

شماره
۴۶۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۷ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





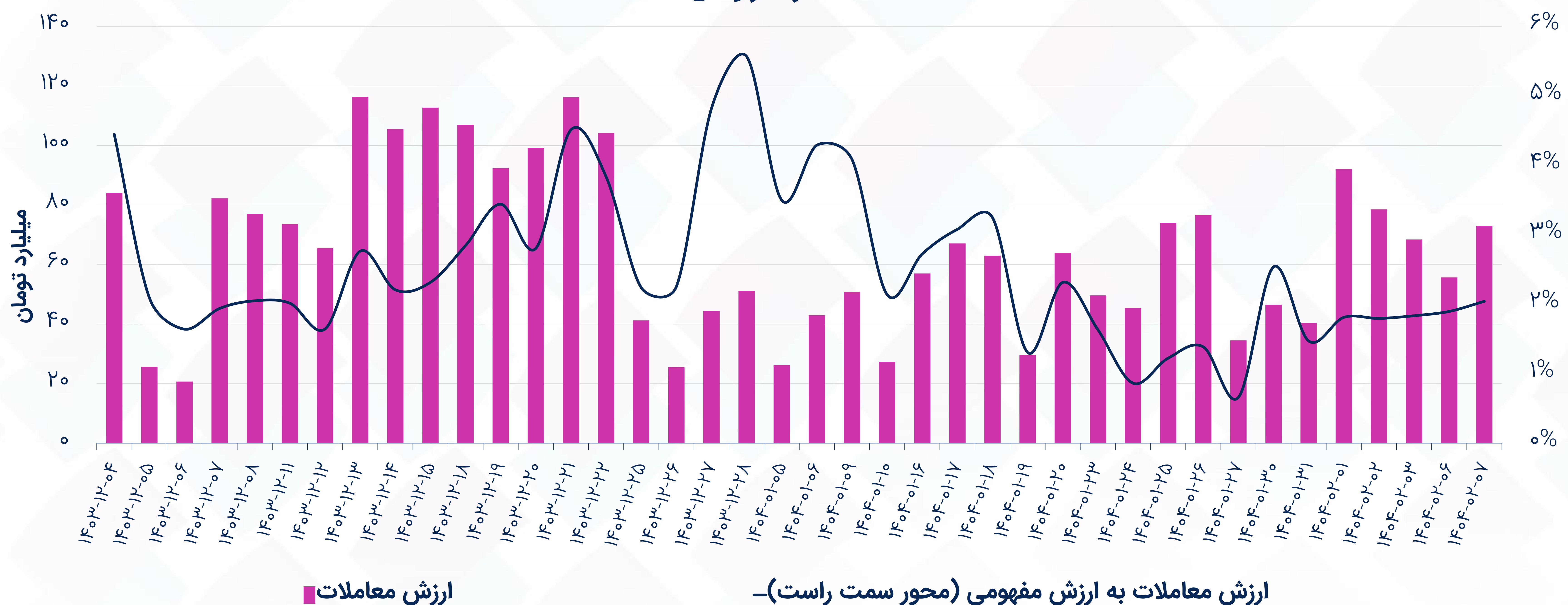
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



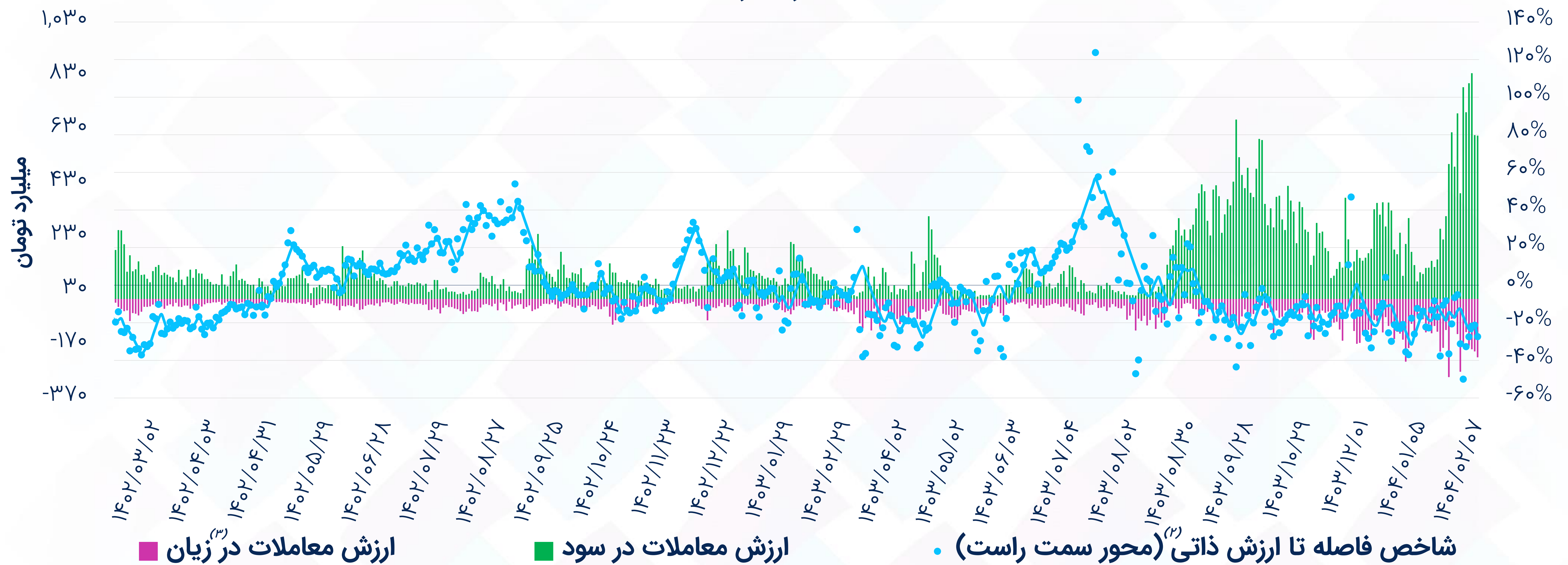
اختیار فروش



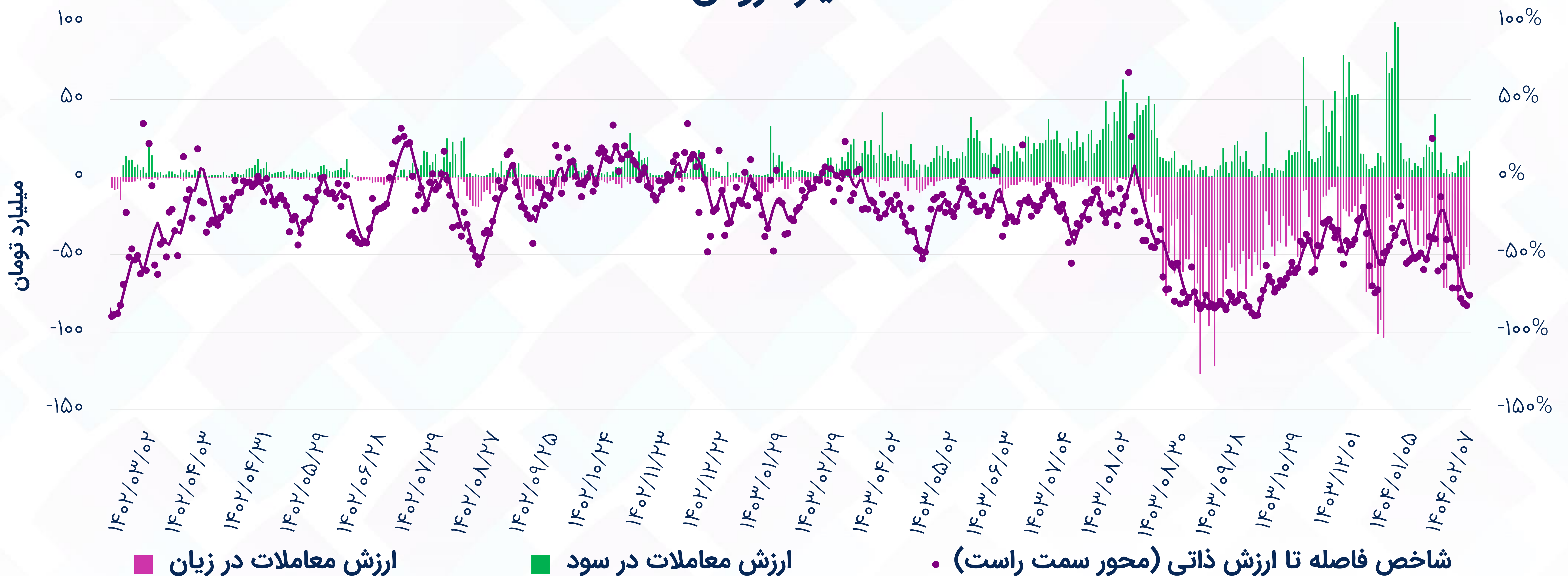
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۷	۴۷۷.۰	۳,۷۳۷.۳	۳۵۴.۴	۱۲۲.۶	(۳۲.۹%)
خودرو	۱۳	۱۴۲.۹	۸۶۰.۱	۷۳.۹	۶۹.۰	(۳۴.۰%)
شستا	۴۸	۱۰۸.۴	۲,۰۵۹.۰	۹۴.۴	۱۴.۰	(۱.۴%)
ذوب	۲۹	۲۸.۹	۲۰۳.۸	۲۵.۱	۳.۸	(۱۷.۷%)
وبصادر	۱۸	۱۹.۲	۸۴.۴	۱۸.۵	۰.۷	(۲۲.۷%)
وبملت	۲۳	۱۸.۲	۱۰۸.۸	۱۶.۱	۲.۱	(۲۶.۴%)
وتجارت	۱۸	۸.۳	۷۲.۶	۴.۹	۳.۴	(۳۶.۰%)

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	۵۴,۹۹۳.۴	۲,۸۲۳,۹۳۱.۴	۵,۴۶۵.۰	۴۹,۵۲۸.۴	(۸۰.۳%)
خودرو	۵	۱۱,۲۶۵.۸	۹۴,۹۵۸.۶	۹,۹۶۰.۲	۱,۳۰۵.۶	(۵۶.۰%)
شستا	۱۱	۶,۰۳۶.۴	۶۳۴,۳۹۱.۸	۸۴۵.۰	۵,۱۹۱.۴	(۷۸.۵%)
بساما	۲	۲۸۷.۷	۴,۴۶۸.۰	۲۸۶.۳	۱.۴	(۳۴.۵%)
ذوب	۳	۱۵۹.۳	۷,۷۵۱.۷	۰.۰	۱۵۹.۳	(۸۳.۳%)
وتعاون	۲	۹۲.۲	۱,۴۵۸.۶	۳۰.۵	۶۱.۷	(۴۹.۲%)
وبملت	۴	۸۶.۸	۳,۳۶۵.۵	۰.۰	۸۶.۸	(۶۷.۵%)

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 ۵,۰۸۹

شستا ۷۴۲

خودرو ۸۲

ذوب ۳۵

وبملت ۲۳

وتعاون ۱۶

شتاب ۱۰

بساما ۷.۹۲

وبصادر ۲.۷۸

خودران ۱.۷۹

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۲۵,۴۶۹.۴

خودرو ۲۳,۲۴۷.۷

ذوب ۳,۰۷۳.۶

وبصادر ۳۹۶.۹

وبملت ۲۴۲.۸

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۳۰,۲۶۳.۷)

وتعاون (۱۲۷.۵)

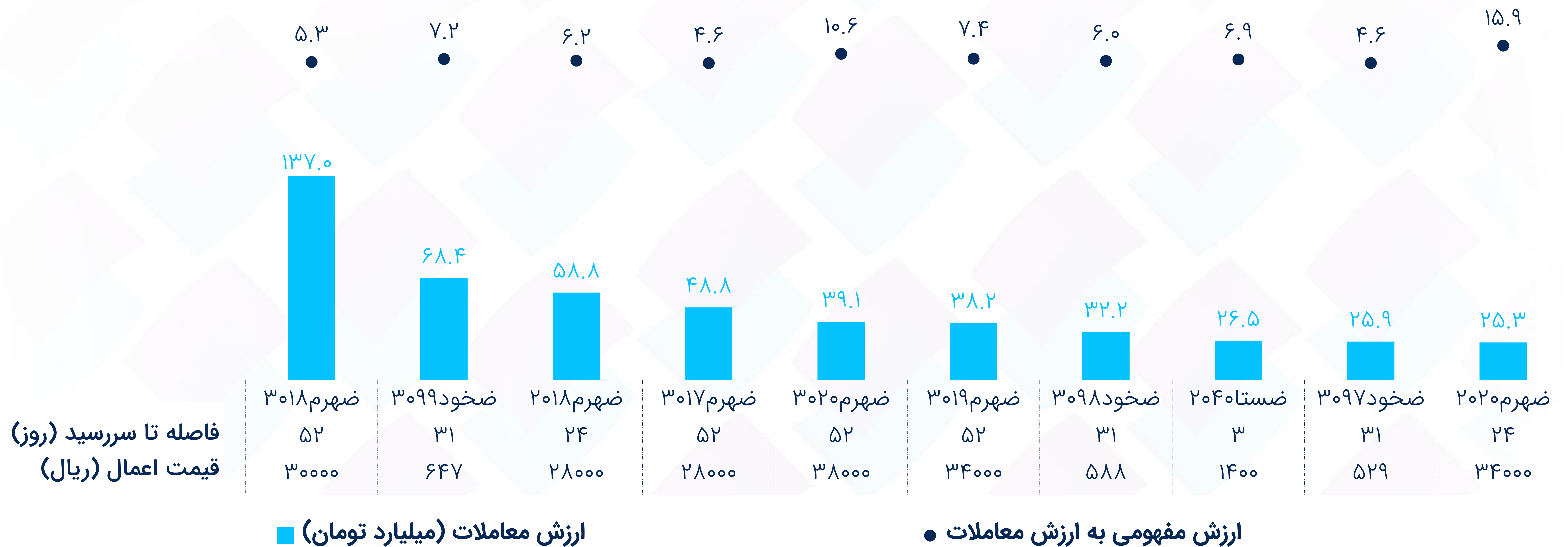
خبهمن (۰.۲)

میلیون تومان

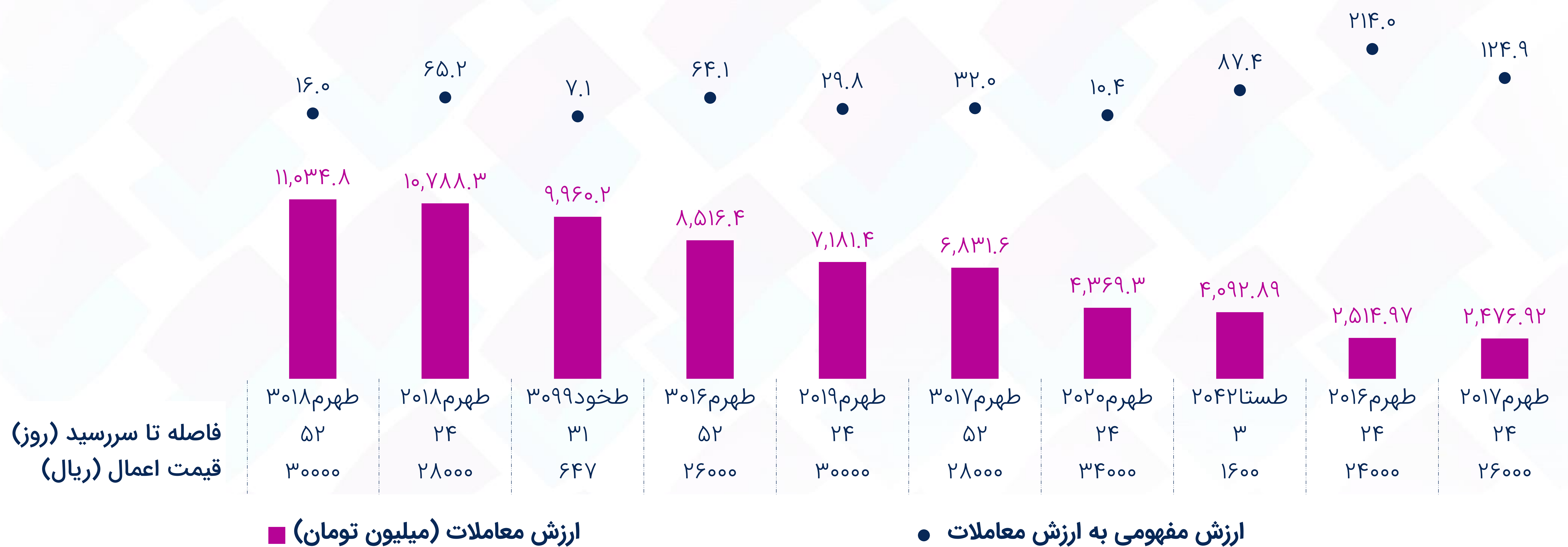
میلیون تومان

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
ضفر ۲۰۱	فزر	۲۵,۳۰۰	۷	۴.۲	۴,۷۰۰	۴۳,۰۵۰	۳۰,۰۰۰	(۳۰.۳%)	۶.۴	۱.۰۰	۱۷,۹۵۶	۲۸۲%
ضتاب ۲۰۰۷	شتاب	۱۶,۰۰۰	۳	۸۸.۰	۱,۱۰۶	۱۷,۴۳۰	۱۷,۱۰۶	(۱.۹%)	۱۵.۵	۰.۹۸	۱,۵۲۴	۳۸%
ضموج ۲۱۳	موج	۱۷,۰۰۰	۱۴	۵۱.۹	۱۲,۳۵۵	۳۱,۵۵۲	۲۹,۳۵۵	(۷.۰%)	۲.۴	۱.۰۰	۱۴,۸۰۵	۲۰%
ضتاب ۲۰۰۶	شتاب	۱۵,۰۰۰	۳	۷۲۴.۲	۲,۱۱۹	۱۷,۴۳۰	۱۷,۱۱۹	(۱.۸%)	۸.۱	۱.۰۰	۲,۵۱۲	۱۹%
ضدوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۸۰	۱.۳	۲۹۲	۵۳۰	۴۹۲	(۷.۲%)	۱.۷	۱.۰۰	۳۴۴	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
ضدوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۴۵	۲۳.۰	۱۵	۵۳۰	۱,۰۱۵	۹۲%	۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۷	۲۰.۲	۳	۵۳۰	۸۰۳	۵۲%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۳۷	۲.۱	۲۶	۴,۳۰۳	۶,۵۰۶	۵۱%	۲۵۰.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۲۰۵۵	شپنا	۵,۲۸۲	۱۰	۳.۷	۱۴	۴,۱۶۸	۵,۲۹۶	۲۷%	۳۷۸.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۷	۳۴.۶	۵	۵۳۰	۷۰۵	۳۳%	۱۴۱.۰	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
طجار۵۵۲۰	وتجارت	۶۳۵	۱۰	۲۳.۵	۱۷	۵۹۷	۶۱۸	۳.۵%	۳۶.۴	-۰.۷۷	۳۵	۱۰۸.۱%
طهرم۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۲۴	۴۹.۴	۹,۵۰۰	۳۲,۱۰۰	۳۲,۵۰۰	۱.۲%	۳.۴	-۰.۹۹	۸,۸۳۶	(۷.۰%)
طوتعاون۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۵۰	۳۰.۵	۱۵۷	۱,۷۱۵	۱,۷۴۳	۱.۶%	۱۱.۱	-۰.۶۹	۱۳۲	(۱۵.۶%)
طهرم۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۲	۷۸.۹	۹,۸۶۱	۳۲,۱۰۰	۳۲,۱۳۹	۰.۱%	۳.۳	-۰.۹۴	۸,۰۰۳	(۱۸.۸%)
طهرم۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲۴	۴۱.۸	۶,۹۶۷	۳۲,۱۰۰	۳۱,۰۳۳	(۳.۳%)	۴.۵	-۰.۹۲	۵,۰۴۵	(۲۷.۶%)

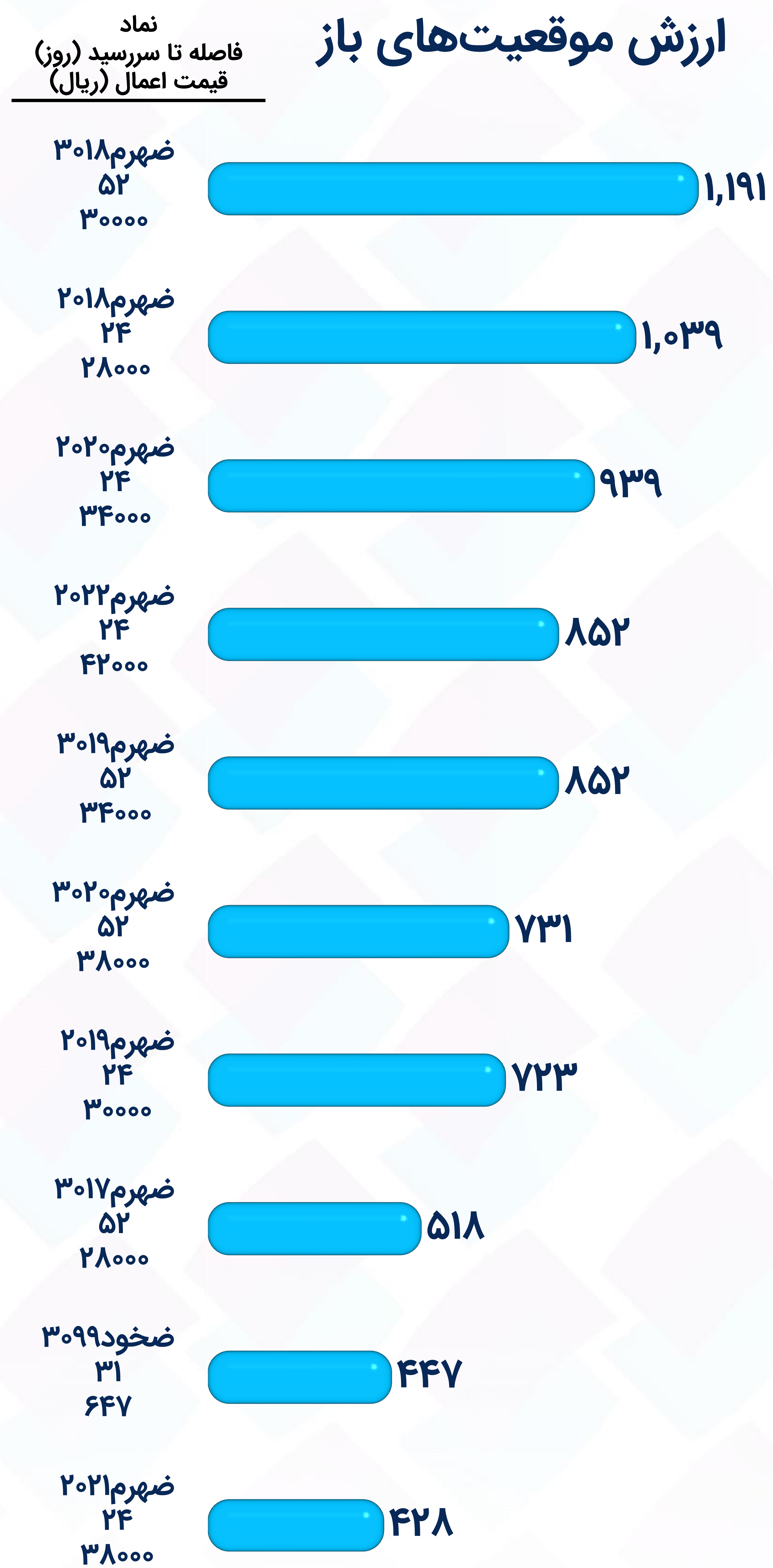
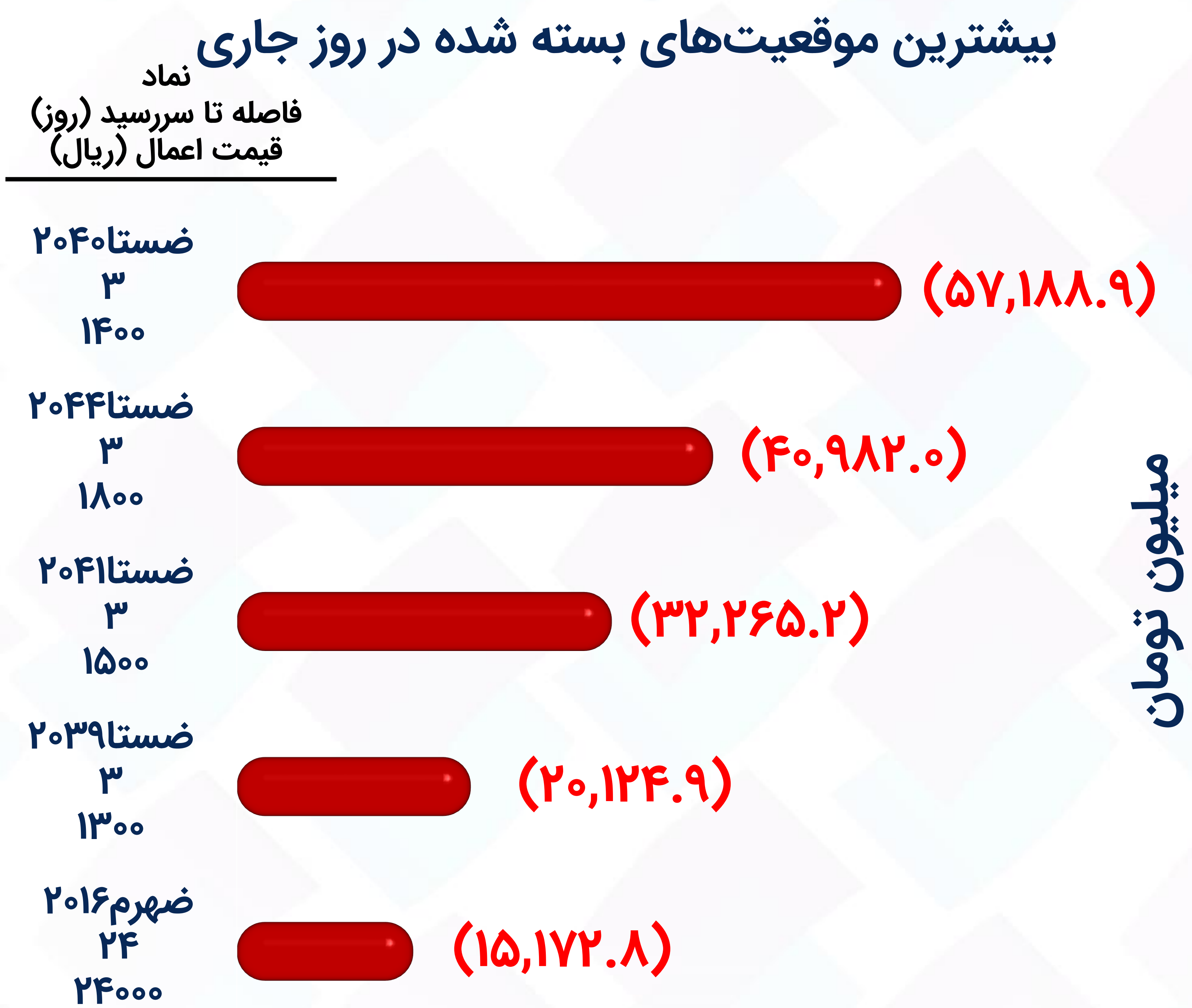
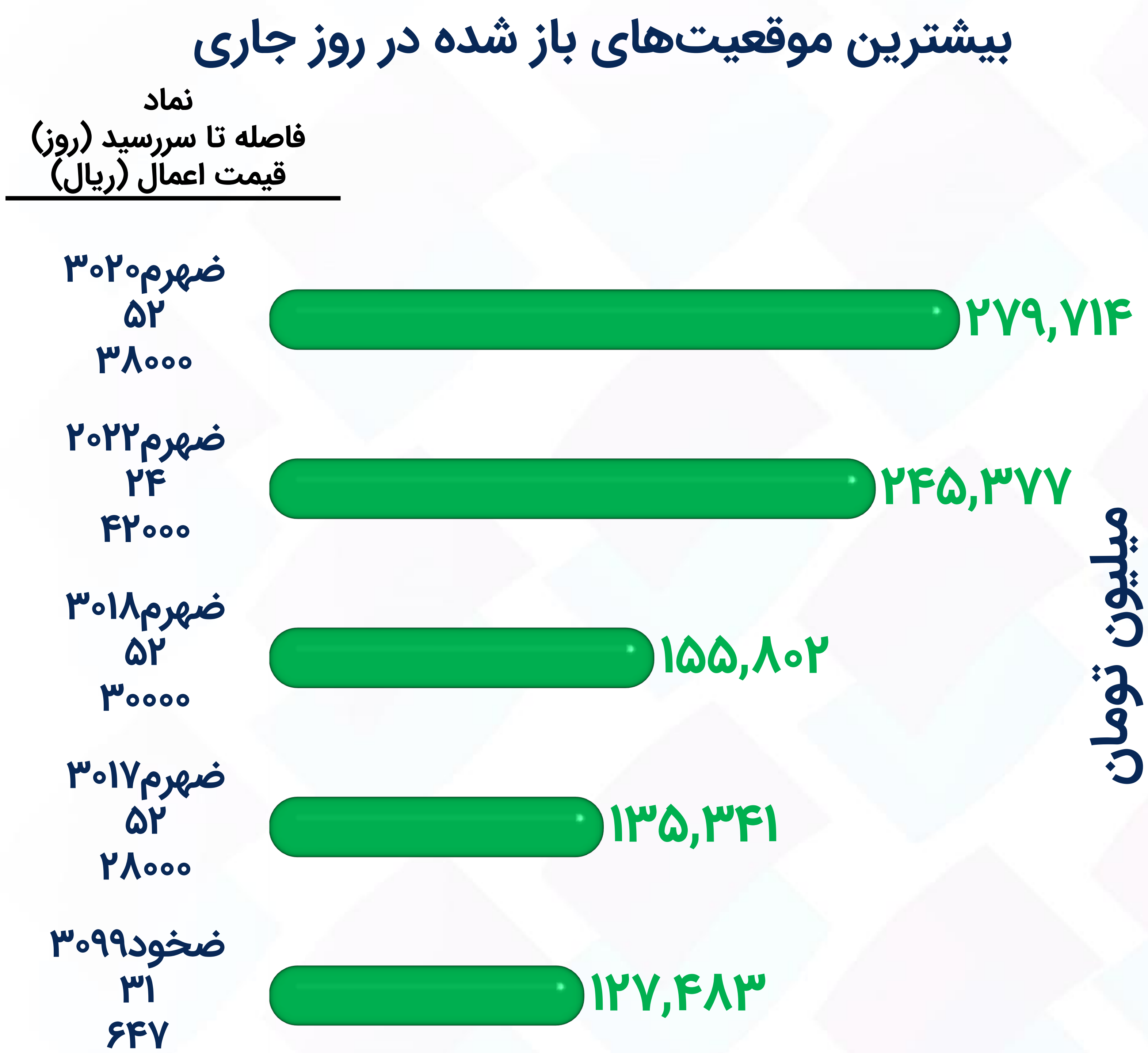
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طستا۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۳	۱.۰	۱	۱,۶۶۱	۱,۱۹۹	(۲۷.۸%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب۲۰۰۱	ذوب	۳۰۰	۱۷	۰.۰	۱	۵۳۰	۲۹۹	(۴۳.۶%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۳	۴۵.۳	۱	۱,۶۶۱	۱,۲۹۹	(۲۱.۸%)	۱,۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲۴	۰.۰	۵۰	۳۲,۱۰۰	۱۷,۹۵۰	(۴۴.۱%)	۳۵۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۳۱	۳.۱	۳	۶۲۹	۲۷۹	(۵۵.۶%)	۹۳.۰	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.



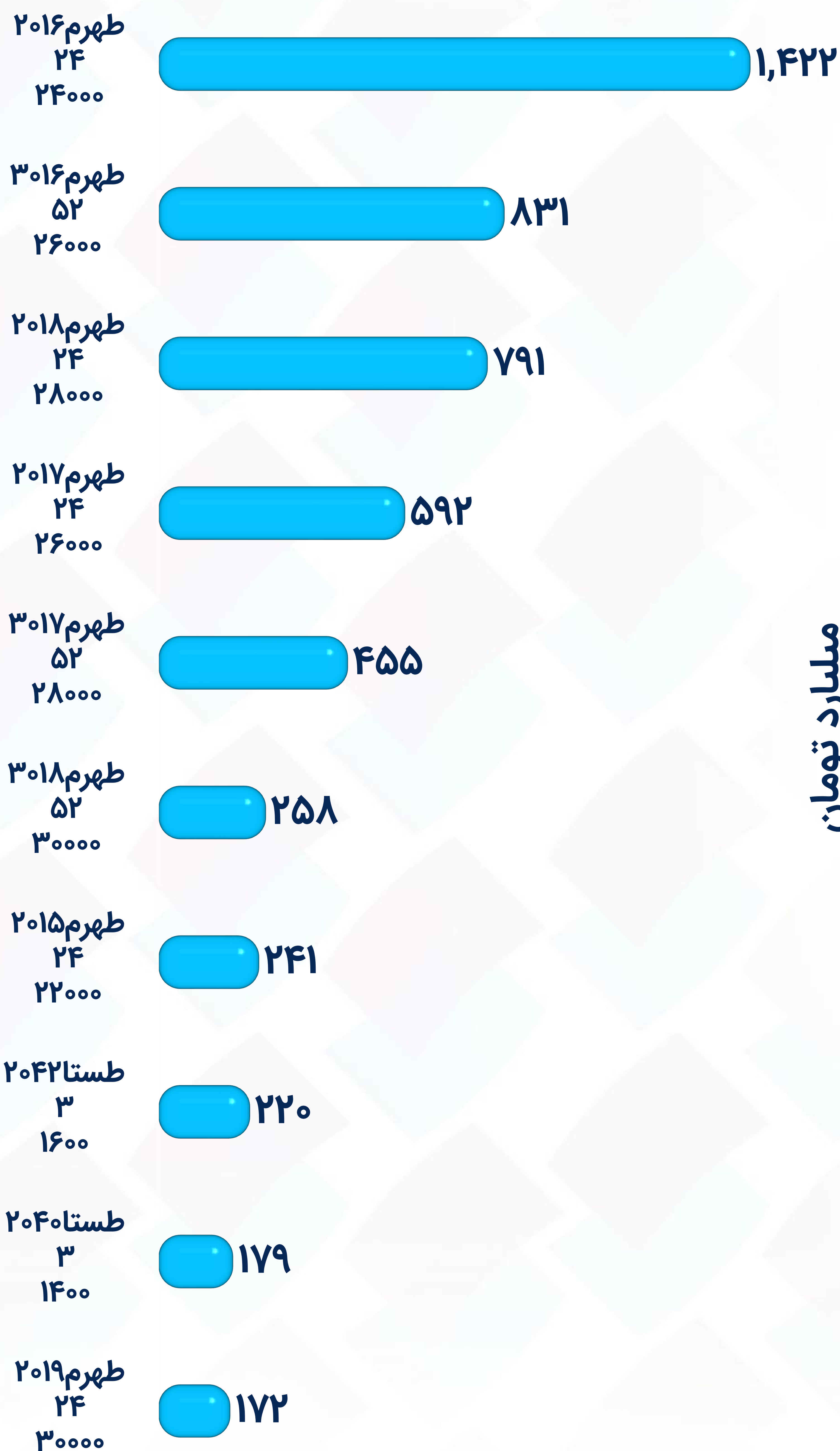
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

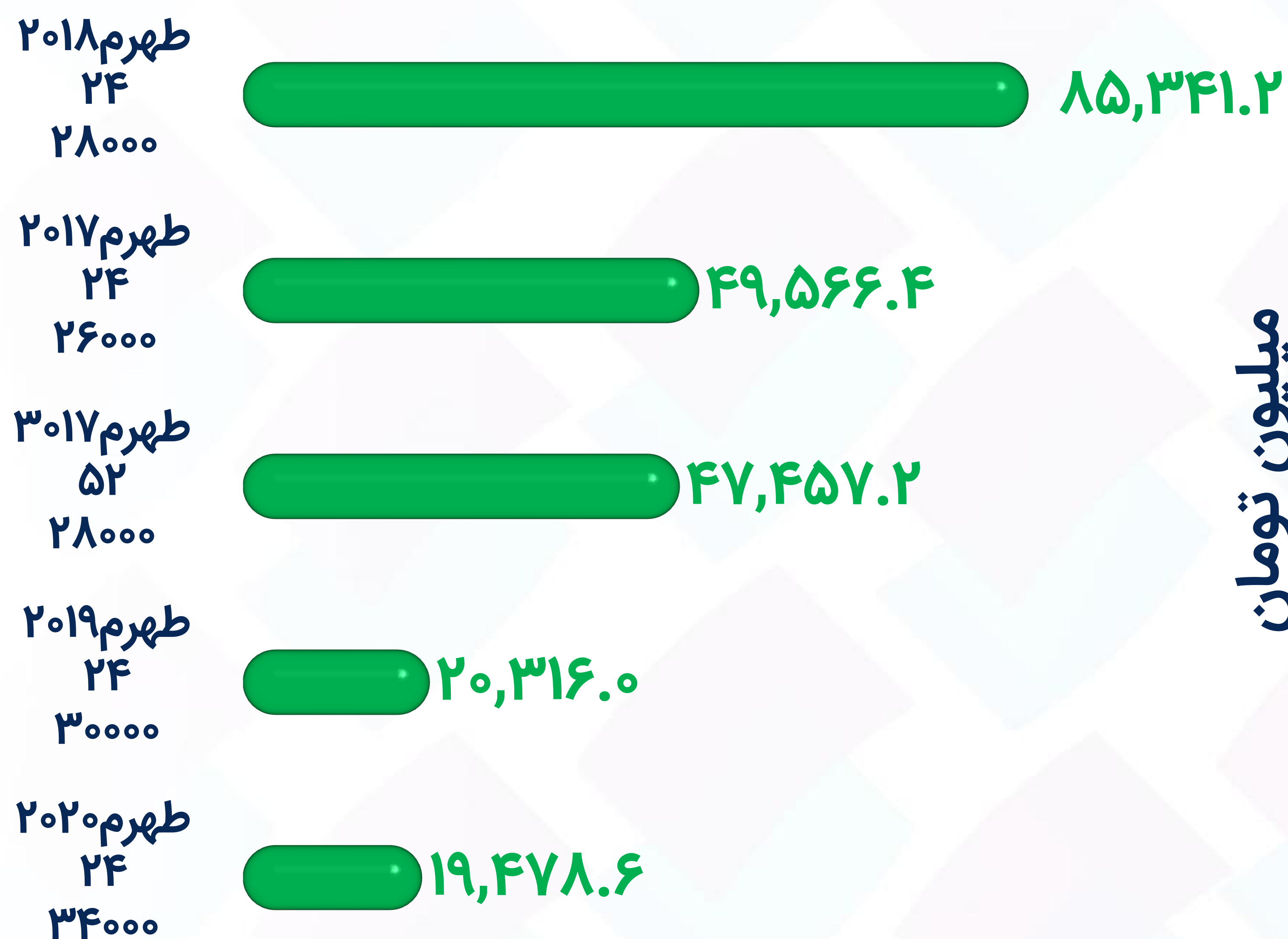
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

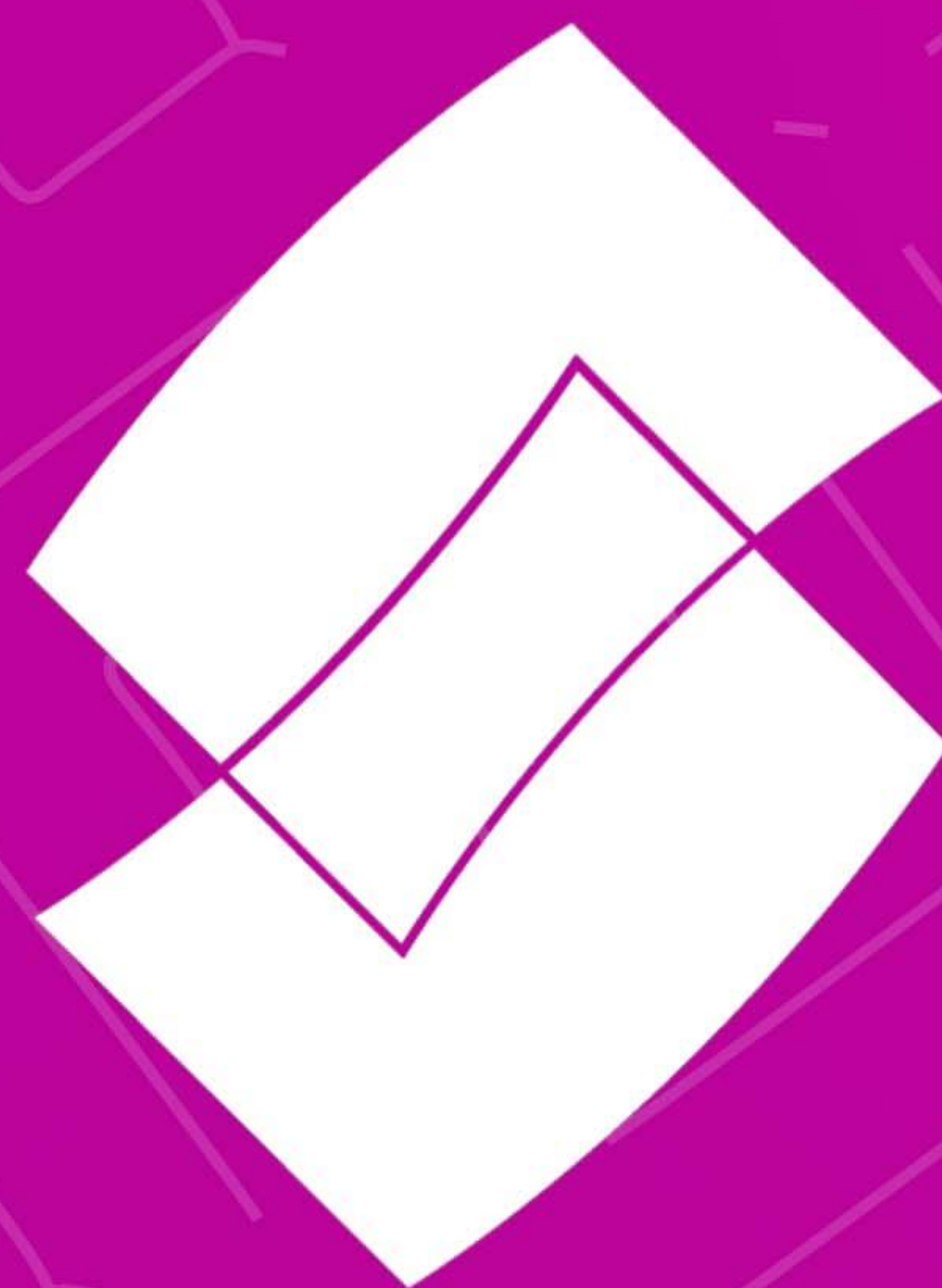
اختیار خرید



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.