

شماره
۴۶۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۱ فروردین ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





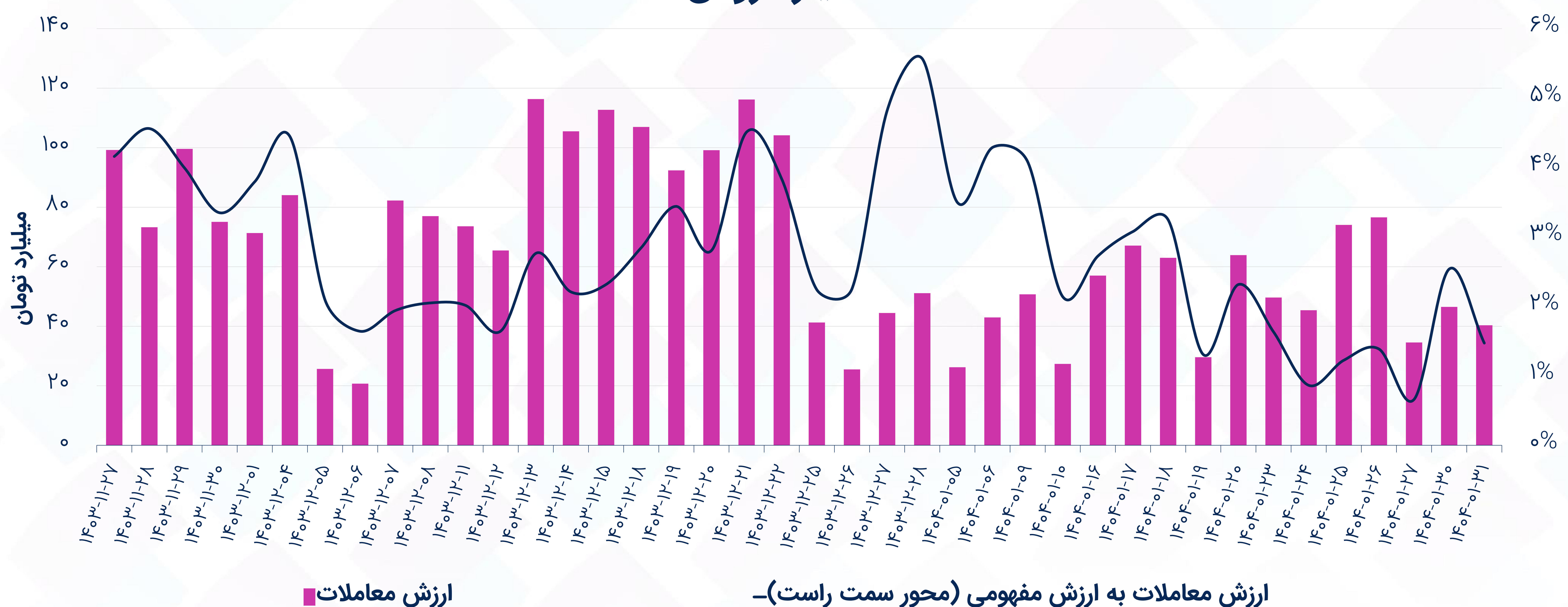
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



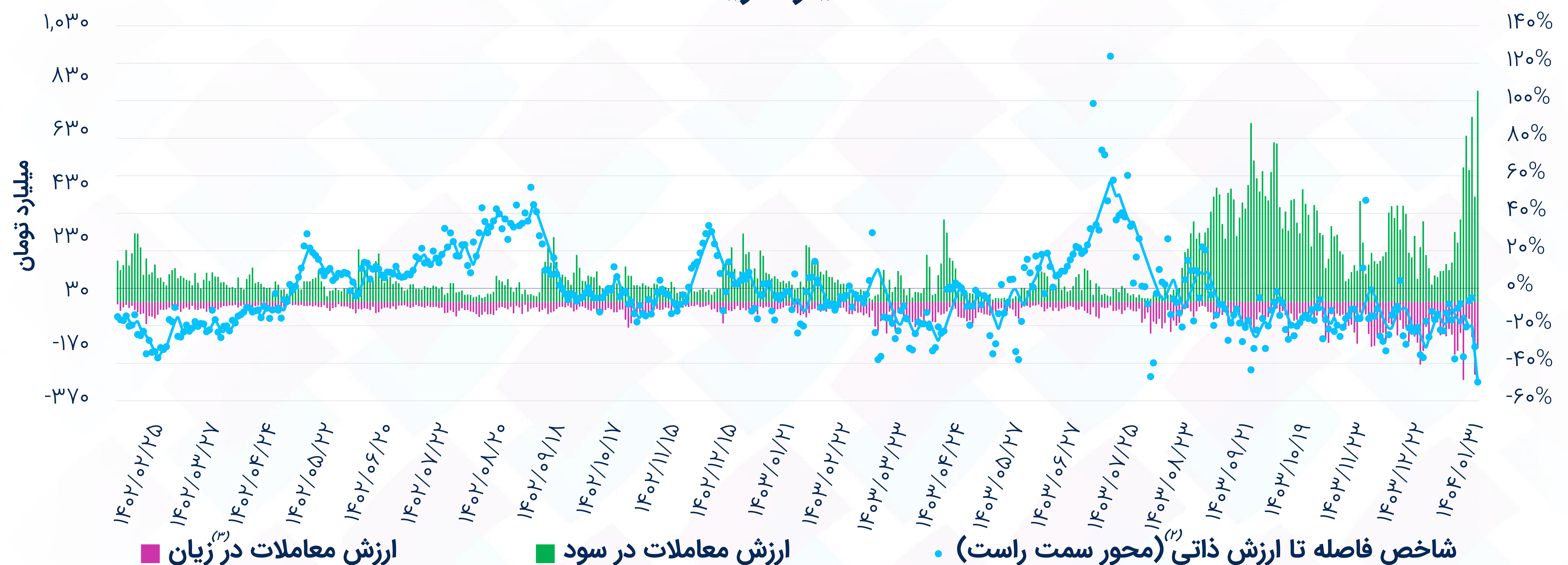
اختیار فروش



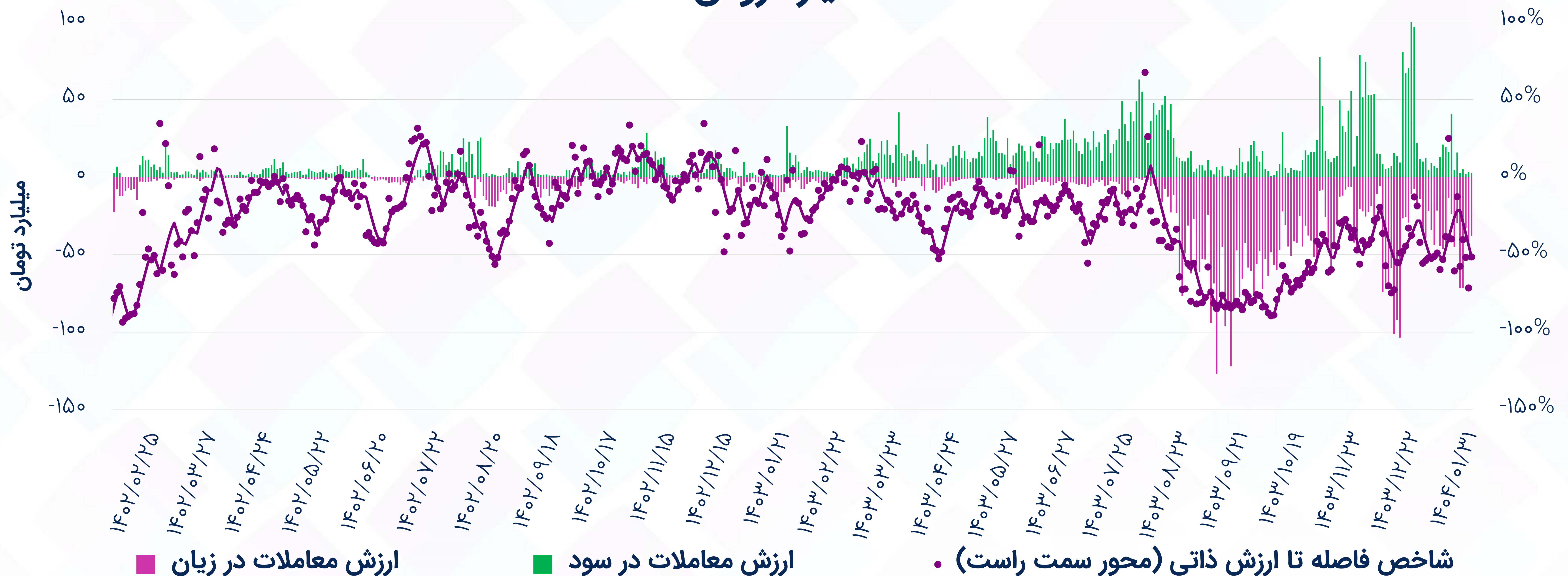
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

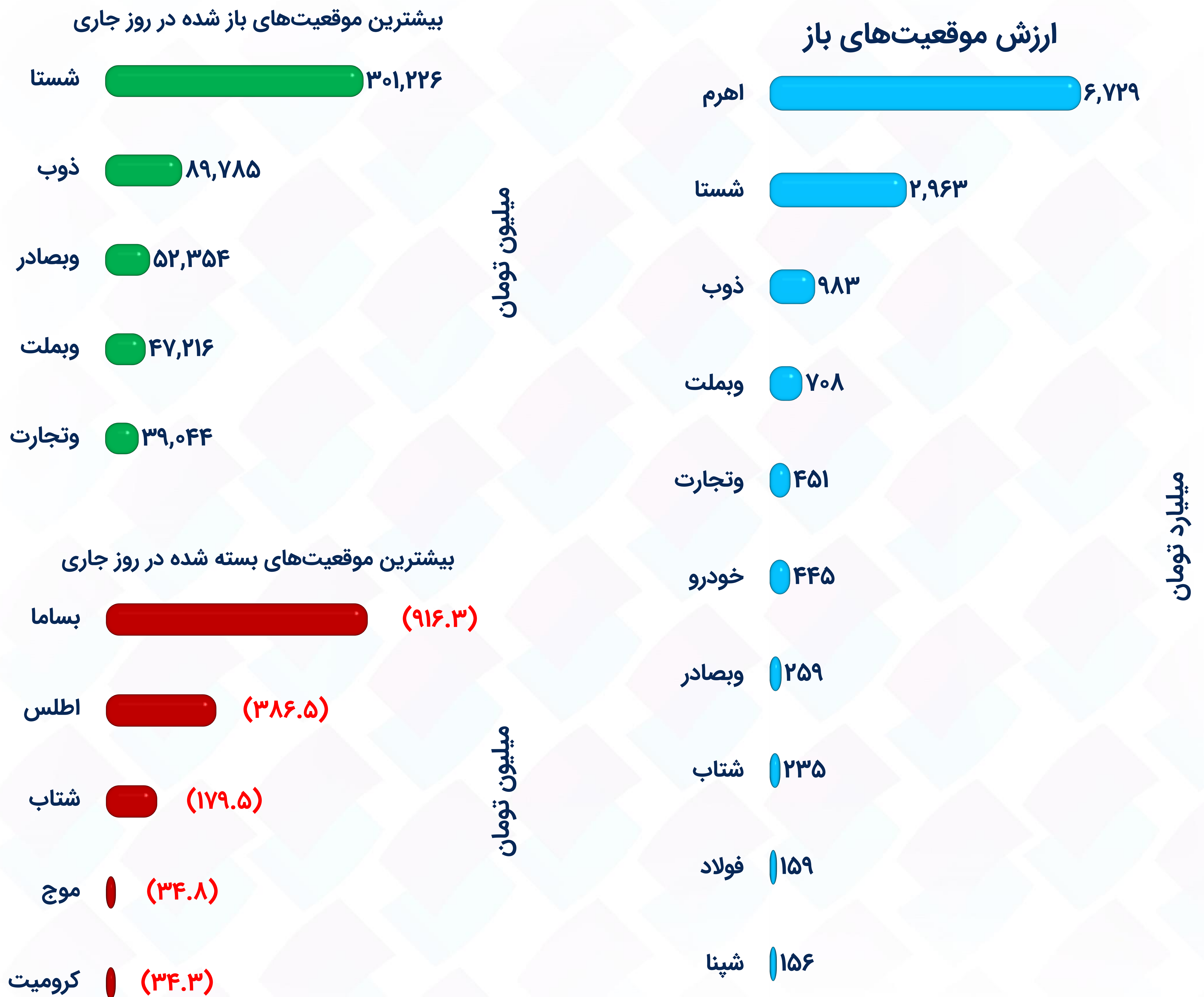
اختیار خرید

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	۴۹	۵۵۲.۰	۲,۴۸۳.۷	۴۴۵.۴	۱۰۶.۶	(۵۵.۵%)
شستا	۶۰	۱۷۶.۰	۱,۶۵۸.۱	۱۴۰.۱	۳۵.۹	(۵۰.۶%)
ذوب	۲۷	۷۳.۱	۳۶۲.۹	۶۶.۴	۶.۶	(۳۸.۶%)
وبملت	۲۱	۵۸.۴	۲۶۶.۴	۴۸.۹	۹.۵	(۱۹.۵%)
وبصادر	۱۷	۴۵.۲	۹۸.۸	۳۶.۷	۸.۵	(۵۵.۷%)
وتجارت	۲۱	۳۴.۱	۱۳۵.۰	۲۸.۷	۵.۴	(۴۵.۳%)
خگستر	۱۳	۴.۰	۲۸.۷	۳.۸	۰.۲	(۳۰.۴%)

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	۱۵	۳۴,۵۹۵.۰	۲,۰۰۱,۶۶۹.۲	۱,۳۷۸.۰	۳۳,۲۱۷.۰	(۵۲.۴%)
شستا	۹	۵,۴۷۰.۵	۷۱۸,۲۵۲.۸	۱,۲۹۵.۲	۴,۱۷۵.۳	(۴۵.۴%)
ذوب	۳	۱۳۲.۳	۱۰,۷۰۹.۱	۰.۰	۱۳۲.۳	(۵۹.۸%)
وبملت	۴	۶۵.۴	۵,۲۱۴.۷	۰.۵	۶۴.۹	(۷۳.۸%)
وبصادر	۳	۳۳.۱	۲,۰۴۹.۱	۰.۰	۳۳.۱	(۹۸.۴%)
وتعاون	۲	۲۲.۴	۸۳۲.۱	۱۷.۳	۵.۱	(۹.۳%)
فزر	۲	۱۲.۳	۸۸۱.۹	۲.۳	۱۰.۰	(۸۴.۹%)

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 ۳,۱۵۳

شستا ۶۱۰

ذوب ۲۱

وتعاون ۱۶

شتاب ۱۳

وبملت ۱۲

بساما ۸

خودرو ۳.۳۰

وبصادر ۲.۱۶

خودران ۲.۰۷

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۲۸,۹۷۴.۰

شستا ۷۵,۹۶۵.۳

ذوب ۴,۵۱۳.۸

وبملت ۲,۰۴۳.۵

وبصادر ۱,۶۷۶.۳

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اطلس (۹۷.۵)

میلیون تومان

وتجارت (۱.۲)

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
ضفر ۲۰۷	فزر	۳۷,۳۰۰	۱۴	۲.۸	۴,۰۰۰	۴۳,۴۰۰	۴۱,۳۰۰	(۴.۸%)	۱۰.۳	۱.۰۰	۶,۶۶۶	۶۷%
ضیاد ۴۰۲	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۷۰	۷۷۲.۳	۵۲,۱۴۷	۲۳۵,۲۵۷	۲۲۲,۱۴۷	(۵.۶%)	۴.۳	۱.۰۰	۷۶,۱۸۸	۴۶%
ضیاد ۴۰۳	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۷۰	۱۳۴.۳	۴۶,۷۳۰	۲۳۵,۲۵۷	۲۲۶,۷۳۰	(۳.۶%)	۴.۹	۱.۰۰	۶۶,۸۳۲	۴۳%
ضبساما ۲۲۱	بساما	۷,۹۱۱	۷	۳.۲	۸۸۷	۸,۹۴۰	۸,۷۹۸	(۱.۶%)	۹.۹	۱.۰۰	۱,۰۹۴	۲۳%
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۷	۵۲.۴	۱,۲۲۴	۸,۹۴۰	۸,۷۱۹	(۲.۵%)	۷.۱	۱.۰۰	۱,۵۰۷	۲۳%

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 ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۵۲	۹.۲	۱۸	۵۰۸	۱,۰۱۸	۱۰۰%	۵۶.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۴	۶۴.۹	۷	۵۰۸	۸۰۷	۵۹%	۱۱۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۵۲	۲۹۹.۰	۷۰	۶۳۷	۱,۰۷۰	۶۸%	۱۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۱۰	۲۴۰.۳	۷	۱,۵۳۷	۱,۹۰۷	۲۴%	۲۷۲.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۲۴	۱۴۲.۲	۱۰	۵۰۸	۷۱۰	۴۰%	۷۱.۰	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
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۹	۱۰۴.۱	۸,۳۹۲	۳۰,۲۴۰	۳۳,۶۰۸	۱۱.۱%	۴.۰	-۰.۹۶	۹,۵۰۰	۱۳.۲%
طستا ۲۰۴۲	شستا	۱,۶۰۰	۱۰	۱,۲۹۵.۰	۵۷	۱,۵۳۷	۱,۵۴۳	۰.۴%	۲۷.۱	-۰.۶۹	۶۰	۴.۶%
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۵۹	۱,۲۶۷.۵	۳,۰۵۴	۳۰,۲۴۰	۳۰,۹۴۶	۲.۳%	۱۰.۱	-۰.۶۴	۲,۸۹۲	(۵.۳%)
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۵۷	۱۷.۳	۸۴	۱,۸۰۲	۱,۸۱۶	۰.۸%	۲۱.۶	-۰.۴۷	۷۹	(۵.۶%)
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۵۹	۶.۵	۶,۴۵۰	۳۰,۲۴۰	۳۱,۵۵۰	۴.۳%	۴.۹	-۰.۸۷	۵,۹۳۶	(۸.۰%)

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
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۱۰	۱۳.۱	۱	۱,۵۳۷	۱,۱۹۹	(۲۲.۰%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۵۲	۰.۰	۱	۶۳۷	۳۹۹	(۳۷.۴%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طفرز ۲۰۶۶	فز	۳۵,۳۰۰	۱۴	۱۰.۰	۵۰۰	۴۳,۴۰۰	۳۴,۸۰۰	(۱۹.۸%)	۶۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۵۲	۴.۳	۱۴	۲,۹۱۱	۱,۸۹۳	(۳۵.۰%)	۱۳۵.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۱	۸.۴	۴۰	۳۰,۲۴۰	۱۹,۹۶۰	(۳۴.۰%)	۴۹۹.۰	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)

ضهرم ۲۰۱۸
۳۱
۲۸۰۰۰ ۱,۱۱۴

ضهرم ۳۰۱۸
۵۹
۳۰۰۰۰ ۸۴۲

ضستا ۲۰۴۰
۱۰
۱۴۰۰ ۶۵۳

ضهرم ۲۰۲۰
۳۱
۳۴۰۰۰ ۶۳۹

ضهرم ۲۰۱۹
۳۱
۳۰۰۰۰ ۵۵۹

ضهرم ۳۰۱۹
۵۹
۳۴۰۰۰ ۵۰۲

ضهرم ۲۰۱۶
۳۱
۲۴۰۰۰ ۴۶۳

ضهرم ۲۰۱۷
۳۱
۲۶۰۰۰ ۴۳۷

ضستا ۲۰۴۱
۱۰
۱۵۰۰ ۴۰۸

ضستا ۲۰۴۲
۱۰
۱۶۰۰ ۳۴۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۳۰۱۹
۵۹
۳۴۰۰۰ ۱۹۳,۲۴۶

ضهرم ۳۰۲۰
۵۹
۳۸۰۰۰ ۱۳۳,۲۵۵

ضستا ۲۰۴۴
۱۰
۱۸۰۰ ۱۲۹,۱۹۸

ضهرم ۳۰۱۸
۵۹
۳۰۰۰۰ ۱۱۳,۰۴۹

ضهرم ۳۰۲۱
۵۹
۴۲۰۰۰ ۵۴,۰۶۲

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضهرم ۲۰۱۸
۳۱
۲۸۰۰۰ (۱۶۹,۰۵۸.۴)

ضهرم ۲۰۲۰
۳۱
۳۴۰۰۰ (۹۵,۴۴۴.۸)

ضهرم ۲۰۱۹
۳۱
۳۰۰۰۰ (۹۳,۷۶۸.۰)

ضهرم ۲۰۱۷
۳۱
۲۶۰۰۰ (۷۷,۷۳۲.۲)

ضستا ۲۰۴۰
۱۰
۱۴۰۰ (۷۲,۰۵۶.۳)

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.