

شماره
۴۸۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





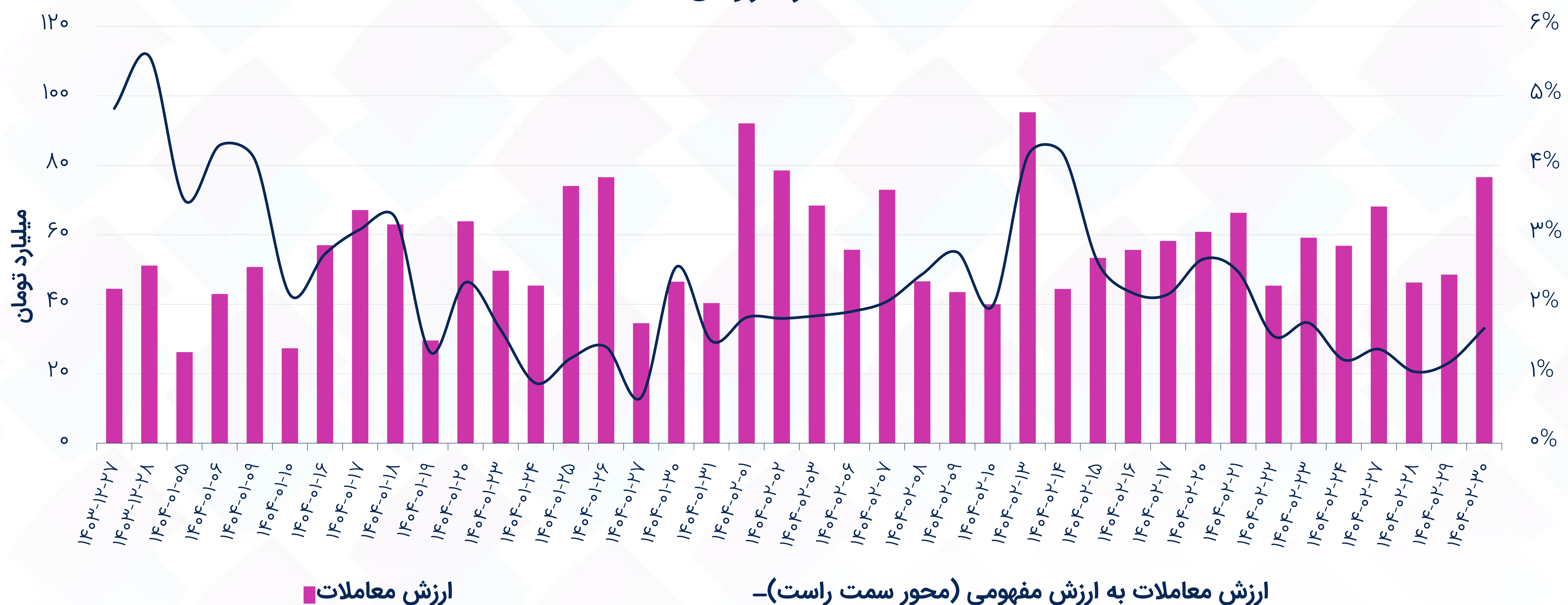
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



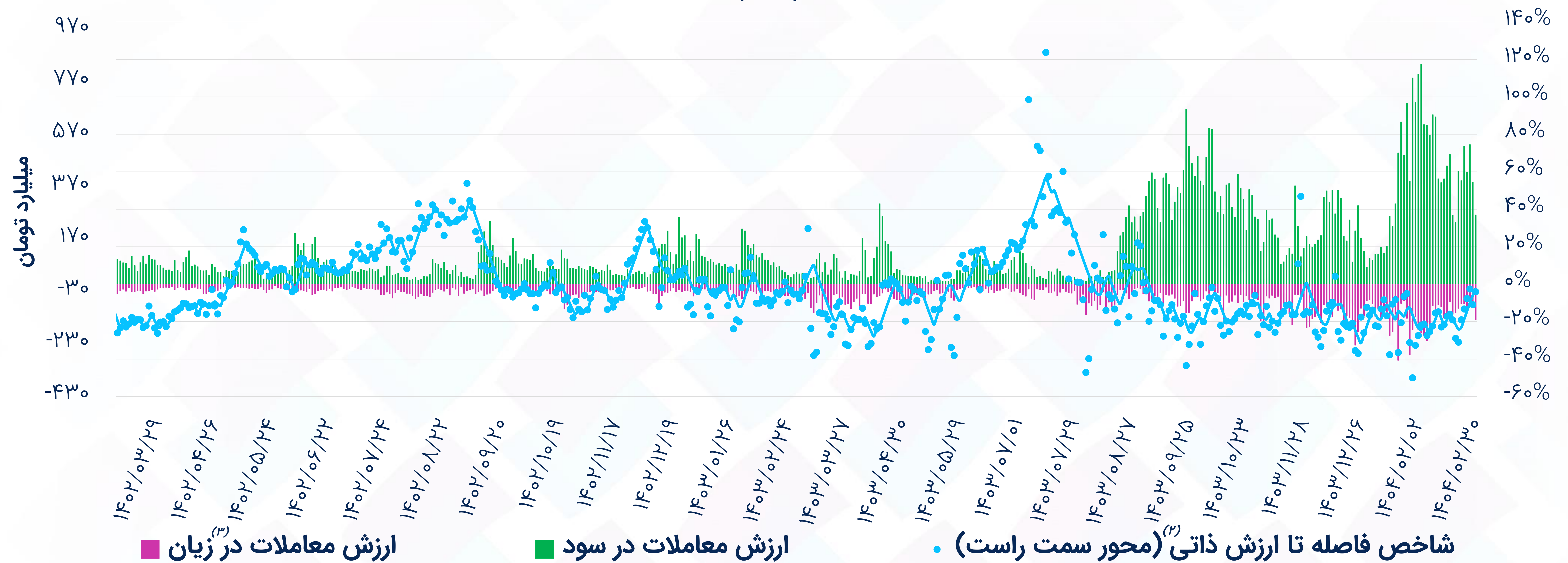
اختیار فروش



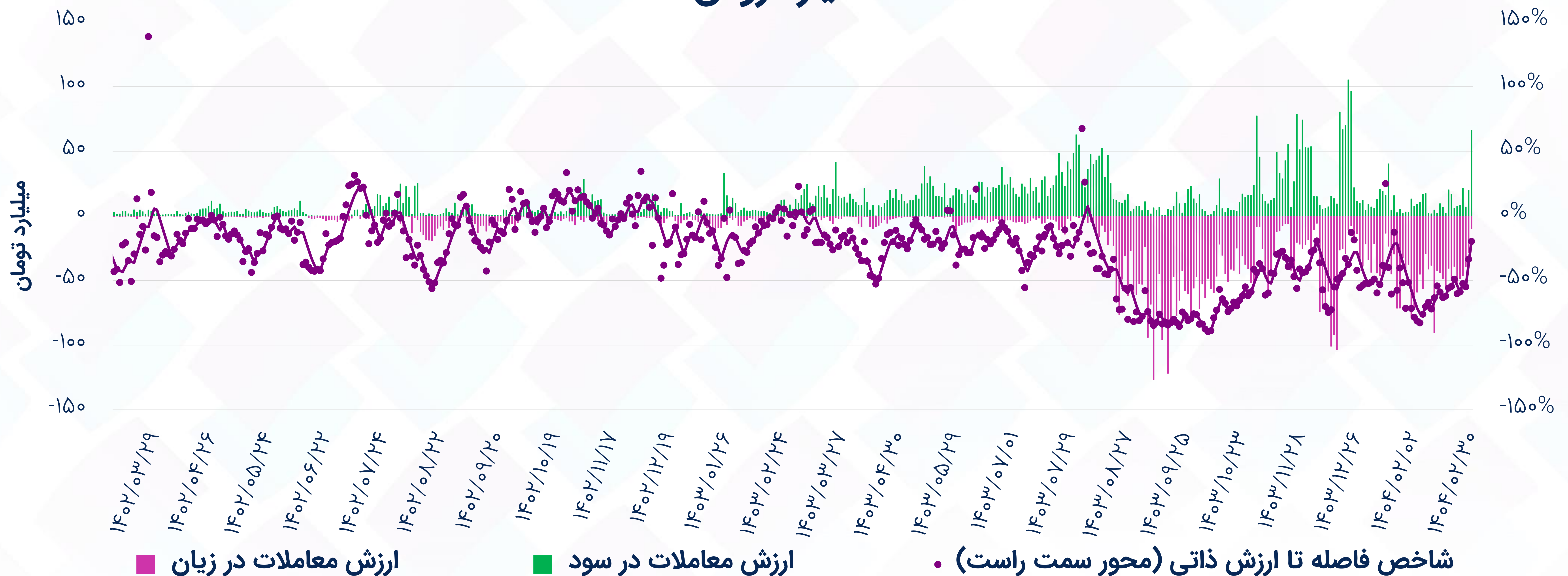
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

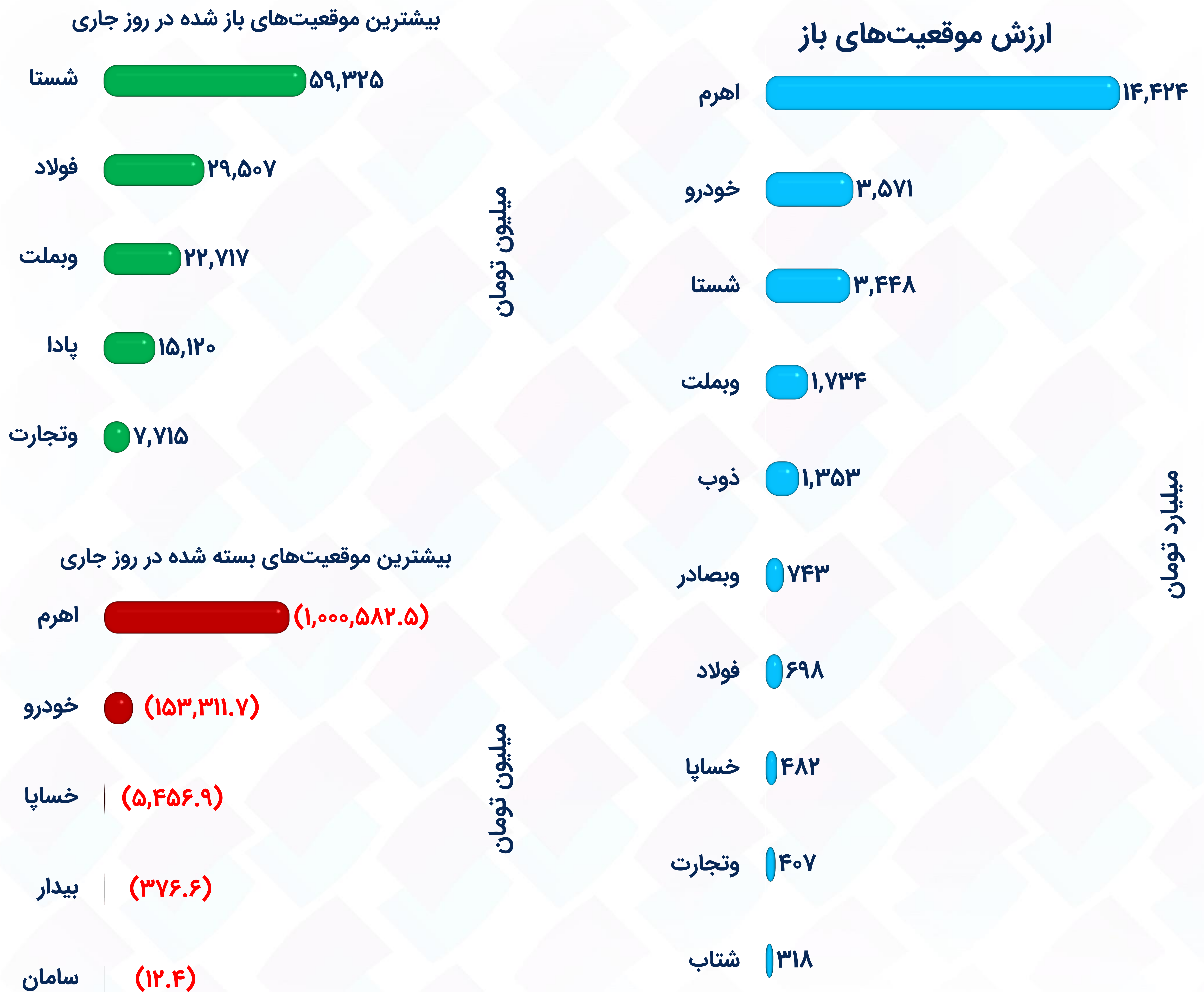
اختیار خرید

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	۵۱	۲۳۵.۲	۶,۲۱۲.۵	۱۴۳.۴	۹۱.۸	(۳.۳%)
خودرو	۱۳	۶۱.۶	۲,۰۲۹.۴	۳۹.۵	۲۲.۱	۳.۰%
شستا	۴۳	۵۳.۵	۱,۰۳۲.۳	۴۰.۳	۱۳.۲	(۵.۹%)
ذوب	۳۱	۱۷.۰	۲۱۰.۵	۱۵.۰	۱.۹	(۲۰.۵%)
وبملت	۱۸	۶.۳	۱۲۳.۷	۵.۰	۱.۳	(۱۳.۳%)
وبصادر	۱۶	۵.۹	۶۷.۷	۴.۶	۱.۳	(۲۲.۸%)
خسپا	۲۲	۵.۸	۹۸.۸	۴.۵	۱.۴	۱۹.۰%

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	۲۵	۳۹,۹۸۱.۵	۳,۵۸۳,۱۳۴.۴	۳۵,۶۲۲.۳	۴,۳۵۹.۲	(۲۲.۸%)
خودرو	۶	۳۱,۳۴۵.۸	۶۸۳,۵۶۱.۱	۲۷,۸۷۰.۸	۳,۴۷۵.۰	(۹.۷%)
شستا	۸	۵,۰۸۷.۵	۳۵۶,۰۷۵.۵	۲,۸۸۹.۹	۲,۱۹۷.۶	(۵۸.۳%)
خسپا	۶	۵۱.۳	۴,۳۳۱.۹	۳۸.۰	۱۳.۳	۶۱.۳%
وتعاون	۳	۳۵.۰	۳۹۸.۹	۳۵.۰	۰.۰	۲.۵%
وبملت	۴	۳۱.۶	۱,۱۸۵.۰	۰.۰	۳۱.۶	(۴۷.۱%)
ذوب	۴	۲۸.۱	۱,۶۳۷.۰	۶.۵	۲۱.۶	(۵۷.۳%)

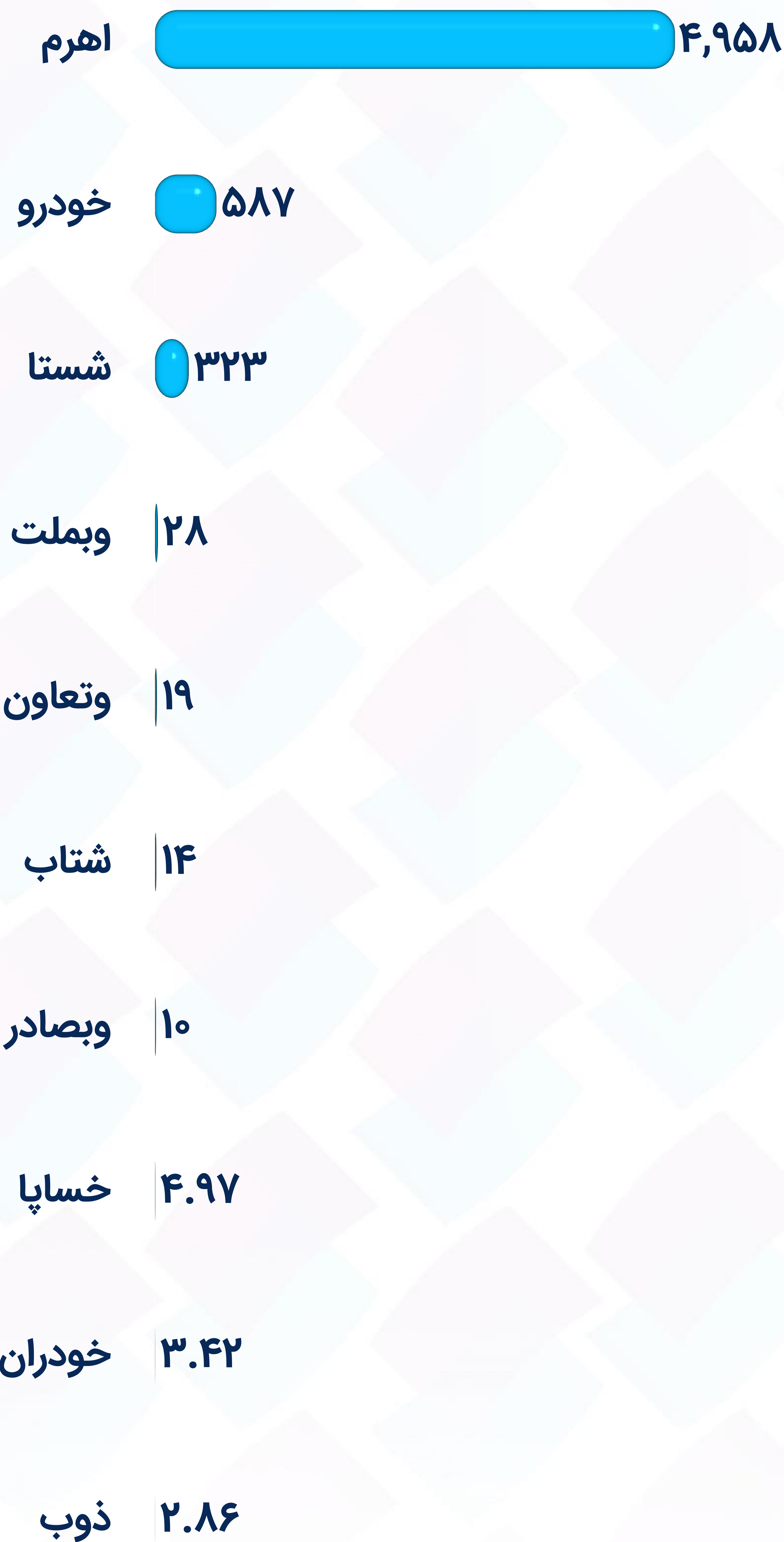
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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

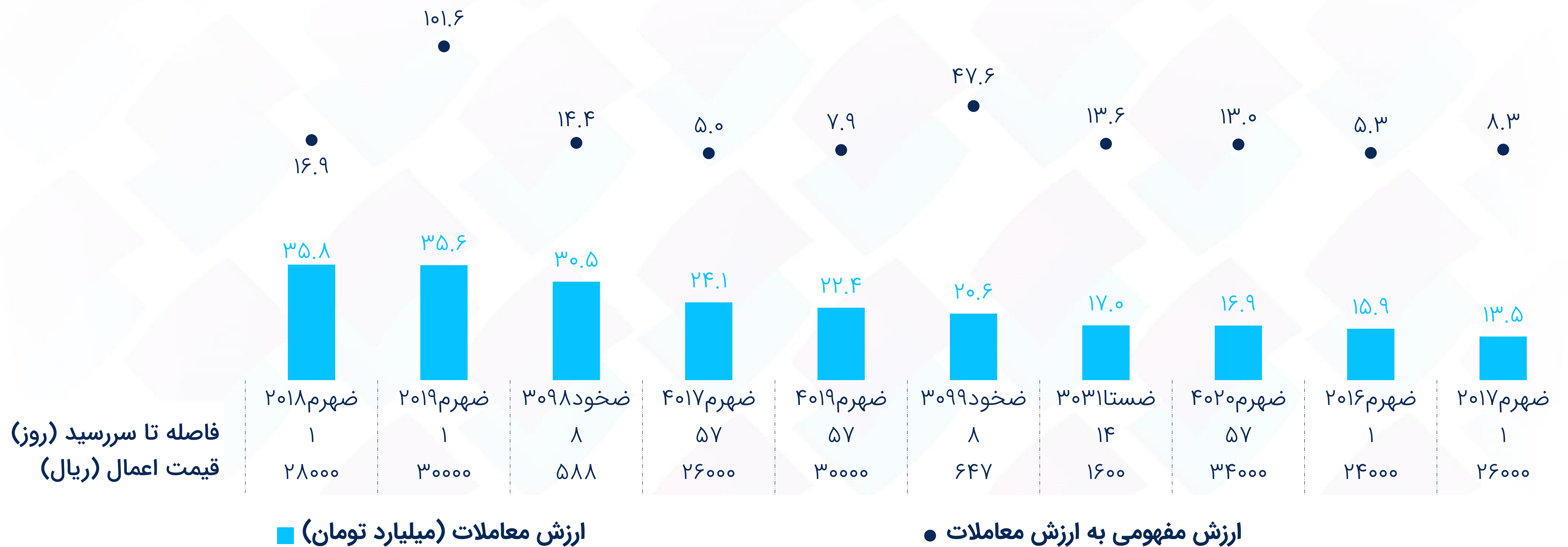
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضنارنج ۳۰۰	نارنج اهرم	۹,۵۰۰	۱۲	۱.۵	۷,۵۰۰	۲۰,۵۰۹	۱۷,۰۰۰	(۱۷.۱%)	۲.۳	۱.۰۰	۱۱,۱۲۸	۴۸%
ضنارنج ۳۰۶	نارنج اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۲	۸.۵	۴,۰۴۳	۲۰,۵۰۹	۱۹,۰۴۳	(۷.۱%)	۴.۷	۱.۰۰	۵,۶۹۷	۴۱%
ضنارنج ۳۰۴	نارنج اهرم	۱۳,۰۰۰	۱۲	۱.۱	۵,۵۰۰	۲۰,۵۰۹	۱۸,۵۰۰	(۹.۸%)	۳.۴	۱.۰۰	۷,۶۷۲	۳۹%
ضخود ۳۱۰۰	خودرو	۷۰۰	۸	۱,۲۷۲.۲	۲	۶۱۹	۷۰۲	۱۳.۴%	۳۵۱.۰	۰.۱۱	۳	۳۶%
ضملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۲۲	۲۸۳.۵	۶۳۳	۲,۶۶۲	۲,۵۴۰	(۴.۶%)	۴.۰	۱.۰۰	۷۹۵	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	۲۲	۲.۲	۳	۵۱۱	۱,۰۰۳	۹۶%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۲۲	۲.۳	۲	۵۱۱	۹۰۲	۷۷%	۴۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۲۲	۴.۵	۳	۵۱۱	۸۰۳	۵۷%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۲	۱۴.۰	۴	۶۸۱	۱,۰۰۴	۴۷%	۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۱۴	۱۳.۱	۷	۳,۸۱۹	۵,۰۴۷	۳۲%	۷۲۱.۰	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
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۸	۲۴۵.۲	۱۴۳	۶۱۹	۶۵۷	۶.۱%	۴.۶	-۱.۰۰	۱۷۳	۲۱.۲%
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲۹	۹.۰	۶,۰۰۰	۲۹,۹۷۰	۳۲,۰۰۰	۶.۸%	۵.۳	-۰.۹۸	۷,۰۵۵	۱۷.۶%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۲۷	۳۱.۸	۱۶۹	۱,۶۸۰	۱,۷۳۱	۳.۰%	۱۰.۲	-۰.۹۱	۱۸۰	۶.۵%
طخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۸	۳,۴۳۰.۸	۸	۶۱۹	۵۸۰	(۶.۳%)	۷۲.۵	-۰.۲۳	۸	(۴.۶%)
طخود ۳۱۰۰	خودرو	۷۰۰	۸	۵,۷۳۵.۷	۸۴	۶۱۹	۶۱۶	(۰.۵%)	۷.۳	-۰.۸۹	۷۷	(۸.۵%)

گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

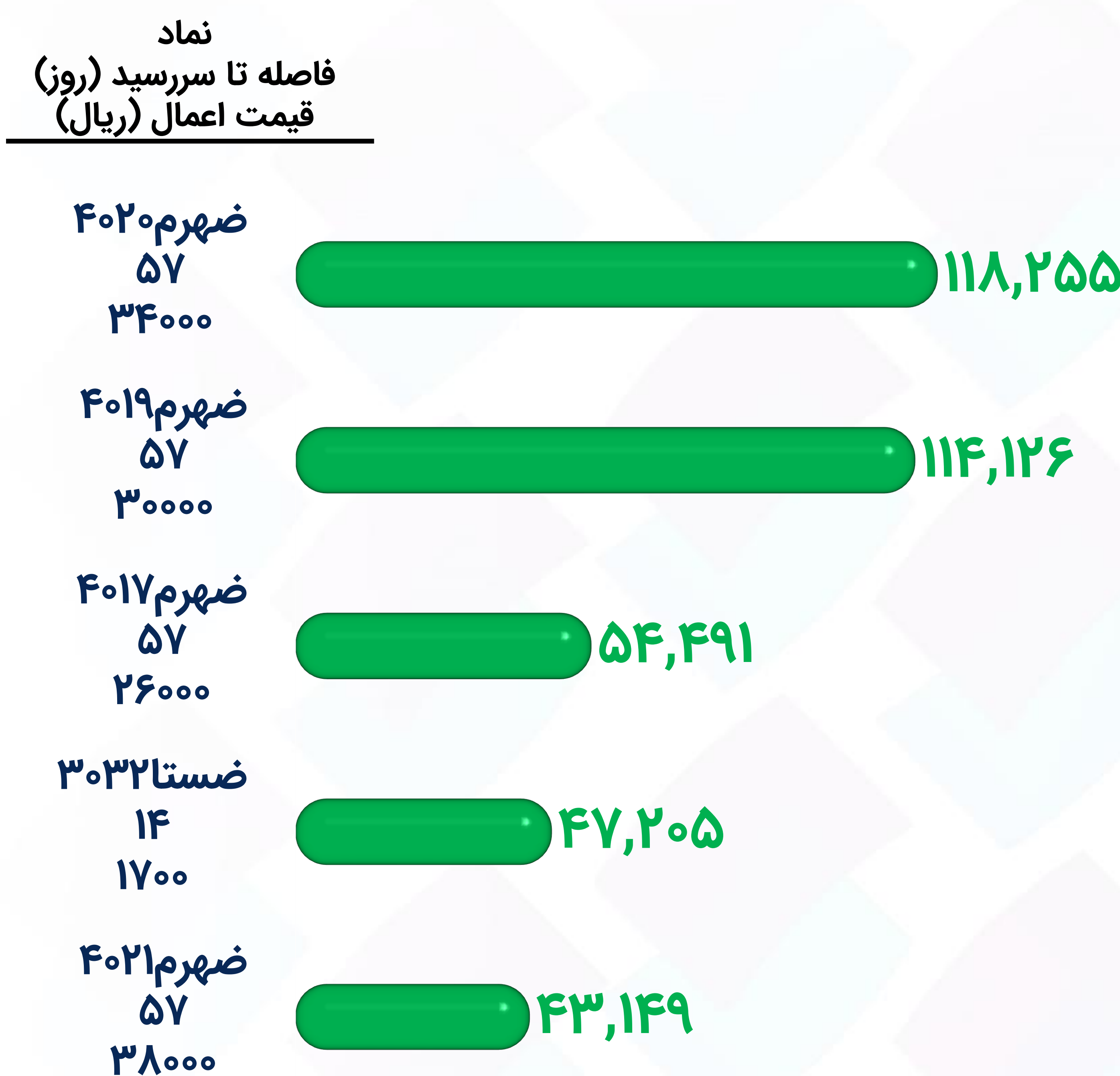
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر	فاصله تا سربه‌سر	اهرم	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۸	۱.۴	۱	۶۱۹	۲۸۱	(۵۴.۶%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۵۷	۰.۱	۱	۵۱۱	۱۹۹	(۶۱.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۲۲	۰.۱	۱	۶۸۱	۳۹۹	(۴۱.۴%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۱	وبصادر	۵۰۰	۲۲	۰.۵	۲	۶۸۱	۴۹۸	(۲۶.۹%)	۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۳۰۲۸	شستا	۱,۳۰۰	۱۴	۰.۱	۱	۱,۶۹۰	۱,۲۹۹	(۲۳.۱%)	۱,۲۹۹.۰	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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

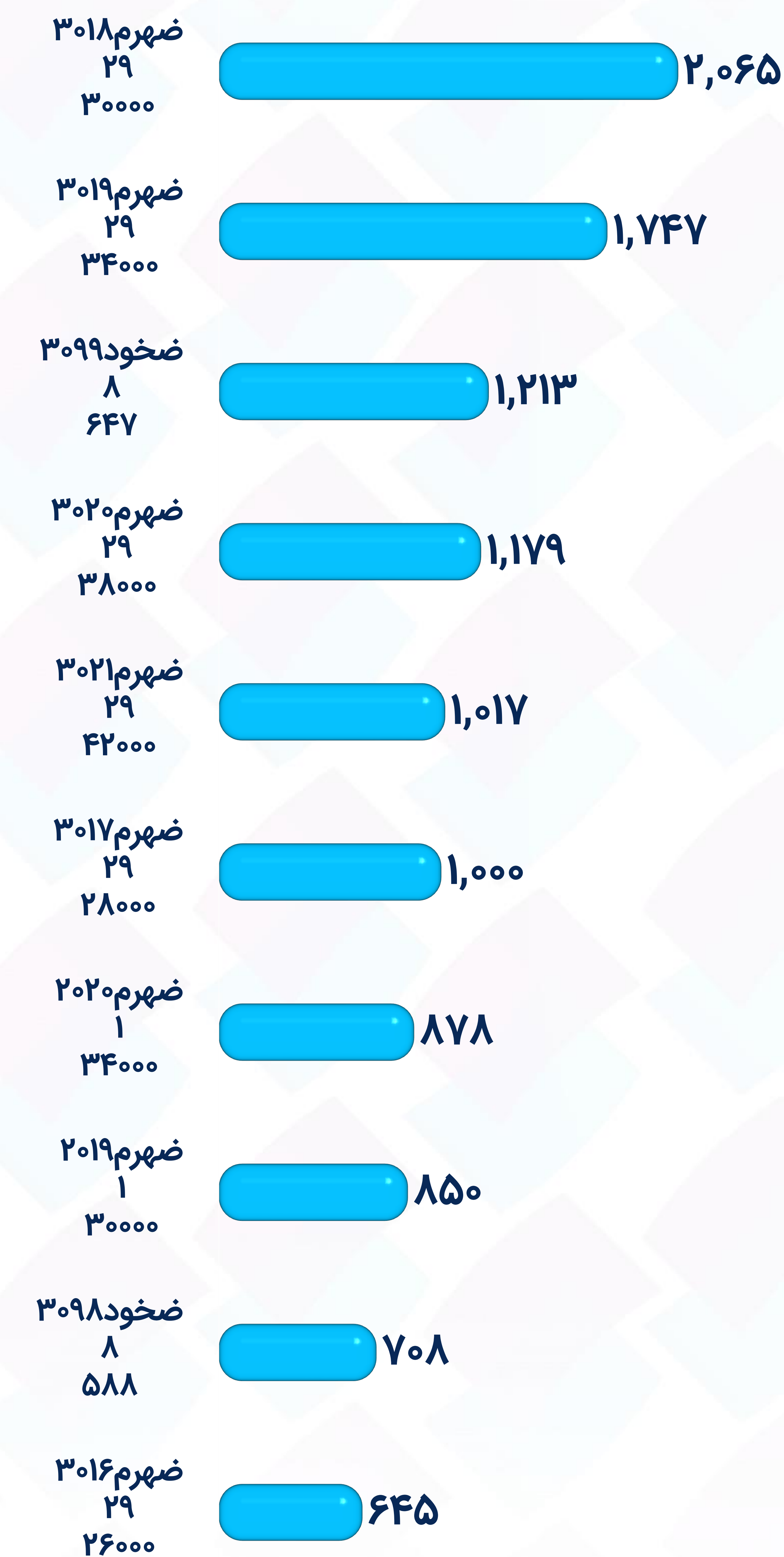
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

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

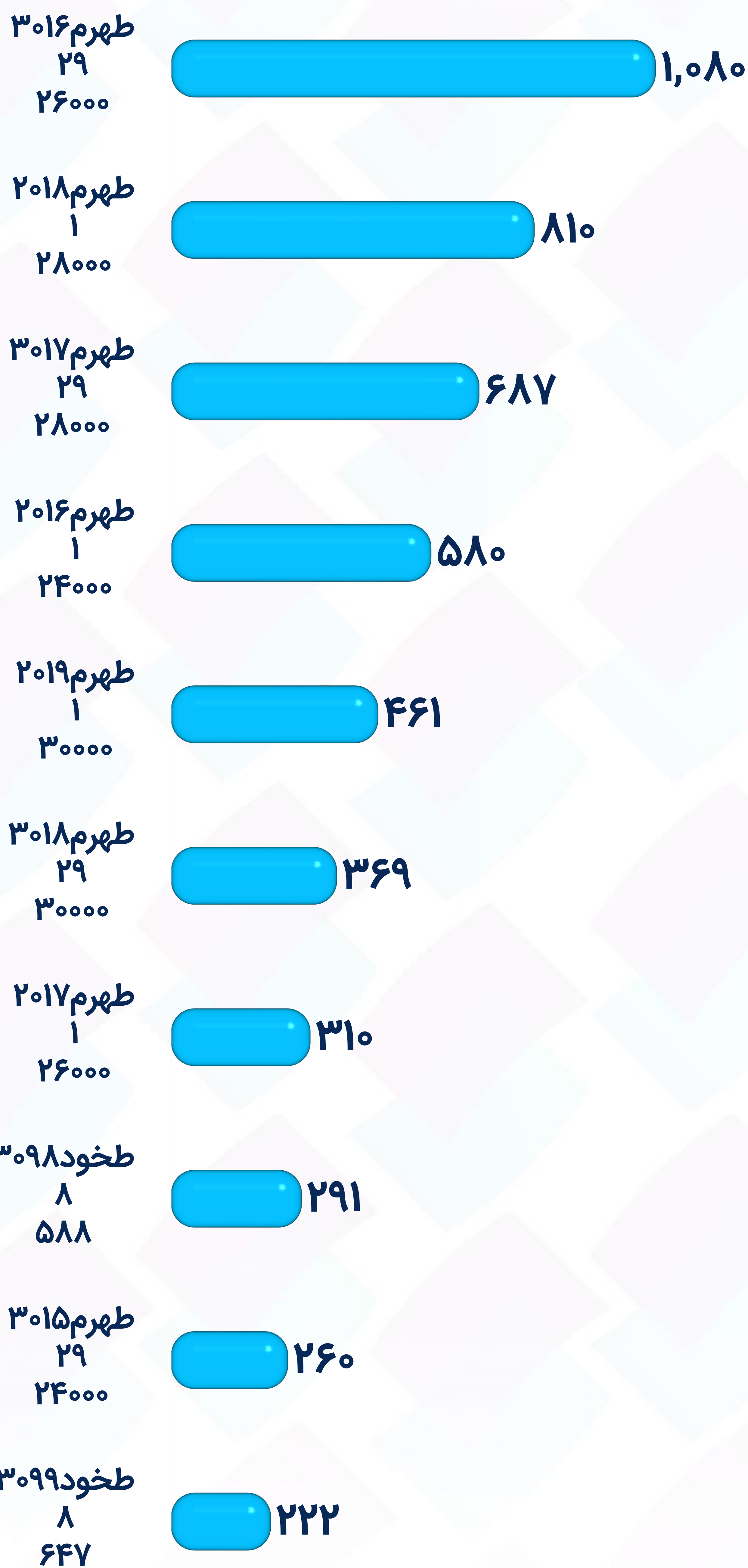


میلیارد تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

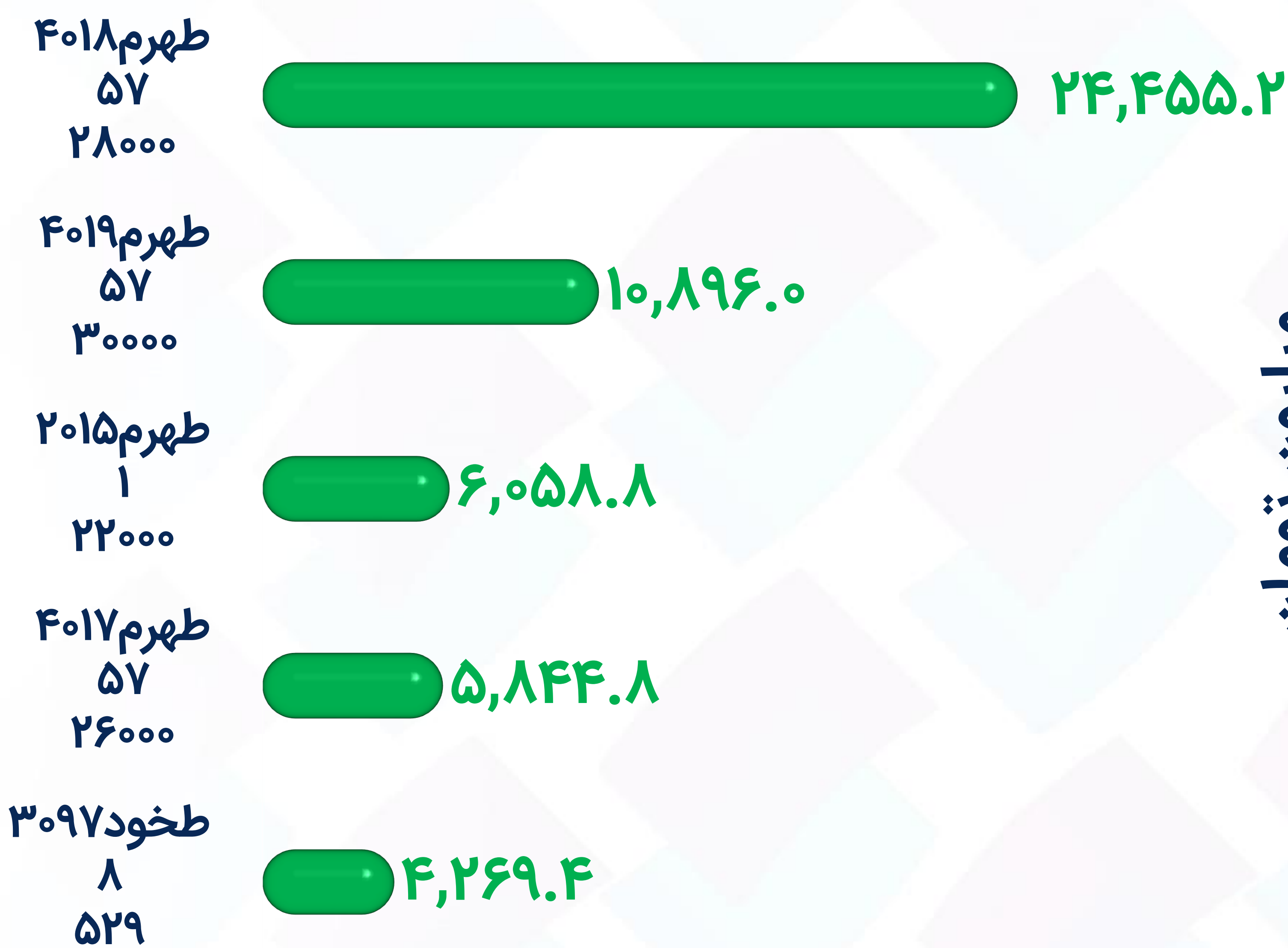
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

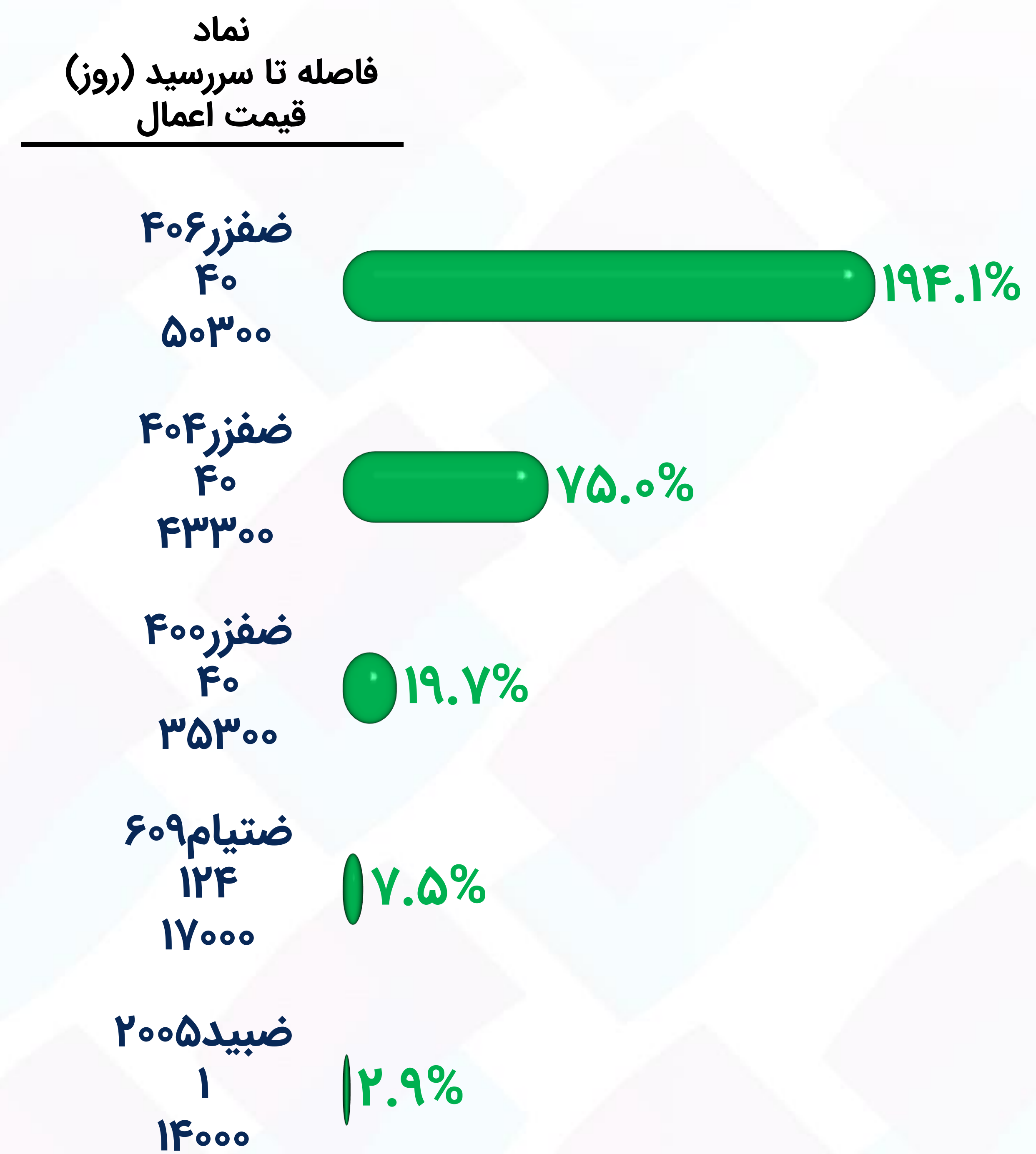
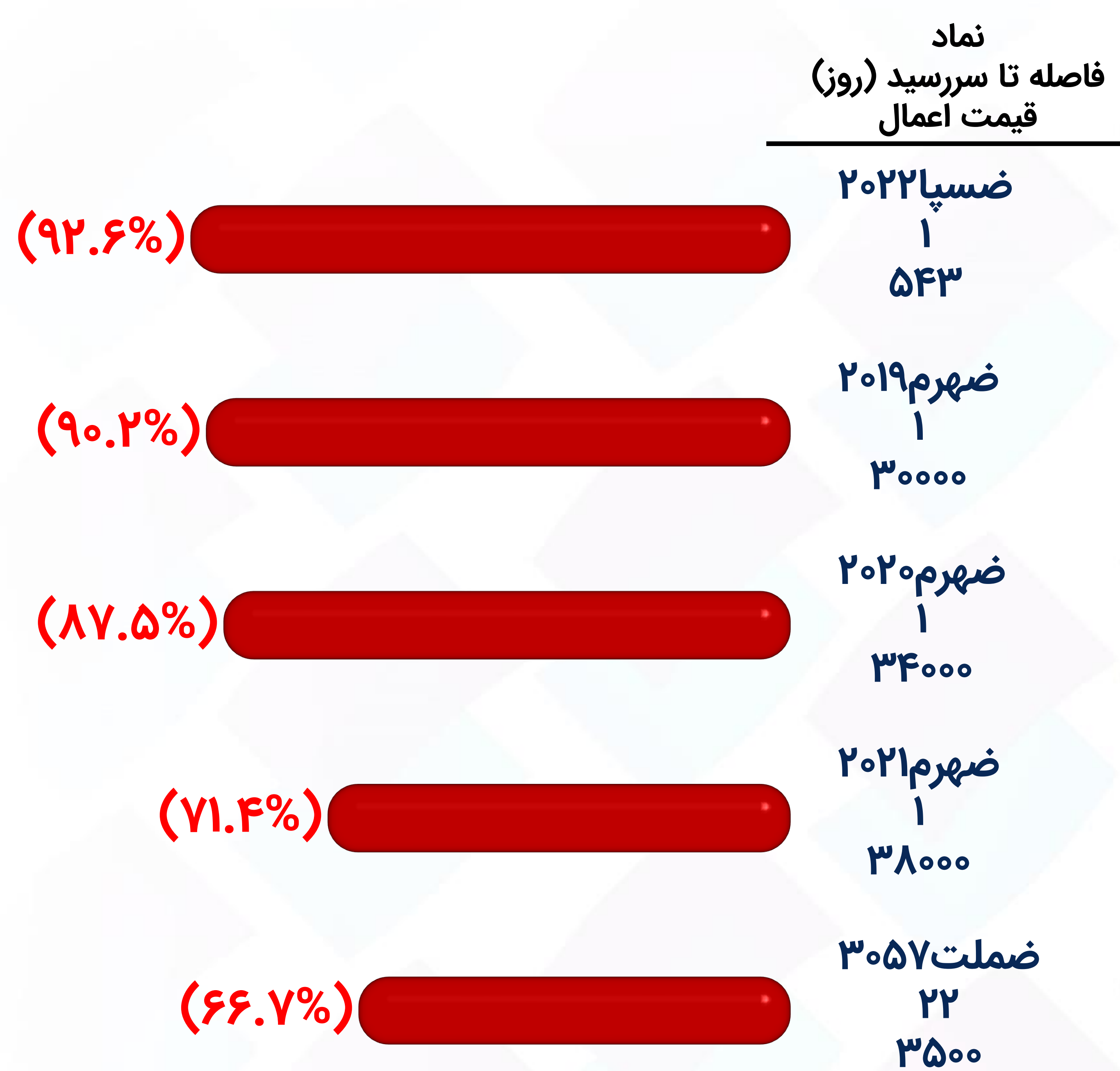
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



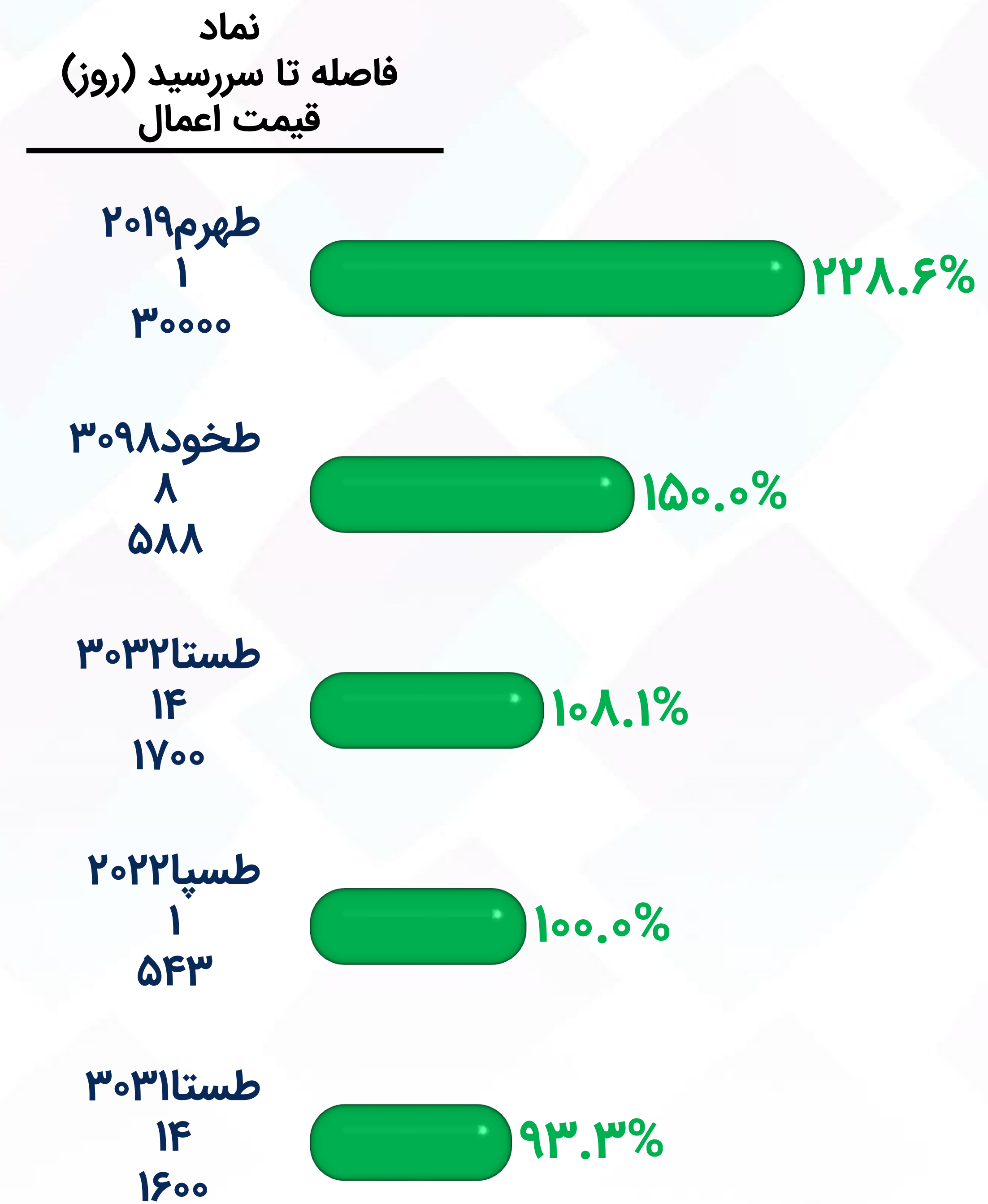
میلیون تومان

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.