

شماره
۴۶۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





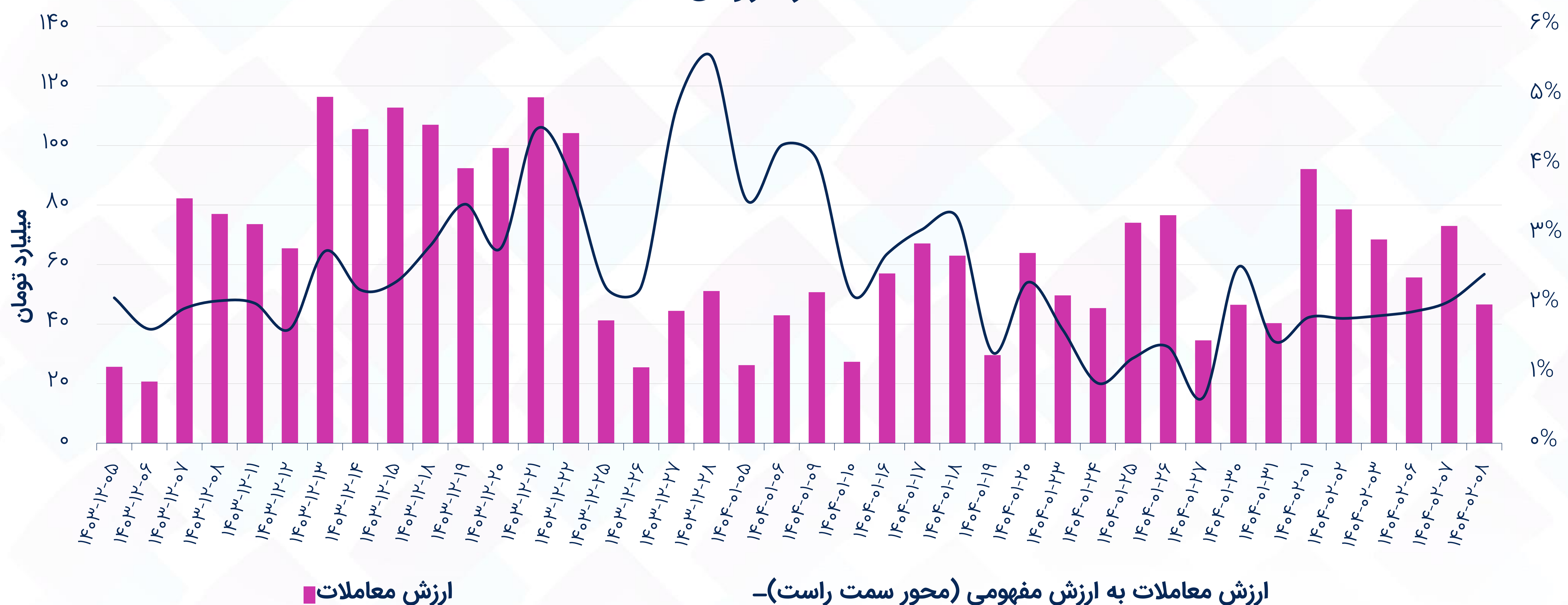
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



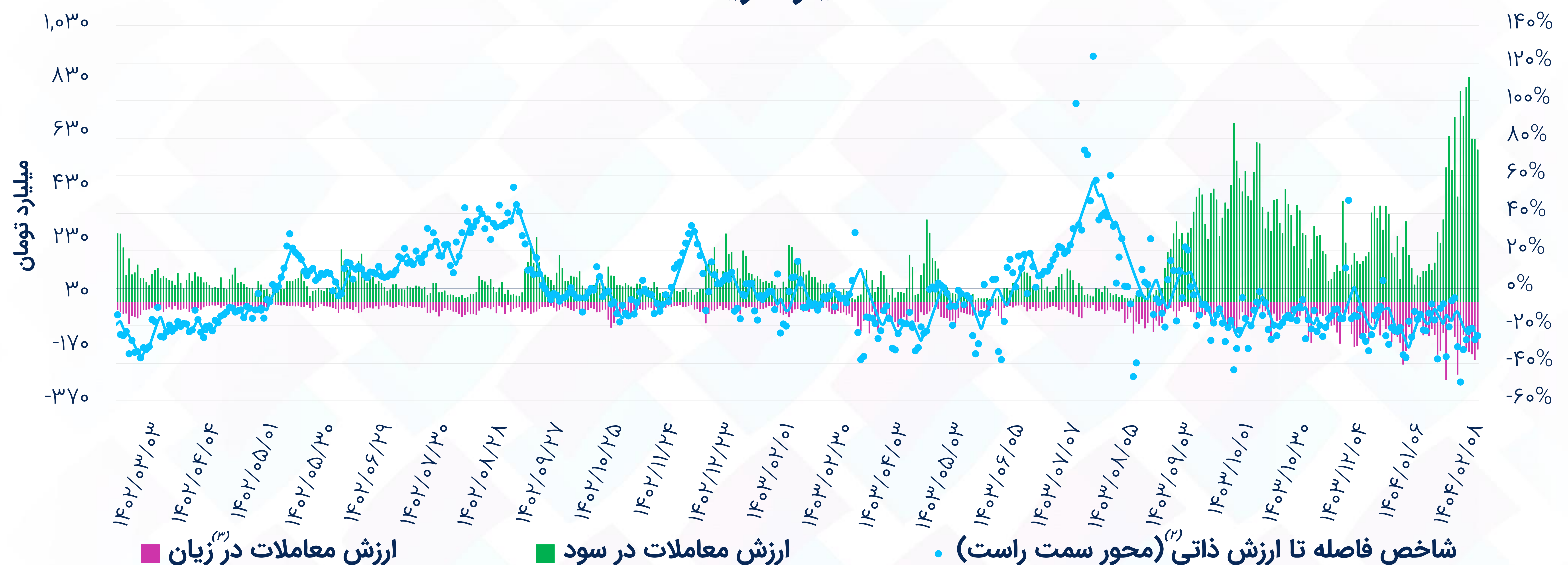
اختیار فروش



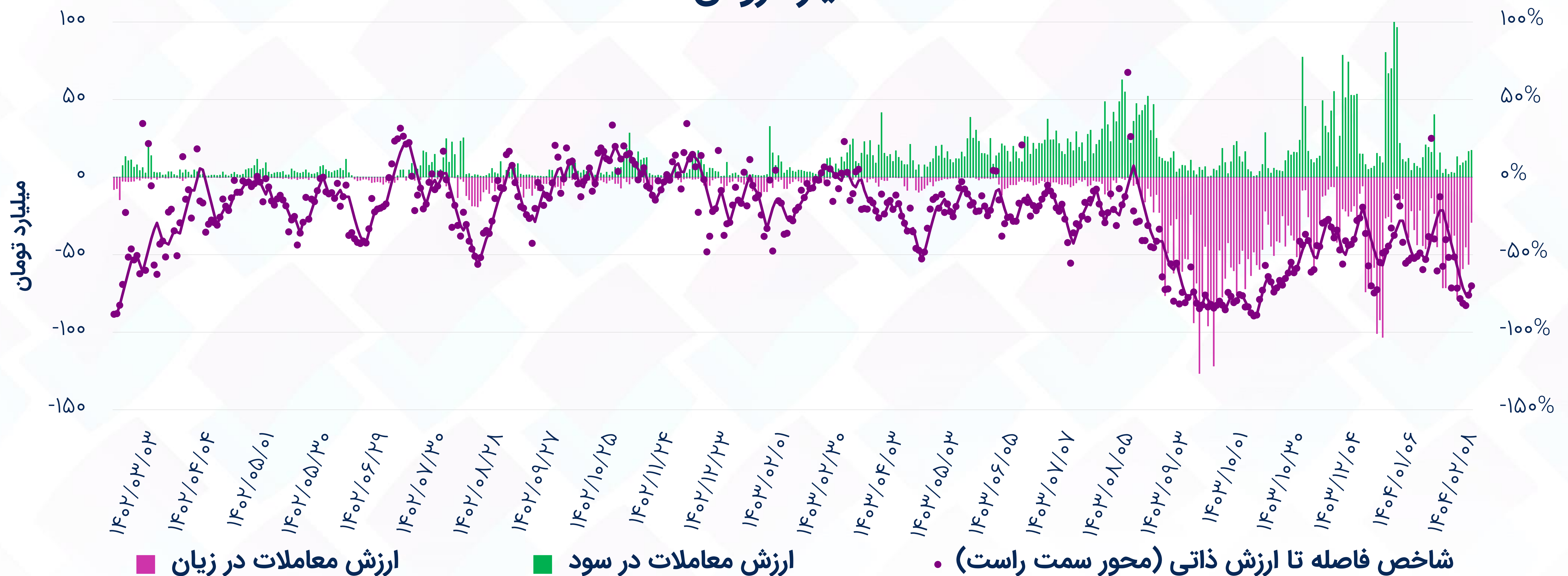
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۵۰	۴۲۵.۶	۲,۶۹۵.۳	۳۳۲.۳	۹۳.۳	(۳۶.۰%)
خودرو	۱۳	۱۱۶.۷	۷۸۸.۵	۵۵.۹	۶۰.۸	(۲۹.۶%)
شستا	۵۰	۱۰۶.۵	۱,۹۲۰.۵	۹۷.۰	۹.۵	۱۶.۸%
ذوب	۲۸	۲۷.۳	۲۱۴.۸	۲۴.۱	۳.۲	(۱۷.۴%)
وبصادر	۱۷	۲۶.۴	۱۱۲.۵	۲۵.۰	۱.۴	(۱۵.۴%)
وبملت	۲۶	۱۴.۳	۱۱۰.۹	۱۰.۴	۴.۰	(۳۳.۳%)
وتجارت	۲۰	۱۰.۹	۱۲۵.۸	۸.۱	۲.۸	(۲۰.۵%)

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	۱۷	۲۵,۱۸۲.۱	۹۵۴,۸۹۸.۱	۱,۲۶۲.۶	۲۳,۹۱۹.۵	(۸۰.۴%)
خودرو	۴	۱۶,۸۰۸.۱	۱۶۳,۳۶۰.۳	۱۵,۰۰۱.۴	۱,۸۰۶.۷	(۵۳.۳%)
شستا	۱۳	۴,۲۷۳.۹	۷۸۱,۳۷۱.۷	۱,۰۵۲.۷	۳,۲۲۱.۲	(۷۵.۶%)
ذوب	۲	۲۵۷.۷	۱۲,۶۸۷.۹	۰.۰	۲۵۷.۷	(۷۵.۵%)
وبملت	۵	۴۴.۳	۱,۵۲۷.۳	۰.۵	۴۳.۷	(۶۴.۷%)
خودران	۱	۱۱.۶	۱۳۶.۶	۱۱.۶	۰.۰	(۳۹.۳%)
وبصادر	۲	۹.۷	۱,۲۴۱.۸	۰.۰	۹.۷	(۹۸.۸%)

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



میلیون تومان



میلیارد تومان



میلیون تومان



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۵,۰۲۸

شستا ۷۵۲

خودرو ۱۰۷

ذوب ۴۰

وبملت ۲۴

وتعاون ۱۶

شتاب ۱۰

وبصادر ۳.۱۴

خودران ۱.۹۳

شپنا ۱.۷۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۲۵,۰۶۷.۱

شستا ۱۰,۲۶۳.۰

ذوب ۴,۳۸۲.۵

وبصادر ۳۶۳.۱

وبملت ۲۸۵.۶

میلیون تومان

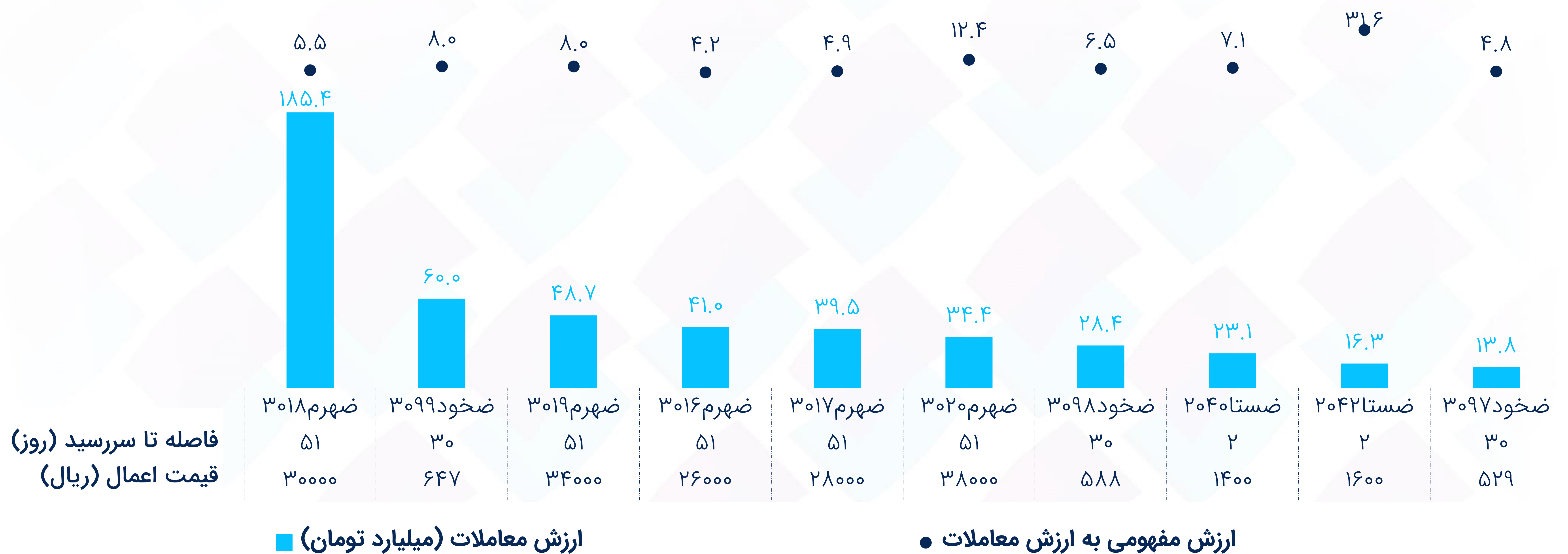
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۶۰,۱۷۶.۰)

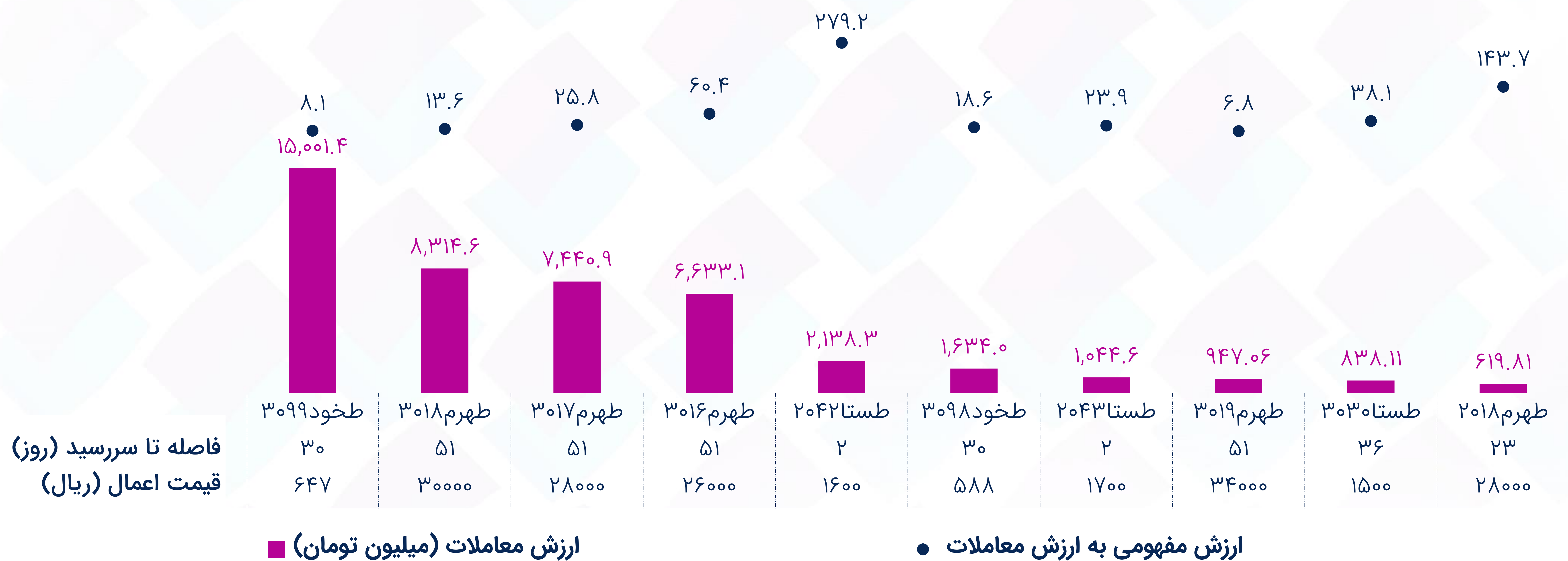
میلیون تومان

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
ضتیام ۴۰۲	تیام	۱۰,۰۰۰	۸۳	۱۲۸.۹	۱,۹۸۰	۱۵,۲۵۱	۱۱,۹۸۰	(۲۱.۴%)	۶.۱	۱.۰۰	۵,۹۵۹	۲۰۱%
ضستا ۲۰۴۲	شستا	۱,۶۰۰	۲	۱۶,۲۸۲.۴	۵۳	۱,۶۷۵	۱,۶۵۳	(۱.۳%)	۳۱.۲	۰.۹۴	۸۳	۵۶%
ضاساس ۲۱۰	آساس	۵۰,۰۰۰	۲۰	۳۶.۴	۲,۷۵۹	۵۲,۵۳۵	۵۲,۷۵۹	۰.۴%	۱۹.۱	۰.۸۸	۳,۷۰۵	۳۴%
ضهرم ۲۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۲۳	۲.۴	۱۲,۰۰۱	۳۱,۶۱۰	۲۸,۰۰۱	(۱۱.۴%)	۲.۳	۱.۰۰	۱۵,۹۹۰	۳۳%
ضستا ۲۰۴۱	شستا	۱,۵۰۰	۲	۱۳,۴۹۱.۹	۱۳۹	۱,۶۷۵	۱,۶۳۹	(۲.۱%)	۱۱.۸	۱.۰۰	۱۸۱	۳۰%

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 ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۶	۱۰.۵	۲	۵۲۹	۸۰۲	۵۲%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۴۴	۱۰.۲	۲۱	۵۲۹	۹۲۱	۷۴%	۴۳.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۳۶	۱۸.۰	۲۴	۴,۲۰۵	۶,۵۰۴	۵۵%	۲۷۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضبساما ۵۱۰	بساما	۱۳,۰۰۰	۹۰	۵۴.۴	۵۲۸	۸,۸۳۰	۱۳,۵۲۸	۵۳%	۲۵.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۶	۱۷.۹	۳	۵۲۹	۷۰۳	۳۳%	۲۳۴.۳	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	۵۱	۳۴.۷	۱۰,۸۳۷	۳۱,۶۱۰	۳۱,۱۶۳	(۱.۴%)	۲.۹	-۰.۹۵	۸,۵۴۹	(۲۱.۱%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۳	۲۶۹.۹	۲,۸۳۲	۳۱,۶۱۰	۳۱,۱۶۸	(۱.۴%)	۱۱.۰	-۰.۶۸	۲,۱۹۷	(۲۲.۴%)
طستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۲	۸.۱	۱۶۲	۱,۶۷۵	۱,۶۳۸	(۲.۲%)	۱۰.۱	-۰.۹۸	۱۱۸	(۲۷.۱%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷۹	۱۱.۰	۱۱,۰۰۰	۳۱,۶۱۰	۳۱,۰۰۰	(۱.۹%)	۲.۸	-۰.۸۹	۷,۷۹۵	(۲۹.۱%)
طوتعاون ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۴۹	۲.۳	۶۰	۱,۶۹۵	۱,۶۴۰	(۳.۲%)	۲۷.۳	-۰.۳۲	۳۸	(۳۶.۲%)

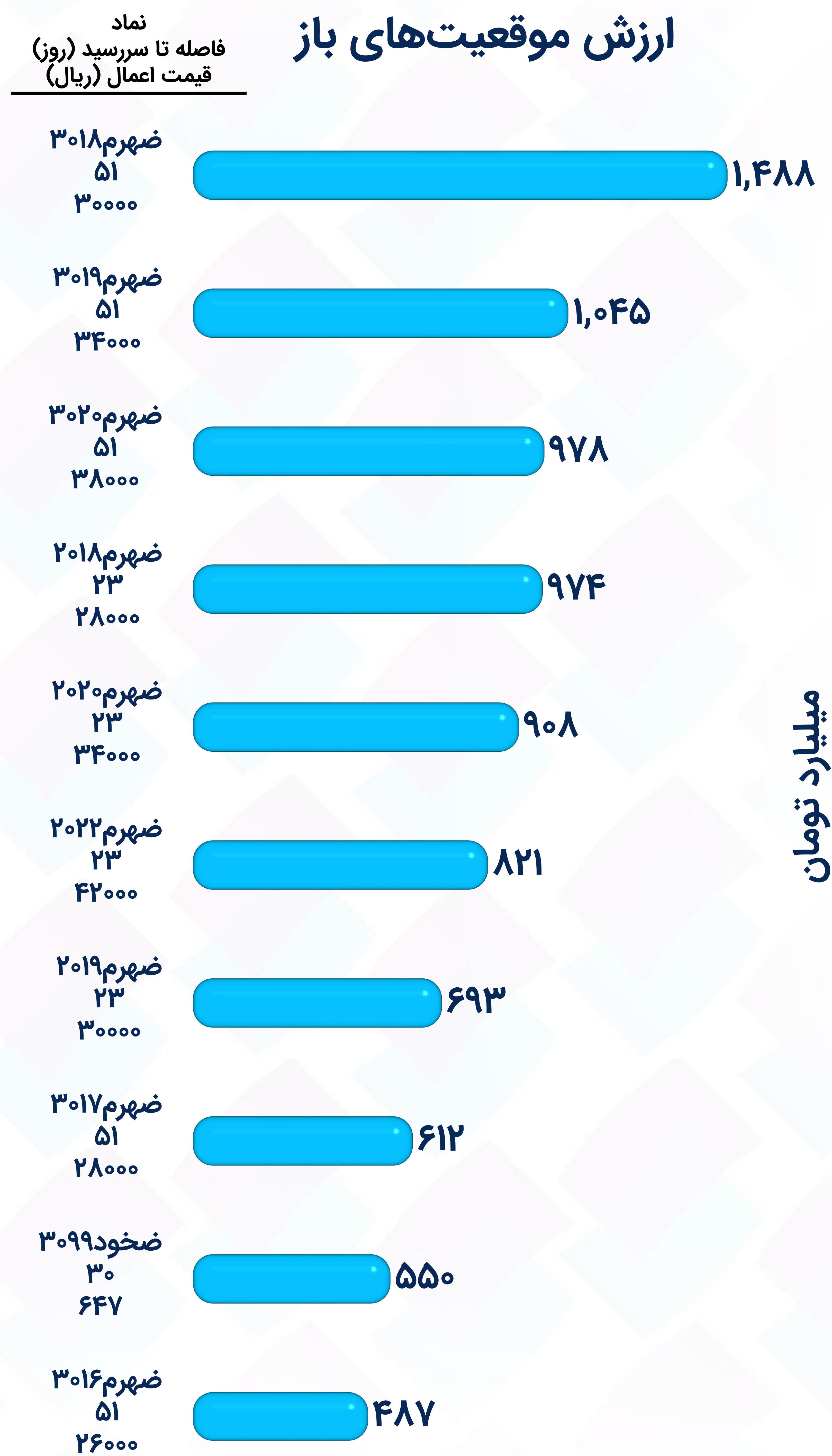
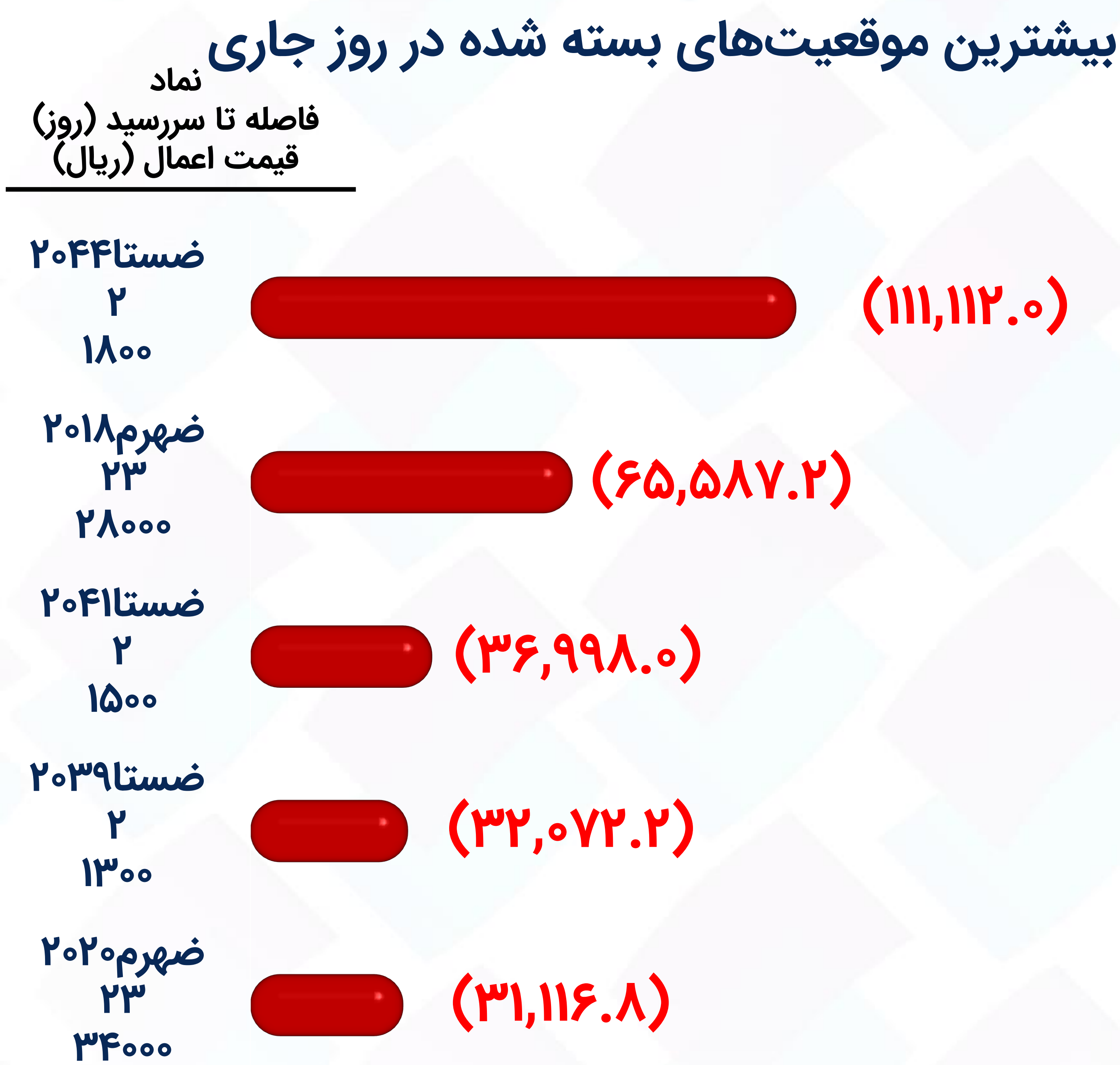
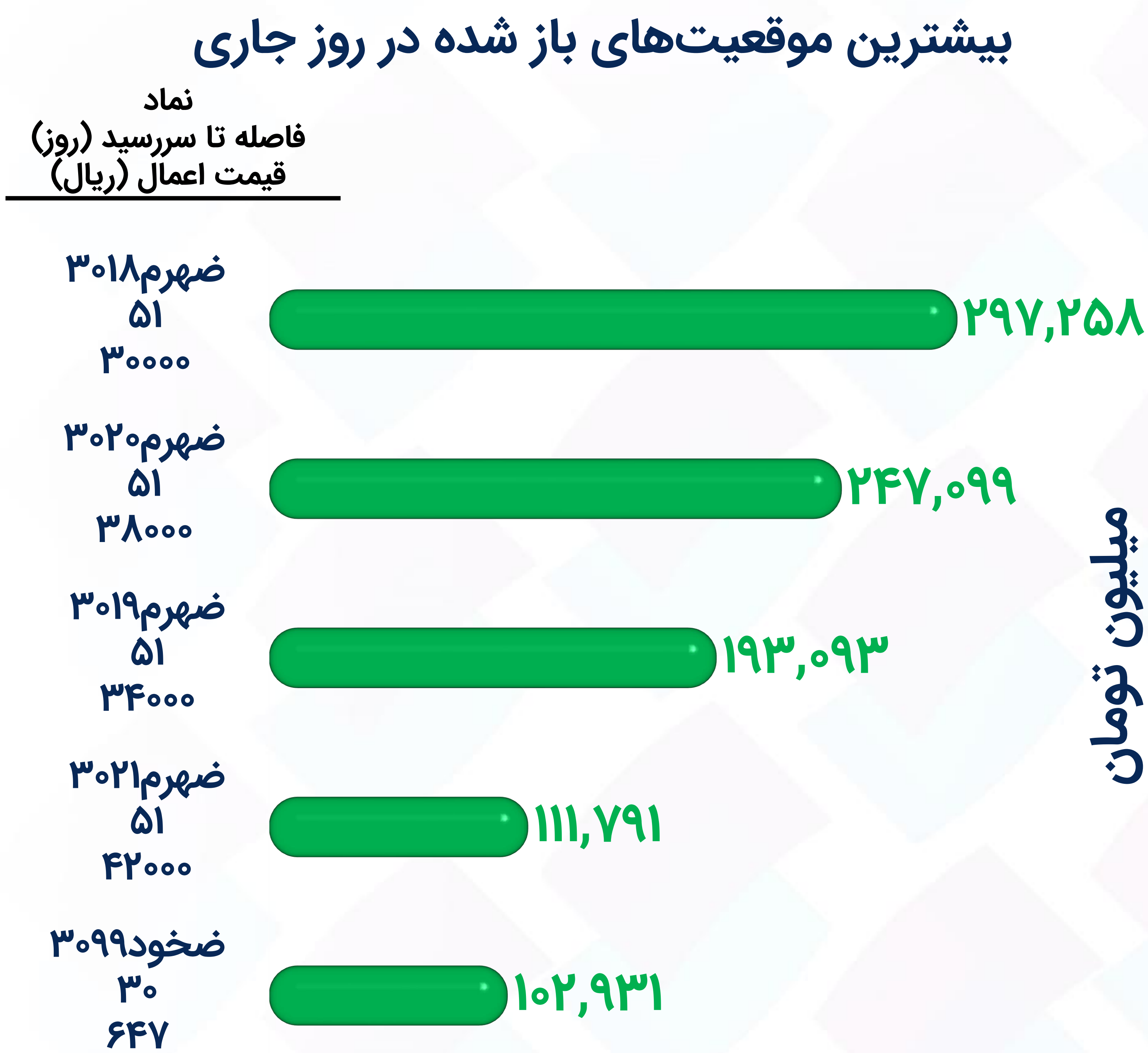
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۲	۱.۵	۱	۱,۶۷۵	۱,۱۹۹	(۲۸.۴%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۲	۰.۵	۱	۱,۶۷۵	۱,۲۹۹	(۲۲.۴%)	۱,۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طتاب ۲۰۰۴	شتاب	۱۳,۰۰۰	۲	۰.۰	۱	۱۷,۵۳۰	۱۲,۹۹۹	(۲۵.۸%)	۱۲,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۴۰	شستا	۱,۴۰۰	۲	۶.۵	۱	۱,۶۷۵	۱,۳۹۹	(۱۶.۵%)	۱,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۳۰	۰.۲	۶	۶۳۴	۲۷۶	(۵۶.۵%)	۴۶.۰	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

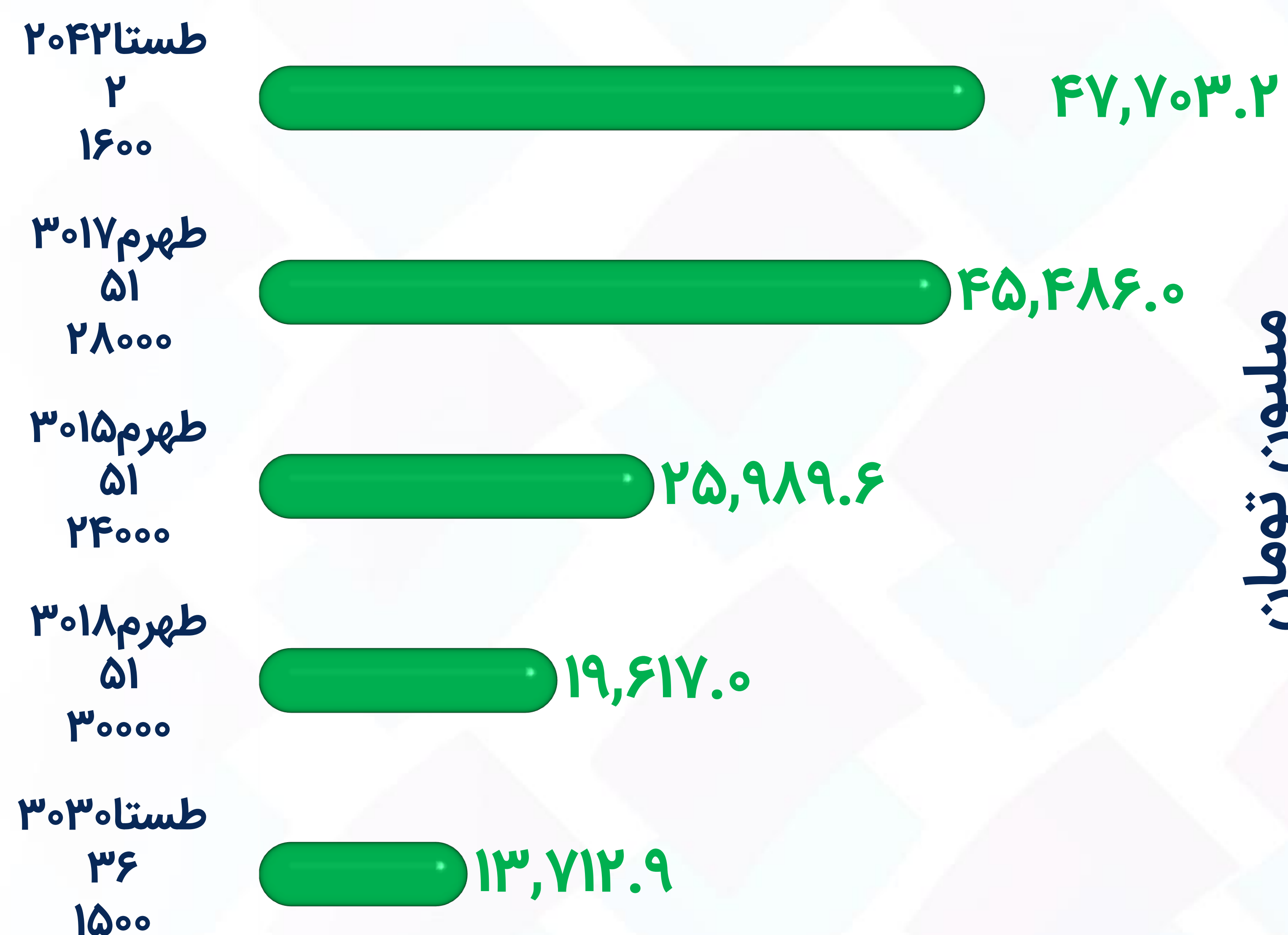
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

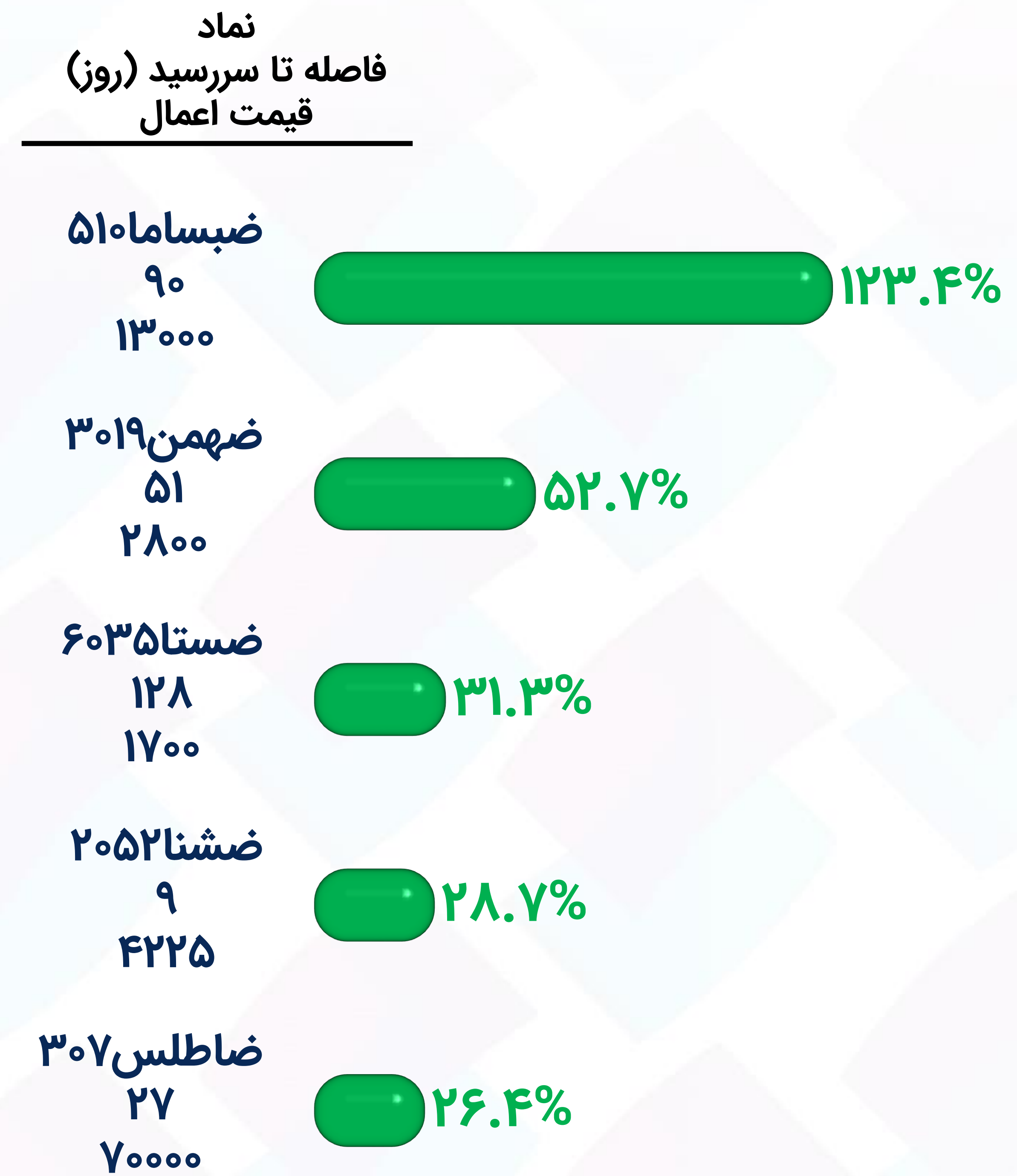
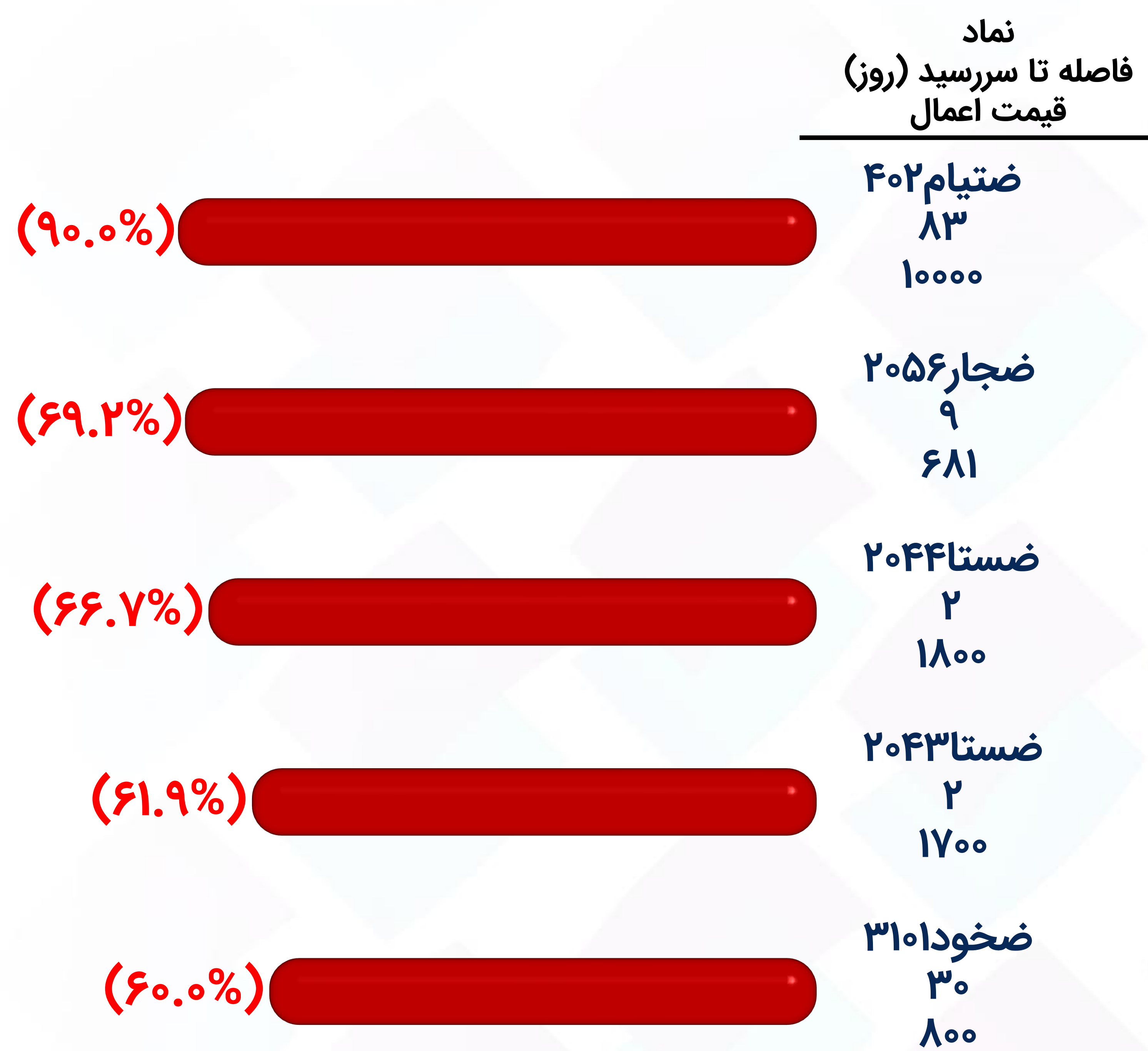
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



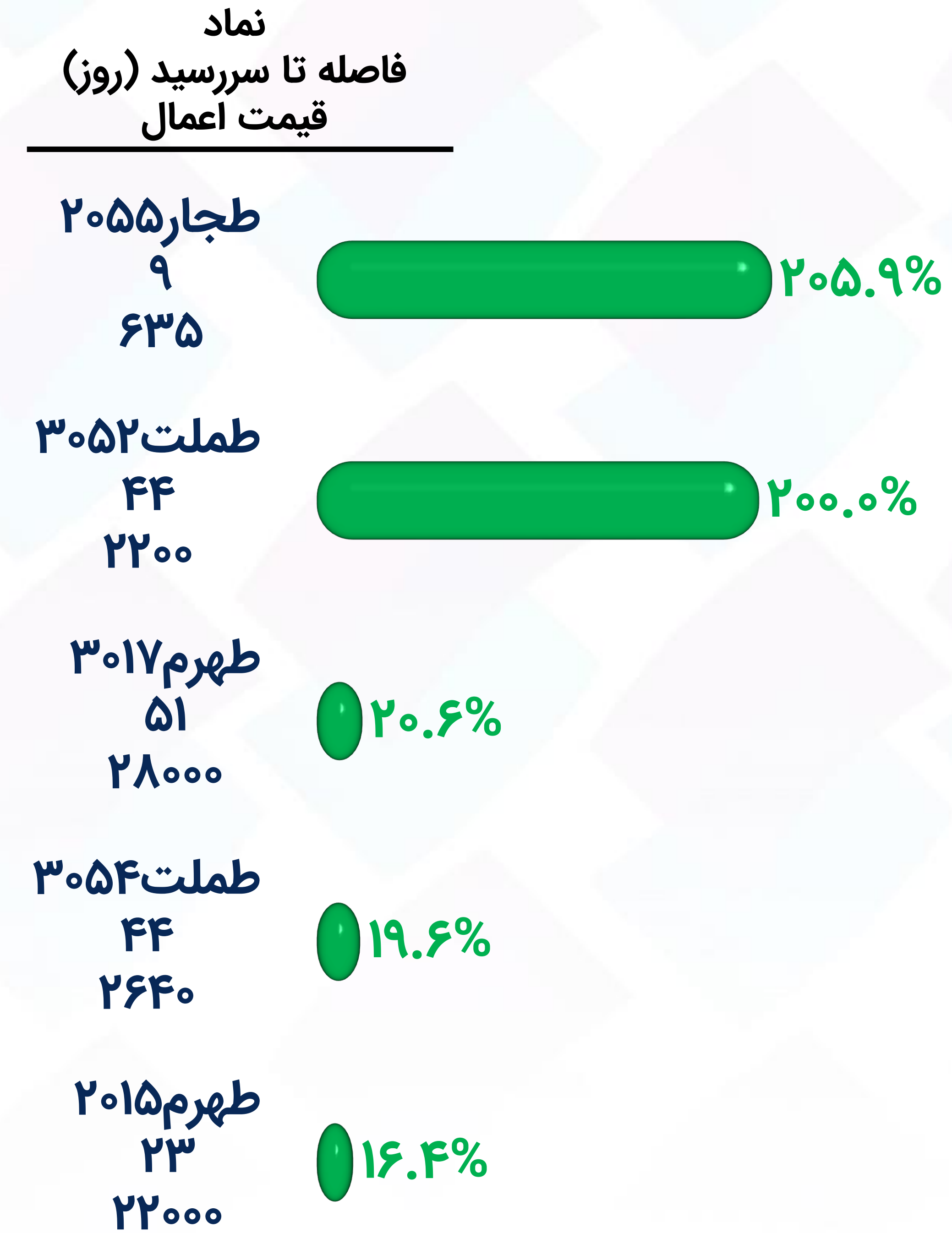
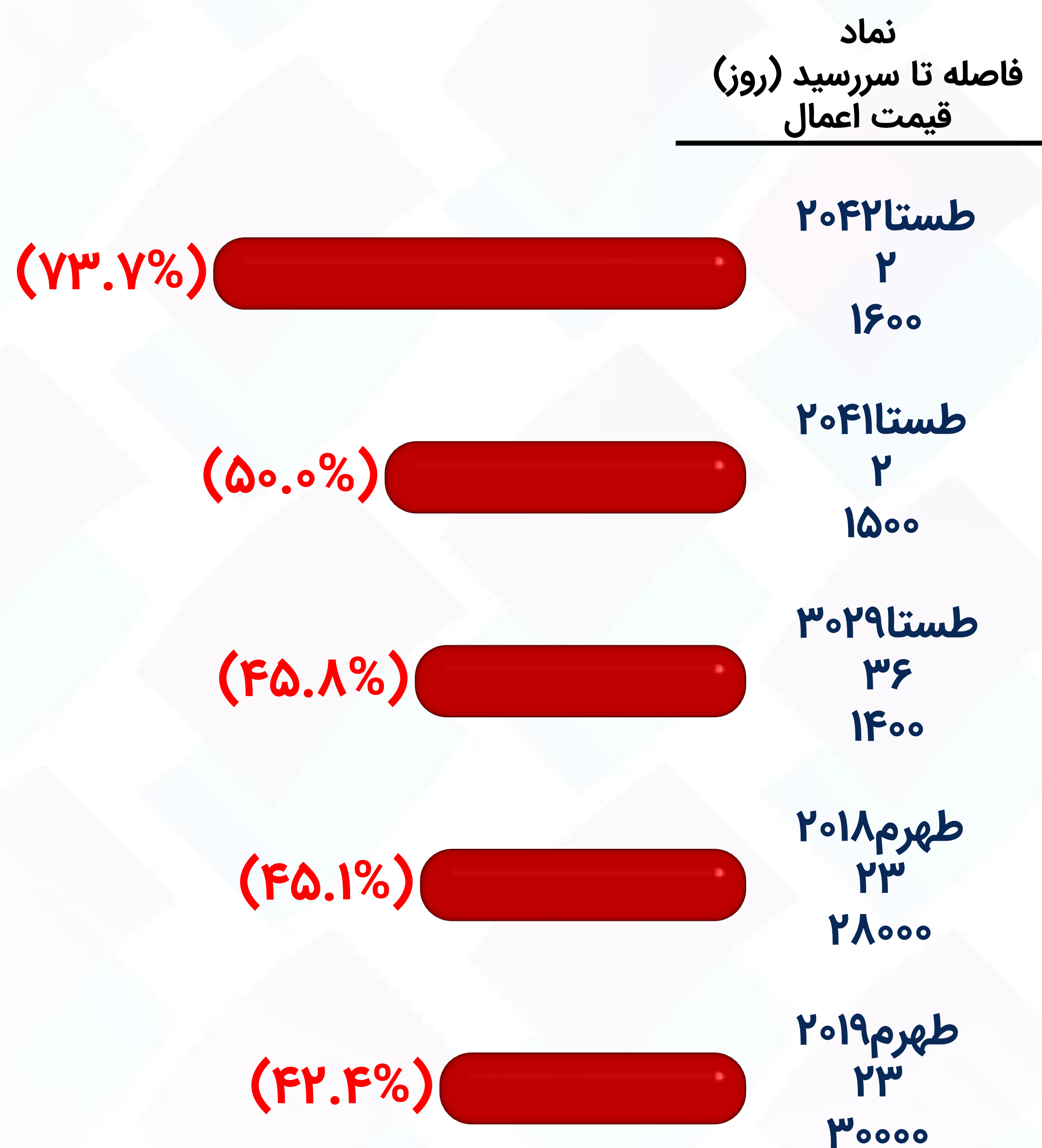
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

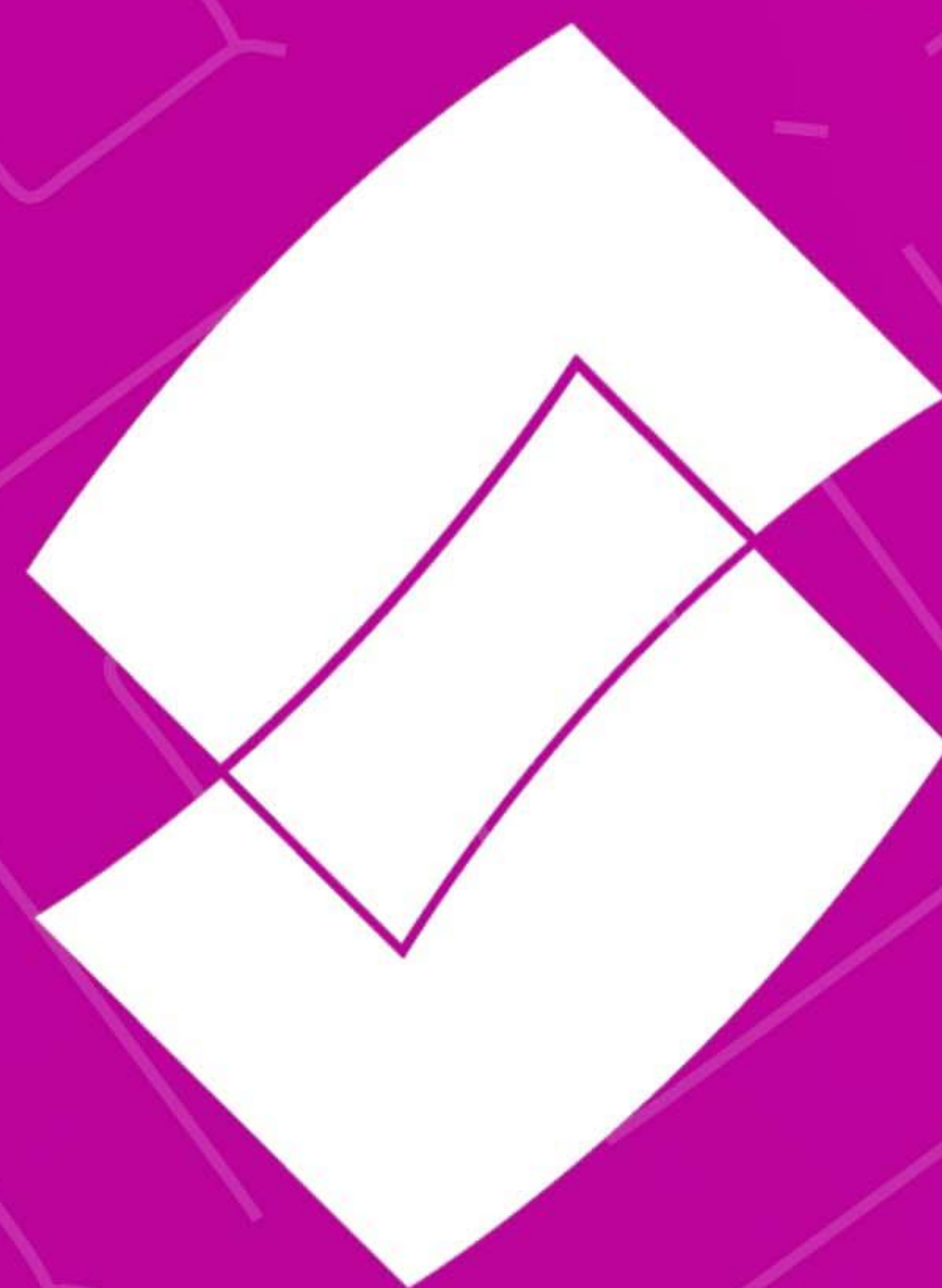
اختیار خرید



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.