

شماره
۴۸۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

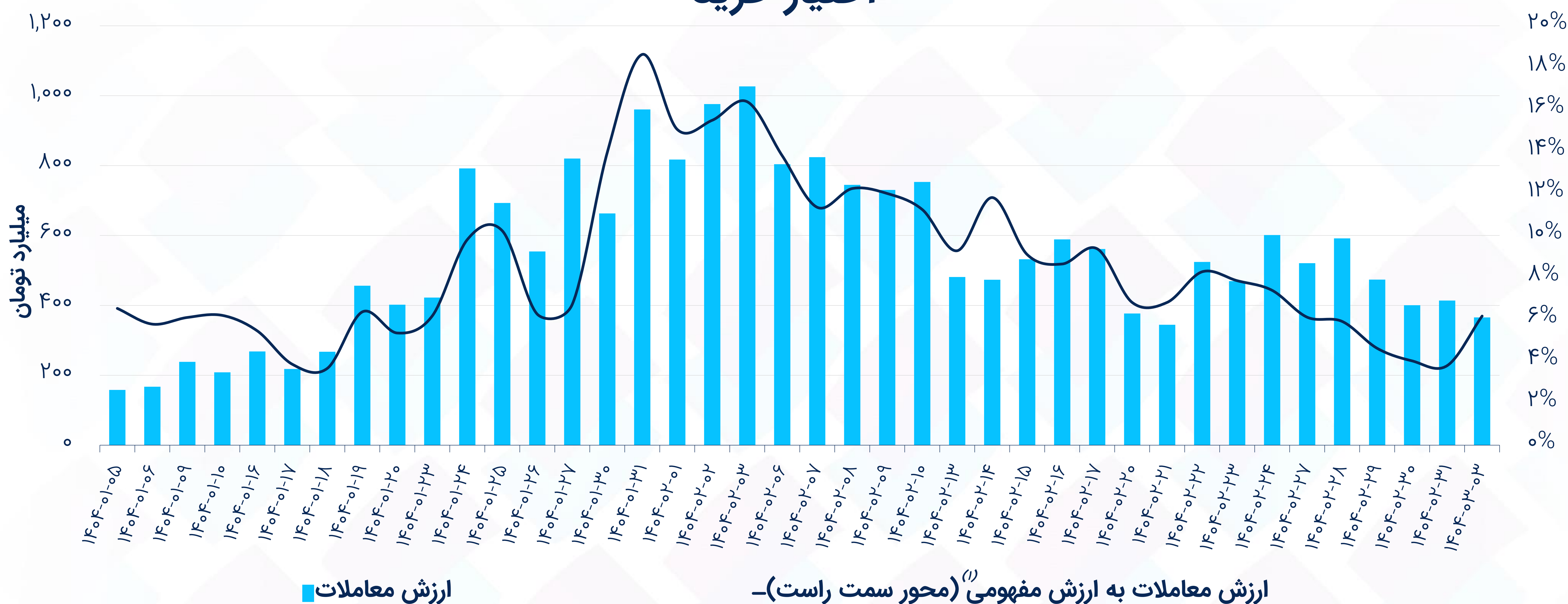




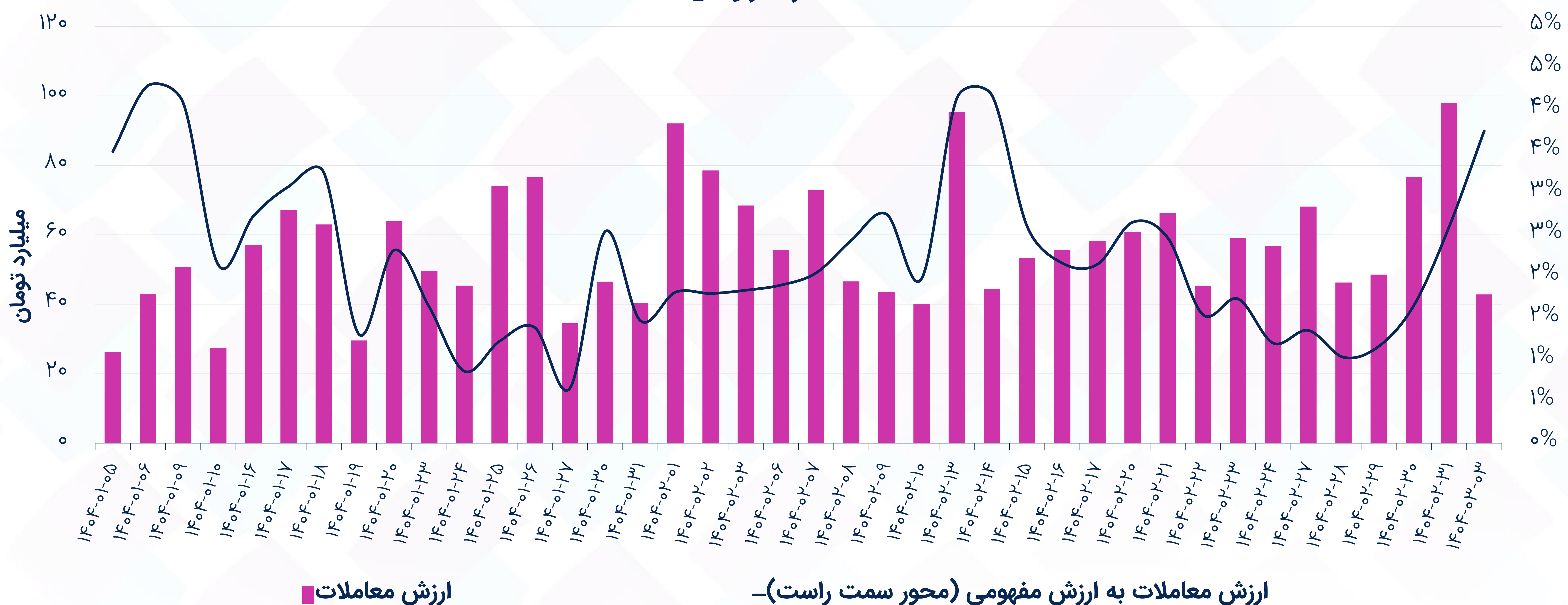
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



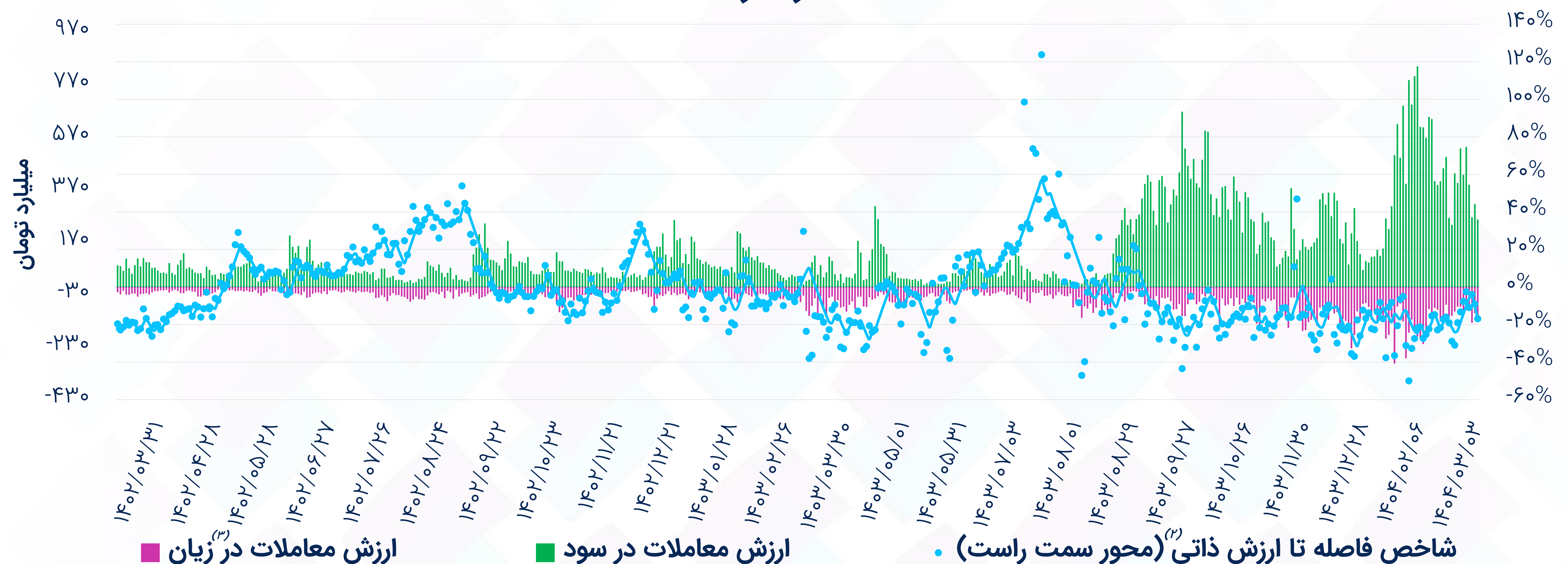
اختیار فروش



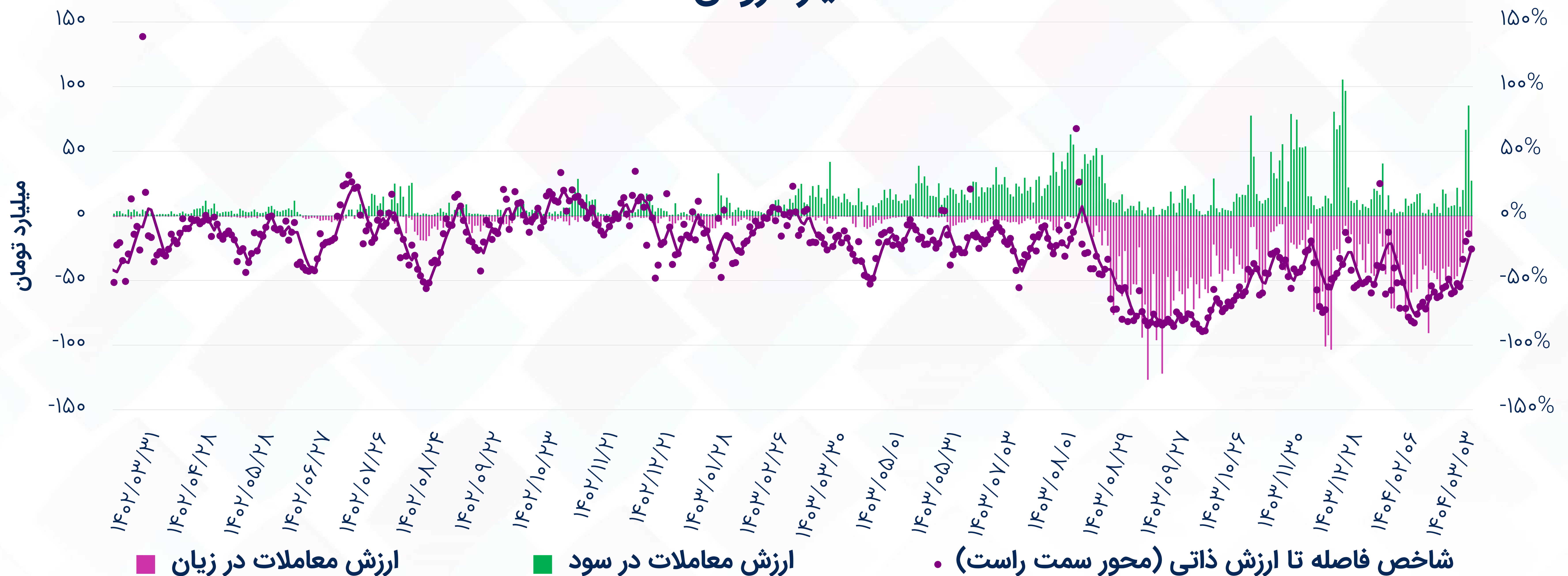
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

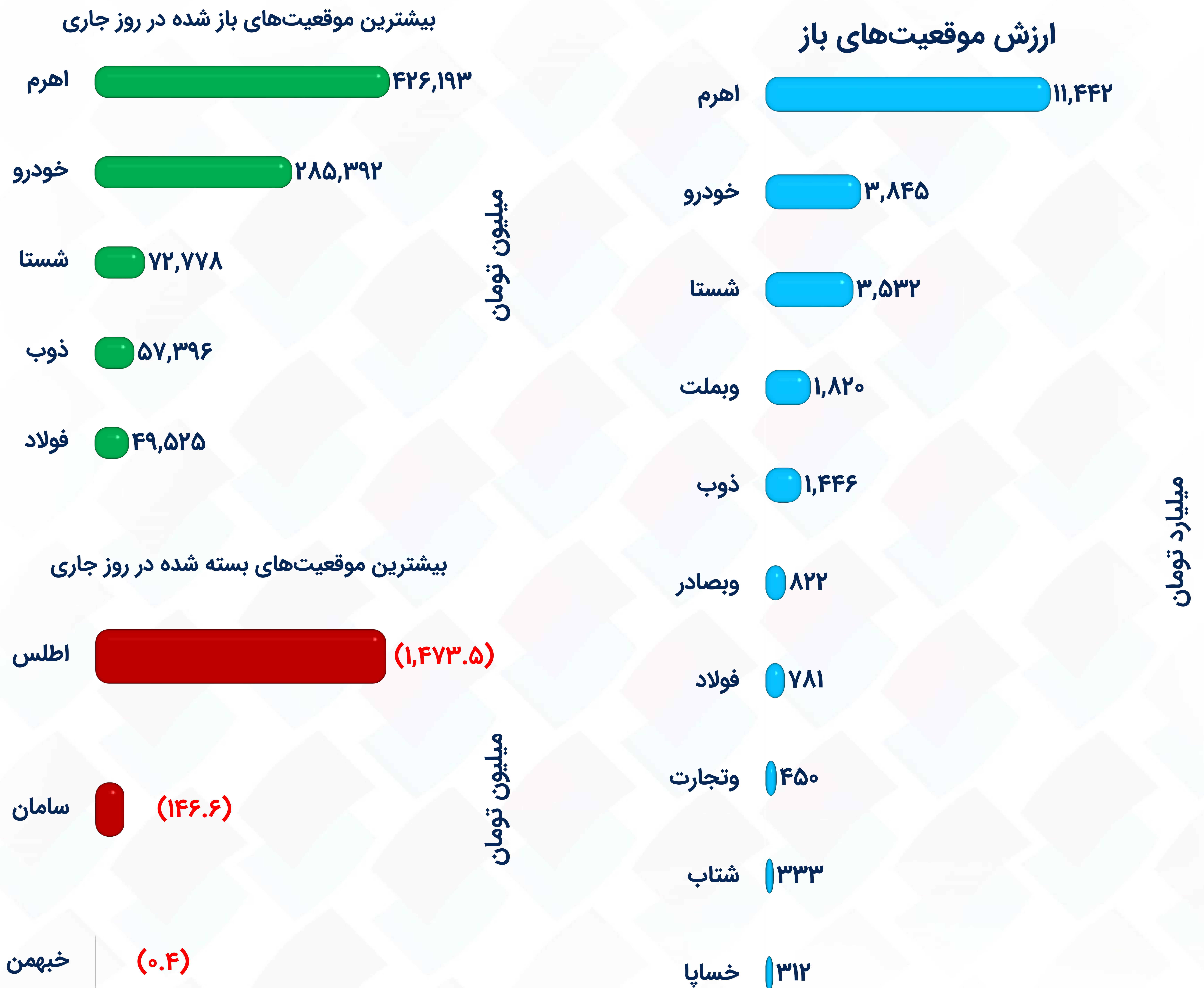
اختیار خرید

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	۴۳	۱۹۳.۴	۱,۹۲۱.۰	۱۱۳.۳	۸۰.۱	(۲۸.۶%)
خودرو	۲۸	۸۹.۴	۲,۴۵۰.۲	۷۷.۸	۱۱.۵	۸.۳%
شستا	۳۹	۲۹.۱	۷۸۰.۹	۲۲.۹	۶.۲	(۱۳.۴%)
ذوب	۲۷	۱۷.۸	۲۱۰.۰	۱۶.۲	۱.۶	(۱۹.۱%)
وبملت	۲۵	۶.۴	۱۴۸.۳	۵.۱	۱.۴	(۲۲.۵%)
وتجارت	۱۳	۵.۶	۴۳.۴	۳.۵	۲.۱	(۲۴.۱%)
وبصادر	۱۷	۵.۵	۸۴.۱	۴.۲	۱.۲	(۲۵.۳%)

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	۹	۲۴,۲۰۹.۲	۵۱۴,۸۸۵.۳	۲۰,۹۹۸.۳	۳,۲۱۱.۰	(۶.۴%)
اهرم	۲۰	۱۴,۲۵۲.۱	۳۴۸,۳۰۰.۰	۳,۴۷۴.۵	۱۰,۷۷۷.۷	(۵۴.۷%)
شستا	۱۰	۴,۲۳۰.۸	۲۴۲,۹۵۵.۱	۲,۵۱۱.۹	۱,۷۱۸.۹	(۳۷.۵%)
اطلس	۳	۴۷.۹	۳۰,۳۴۱.۳	۴۵.۹	۲.۰	(۴۱.۵%)
وبملت	۸	۲۷.۰	۲,۳۰۱.۲	۰.۴	۲۶.۶	(۵۲.۹%)
ذوب	۳	۲۱.۰	۱,۹۴۲.۳	۰.۰	۲۱.۰	(۶۲.۴%)
وبصادر	۲	۱۱.۷	۱,۸۴۰.۷	۰.۰	۱۱.۷	(۸۸.۱%)

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



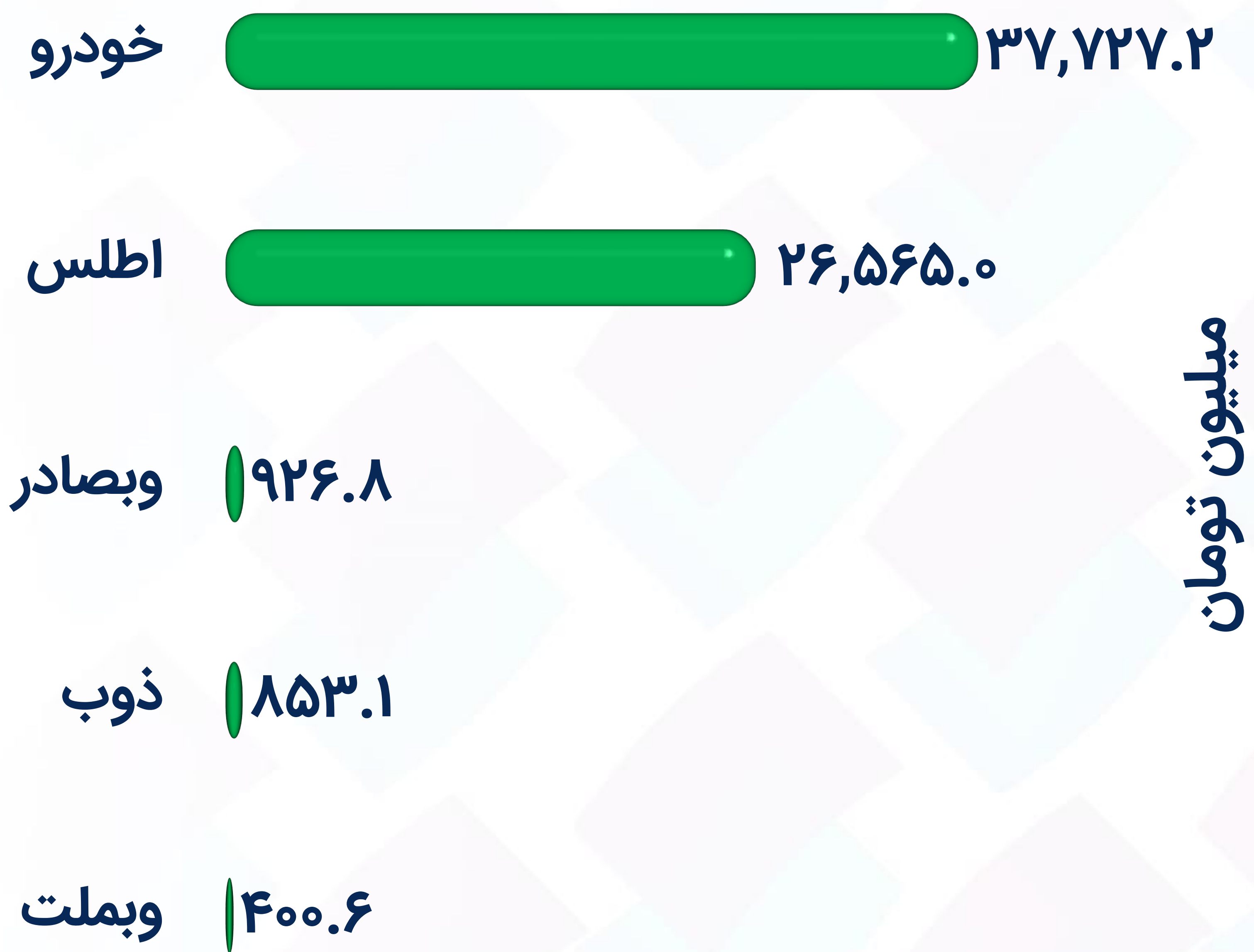
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

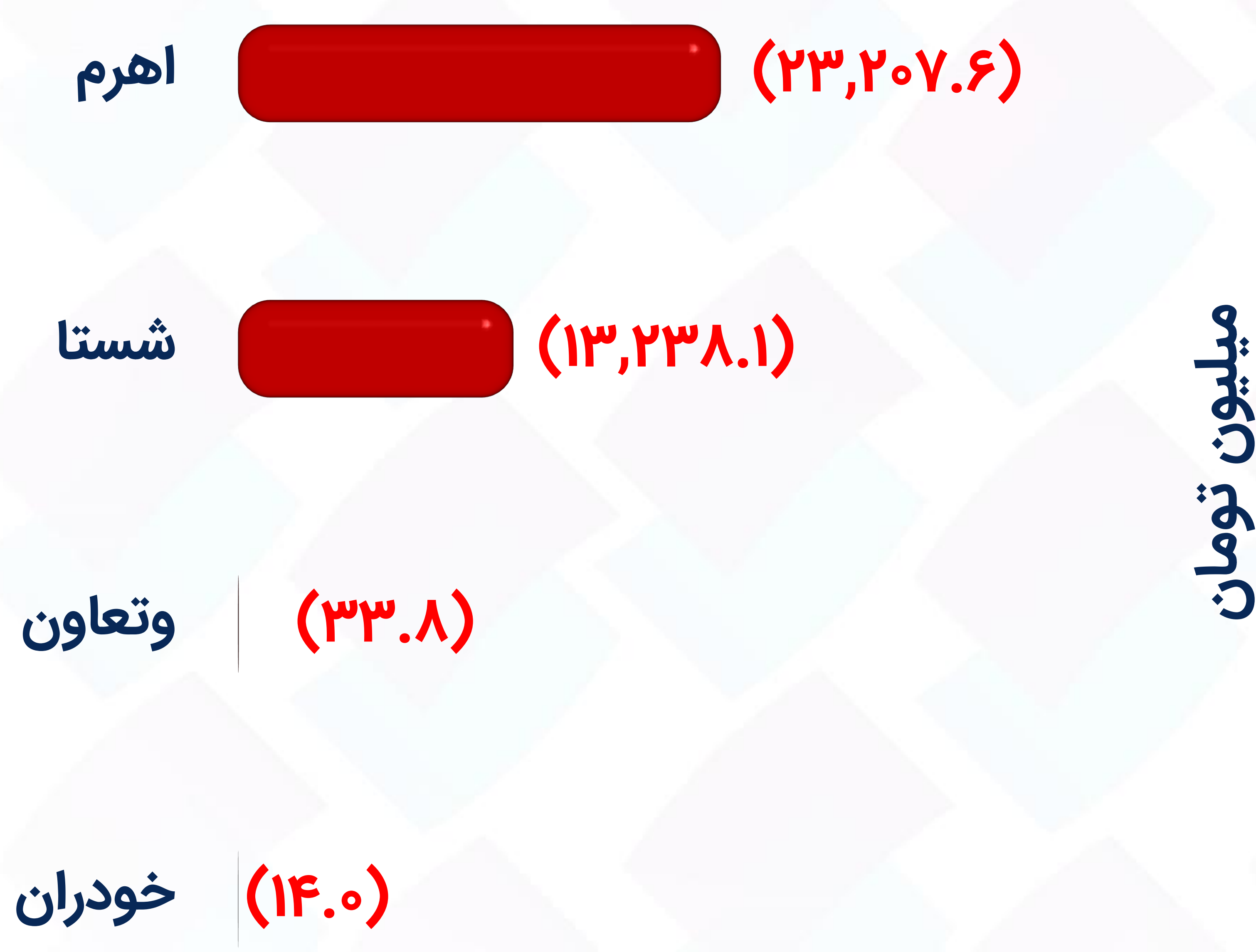
ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

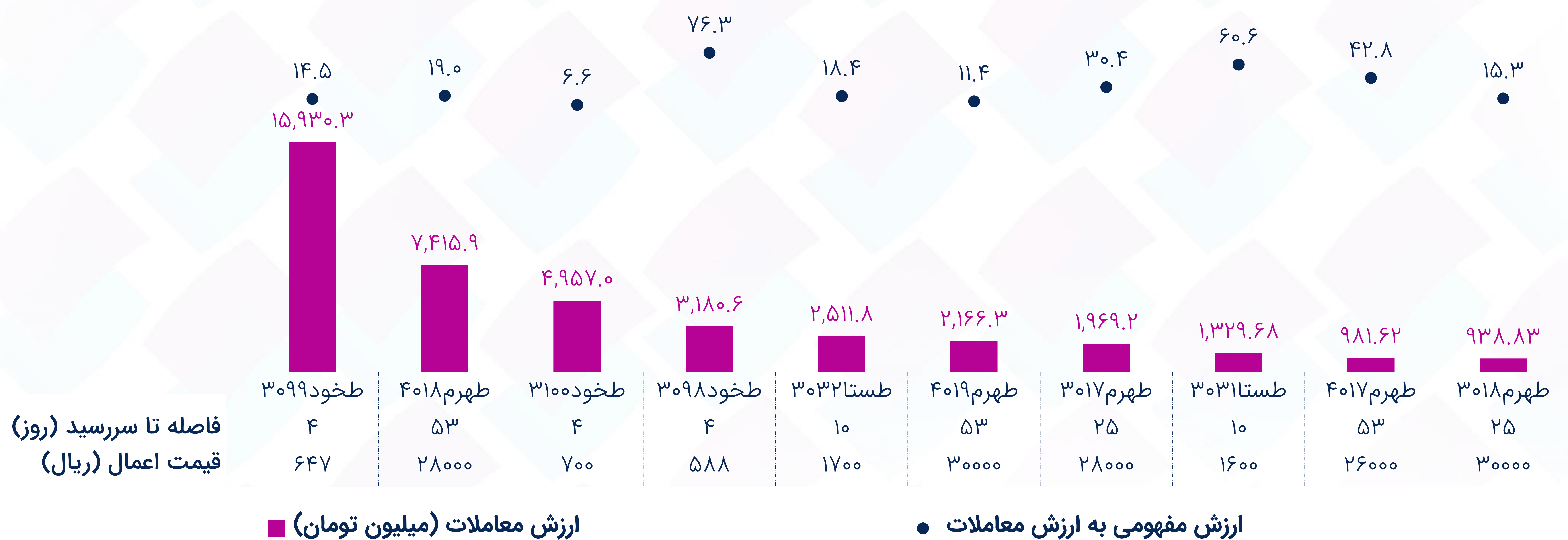


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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
ضیاداد ۴۰۳۱	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۳۶	۶.۱	۱۹,۷۴۰	۲۰۵,۴۶۴	۱۹۹,۷۴۰	(۲.۸%)	۱۰.۱	۰.۹۹	۳۱,۴۴۱	۵۹%
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۲۵	۶۳۲.۴	۱۹	۵۴۸	۶۲۲	۱۳.۵%	۳۲.۷	۰.۳۹	۲۶	۳۶%
ضسپا ۶۰۳۱	خسپا	۵۰۰	۱۱۶	۳۰۷.۳	۱۰۴	۵۴۸	۶۰۴	۱۰.۲%	۵.۸	۰.۷۶	۱۳۸	۳۳%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۲۵	۱,۲۹۹.۹	۳۹	۵۴۸	۵۸۲	۶.۲%	۱۴.۹	۰.۶۱	۵۱	۳۰%
ضملی ۳۰۵۰	فملی	۶,۶۸۶	۴	۱۸۵.۰	۱۸۹	۶,۸۵۰	۶,۸۷۵	۰.۴%	۳۶.۴	۰.۷۹	۲۴۳	۲۹%

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	۱۸	۸.۶	۲	۵۰۲	۱,۰۰۲	۱۰۰%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۱۸	۱.۱	۳	۵۰۲	۸۰۳	۶۰%	۲۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۸	۲۷.۴	۳	۶۶۳	۱,۰۰۳	۵۱%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۴۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۵۳	۱.۳	۹	۵۰۲	۱,۰۰۹	۱۰۱%	۱۱۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۱۰	۱۷.۶	۲	۱,۶۳۵	۲,۲۰۲	۳۵%	۱,۱۰۱.۰	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
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۲۳	۲.۹	۱۸۲	۱,۶۶۷	۱,۷۱۸	۳.۱%	۹.۴	-۰.۹۵	۱۹۶	۷.۷%
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۴	۱۱۱.۰	۱۸۰	۶۱۰	۶۲۰	۱.۶%	۳.۴	-۱.۰۰	۱۸۴	۲.۵%
طخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۴	۳,۱۸۰.۶	۸	۶۱۰	۵۸۰	(۴.۹%)	۷۲.۵	-۰.۲۷	۸	(۴.۲%)
طخود ۳۱۰۰	خودرو	۷۰۰	۴	۴,۹۵۷.۰	۹۲	۶۱۰	۶۰۸	(۰.۳%)	۶.۶	-۰.۹۶	۸۶	(۶.۶%)
طخود ۳۰۹۹	خودرو	۶۴۷	۴	۱۵,۹۳۰.۳	۴۲	۶۱۰	۶۰۵	(۰.۸%)	۱۴.۴	-۰.۷۵	۳۹	(۶.۷%)

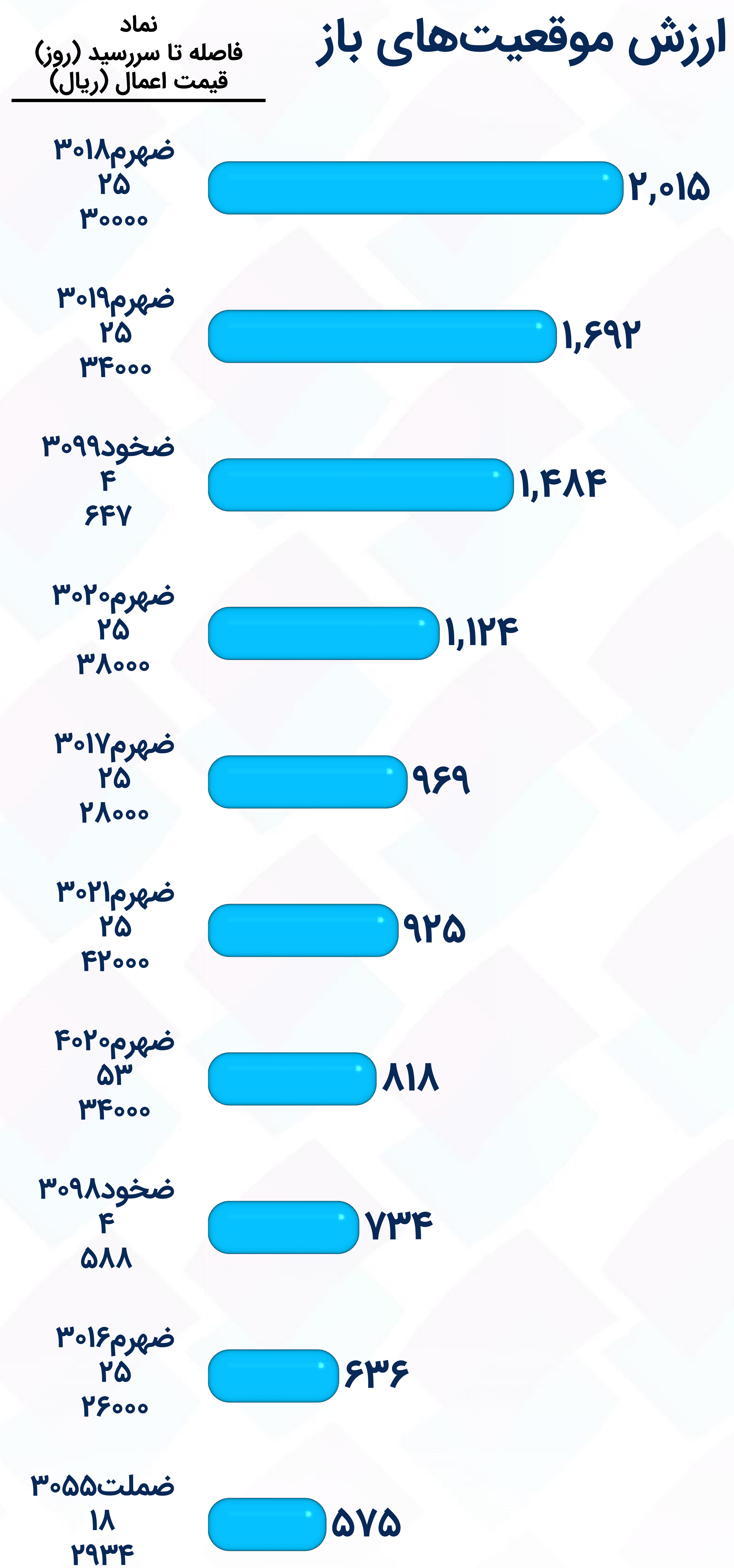
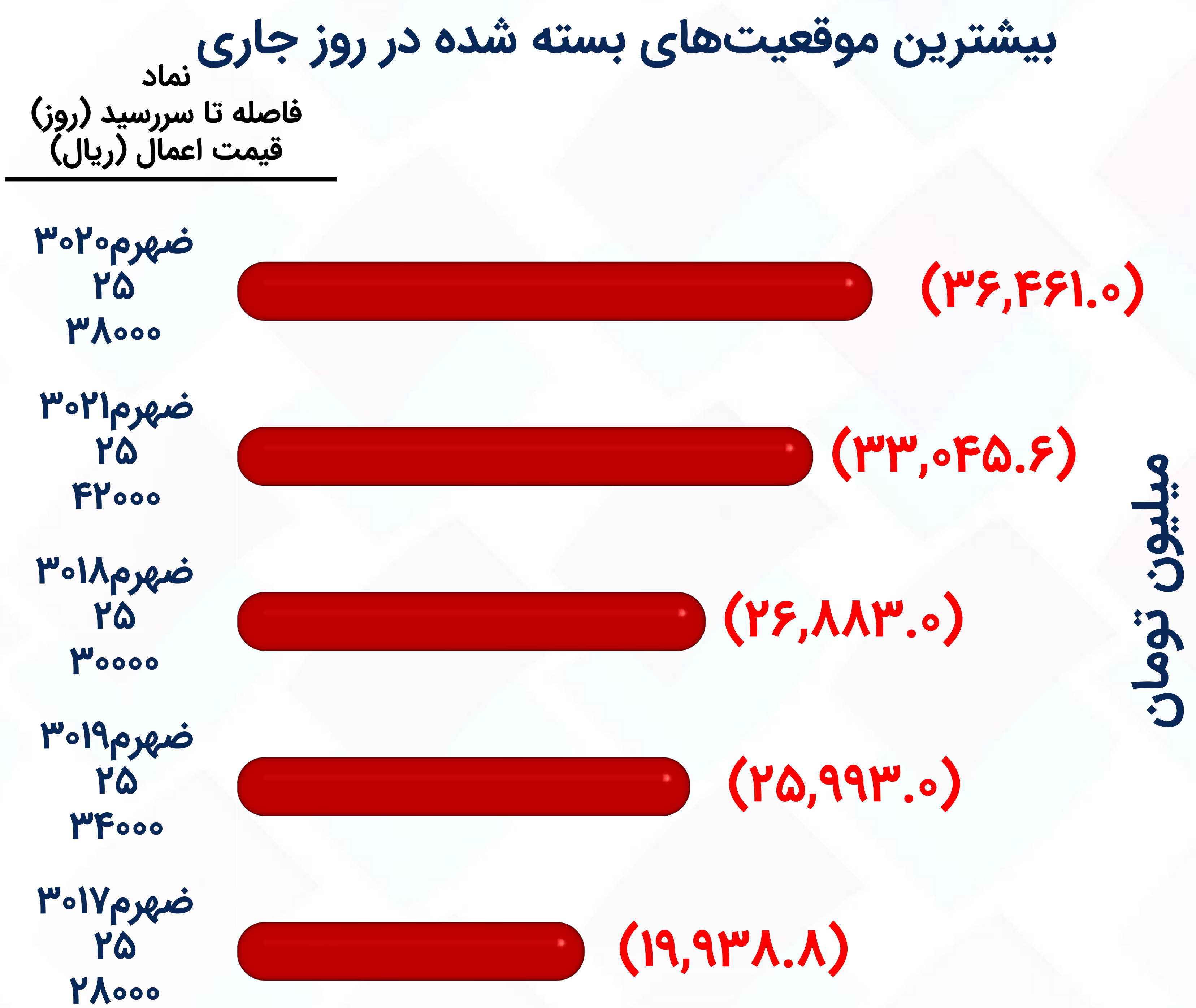
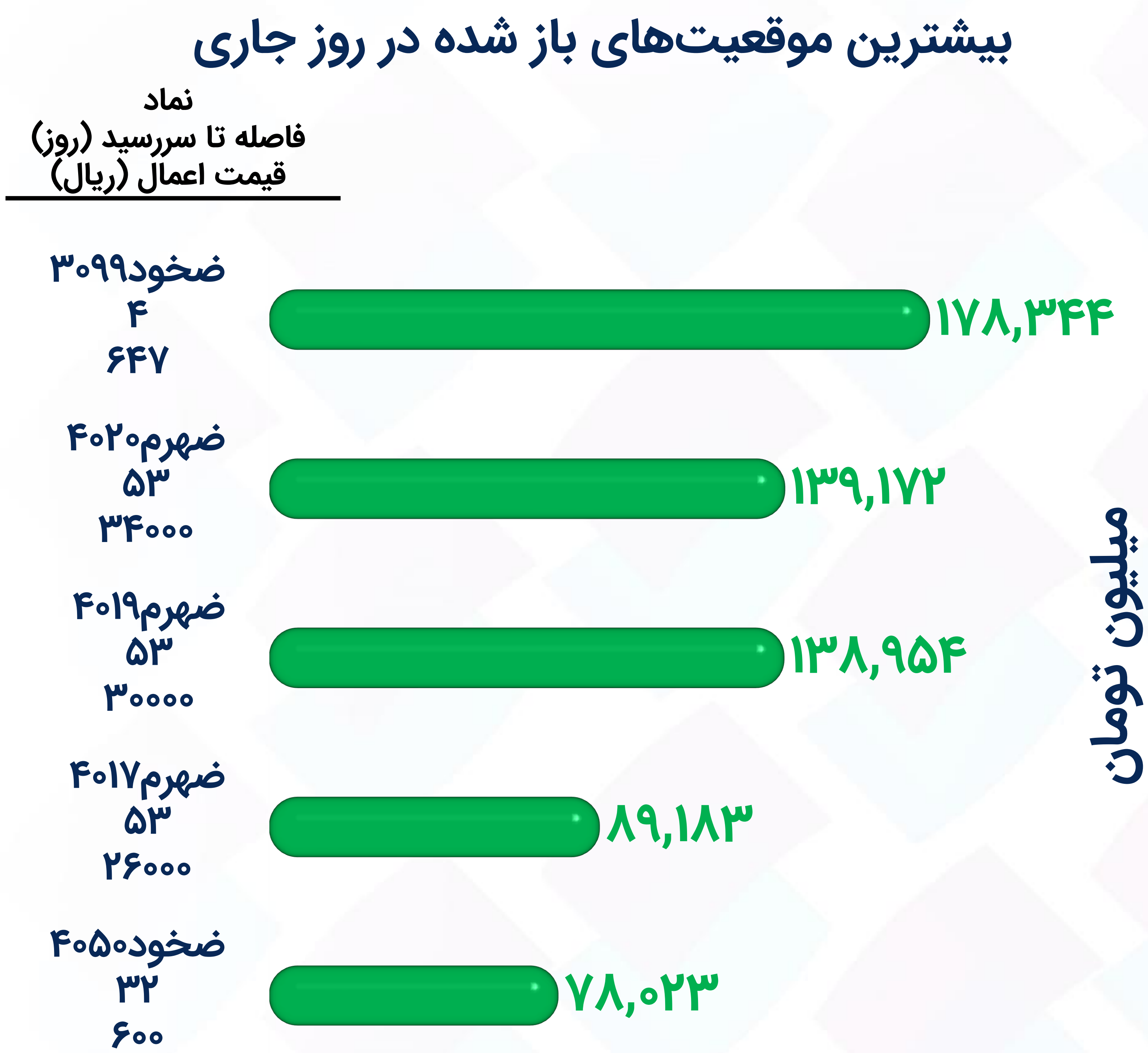
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طجار ۴۰۱۲	وتجارت	۲۰۰	۴۶	۲.۱	۵۷۵	۵۸۲	-۳۷۵	(۱۶۴.۴%)	-۰.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۹۱	خودرو	۳۲۹	۴	۰.۰	۱	۶۱۰	۳۲۸	(۴۶.۲%)	۳۲۸.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۵۳	۰.۰	۲	۵۰۲	۱۹۸	(۶۰.۶%)	۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۹۲	خودرو	۳۵۳	۴	۰.۰	۱	۶۱۰	۳۵۲	(۴۲.۳%)	۳۵۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۵۳	۰.۵	۵۰	۲۸,۹۹۰	۱۴,۹۵۰	(۴۸.۴%)	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.



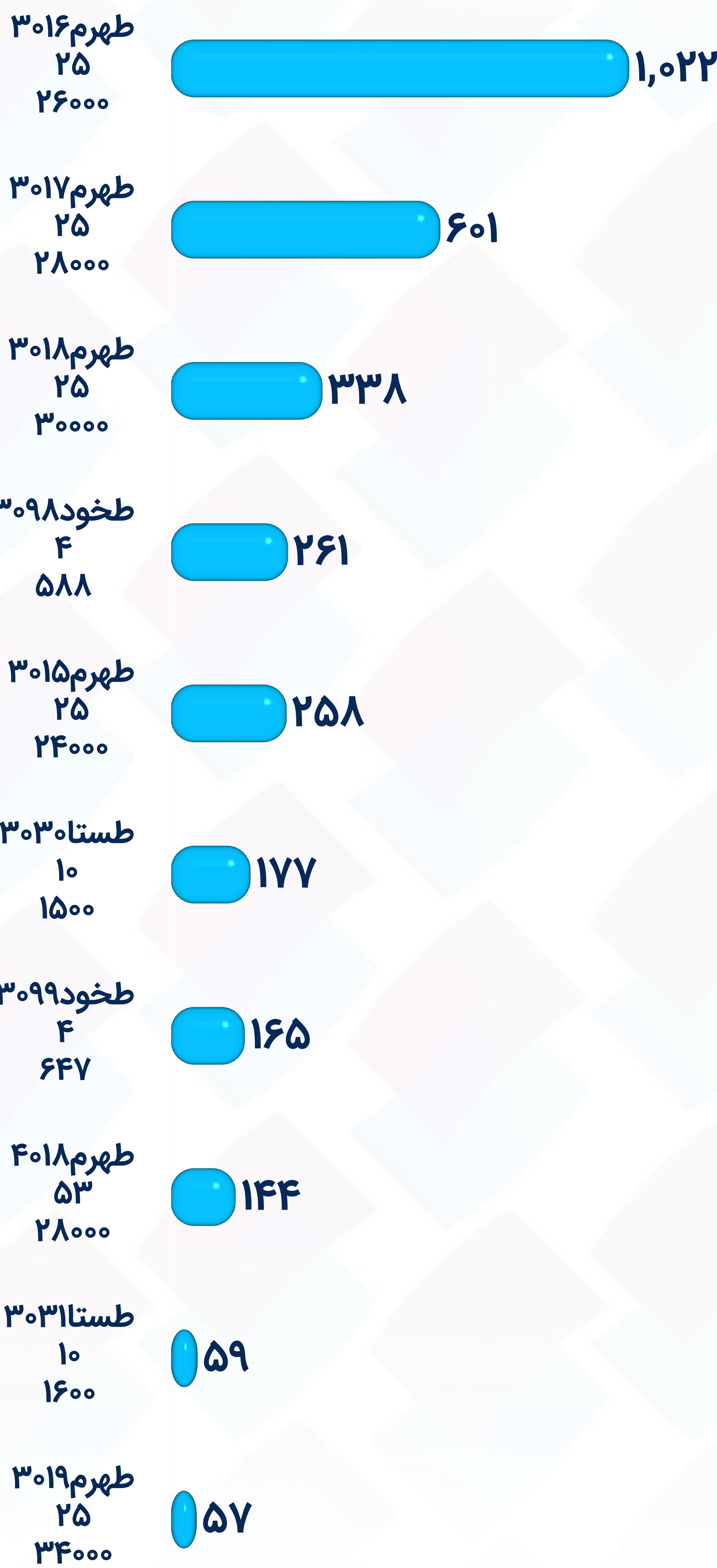
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

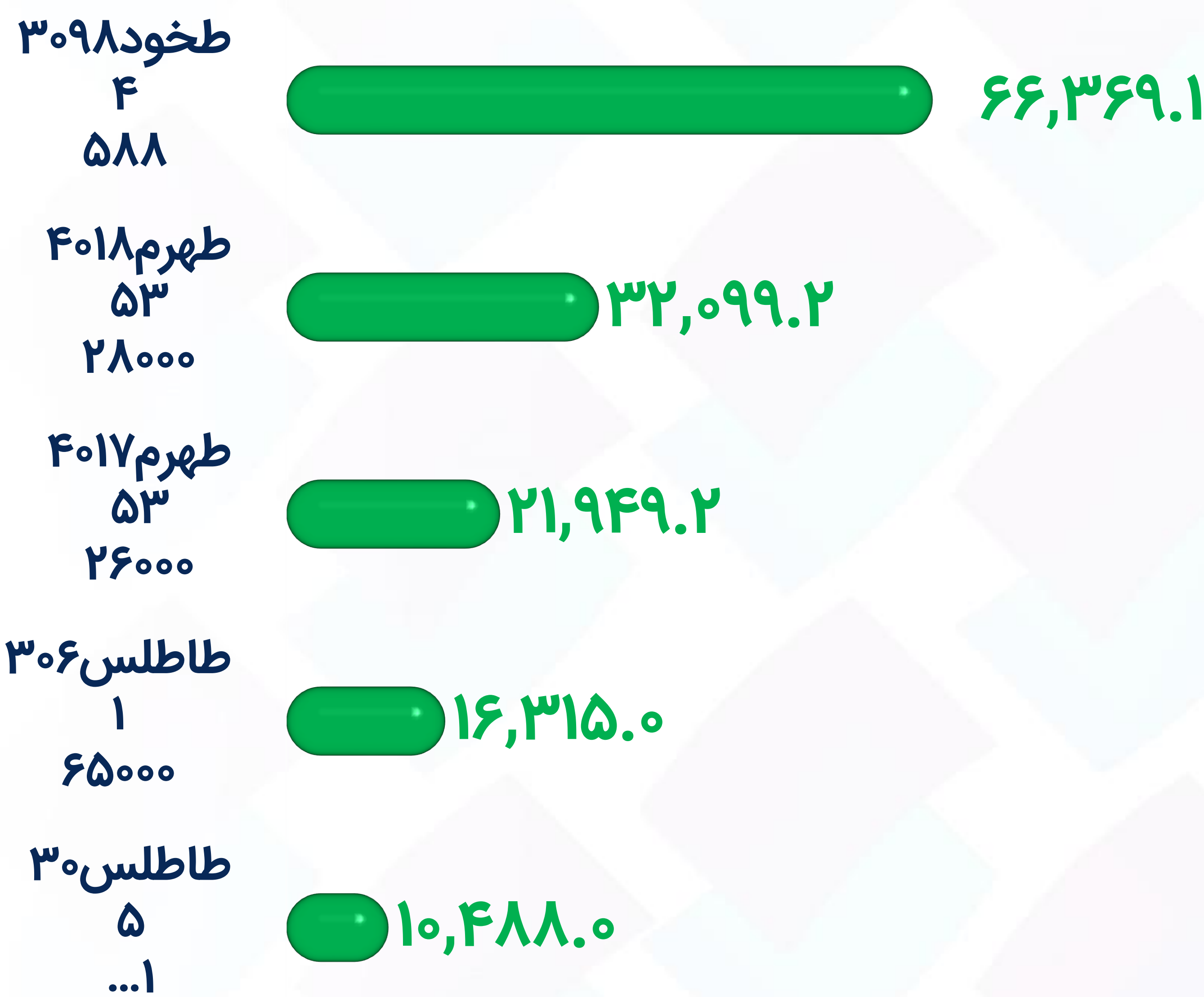
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

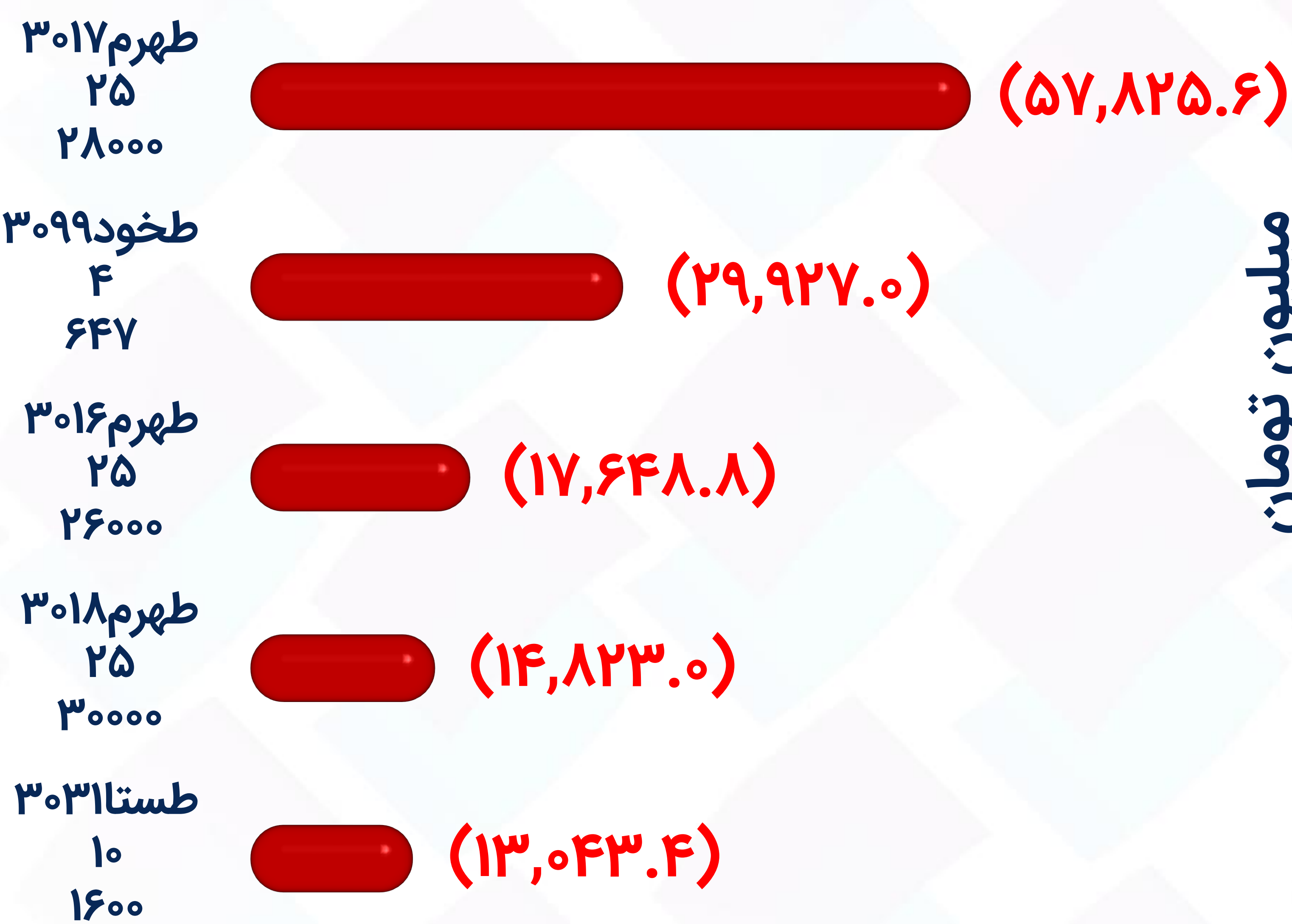
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

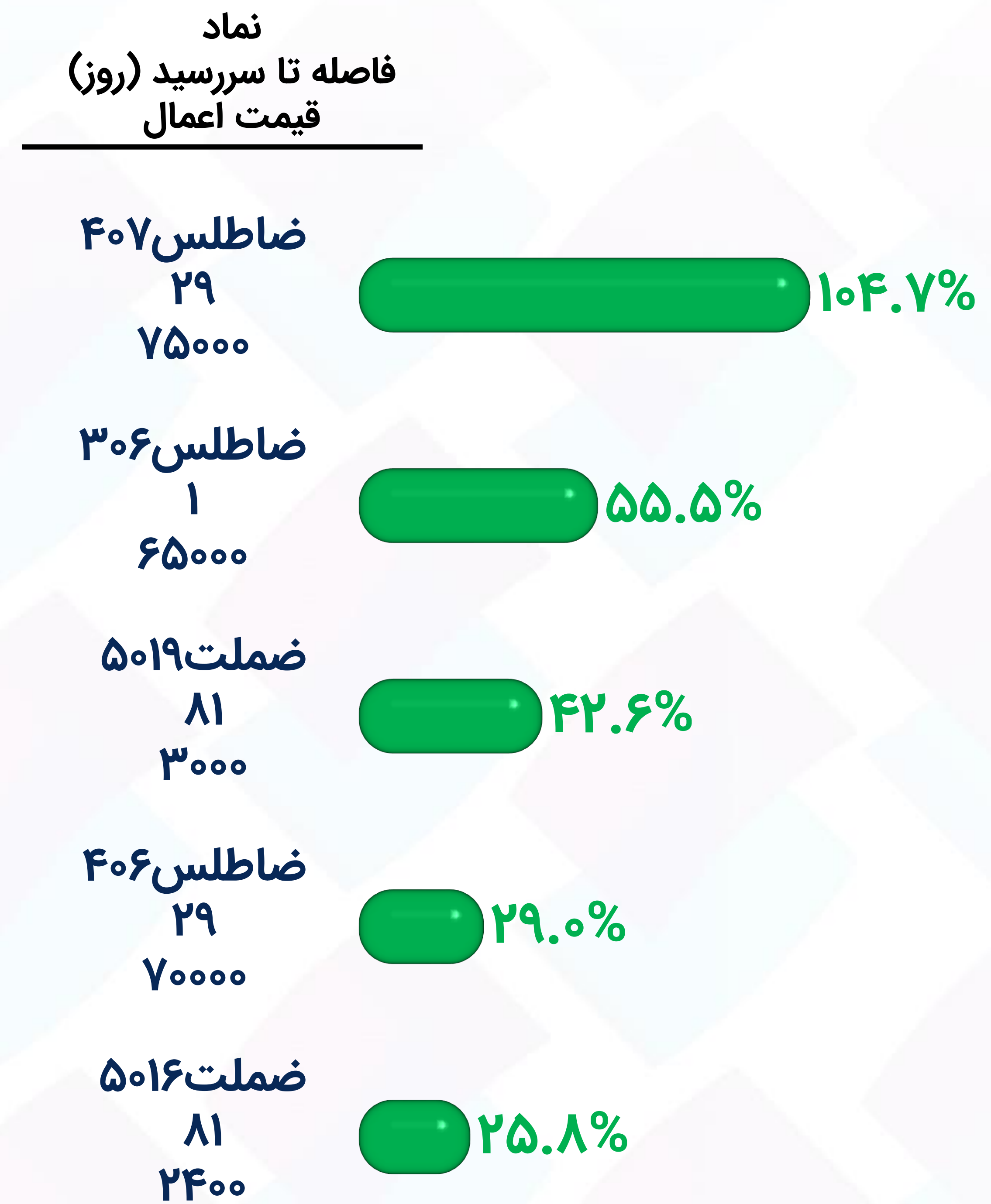
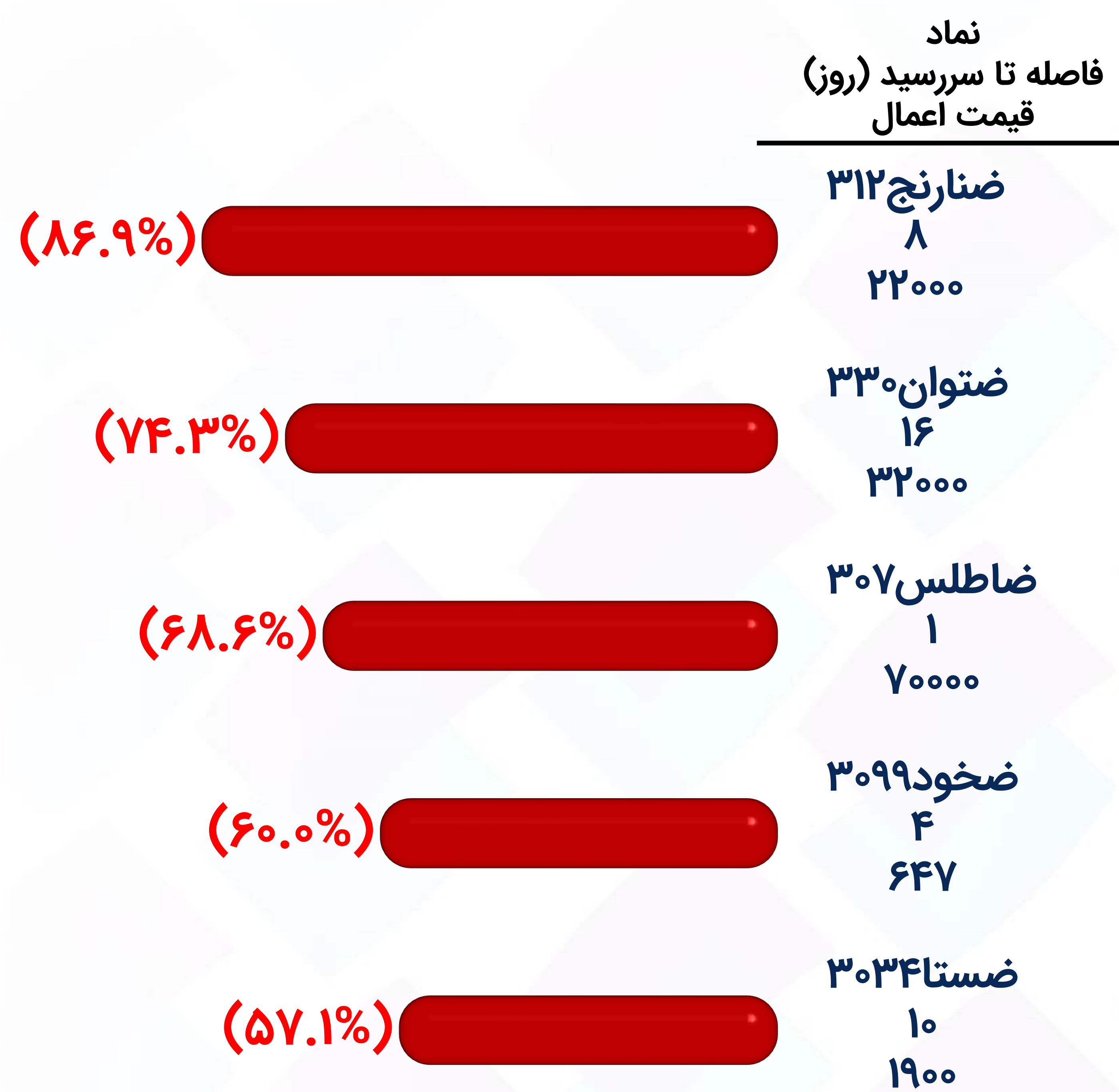
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



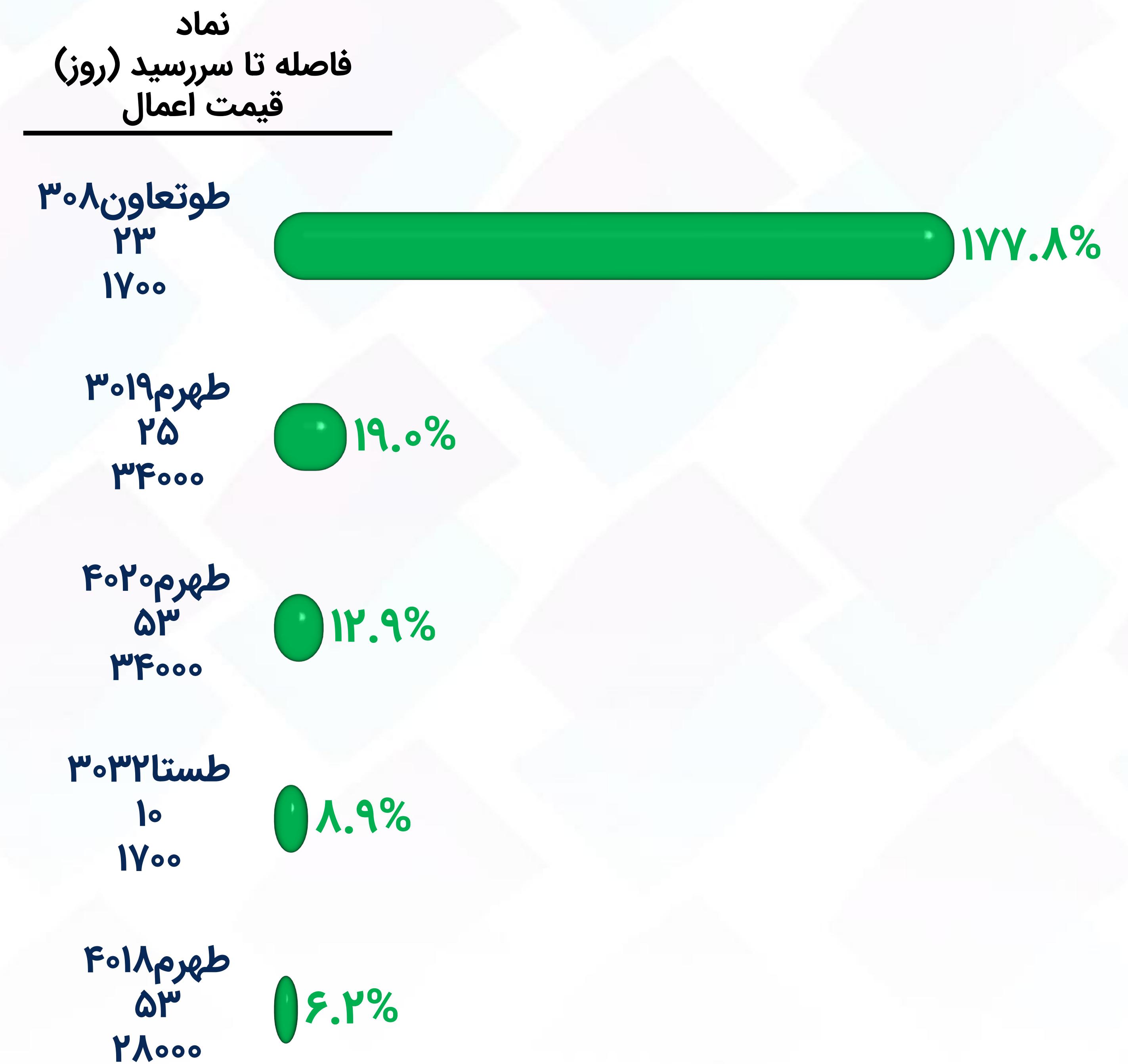
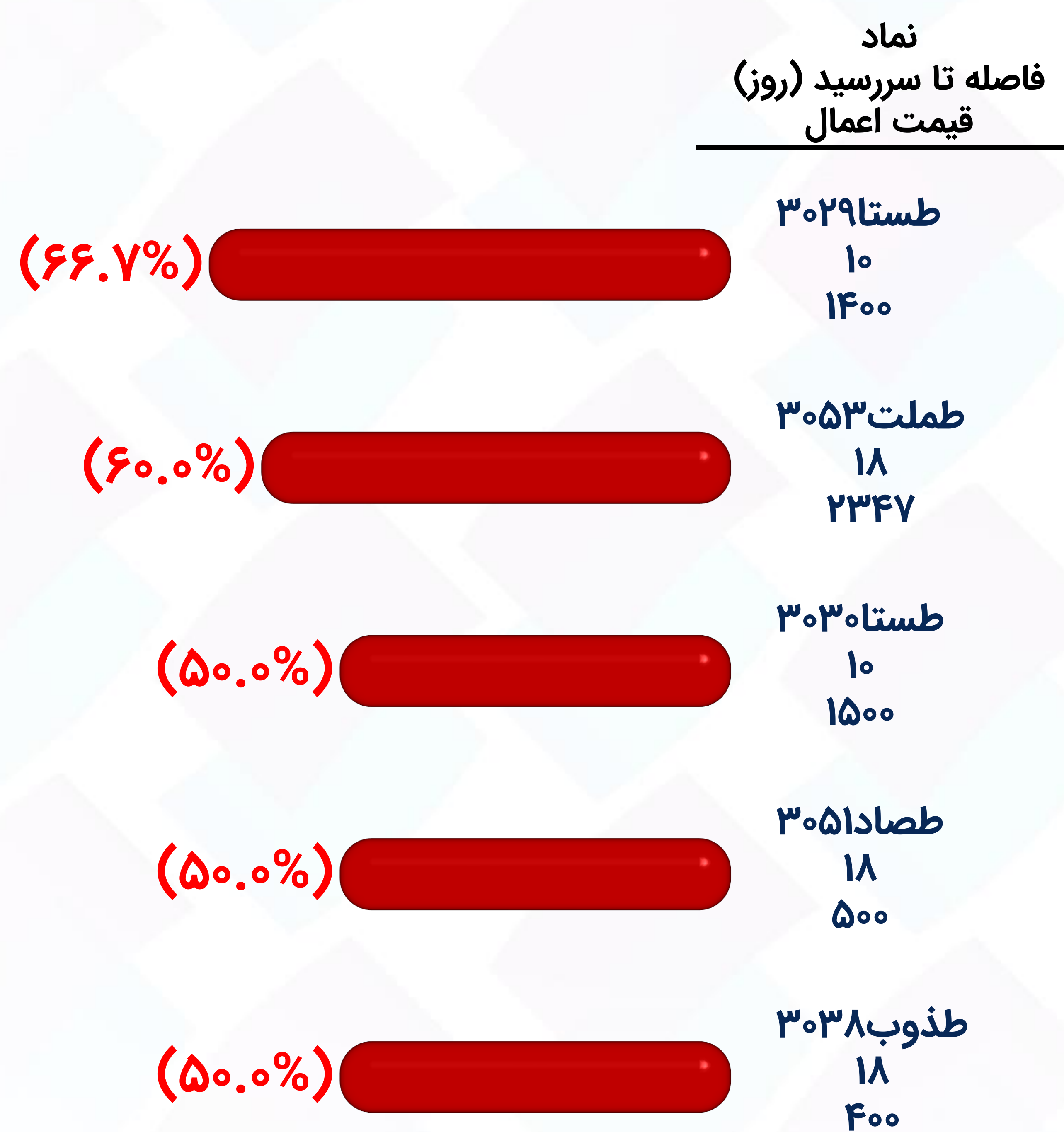
میلیون تومان

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.