

شماره
۴۵۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





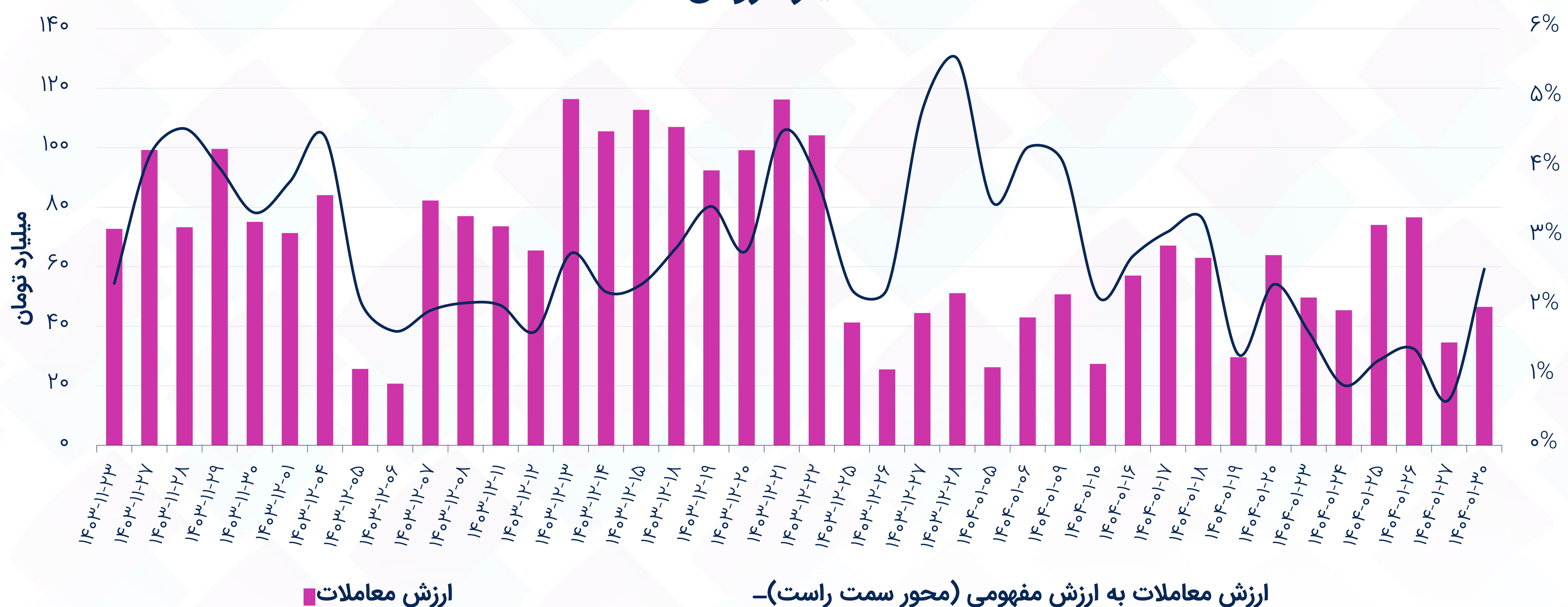
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



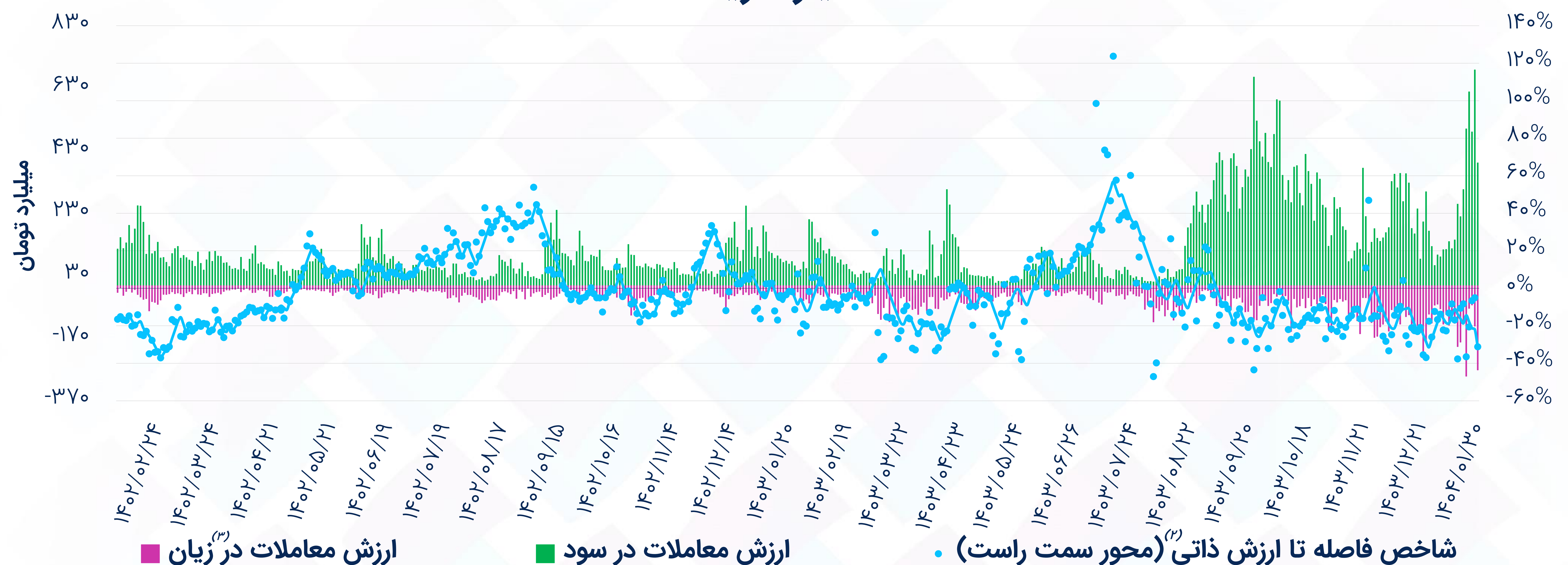
اختیار فروش



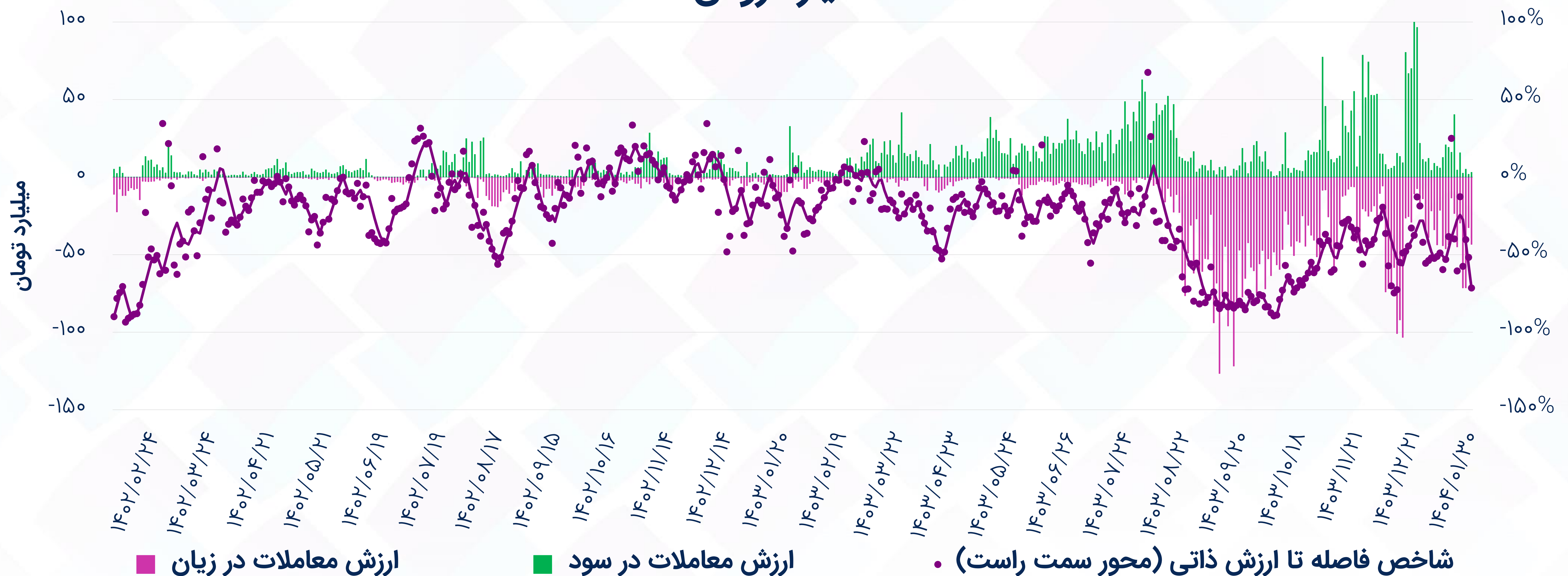
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

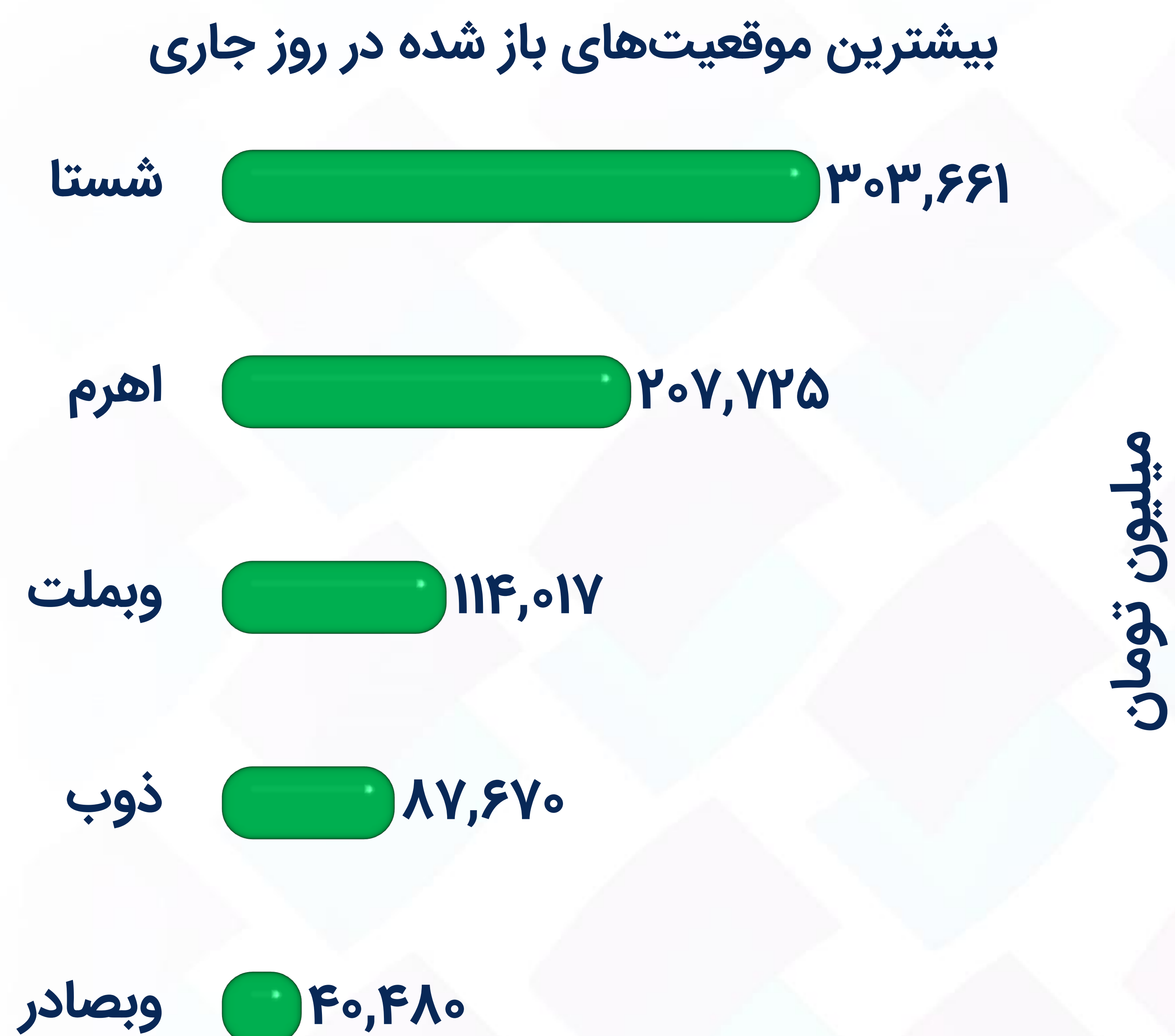
اختیار خرید

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	۴۳	۳۷۰.۵	۲,۳۰۸.۱	۱۶۴.۹	۲۰۵.۶	(۳۷.۱%)
شستا	۴۸	۱۱۸.۳	۱,۴۱۵.۳	۸۶.۲	۳۲.۱	(۳۲.۲%)
وبملت	۱۴	۶۱.۳	۳۸۷.۰	۵۰.۵	۱۰.۸	(۲.۲%)
ذوب	۲۴	۴۴.۱	۲۷۶.۱	۳۱.۰	۱۳.۱	(۲۶.۶%)
وبصادر	۱۵	۲۴.۹	۶۹.۹	۲۰.۹	۴.۰	(۴۸.۳%)
وتجارت	۲۰	۱۹.۰	۹۳.۹	۱۷.۰	۲.۰	(۲۶.۴%)
خگستر	۹	۶.۸	۵۷.۷	۶.۷	۰.۱	(۰.۵%)

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	۳۸,۱۰۶.۹	۱,۲۴۸,۷۹۸.۲	۱,۰۸۵.۴	۳۷,۰۲۱.۵	(۶۹.۶%)
شستا	۶	۸,۱۷۶.۵	۵۶۶,۴۴۱.۴	۱,۹۸۴.۱	۶,۱۹۲.۳	(۸۰.۱%)
ذوب	۳	۹۳.۹	۱۱,۰۲۰.۲	۵.۰	۸۸.۹	(۹۴.۸%)
وبملت	۴	۹۱.۸	۵,۵۷۷.۰	۰.۰	۹۱.۸	(۷۲.۹%)
وتعاون	۳	۲۳.۹	۴۰۹.۶	۲۳.۲	۰.۶	(۶.۵%)
وبصادر	۱	۵.۱	۳۴۸.۸	۰.۰	۵.۱	(۹۶.۶%)
اطلس	۱	۳.۰	۶۴.۱	۳.۰	۰.۰	(۵۰.۷%)

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 ۲,۹۲۴

شستا ۵۳۴

ذوب ۱۶

وتعاون ۱۶

شتاب ۱۳

وبملت ۱۰

بساما ۸

خودرو ۳.۳۰

توان ۱.۶۸

فملی ۱.۶۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۴۶۱,۸۹۵.۸

شستا ۲۳۱,۶۳۷.۴

ذوب ۷,۷۲۴.۰

وبملت ۲,۵۵۵.۱

وبصادر ۲۷۵.۳

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

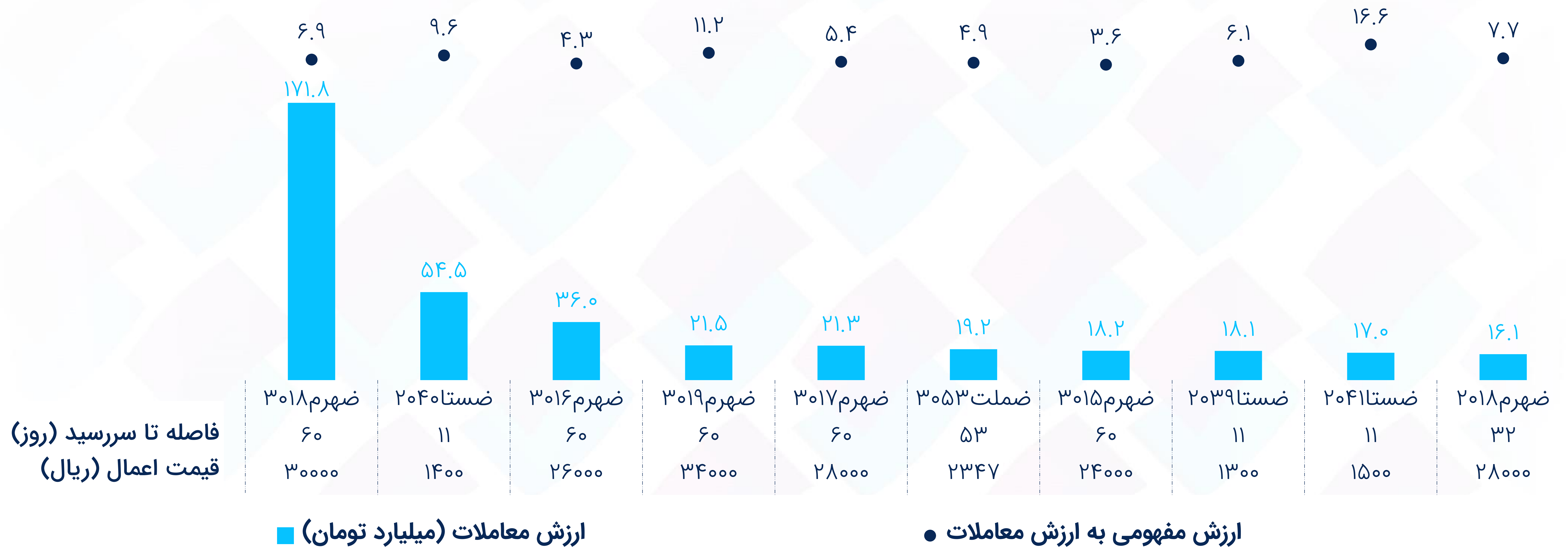
خودران (۱.۹)

فزر (۱.۴)

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
ضیاداد ۴۰۳۱	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۷۱	۲۶.۴	۲۶,۳۸۱	۲۲۸,۴۲۸	۲۰۶,۳۸۱	(۹.۷%)	۷.۸	۱.۰۰	۶۰,۲۴۵	۱۲۸%
ضهرم ۶۰۳۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۵۱	۴.۳	۲,۱۲۵	۲۹,۳۶۰	۳۲,۱۲۵	۹.۴%	۱۵.۱	۰.۷۴	۴,۴۷۰	۱۱۰%
ضیاداد ۴۰۲۱	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۷۱	۱,۶۴۰.۱	۳۷,۸۹۱	۲۲۸,۴۲۸	۲۰۷,۸۹۱	(۹.۰%)	۵.۵	۱.۰۰	۶۹,۵۸۷	۸۴%
ضفرز ۴۰۲	فزر	۳۹,۳۰۰	۷۱	۲۲.۲	۵,۸۳۳	۴۴,۷۰۰	۴۵,۱۳۳	۱.۰%	۷.۷	۰.۹۴	۸,۱۲۸	۳۹%
ضفرز ۲۰۵	فزر	۳۳,۳۰۰	۱۵	۲۶۱.۷	۹,۰۸۸	۴۴,۷۰۰	۴۲,۳۸۸	(۵.۲%)	۴.۷	۱.۰۰	۱۱,۹۴۹	۳۱%

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
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۵	۱۲.۱	۴	۴۹۴	۸۰۴	۶۳%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۱	۸۸.۹	۵	۱,۴۹۳	۱,۹۰۵	۲۸%	۳۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۵۳	۱۴.۱	۲۴	۶۱۹	۱,۰۲۴	۶۵%	۴۲.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۵	۲۶.۸	۷	۴۹۴	۷۰۷	۴۳%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۴۵	۹۱.۱	۲۴	۱,۴۹۳	۲,۲۲۴	۴۹%	۹۲.۷	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	۵۸	۲۱.۴	۱۰۹	۱,۷۵۱	۱,۷۹۱	۲.۳%	۱۶.۴	-۰.۵۷	۱۰۶	(۳.۱%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۲	۵.۰	۵,۰۰۰	۲۹,۳۶۰	۲۹,۰۰۰	(۱.۲%)	۵.۸	-۰.۸۳	۳,۷۷۶	(۲۴.۵%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۶۰	۱۷.۰	۴,۷۲۶	۲۹,۳۶۰	۲۹,۲۷۴	(۰.۳%)	۶.۲	-۰.۷۰	۳,۴۶۵	(۲۶.۷%)
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۲	۲۳.۸	۱,۷۲۳	۲۹,۳۶۰	۲۸,۲۷۷	(۳.۷%)	۱۶.۴	-۰.۴۳	۱,۱۲۹	(۳۴.۵%)
طوتعاون ۳۰۹	وتعاون	۱,۸۰۰	۵۸	۱.۸	۹۰	۱,۷۵۱	۱,۷۱۰	(۲.۳%)	۱۹.۰	-۰.۳۸	۵۶	(۳۷.۴%)

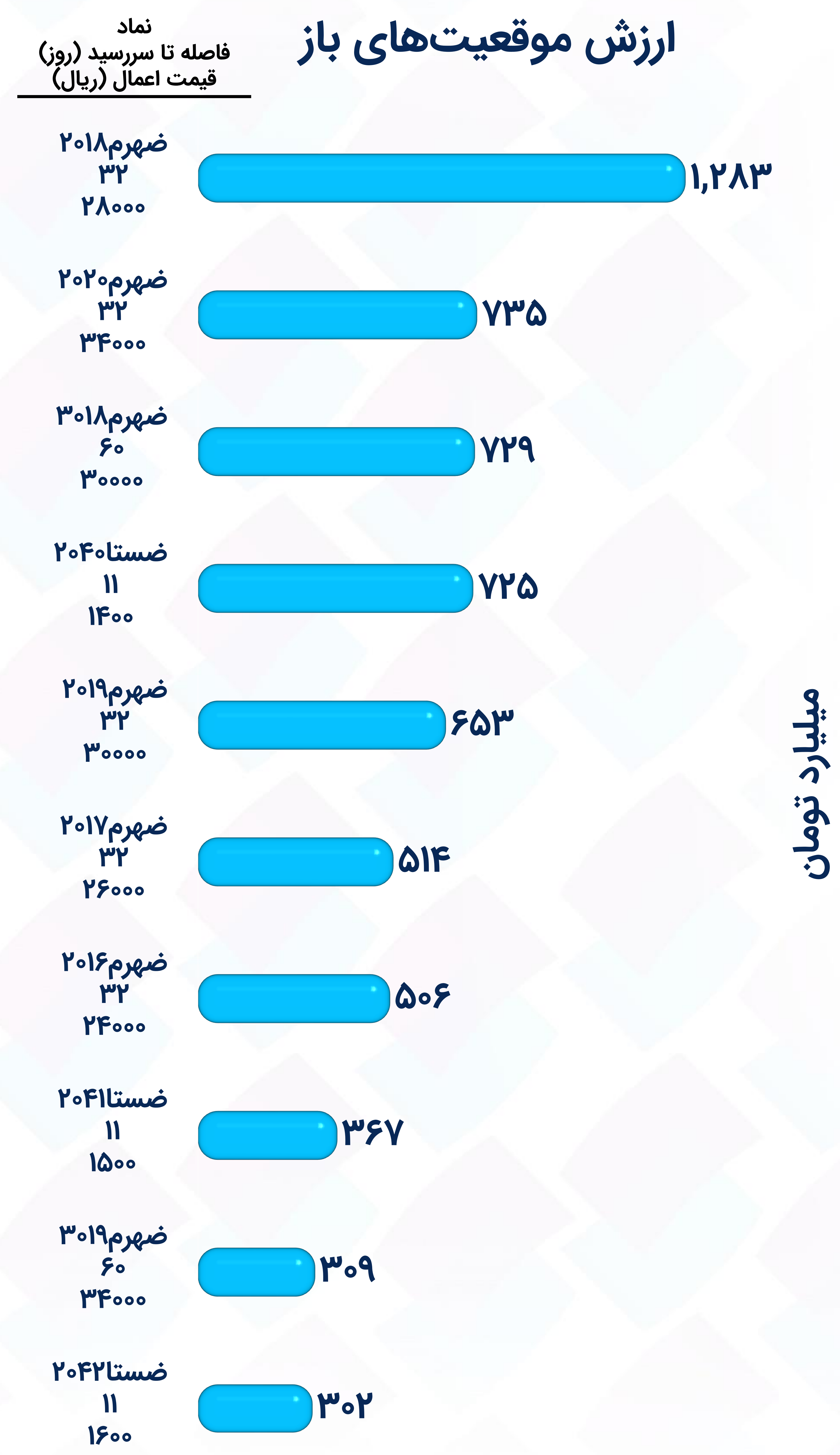
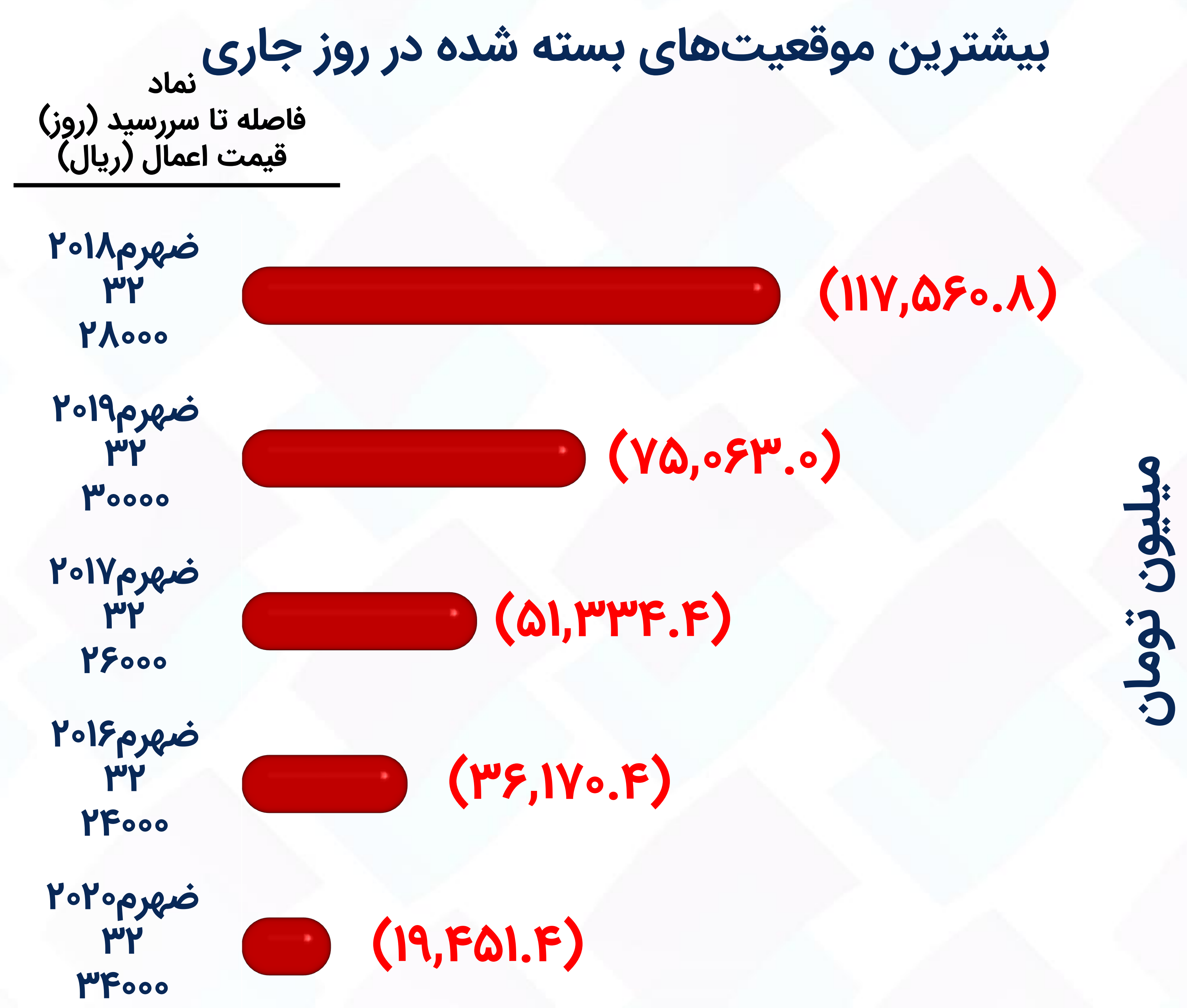
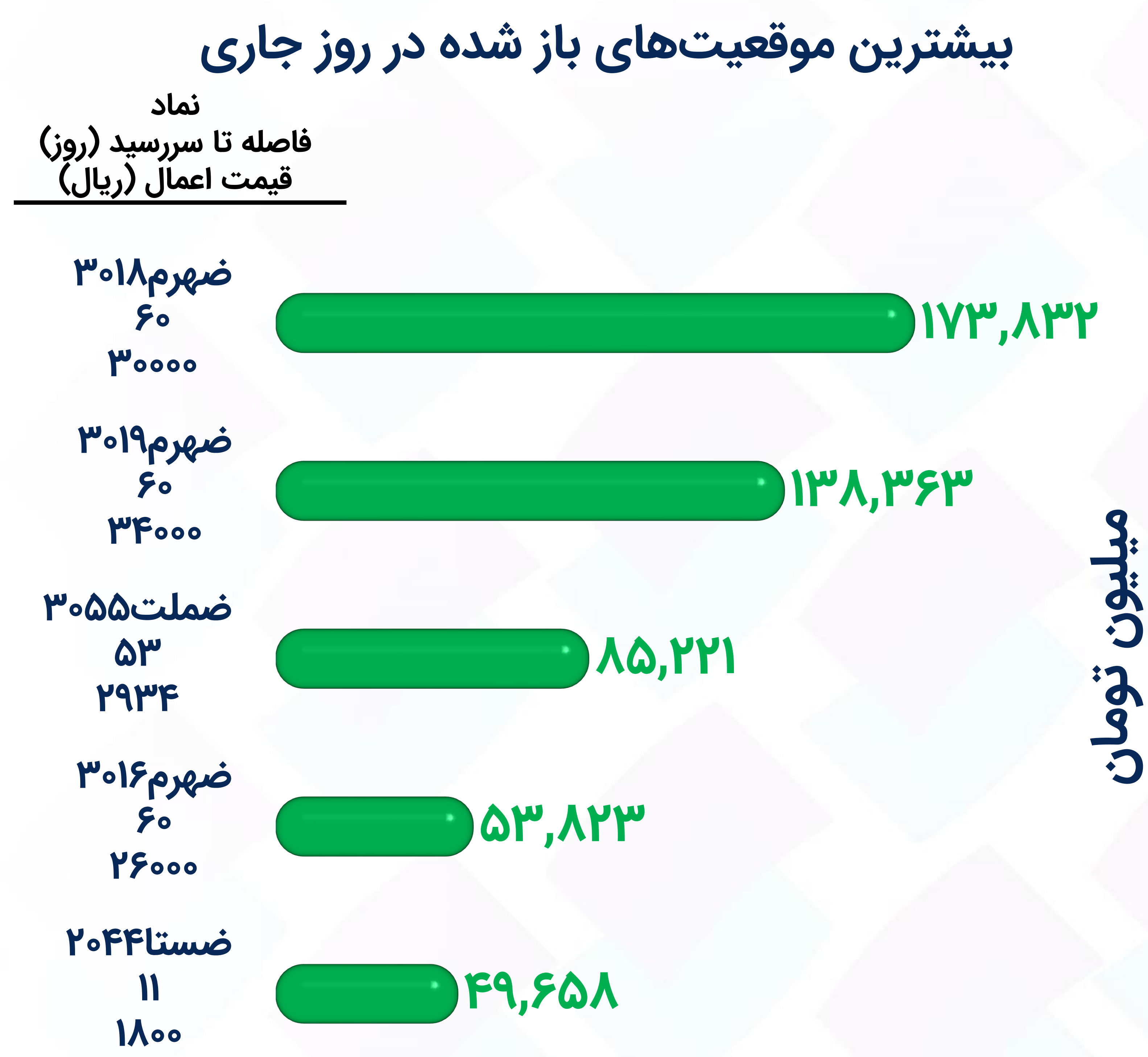
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طران ۳۰۰۴	خودران	۸,۰۰۰	۶۰	۰.۰	۴۳۰	۱۲,۳۲۰	۷,۵۷۰	(۳۸.۶%)	۱۷.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۱۱	۱۲.۱	۲	۱,۴۹۳	۱,۱۹۸	(۱۹.۸%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۵۳	۸.۷	۱۸	۲,۸۲۷	۱,۸۸۹	(۳۳.۲%)	۱۰۴.۹	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طذوب ۴۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۸۸	۰.۵	۱,۰۰۰	۴۹۴	-۶۰۰	(۲۲۱.۵%)	-۰.۶	-۰.۰۳	۱	(۹۹.۹%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۲	۲.۴	۵۷	۲۹,۳۶۰	۱۹,۹۴۳	(۳۲.۱%)	۳۴۹.۹	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)

(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

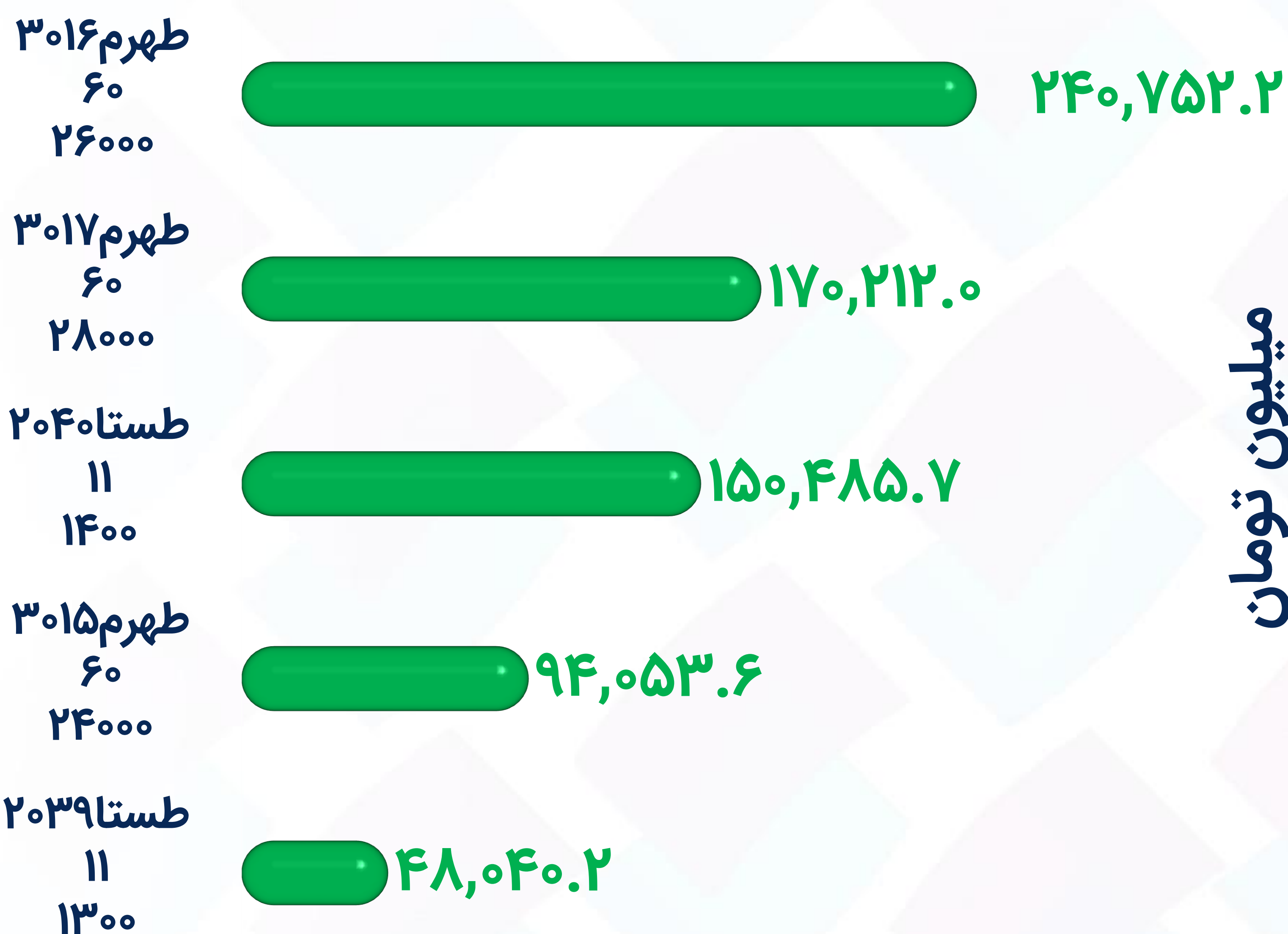
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

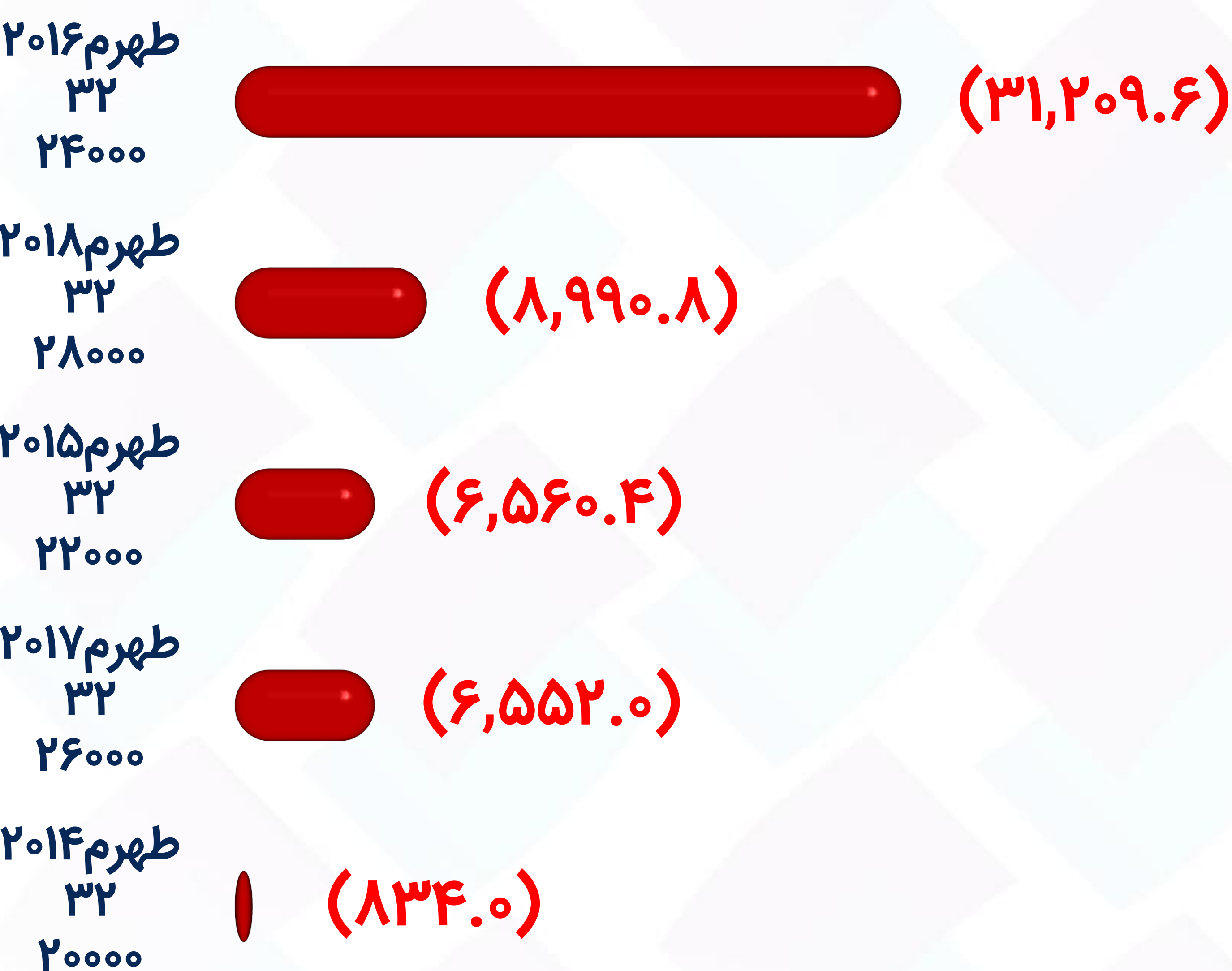
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

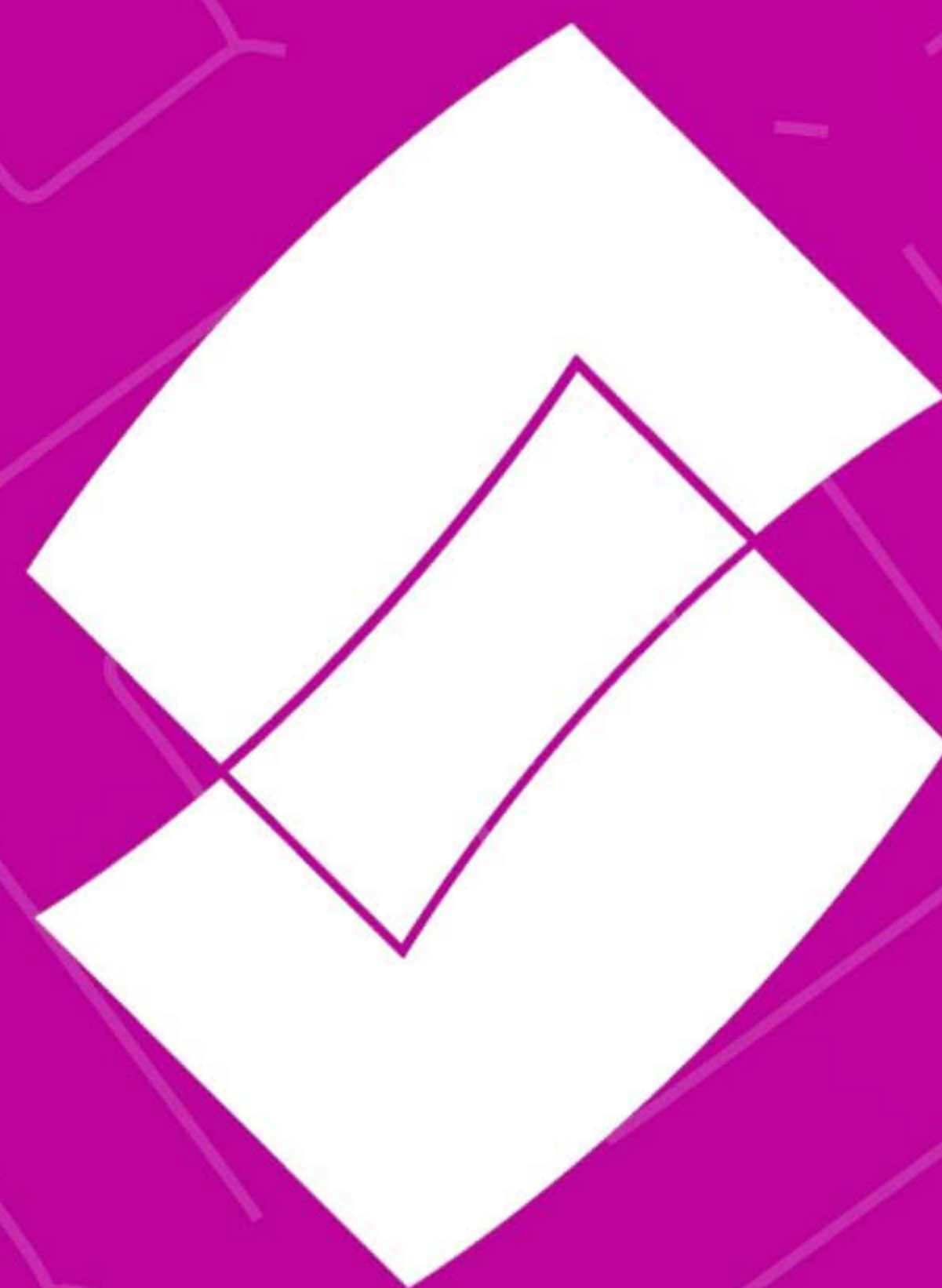
اختیار خرید



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.