

شماره
۴۵۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۷ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





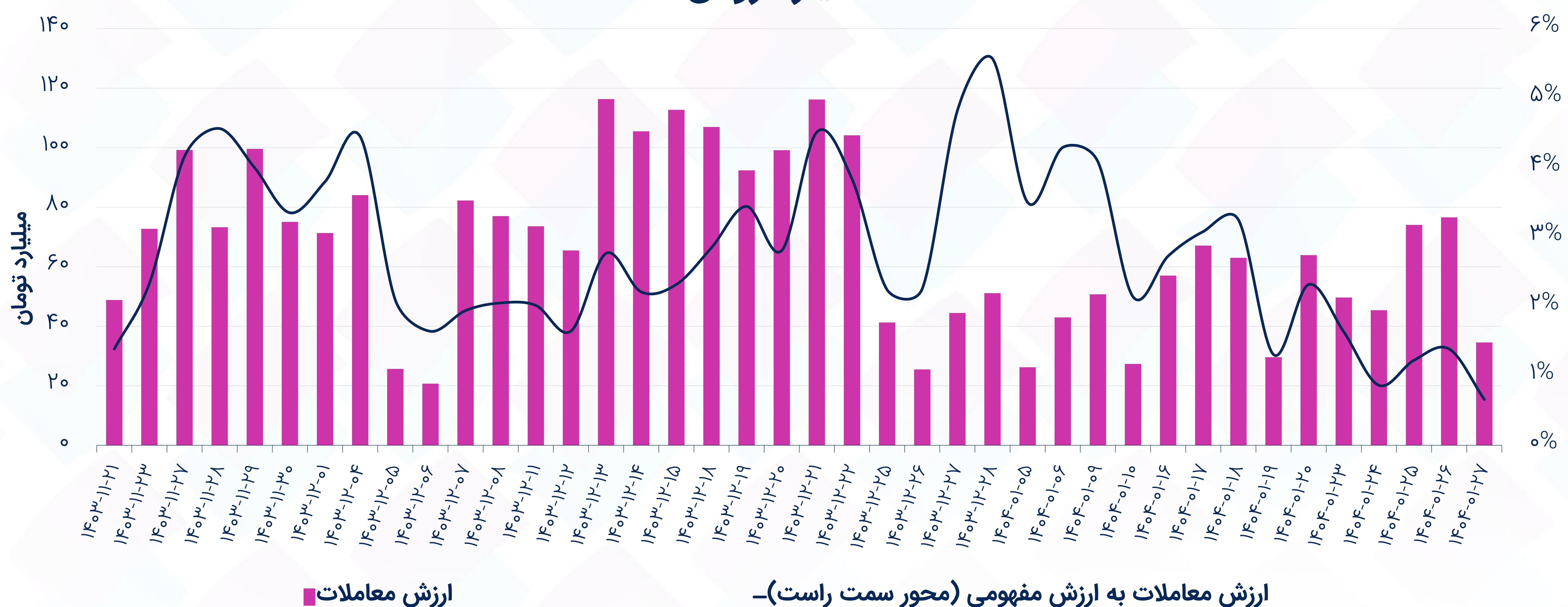
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



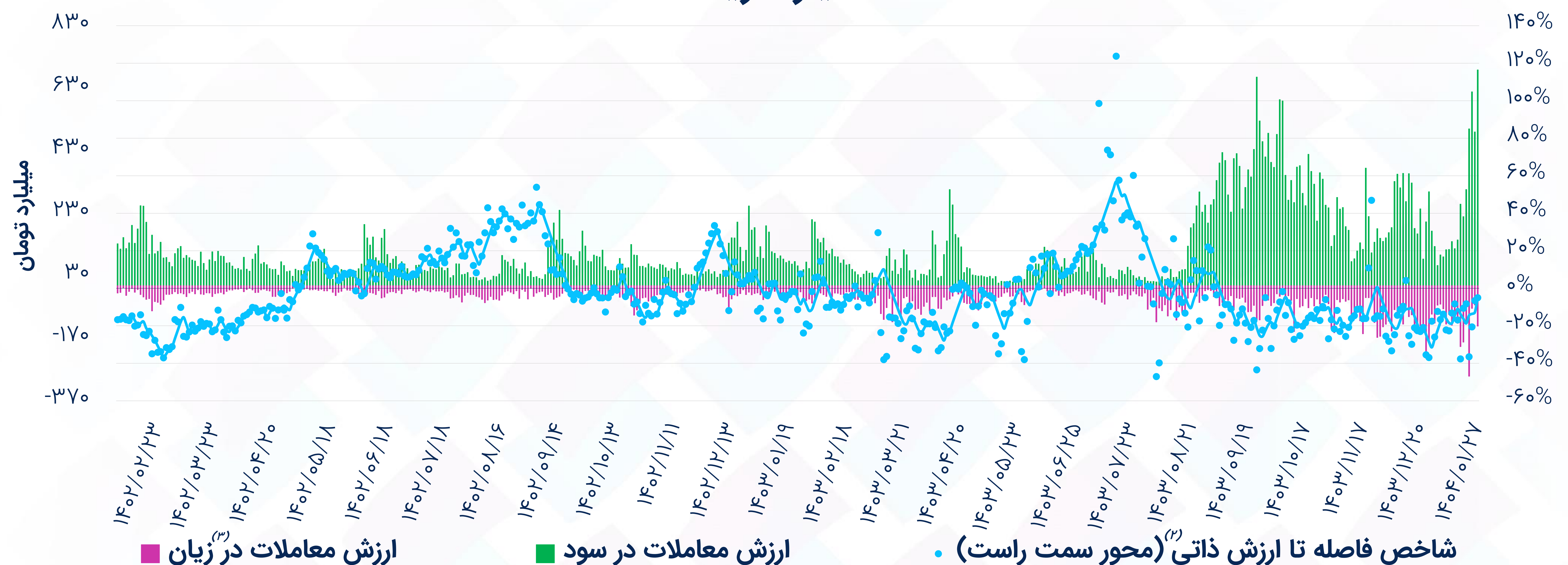
اختیار فروش



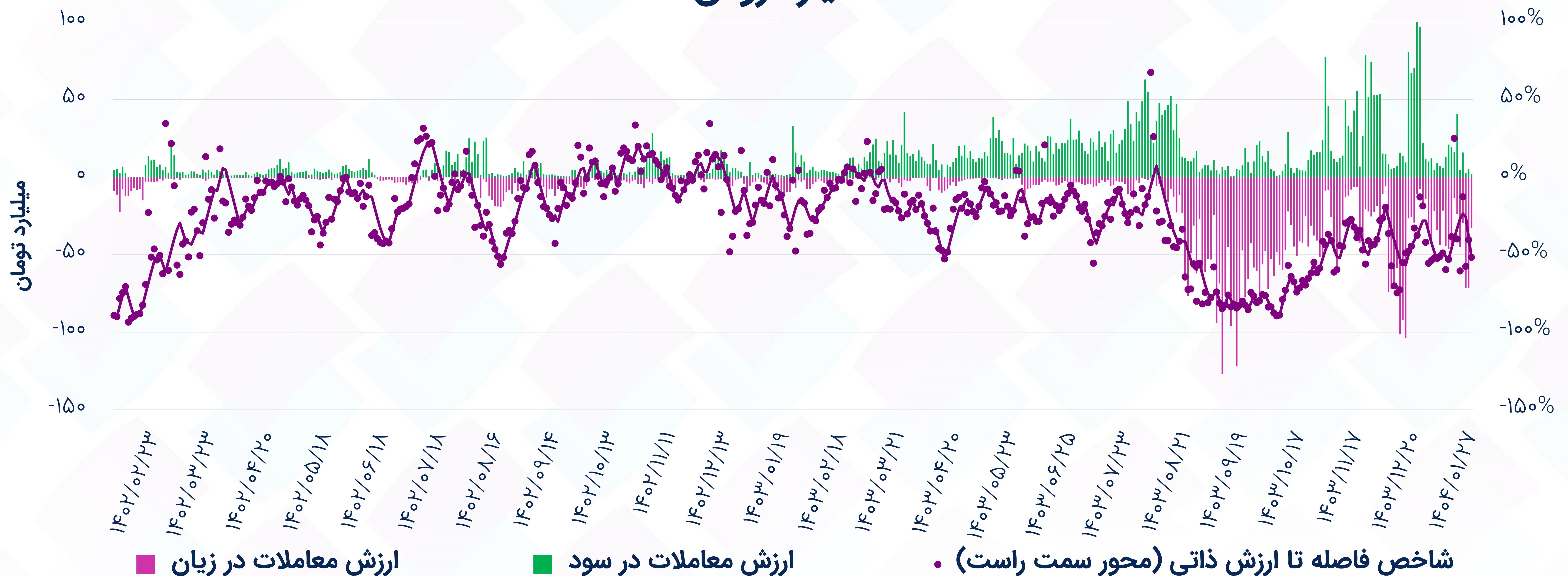
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

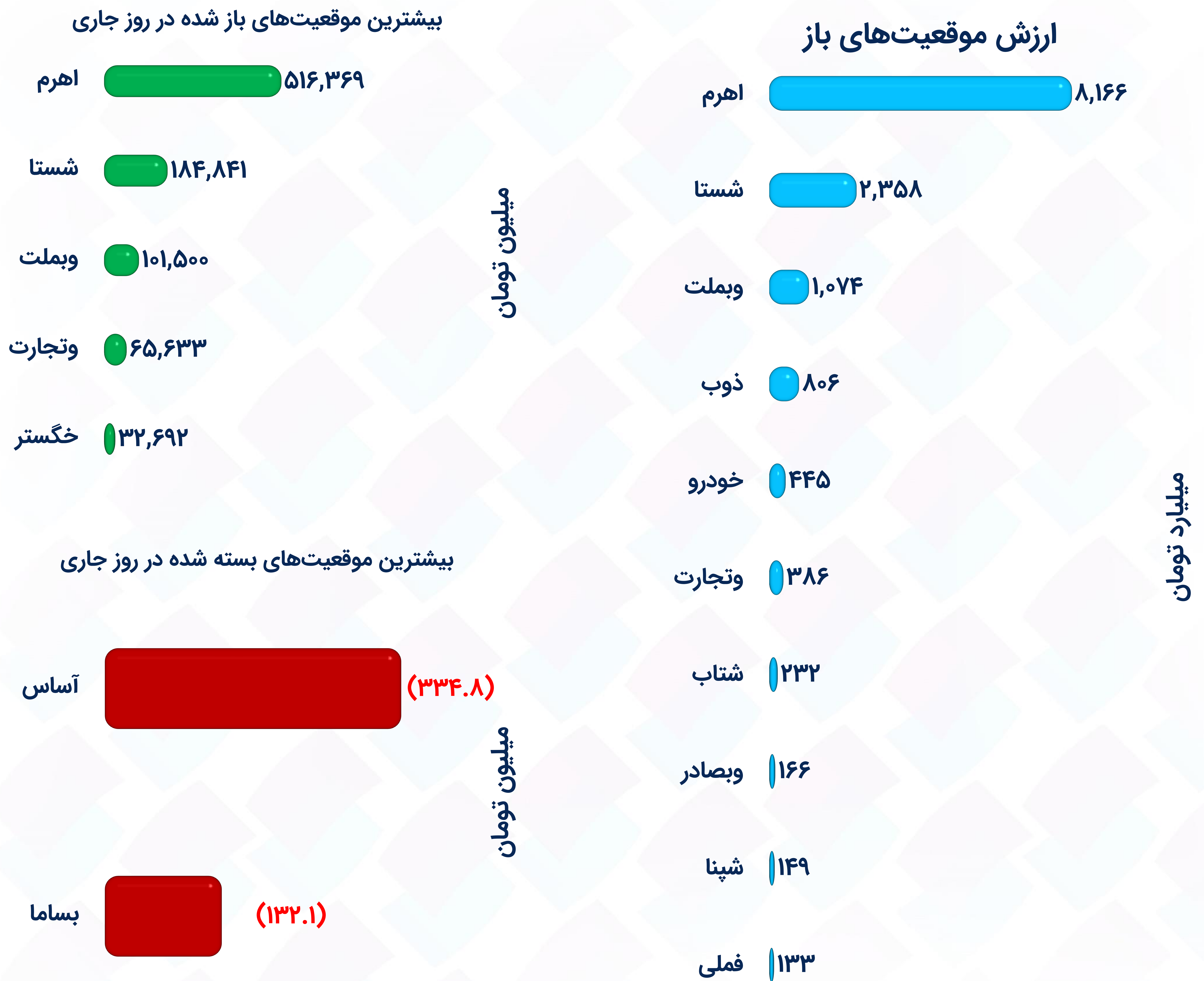
اختیار خرید

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	۵۶	۵۱۱.۸	۹,۵۹۴.۵	۴۱۴.۲	۹۷.۶	(۱.۹%)
وبملت	۲۳	۱۳۵.۶	۸۳۲.۲	۱۳۲.۸	۲.۸	۶.۱%
شستا	۴۷	۸۶.۵	۱,۲۲۲.۲	۶۹.۶	۱۶.۹	(۲۶.۷%)
ذوب	۲۳	۲۶.۲	۱۷۷.۹	۱۹.۲	۷.۰	(۲۳.۲%)
وتجارت	۲۱	۲۶.۱	۱۵۵.۷	۲۲.۸	۳.۳	(۲۳.۲%)
شتاب	۱۱	۹.۳	۴۱.۵	۸.۹	۰.۴	۳.۷%
وبصادر	۱۴	۶.۶	۲۲.۷	۶.۱	۰.۵	(۵۱.۷%)

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	۲۱	۲۷,۳۸۶.۸	۴,۷۸۰,۱۵۵.۰	۱,۵۷۲.۶	۲۵,۸۱۴.۳	(۴۸.۵%)
شستا	۸	۶,۳۴۶.۷	۴۱۰,۱۶۲.۱	۲۵.۷	۶,۳۲۱.۰	(۷۴.۳%)
شتاب	۱	۳۲۴.۷	۱۵,۲۹۷.۰	۰.۰	۳۲۴.۷	(۸۳.۳%)
وتعاون	۳	۲۹۵.۰	۱۳,۸۸۸.۰	۲۶۴.۸	۳۰.۲	۱۸۱.۰%
وبملت	۵	۱۰۵.۴	۵,۸۸۴.۹	۰.۰	۱۰۵.۴	(۷۲.۷%)
ذوب	۱	۵۶.۹	۵,۴۶۱.۲	۰.۰	۵۶.۹	(۹۵.۱%)
خودران	۲	۱۰.۷	۳۹۶.۲	۱۰.۷	۰.۰	(۴۵.۳%)

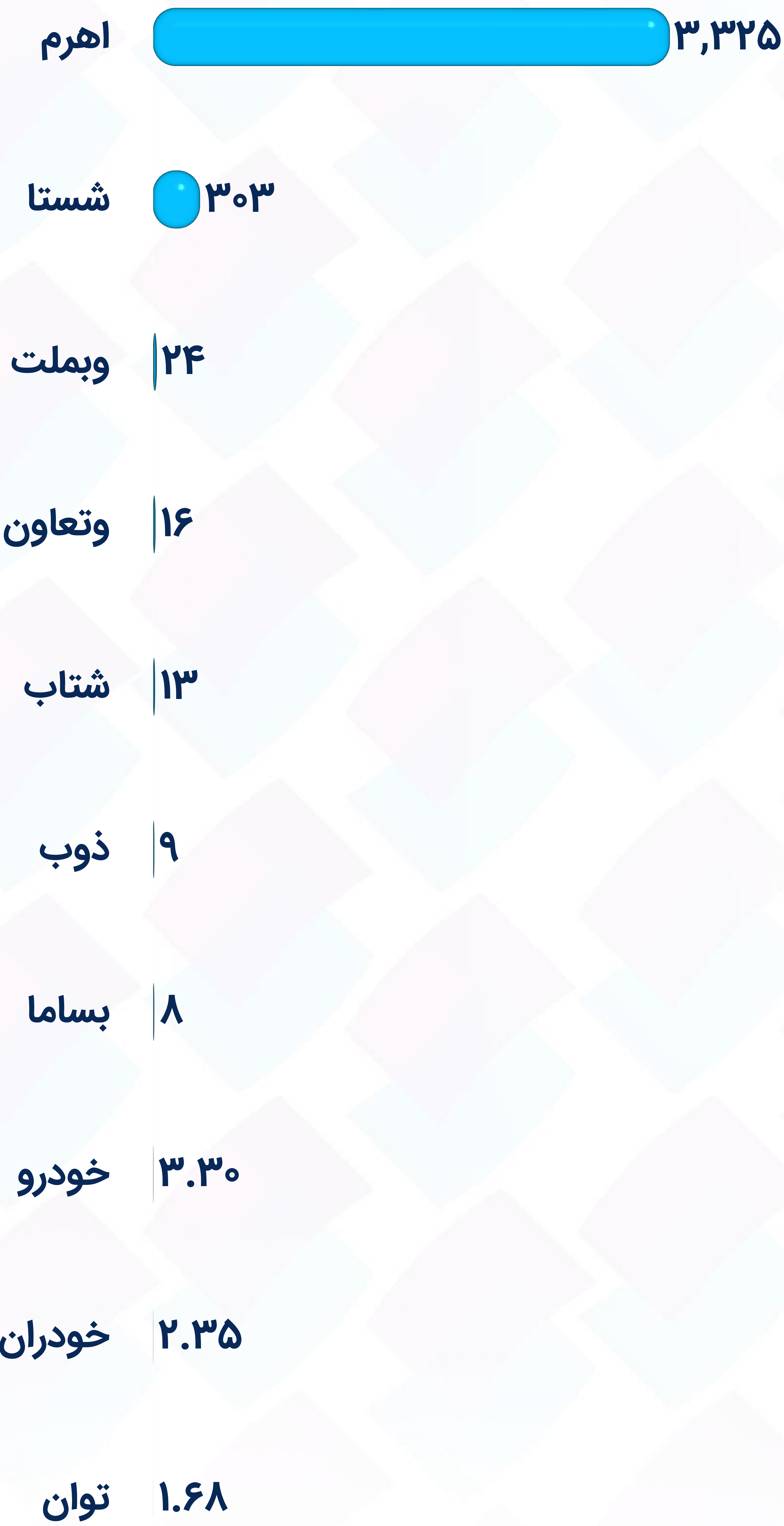
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

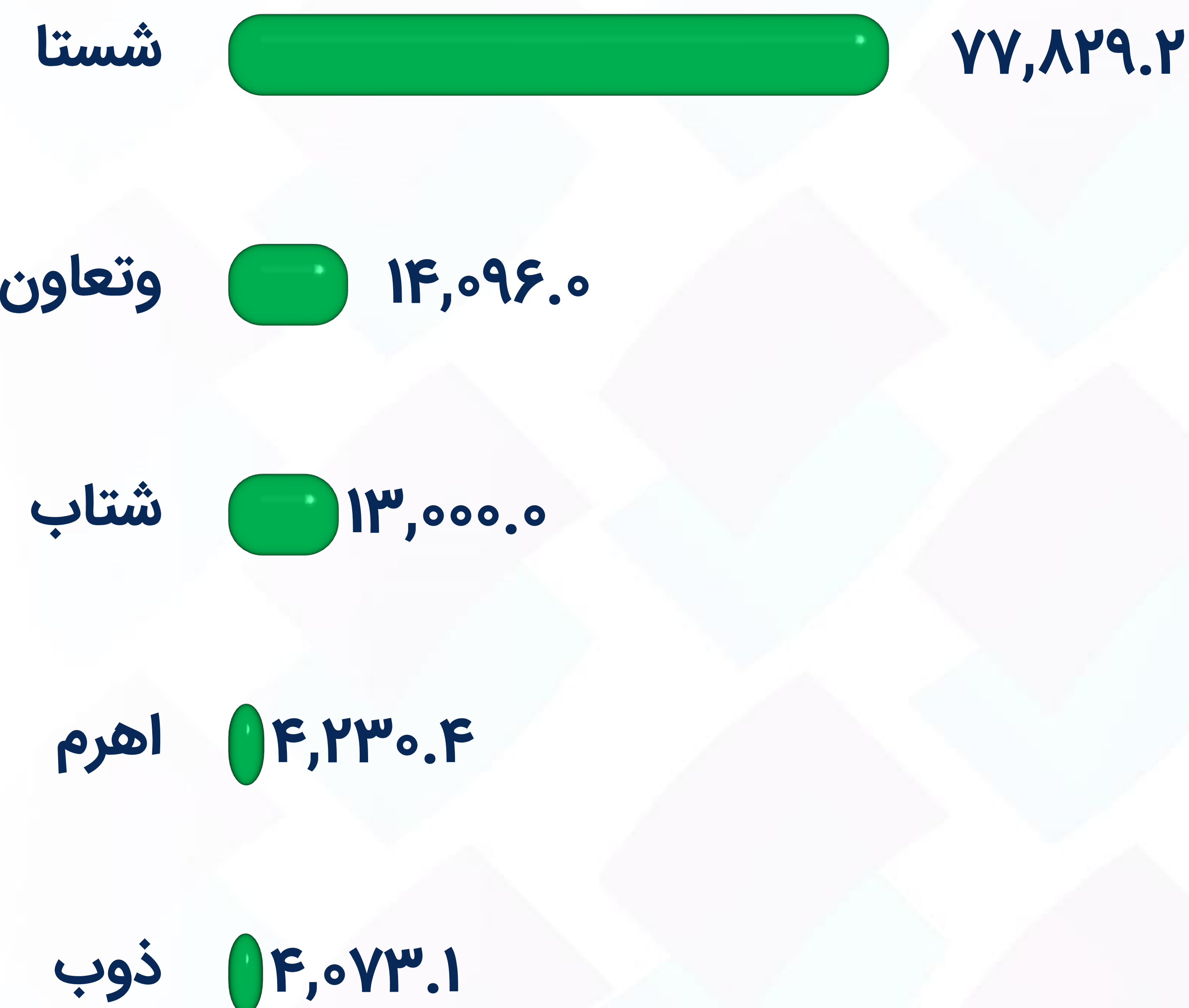
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین 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	۴	۱۱.۹	۶۳۵	۱۳,۰۴۸	۱۲,۶۳۵	(۳.۲%)	۱۹.۹	۱.۰۰	۱,۰۹۷	۷۳%
ضرویین ۱۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۴	۲۳۲.۱	۱,۴۰۳	۱۳,۰۴۸	۱۲,۴۰۳	(۴.۹%)	۸.۸	۱.۰۰	۲,۰۹۳	۴۹%
ضشنا ۲۰۴۹	شپنا	۳,۱۶۹	۲۱	۲.۷	۳۴۳	۳,۵۰۵	۳,۵۱۲	۰.۲%	۱۰.۲	۰.۹۳	۴۱۴	۲۱%
ضبساما ۲۱۵	بساما	۵,۴۱۳	۱۱	۱۴.۳	۲,۹۶۹	۸,۸۸۰	۸,۳۸۲	(۵.۶%)	۲.۸	۱.۰۰	۳,۵۲۶	۱۹%
ضپتروآبان ۳۰۳	پتروآبان	۱۴,۰۰۰	۵۴	۱.۷	۱,۵۱۳	۱۴,۹۹۲	۱۵,۵۱۳	۳.۵%	۱۰.۳	۰.۸۸	۱,۷۸۴	۱۸%

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	۲۸	۱.۶	۵	۴۸۰	۸۰۵	۶۸%	۱۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۴	۱۰.۹	۵	۱,۴۵۰	۱,۹۰۵	۳۱%	۳۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۸	۱۴.۳	۶	۴۸۰	۷۰۶	۴۷%	۱۱۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۴۸	۱۶.۴	۲۱	۱,۴۵۰	۲,۲۲۱	۵۳%	۱۰۵.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۱۴	۱۲.۸	۶	۱,۴۵۰	۱,۸۰۶	۲۵%	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	۶۱	۲۳۵.۰	۳۶	۱,۷۳۴	۱,۸۶۴	۷.۵%	۵۱.۸	-۰.۶۰	۱۱۶	۲۲۳.۳%
طوتعاون ۳۰۹	وتعاون	۱,۸۰۰	۶۱	۲۹.۸	۴۱	۱,۷۳۴	۱,۷۵۹	۱.۴%	۴۲.۹	-۰.۴۱	۶۴	۵۶.۸%
طهرم ۲۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۵	۴۰۲.۶	۷۸۴	۲۸,۵۳۰	۲۷,۲۱۶	(۴.۶%)	۳۴.۷	-۰.۳۰	۶۸۵	(۱۲.۶%)
طوتعاون ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۶۱	۳۰.۲	۴۰	۱,۷۳۴	۱,۶۶۰	(۴.۳%)	۴۱.۵	-۰.۲۴	۳۰	(۲۵.۴%)
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۵	۲۹.۷	۲,۲۶۴	۲۸,۵۳۰	۲۷,۷۳۶	(۲.۸%)	۱۲.۳	-۰.۵۳	۱,۵۶۸	(۳۰.۷%)

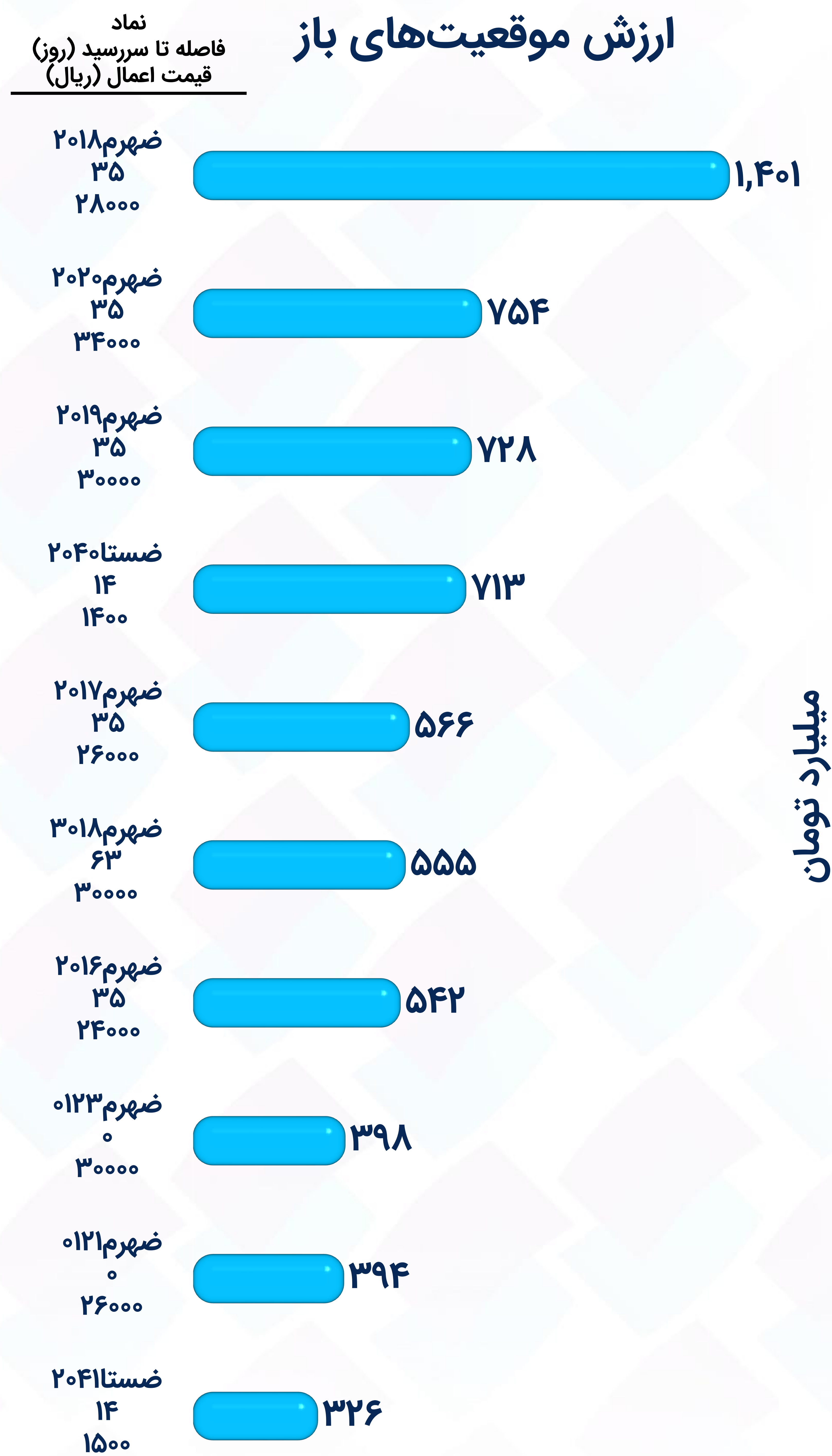
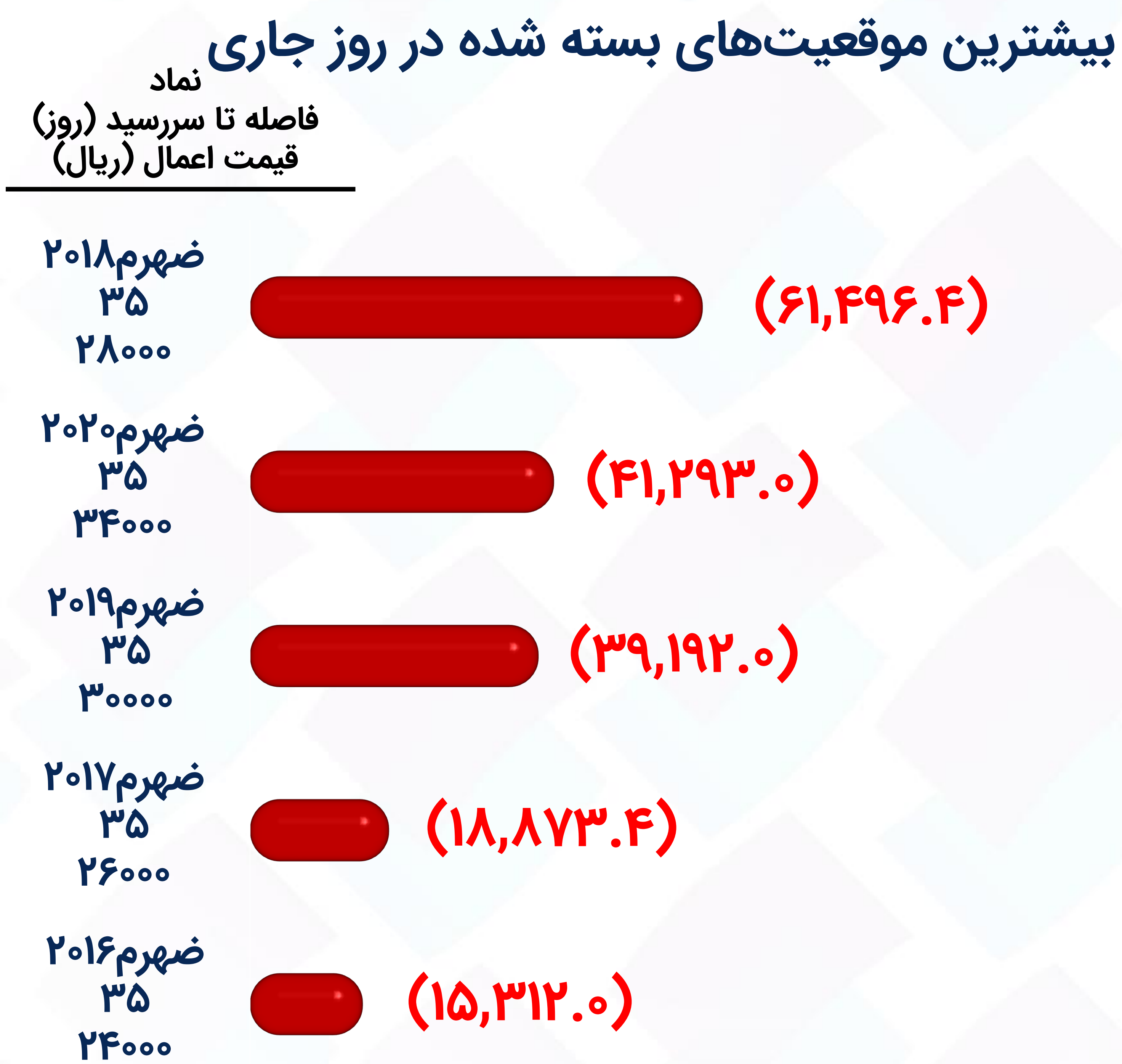
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طفلا ۳۰۴۴	فولاد	۲,۸۸۰	۴۸	۰.۰	۴	۴,۱۳۱	۲,۸۷۶	(۳۰.۴%)	۷۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۵۶	۱.۷	۲۵	۲,۷۴۸	۱,۸۸۲	(۳۱.۵%)	۷۵.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۱۴	۲۰.۶	۲	۱,۴۵۰	۱,۱۹۸	(۱۷.۴%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۵	۵.۰	۴۸	۲۸,۵۳۰	۱۹,۹۵۲	(۳۰.۱%)	۴۱۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۳%)
طهرم ۴۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۹۱	۰.۱	۹۲۰	۲۸,۵۳۰	۱۹,۰۸۰	(۳۳.۱%)	۲۰.۷	-۰.۰۱	۱۰	(۹۸.۹%)

(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

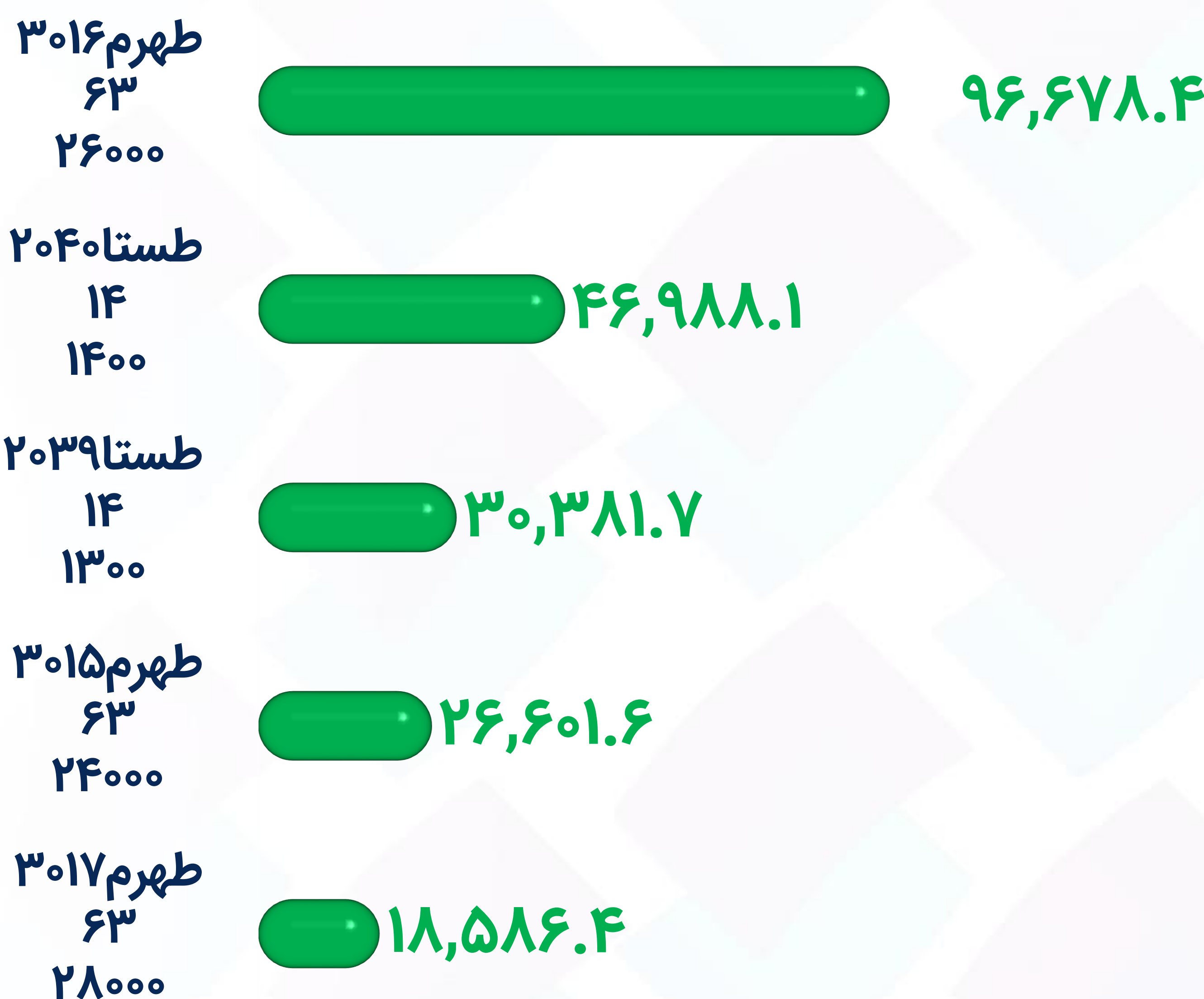
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

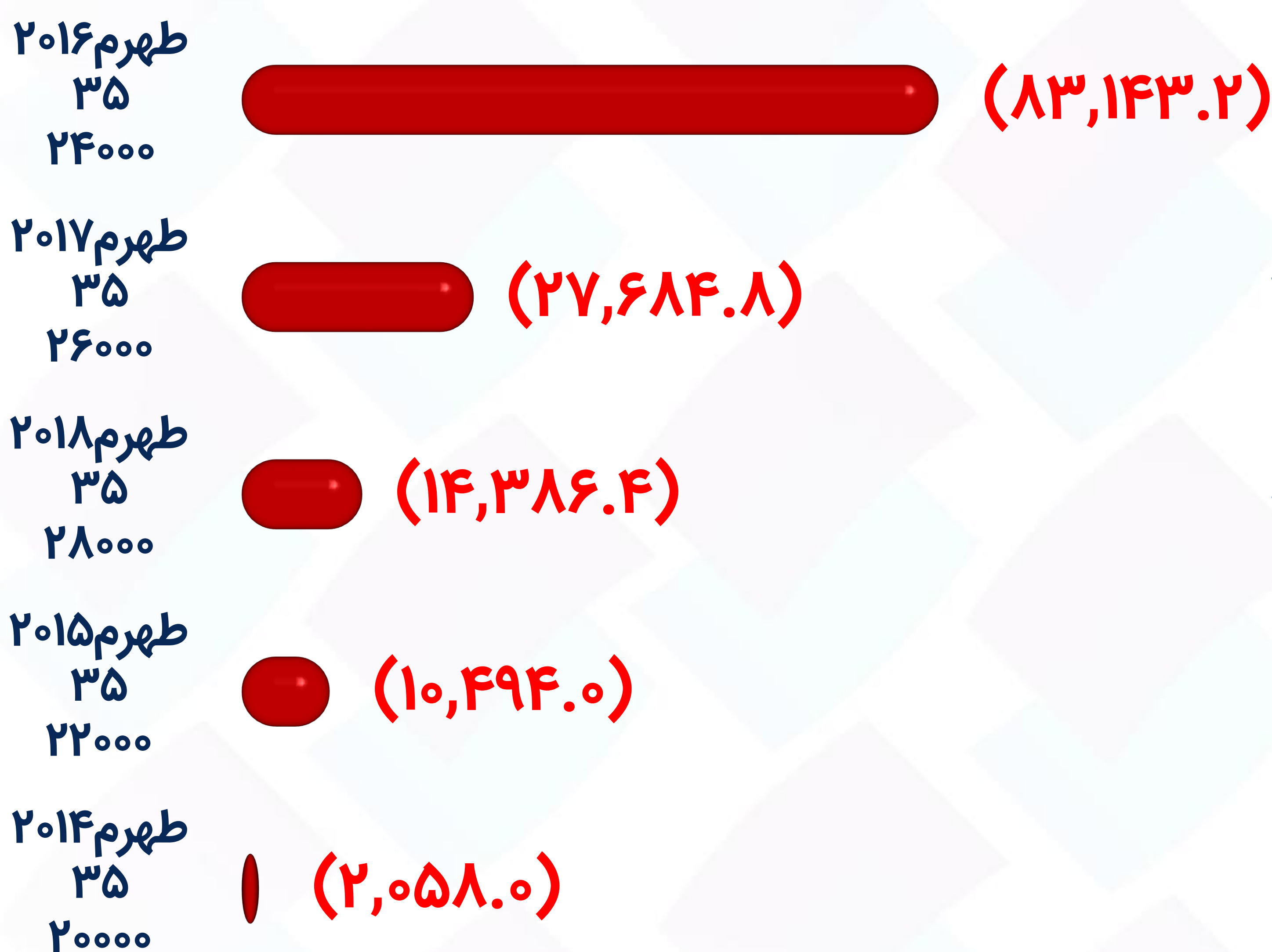
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



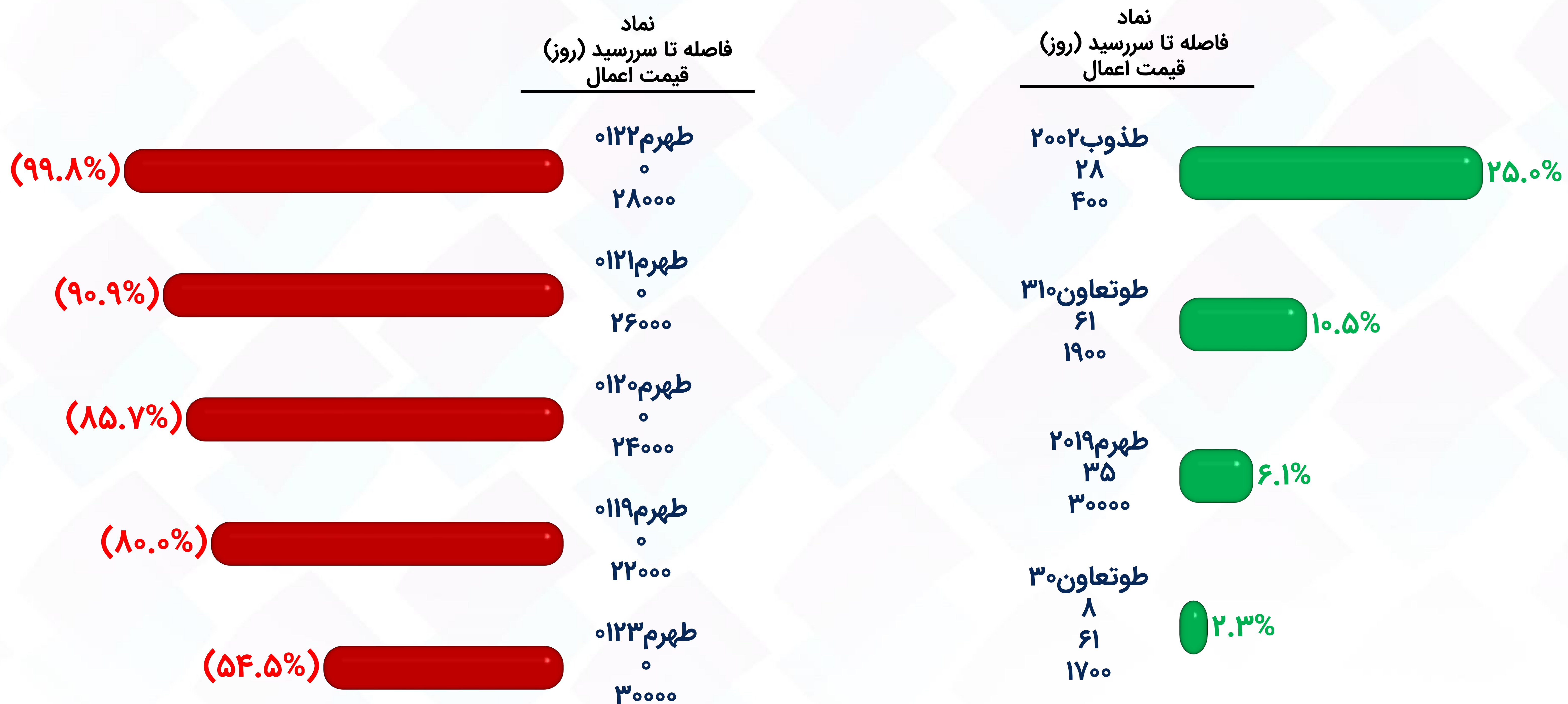
میلیون تومان

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.