

شماره
۴۶۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

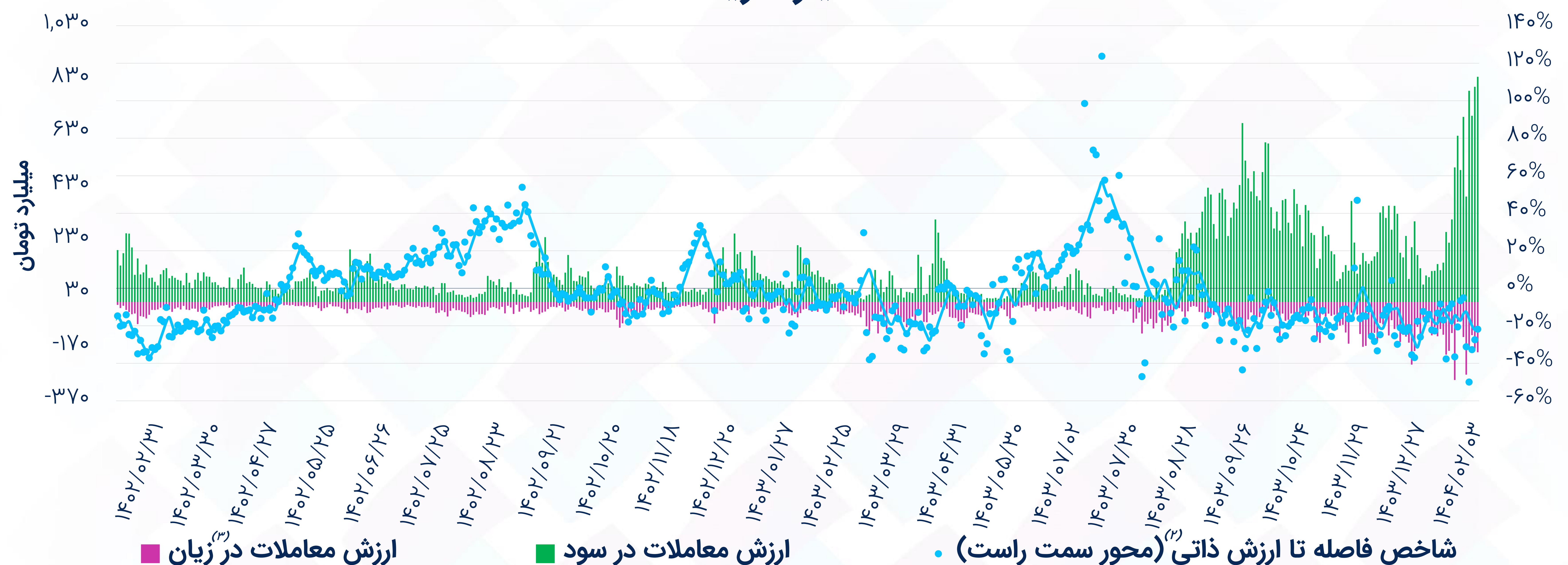




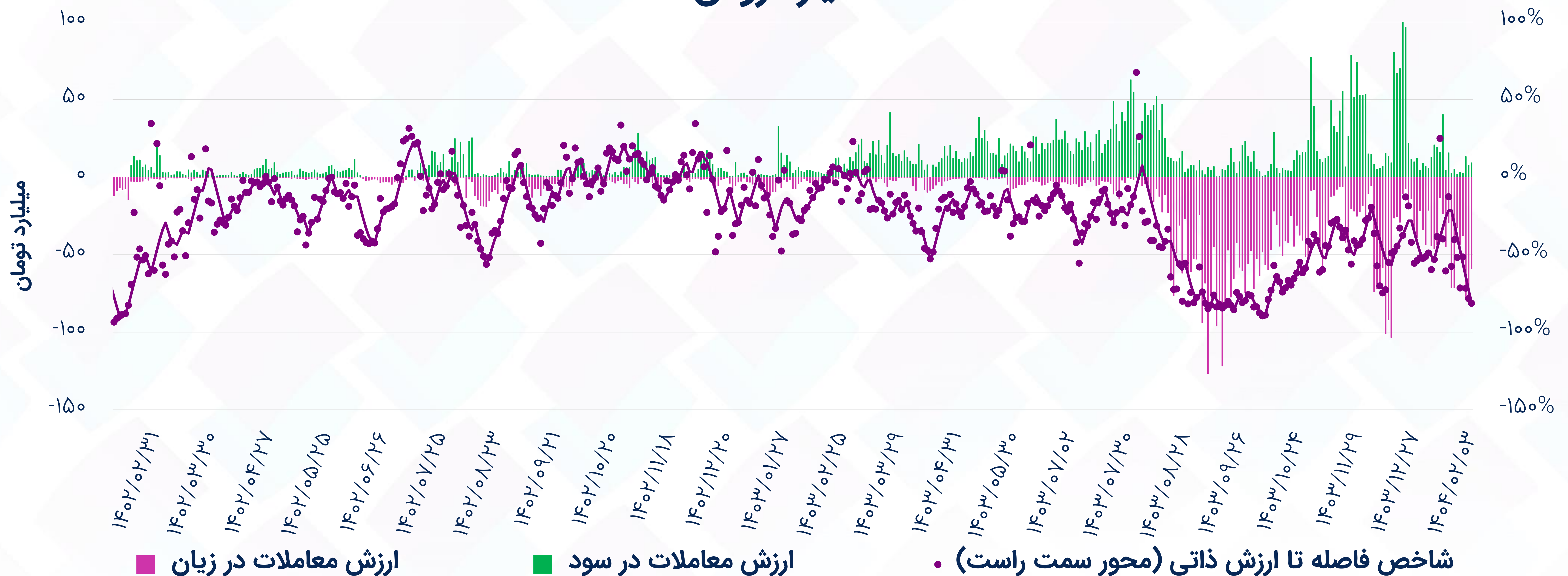
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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	۴۷	۴۳۶.۰	۲,۸۷۴.۴	۳۳۲.۷	۱۰۳.۳	(۳۲.۶%)
خودرو	۲۳	۳۴۲.۲	۱,۲۷۸.۴	۲۹۱.۴	۵۰.۸	(۱۳.۹%)
شستا	۵۵	۱۱۸.۷	۱,۳۲۳.۱	۱۰۶.۶	۱۲.۱	(۴.۵%)
ذوب	۲۷	۴۹.۲	۲۷۷.۲	۴۴.۶	۴.۶	(۱۸.۵%)
وبملت	۲۸	۲۵.۸	۱۵۷.۳	۱۸.۹	۶.۹	(۲۶.۶%)
وبصادر	۱۶	۱۹.۵	۸۱.۷	۱۴.۶	۴.۹	(۳۰.۶%)
وتجارت	۲۰	۱۱.۶	۷۱.۳	۹.۷	۲.۰	(۲۳.۲%)

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	۱۴	۵۲,۳۶۸.۷	۲,۸۴۷,۴۲۱.۷	۳,۹۶۲.۷	۴۸,۴۰۶.۱	(۸۲.۹%)
شستا	۱۲	۹,۲۰۰.۸	۸۰۹,۷۴۹.۵	۲.۷	۹,۱۹۸.۱	(۸۸.۶%)
خودرو	۸	۶,۴۳۸.۳	۵۸,۱۳۰.۵	۵,۳۲۷.۴	۱,۱۱۱.۰	(۵۸.۵%)
ذوب	۲	۳۲۶.۲	۱۰,۷۹۴.۸	۰.۰	۳۲۶.۲	(۸۴.۷%)
وبملت	۴	۹۴.۲	۳,۲۹۲.۶	۰.۸	۹۳.۴	(۶۷.۹%)
خودران	۲	۲.۸	۷۰.۰	۰.۰	۲.۸	(۷۳.۳%)
وتعاون	۱	۱.۱	۲۱.۶	۱.۱	۰.۰	(۱۰.۵%)

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

میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

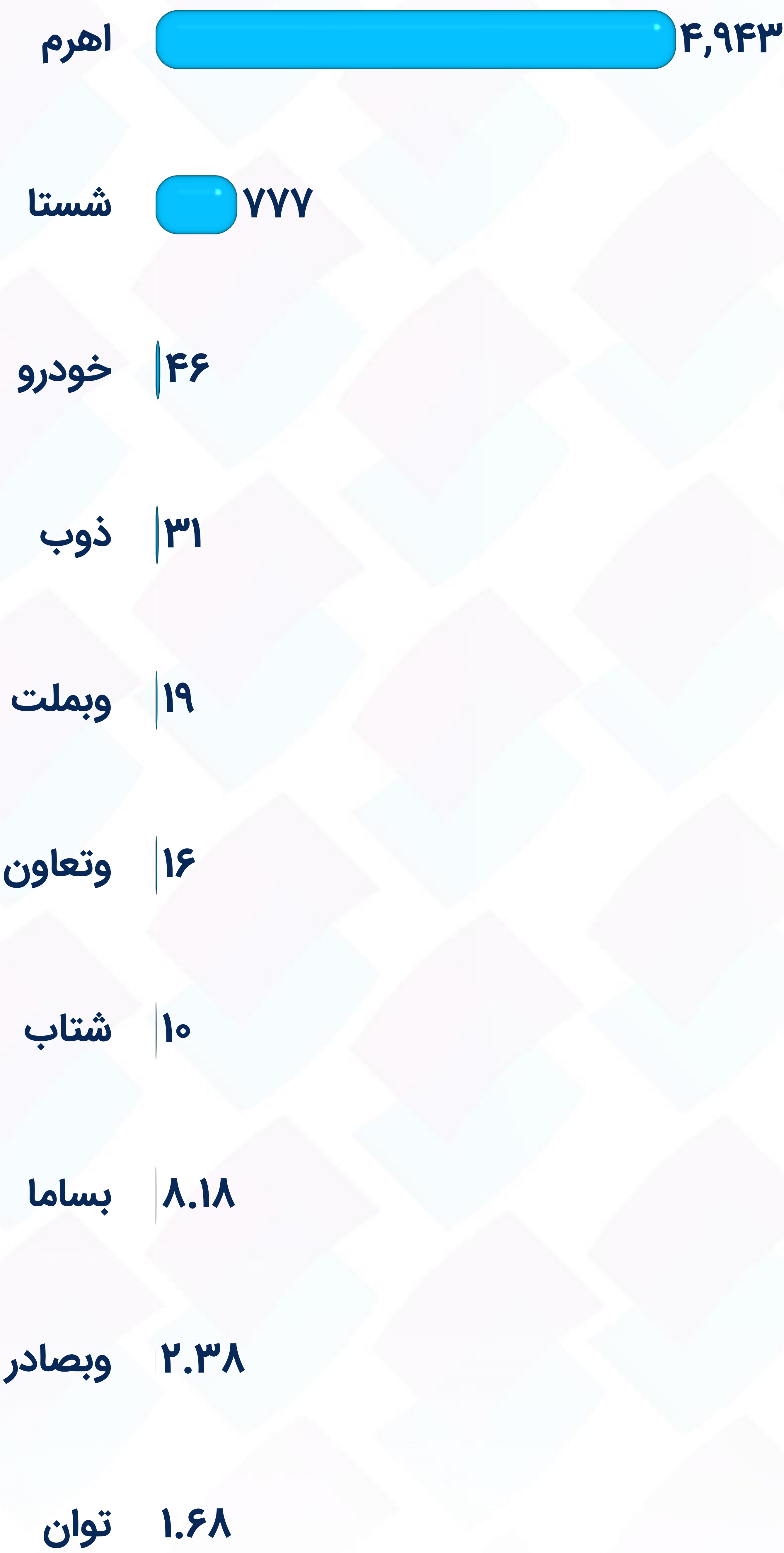
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

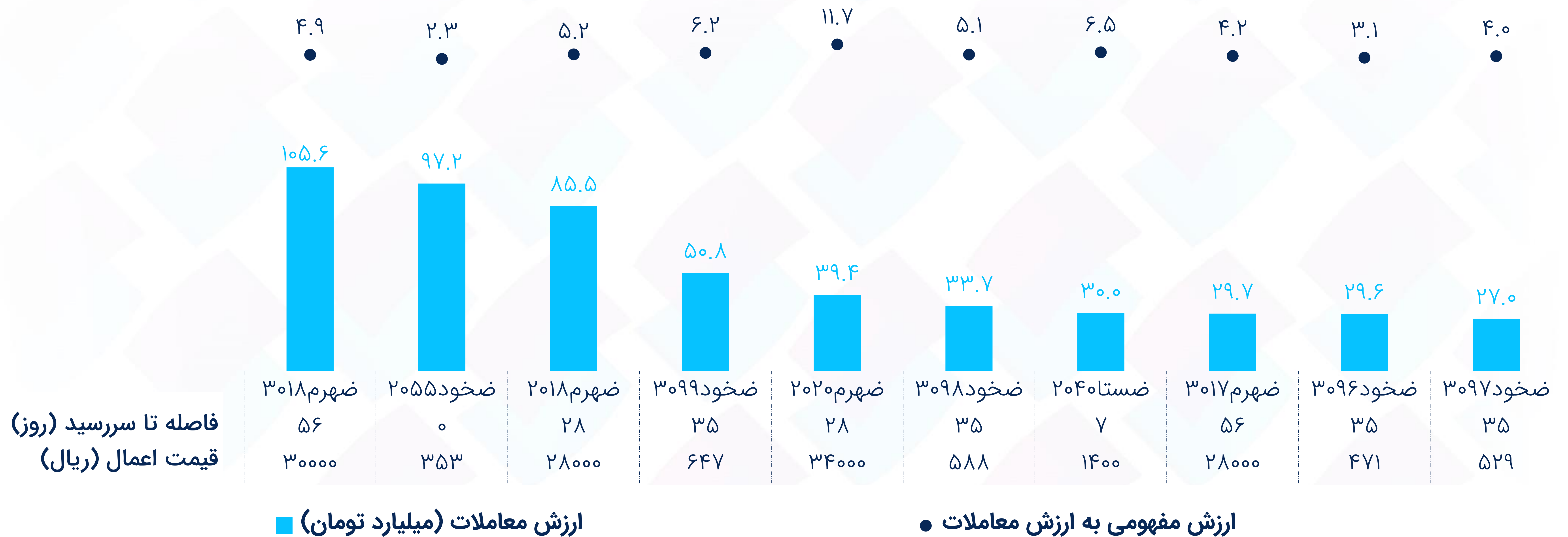
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



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
ضهم وزن ۳۰۶	هم وزن	۲۰,۰۰۰	۳۲	۷۱.۶	۵۴۲	۲۰,۴۰۸	۲۰,۵۴۲	۰.۷%	۳۷.۹	۰.۷۵	۱,۳۰۱	۱۴۰%
ضبساما ۲۲۱	بساما	۷,۹۱۱	۴	۱.۹	۷۰۹	۹,۰۲۰	۸,۶۲۰	(۴.۴%)	۱۲.۲	۱.۰۰	۱,۱۴۲	۶۱%
ضبساما ۲۲۰	بساما	۷,۴۹۵	۴	۳۰.۶	۱,۱۴۷	۹,۰۲۰	۸,۶۴۲	(۴.۲%)	۷.۵	۱.۰۰	۱,۵۵۶	۳۶%
ضبساما ۲۱۸	بساما	۶,۶۶۲	۴	۳۹۰.۹	۱,۸۰۰	۹,۰۲۰	۸,۴۶۲	(۶.۲%)	۴.۷	۱.۰۰	۲,۳۸۵	۳۳%
ضپادا ۴۰۲	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۶۷	۳.۷	۶۱,۷۱۸	۲۴۰,۷۱۸	۲۳۱,۷۱۸	(۳.۷%)	۳.۸	۱.۰۰	۸۰,۹۲۹	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
ضذوب ۲۰۰۷	ذوب	۹۰۰	۲۱	۱.۴	۴	۵۳۳	۹۰۴	۷۰%	۲۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۱	۹.۶	۶	۵۳۳	۸۰۶	۵۱%	۱۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۲۰۵۵	شپنا	۵,۲۸۲	۱۴	۲.۰	۳۸	۴,۰۱۱	۵,۳۲۰	۳۳%	۱۴۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۴۱	۱۱۹.۲	۲۱	۴,۳۸۹	۶,۵۰۱	۴۸%	۳۰۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۴۹	۱۹.۷	۲۸	۵۳۳	۸۲۸	۵۵%	۲۹.۶	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	۵۴	۱.۱	۹۵	۱,۷۹۱	۱,۸۰۵	۰.۸%	۱۹.۰	-۰.۵۱	۸۵	(۱۰.۵%)
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۶	۳۹.۴	۹,۳۸۱	۳۲,۳۸۰	۳۲,۶۱۹	۰.۷%	۳.۵	-۰.۹۲	۷,۶۳۲	(۱۸.۶%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۸	۳,۴۹۵.۰	۲,۹۶۵	۳۲,۳۸۰	۳۱,۰۳۵	(۴.۲%)	۱۰.۵	-۰.۵۶	۱,۷۰۹	(۴۲.۴%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۵۶	۴۲۸.۳	۳,۹۳۶	۳۲,۳۸۰	۳۰,۰۶۴	(۷.۲%)	۷.۶	-۰.۴۶	۱,۷۴۹	(۵۵.۶%)
طخود ۳۰۹۹	خودرو	۶۴۷	۳۵	۵,۳۲۷.۴	۸۶	۶۳۶	۵۶۱	(۱۱.۸%)	۶.۵	-۰.۴۲	۳۷	(۵۷.۲%)

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	۷	۴.۵	۱	۱,۶۶۸	۱,۱۹۹	(۲۸.۱%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۷	۵۲.۳	۲	۱,۶۶۸	۱,۲۹۸	(۲۲.۲%)	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۳۵	۰.۰	۱	۶۳۶	۲۸۱	(۵۵.۸%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۸	۹۱.۰	۶۳	۳۲,۳۸۰	۱۹,۹۳۷	(۳۸.۴%)	۳۱۶.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۳۰۱۱	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۶	۰.۰	۲	۳۲,۳۸۰	۱۵,۹۹۸	(۵۰.۶%)	۷,۹۹۹.۰	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
۲۸
۲۸۰۰۰ ۱,۰۷۶

ضهرم ۳۰۱۸
۵۶
۳۰۰۰۰ ۱,۰۰۳

ضهرم ۲۰۲۰
۲۸
۳۴۰۰۰ ۸۴۰

ضهرم ۲۰۱۹
۲۸
۳۰۰۰۰ ۷۰۷

ضهرم ۳۰۱۹
۵۶
۳۴۰۰۰ ۶۹۴

ضستا ۲۰۴۰
۷
۱۴۰۰ ۵۰۲

ضهرم ۲۰۱۶
۲۸
۲۴۰۰۰ ۴۵۴

ضهرم ۲۰۲۲
۲۸
۴۲۰۰۰ ۴۳۵

ضهرم ۲۰۱۷
۲۸
۲۶۰۰۰ ۴۲۷

ضستا ۲۰۴۱
۷
۱۵۰۰ ۴۱۶

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضخود ۳۰۹۹
۳۵
۶۴۷ ۱۴۱,۲۶۸

ضخود ۳۰۹۸
۳۵
۵۸۸ ۱۱۳,۳۰۴

ضهرم ۲۰۲۲
۲۸
۴۲۰۰۰ ۹۸,۳۴۷

ضهرم ۲۰۲۰
۲۸
۳۴۰۰۰ ۸۳,۶۶۷

ضهرم ۳۰۱۹
۵۶
۳۴۰۰۰ ۶۵,۳۵۵

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضستا ۲۰۴۰
۷
۱۴۰۰ (۴۵,۶۵۲.۹)

ضهرم ۲۰۱۸
۲۸
۲۸۰۰۰ (۴۲,۱۸۴.۸)

ضستا ۲۰۳۹
۷
۱۳۰۰ (۲۰,۹۵۵.۲)

ضستا ۲۰۴۱
۷
۱۵۰۰ (۱۴,۵۱۰.۷)

ضستا ۲۰۳۸
۷
۱۲۰۰ (۱۱,۵۱۳.۵)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

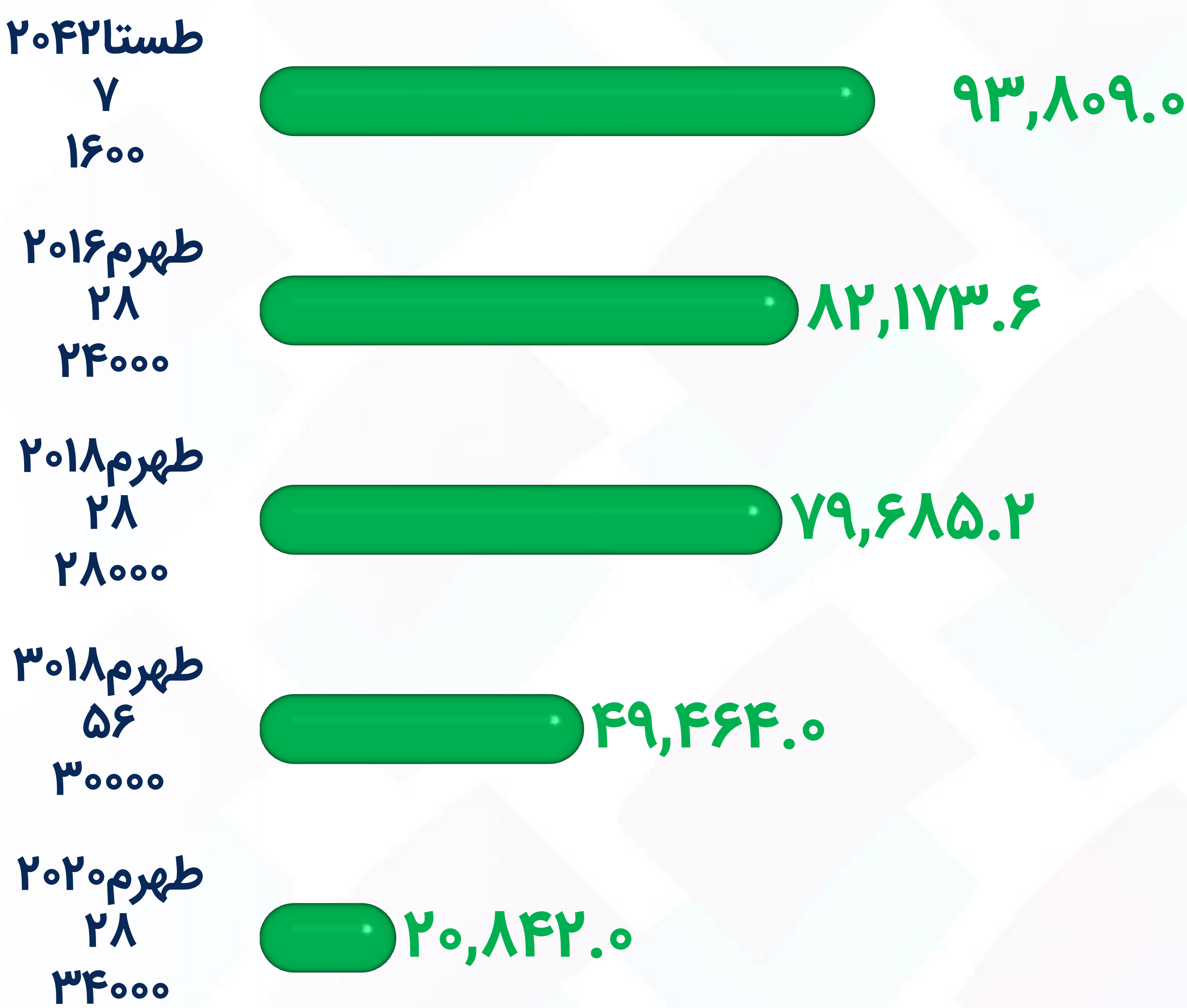
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

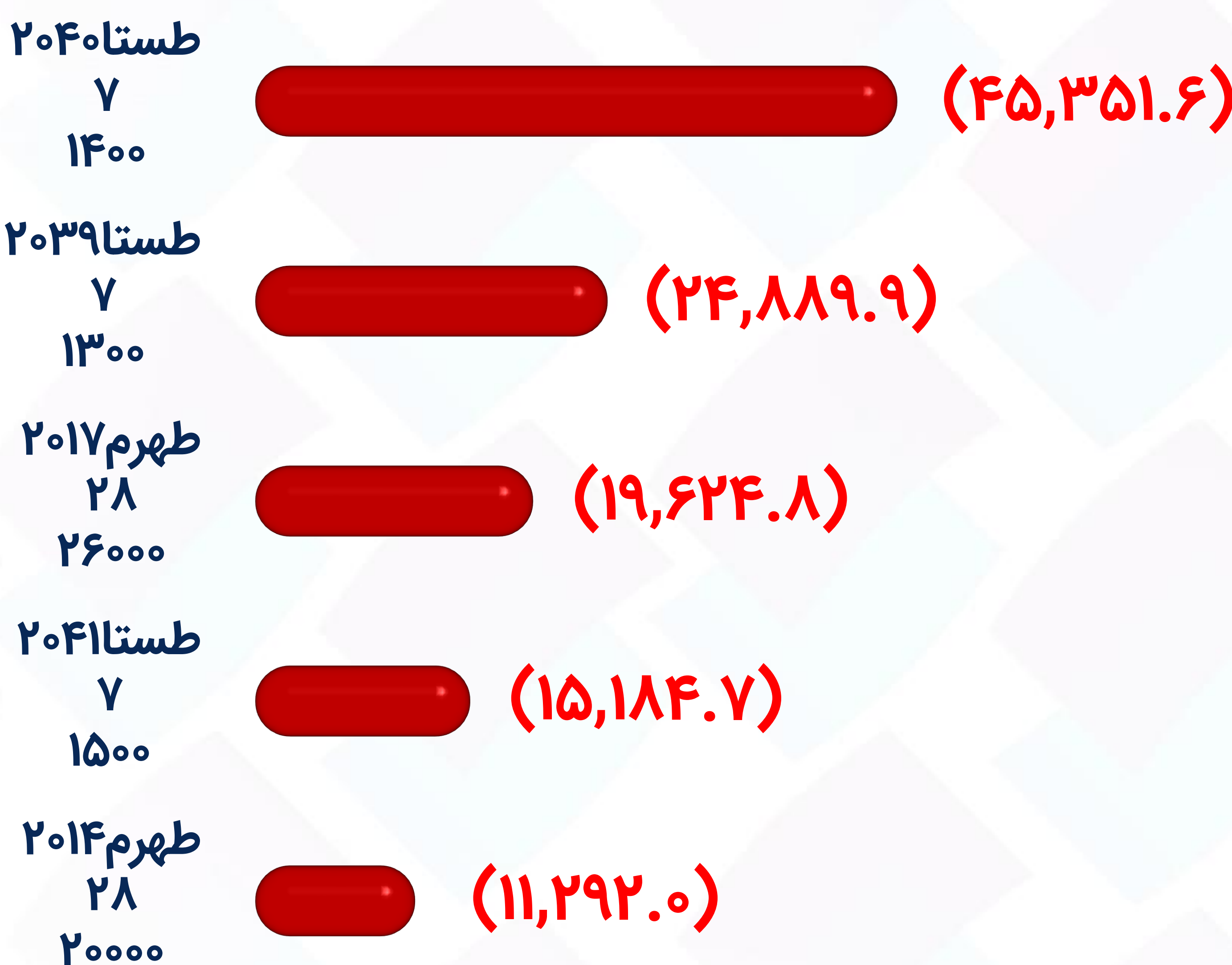
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.