

شماره
۴۶۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





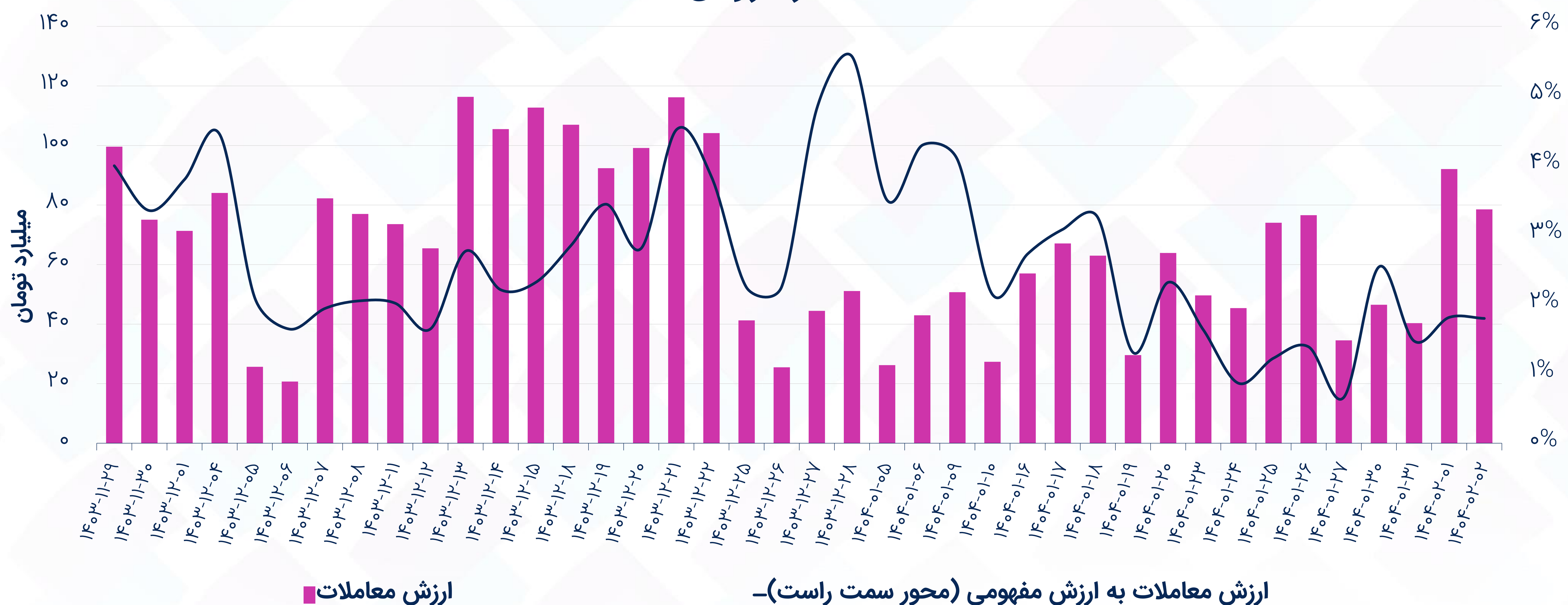
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



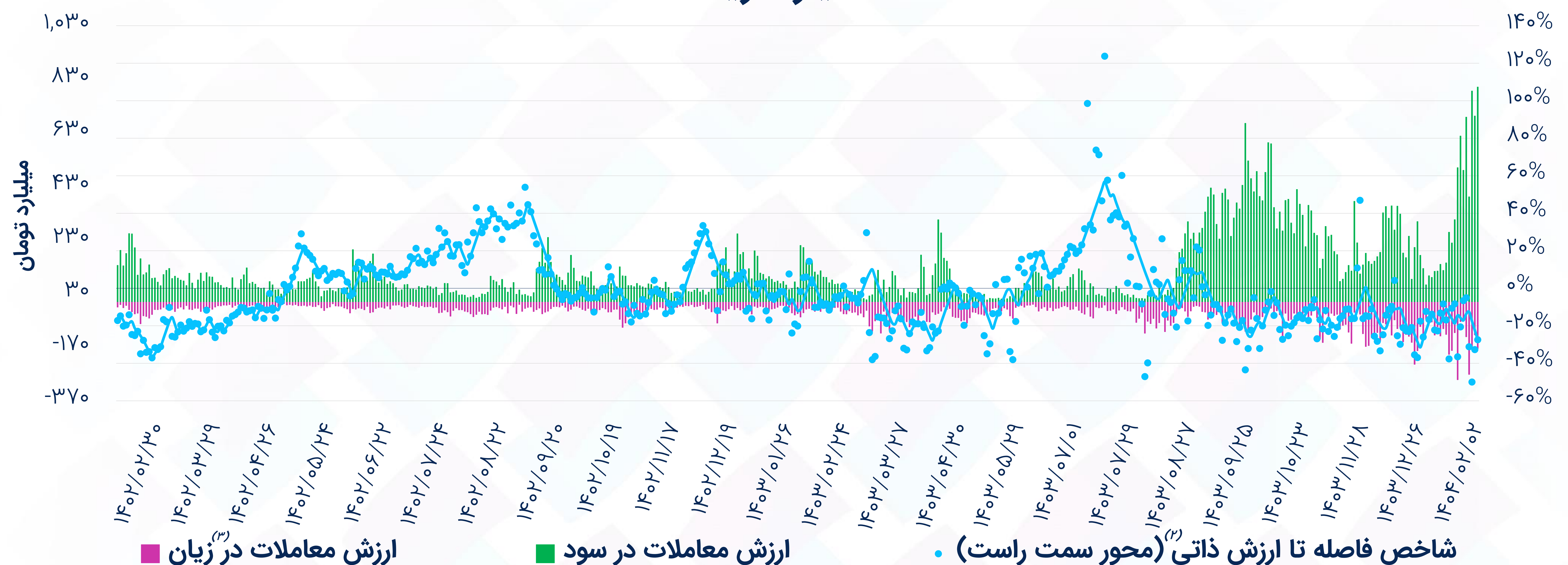
اختیار فروش



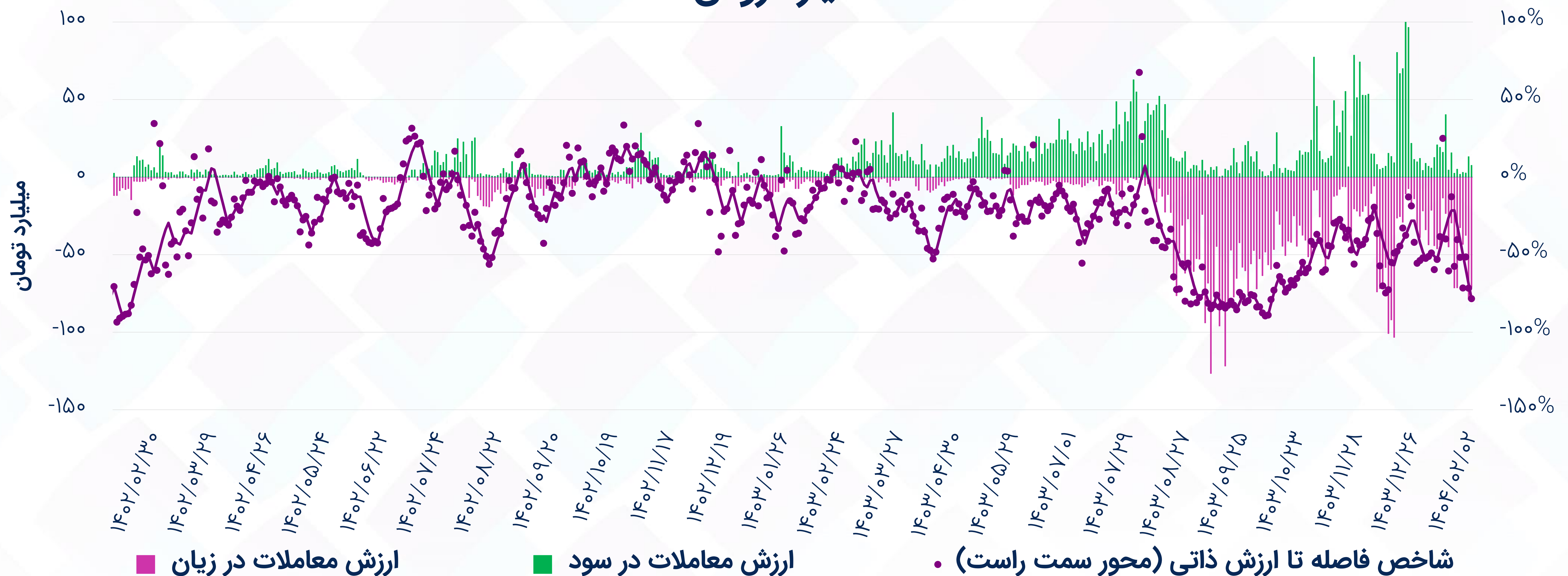
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

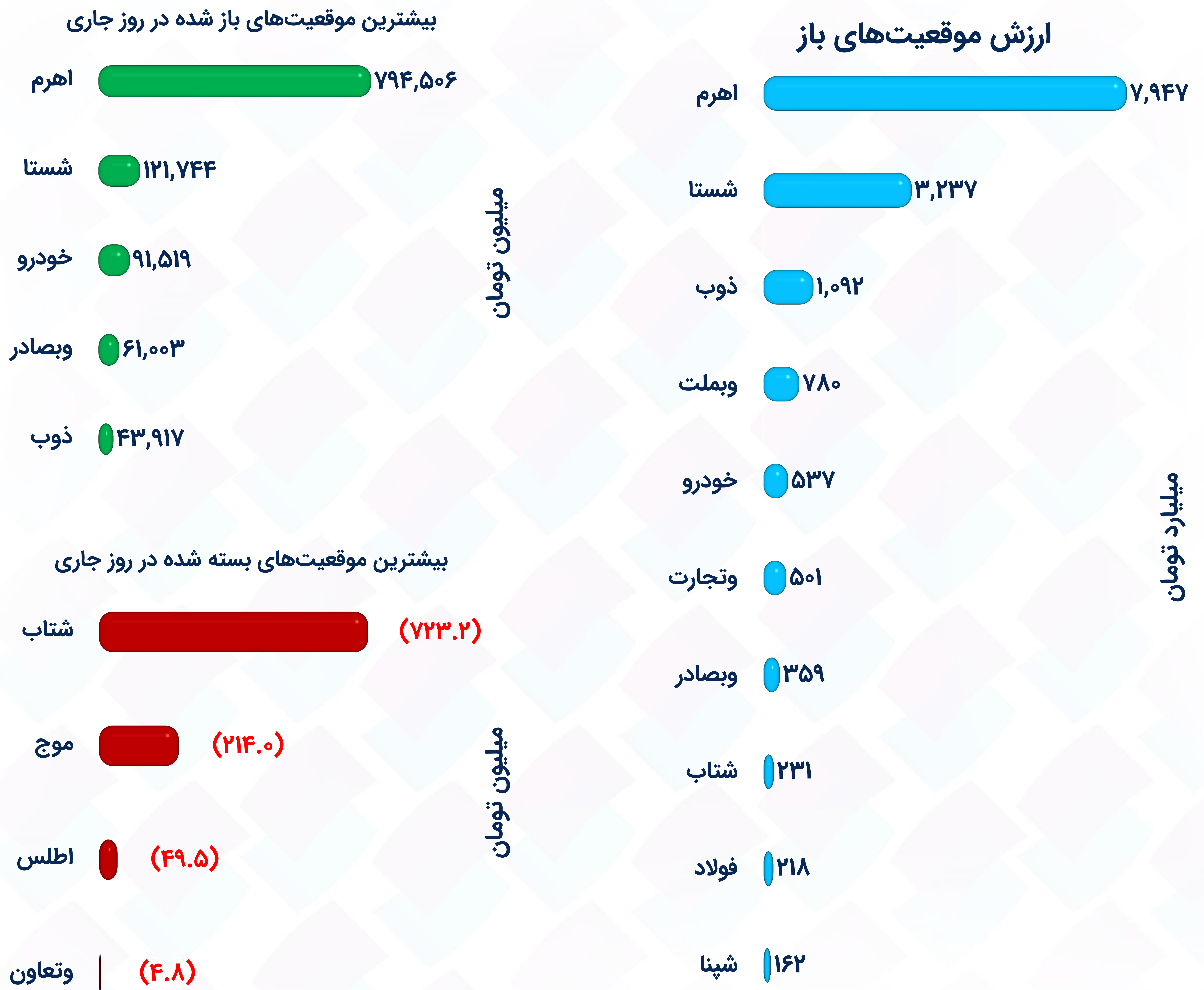
اختیار خرید

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	۵۳	۵۱۶.۷	۳,۳۹۳.۸	۳۹۲.۳	۱۲۴.۴	(۳۵.۱%)
خودرو	۲۳	۱۶۴.۵	۵۹۹.۹	۱۴۴.۲	۲۰.۳	(۲۲.۶%)
شستا	۵۵	۱۳۴.۹	۱,۴۷۲.۸	۱۲۵.۸	۹.۱	(۱۲.۳%)
ذوب	۲۶	۵۲.۹	۳۰۵.۹	۴۷.۹	۵.۰	(۲۱.۲%)
وبصادر	۱۶	۴۱.۱	۱۴۳.۳	۳۴.۹	۶.۲	(۲۶.۹%)
وبملت	۲۴	۲۳.۵	۱۳۵.۷	۱۷.۶	۵.۹	(۱۶.۱%)
وتجارت	۲۲	۲۰.۰	۱۰۵.۸	۱۸.۱	۱.۹	(۱۵.۴%)

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	۱۸	۶۶,۴۶۱.۸	۳,۵۲۷,۴۳۰.۲	۶,۸۴۵.۸	۵۹,۶۱۶.۰	(۷۸.۹%)
شستا	۹	۱۰,۷۳۲.۶	۷۹۰,۰۴۰.۵	۰.۰	۱۰,۷۳۲.۶	(۷۶.۸%)
خودرو	۷	۸۰۵.۶	۳۱,۱۵۱.۷	۷۶۶.۸	۳۸.۸	(۵۴.۵%)
وبملت	۳	۲۵۸.۸	۱۰,۰۵۵.۲	۰.۰	۲۵۸.۸	(۸۰.۹%)
ذوب	۲	۱۴۸.۷	۱۱,۱۱۳.۱	۰.۰	۱۴۸.۷	(۸۳.۶%)
وتجارت	۱	۱۱۰.۷	۱,۴۱۷.۰	۰.۰	۱۱۰.۷	(۷۵.۶%)
اطلس	۱	۱۰.۲	۳۷۶.۰	۰.۰	۱۰.۲	(۵۱.۴%)

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 ۴,۷۲۰

شستا ۷۶۹

ذوب ۲۷

خودرو ۲۴

وبملت ۱۹

وتعاون ۱۶

شتاب ۱۰

بساما ۸.۱۸

وبصادر ۲.۳۷

توان ۱.۶۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۵۵۷,۴۷۶.۰

خودرو ۲۰,۸۰۷.۶

شستا ۹,۵۹۵.۲

وتجارت ۱,۴۰۴.۷

وبملت ۱,۲۰۶.۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

ذوب (۶۷۶.۶)

وتعاون (۱۰.۴)

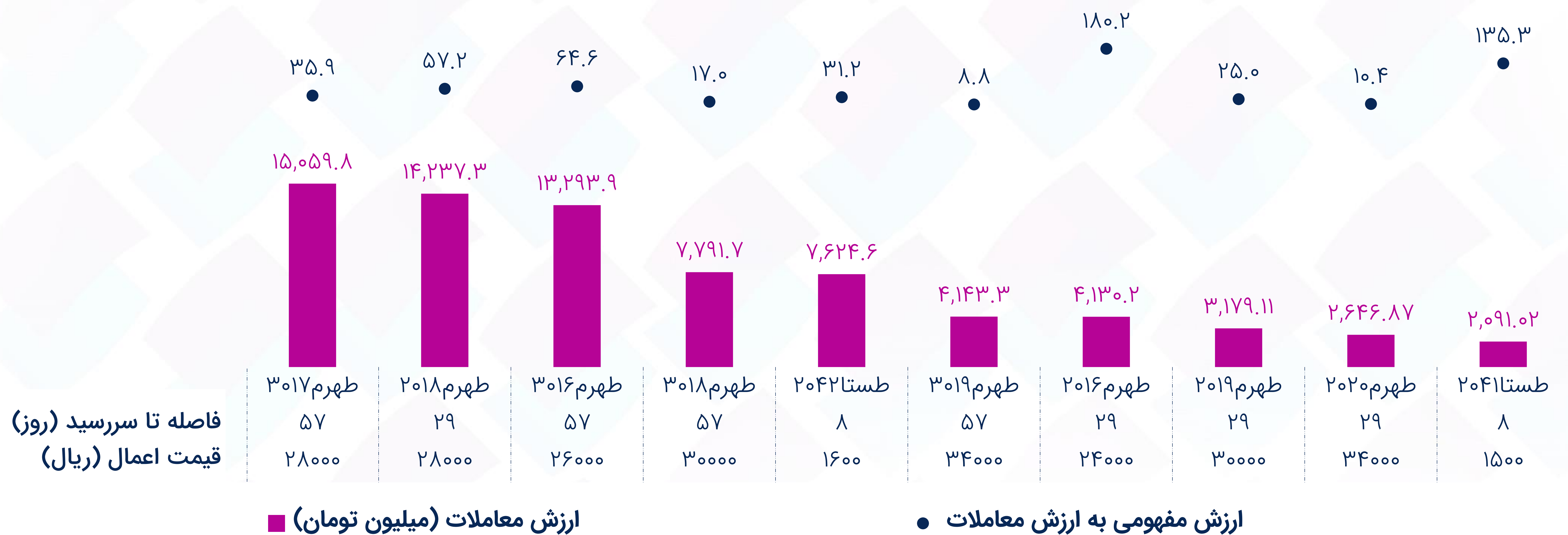
میلیون تومان

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 ۴۰۲۱	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۶۸	۲۴.۱	۶۰,۷۷۷	۲۴۱,۳۶۹	۲۳۰,۷۷۷	(۴.۴%)	۳.۸	۱.۰۰	۸۱,۸۰۸	۳۵%
ضتاب ۲۰۰۷	شتاب	۱۶,۰۰۰	۸	۱.۳	۱,۰۰۰	۱۷,۱۴۰	۱۷,۰۰۰	(۰.۸%)	۱۷.۰	۰.۹۰	۱,۳۴۲	۳۴%
ضتیام ۲۰۲	تیام	۱۰,۰۰۰	۲۶	۱۰۶.۳	۴,۲۵۰	۱۵,۴۰۱	۱۴,۲۵۰	(۷.۵%)	۳.۴	۱.۰۰	۵,۶۵۹	۳۳%
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۵	۲.۹	۱,۲۰۰	۸,۸۹۰	۸,۶۹۵	(۲.۲%)	۷.۲	۱.۰۰	۱,۴۳۶	۲۰%
ضستا ۴۰۲۳	شستا	۹۰۰	۷۱	۶.۴	۶۵۷	۱,۶۲۳	۱,۵۵۷	(۴.۱%)	۲.۴	۱.۰۰	۷۸۲	۱۹%

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
ضشنا ۲۰۵۶	شپنا	۵,۶۳۴	۱۵	۶.۳	۴۰	۳,۸۹۵	۵,۶۷۴	۴۶%	۱۴۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۲	۲۷.۱	۶	۵۲۹	۸۰۶	۵۲%	۱۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۴۲	۴۶.۳	۱۹	۴,۳۱۰	۶,۴۹۹	۵۱%	۳۴۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۵۰	۲۸۶.۳	۴۲	۶۷۴	۱,۰۴۲	۵۵%	۲۴.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۲۰۵۴	شپنا	۴,۹۳۰	۱۵	۴.۰	۴۲	۳,۸۹۵	۴,۹۷۲	۲۸%	۱۱۸.۴	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
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۵۵	۲.۱	۶۹	۱,۸۱۹	۱,۸۳۱	۰.۷%	۲۶.۵	-۰.۴۵	۷۱	۳.۱%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۷	۵۵.۶	۹,۱۰۸	۳۱,۹۰۰	۳۲,۸۹۲	۳.۱%	۳.۶	-۰.۹۳	۸,۰۳۱	(۱۱.۸%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۹	۲,۶۴۶.۹	۳,۰۶۴	۳۱,۹۰۰	۳۰,۹۳۶	(۳.۰%)	۱۰.۱	-۰.۶۰	۱,۹۸۶	(۳۵.۲%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۵۷	۴,۱۴۳.۳	۳,۶۲۲	۳۱,۹۰۰	۳۰,۳۷۸	(۴.۸%)	۸.۴	-۰.۵۰	۱,۹۷۶	(۴۵.۵%)
طاطلس ۳۰۶	اطلس	۶۵,۰۰۰	۳۳	۱۰.۲	۱,۷۹۸	۶۵,۹۶۸	۶۳,۲۰۲	(۴.۲%)	۳۵.۲	-۰.۲۶	۸۷۴	(۵۱.۴%)

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
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۸	۵.۹	۱	۱,۶۲۳	۱,۱۹۹	(۲۶.۱%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۸	۴۵.۱	۲	۱,۶۲۳	۱,۲۹۸	(۲۰.۰%)	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۹	۴۹.۹	۶۶	۳۱,۹۰۰	۱۹,۹۳۴	(۳۷.۵%)	۳۰۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۵۰	۳.۶	۱۱	۲,۸۸۹	۱,۸۹۶	(۳۴.۴%)	۱۷۲.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲۹	۹۱.۴	۱۰۸	۳۱,۹۰۰	۲۱,۸۹۲	(۳۱.۴%)	۲۰۲.۷	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

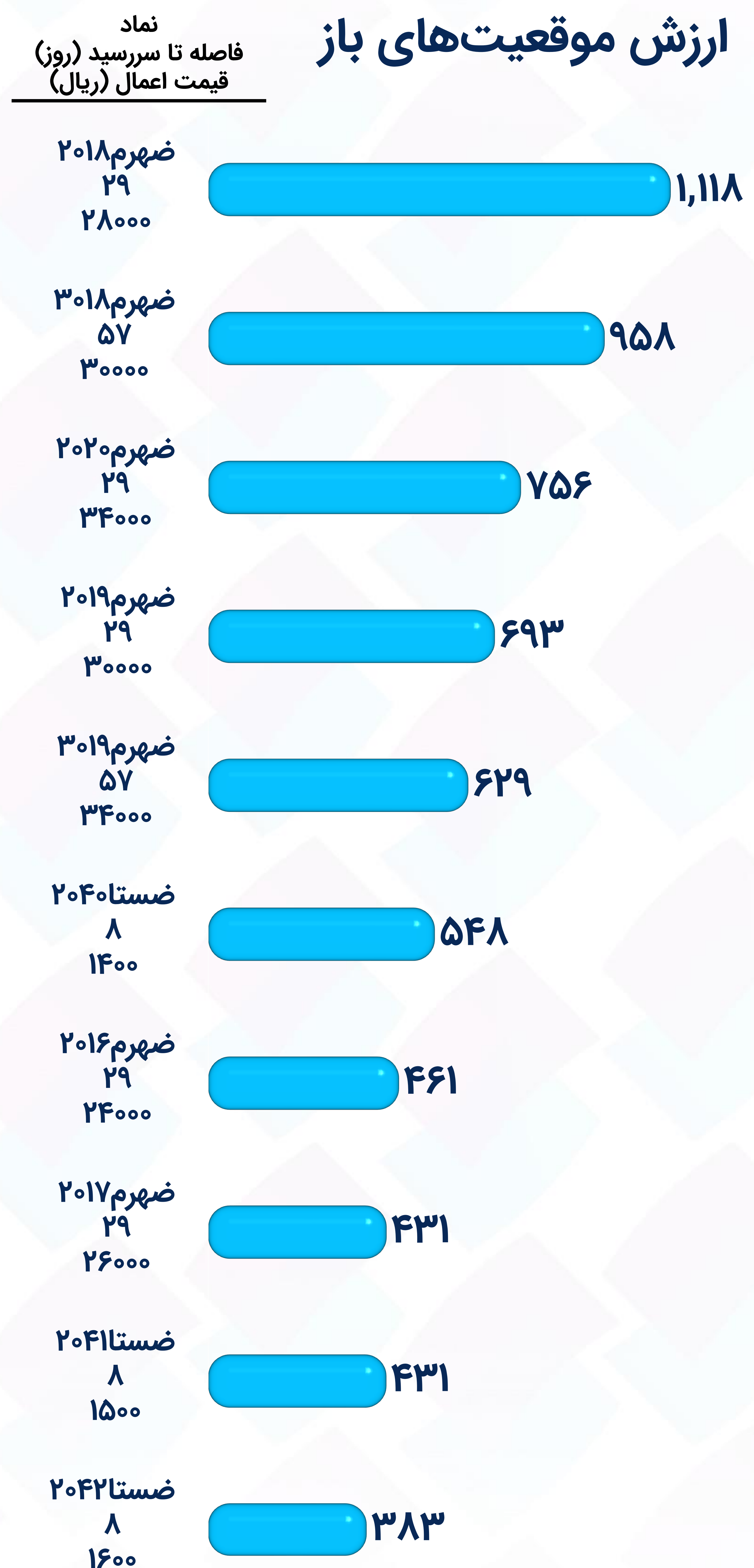
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



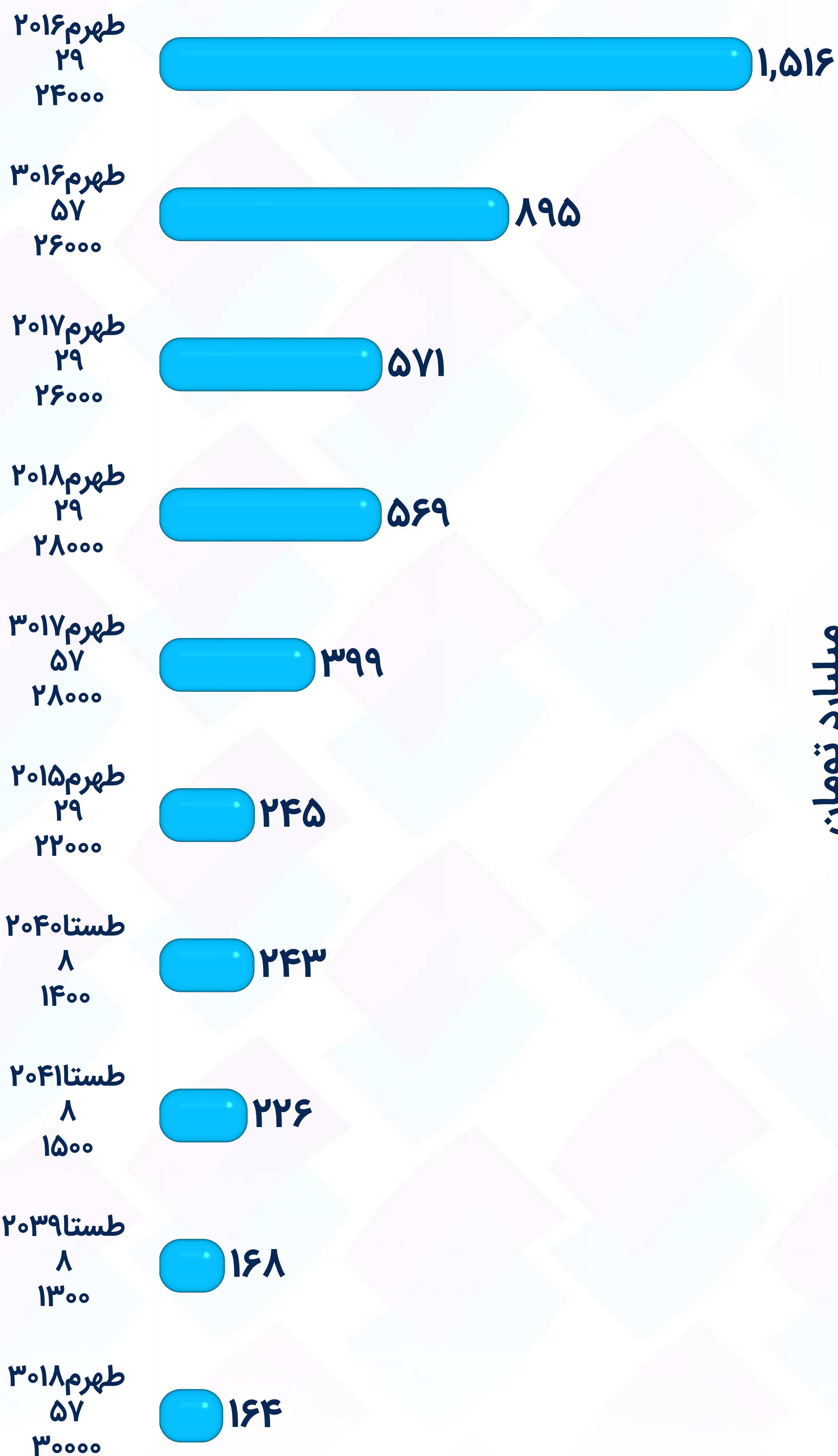
ارزش موقعیت‌های باز



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)



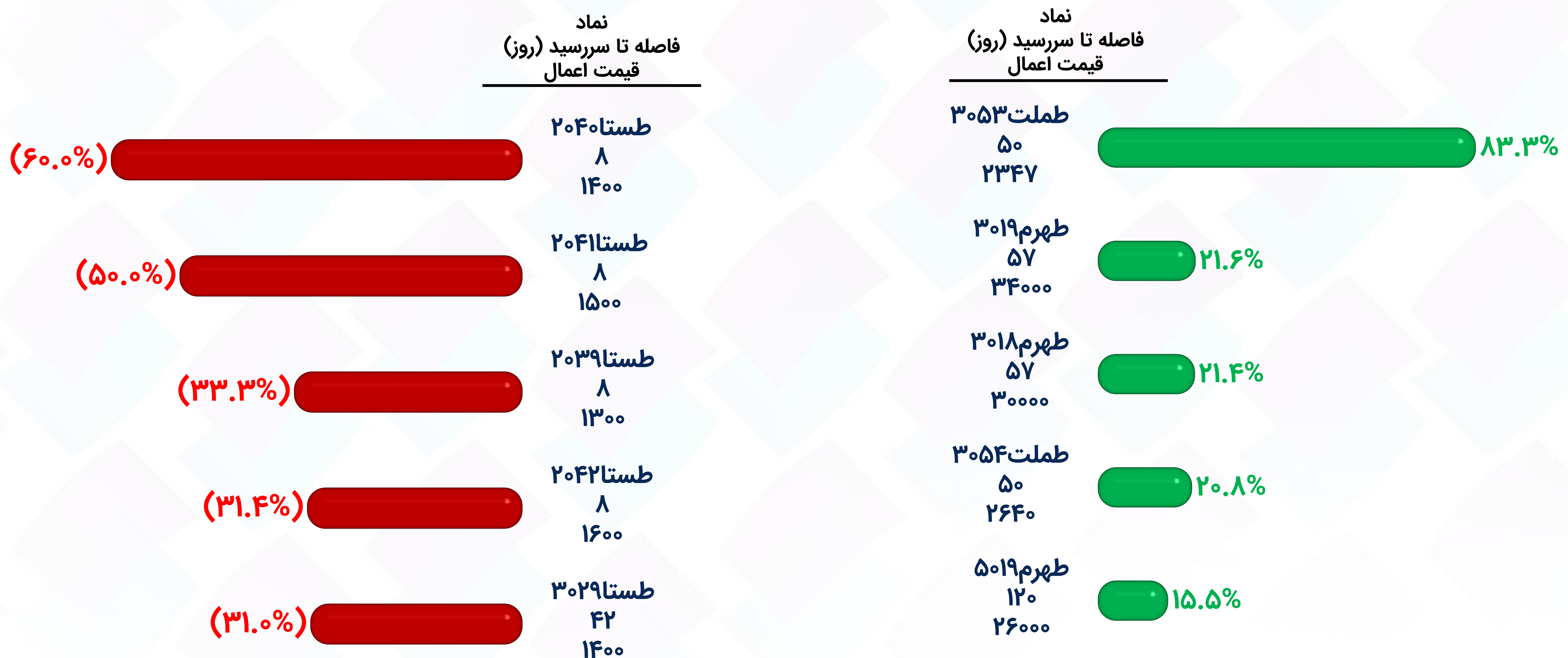
میلیون تومان

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.