

شماره
۴۷۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ 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



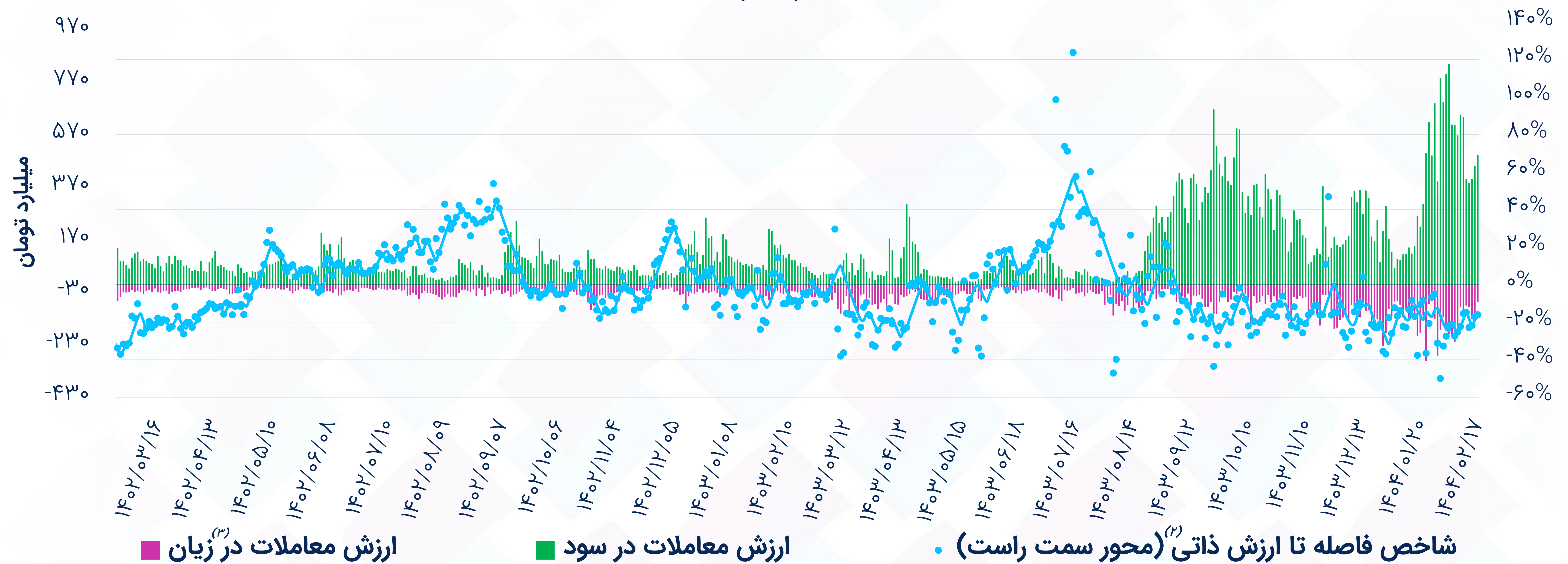
اختیار فروش



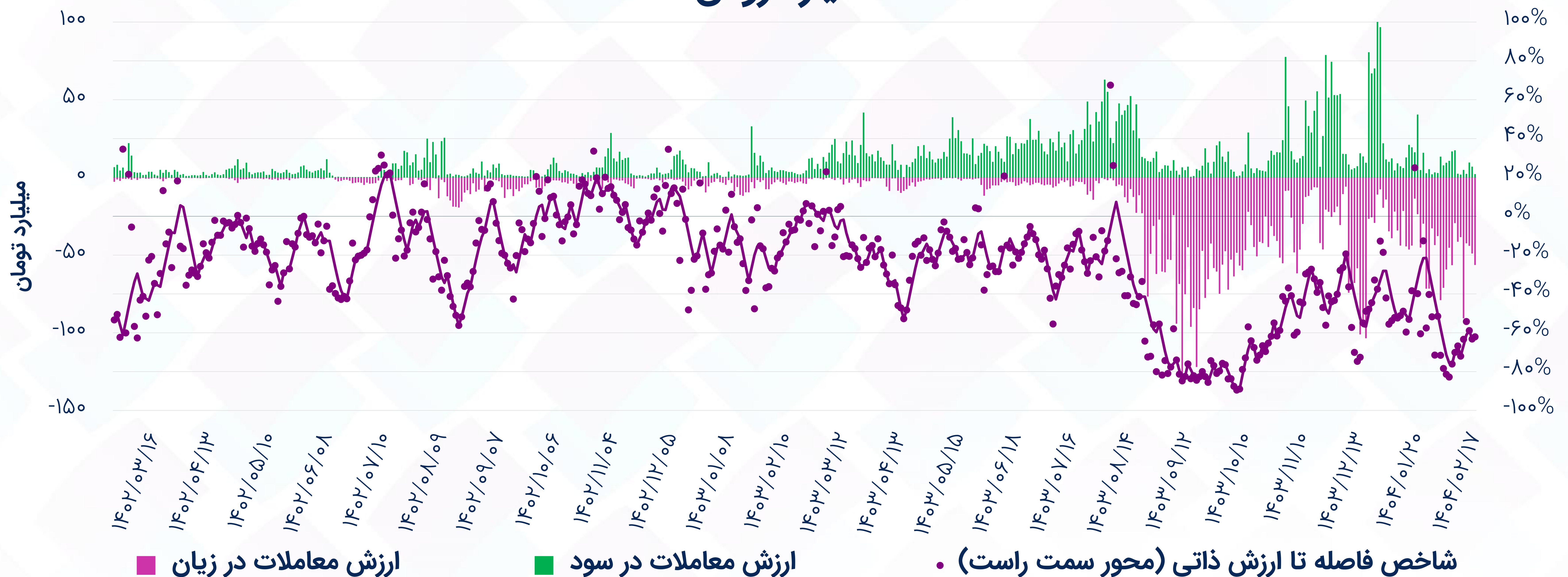
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

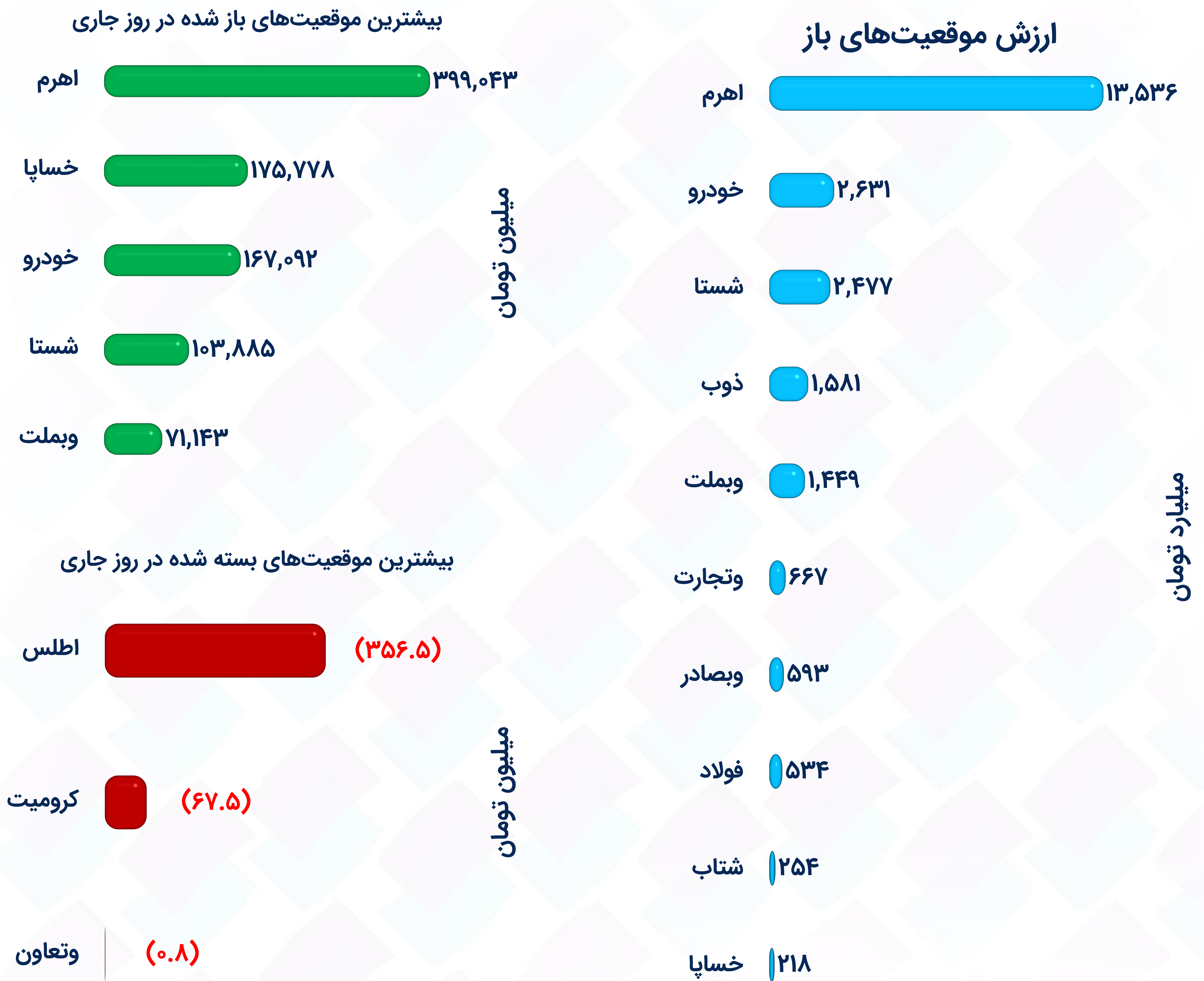
اختیار خرید

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	۴۴	۱۹۷.۹	۲,۷۵۸.۵	۱۶۶.۵	۳۱.۵	(۲۶.۸%)
خودرو	۱۳	۱۶۸.۳	۱,۳۹۴.۶	۱۶۴.۹	۳.۴	(۵.۰%)
شستا	۳۴	۴۸.۷	۵۸۶.۴	۳۸.۹	۹.۸	(۸.۸%)
وتجارت	۲۳	۴۴.۹	۳۰۹.۳	۴۳.۴	۱.۵	(۳.۸%)
خسپا	۲۶	۳۸.۷	۳۶۲.۳	۲۶.۰	۱۲.۷	(۳۵.۲%)
ذوب	۲۴	۲۶.۲	۲۲۲.۱	۲۴.۳	۱.۹	(۱۱.۰%)
وبملت	۲۱	۹.۰	۱۶۲.۰	۵.۵	۳.۵	(۳۶.۲%)

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
خودرو	۶	۳۲,۵۳۸.۰	۸۸۷,۰۰۲.۲	۳۵۶.۵	۳۲,۱۸۱.۵	(۵۶.۳%)
اهرم	۲۳	۲۳,۱۴۷.۵	۱,۶۲۸,۱۷۲.۱	۱,۶۷۰.۳	۲۱,۴۷۷.۲	(۶۷.۸%)
شستا	۶	۲,۱۳۶.۹	۱۶۸,۹۵۷.۶	۲.۶	۲,۱۳۴.۳	(۸۳.۴%)
شتاب	۲	۲۵۰.۰	۱۷,۷۹۱.۸	۰.۰	۲۵۰.۰	(۹۲.۸%)
خسپا	۳	۸۱.۸	۱,۵۷۸.۳	۰.۰	۸۱.۸	(۸۹.۳%)
ذوب	۴	۴۸.۴	۸,۷۳۰.۴	۰.۰	۴۸.۴	(۷۹.۴%)
وبملت	۳	۳۶.۷	۱,۰۰۸.۲	۰.۰	۳۶.۷	(۵۰.۷%)

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

اهرم ۵,۲۲۸

خودرو ۸۹۳

شستا ۲۲۶

ذوب ۶۲

وبملت ۲۵

شتاب ۲۴

وتعاون ۱۹

وبصادر ۶.۴۵

وتجارت ۲.۶۱

خودران ۲.۴۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۳۱,۲۷۱.۰

خودرو ۴۰,۰۵۲.۳

شستا ۲۰,۲۱۶.۶

شتاب ۱۴,۰۰۰.۲

خسپا ۱,۲۱۸.۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

توان (۴۱۷.۶)

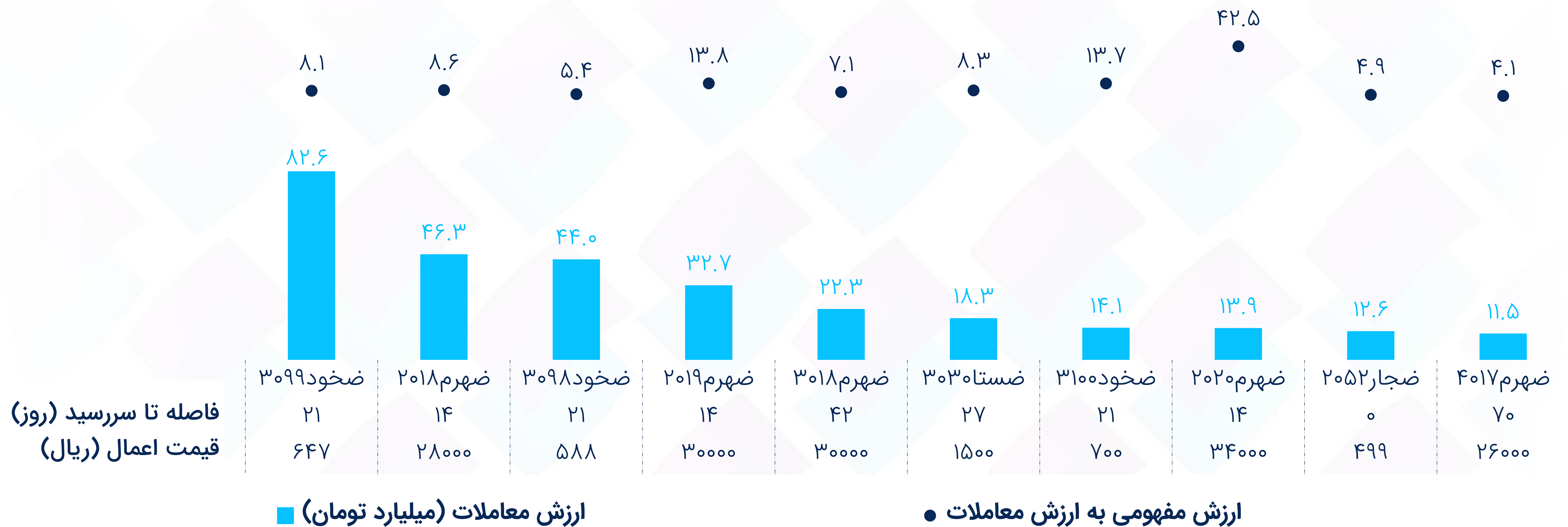
وبصادر (۰.۸)

وتعاون (۰.۲)

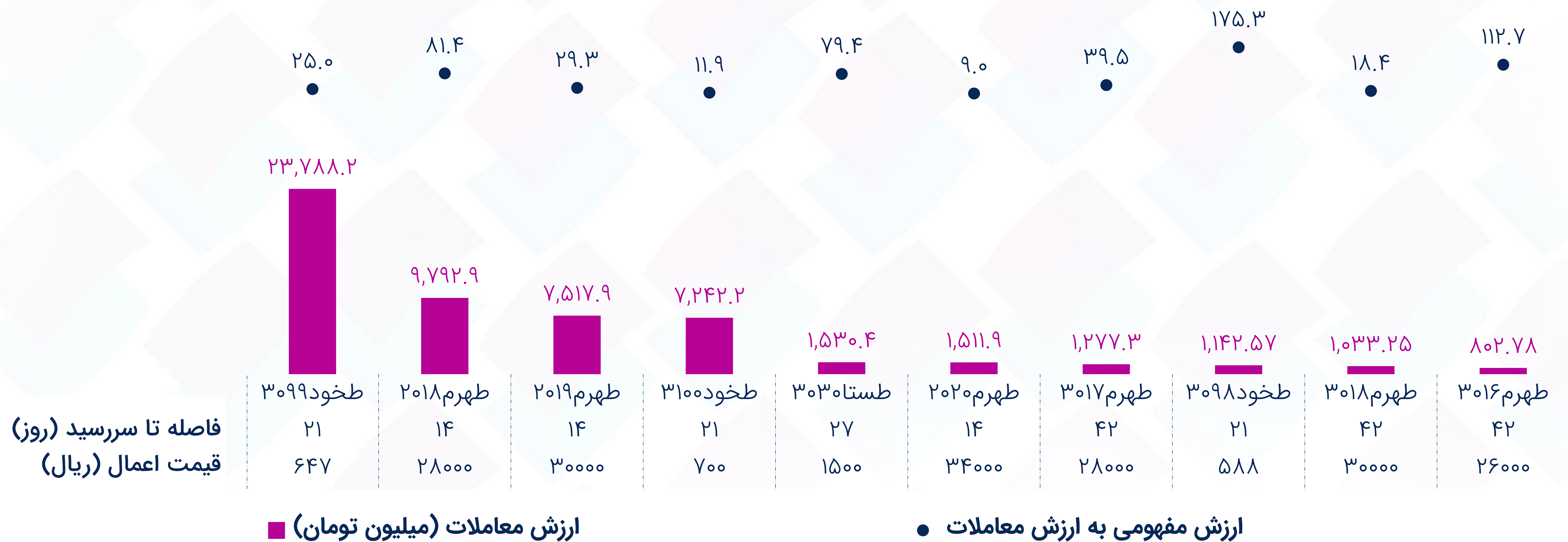
میلیون تومان

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
ضوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۴۰	۲.۶	۵۱	۱,۸۵۷	۱,۹۵۱	۵.۱%	۳۸.۳	۰.۵۸	۸۰	۵۸%
ضتوان ۲۱۰	توان	۳۰,۰۰۰	۴	۳.۰	۱۹	۲۷,۹۹۷	۳۰,۰۱۹	۷.۲%	۱,۵۷۹.۹	۰.۰۶	۲۶	۳۸%
ضپناه ۳۰۶	پناه	۱۵,۰۰۰	۳۳	۱۰.۰	۱,۰۰۰	۱۵,۸۲۵	۱۶,۰۰۰	۱.۱%	۱۶.۰	۰.۹۰	۱,۳۲۸	۳۳%
ضفرز ۴۰۱	فرز	۳۷,۳۰۰	۵۳	۶.۳	۷,۰۰۰	۴۴,۴۰۰	۴۴,۳۰۰	(۰.۲%)	۶.۳	۰.۹۸	۸,۹۰۳	۲۷%
ضهمن ۳۰۱۴	خبهمن	۱,۹۰۰	۴۲	۱.۱	۵۸۲	۲,۵۶۱	۲,۴۸۲	(۳.۱%)	۴.۳	۱.۰۰	۷۳۳	۲۶%

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 ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۳۵	۹.۹	۶	۵۴۰	۱,۰۰۶	۸۶%	۱۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۷	۴.۱	۱۱	۴,۰۸۱	۶,۴۹۱	۵۹%	۵۹۰.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۷	۱.۷	۱	۵۴۰	۷۰۱	۳۰%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۳۵	۶.۱	۶	۵۴۰	۹۰۶	۶۸%	۱۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۲	فولاد	۵,۷۶۰	۲۷	۶.۳	۲۰	۴,۰۸۱	۵,۷۸۰	۴۲%	۲۸۹.۰	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
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۲	۳.۱	۱۰,۲۹۷	۳۰,۷۸۰	۳۱,۷۰۳	۳.۰%	۳.۱	-۰.۹۹	۹,۶۳۹	(۶.۴%)
طهرم ۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۴	۸.۶	۷,۱۵۰	۳۰,۷۸۰	۳۰,۸۵۰	۰.۲%	۴.۳	-۰.۹۹	۶,۶۴۹	(۷.۰%)
طهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۴	۲.۴	۱۲,۰۰۰	۳۰,۷۸۰	۳۰,۰۰۰	(۲.۵%)	۲.۵	-۱.۰۰	۱۰,۵۸۴	(۱۱.۸%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۴	۱,۵۱۱.۹	۳,۴۰۶	۳۰,۷۸۰	۳۰,۵۹۴	(۰.۶%)	۹.۰	-۰.۸۶	۲,۸۷۲	(۱۵.۷%)
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۲۱	۳۵۶.۵	۱۱۳	۷۰۱	۶۸۷	(۲.۰%)	۶.۱	-۰.۷۸	۹۳	(۱۷.۹%)

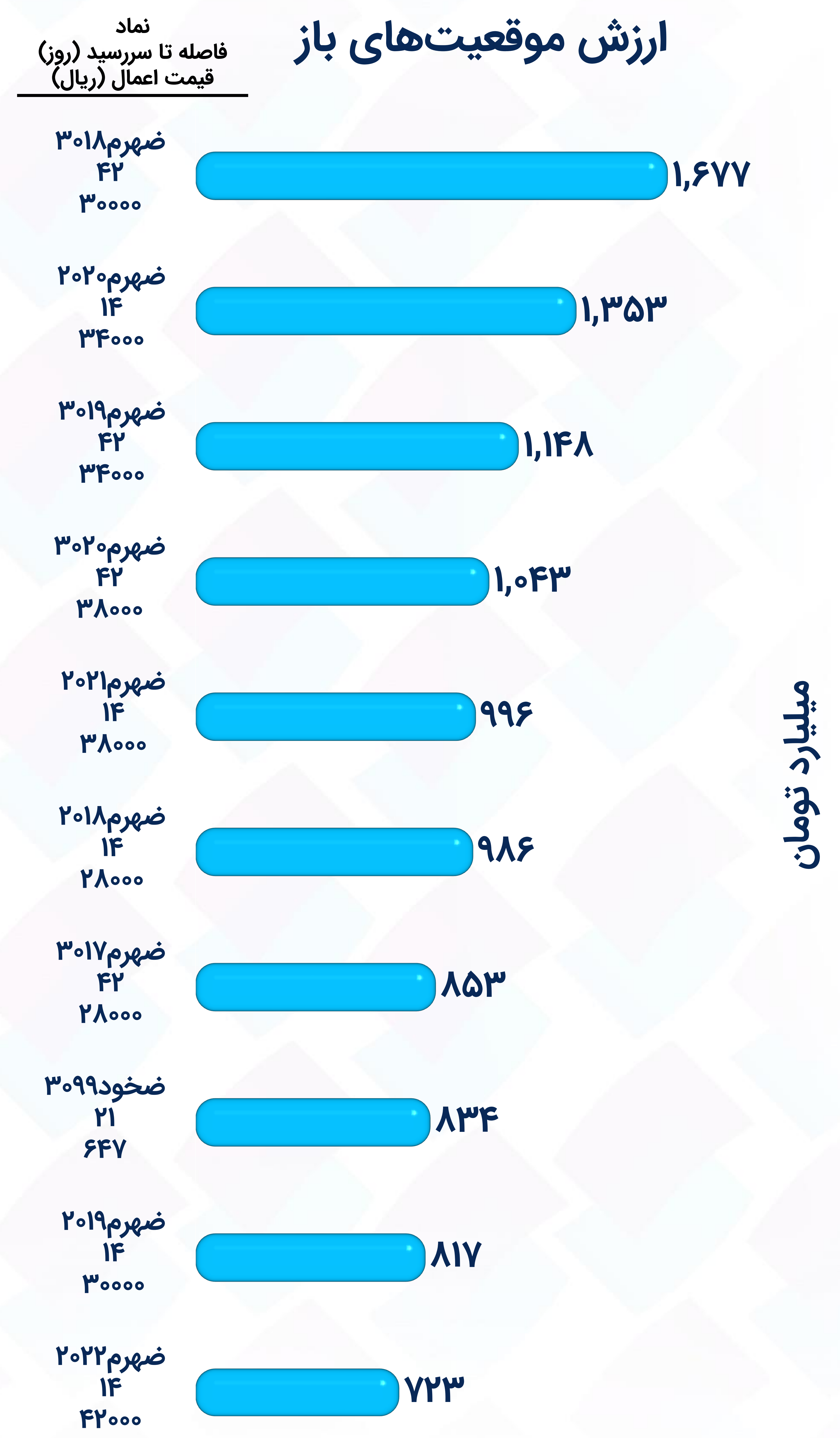
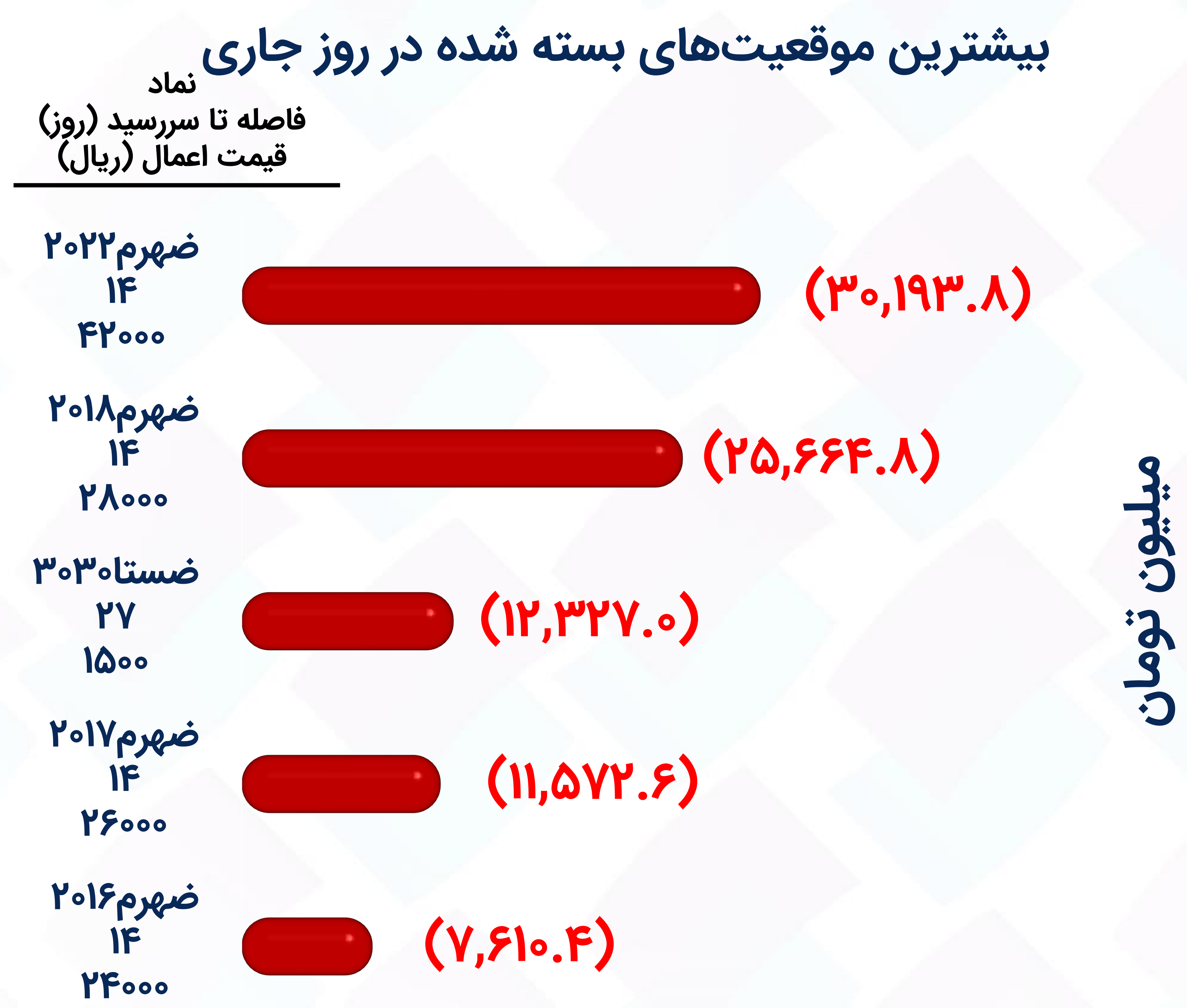
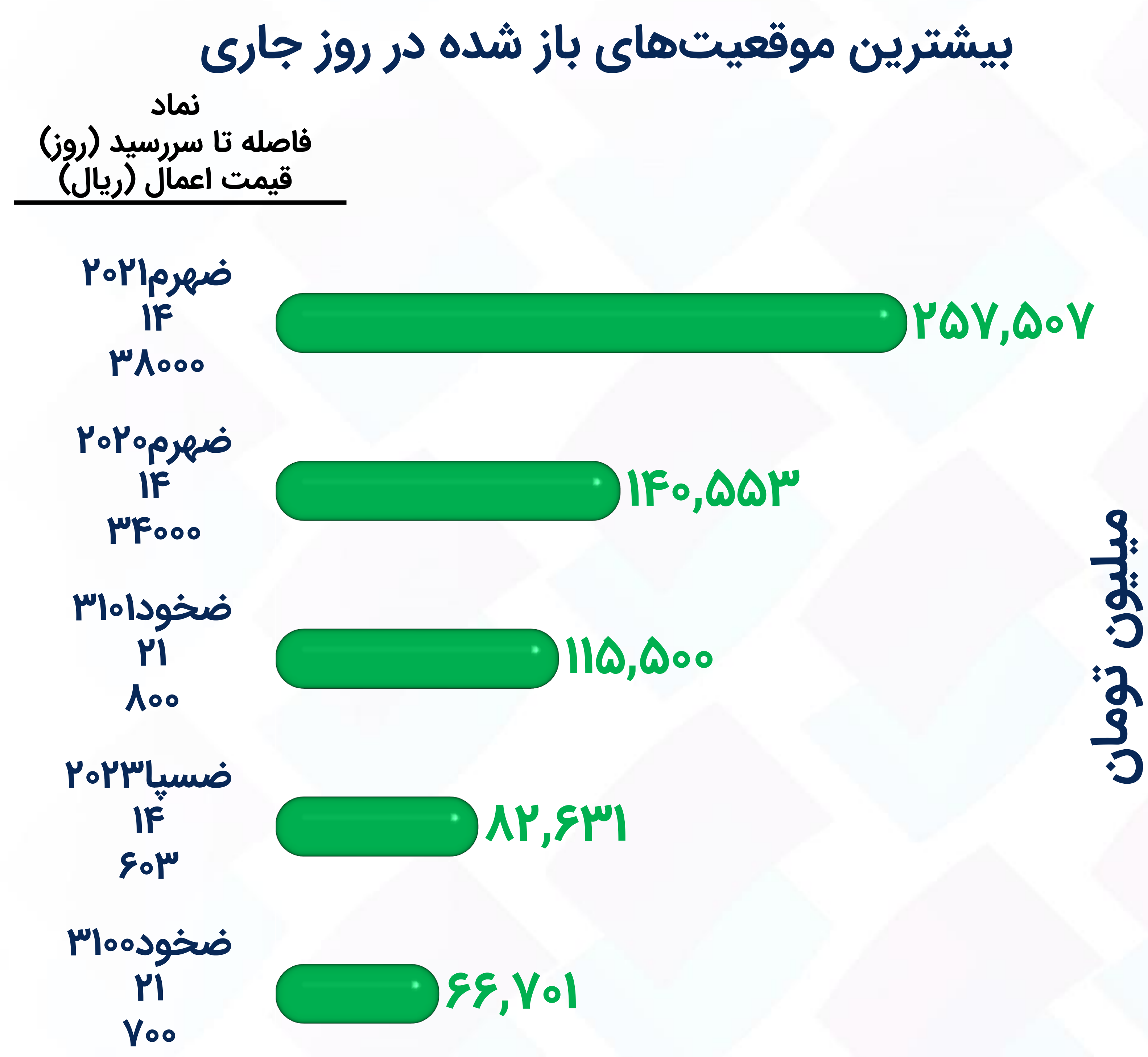
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طذوب ۲۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۷	۰.۱	۱	۵۴۰	۱۹۹	(۶۳.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طسپا ۲۰۱۸	خسپا	۳۹۲	۱۴	۰.۸	۵	۵۶۸	۳۸۷	(۳۱.۹%)	۷۷.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۹۱	خودرو	۳۲۹	۲۱	۰.۱	۱۵	۷۰۱	۳۱۴	(۵۵.۲%)	۲۰.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۷	۰.۲	۱	۵۴۰	۳۹۹	(۲۶.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۴	۲۳.۸	۱۷	۳۰,۷۸۰	۱۹,۹۸۳	(۳۵.۱%)	۱,۱۷۵.۵	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.



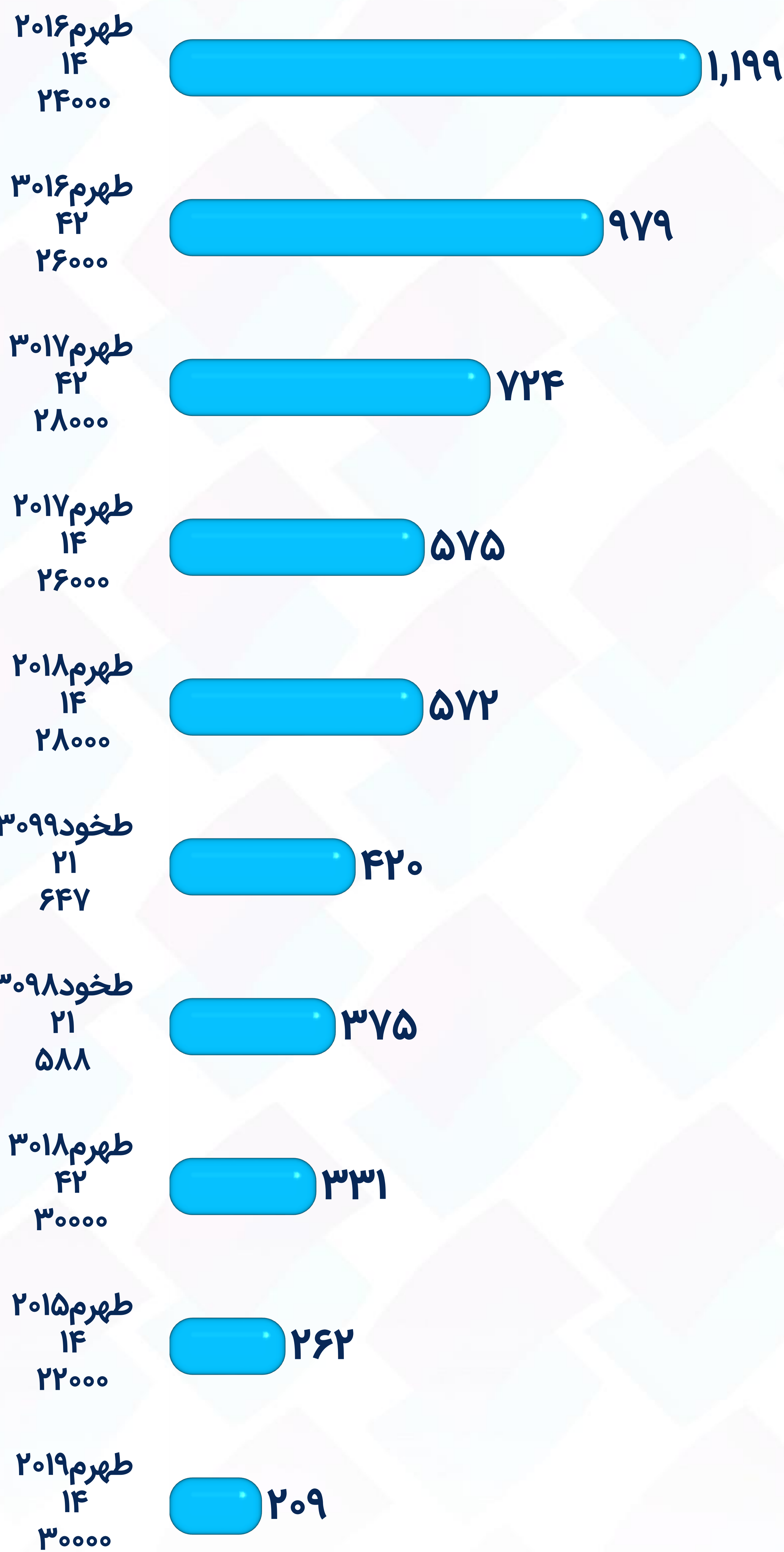
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

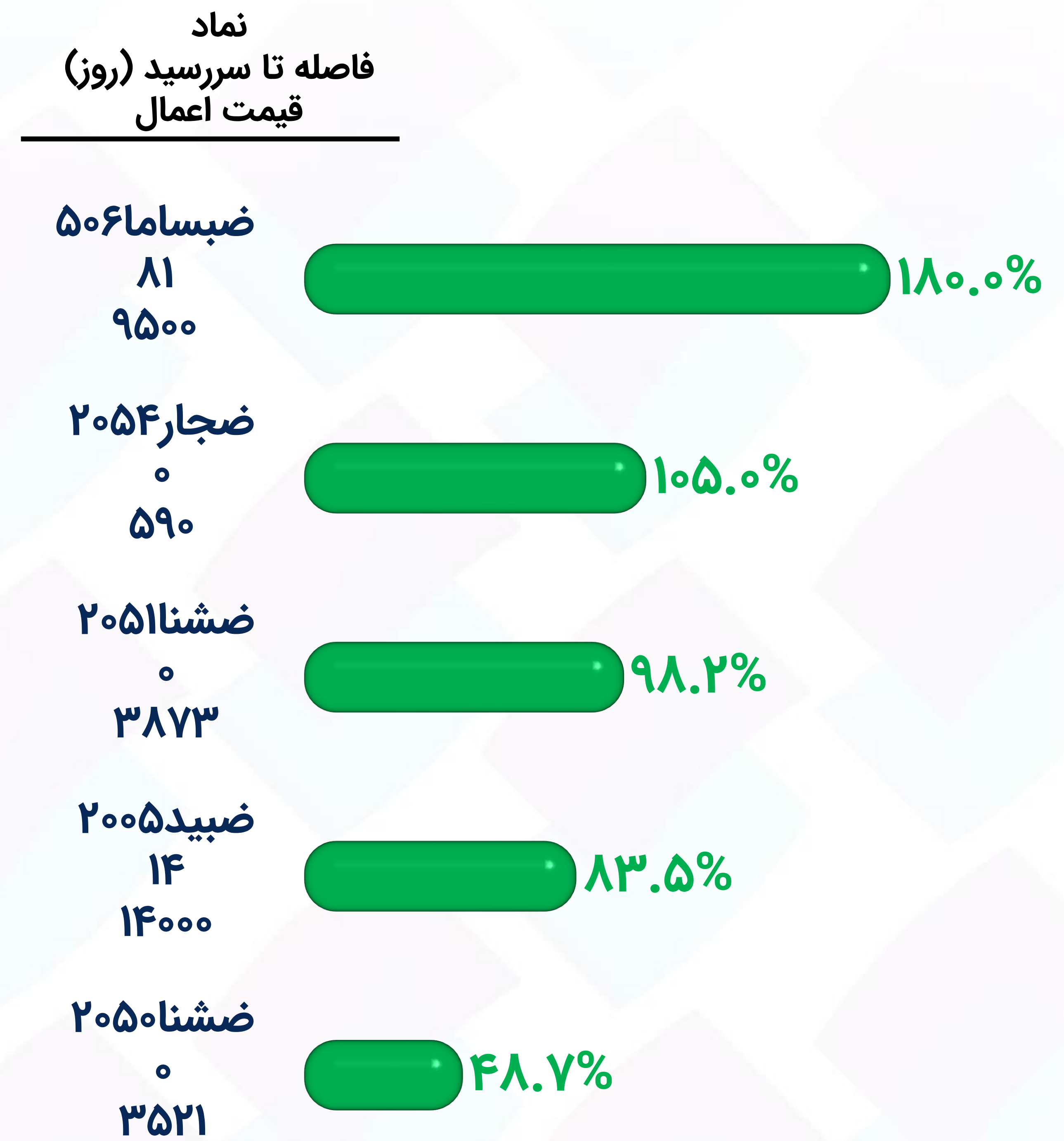
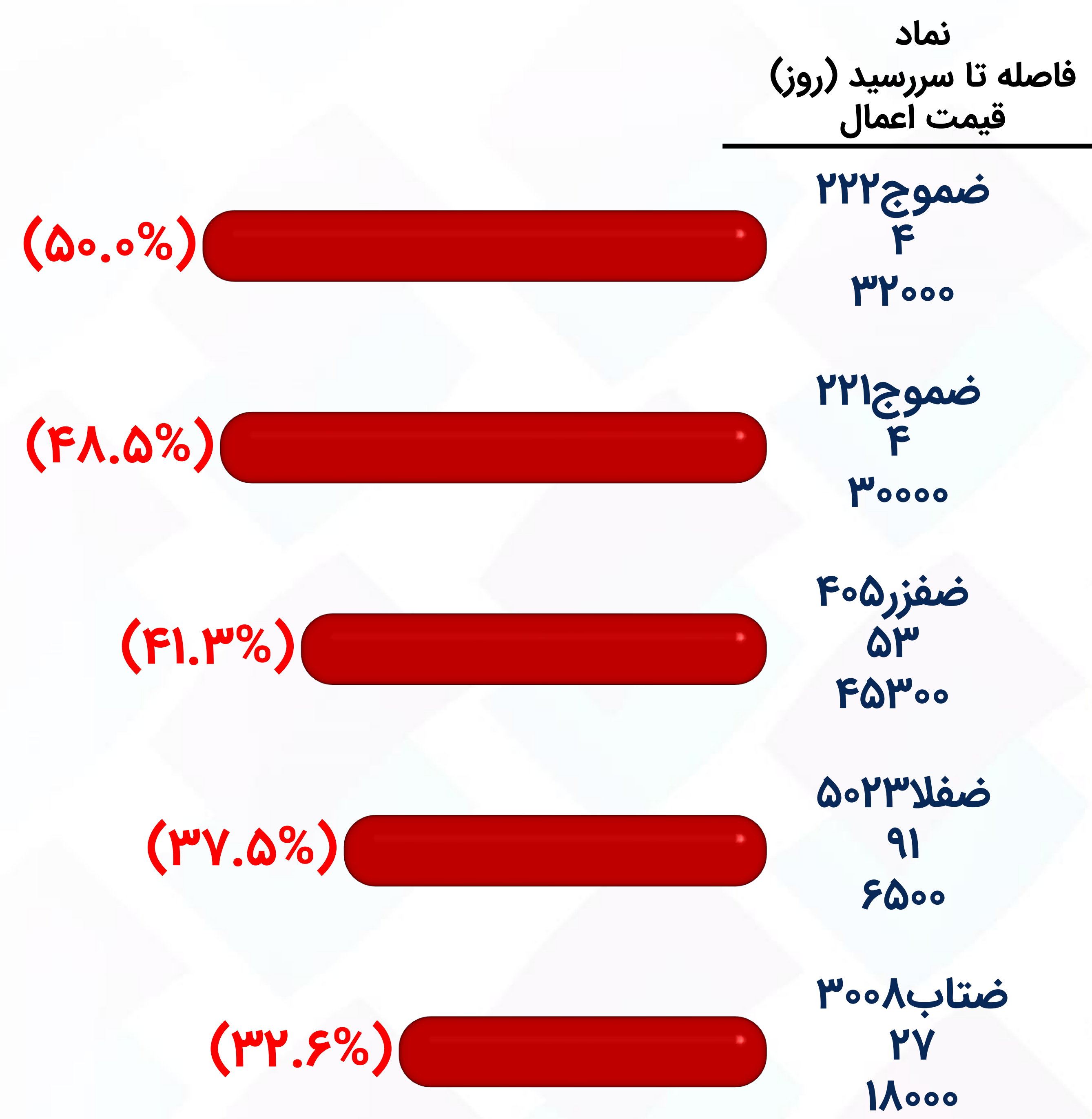
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



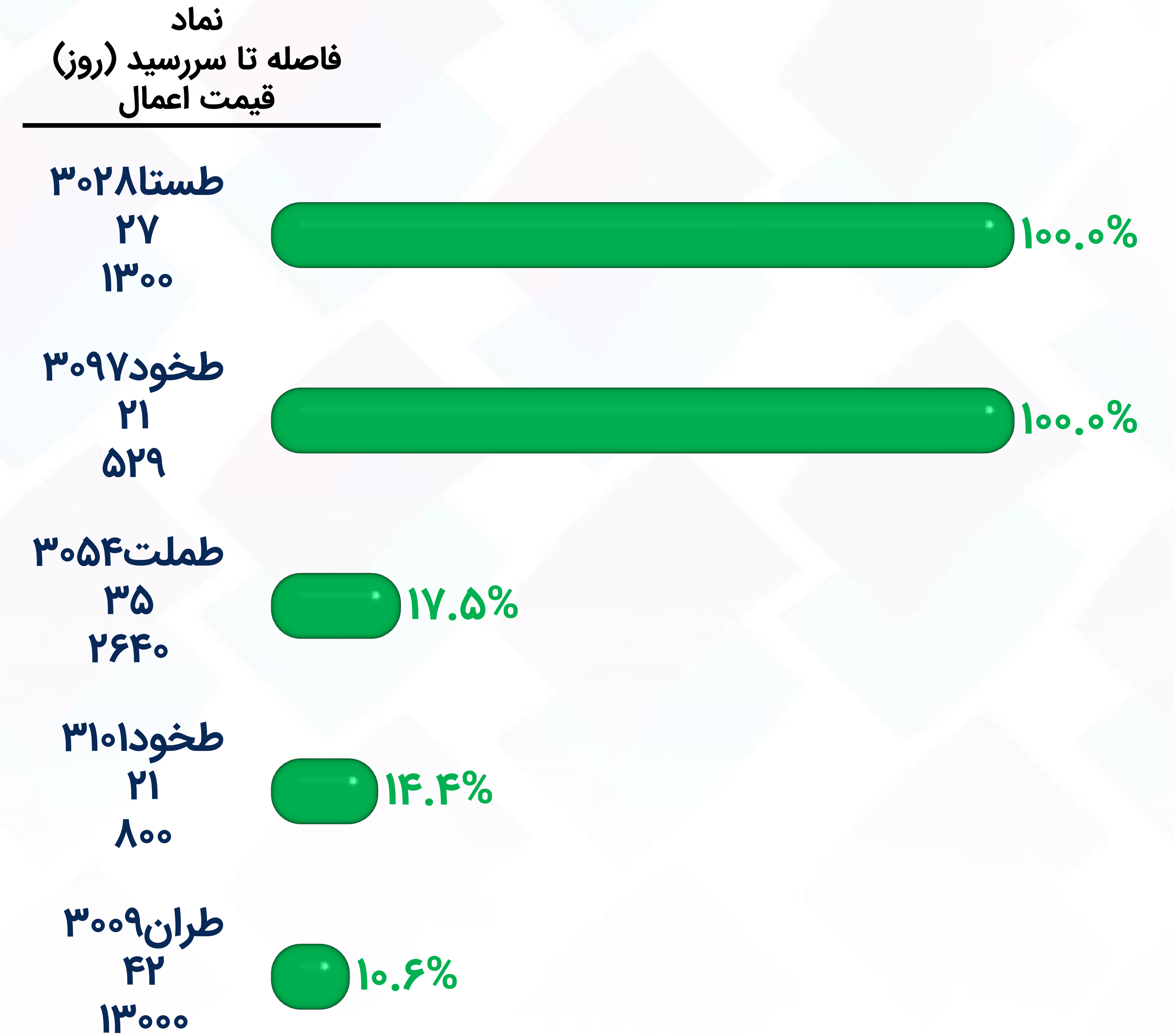
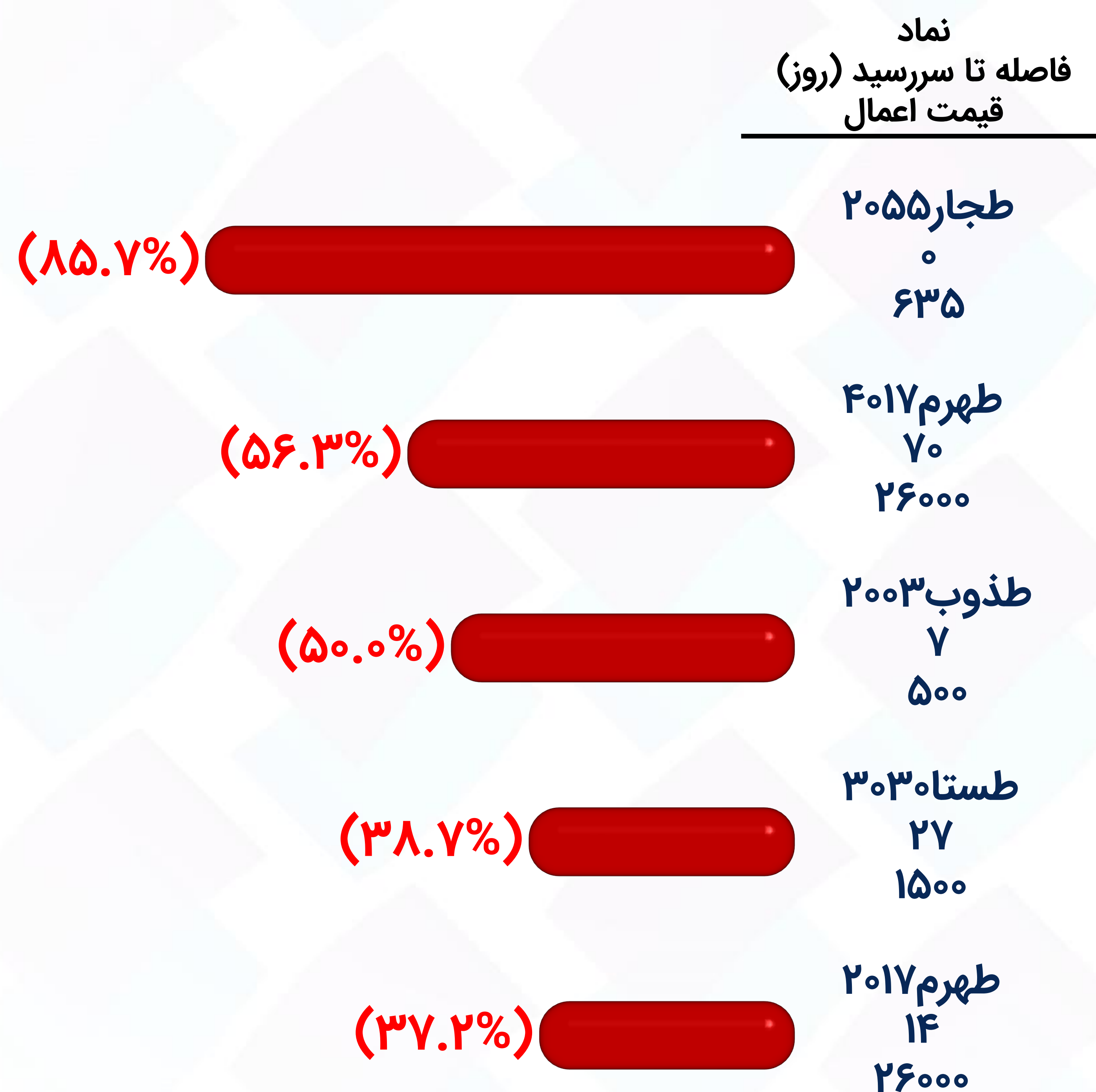
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

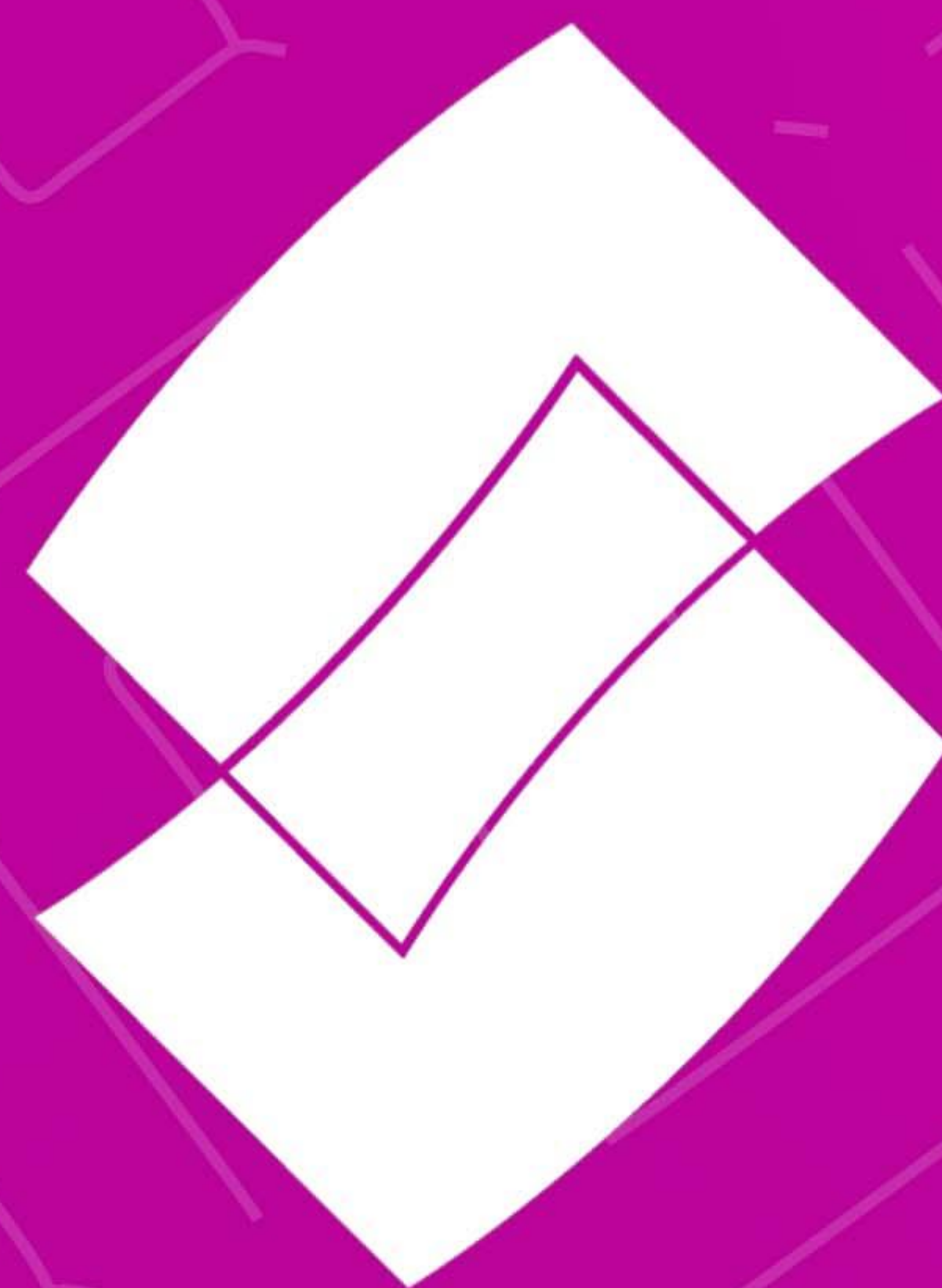
اختیار خرید



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.