

شماره
۴۷۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





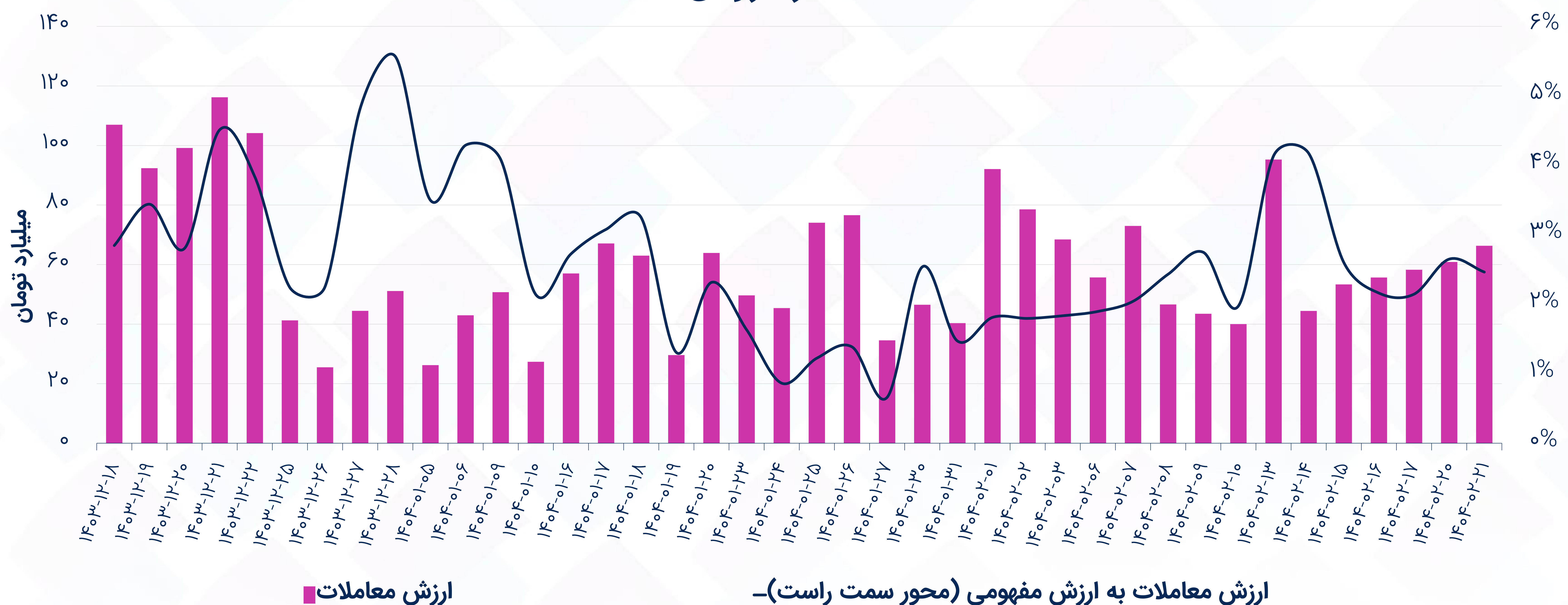
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



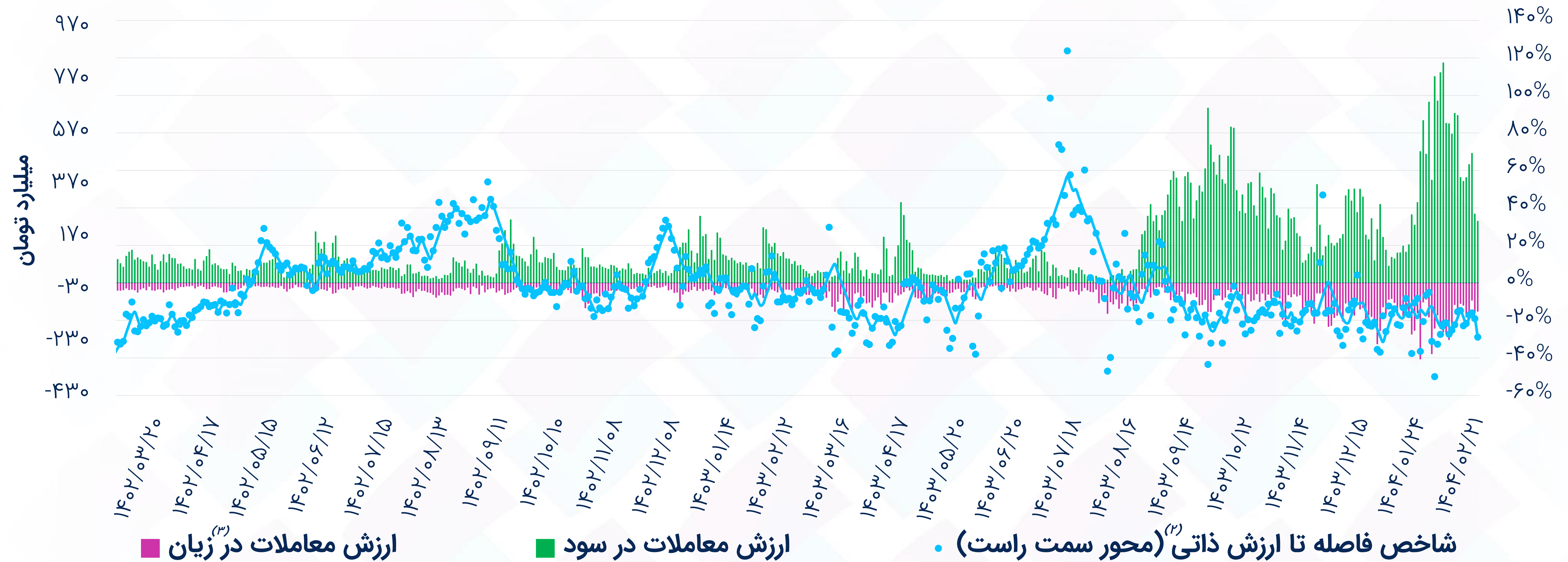
اختیار فروش



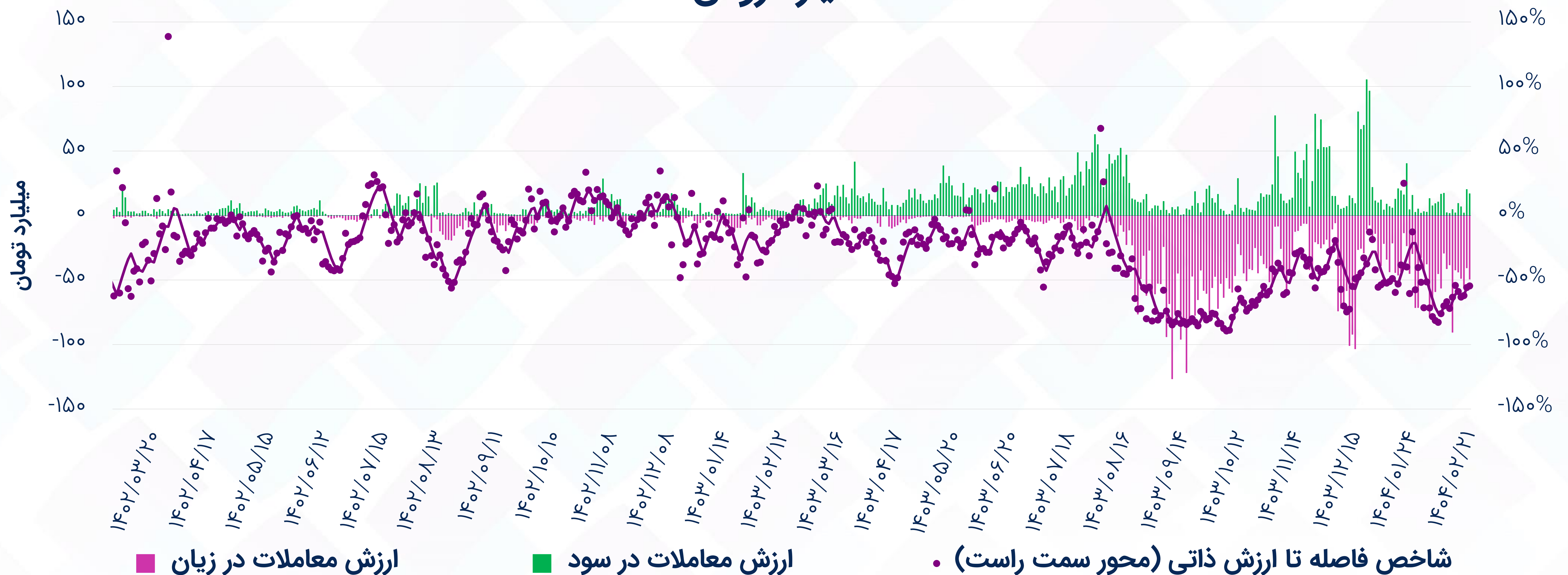
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

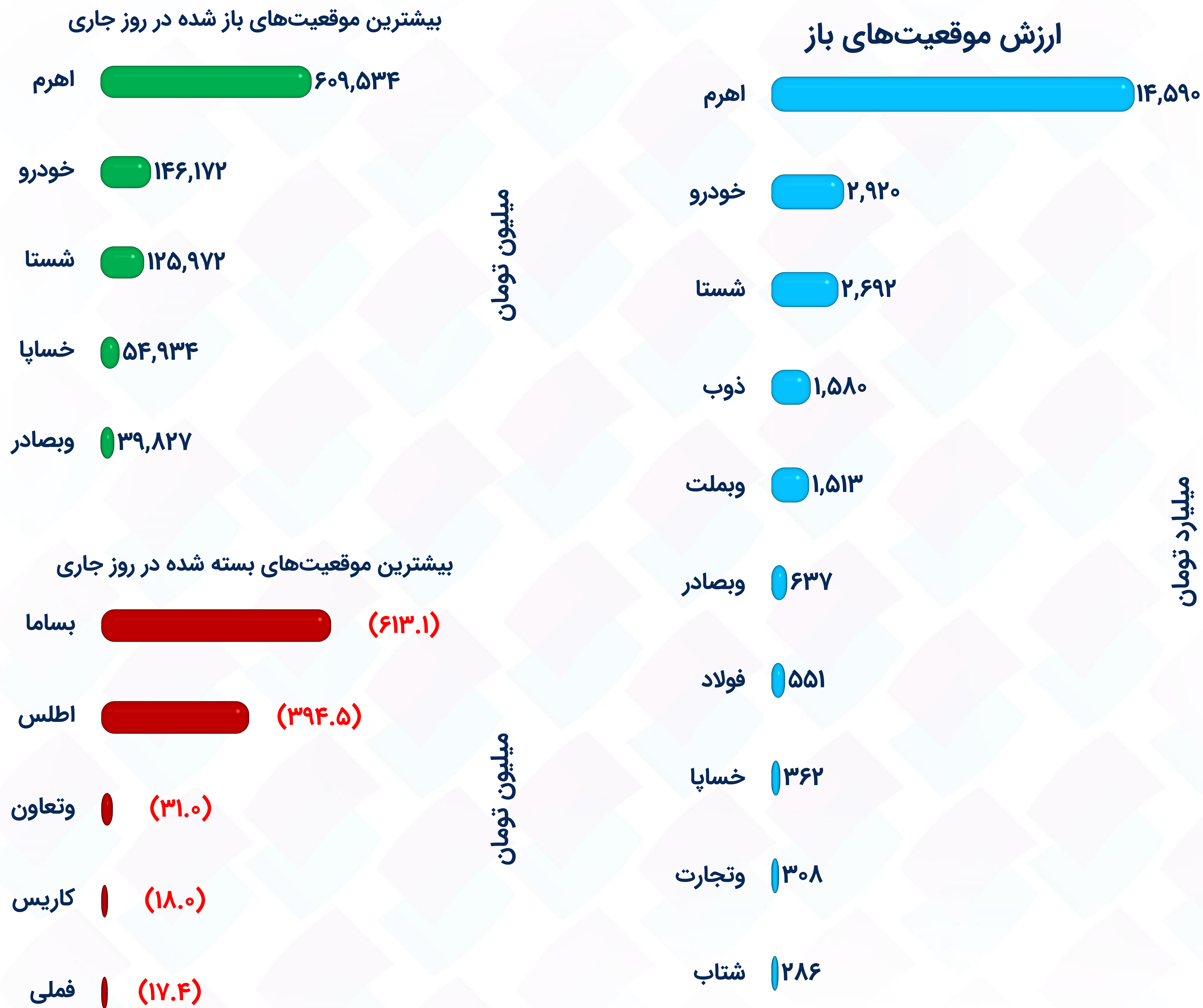
اختیار خرید

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	۱۷۵.۱	۳,۰۵۳.۳	۹۹.۹	۷۵.۱	(۳۸.۰%)
خودرو	۱۳	۷۱.۶	۸۴۳.۹	۶۵.۳	۶.۳	(۱۹.۷%)
شستا	۳۸	۲۷.۶	۴۵۰.۷	۱۴.۵	۱۳.۱	(۳۴.۹%)
ذوب	۲۵	۱۸.۵	۱۷۲.۴	۱۷.۵	۱.۰	(۱۸.۲%)
خسپا	۲۲	۱۴.۱	۱۸۸.۶	۷.۸	۶.۳	(۷.۸%)
وتجارت	۱۵	۶.۴	۳۲.۳	۳.۷	۲.۷	(۲۴.۶%)
وبملت	۱۹	۶.۴	۷۶.۳	۴.۵	۱.۸	(۲۳.۵%)

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	۲۱	۴۴,۲۲۰.۶	۲,۰۰۱,۹۵۳.۸	۱۲,۲۴۴.۹	۳۱,۹۷۵.۷	(۶۳.۶%)
خودرو	۷	۱۹,۶۰۴.۹	۵۴۶,۵۲۷.۲	۴,۰۶۰.۳	۱۵,۵۴۴.۵	(۳۴.۸%)
شستا	۸	۱,۹۷۷.۲	۱۰۳,۷۶۷.۲	۶۳۴.۶	۱,۳۴۲.۶	(۵۶.۱%)
ذوب	۴	۴۱۳.۳	۳۰,۳۸۹.۳	۰.۰	۴۱۳.۳	(۴۵.۸%)
خسپا	۲	۵۵.۸	۱,۵۶۸.۸	۰.۰	۵۵.۷	(۴.۸%)
وبصادر	۳	۱۸.۵	۲,۳۴۷.۹	۲.۴	۱۶.۱	۳۶۲.۸%
فولاد	۳	۱۵.۶	۲۱۱.۱	۱۴.۸	۰.۸	۱۷۰.۹%

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 ۴,۸۸۹

خودرو ۸۳۶

شستا ۲۰۵

ذوب ۵۸

وبملت ۲۵

شتاب ۲۲

وتعاون ۱۹

وبصادر ۷.۸۸

خسپا ۲.۶۳

خودران ۲.۵۷

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

وبصادر ۱,۱۷۵.۱

فولاد ۱۸۵.۱

شپنا ۱۴۲.۰

خودران ۷۶.۳

خسپا ۲۴.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۶۶,۱۶۰.۰)

خودرو (۵۳,۹۰۰.۲)

ذوب (۲,۹۸۴.۶)

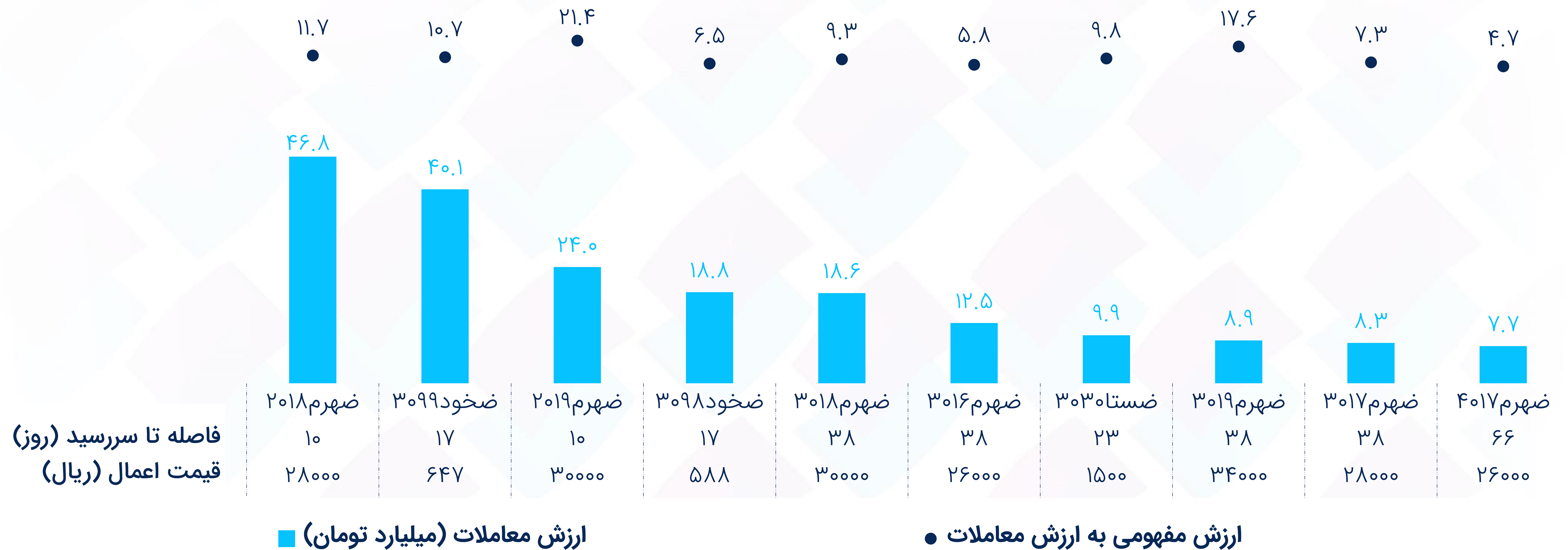
شتاب (۲,۰۳۹.۷)

شستا (۱,۵۵۱.۶)

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
ضموج ۴۱۵	موج	۲۶,۰۰۰	۶۳	۲.۳	۲,۵۱۰	۲۷,۸۰۰	۲۸,۵۱۰	۲.۶%	۱۱.۴	۰.۸۰	۳,۷۸۷	۵۱%
ضهم وزن ۳۰۶	هم وزن	۲۰,۰۰۰	۱۴	۲.۵	۱,۰۷۸	۲۰,۹۹۹	۲۱,۰۷۸	۰.۴%	۱۹.۶	۰.۸۶	۱,۳۸۹	۲۹%
ضتاب ۳۰۰۵	شتاب	۱۴,۰۰۰	۲۳	۳.۸	۲,۵۰۳	۱۶,۸۴۰	۱۶,۵۰۳	(۲.۰%)	۶.۶	۰.۹۸	۳,۱۹۳	۲۸%
ضسپا ۳۰۳۹	خسپا	۲۸۹	۳۸	۱۲۵.۱	۲۳۳	۵۶۳	۵۲۲	(۷.۳%)	۲.۲	۱.۰۰	۲۸۴	۲۲%
ضهرم ۶۰۲۷	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۲۹	۲۲.۲	۱۰,۰۹۱	۲۹,۳۳۰	۳۰,۰۹۱	۲.۶%	۳.۰	۰.۹۹	۱۱,۵۵۹	۱۵%

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
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۳	۱۲.۱	۱۰	۳,۹۰۵	۶,۴۹۰	۶۶%	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۳۱	۱.۰	۵	۵۱۰	۹۰۵	۷۷%	۱۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۰	۸۱.۵	۳۷	۲۹,۳۳۰	۴۲,۰۳۷	۴۳%	۱,۱۳۶.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۲	فولاد	۵,۷۶۰	۲۳	۱.۱	۶	۳,۹۰۵	۵,۷۶۶	۴۸%	۹۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۳۱	۸.۰	۶	۵۱۰	۸۰۶	۵۸%	۱۳۴.۳	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
تصاد۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۳۱	۲.۴	۸	۶۹۳	۹۹۲	۴۳.۱%	۱۲۴.۰	-۱.۰۰	۲۷۷	۳۳۶۳.۹%
طفلا۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۲۳	۱۴.۷	۳۵۳	۳,۹۰۵	۴,۶۸۷	۲۰.۰%	۱۳.۳	-۱.۰۰	۱,۰۱۲	۱۸۶.۶%
طهرم۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳۸	۱.۵	۷,۳۰۰	۲۹,۳۳۰	۳۰,۷۰۰	۴.۷%	۴.۲	-۰.۹۷	۷,۳۷۵	۱.۰%
طهرم۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۰	۱,۳۸۱.۱	۴,۴۱۴	۲۹,۳۳۰	۲۹,۵۸۶	۰.۹%	۶.۷	-۰.۹۷	۴,۲۷۲	(۳.۲%)
طسپا۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۱۰	۵۵.۷	۲۰	۵۶۳	۵۲۳	(۷.۱%)	۲۶.۲	-۰.۳۴	۱۹	(۴.۸%)

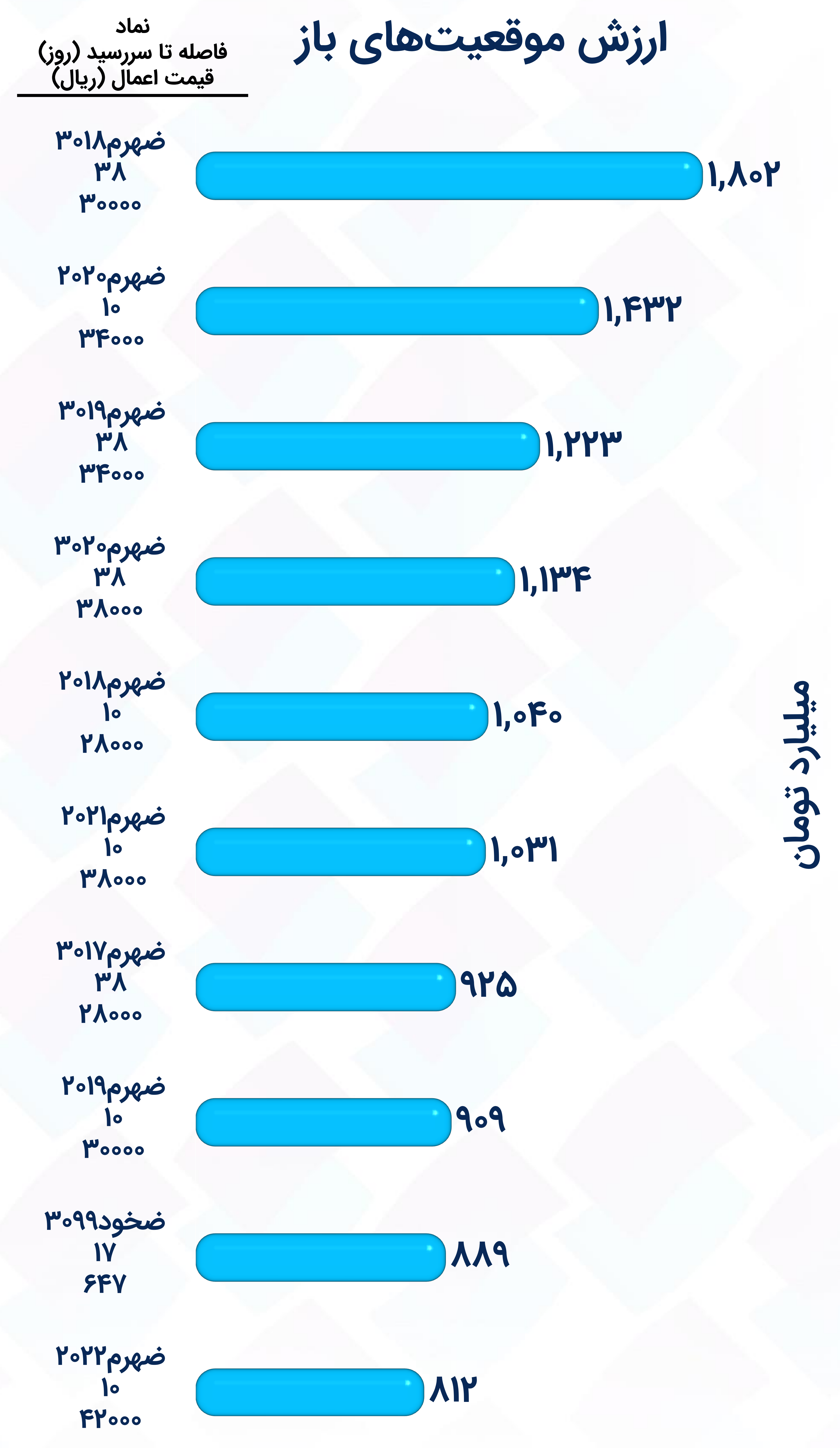
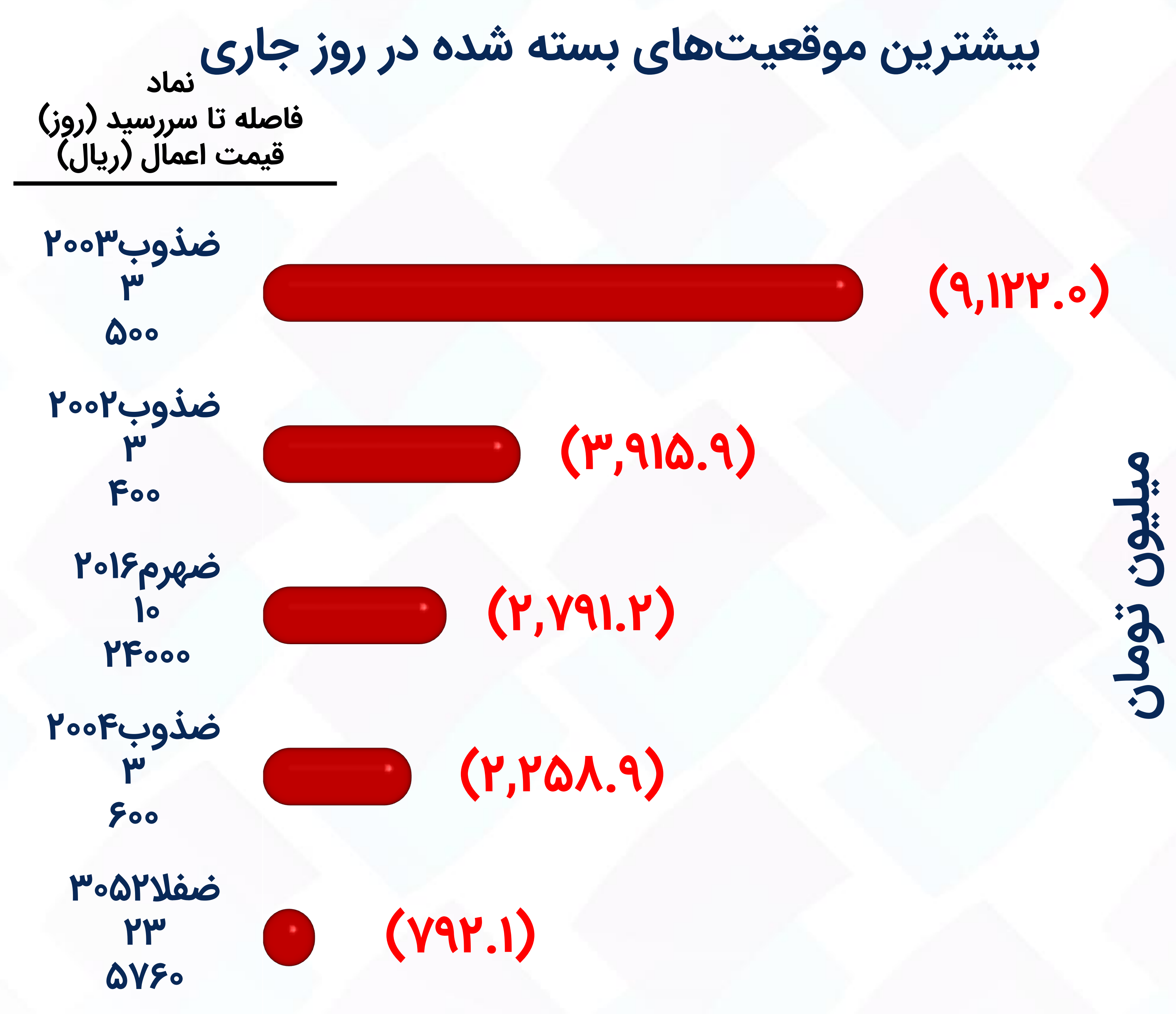
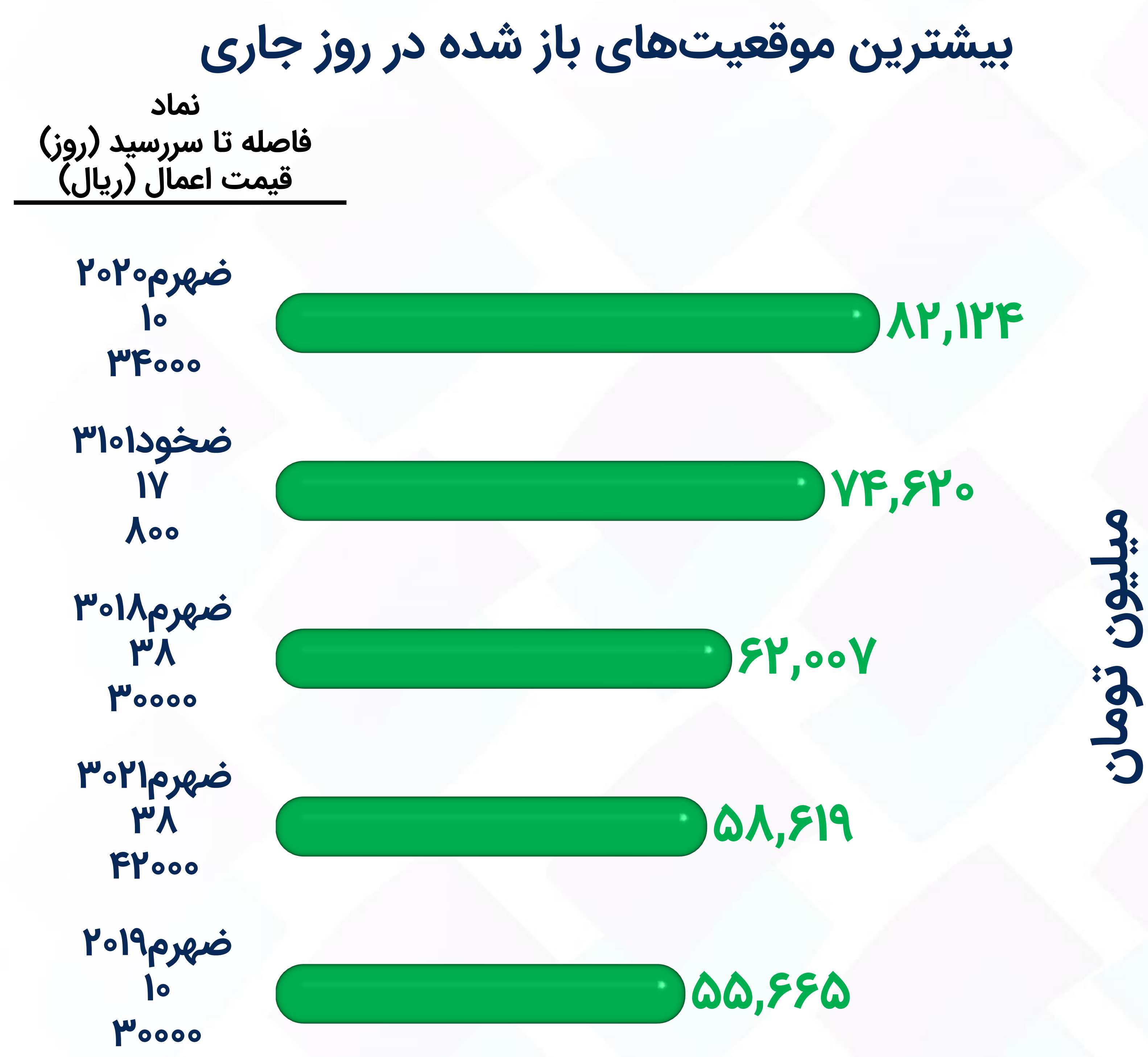
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طذوب۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۶۶	۰.۲	۴	۵۱۰	۱۹۶	(۶۱.۶%)	۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۱۷	۰.۲	۱	۶۶۱	۲۸۱	(۵۷.۵%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۳	۱.۰	۱	۵۱۰	۳۹۹	(۲۱.۸%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۰	۱۲.۳	۱۲	۲۹,۳۳۰	۱۹,۹۸۸	(۳۱.۹%)	۱,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۰	۱۹.۴	۲۶	۲۹,۳۳۰	۲۱,۹۷۴	(۲۵.۱%)	۸۴۵.۲	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.



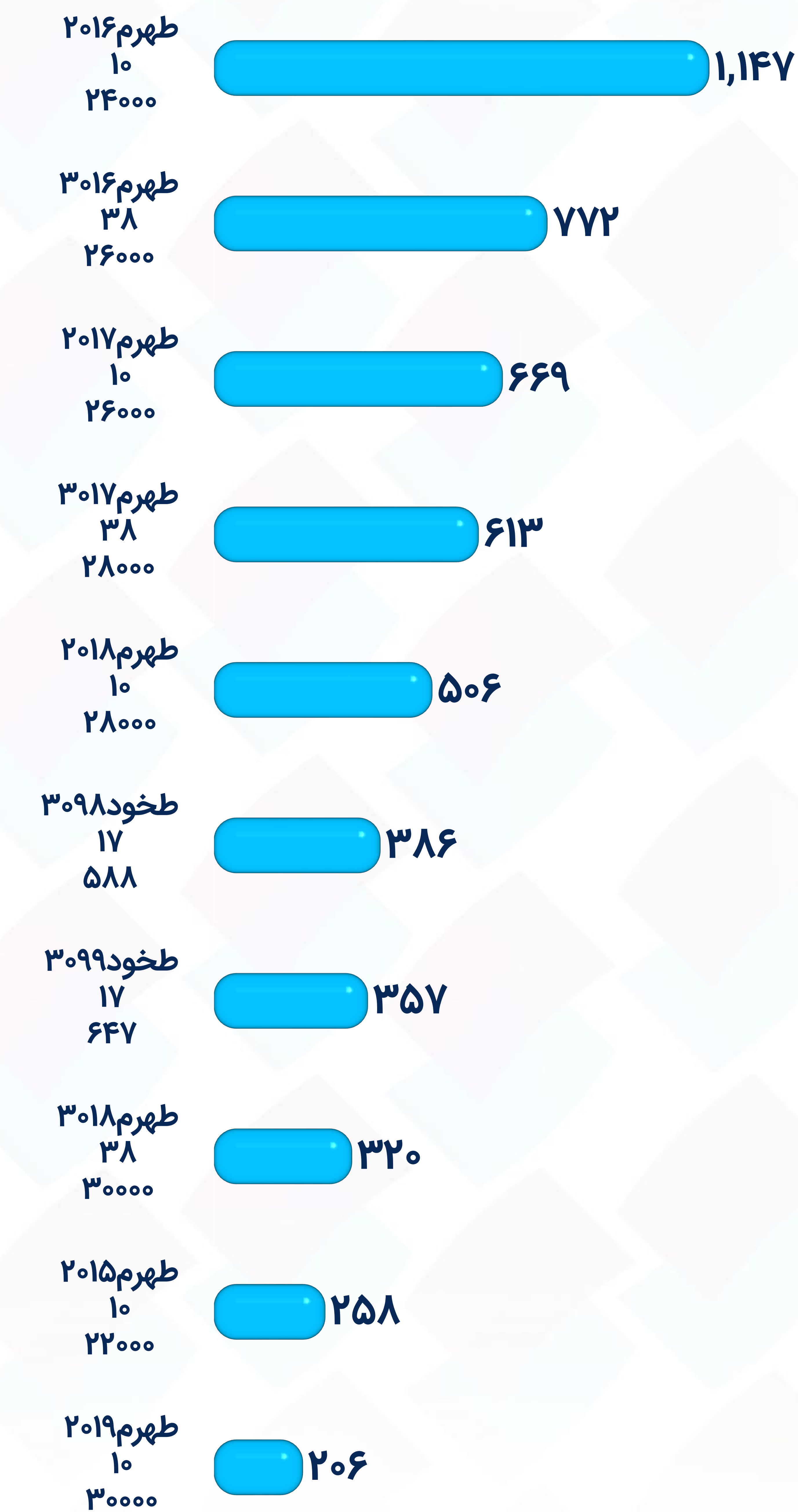
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

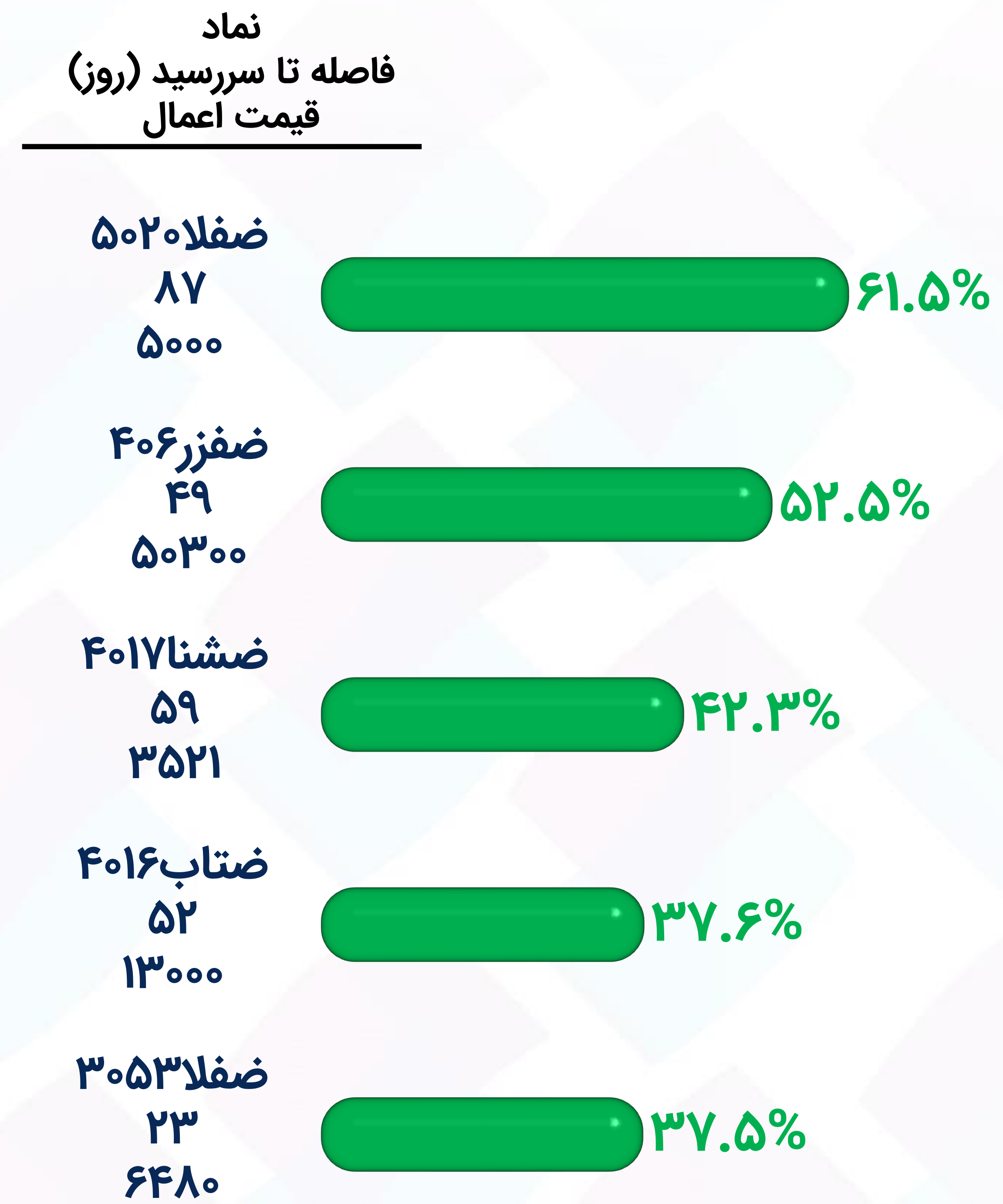
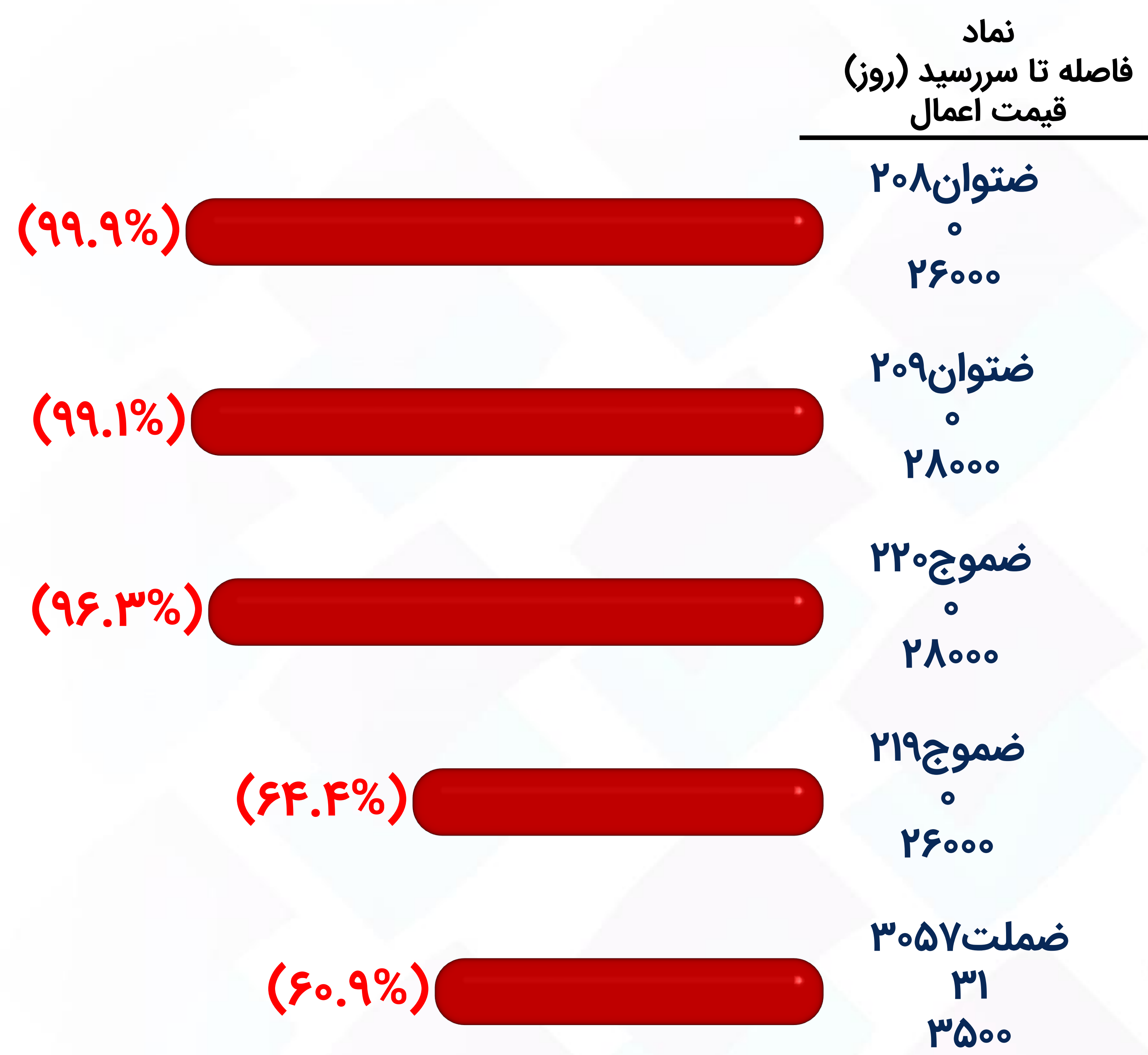
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



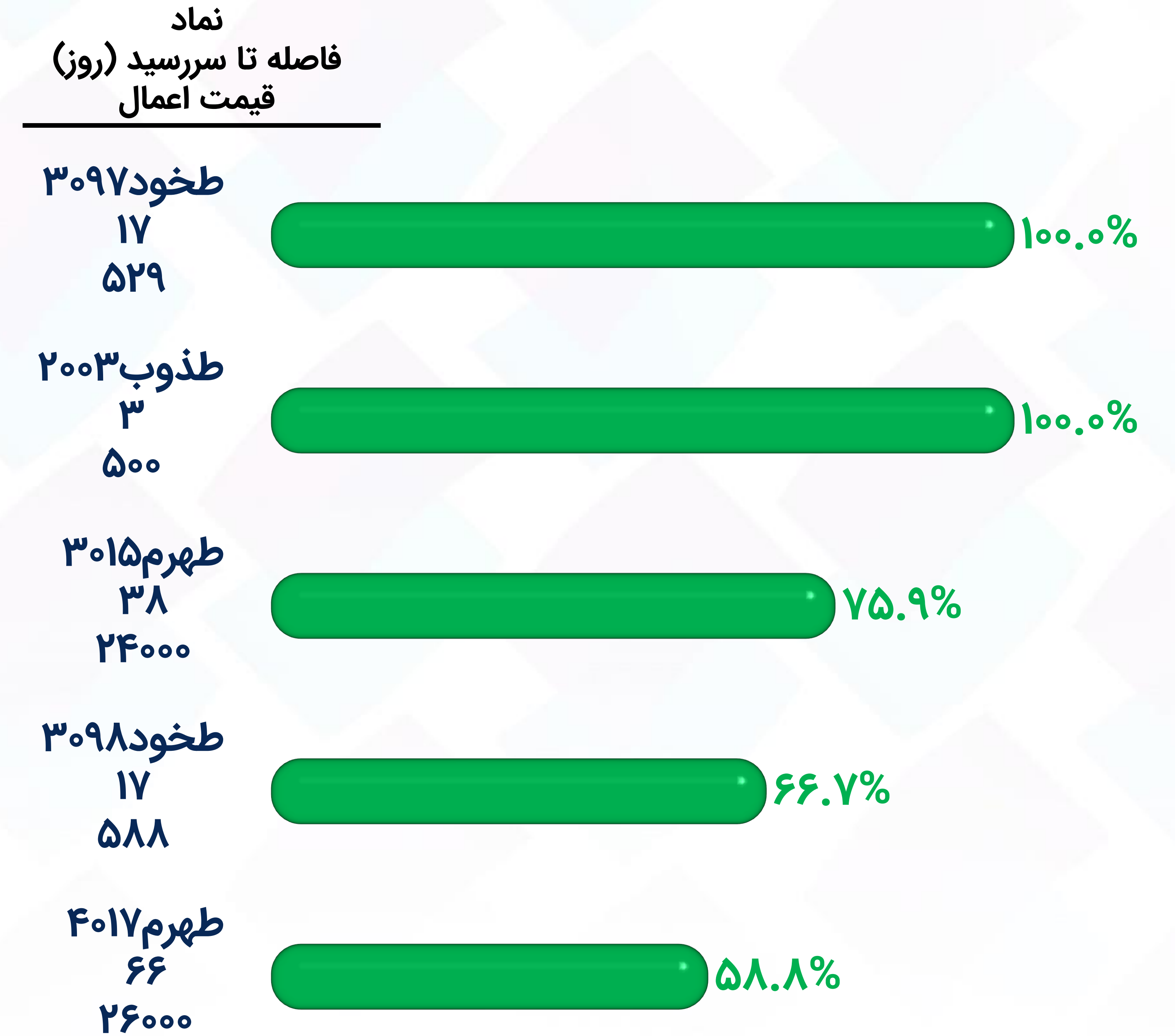
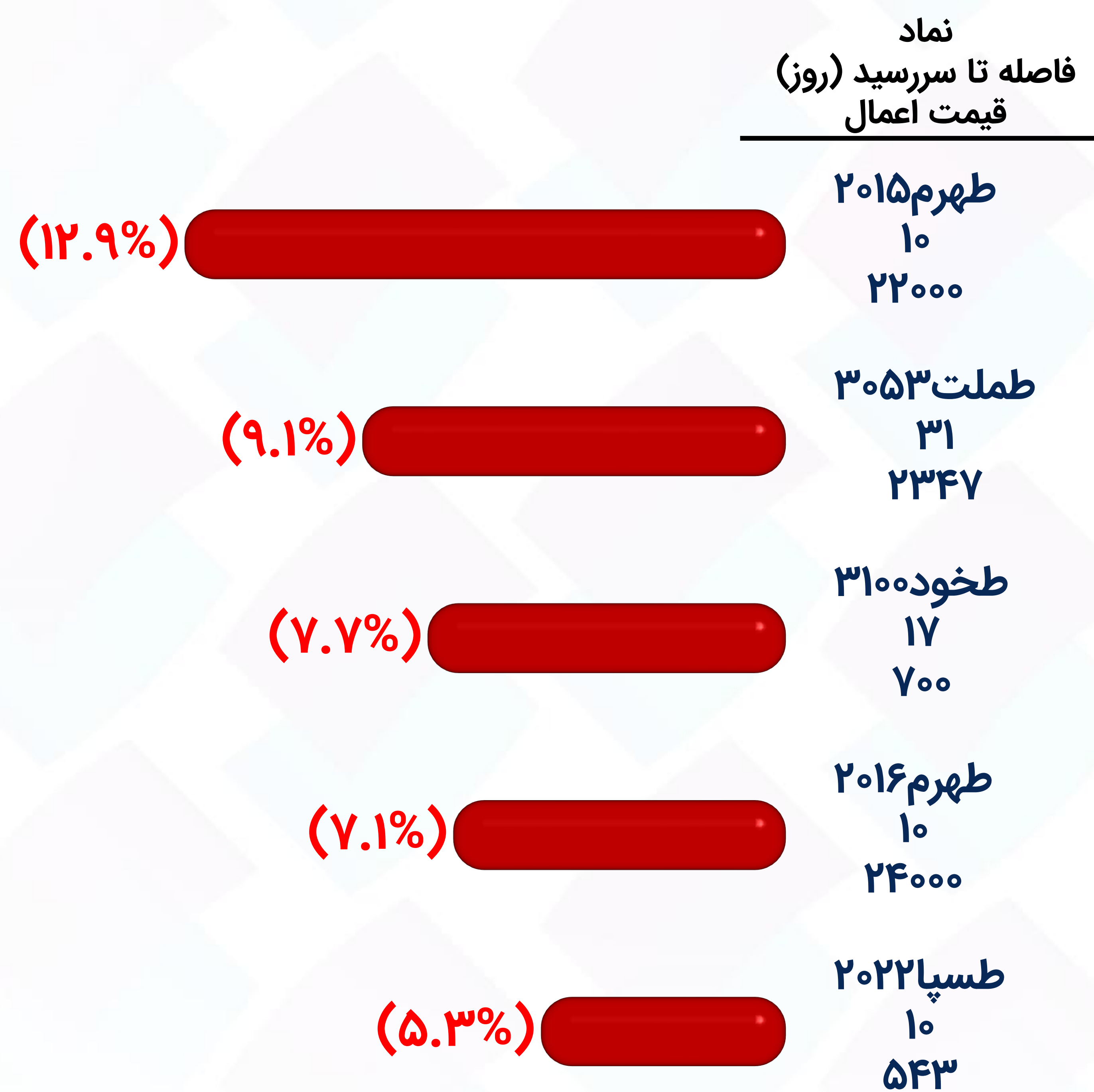
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

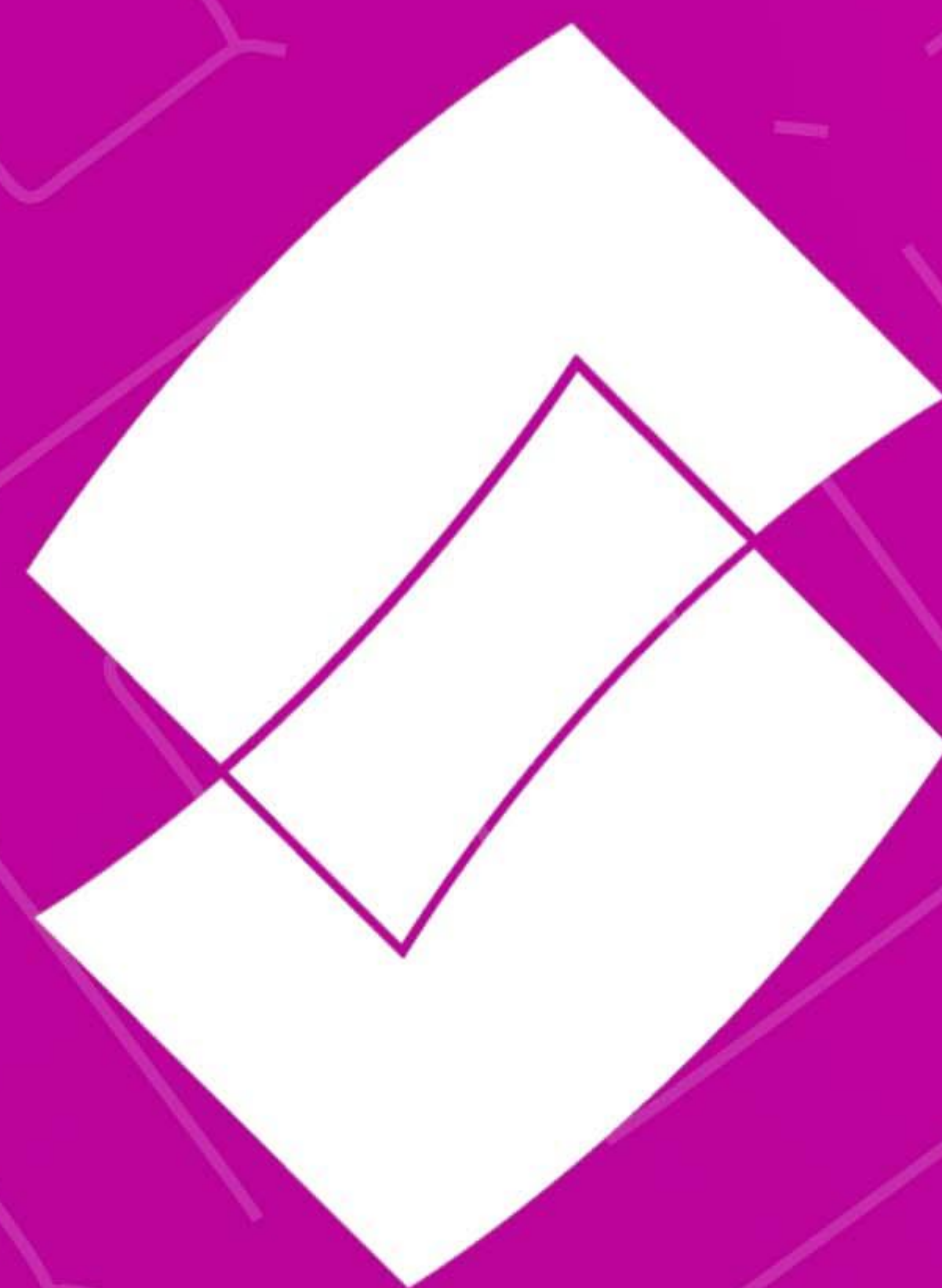
اختیار خرید



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.