲	۶,۸۷۳.۰	(۶۰.۹%)
وتعاون	۲	۷۹.۲	۱,۷۷۹.۶	۶۳.۲	۱۶.۰	۲۲.۳%
وبملت	۶	۶۳.۴	۵,۵۷۴.۸	۰.۰	۶۳.۴	(۷۹.۸%)
ذوب	۱	۳۸.۶	۴,۵۱۰.۱	۰.۰	۳۸.۶	(۸۶.۱%)
خودران	۵	۱۰.۸	۵۴۳.۷	۱۰.۱	۰.۷	(۵۱.۱%)
فملی	۱	۱.۵	۹۷.۲	۰.۰	۱.۵	(۶۴.۴%)

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 ۳,۹۰۱

شستا ۲۲۵

وبملت ۲۱

بساما ۸

ذوب ۴

خودرو ۳

خودران ۲

وتعاون ۱.۹۰

توان ۱.۶۸

فملی ۱.۶۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۴۵,۵۴۴.۷

وتعاون ۱,۶۸۰.۸

ذوب ۱,۳۱۵.۷

وبملت ۱,۰۲۶.۹

وتجارت ۱۶.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم

(۵۵۷,۷۰۸.۰)

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
ضبساما ۲۲۲	بساما	۸,۴۱۱	۱۲	۱.۴	۳۳۵	۸,۹۱۰	۸,۷۴۶	(۱.۸%)	۲۶.۱	۰.۹۶	۶۰۹	۸۲%
ضبساما ۲۱۶	بساما	۵,۸۲۹	۱۲	۹۶۹.۵	۲,۲۴۶	۸,۹۱۰	۸,۰۷۵	(۹.۴%)	۳.۶	۱.۰۰	۳,۱۵۲	۴۰%
ضرویین ۱۰۶	رویین	۱۲,۰۰۰	۵	۱۵.۰	۷۵۰	۱۲,۹۸۱	۱۲,۷۵۰	(۱.۸%)	۱۷.۰	۱.۰۰	۱,۰۴۷	۴۰%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۵	۲۲.۸	۱,۴۶۳	۱۲,۹۸۱	۱۲,۴۶۳	(۴.۰%)	۸.۵	۱.۰۰	۲,۰۴۱	۴۰%
ضران ۳۰۰۴	خودران	۸,۰۰۰	۶۴	۱.۲	۳,۰۹۹	۱۱,۶۶۰	۱۱,۰۹۹	(۴.۸%)	۳.۶	۱.۰۰	۴,۱۲۸	۳۳%

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	۲۹	۱.۲	۳	۴۶۷	۸۰۳	۷۲%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۵	۹.۷	۵	۱,۴۱۰	۱,۹۰۵	۳۵%	۳۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۹	۱.۶	۶	۴۶۷	۷۰۶	۵۱%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۴۹	۲.۳	۱۷	۱,۴۱۰	۲,۲۱۷	۵۷%	۱۳۰.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۱۵	۳.۹	۶	۱,۴۱۰	۱,۸۰۶	۲۸%	۳۰۱.۰	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
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۶۲	۶۳.۲	۹۵	۱,۷۱۶	۱,۸۰۵	۵.۲%	۱۹.۰	-۰.۶۳	۱۲۶	۳۳.۱%
طهرم ۲۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۶	۹۵۶.۱	۹۱۵	۲۸,۱۰۰	۲۷,۰۸۵	(۳.۶%)	۲۹.۶	-۰.۳۵	۸۳۵	(۸.۸%)
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۶	۷۱.۸	۲,۰۹۳	۲۸,۱۰۰	۲۷,۹۰۷	(۰.۷%)	۱۳.۳	-۰.۵۷	۱,۸۰۸	(۱۳.۶%)
طوتعاون ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۶۲	۱۶.۰	۴۳	۱,۷۱۶	۱,۶۵۷	(۳.۴%)	۳۸.۵	-۰.۲۶	۳۴	(۲۰.۶%)
طستا ۲۰۴۱	شستا	۱,۵۰۰	۱۵	۳.۲	۱۱۹	۱,۴۱۰	۱,۳۸۱	(۲.۱%)	۱۱.۶	-۰.۷۵	۷۸	(۳۴.۳%)

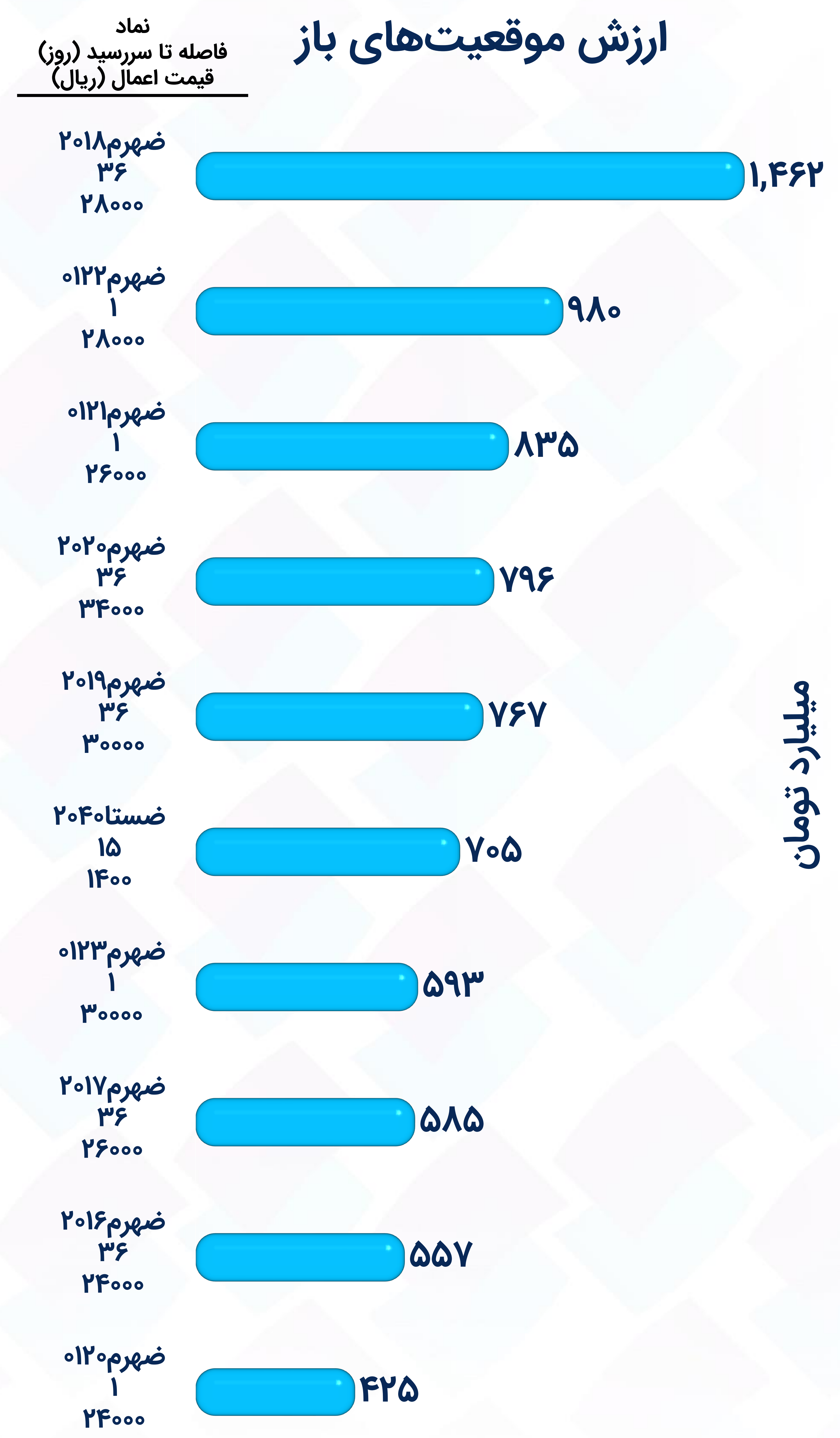
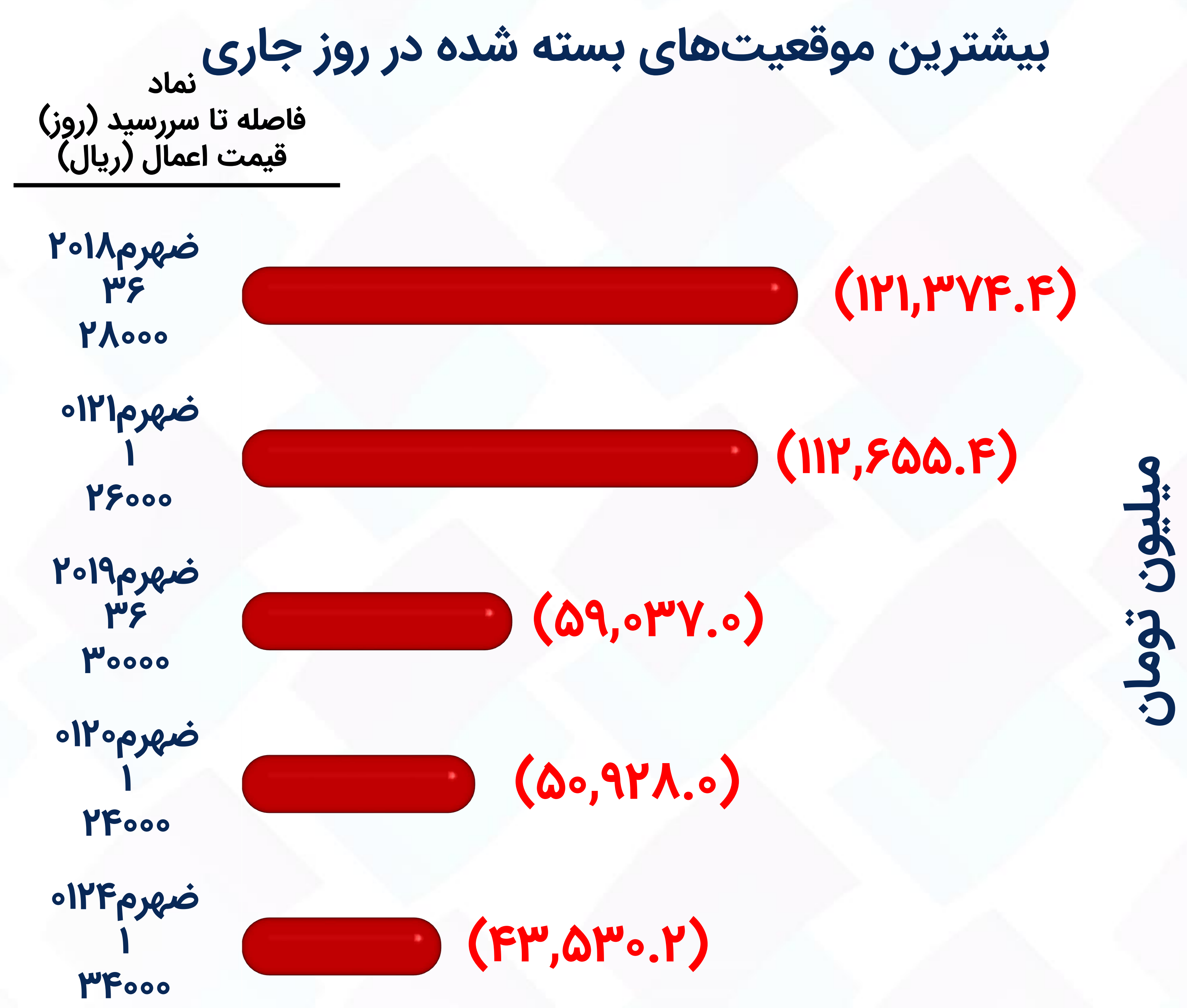
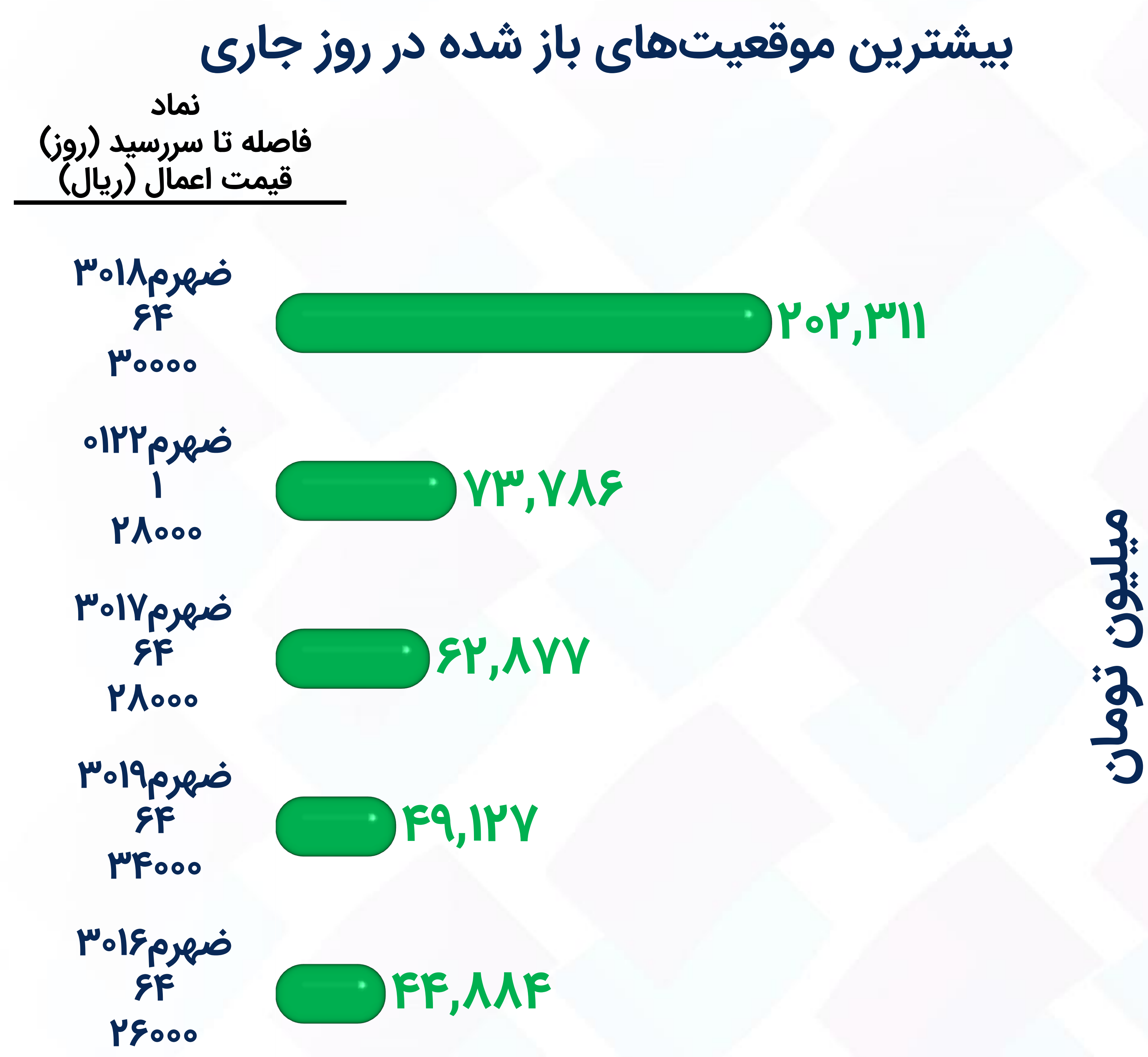
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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 ۳۰۵۰	ویملت	۱,۹۰۷	۵۷	۰.۰	۳۰	۲,۶۸۲	۱,۸۷۷	(۳۰.۰%)	۶۲.۶	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۱۵	۱۴.۸	۳	۱,۴۱۰	۱,۱۹۷	(۱۵.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳۶	۲۰.۸	۱۰۱	۲۸,۱۰۰	۲۱,۸۹۹	(۲۲.۱%)	۲۱۶.۸	-۰.۰۱	۹	(۹۰.۸%)
طذوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۲۹	۳۸.۶	۴	۴۶۷	۳۹۶	(۱۵.۲%)	۹۹.۰	-۰.۰۳	۱	(۸۶.۱%)
طجار ۲۰۵۳	وتجارت	۵۴۵	۲۲	۱.۱	۳۱	۵۷۷	۵۱۴	(۱۰.۹%)	۱۶.۶	-۰.۱۷	۵	(۸۴.۲%)

(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

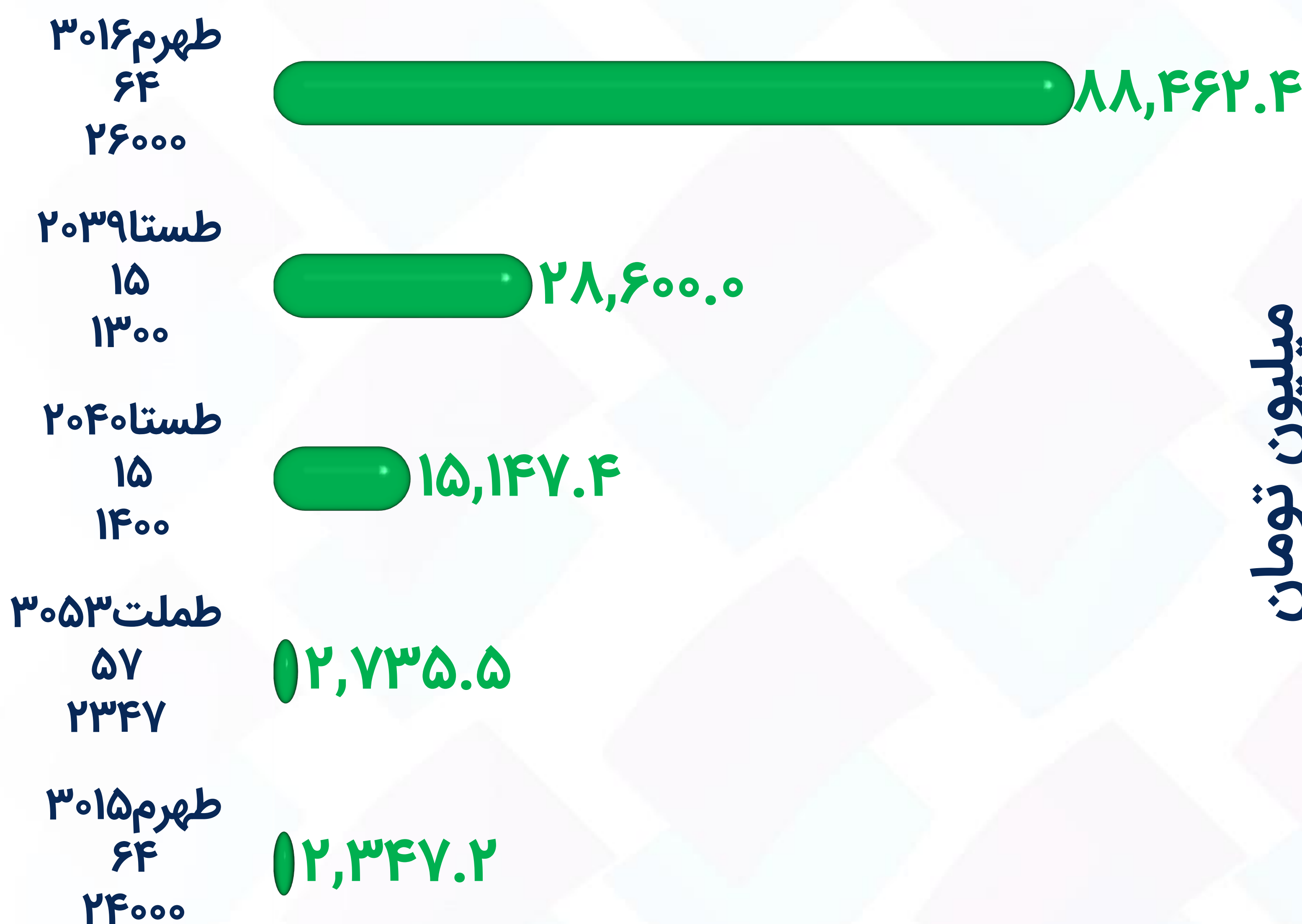
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.