

شماره
۴۷۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۵ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





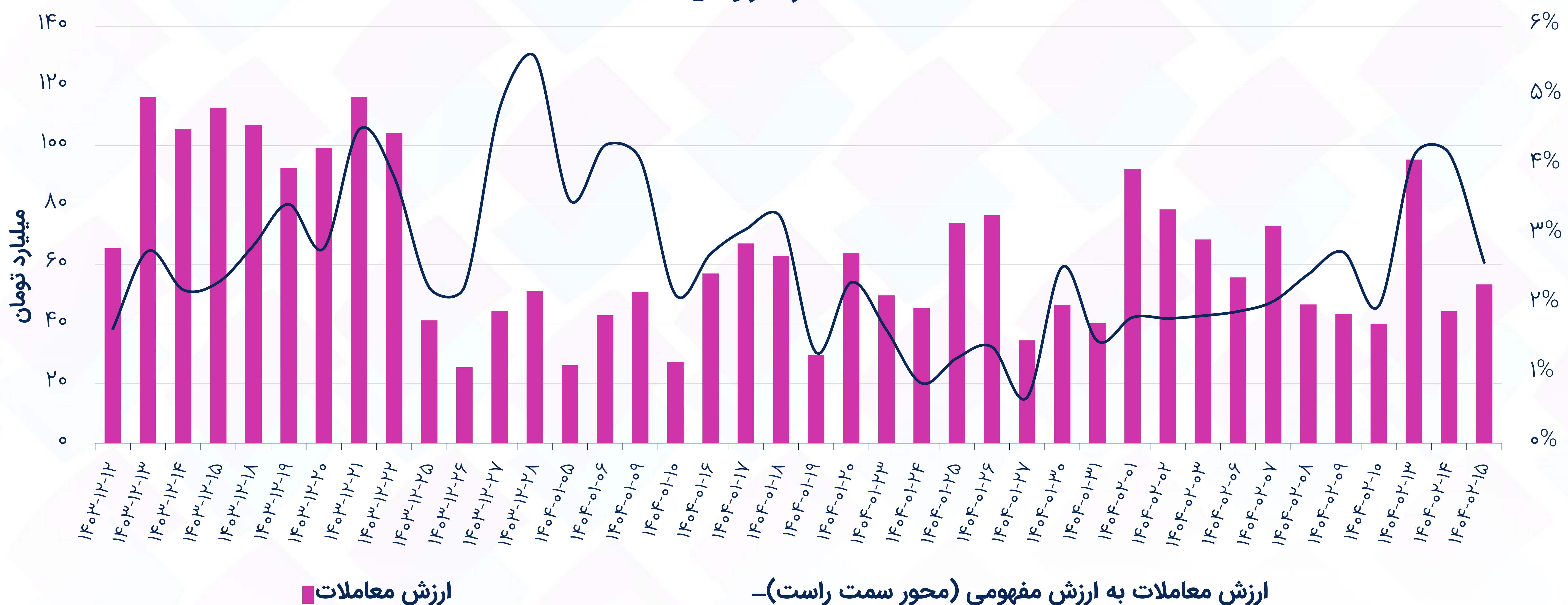
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



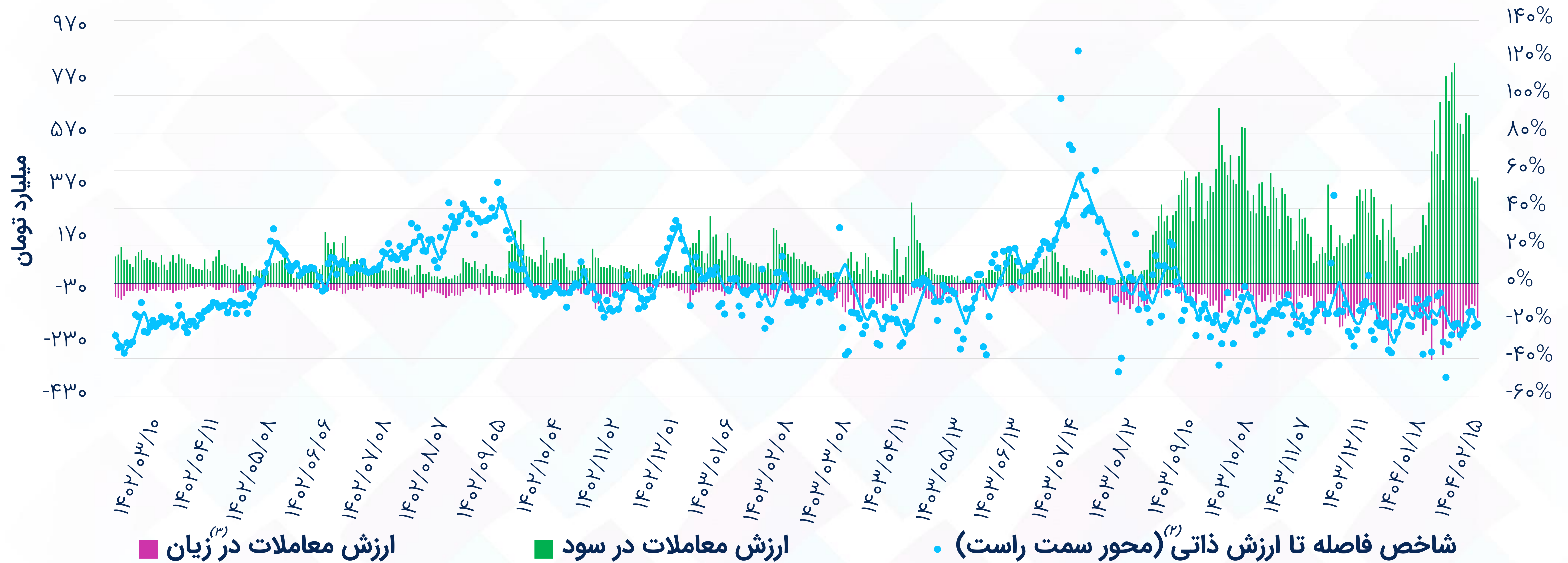
اختیار فروش



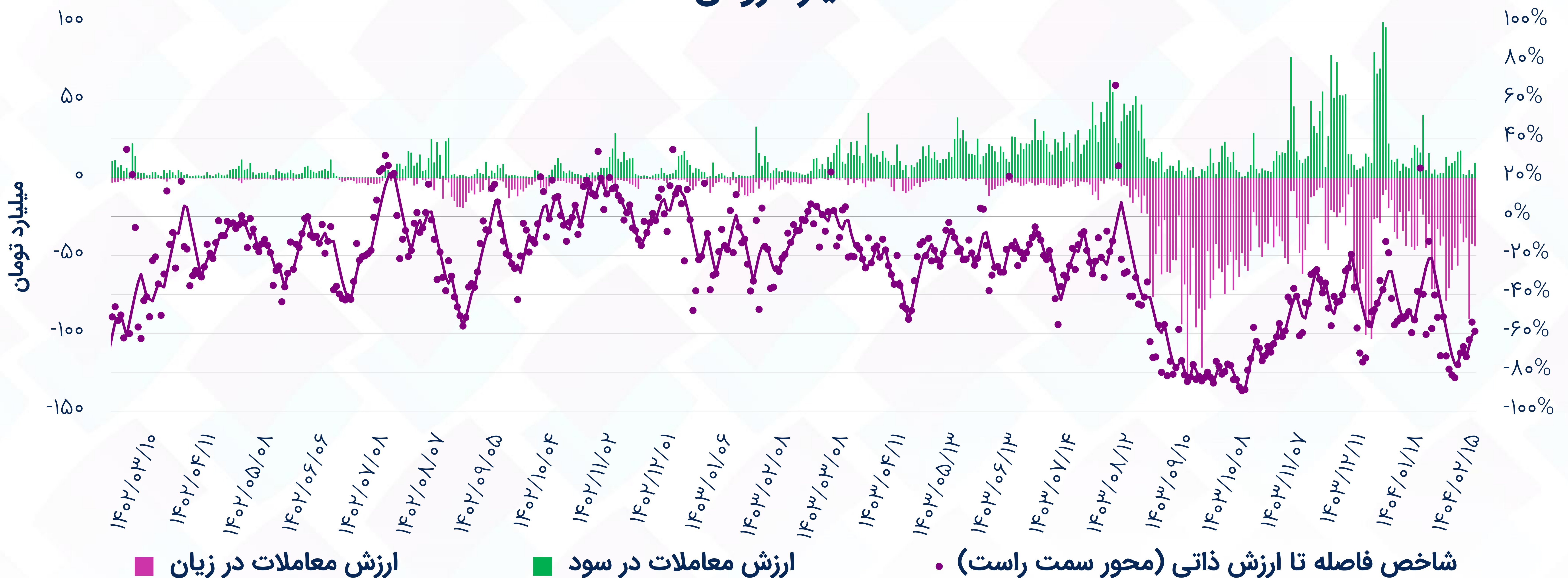
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۲۲۸.۳	۳,۱۰۳.۳	۱۳۷.۴	۹۰.۹	(۳۲.۱%)
خودرو	۱۳	۱۸۵.۳	۱,۳۹۰.۰	۱۷۴.۲	۱۱.۱	(۱۰.۱%)
شستا	۳۸	۳۸.۹	۵۵۵.۱	۲۱.۴	۱۷.۴	(۳۰.۲%)
وتجارت	۲۱	۲۶.۱	۲۲۶.۶	۲۳.۸	۲.۳	(۲.۵%)
ذوب	۲۵	۲۴.۱	۲۷۱.۹	۲۰.۸	۳.۲	(۲۵.۸%)
وبملت	۲۴	۱۱.۵	۱۰۴.۵	۸.۴	۳.۱	(۱۹.۲%)
وبصادر	۱۷	۶.۷	۳۹.۰	۶.۲	۰.۵	(۹.۸%)

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
خودرو	۷	۳۰,۲۷۳.۶	۵۷۷,۲۲۵.۸	۹۹۲.۴	۲۹,۲۸۱.۲	(۶۵.۴%)
اهرم	۲۸	۲۰,۲۶۳.۰	۱,۳۲۷,۸۷۰.۹	۸,۱۲۶.۴	۱۲,۱۳۶.۶	(۴۷.۸%)
شستا	۹	۲,۵۷۳.۲	۱۳۲,۲۷۰.۰	۲۵۷.۱	۲,۳۱۶.۱	(۷۱.۰%)
ذوب	۴	۱۳۷.۰	۹,۰۱۹.۴	۰.۰	۱۳۷.۰	(۶۱.۶%)
وتجارت	۳	۴۳.۱	۱,۱۵۷.۲	۴۲.۷	۰.۴	۳۲.۳%
خودران	۳	۲۹.۴	۵۰۰.۴	۳.۲	۲۶.۲	(۵۰.۳%)
وبملت	۲	۱۴.۸	۳۰۷.۶	۱۳.۸	۱.۰	(۵۰.۹%)

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

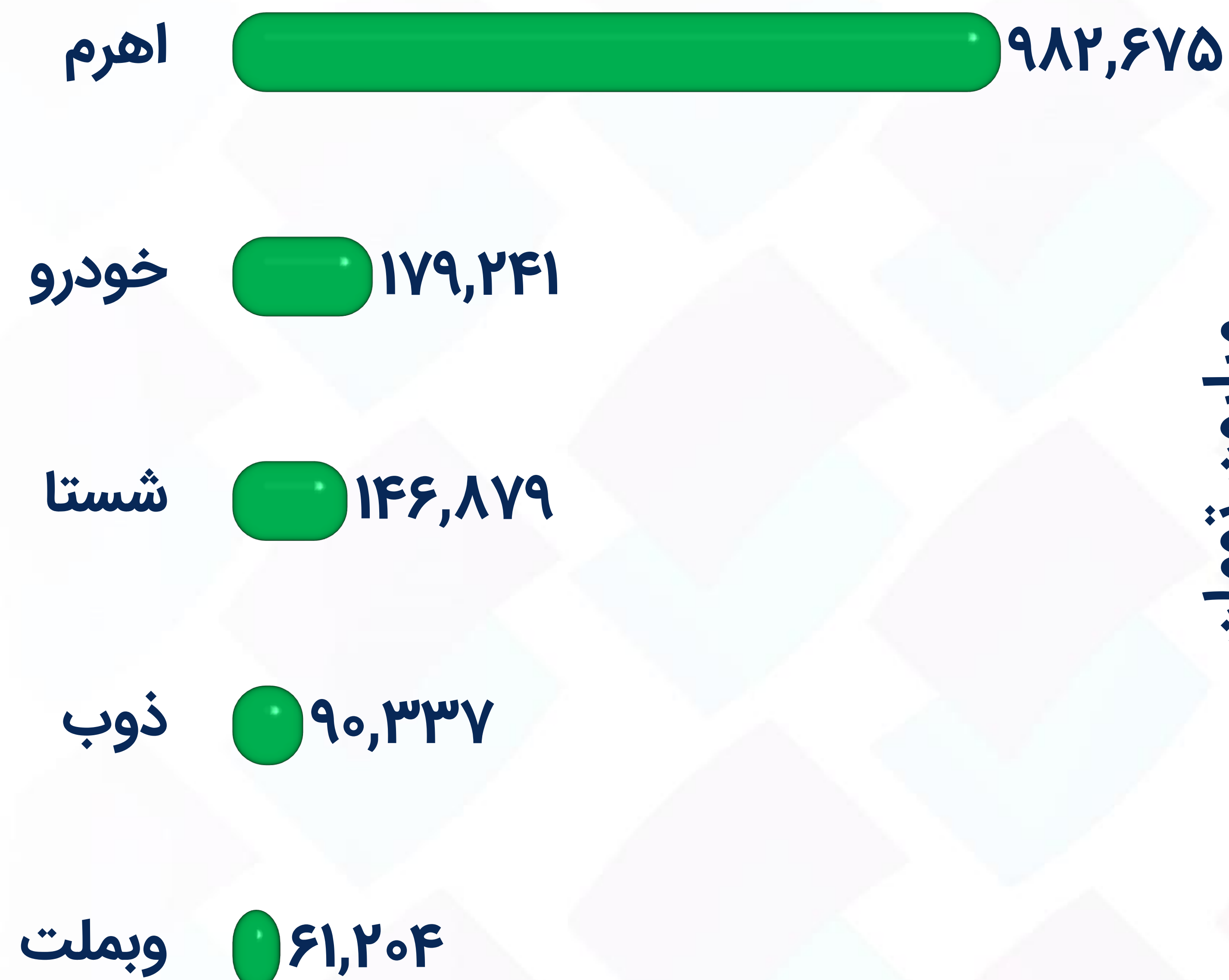
میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

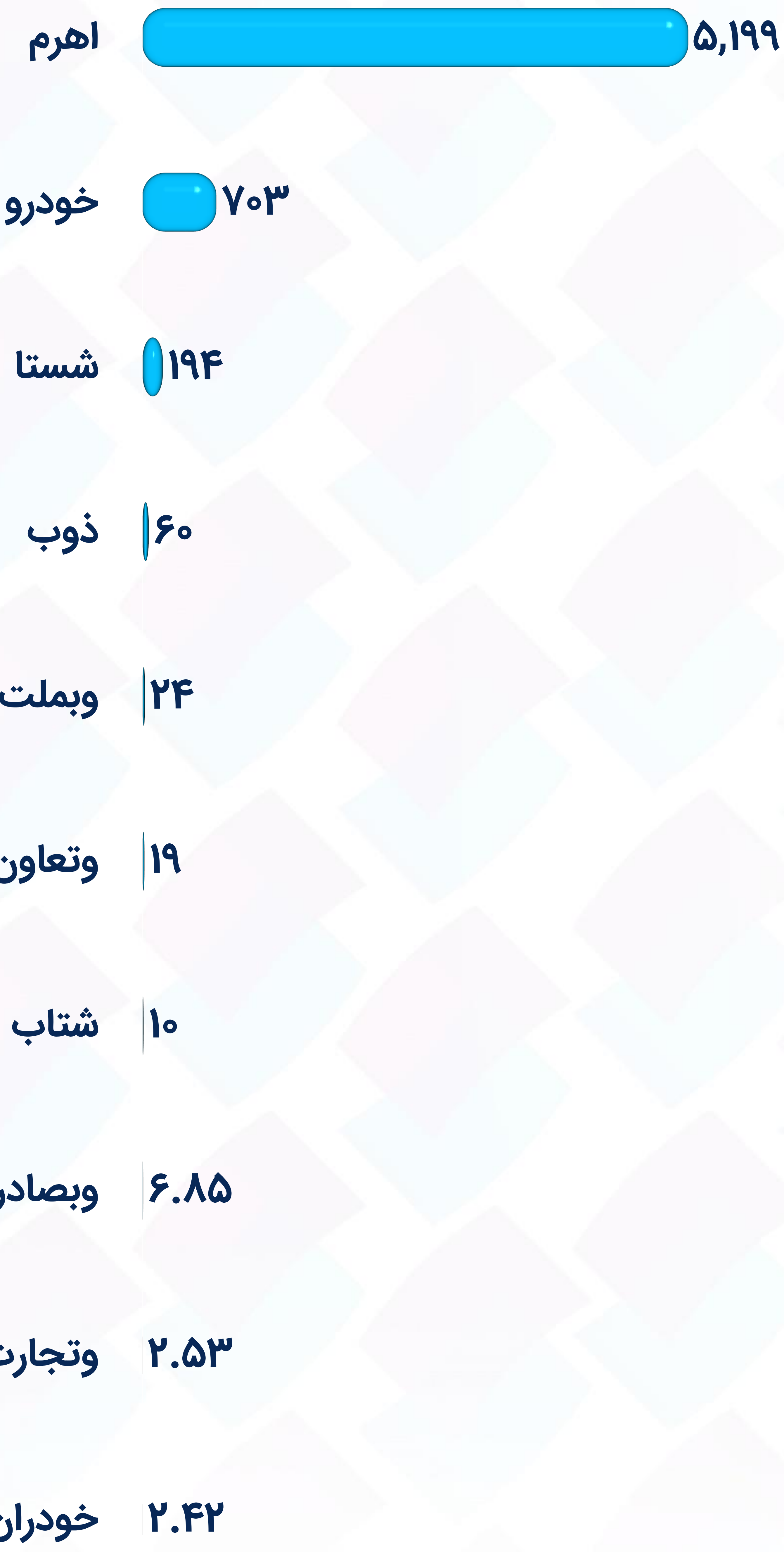
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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

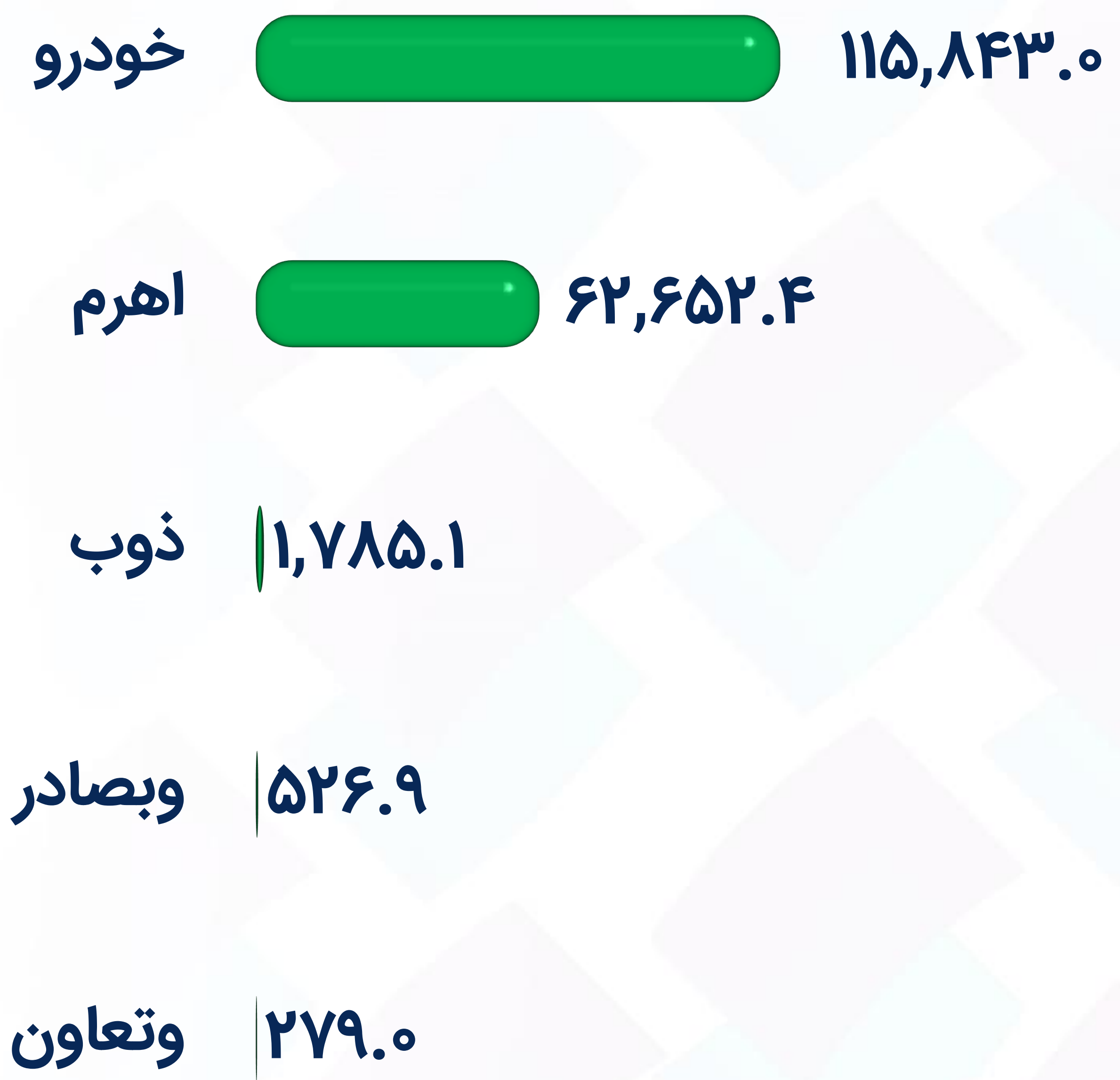
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



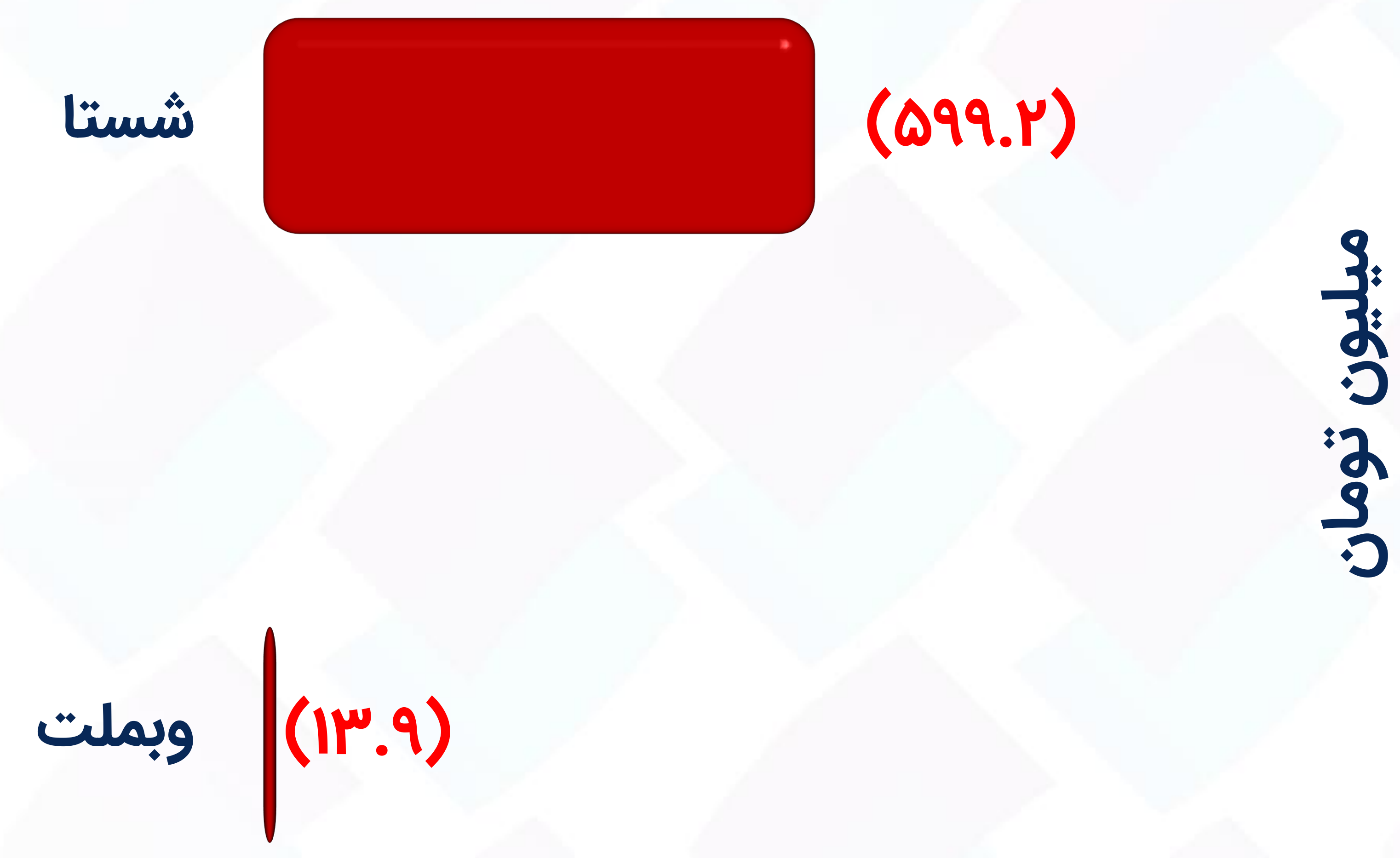
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین 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
ضشنا ۲۰۵۲	شپنا	۴,۲۲۵	۲	۶.۱	۱	۳,۹۲۹	۴,۲۲۶	۷.۶%	۴,۲۲۶.۰	۰.۰۳	۲	۸۷%
ضسامان ۲۰۴	سامان	۱,۹۰۰	۶	۱.۸	۱۸۴	۲,۱۹۸	۲,۰۸۴	(۵.۲%)	۱۱.۳	۱.۰۰	۳۱۱	۶۹%
ضموج ۲۱۹	موج	۲۶,۰۰۰	۶	۱۵۳.۴	۲,۲۲۷	۲۸,۷۸۳	۲۸,۲۲۷	(۱.۹%)	۱۲.۷	۰.۹۷	۲,۹۷۸	۳۴%
ضشنا ۲۰۴۸	شپنا	۲,۸۱۷	۲	۱.۷	۸۷۱	۳,۹۲۹	۳,۶۸۸	(۶.۱%)	۴.۲	۱.۰۰	۱,۱۲۴	۲۹%
ضموج ۲۱۸	موج	۲۴,۰۰۰	۶	۳۱.۳	۳,۸۶۵	۲۸,۷۸۳	۲۷,۸۶۵	(۳.۲%)	۷.۲	۱.۰۰	۴,۹۴۷	۲۸%

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	۹	۲.۹	۱	۵۲۳	۸۰۱	۵۳%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۲۰۵۴	شپنا	۴,۹۳۰	۲	۱.۶	۱	۳,۹۲۹	۴,۹۳۱	۲۶%	۴,۹۳۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۳۷	۶.۸	۵	۵۲۳	۱,۰۰۵	۹۲%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۹	۳۸.۹	۱۰	۴,۰۱۹	۶,۴۹۰	۶۱%	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۹	۹.۸	۱	۵۲۳	۷۰۱	۳۴%	۷۰۱.۰	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	و تجارت	۶۳۵	۲	۴۲.۷	۲۷	۵۹۷	۶۰۸	۱.۸%	۲۲.۵	-۰.۹۳	۳۶	۳۳.۵%
طستا۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۲۹	۳۲.۱	۴۴۰	۱,۵۹۸	۱,۷۶۰	۱۰.۱%	۴.۰	-۱.۰۰	۵۳۷	۲۱.۹%
طهرم۶۰۳۲	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۳۵	۱.۵	۱,۰۹۶	۲۹,۸۰۰	۲۸,۹۰۴	(۳.۰%)	۲۶.۴	-۰.۲۶	۱,۱۴۵	۴.۵%
طهرم۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۶	۳.۱	۷,۶۵۰	۲۹,۸۰۰	۳۰,۳۵۰	۱.۸%	۴.۰	-۱.۰۰	۷,۵۳۱	(۱.۶%)
طهرم۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۶	۳,۳۷۳.۲	۳,۸۲۲	۲۹,۸۰۰	۳۰,۱۷۸	۱.۳%	۷.۹	-۰.۹۱	۳,۷۰۰	(۳.۲%)

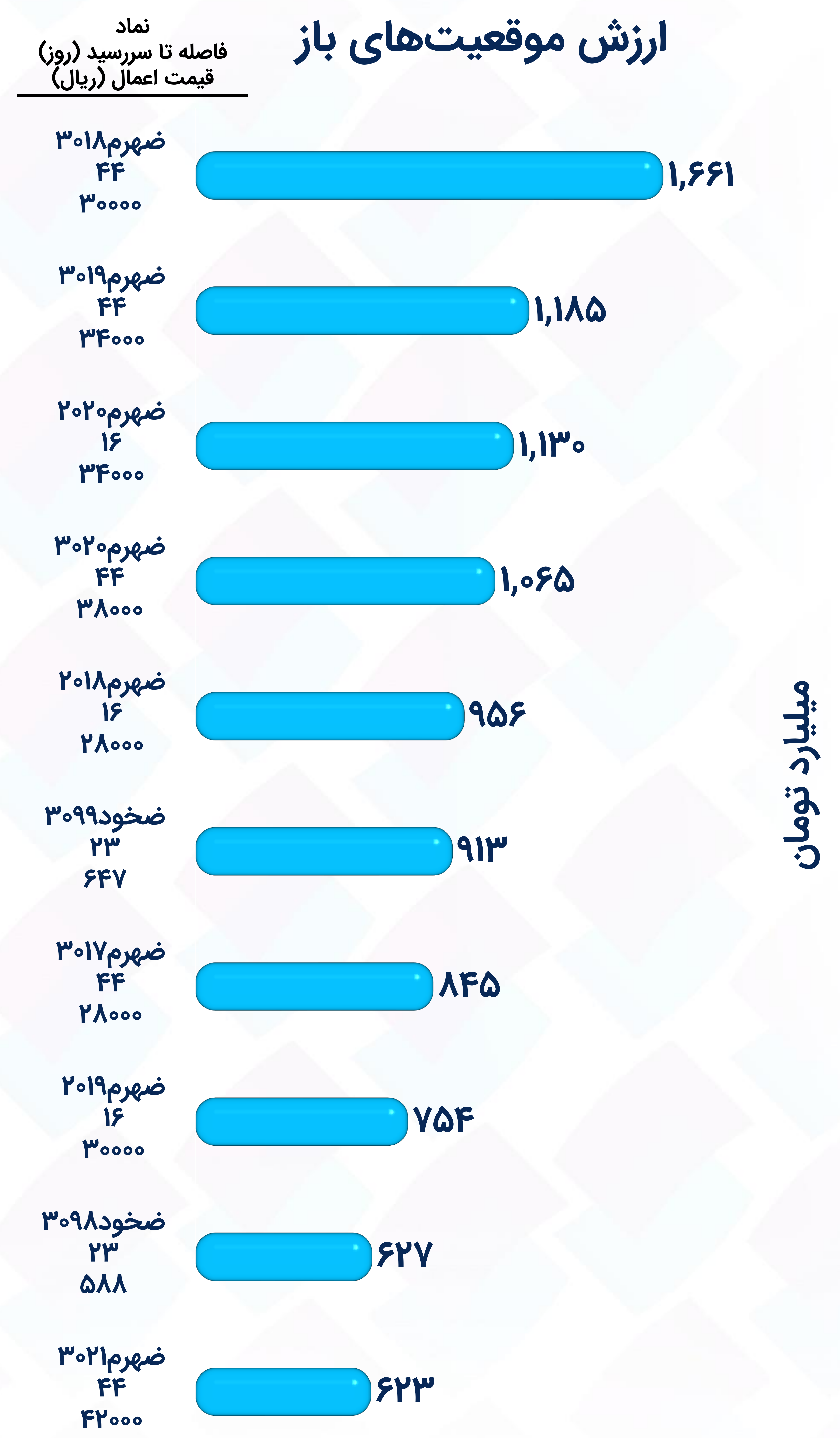
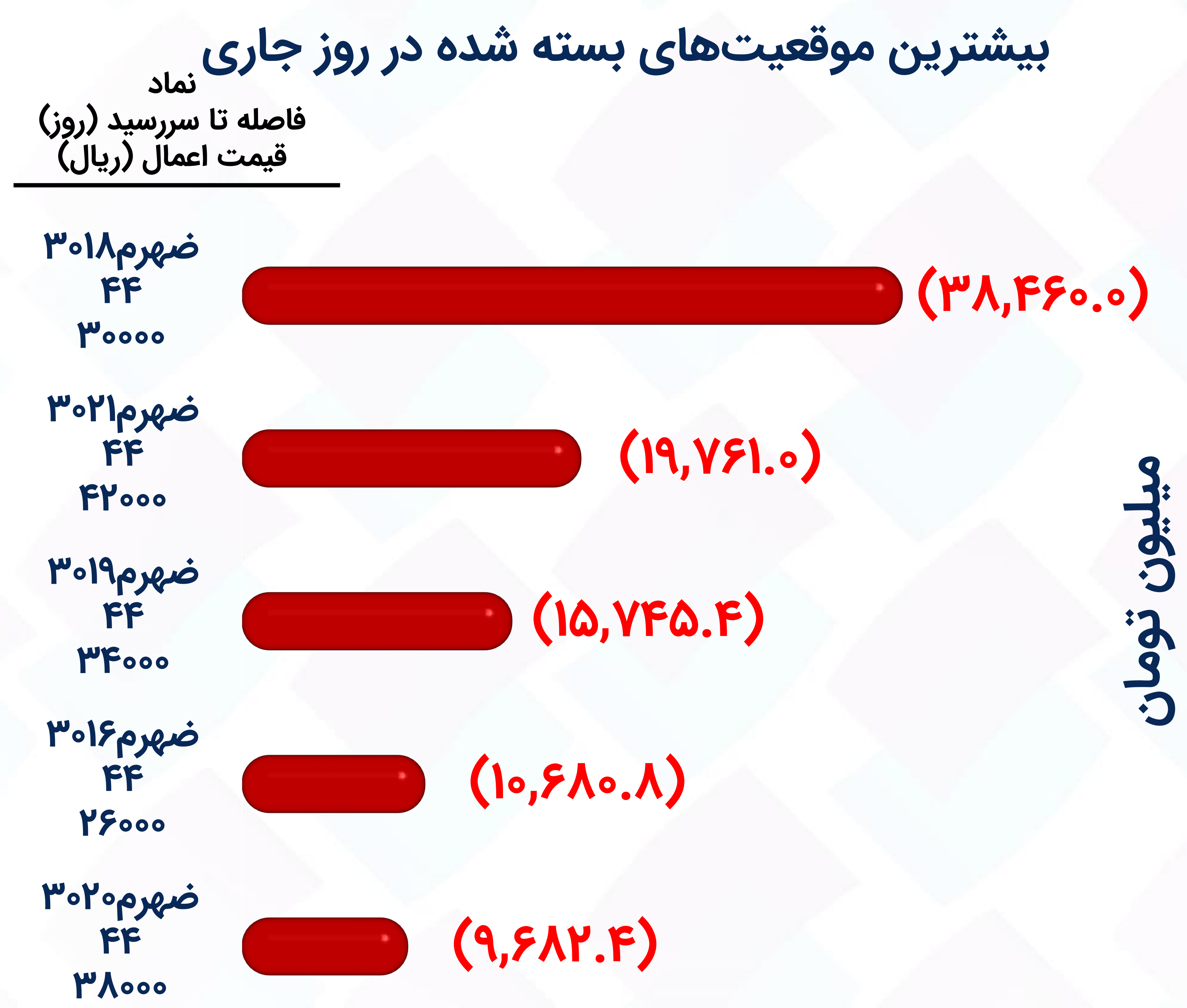
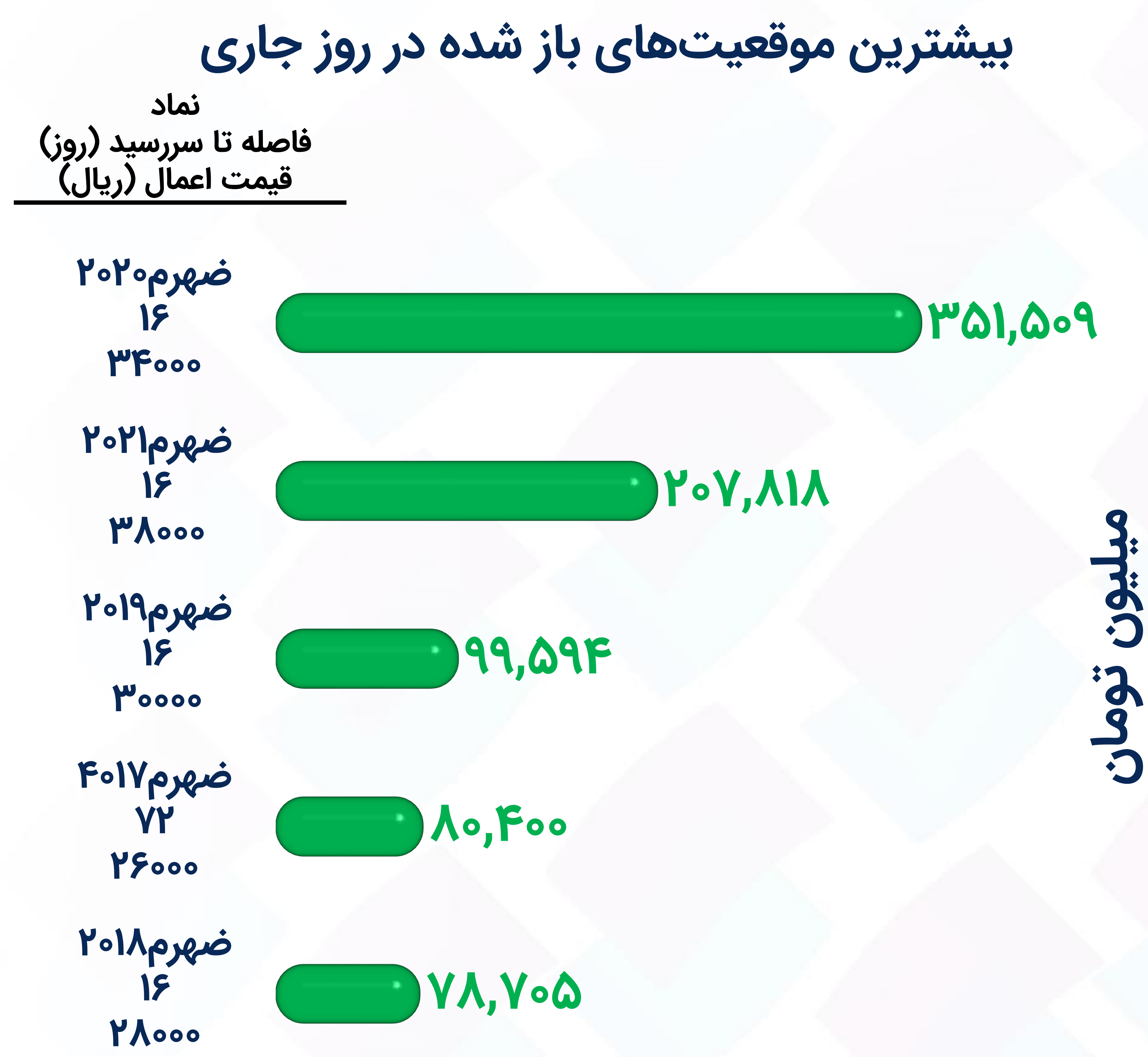
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طخود۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۲۳	۱.۰	۱	۶۸۴	۲۸۱	(۵۸.۹%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۶	۱۷.۵	۳۵	۲۹,۸۰۰	۱۹,۹۶۵	(۳۳.۰%)	۵۷۰.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۳۰۹۲	خودرو	۳۵۳	۲۳	۰.۰	۲	۶۸۴	۳۵۱	(۴۸.۷%)	۱۷۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۹	۰.۲	۱	۵۲۳	۳۹۹	(۲۳.۷%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد۳۰۵۱	وبصادر	۵۰۰	۳۷	۶.۳	۳	۷۲۶	۴۹۷	(۳۱.۵%)	۱۶۵.۷	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.



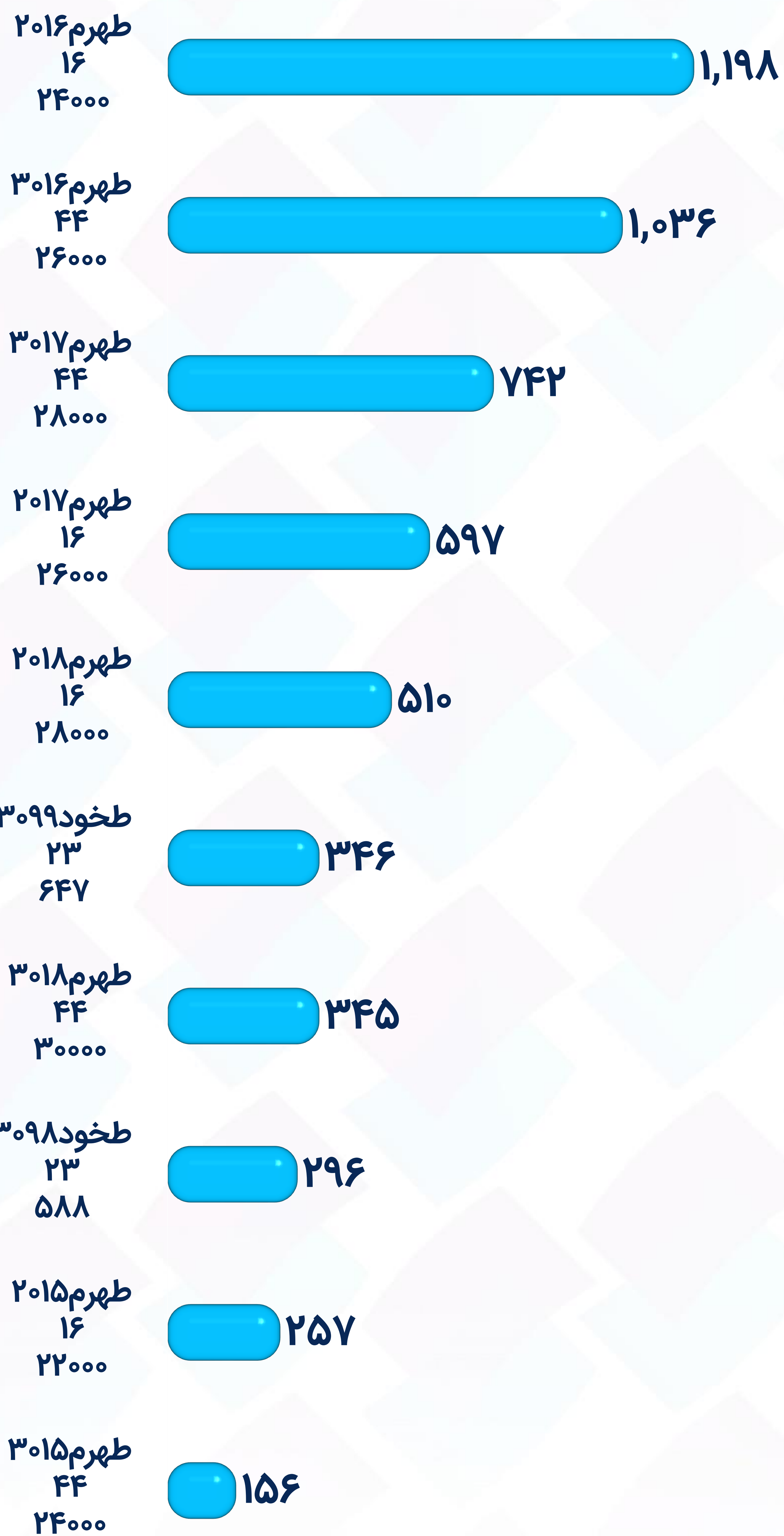
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

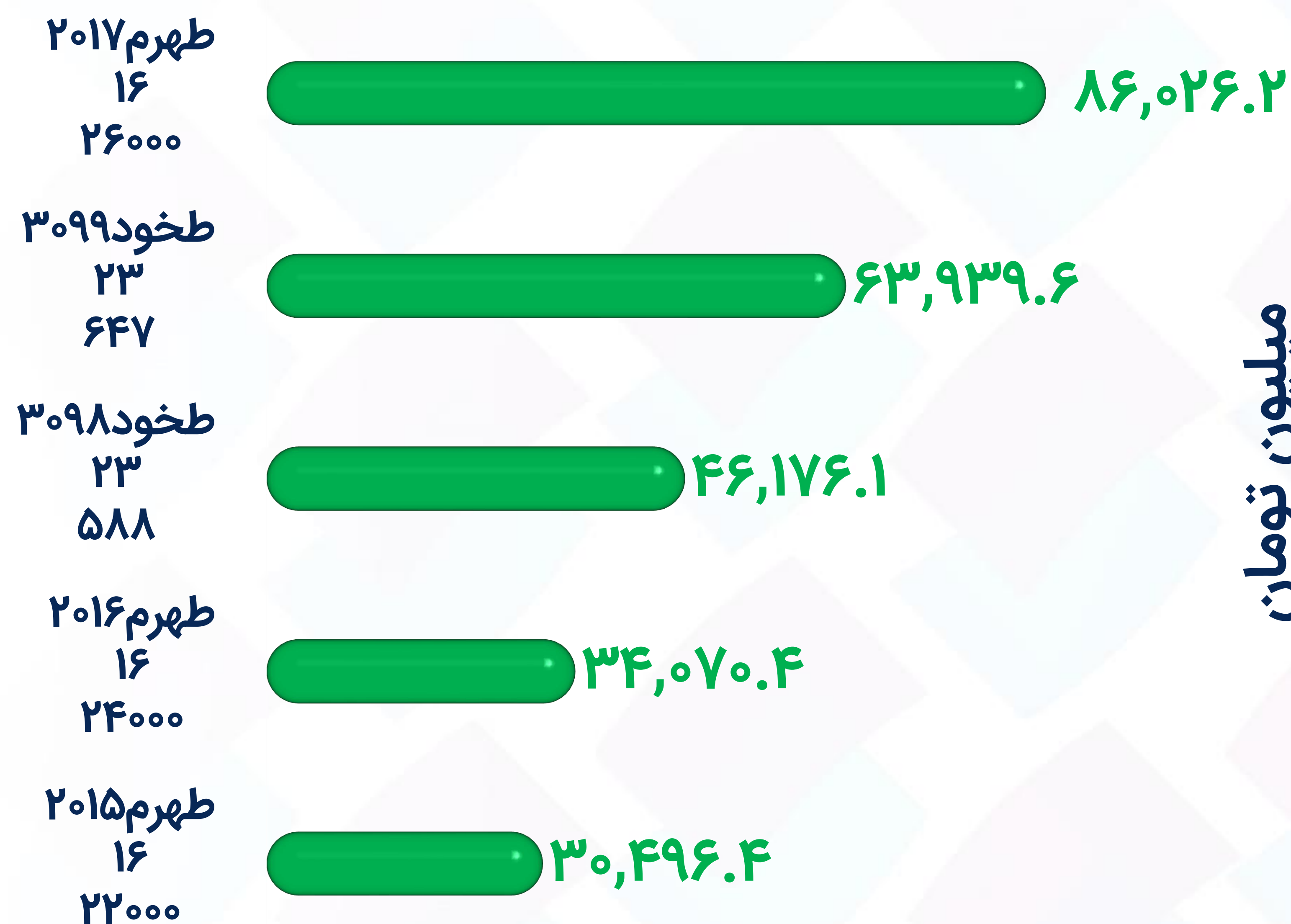
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

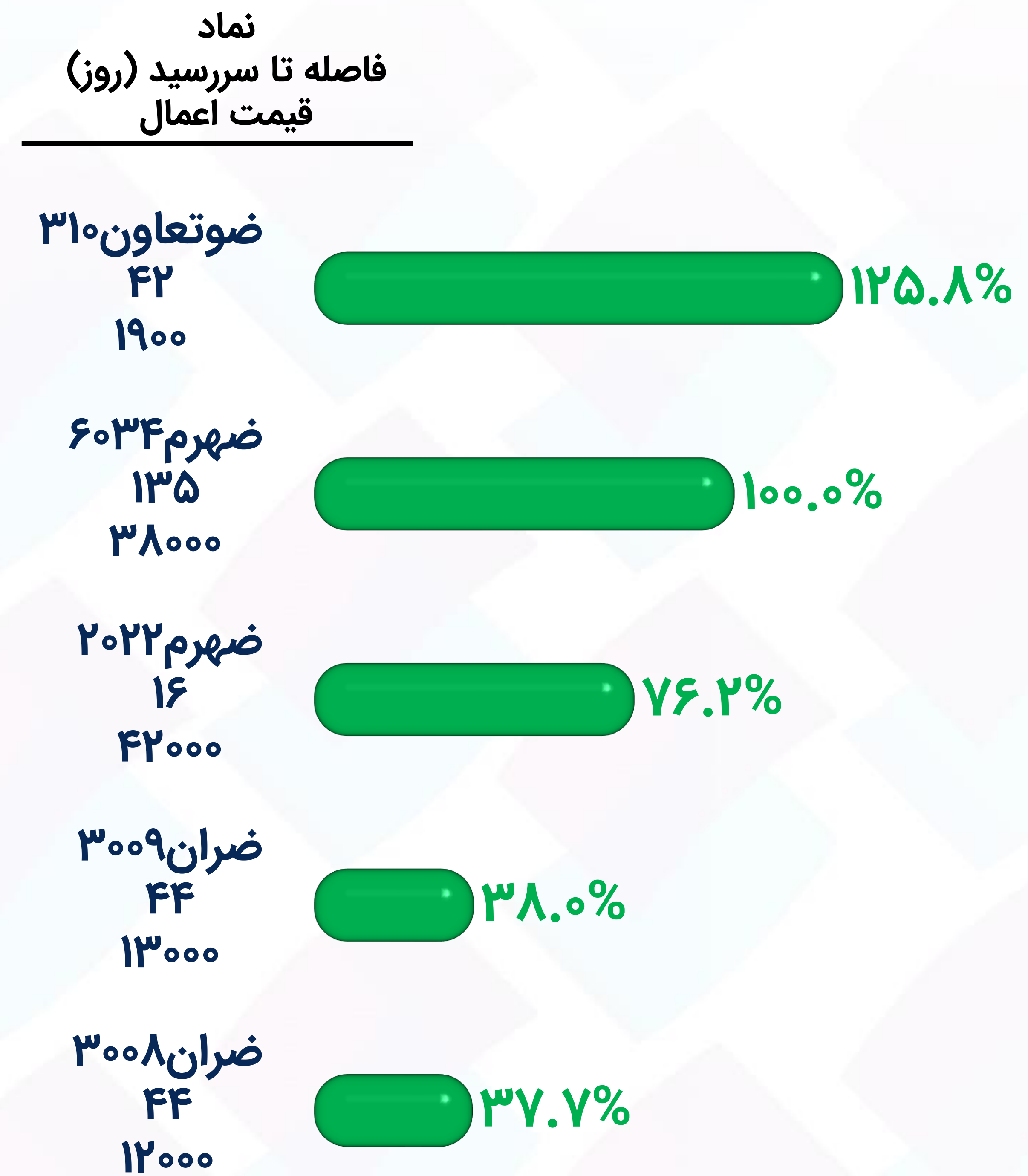
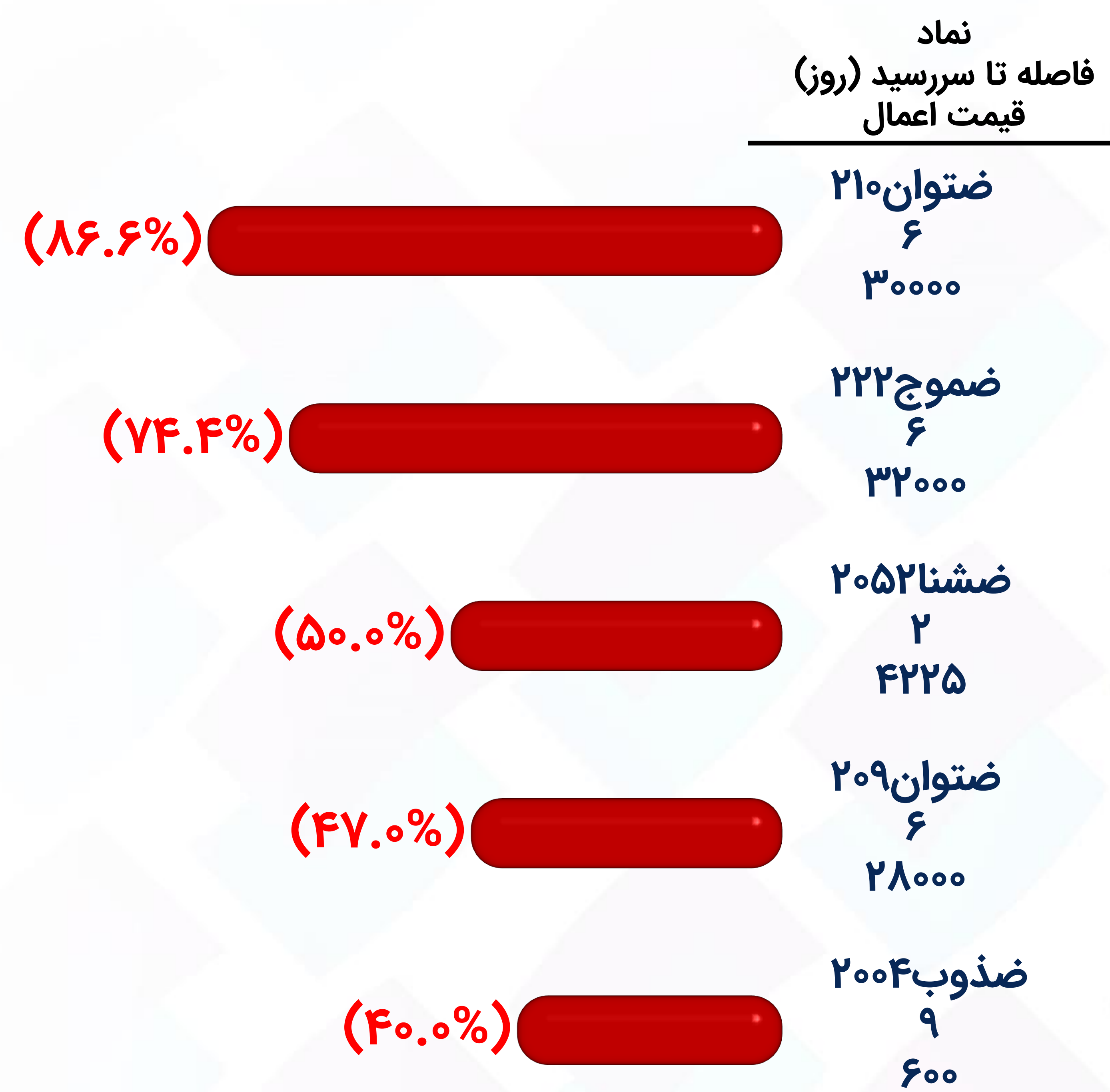
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



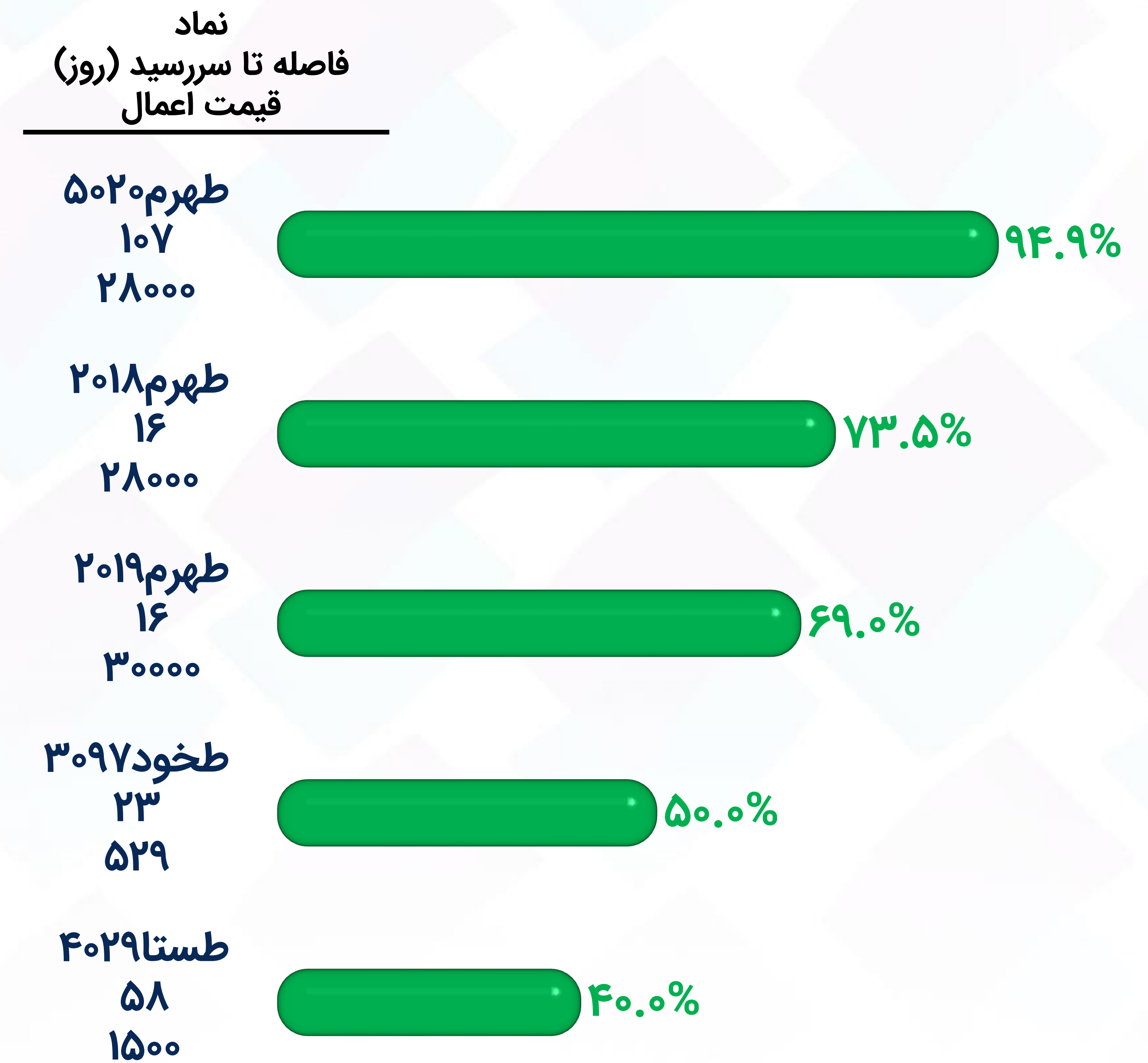
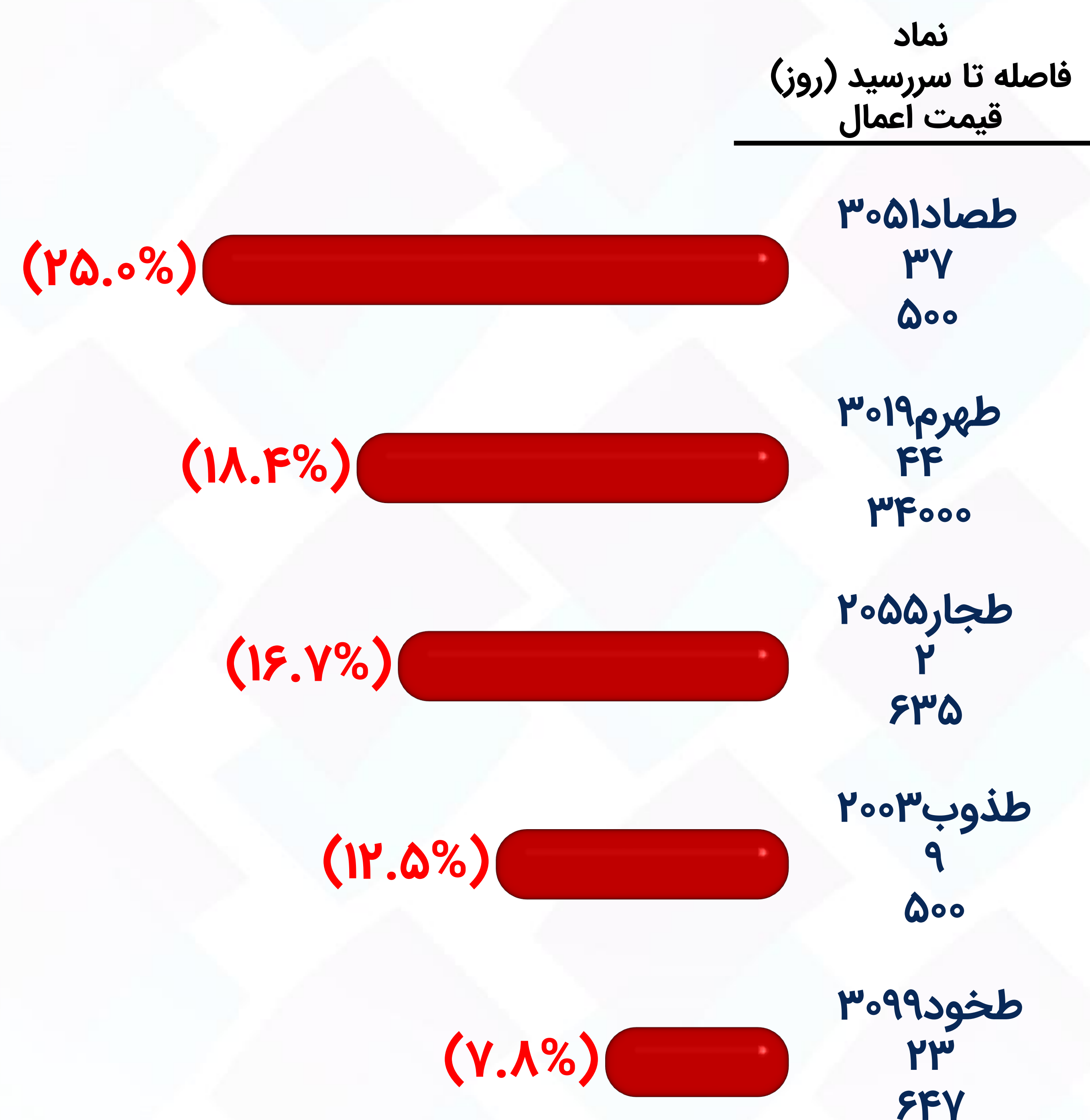
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

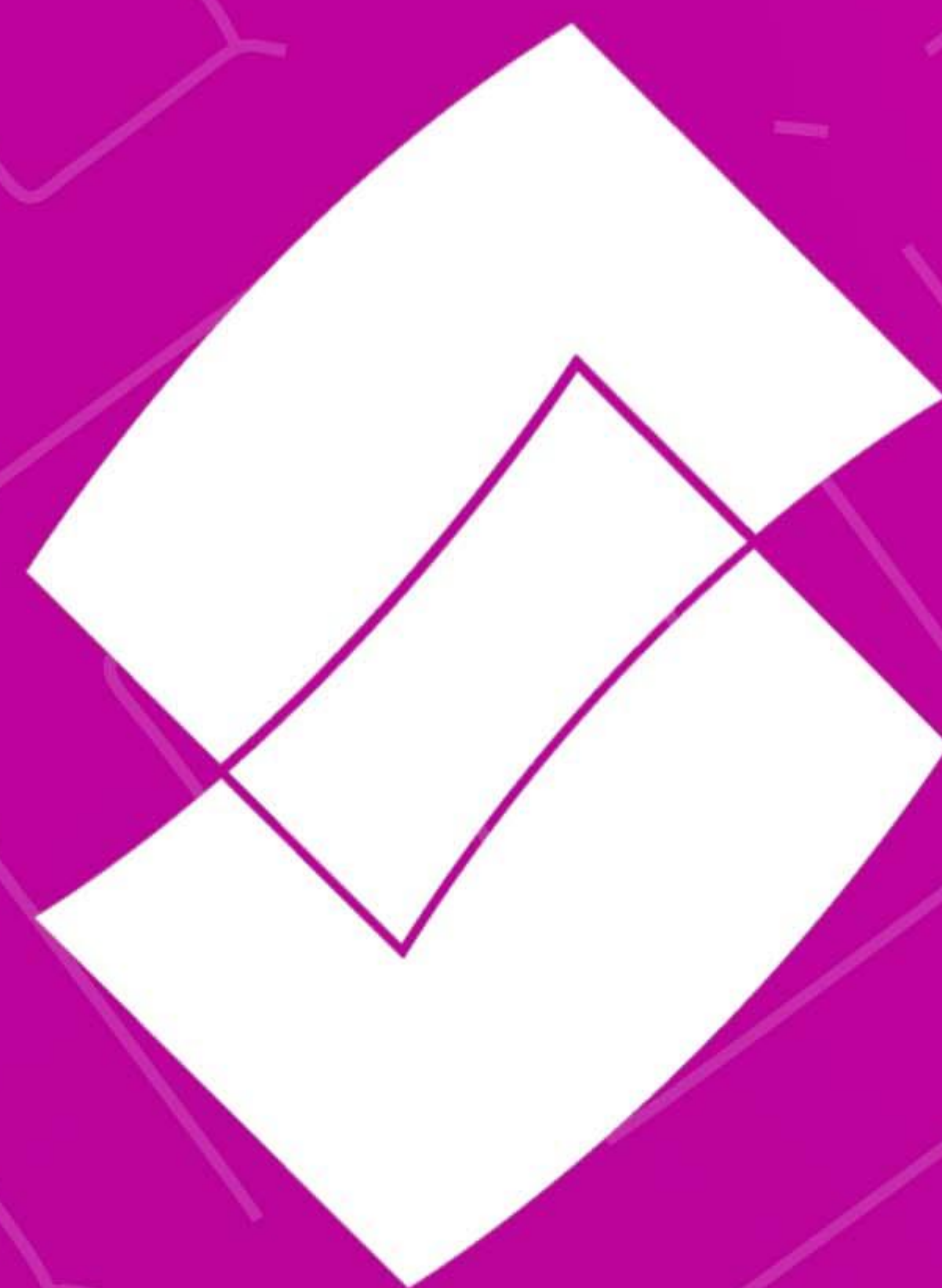
اختیار خرید



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.