

شماره
۴۶۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۹ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





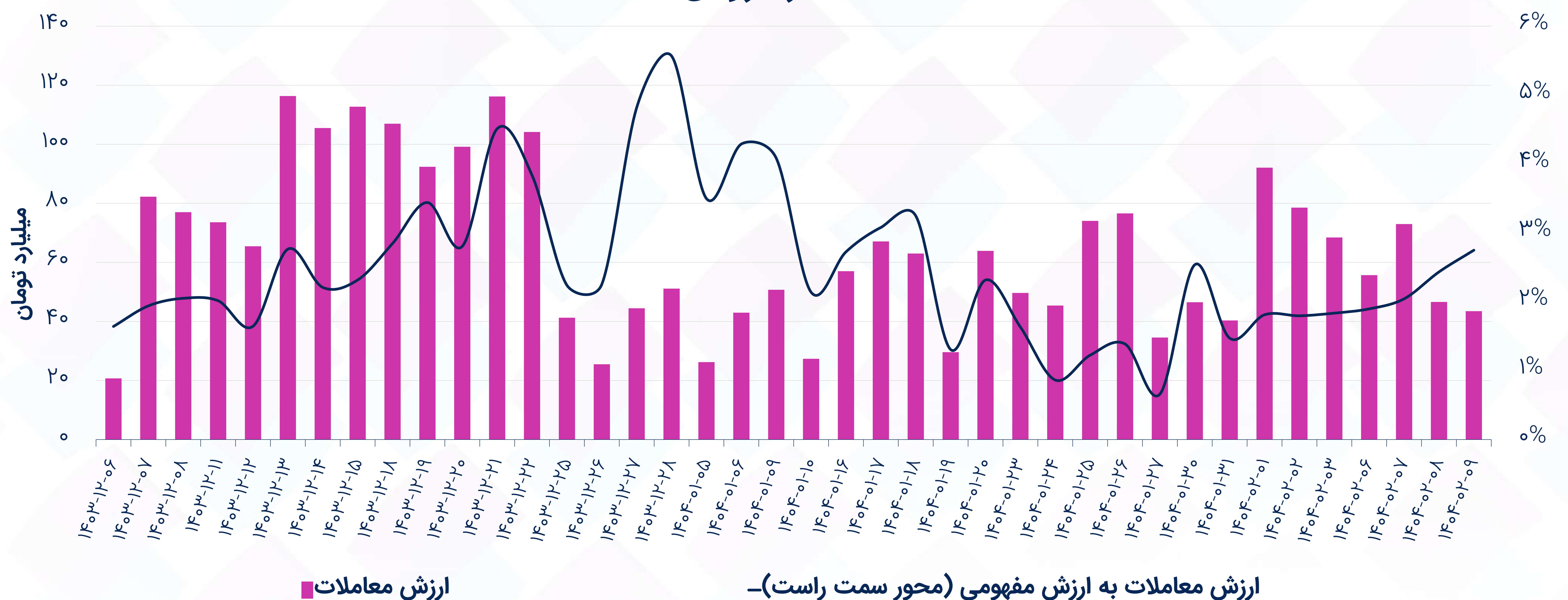
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



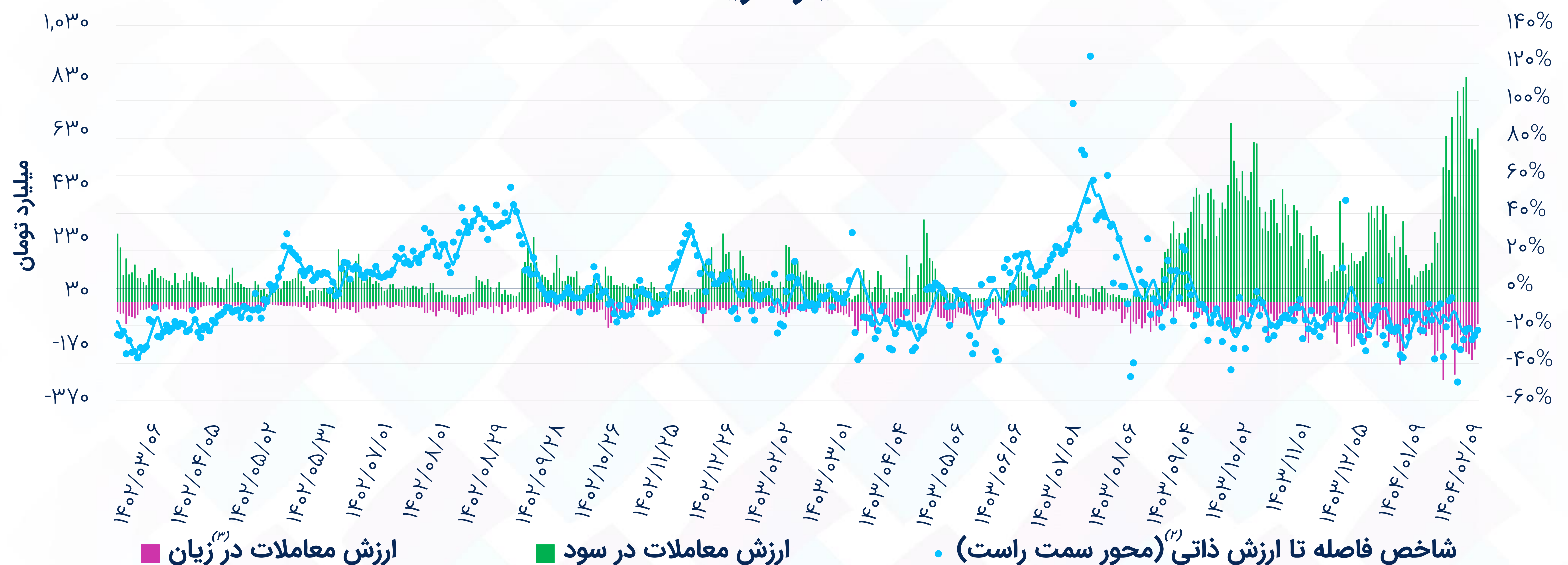
اختیار فروش



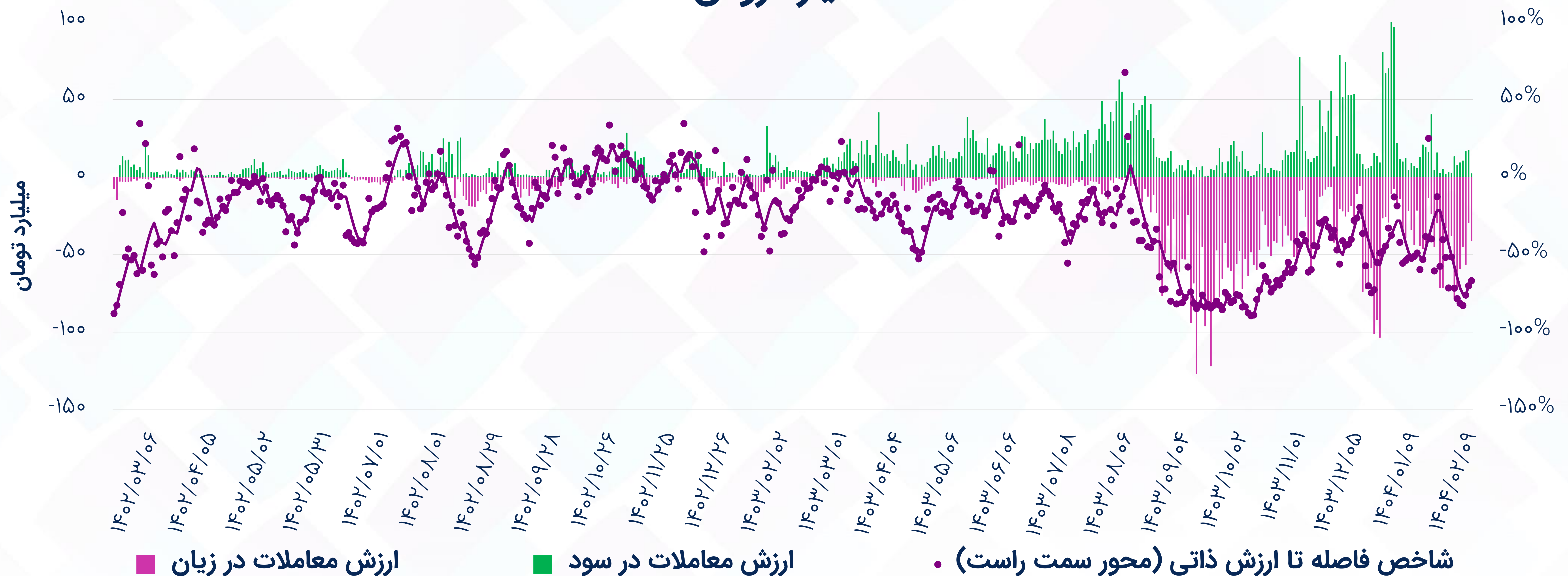
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

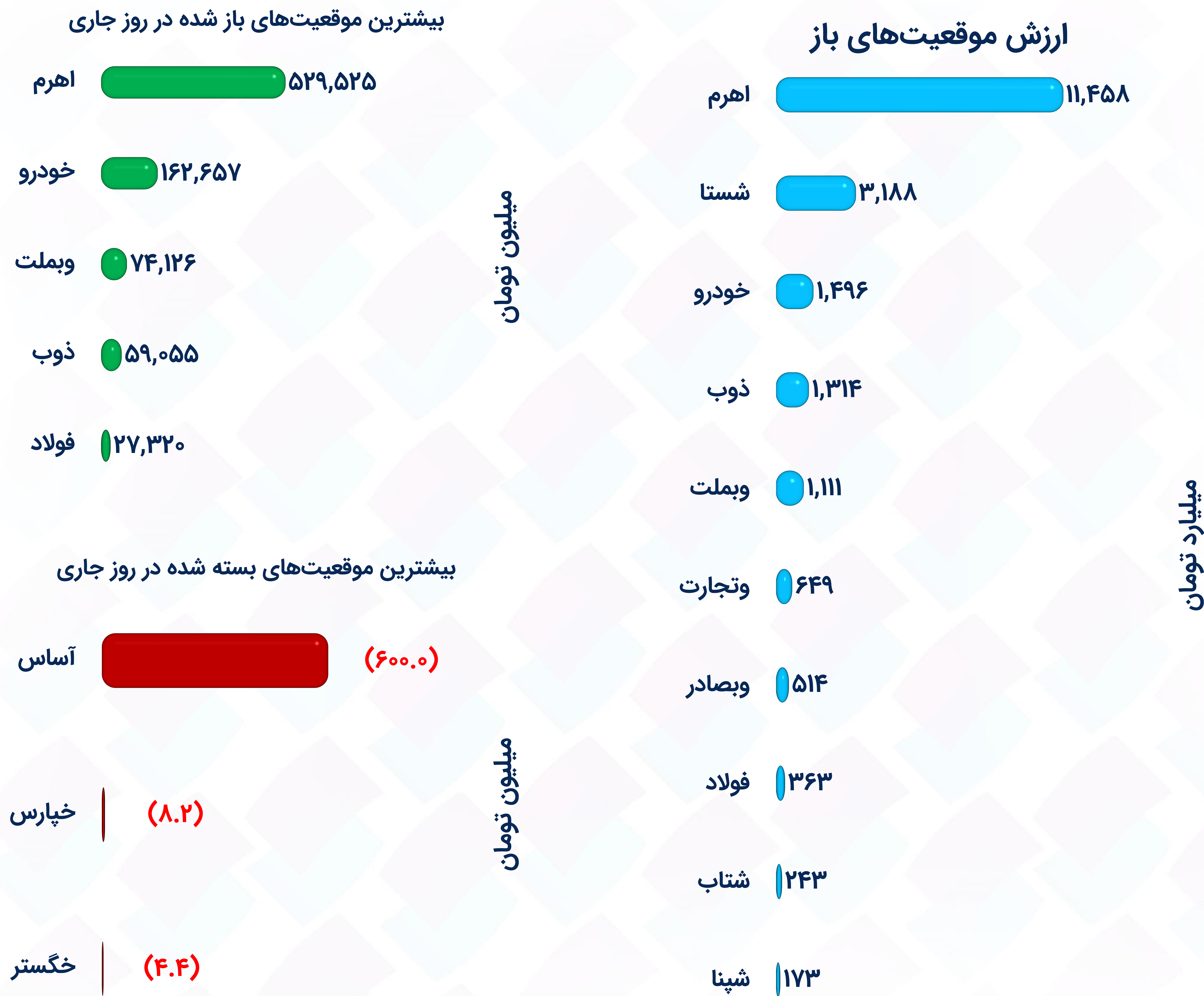
اختیار خرید

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	۴۲	۳۳۸.۶	۲,۲۰۲.۶	۲۷۵.۵	۶۳.۲	(۳۴.۷%)
خودرو	۱۳	۱۹۳.۸	۱,۲۹۹.۸	۱۹۱.۲	۲.۶	(۲۰.۶%)
شستا	۵۱	۹۲.۷	۱,۸۵۵.۹	۸۶.۴	۶.۲	۱۰.۸%
ذوب	۲۹	۳۱.۲	۲۳۴.۷	۲۷.۸	۳.۴	(۱۴.۶%)
وبملت	۳۰	۱۸.۶	۱۳۵.۵	۱۶.۳	۲.۳	(۲۴.۱%)
وبصادر	۱۸	۱۵.۱	۶۳.۵	۱۴.۵	۰.۶	(۸.۴%)
شتاب	۱۶	۱۳.۳	۶۸.۴	۱۲.۸	۰.۵	۲.۸%

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	۱۶	۲۵,۶۸۱.۴	۱,۰۲۱,۹۳۲.۴	۱,۰۲۷.۳	۲۴,۶۵۴.۱	(۷۶.۶%)
خودرو	۴	۱۵,۰۲۲.۶	۱۷۴,۰۵۵.۹	۰.۰	۱۵,۰۲۲.۶	(۵۵.۹%)
شستا	۱۳	۲,۴۵۴.۳	۳۶۴,۰۹۳.۰	۱,۱۱۷.۶	۱,۳۳۶.۶	(۳۲.۵%)
ذوب	۳	۱۸۰.۶	۱۷,۰۶۴.۳	۰.۰	۱۸۰.۶	(۷۸.۴%)
وتعاون	۲	۶۲.۰	۲,۲۴۳.۶	۲۱.۷	۴۰.۳	(۲۱.۳%)
وتجارت	۳	۵۹.۱	۹۳۷.۶	۵۸.۱	۱.۰	(۵.۰%)
وبملت	۳	۱۰.۳	۵۱۹.۱	۰.۰	۱۰.۳	(۶۸.۷%)

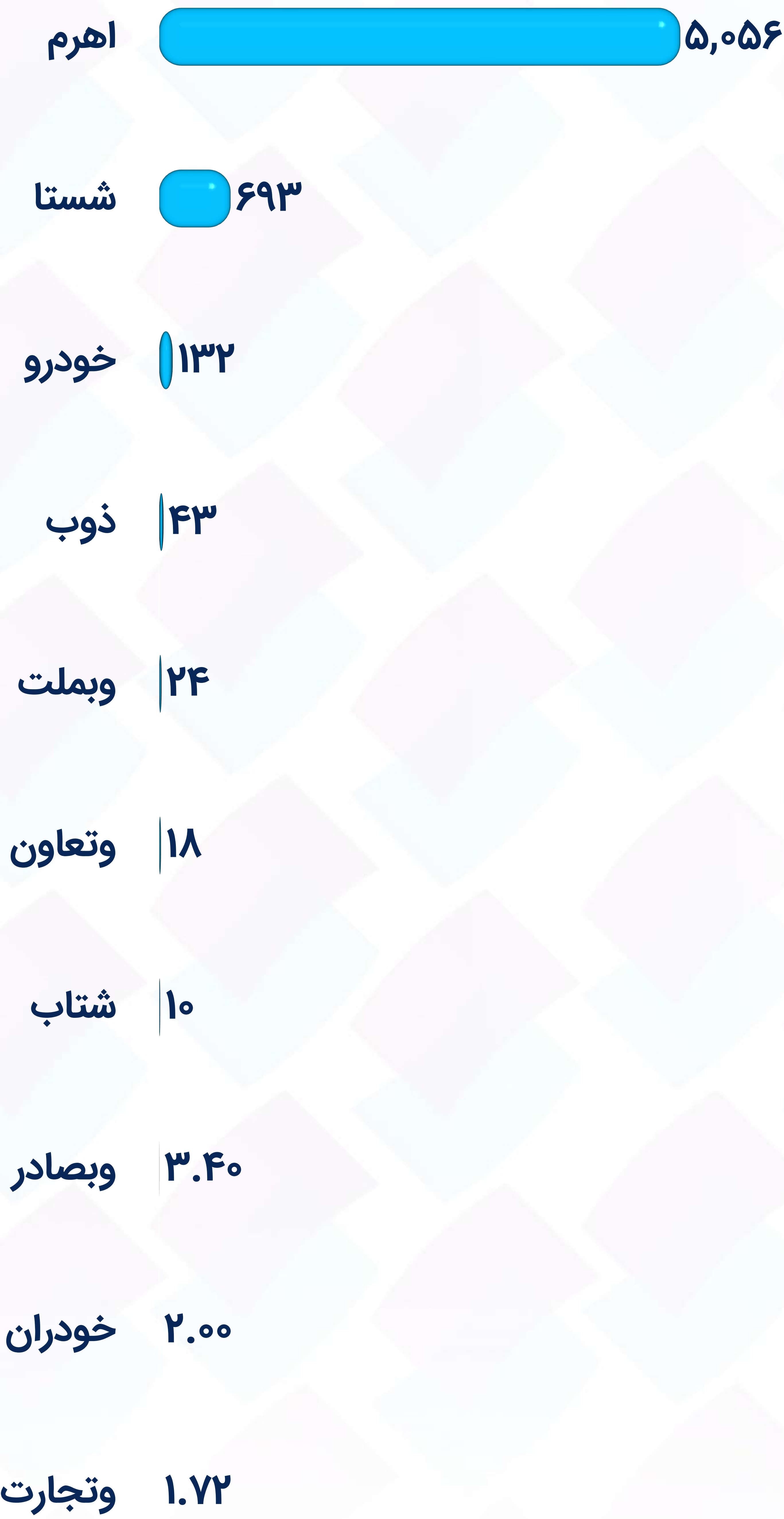
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

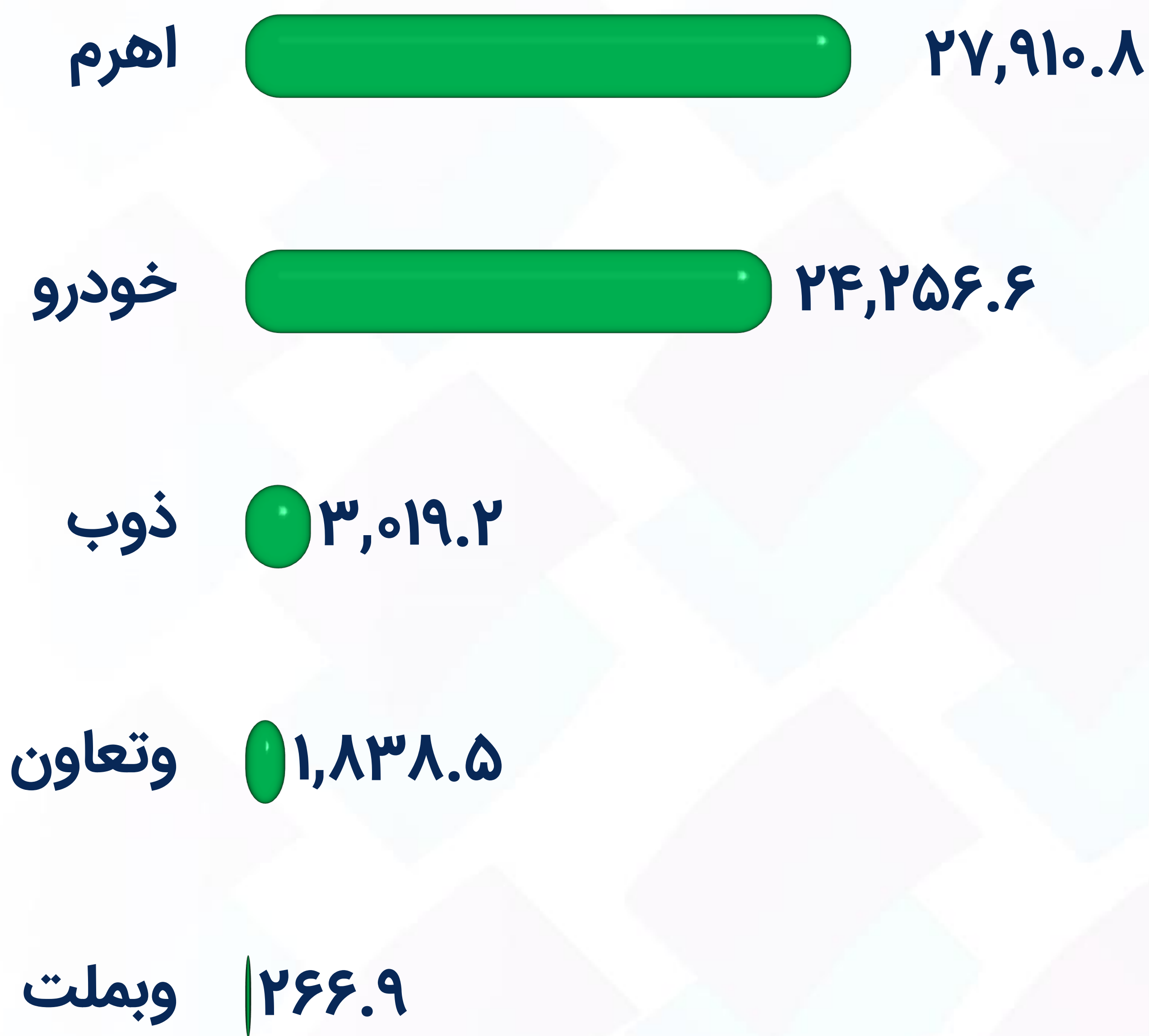
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



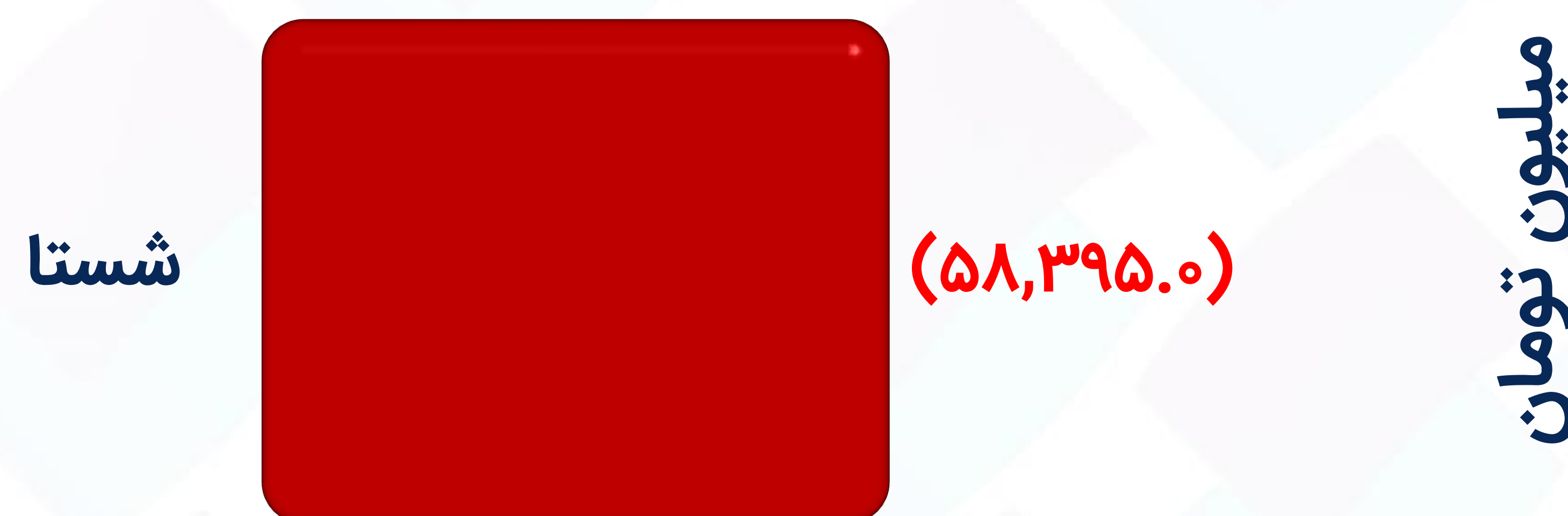
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

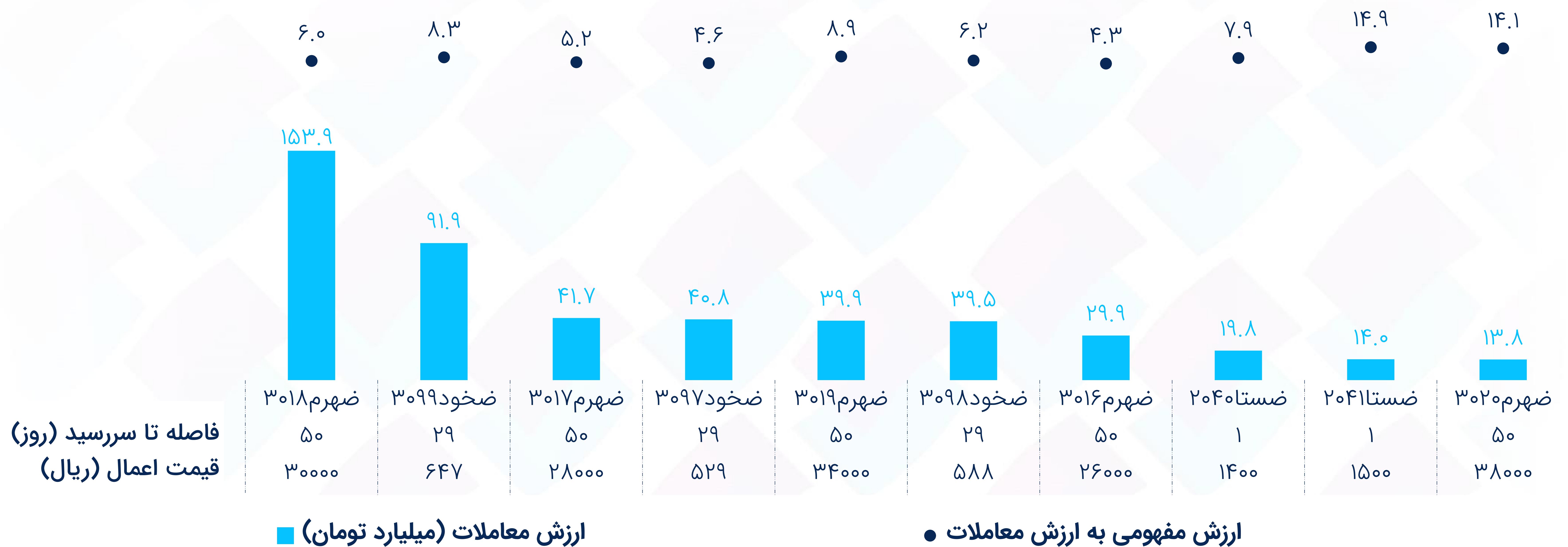
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



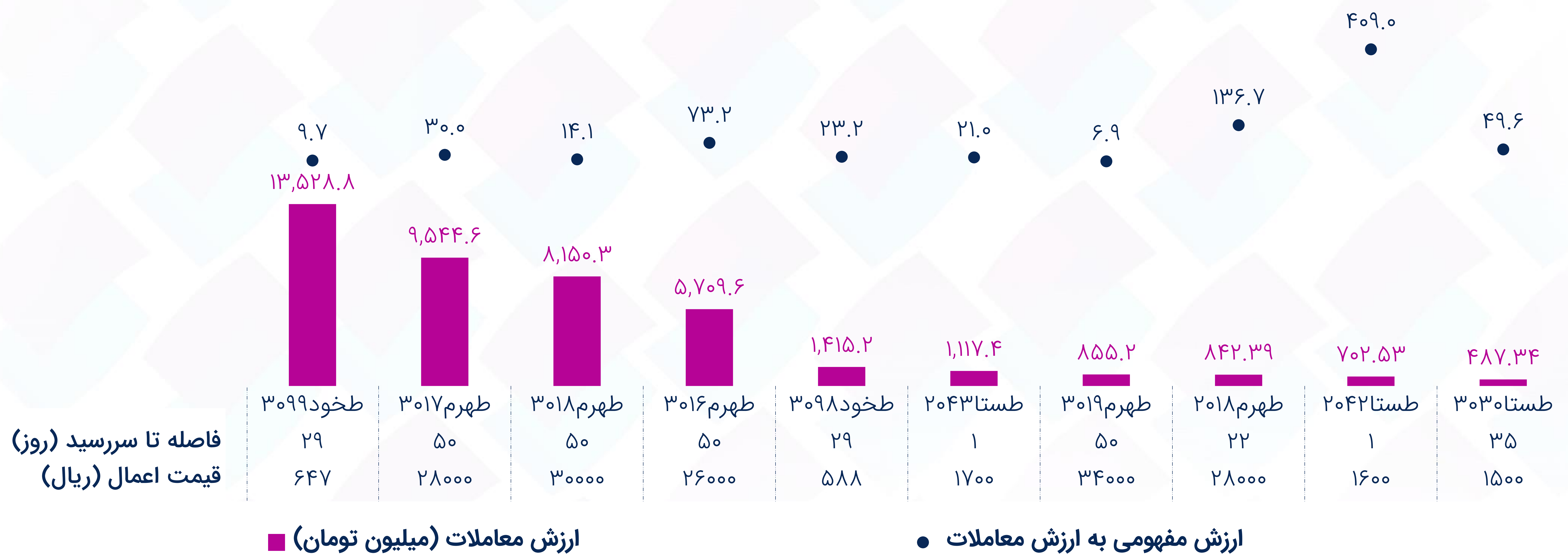
میلیون تومان

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
صفر ۲۰	فزر	۲۵,۳۰۰	۵	۱.۸	۸,۹۰۰	۴۲,۹۰۰	۳۴,۲۰۰	(۲۰.۳%)	۳.۸	۱.۰۰	۱۷,۷۳۸	۹۹%
صیاد ۲۰	پادا	۱۵۰,۰۰۰	۵	۲۰.۰	۴۰,۰۰۰	۲۱۹,۷۷۰	۱۹۰,۰۰۰	(۱۳.۵%)	۴.۸	۱.۰۰	۷۰,۵۹۰	۷۶%
صخور ۲۱	خاور	۱,۰۰۰	۱۲	۱.۷	۳۲۴	۱,۴۸۷	۱,۳۲۴	(۱۱.۰%)	۴.۱	۱.۰۰	۴۹۹	۵۴%
صهمن ۳۰	خبهمن	۲,۰۰۰	۵۰	۸.۵	۴۰۷	۲,۵۰۵	۲,۴۰۷	(۳.۹%)	۵.۹	۰.۹۹	۵۹۷	۴۷%
صستا ۴۰	شستا	۹۰۰	۶۴	۱۱.۴	۶۵۰	۱,۶۳۶	۱,۵۵۰	(۵.۳%)	۲.۴	۱.۰۰	۷۸۹	۲۱%

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
صذوب ۳۰	ذوب	۱,۰۰۰	۴۳	۲۱.۳	۱۱	۵۴۱	۱,۰۱۱	۸۷%	۹۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
صذوب ۲۰	ذوب	۸۰۰	۱۵	۱.۶	۲	۵۴۱	۸۰۲	۴۸%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
صفلا ۳۰	فولاد	۶,۴۸۰	۳۵	۸۷.۱	۲۹	۴,۲۵۴	۶,۵۰۹	۵۳%	۲۲۴.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
صذوب ۳۰	ذوب	۸۰۰	۴۳	۳.۸	۲۸	۵۴۱	۸۲۸	۵۳%	۲۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
صذوب ۲۰	ذوب	۷۰۰	۱۵	۷.۲	۳	۵۴۱	۷۰۳	۳۰%	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
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۴۸	۲۱.۷	۱۱۰	۱,۷۴۴	۱,۷۹۰	۲.۶%	۱۶.۳	-۰.۶۴	۱۱۴	۳.۸%
طجار ۲۰۵۵	وتجارت	۶۳۵	۸	۵۸.۱	۴۱	۵۹۲	۵۹۴	۰.۳%	۱۴.۵	-۰.۸۵	۴۰	(۳.۵%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۲	۷۲.۷	۲,۵۴۳	۳۱,۳۱۰	۳۱,۴۵۷	۰.۵%	۱۲.۴	-۰.۷۲	۲,۳۹۵	(۵.۸%)
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۰	۳۰.۴	۱۰,۸۴۳	۳۱,۳۱۰	۳۱,۱۵۷	(۰.۵%)	۲.۹	-۰.۹۶	۸,۸۳۶	(۱۸.۵%)
طهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۲	۷۴.۶	۵۶۷	۳۱,۳۱۰	۲۹,۴۳۳	(۶.۰%)	۵۱.۹	-۰.۲۳	۴۰۶	(۲۸.۵%)

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
طهرم ۳۰۱۱	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۰	۰.۰	۱۵	۳۱,۳۱۰	۱۵,۹۸۵	(۴۸.۹%)	۱,۰۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۲	۱.۷	۴۶	۳۱,۳۱۰	۱۹,۹۵۴	(۳۶.۳%)	۴۳۳.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طجار ۲۰۵۱	وتجارت	۴۵۴	۸	۰.۱	۱	۵۹۲	۴۵۳	(۲۳.۵%)	۴۵۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طموچ ۲۱۷	موج	۲۲,۰۰۰	۱۲	۰.۲	۳۰	۳۰,۳۹۳	۲۱,۹۷۰	(۲۷.۷%)	۷۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۵	۱۰.۳	۱	۵۴۱	۳۹۹	(۲۶.۲%)	۳۹۹.۰	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

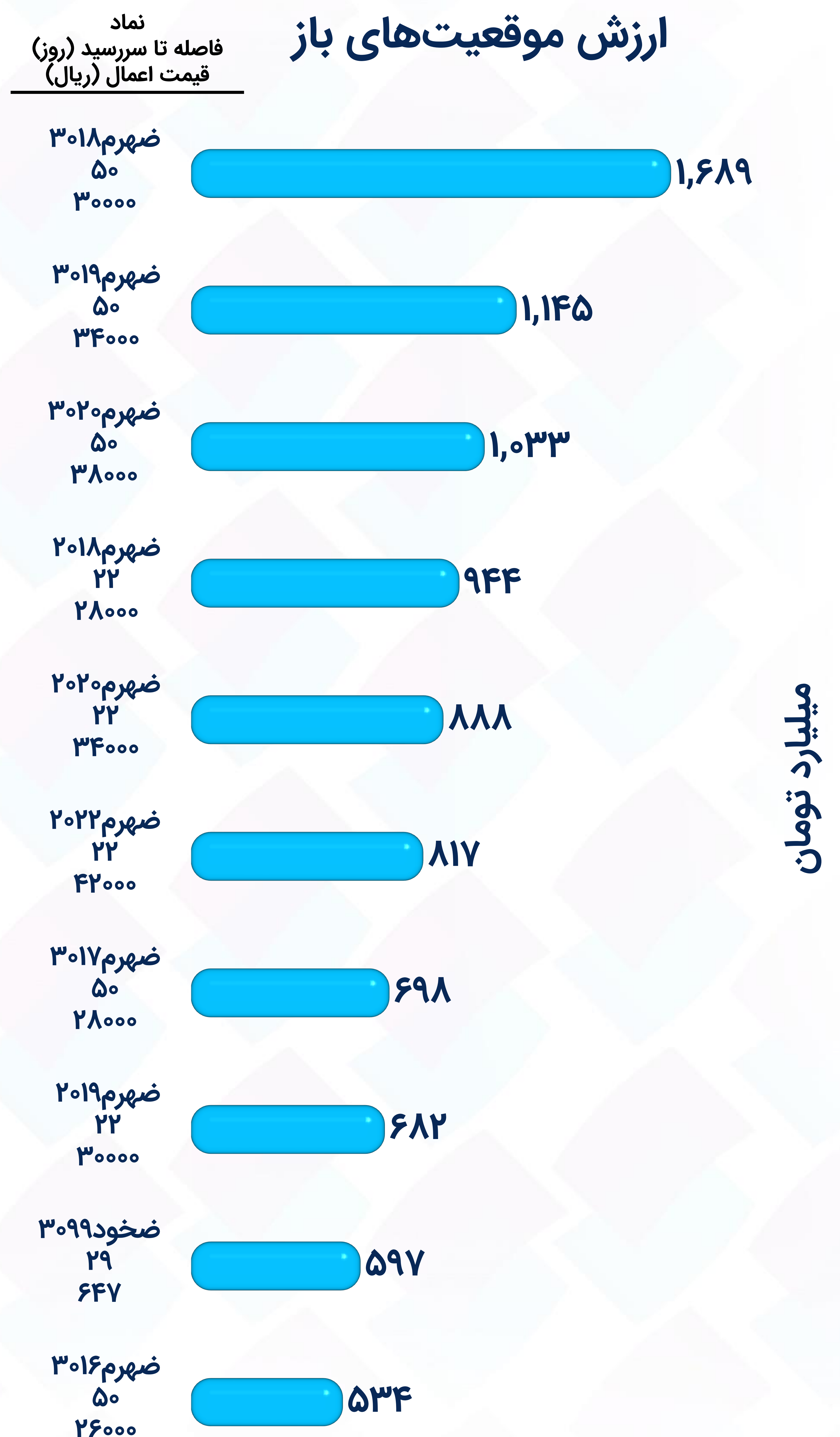
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

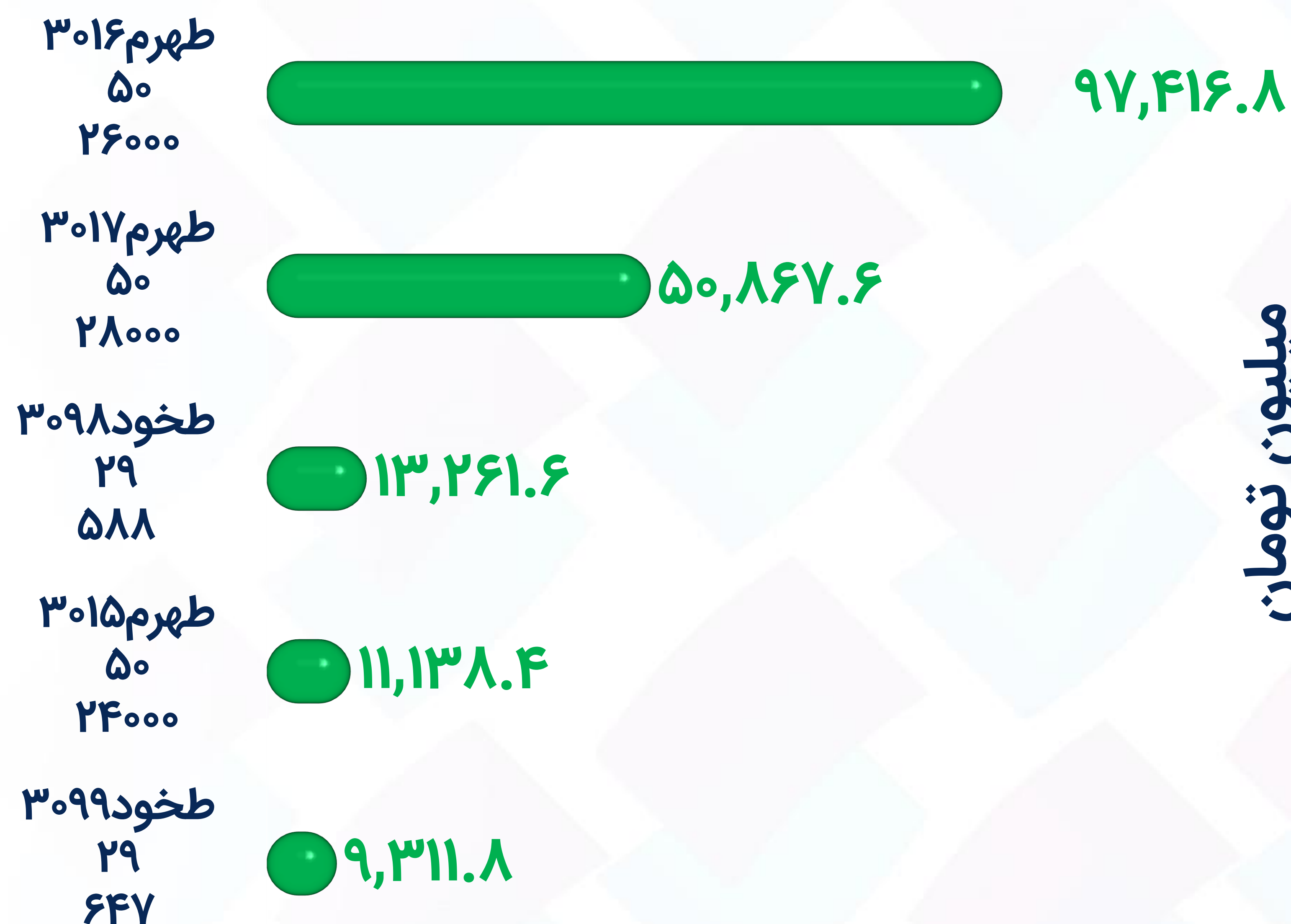
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

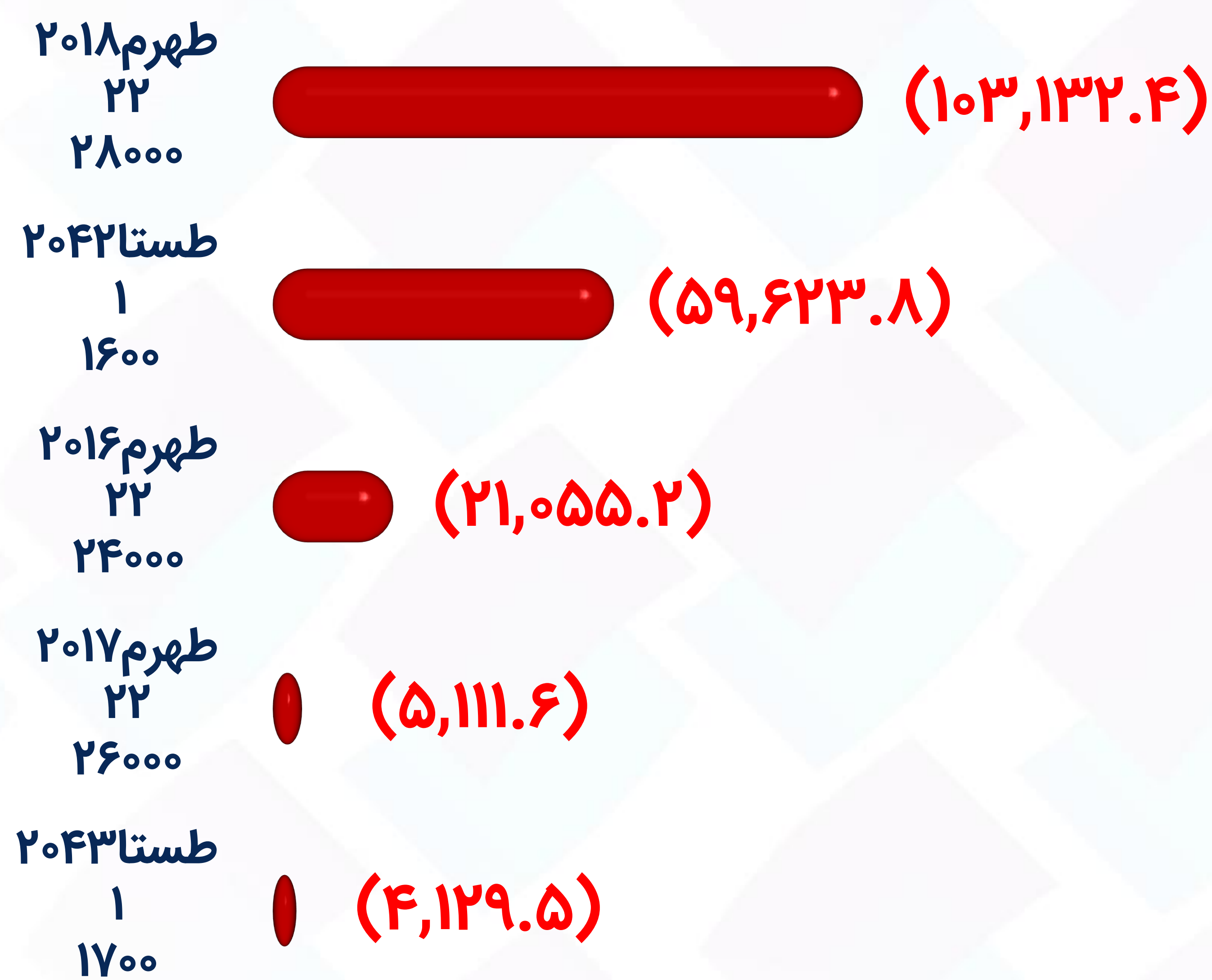
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

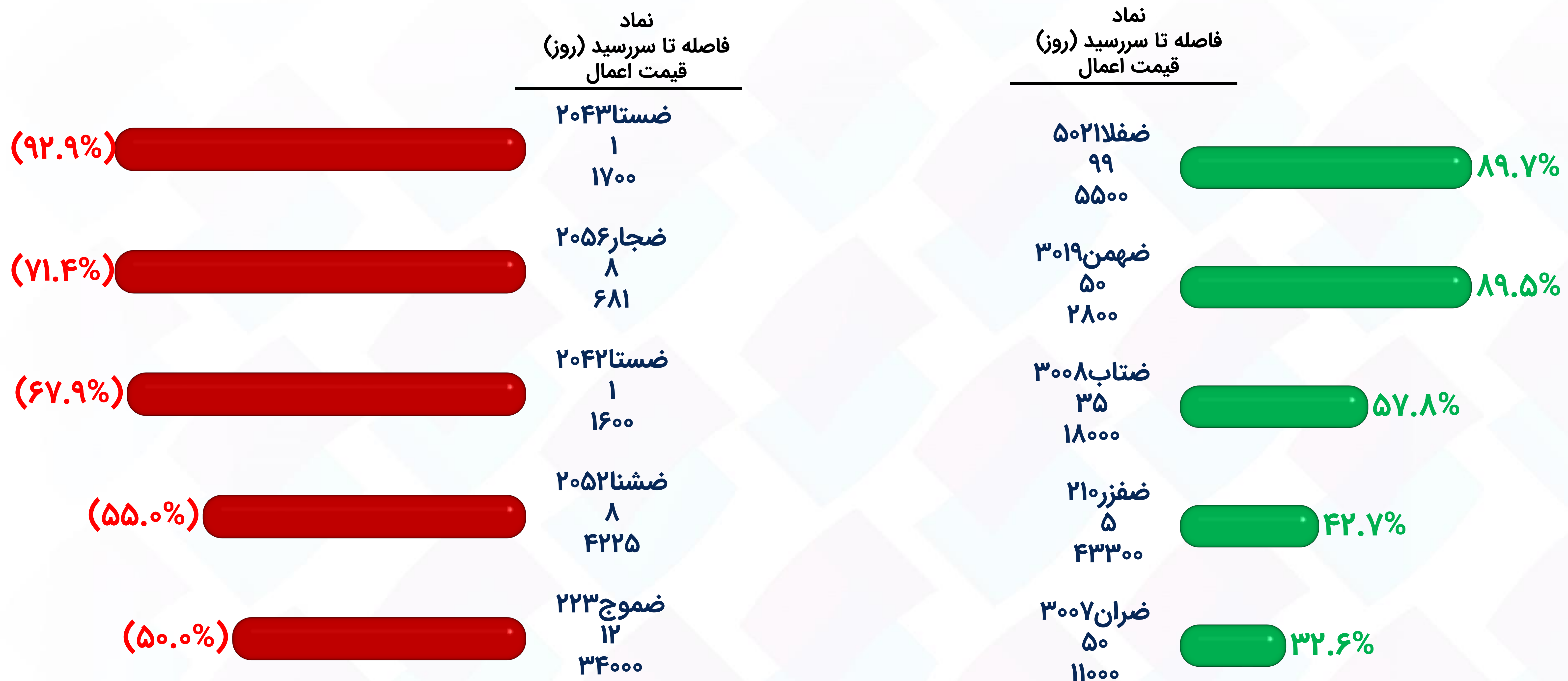
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

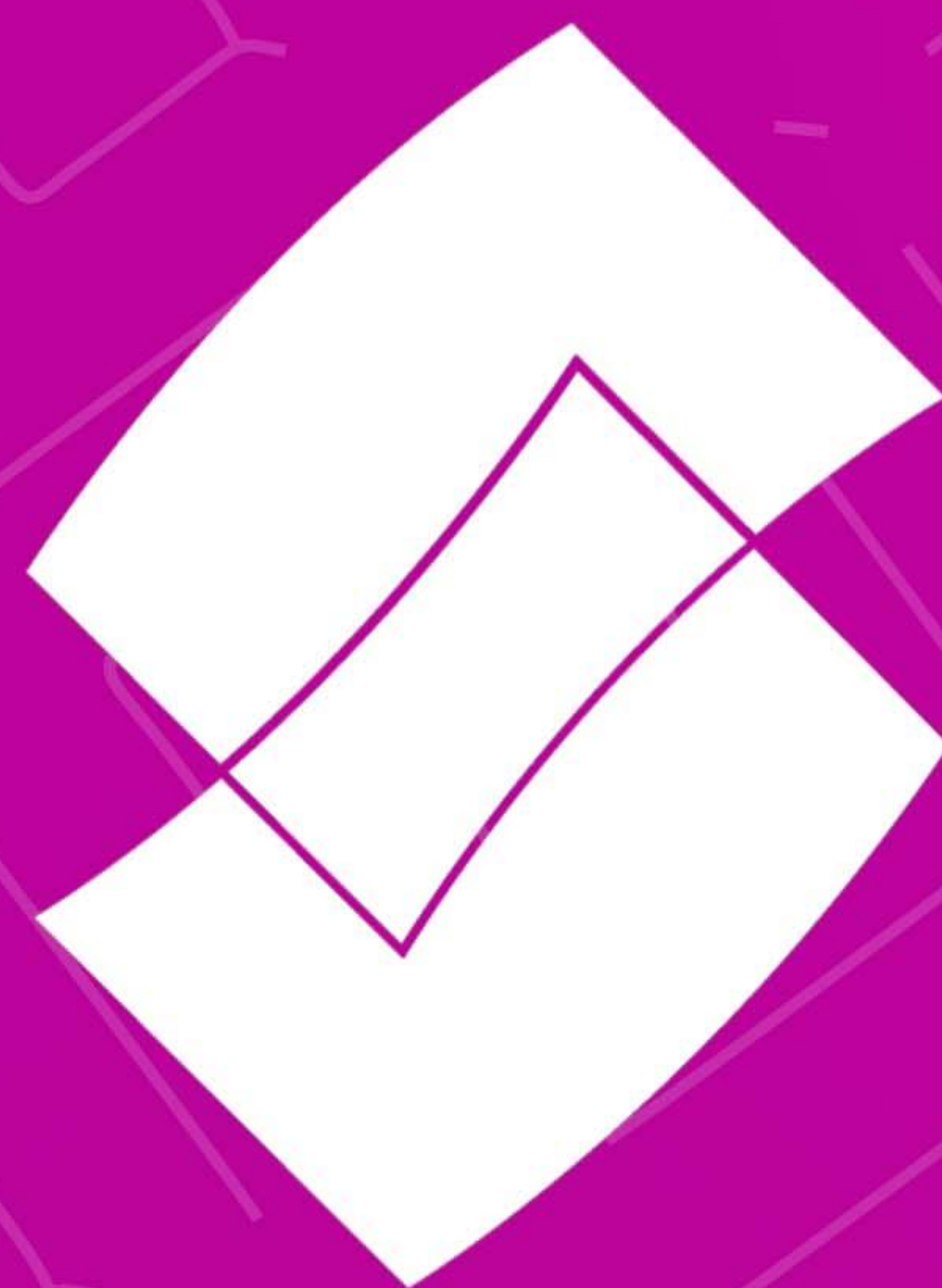
اختیار خرید



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.