

شماره
۴۷۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





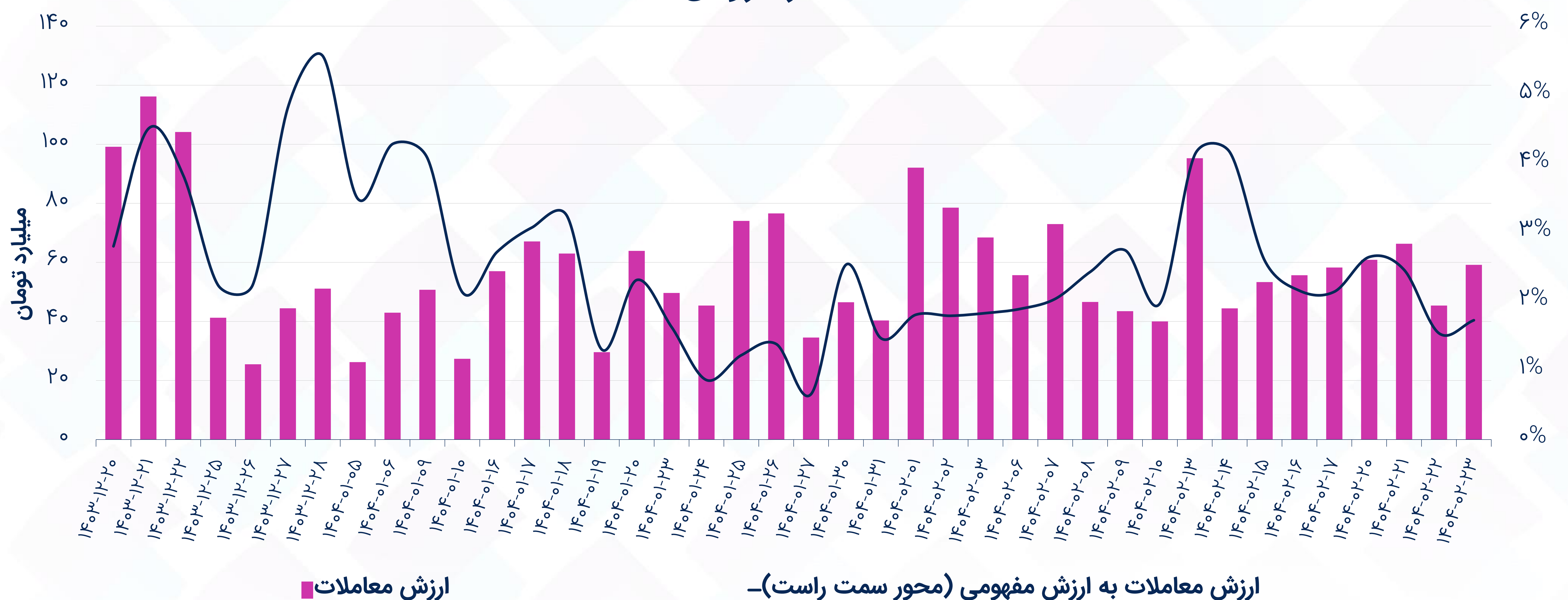
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



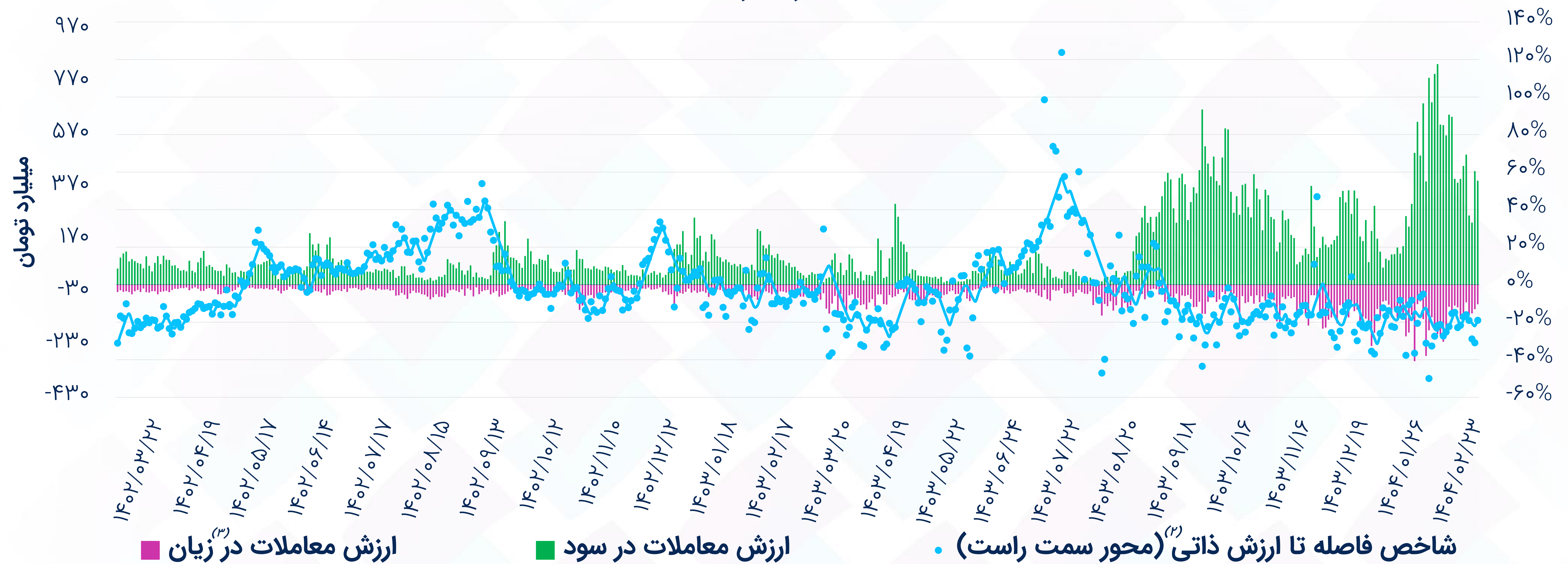
اختیار فروش



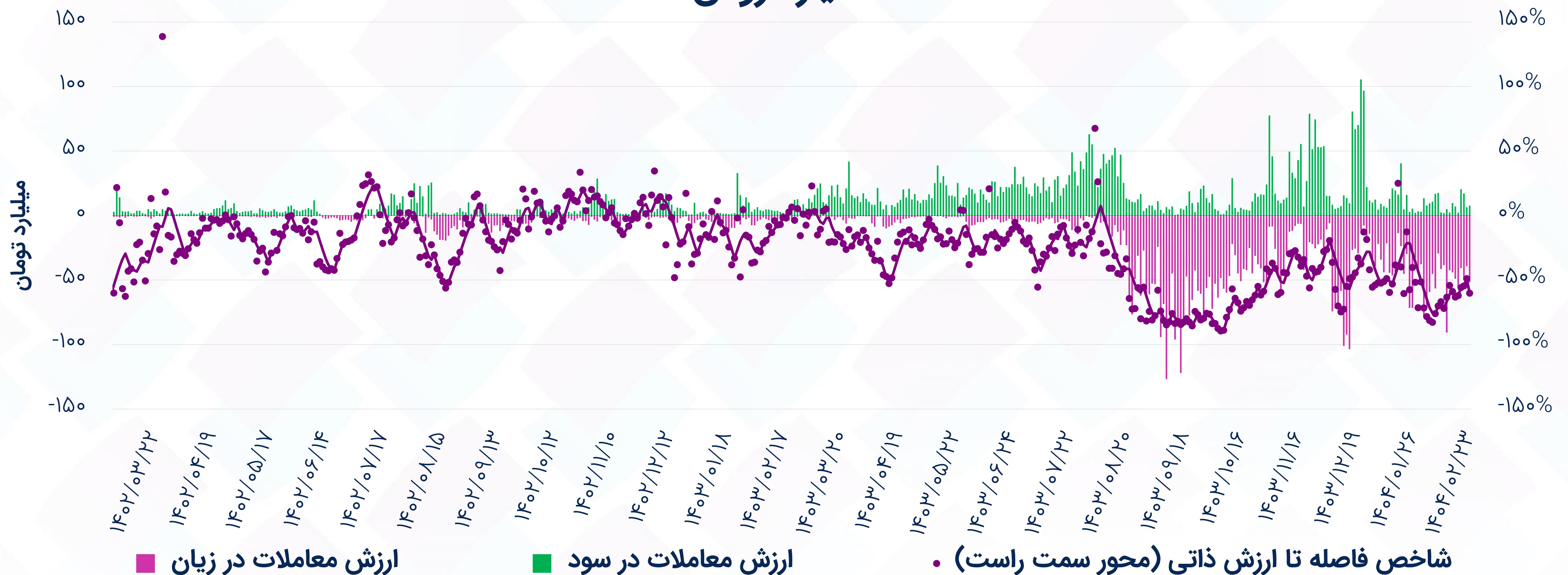
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

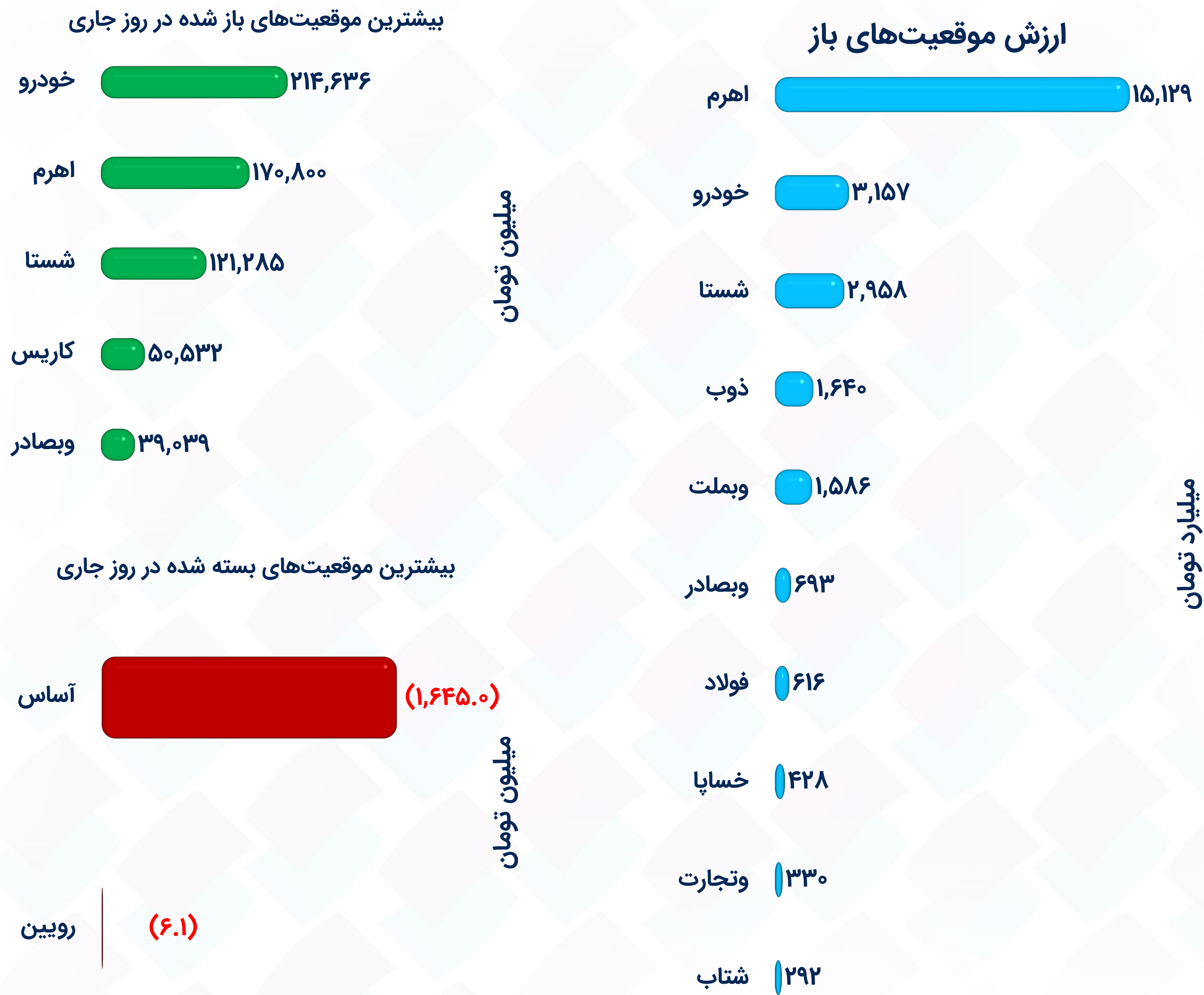
اختیار خرید

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	۴۹	۲۶۷.۹	۳,۸۱۶.۹	۲۲۴.۸	۴۳.۱	(۲۲.۶%)
خودرو	۱۲	۷۱.۲	۸۵۶.۴	۶۱.۰	۱۰.۲	(۱۴.۱%)
ذوب	۳۰	۳۸.۳	۳۰۱.۵	۳۶.۷	۱.۶	(۷.۲%)
شستا	۳۵	۲۷.۴	۴۴۳.۴	۲۰.۵	۶.۹	(۲۴.۶%)
خسپا	۲۶	۲۰.۲	۱۷۳.۵	۱۵.۳	۴.۹	۱.۴%
وبملت	۲۱	۱۱.۸	۱۲۵.۳	۹.۹	۱.۹	(۲۸.۲%)
کاریس	۶	۷.۳	۵۶.۳	۴.۴	۲.۸	(۳۰.۸%)

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	۲۷	۴۲,۷۰۵.۶	۲,۸۷۹,۴۷۴.۸	۳,۴۰۲.۸	۳۹,۳۰۲.۸	(۶۸.۸%)
خودرو	۷	۱۴,۹۵۴.۷	۴۲۴,۶۶۸.۱	۴,۱۰۹.۷	۱۰,۸۴۴.۹	(۳۵.۰%)
شستا	۷	۱,۲۹۲.۶	۹۵,۸۵۴.۹	۶.۳	۱,۲۸۶.۳	(۷۲.۰%)
خسپا	۱	۶۷.۵	۶,۷۰۷.۷	۰.۰	۶۷.۵	۳۰.۵%
وبملت	۴	۴۹.۴	۲,۸۱۶.۴	۰.۰	۴۹.۴	(۵۴.۹%)
موج	۱	۳۶.۷	۷۹۱.۹	۰.۰	۳۶.۷	(۵۰.۹%)
توان	۲	۱۴.۹	۲۸۹.۴	۰.۰	۱۴.۹	(۴۷.۲%)

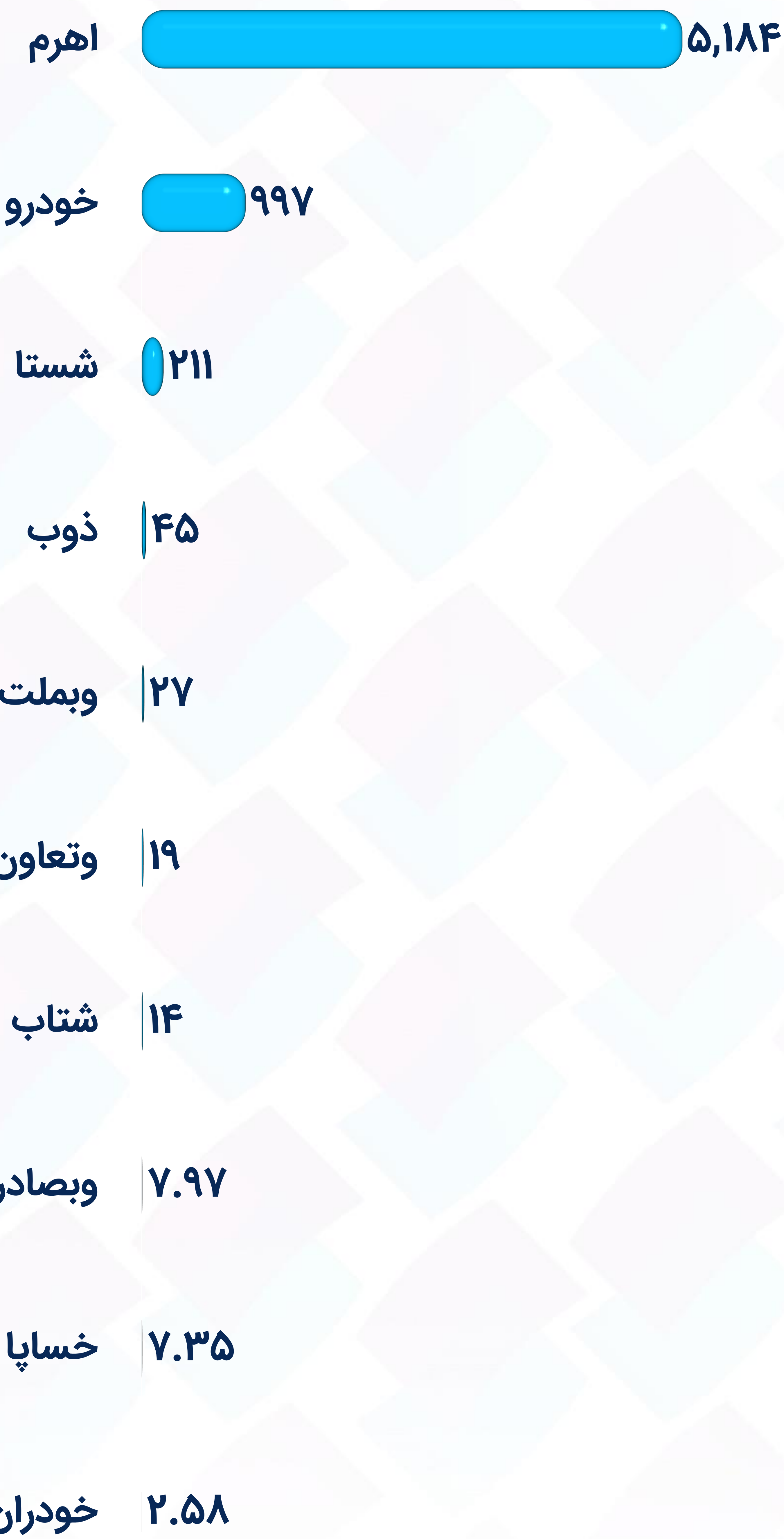
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



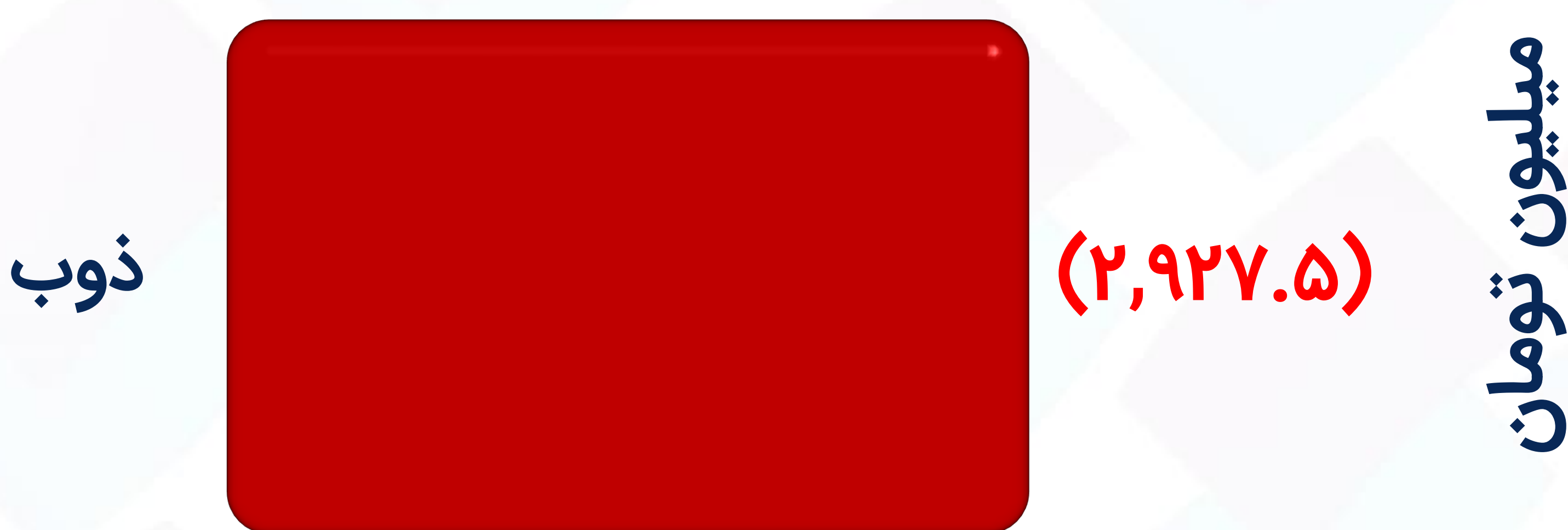
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

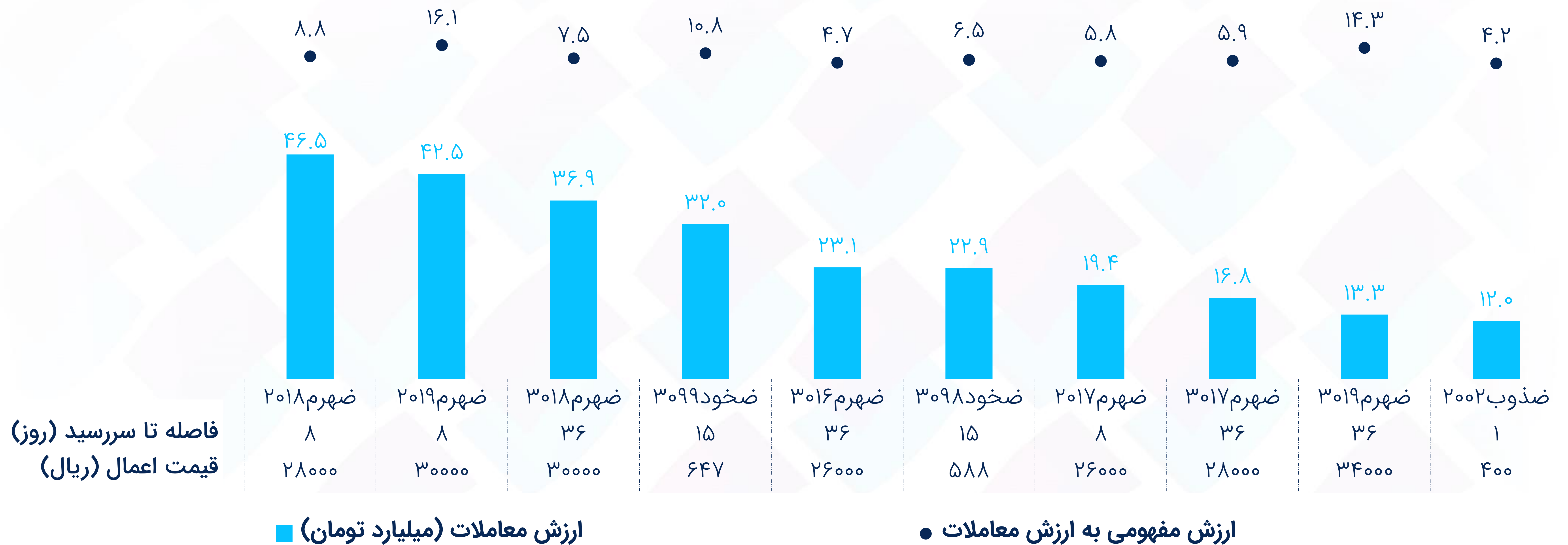
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



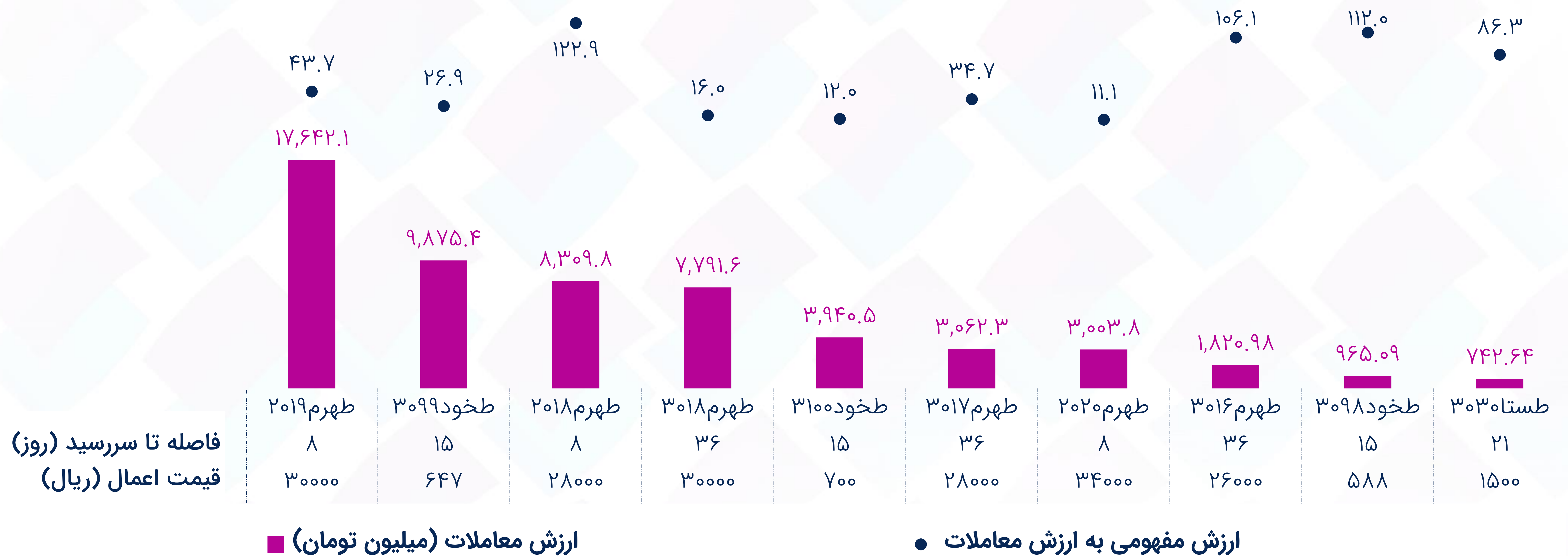
میلیون تومان

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
ضسامان ۵۰۳	سامان	۱,۶۰۰	۸۹	۵.۱	۶۲	۲,۳۱۴	۱,۶۶۲	(۲۸.۲%)	۲۶.۸	۱.۰۰	۸۳۷	۱۲۵۰%
ضسامان ۵۰۱	سامان	۱,۴۰۰	۸۹	۲۱.۱	۲۱۱	۲,۳۱۴	۱,۶۱۱	(۳۰.۴%)	۷.۶	۱.۰۰	۱,۰۲۱	۳۸۴%
ضهمن ۳۰۱۷	خبهمن	۲,۴۰۰	۳۶	۲۸.۸	۱۱۵	۲,۴۵۴	۲,۵۱۵	۲.۵%	۲۱.۹	۰.۷۲	۱۷۶	۵۳%
ضفسوژ ۳۰۸	فسوژ	۵,۵۰۰	۱۹	۳.۹	۱۱۰	۵,۳۷۰	۵,۶۱۰	۴.۵%	۵۱.۰	۰.۴۹	۱۵۰	۳۶%
ضپناه ۳۰۷	پناه	۱۶,۰۰۰	۲۷	۲۱.۵	۴۱۷	۱۵,۹۲۸	۱۶,۴۱۷	۳.۱%	۳۹.۴	۰.۶۴	۵۵۷	۳۴%

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
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸	۱۲۸.۶	۲۴	۳۱,۰۹۰	۴۲,۰۲۴	۳۵%	۱,۷۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۲۹	۱.۴	۶	۵۳۱	۸۰۶	۵۲%	۱۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۲۱	۱۱۲.۲	۶	۱,۶۳۹	۲,۲۰۶	۳۵%	۳۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۱	فولاد	۵,۴۰۰	۲۱	۸.۲	۱۰	۴,۰۵۵	۵,۴۱۰	۳۳%	۵۴۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۲۰	وتجارت	۱,۰۰۰	۵۷	۳.۱	۱۵	۶۲۷	۱,۰۱۵	۶۲%	۶۷.۷	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
تسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۸	۶۷.۵	۶	۵۹۶	۵۳۷	(۹.۹%)	۸۹.۵	-۰.۱۸	۸	۳۰.۵%
طهرم ۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۸	۳۲.۷	۶,۱۶۶	۳۱,۰۹۰	۳۱,۸۳۴	۲.۴%	۵.۲	-۱.۰۰	۶,۵۵۲	۶.۳%
طهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸	۲.۱	۱۰,۶۵۰	۳۱,۰۹۰	۳۱,۳۵۰	۰.۸%	۲.۹	-۱.۰۰	۱۰,۵۱۴	(۱.۳%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۳,۰۰۳.۸	۲,۸۰۴	۳۱,۰۹۰	۳۱,۱۹۶	۰.۳%	۱۱.۱	-۰.۹۰	۲,۶۷۹	(۴.۴%)
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۱۵	۱۶۹.۳	۱۳۵	۶۷۲	۶۶۵	(۱.۰%)	۴.۹	-۰.۹۰	۱۱۸	(۱۲.۳%)

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
طصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۹۲	۰.۶	۳	۷۲۹	۱۹۷	(۷۳.۰%)	۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۸	۰.۰	۵	۳۱,۰۹۰	۱۷,۹۹۵	(۴۲.۱%)	۳,۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۱۵	۰.۰	۱	۶۷۲	۲۸۱	(۵۸.۲%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۶۴	۰.۶	۳	۵۳۱	۱۹۷	(۶۲.۹%)	۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۸	۳.۸	۸	۳۱,۰۹۰	۱۹,۹۹۲	(۳۵.۷%)	۲,۴۹۹.۰	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

ارزش موقعیت‌های باز

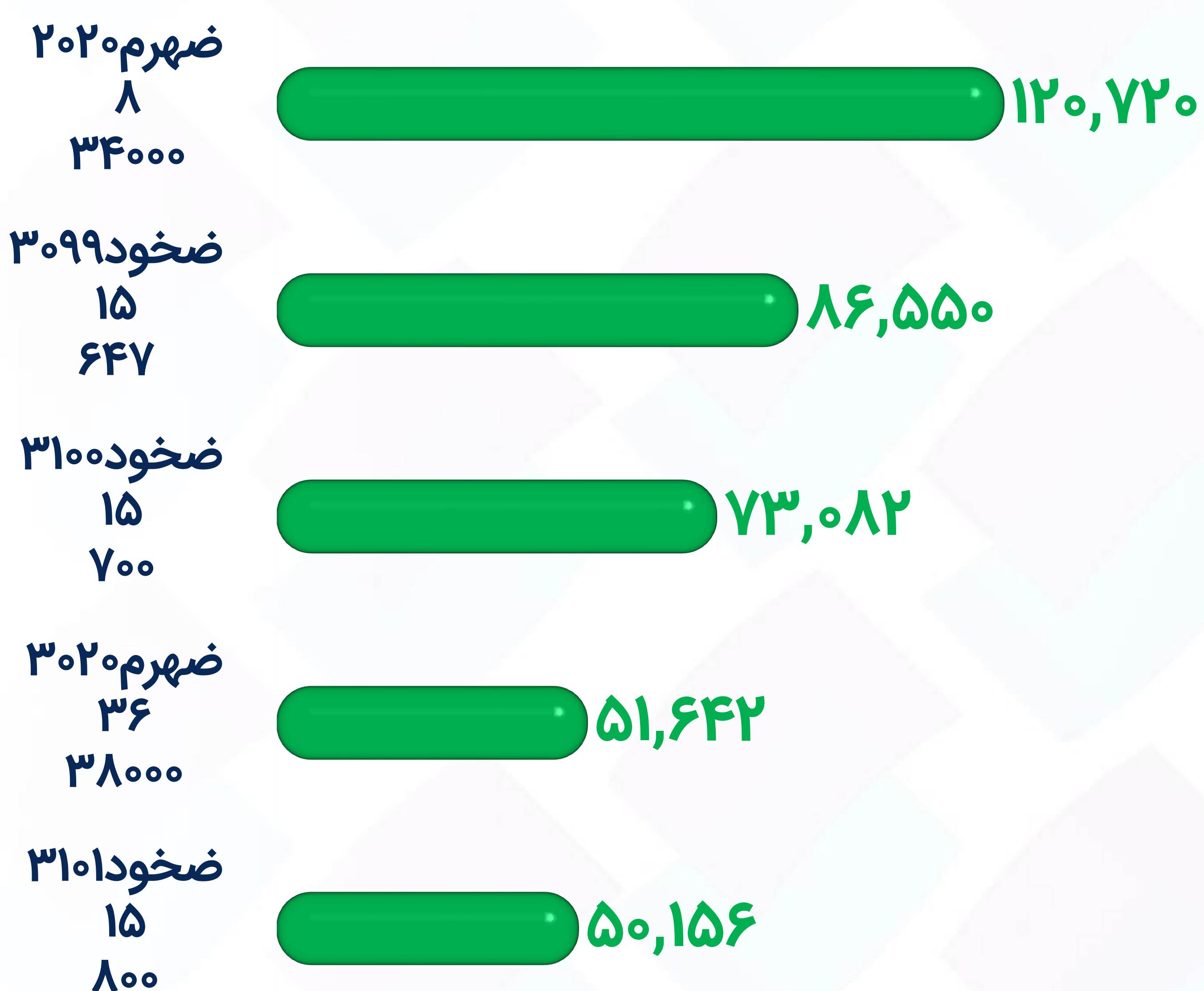
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

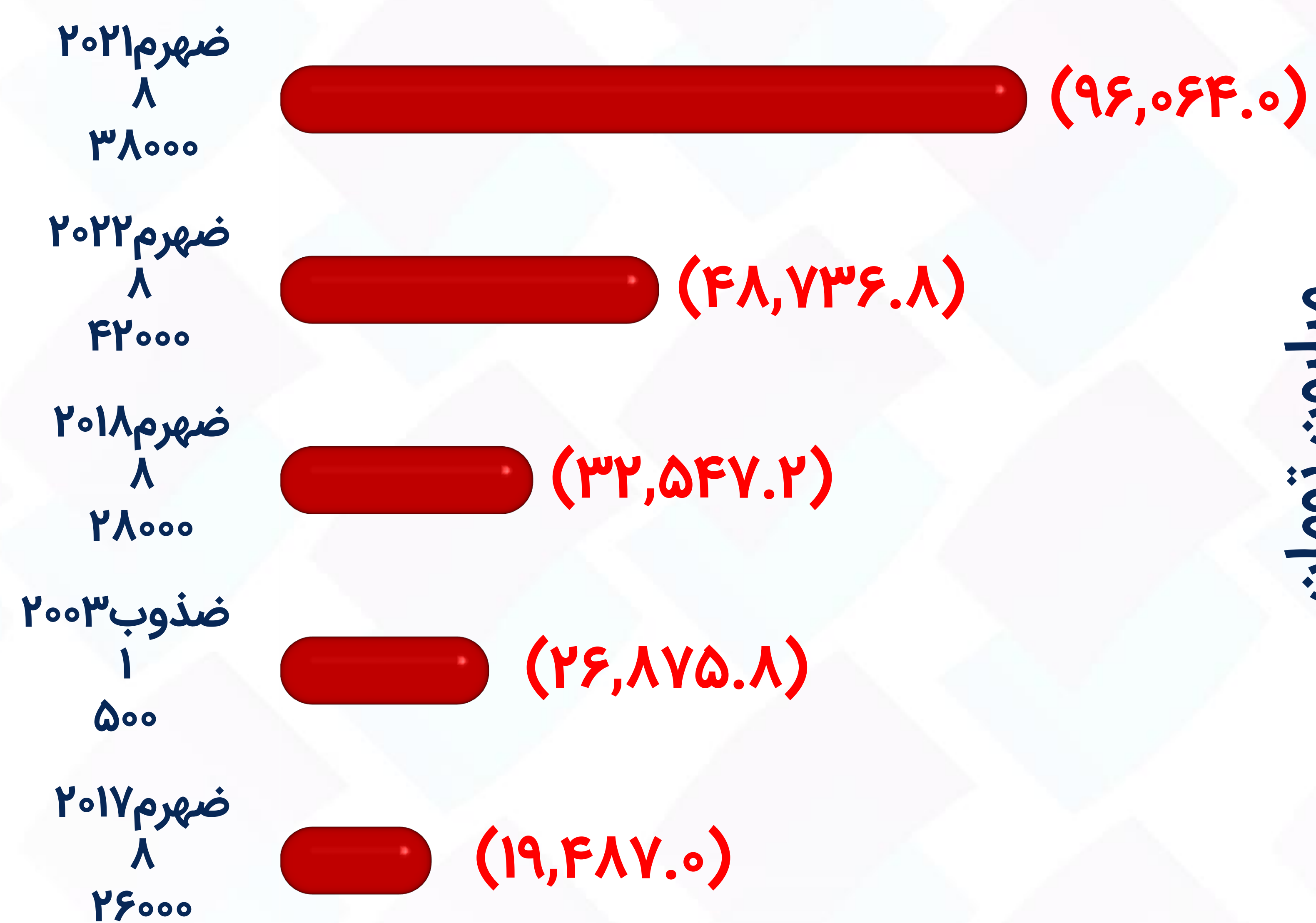
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

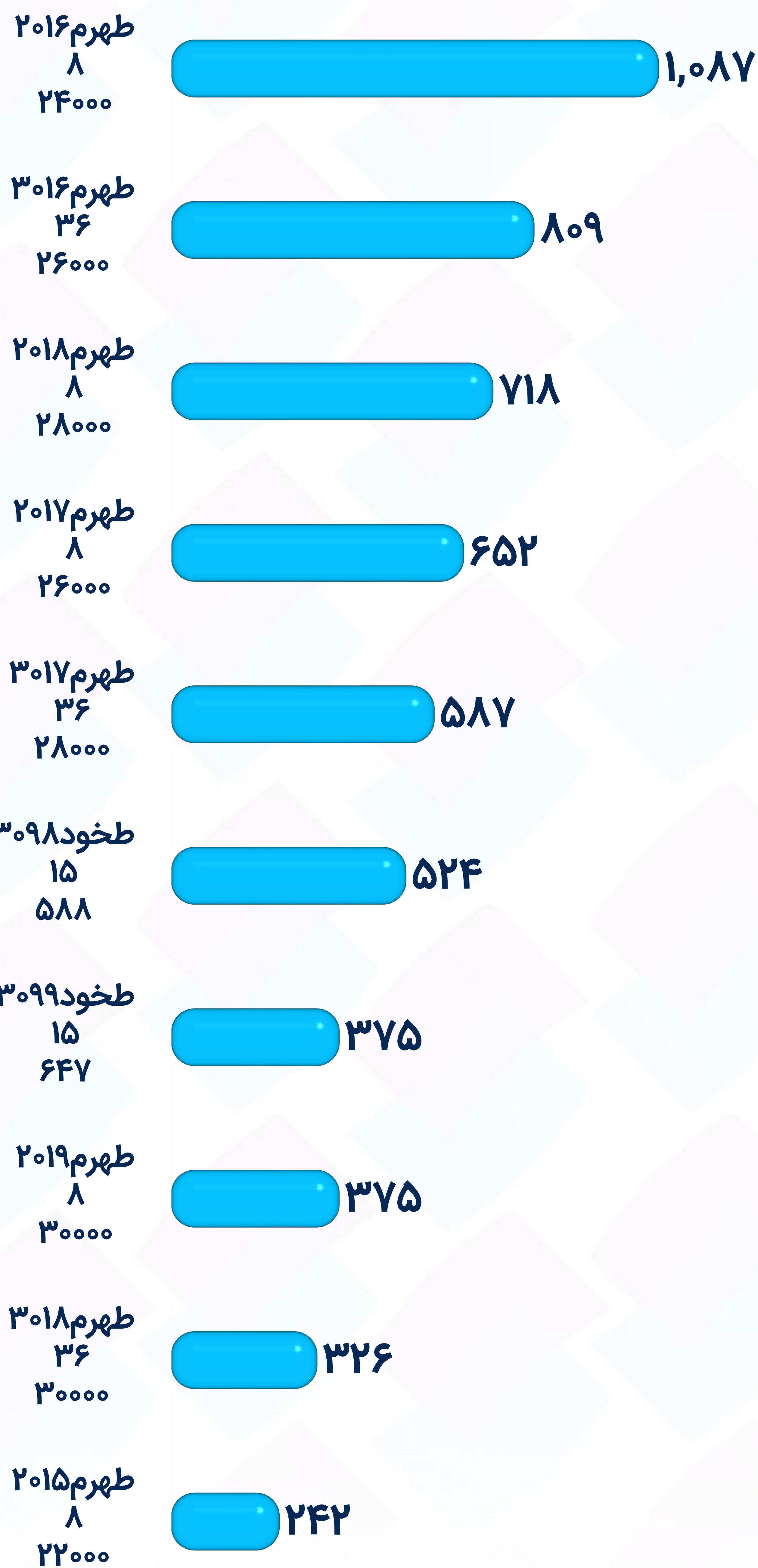


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

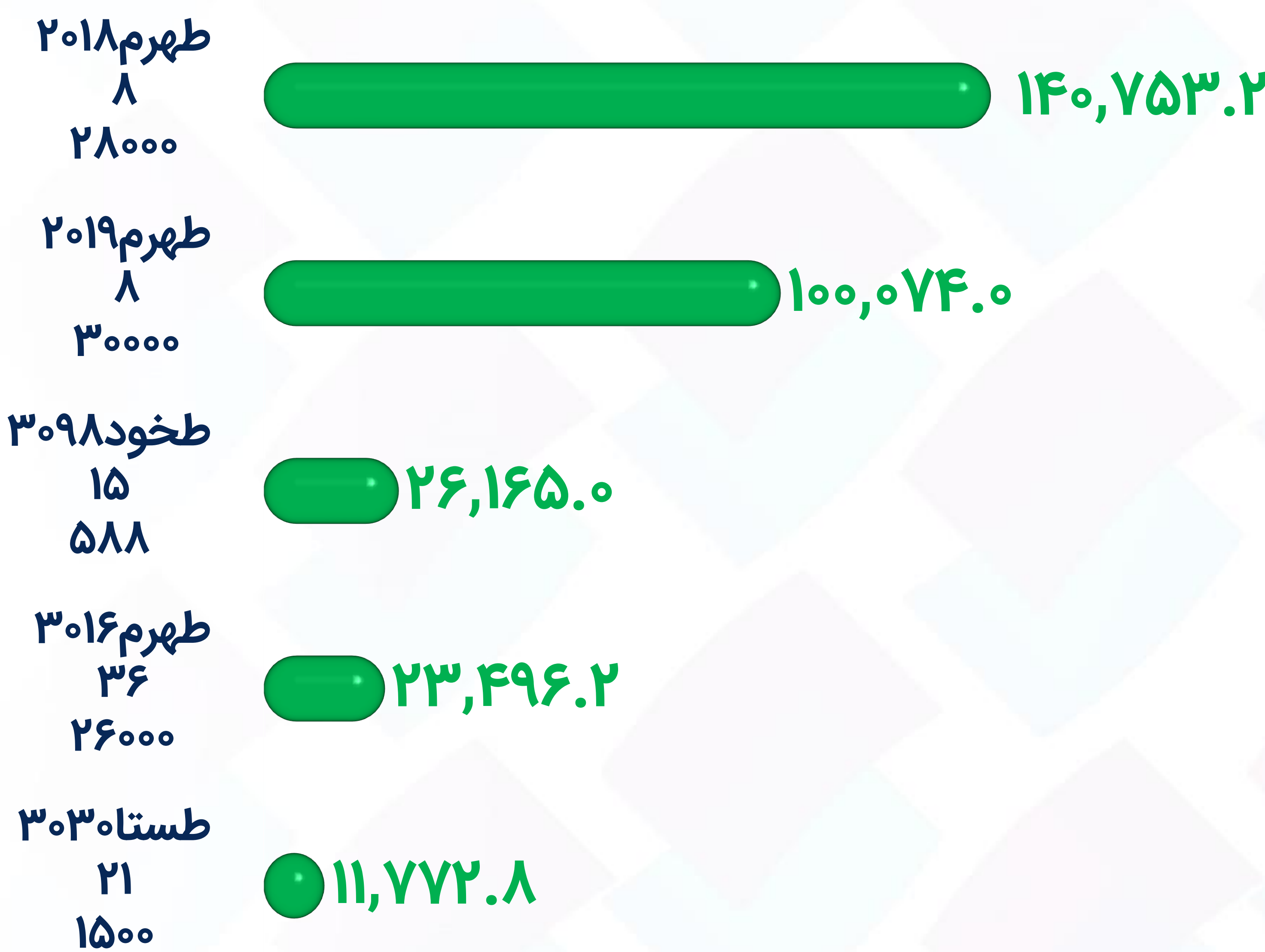
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

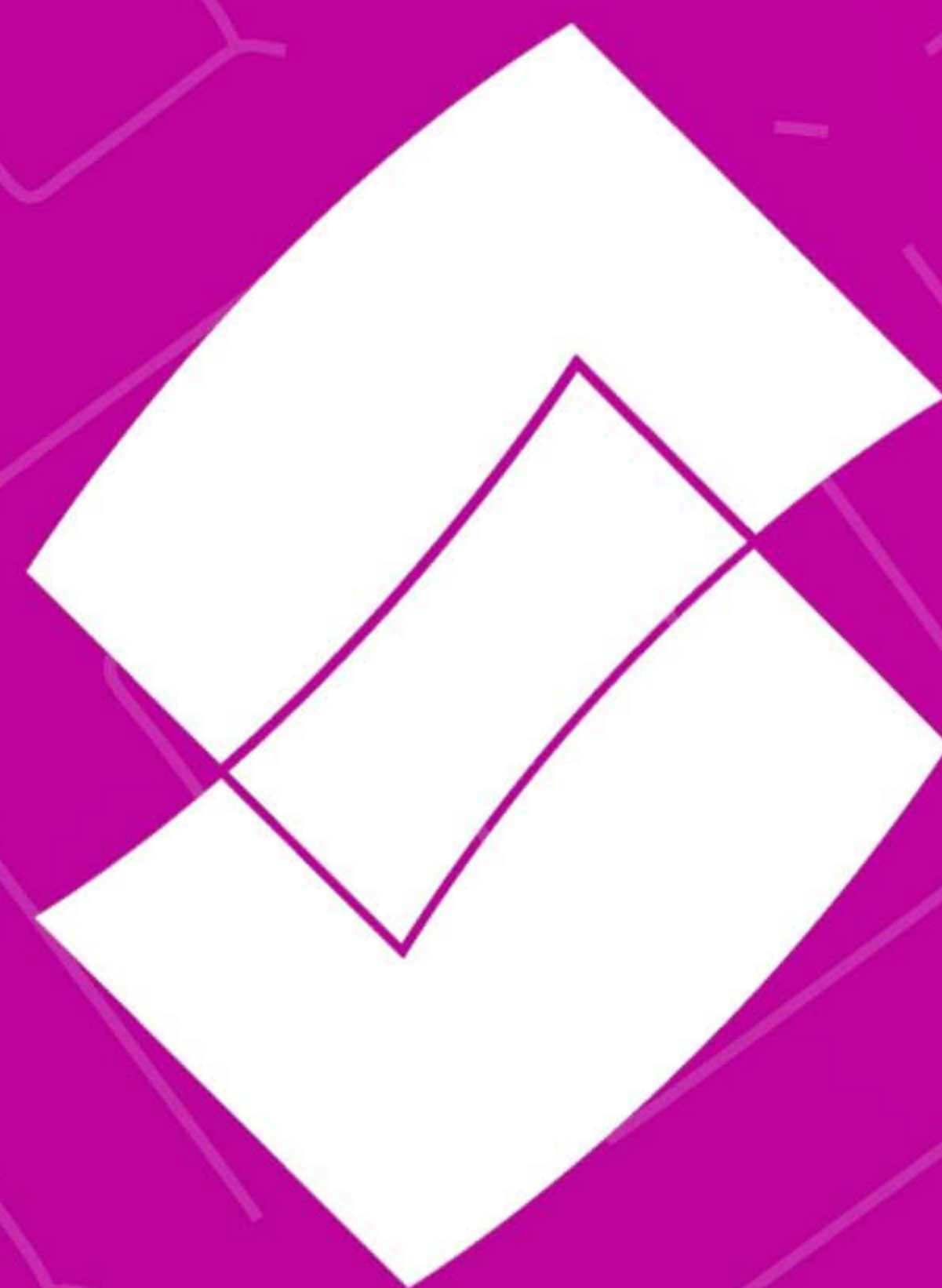
اختیار خرید



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.