

شماره
۴۸۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۴ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





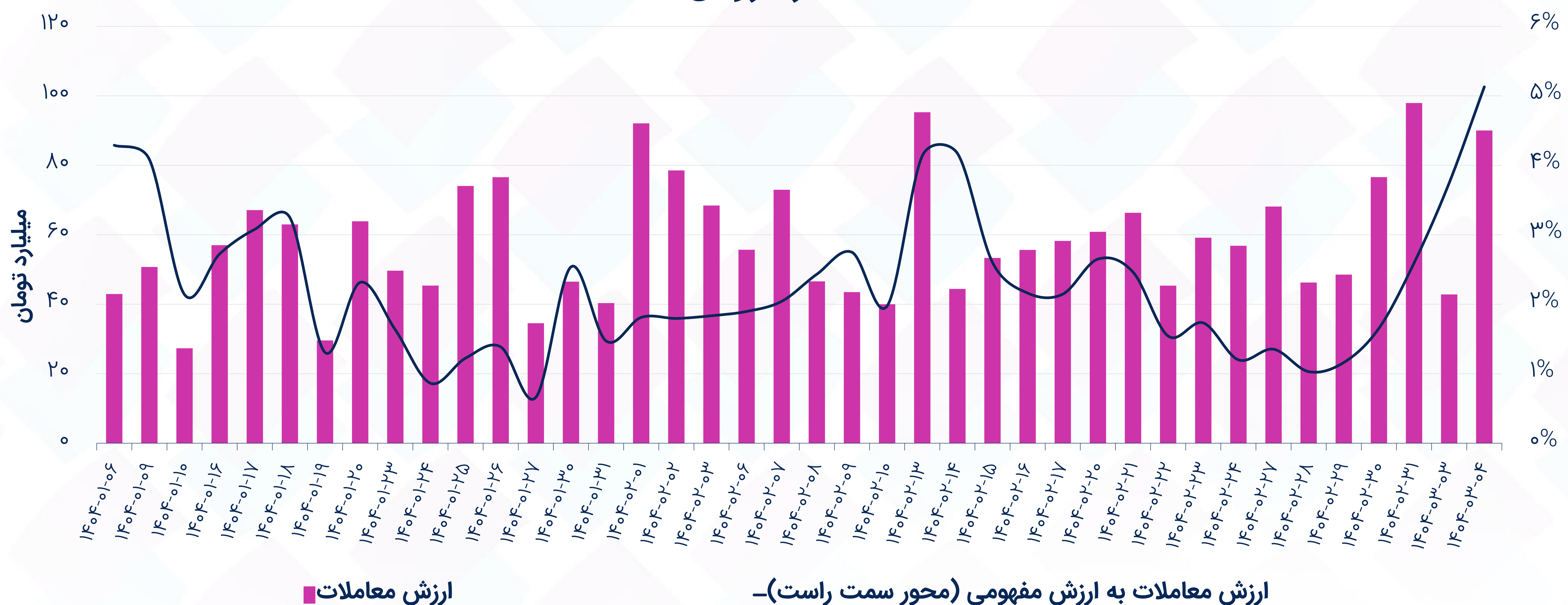
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



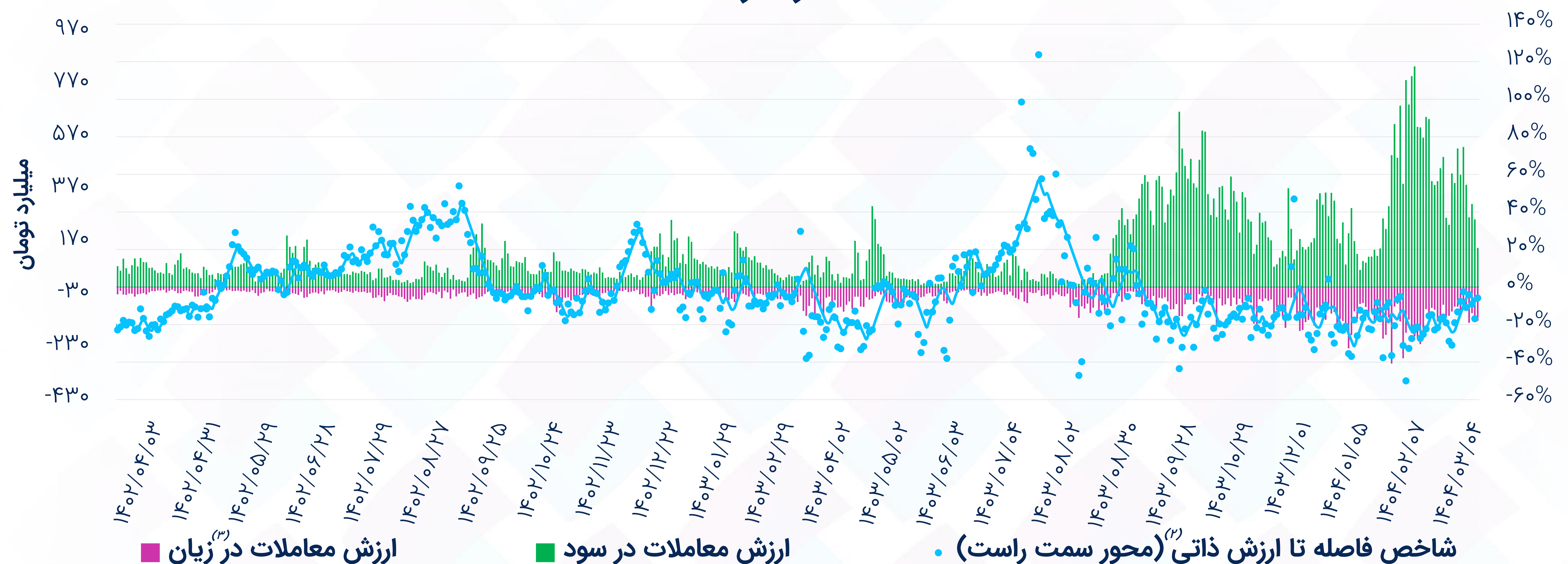
اختیار فروش



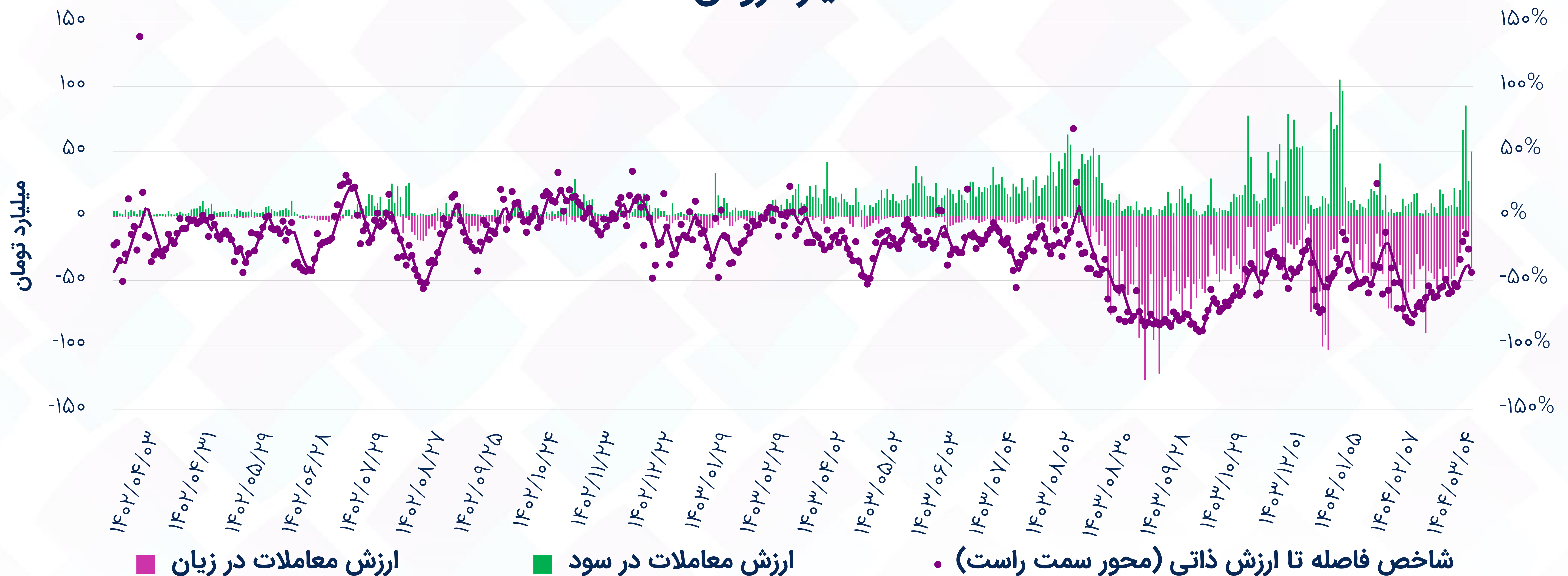
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

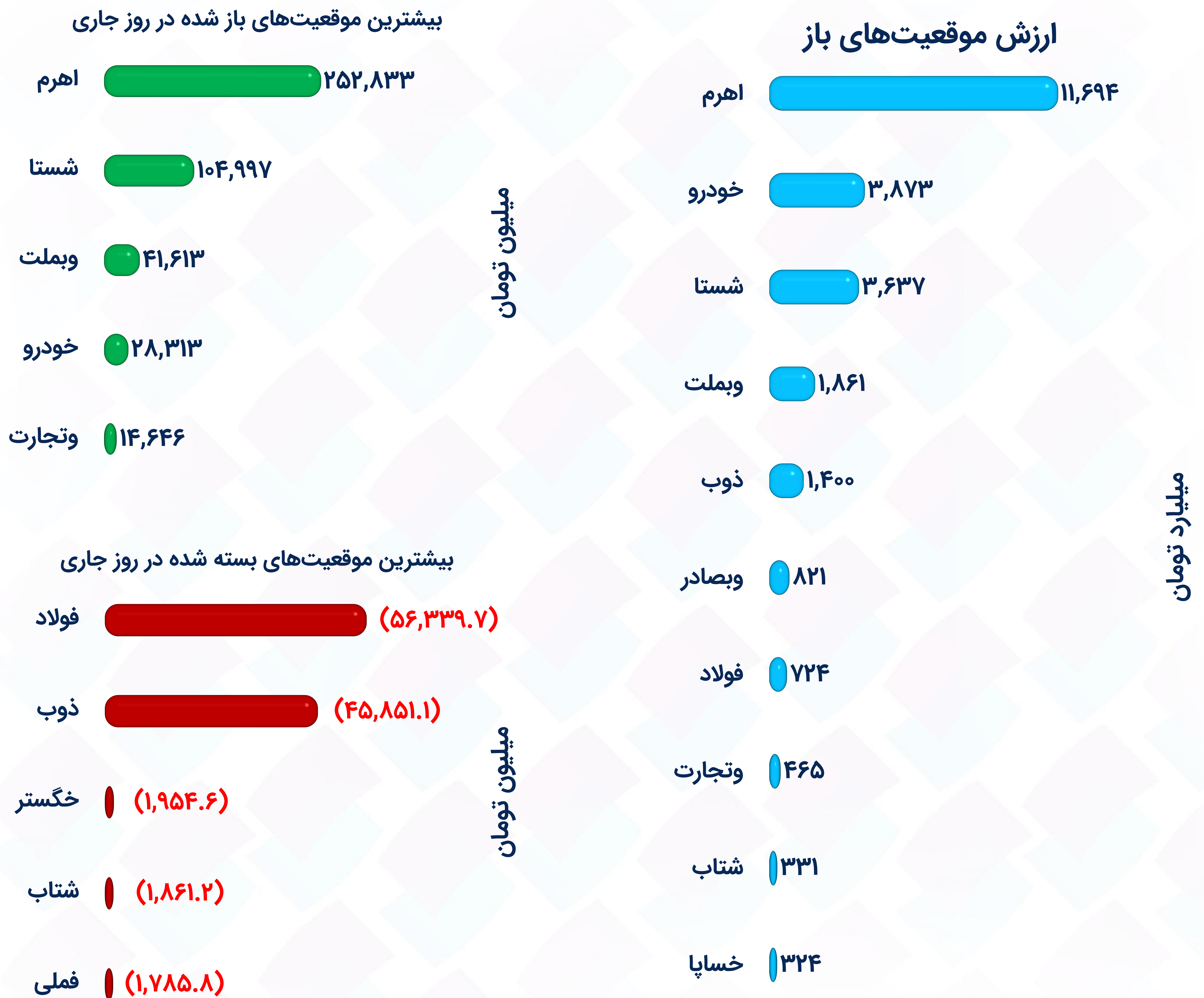
اختیار خرید

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	۱۶۳.۰	۲,۴۱۷.۳	۷۵.۶	۸۷.۴	(۳۱.۷%)
شستا	۴۷	۳۵.۶	۱,۴۷۸.۳	۱۶.۳	۱۹.۳	۱.۷%
خودرو	۲۵	۲۸.۸	۲,۰۸۳.۱	۲۳.۶	۵.۲	۱۳۸.۶%
ذوب	۲۷	۱۸.۳	۲۳۶.۹	۱۱.۸	۶.۵	(۱۱.۶%)
وبصادر	۱۷	۸.۲	۱۳۷.۲	۷.۲	۱.۰	(۰.۷%)
وبملت	۲۹	۷.۲	۲۴۲.۵	۴.۱	۳.۱	(۲۴.۱%)
وتجارت	۱۶	۳.۷	۳۹.۱	۲.۰	۱.۷	(۳۰.۵%)

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
خودرو	۱۰	۴۰,۶۵۶.۵	۴۳۰,۷۰۲.۲	۳۲,۵۶۲.۹	۸,۰۹۳.۶	(۳۵.۱%)
اهرم	۲۲	۳۸,۲۷۵.۰	۹۰۲,۹۳۹.۳	۷,۴۷۲.۱	۳۰,۸۰۲.۹	(۵۴.۰%)
شستا	۱۱	۱۰,۸۰۱.۶	۳۹۵,۵۰۲.۹	۹,۳۴۹.۷	۱,۴۵۱.۸	(۴۰.۵%)
وبملت	۱۳	۹۶.۷	۴,۲۴۹.۰	۸۰.۷	۱۶.۰	(۳۱.۰%)
اطلس	۲	۷۴.۰	۱۴,۷۴۲.۹	۷۳.۸	۰.۲	(۲۶.۷%)
وبصادر	۳	۵۱.۹	۵,۰۱۵.۸	۰.۰	۵۱.۹	(۶۹.۲%)
وتعاون	۱	۲۶.۵	۱,۰۰۳.۶	۲۶.۵	۰.۰	۲۳۰.۳%

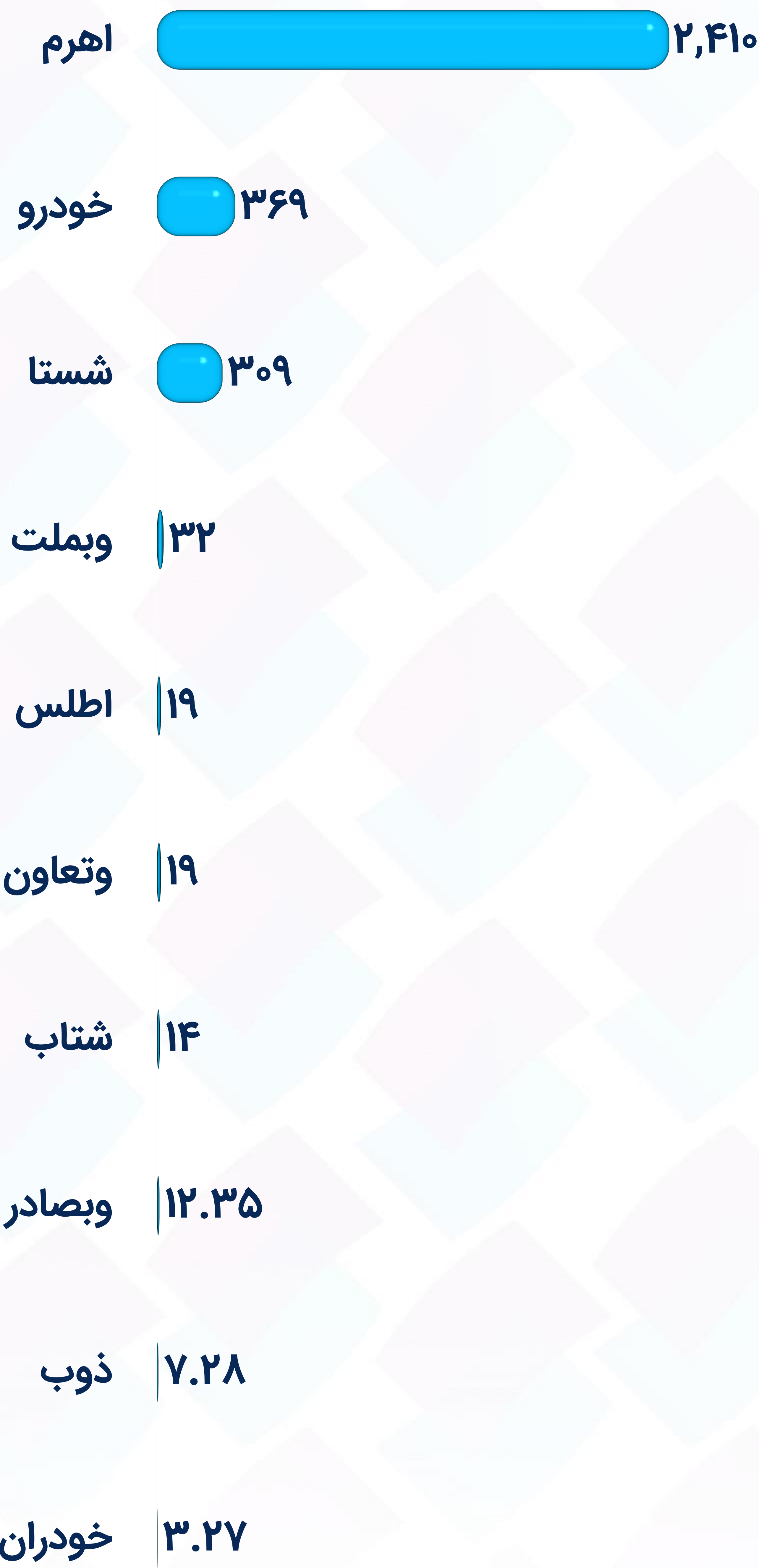
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

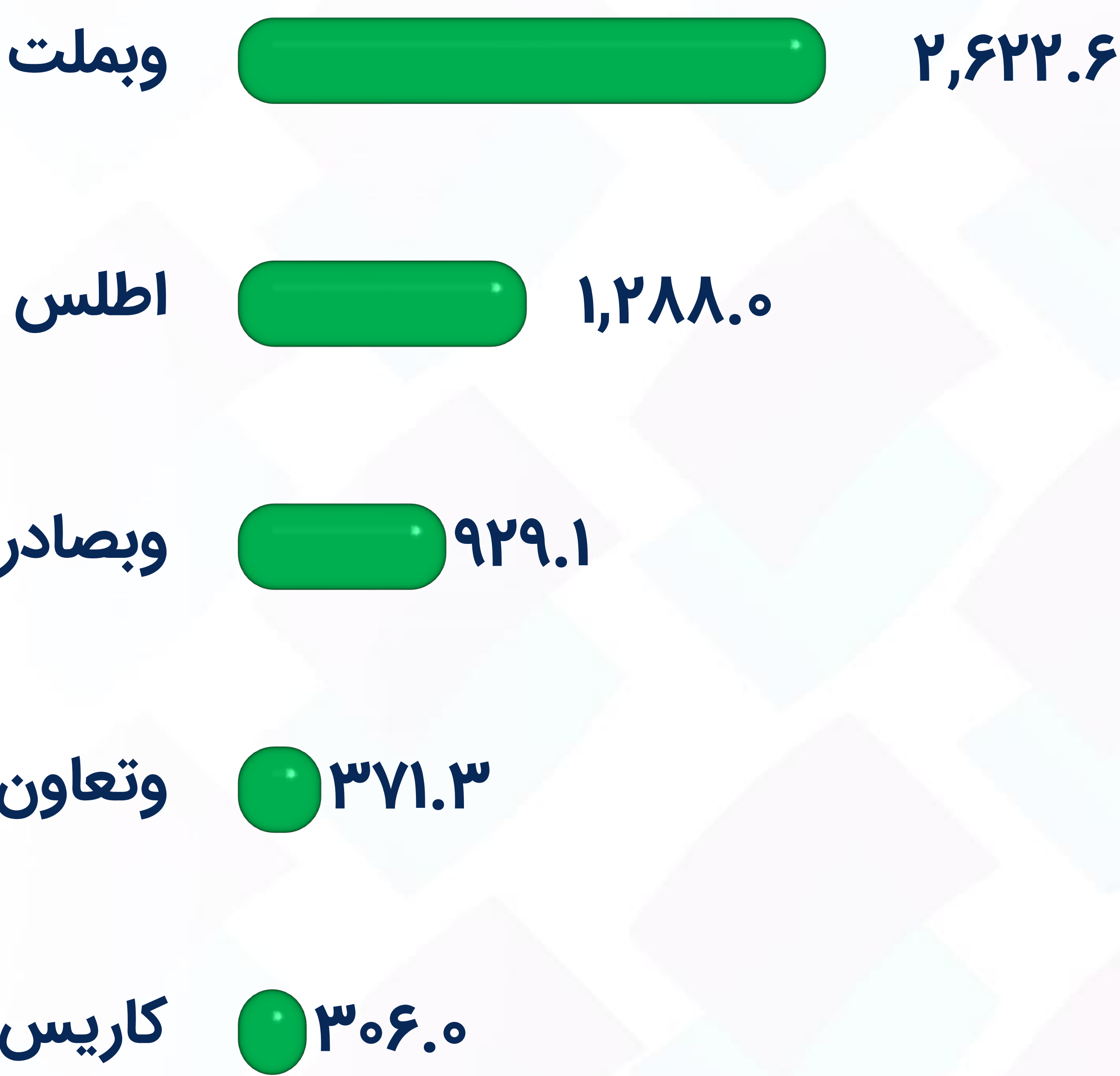
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



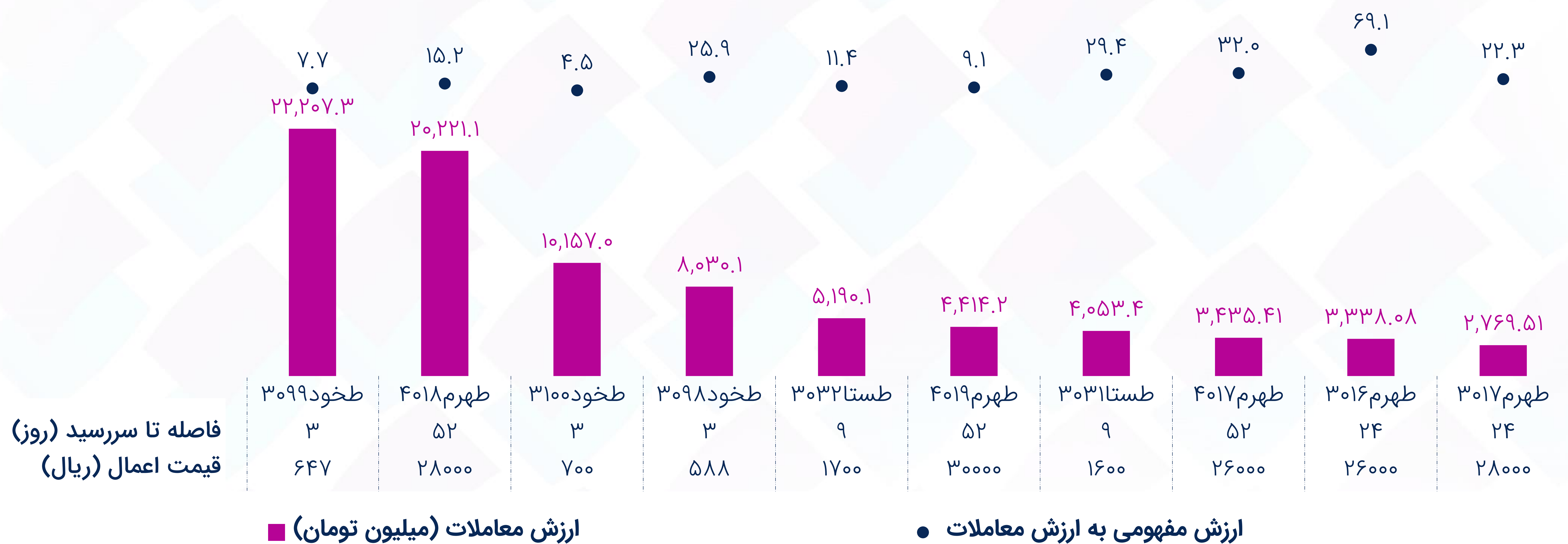
میلیون تومان

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
ضفصبا ۵۱۲	فصبا	۲,۴۰۰	۶۳	۱.۸	۹	۳,۰۴۰	۲,۴۰۹	(۲۰.۸%)	۲۶۷.۷	۱.۰۰	۷۷۶	۸۵۲۶%
ضخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۳	۷,۰۲۹.۳	۵	۵۹۵	۵۹۳	(۰.۳%)	۱۱۸.۶	۰.۶۲	۲۱	۳۲۷%
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۲۴	۴۶۲.۵	۷	۵۴۱	۶۱۰	۱۲.۸%	۸۷.۱	۰.۳۶	۲۲	۲۱۲%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۲۴	۴۵۵.۴	۱۶	۵۴۱	۵۵۹	۳.۳%	۳۴.۹	۰.۵۸	۴۵	۱۸۰%
ضخود ۳۰۹۹	خودرو	۶۴۷	۳	۱,۵۳۱.۳	۱	۵۹۵	۶۴۸	۸.۹%	۶۴۸.۰	۰.۱۳	۲	۱۴۳%

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	۹	۶.۳	۱	۳,۸۳۸	۶,۴۸۱	۶۹%	۶,۴۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۷	۲۴.۵	۲	۶۴۵	۱,۰۰۲	۵۵%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۹	۱۳.۰	۱	۱,۵۹۰	۲,۲۰۱	۳۸%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۴۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۵۲	۱.۲	۱۰	۴۹۰	۱,۰۱۰	۱۰۶%	۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۹	۱۶.۸	۳	۳,۸۳۸	۵,۰۴۳	۳۱%	۱,۶۸۱.۰	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 ۳۰۹	وتعاون	۱,۸۰۰	۲۲	۲۶.۵	۴۳	۱,۶۲۸	۱,۷۵۷	۷.۹%	۴۰.۹	-۰.۸۹	۱۴۲	۲۳۰.۳%
طذوب ۳۰۴۰	ذوب	۶۰۰	۱۷	۲.۰	۱۰۲	۴۹۰	۴۹۸	۱.۶%	۴.۹	-۰.۹۹	۱۰۰	(۲.۰%)
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۲۴	۱۲.۴	۱۳,۷۹۹	۲۸,۲۶۰	۲۸,۲۰۱	(۰.۲%)	۲.۰	-۱.۰۰	۱۲,۷۹۴	(۷.۳%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۲	۱۴۱.۵	۱۳,۰۹۸	۲۸,۲۶۰	۲۸,۹۰۲	۲.۳%	۲.۲	-۰.۹۹	۱۱,۷۶۲	(۱۰.۲%)
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۳	۱۱.۷	۲۲۶	۵۹۵	۵۷۴	(۳.۵%)	۲.۵	-۱.۰۰	۲۰۰	(۱۱.۳%)

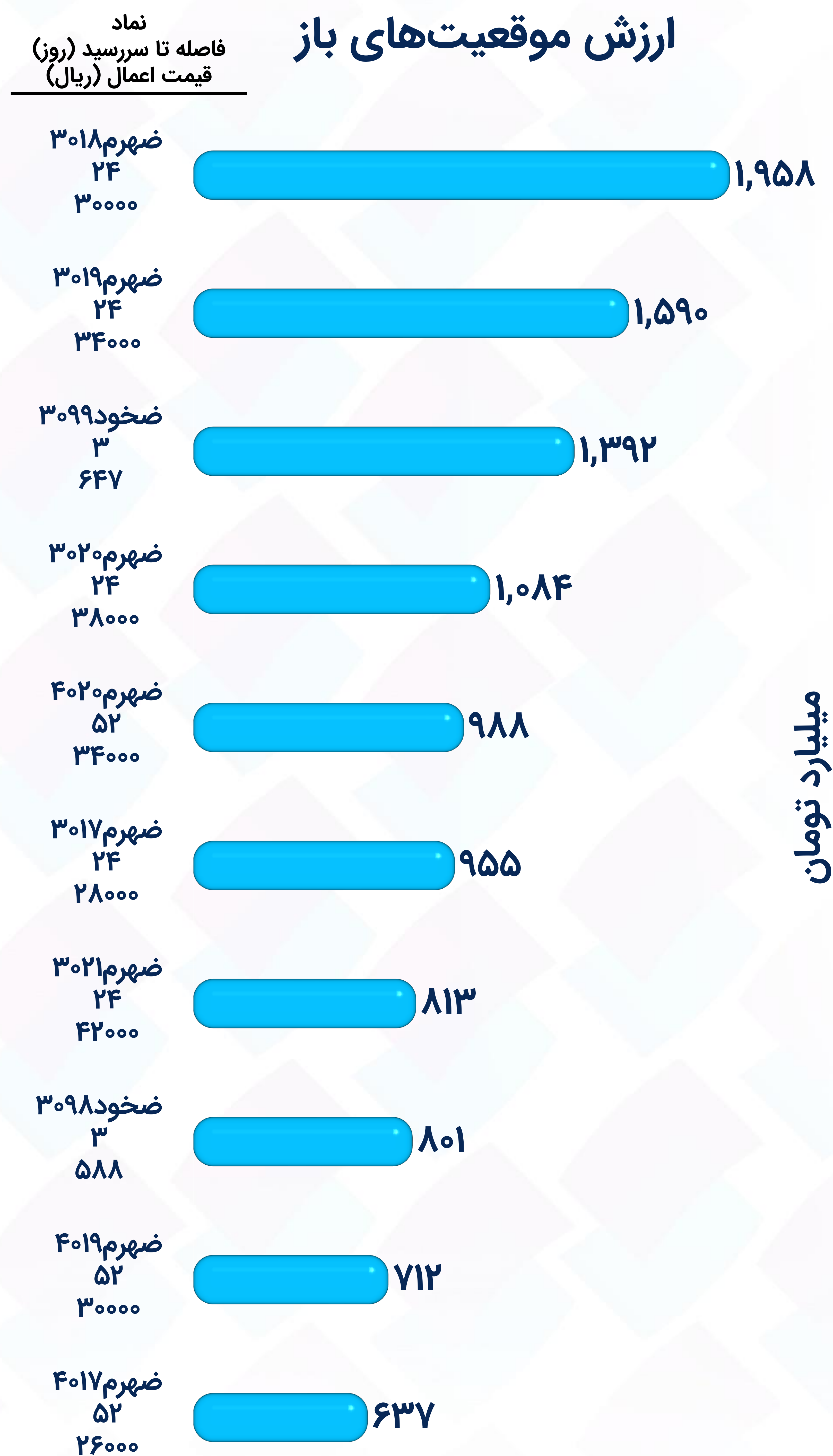
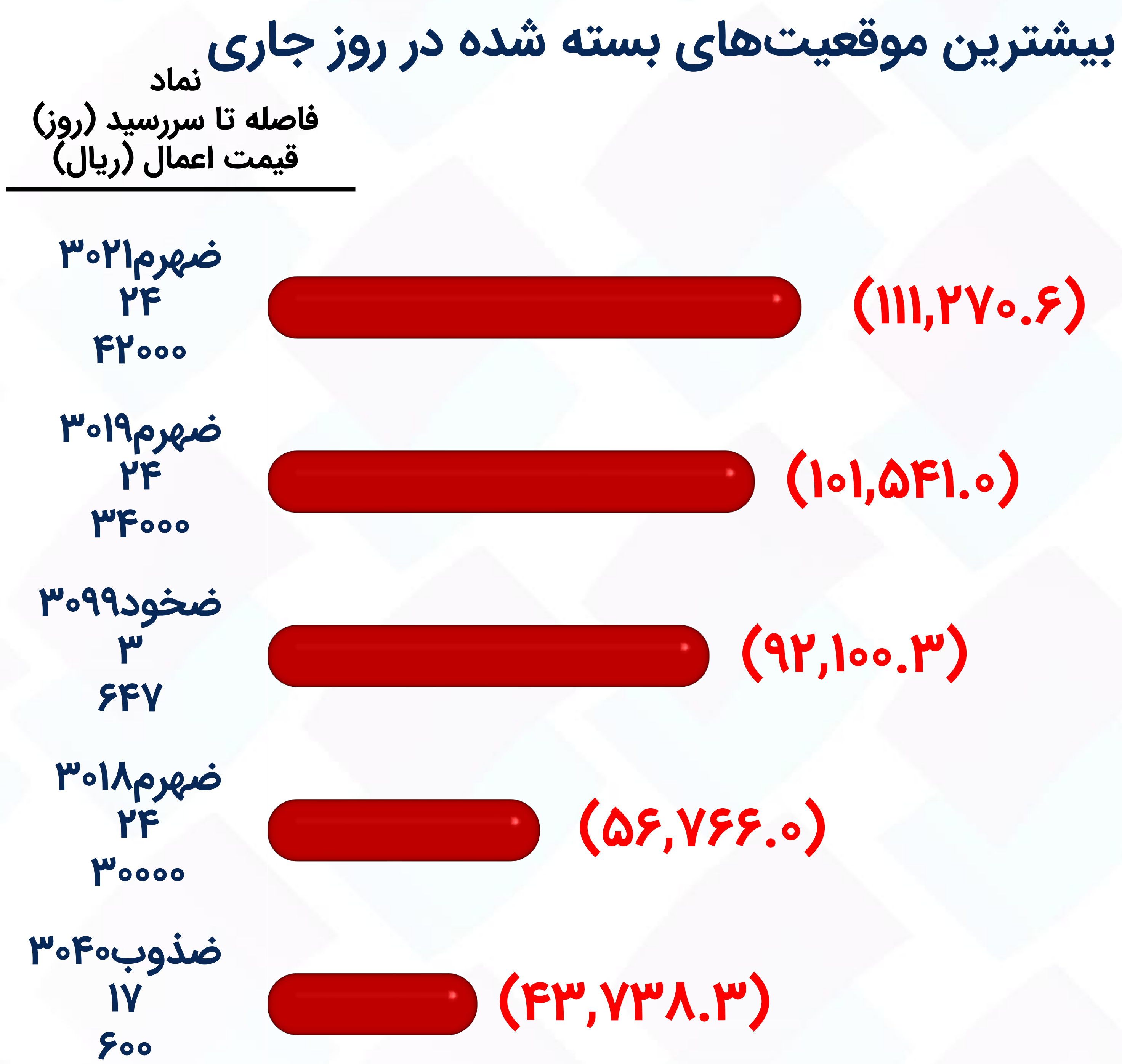
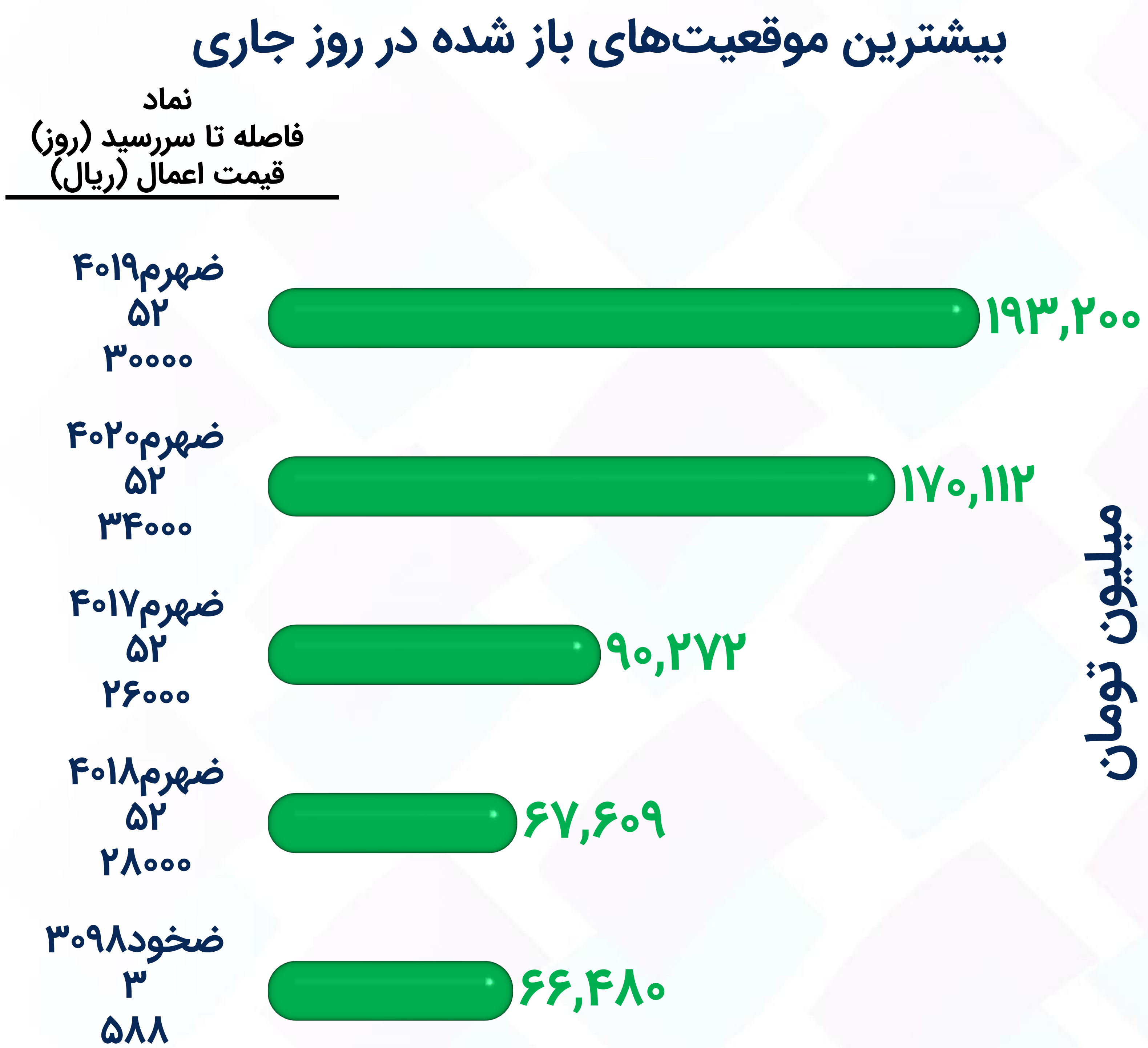
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۵۲	۰.۰	۲	۴۹۰	۱۹۸	(۵۹.۶%)	۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۱۷	۰.۲	۱	۶۴۵	۳۹۹	(۳۸.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۹۴	خودرو	۴۱۲	۳	۰.۰	۱	۵۹۵	۴۱۱	(۳۰.۹%)	۴۱۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۵۲	۰.۷	۷۳	۲۸,۲۶۰	۱۴,۹۲۷	(۴۷.۲%)	۲۰۴.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۱۷	۰.۰	۱	۲,۵۸۶	۱,۹۰۶	(۲۶.۳%)	۱,۹۰۶.۰	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

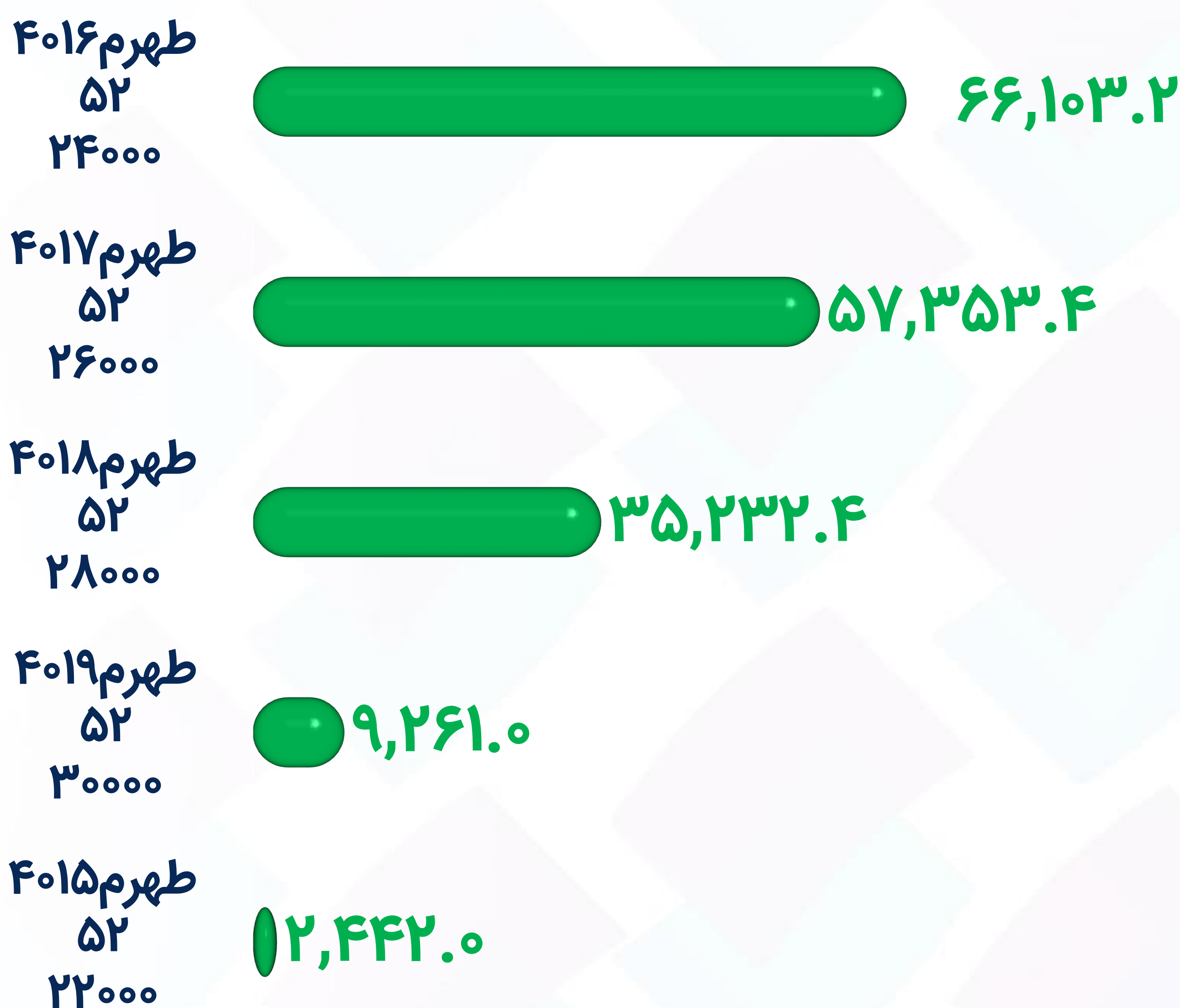
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

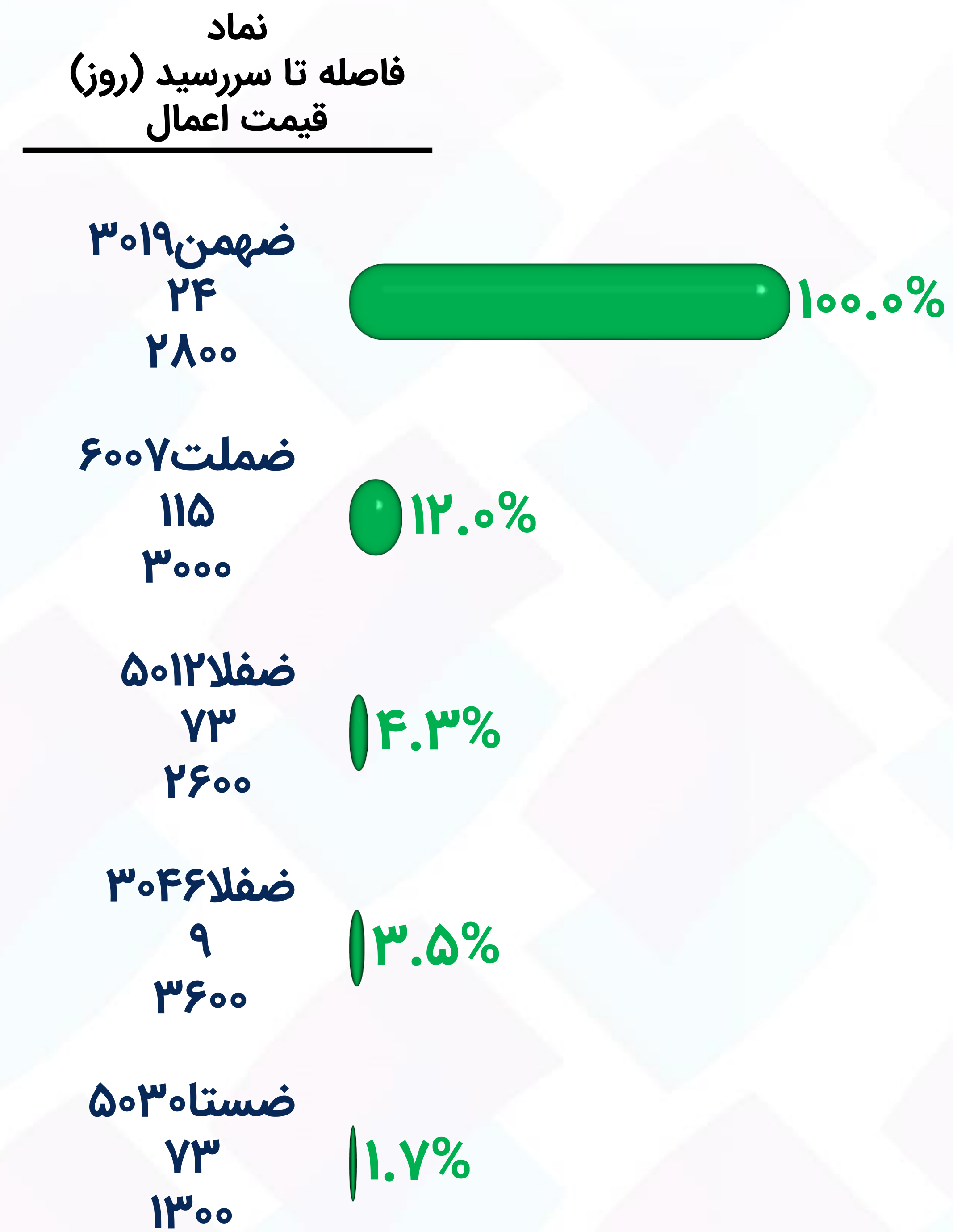
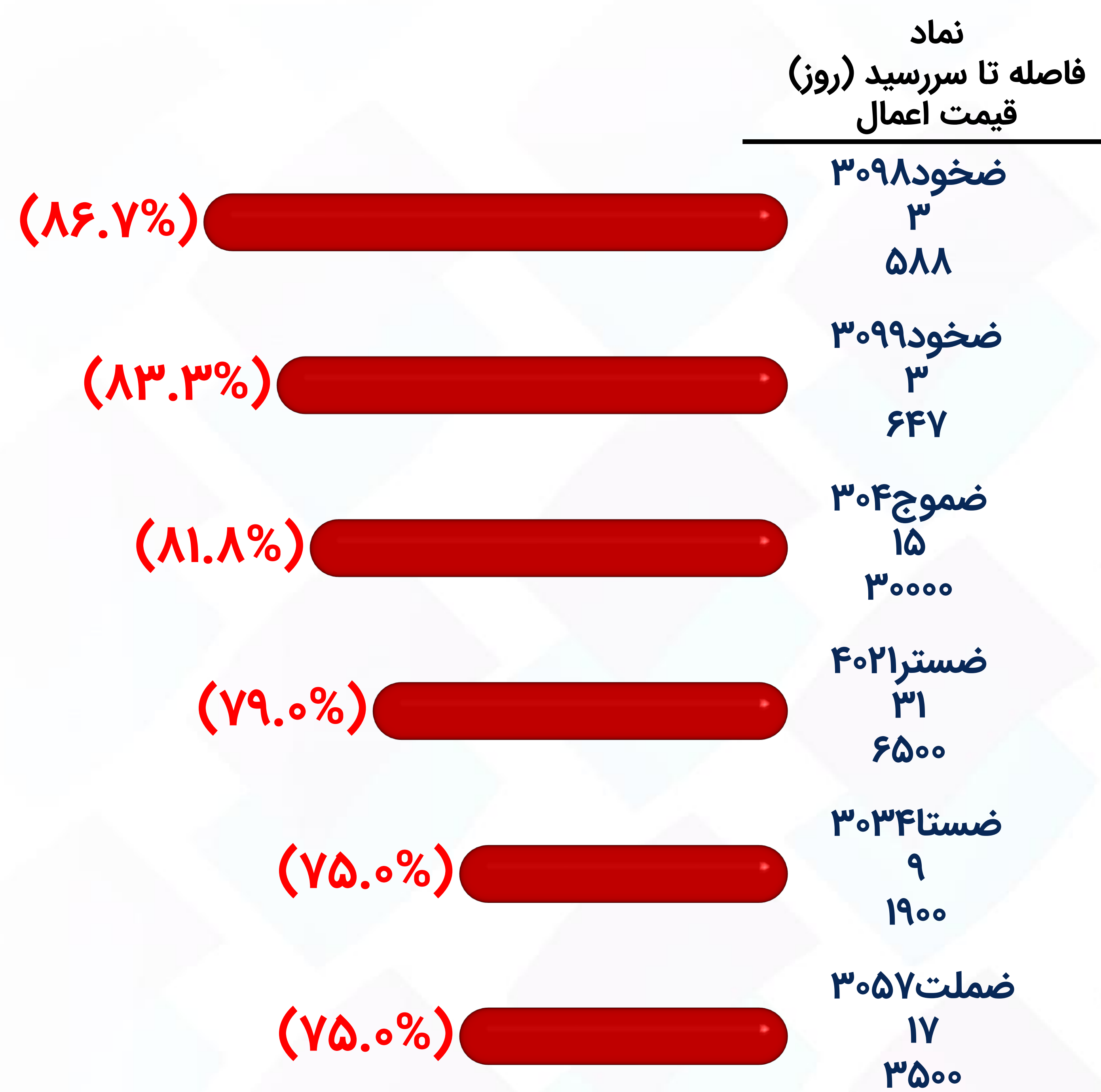
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



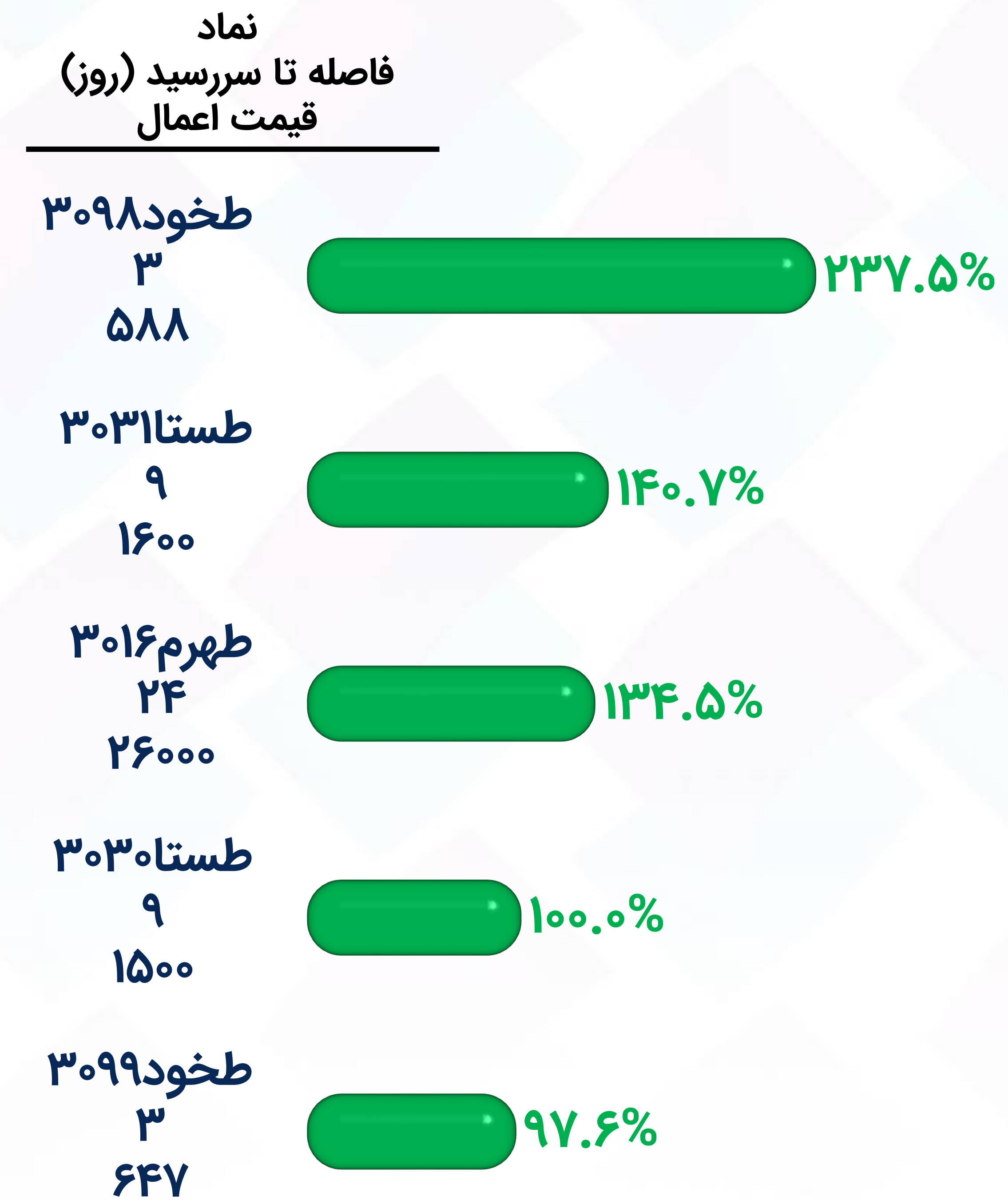
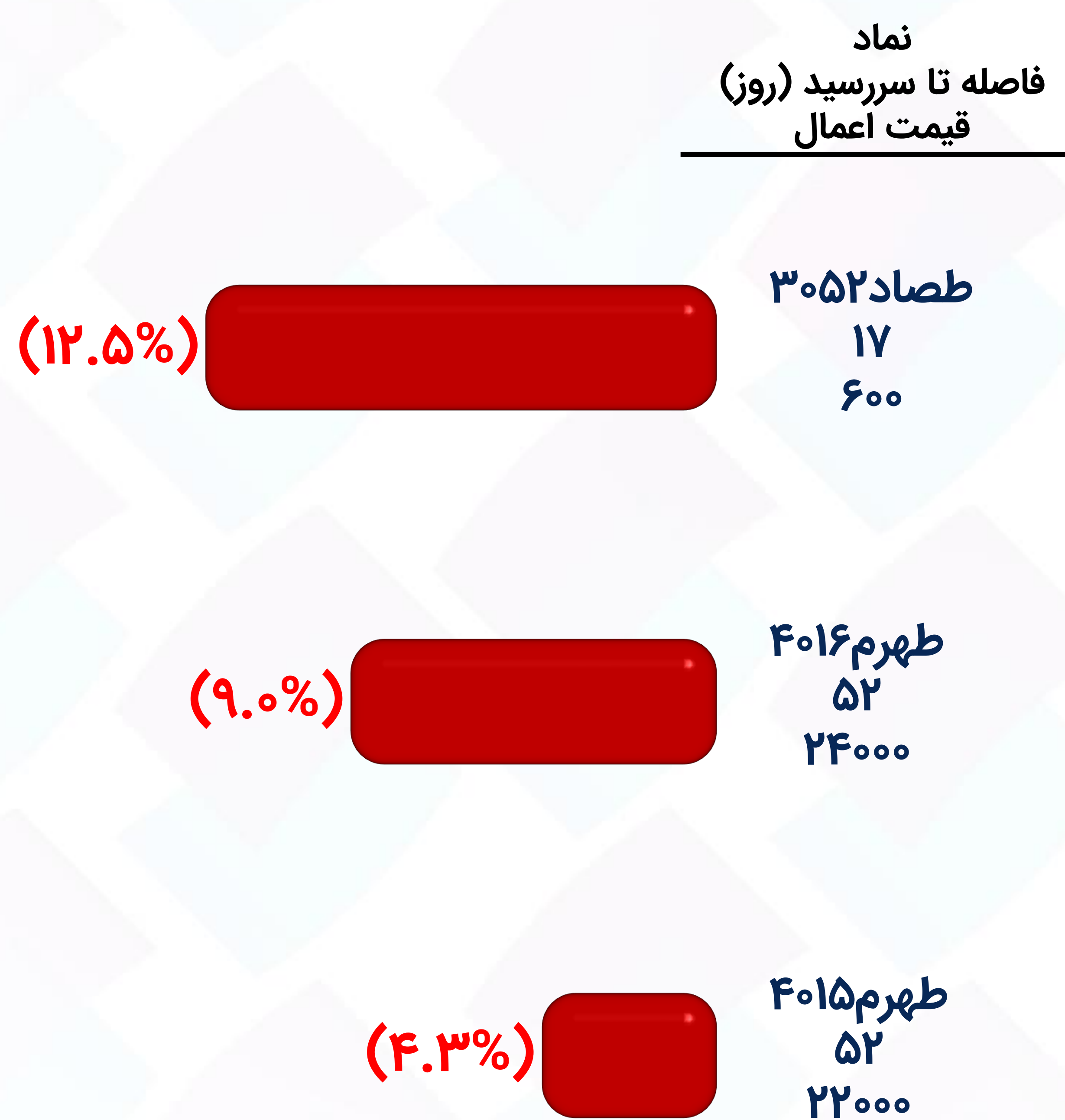
میلیون تومان

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.