

شماره
۴۸۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۸ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

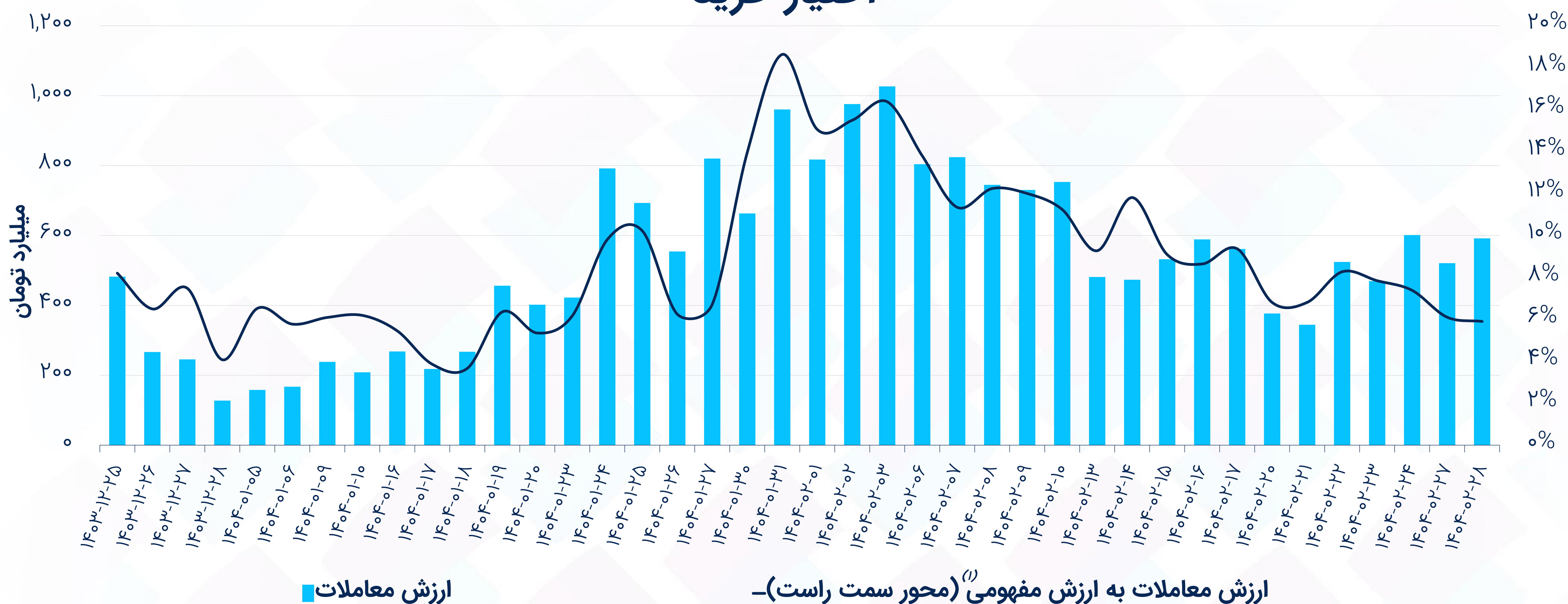




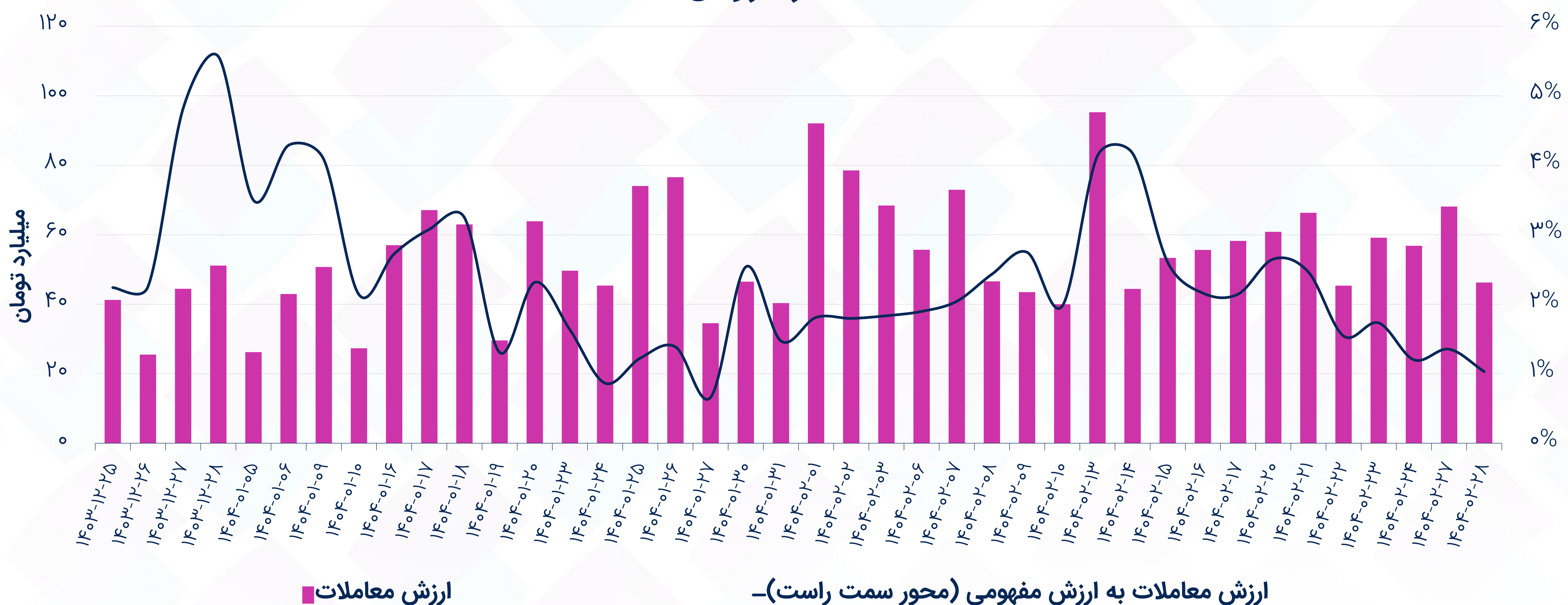
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



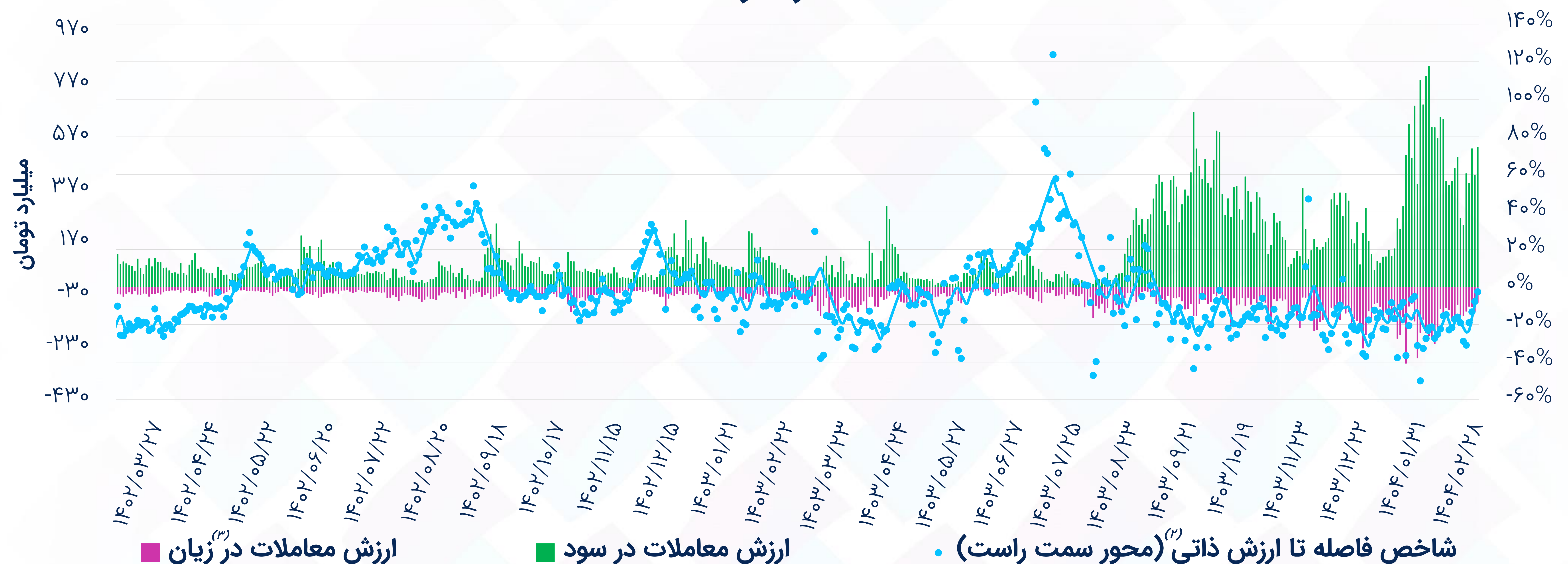
اختیار فروش



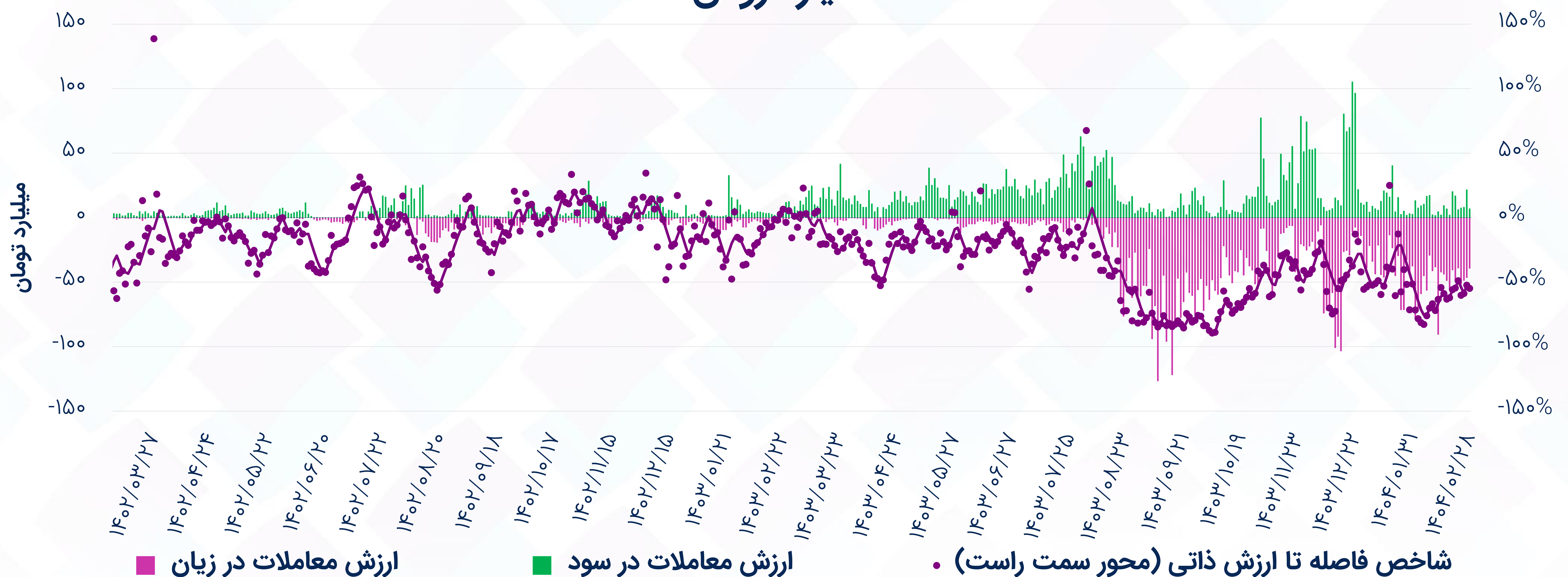
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

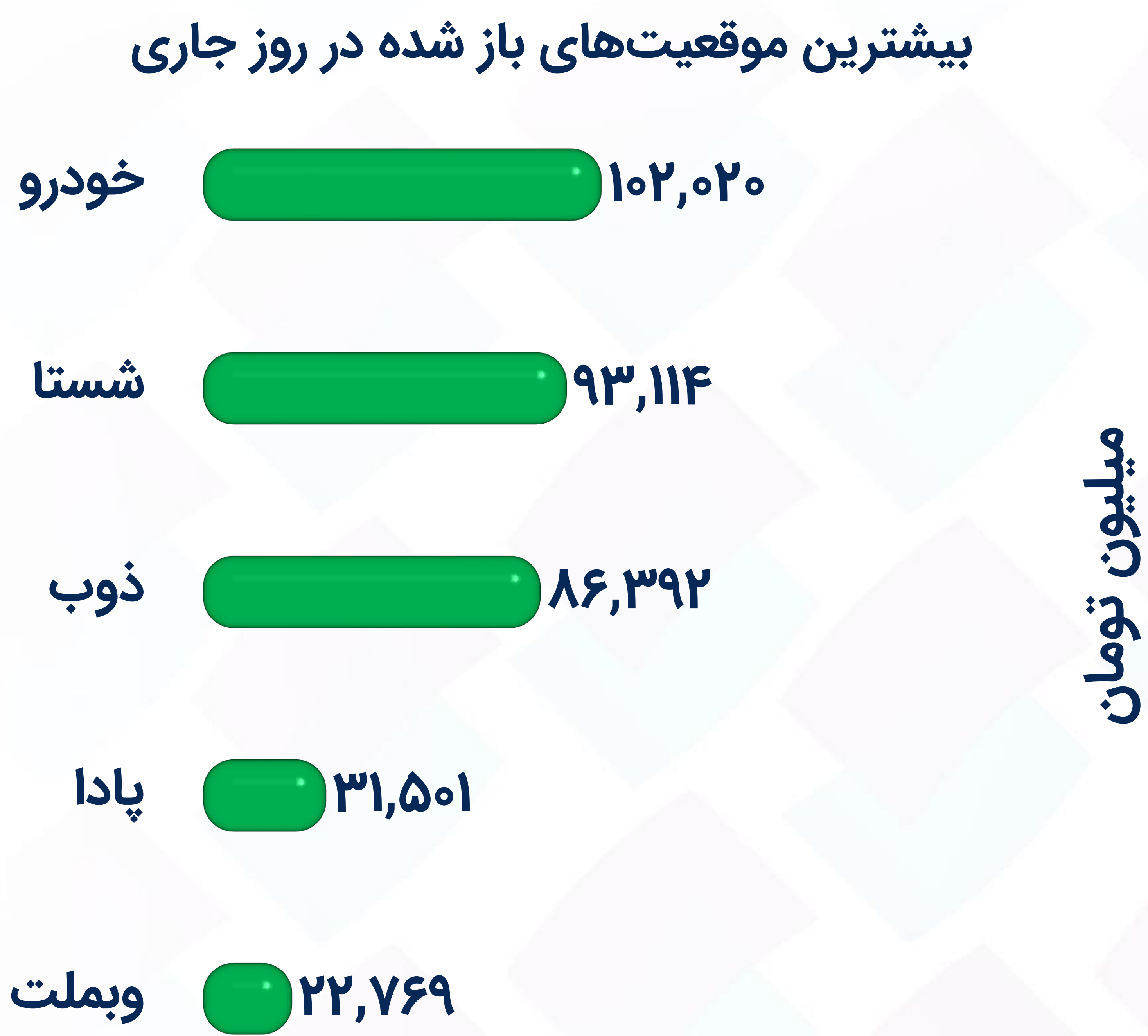
اختیار خرید

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	۳۴۳.۴	۶,۹۶۸.۵	۳۰۸.۴	۳۵.۰	(۱.۵%)
شستا	۵۵	۹۳.۲	۱,۱۸۶.۸	۸۴.۸	۸.۴	۵.۹%
خودرو	۱۳	۷۱.۵	۱,۰۸۷.۸	۶۶.۹	۴.۵	(۱۴.۱%)
ذوب	۲۶	۲۶.۶	۱۹۳.۶	۲۳.۴	۳.۲	(۱۹.۷%)
وبملت	۲۶	۹.۱	۱۱۵.۸	۷.۳	۱.۸	(۴.۰%)
وبصادر	۱۶	۷.۲	۵۵.۴	۶.۸	۰.۴	(۷.۷%)
خسپا	۲۰	۷.۲	۱۴۷.۴	۴.۵	۲.۷	۲۵.۱%

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	۱۷	۳۲,۲۹۳.۵	۳,۹۸۵,۷۵۱.۶	۳,۶۱۷.۱	۲۸,۶۷۶.۳	(۶۶.۳%)
خودرو	۷	۱۲,۰۶۸.۸	۲۷۸,۲۸۳.۵	۳,۲۶۶.۹	۸,۸۰۱.۹	(۲۱.۹%)
شستا	۱۲	۱,۷۶۲.۸	۲۱۳,۲۳۱.۹	۵.۰	۱,۷۵۷.۸	(۷۶.۷%)
خسپا	۲	۶۶.۲	۷,۲۰۳.۲	۵۶.۸	۹.۴	۸۴.۵%
وبملت	۳	۳۰.۵	۲,۶۷۳.۱	۰.۰	۳۰.۵	(۶۴.۵%)
موج	۱	۱۸.۳	۸۲۱.۷	۰.۰	۱۸.۳	(۵۳.۸%)
خودران	۲	۱۵.۳	۲۲۳.۶	۱۴.۶	۰.۸	(۳۰.۲%)

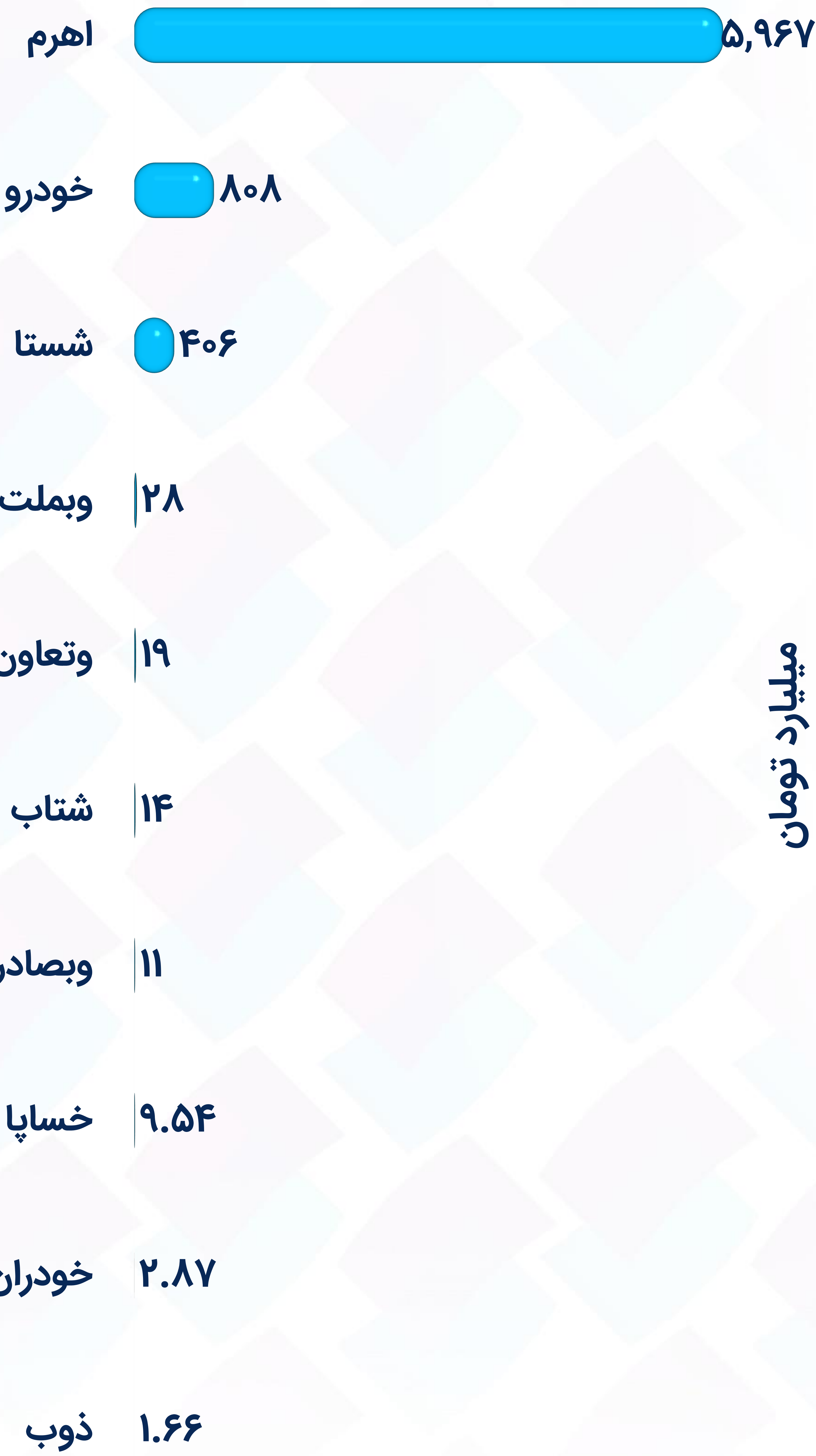
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

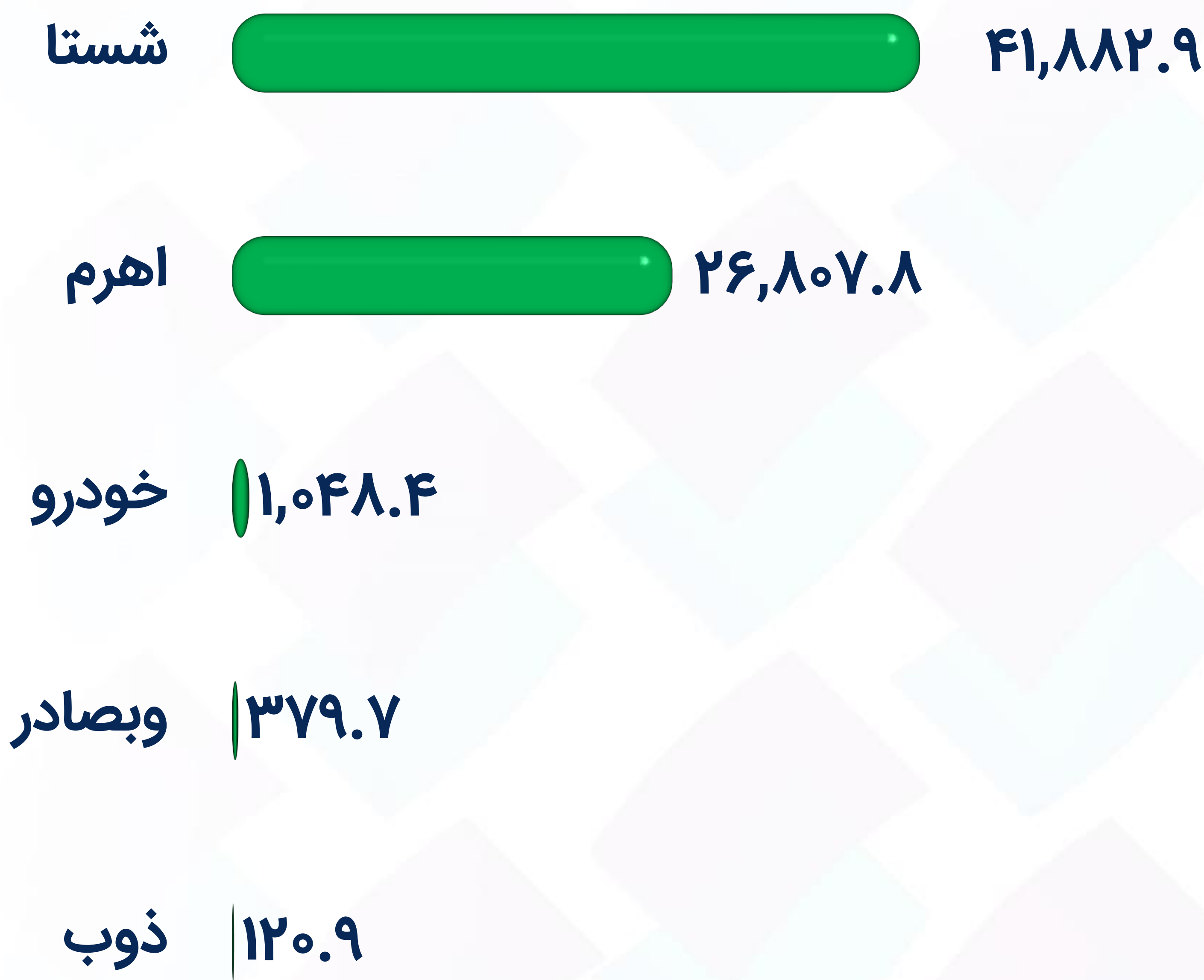
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



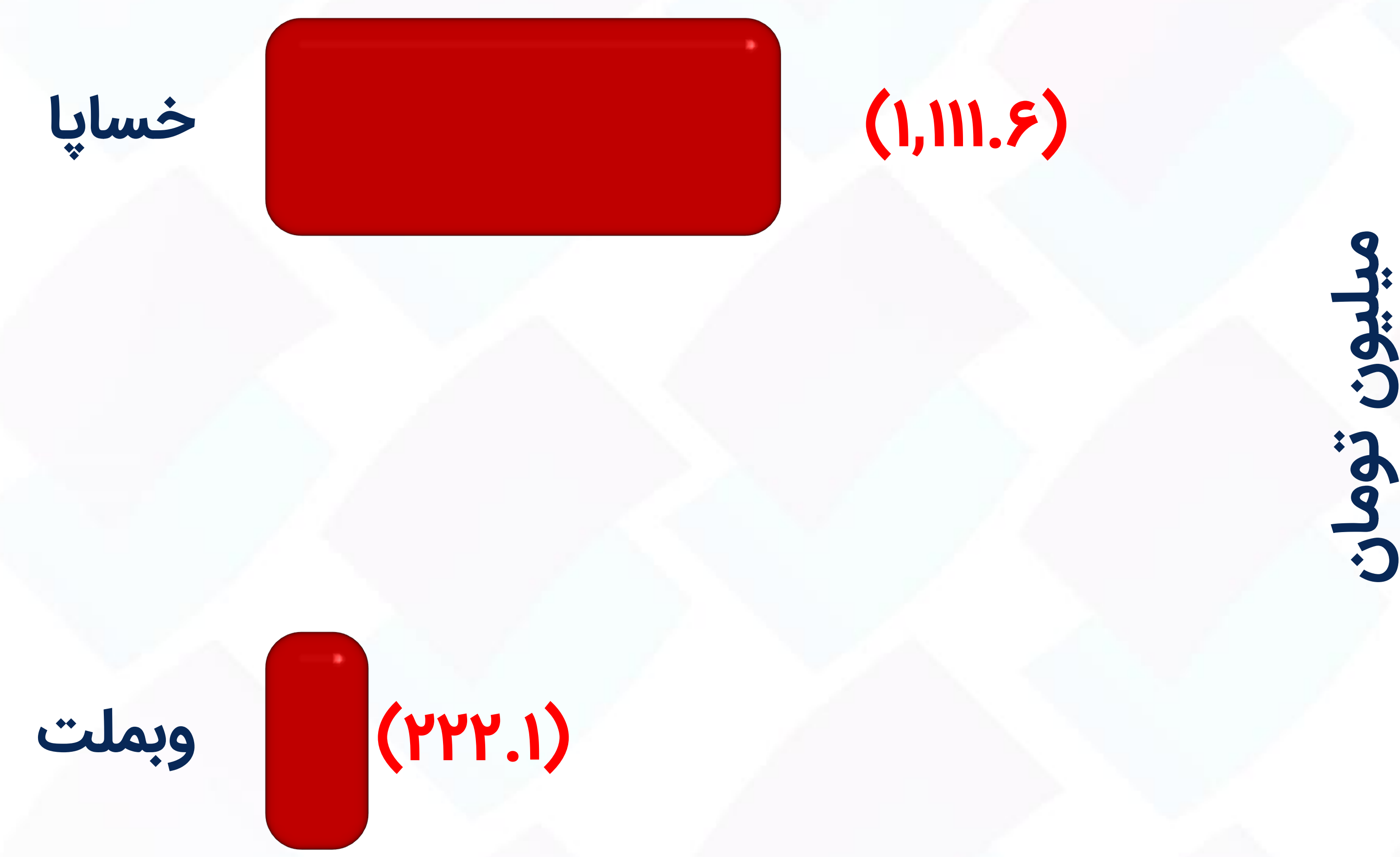
میلیارد تومان

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
ضستر ۶۰۳۷	خگستر	۶,۵۰۰	۱۰۱	۶.۹	۲۵۵	۶,۲۰۰	۶,۷۵۵	۹.۰%	۲۶.۵	۰.۶۳	۵۹۰	۱۳۱%
ضسپا ۲۰۲۳	خسپا	۶۰۳	۳	۱,۸۰۲.۶	۱۰	۵۹۰	۶۱۳	۳.۹%	۶۱.۳	۰.۴۵	۱۸	۷۵%
ضتیام ۴۰۹	تیام	۱۷,۰۰۰	۶۳	۹۸.۷	۴۱۱	۱۶,۱۷۱	۱۷,۴۱۱	۷.۷%	۴۲.۴	۰.۵۴	۶۹۰	۶۸%
ضپادا ۴۰۳۱	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۴۲	۵,۹۱۴.۶	۳۳,۷۹۰	۲۲۲,۳۵۲	۲۱۳,۷۹۰	(۳.۹%)	۶.۳	۱.۰۰	۴۹,۱۳۶	۴۵%
ضمخا ۳۰۵۴	اخابر	۶۰۰	۲۴	۵.۸	۱۱۵	۷۴۸	۷۱۵	(۴.۴%)	۶.۲	۰.۹۹	۱۶۲	۴۱%

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	۲۴	۷.۹	۳	۵۲۵	۱,۰۰۳	۹۱%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۲۴	۸.۹	۳	۵۲۵	۹۰۳	۷۲%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳	۱۳.۸	۸	۳۱,۴۹۰	۴۲,۰۰۸	۳۳%	۵,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۲۴	۴.۹	۵	۵۲۵	۸۰۵	۵۳%	۱۶۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۴	۲۵.۱	۵	۷۲۱	۱,۰۰۵	۳۹%	۲۰۱.۰	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
طسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۳	۹.۴	۱	۵۹۰	۵۴۲	(۸.۱%)	۵۴۲.۰	-۰.۱۶	۵	۳۷۷.۴%
طخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۱۰	۲۰۷.۹	۳	۶۴۸	۵۸۵	(۹.۷%)	۱۹۵.۰	-۰.۱۳	۴	۴۳.۰%
طسپا ۲۰۲۳	خسپا	۶۰۳	۳	۵۶.۸	۲۰	۵۹۰	۵۸۳	(۱.۲%)	۲۹.۲	-۰.۵۵	۲۷	۳۶.۱%
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳۱	۹.۷	۴,۶۱۹	۳۱,۴۹۰	۳۳,۳۸۱	۶.۰%	۷.۲	-۰.۹۲	۵,۵۴۰	۱۹.۹%
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۱۰	۲۸۶.۴	۱۳۲	۶۴۸	۶۶۸	۳.۱%	۵.۱	-۰.۹۷	۱۴۳	۸.۲%

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
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳	۰.۳	۱	۳۱,۴۹۰	۱۹,۹۹۹	(۳۶.۵%)	۱۹,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۸۷	۰.۱	۳	۷۲۱	۱۹۷	(۷۲.۷%)	۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۱۰	۰.۵	۱	۶۴۸	۲۸۱	(۵۶.۶%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۵۹	۱.۲	۲	۵۲۵	۱۹۸	(۶۲.۳%)	۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳	۴.۸	۳	۳۱,۴۹۰	۲۱,۹۹۷	(۳۰.۱%)	۷,۳۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

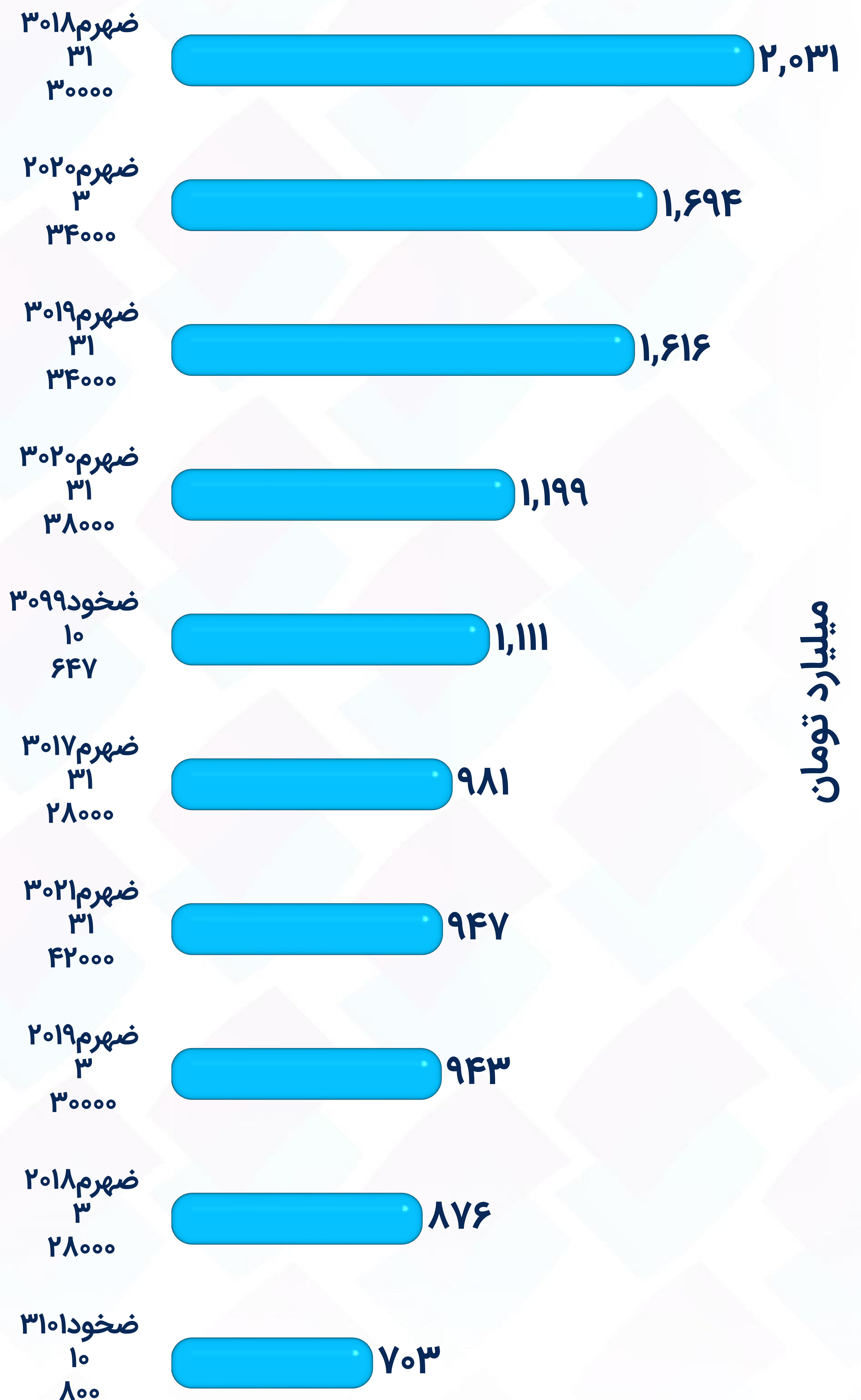
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

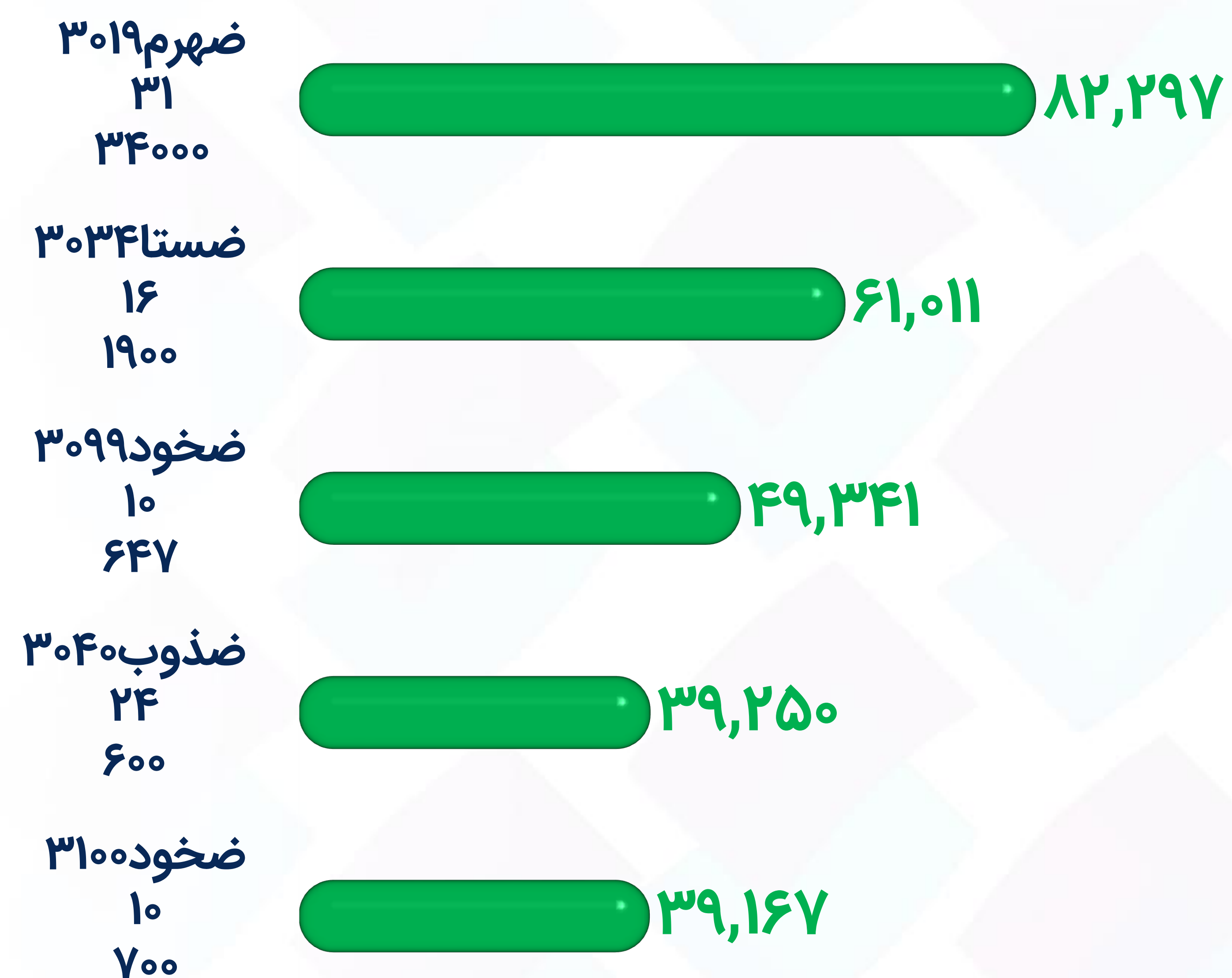
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

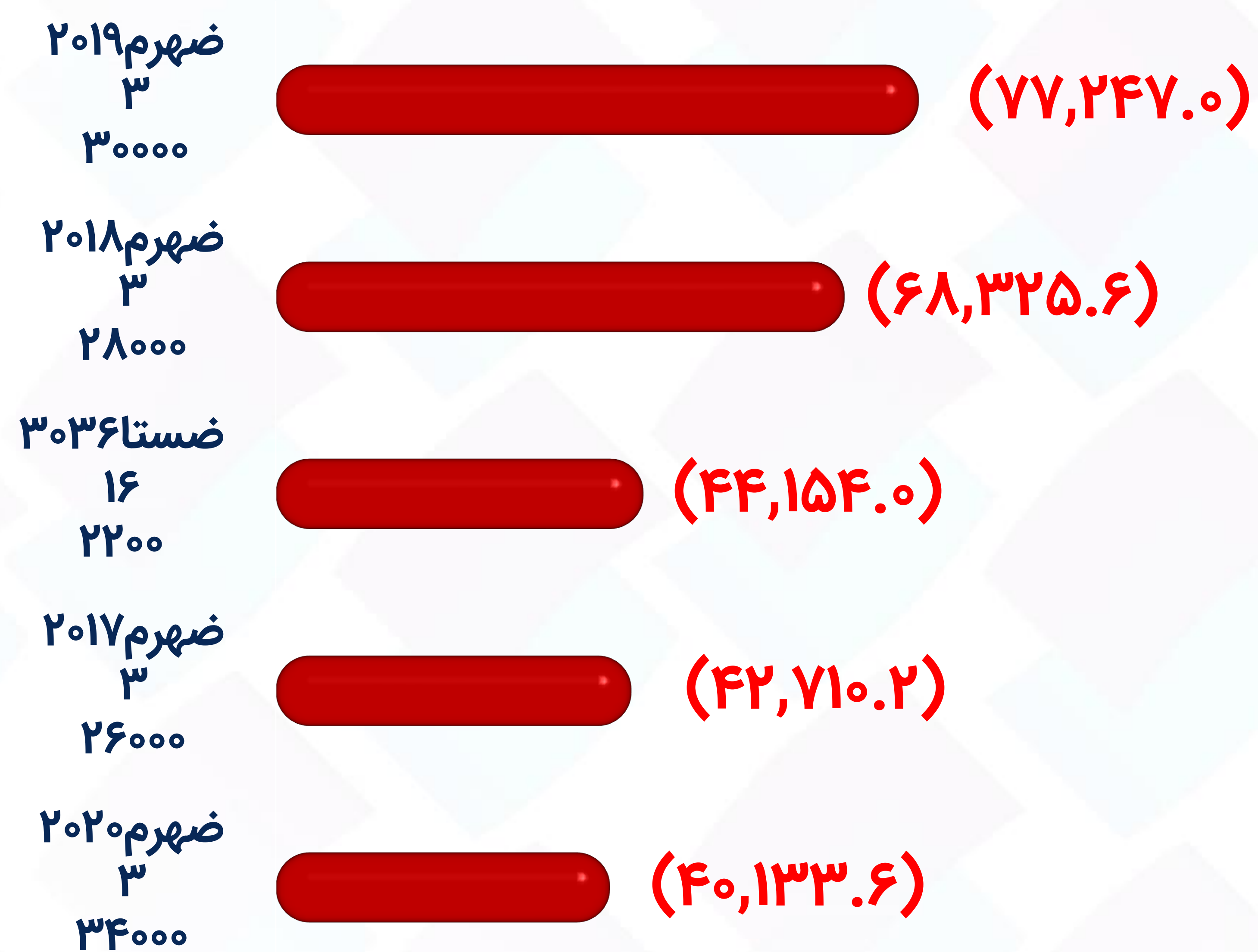
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

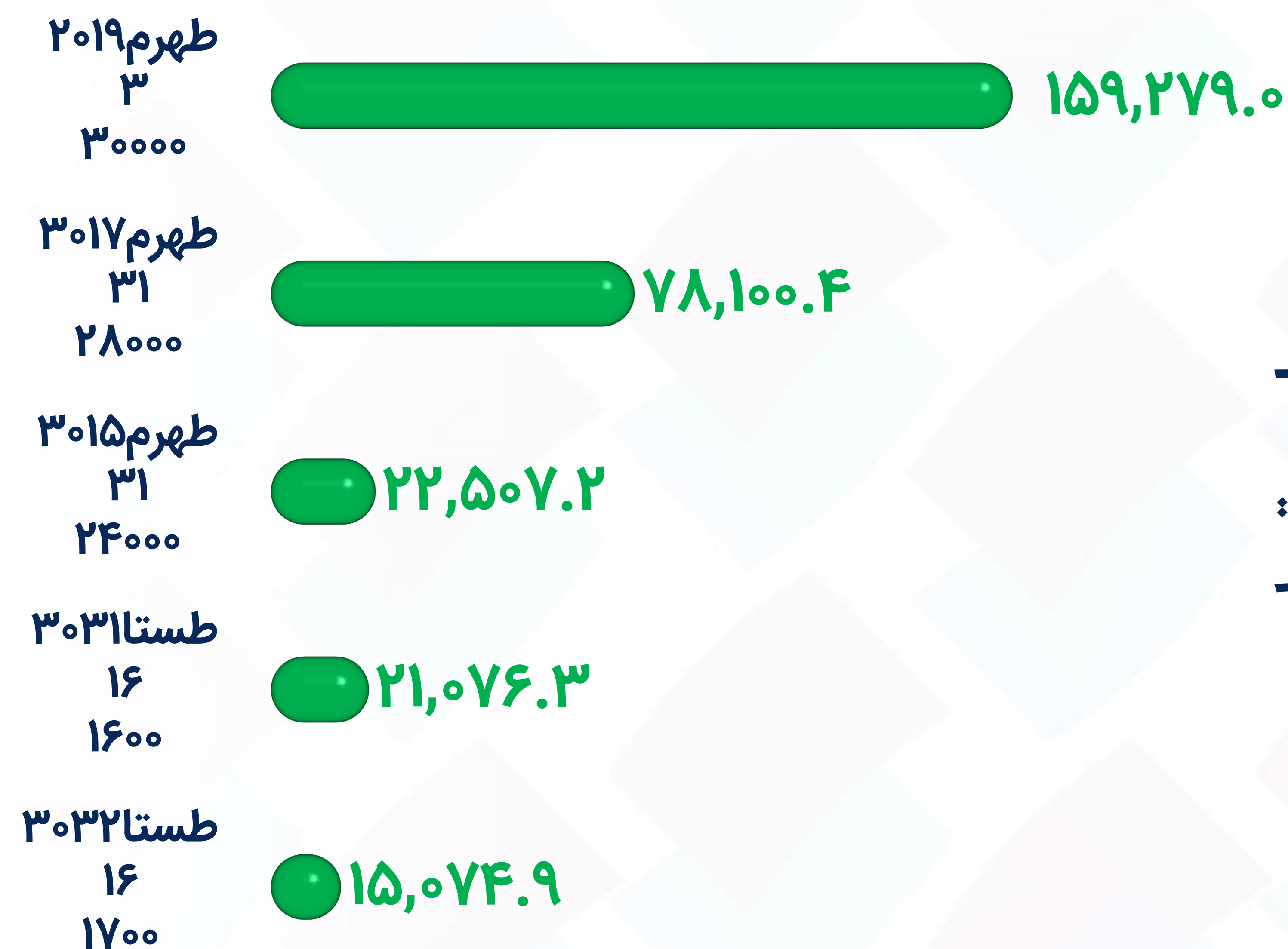
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

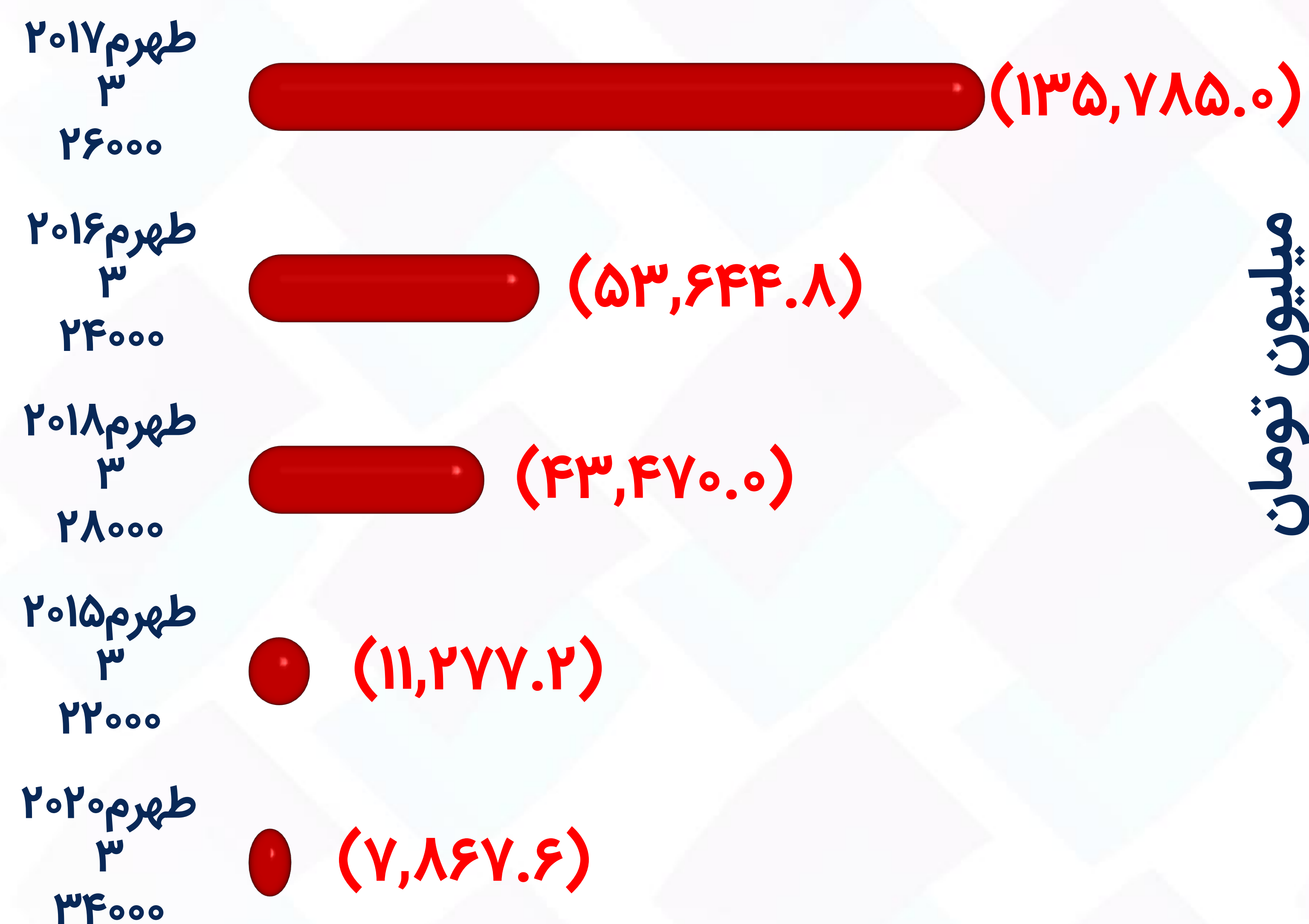
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

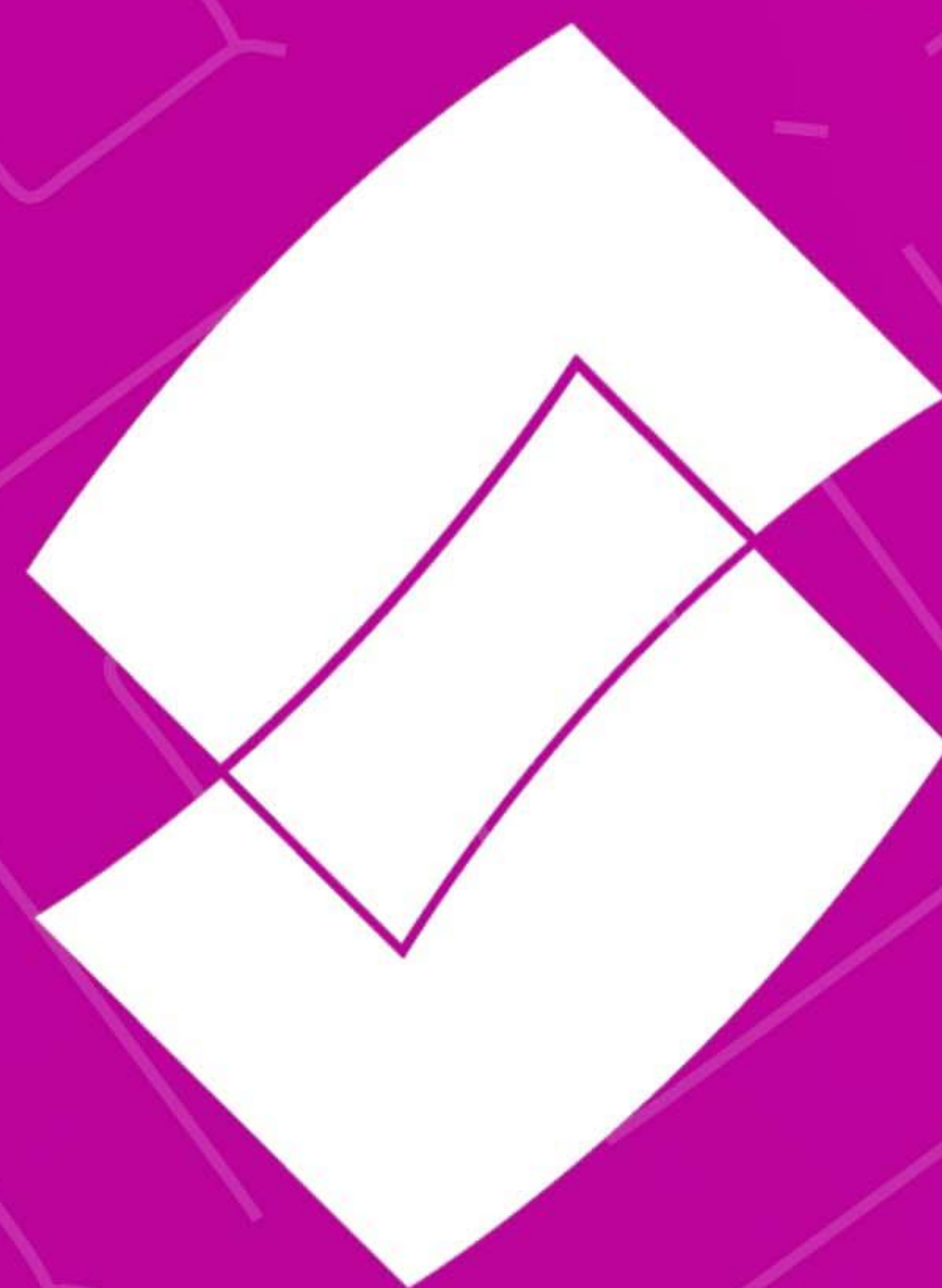
اختیار خرید



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.