

شماره
۴۸۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۵ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





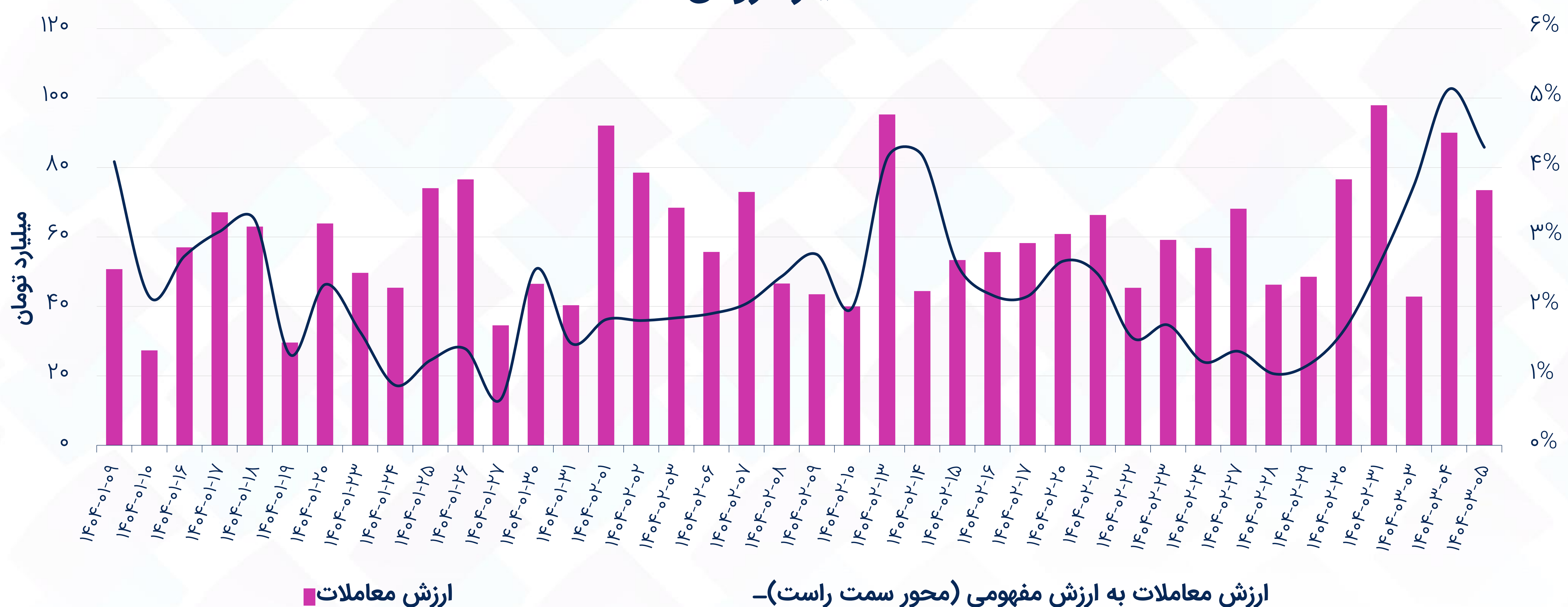
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



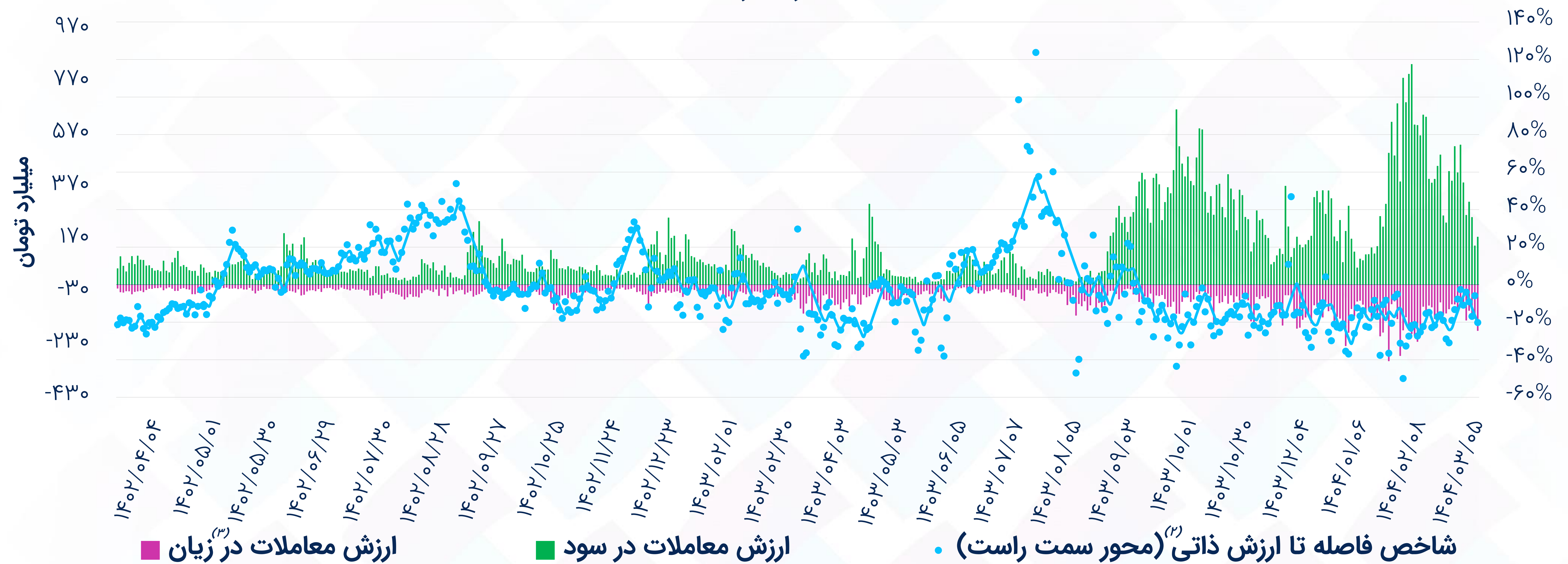
اختیار فروش



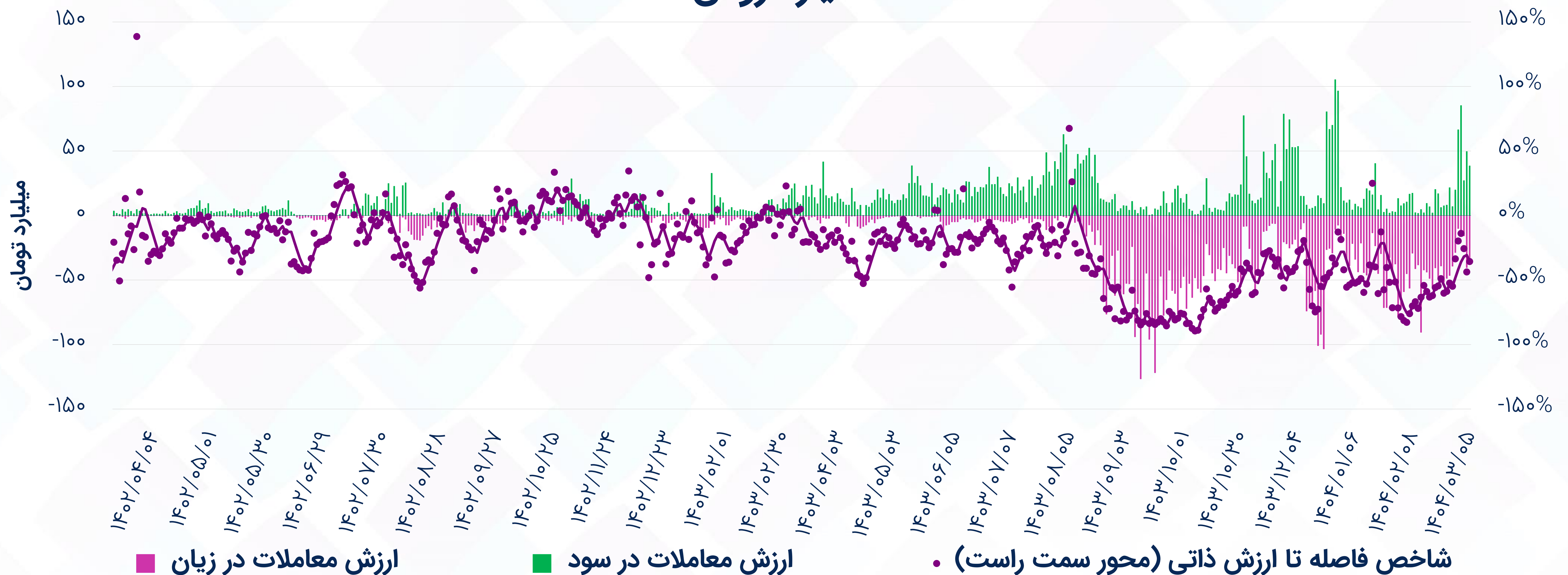
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۶	۲۱۶.۴	۳,۰۳۱.۸	۸۸.۴	۱۲۸.۰	(۳۳.۱%)
خودرو	۲۸	۴۵.۴	۱,۳۷۸.۵	۳۰.۲	۱۵.۲	۲۴.۲%
شستا	۴۶	۳۹.۷	۱,۳۴۹.۹	۲۲.۲	۱۷.۶	(۹.۵%)
ذوب	۲۸	۱۳.۴	۱۴۹.۸	۸.۳	۵.۱	(۲۳.۳%)
وبملت	۲۶	۱۱.۷	۲۸۷.۰	۱۰.۰	۱.۶	(۱۳.۵%)
وبصادر	۱۸	۱۱.۱	۱۴۳.۹	۱۰.۱	۱.۱	(۱۱.۳%)
وتجارت	۱۳	۵.۶	۶۶.۵	۳.۲	۲.۴	(۳۰.۱%)

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	۱۹	۴۰,۷۴۱.۳	۱,۰۴۷,۲۳۵.۹	۶,۸۱۵.۷	۳۳,۹۲۵.۶	(۴۹.۸%)
خودرو	۱۱	۲۶,۴۹۹.۵	۳۶۵,۲۶۴.۹	۲۶,۴۲۶.۹	۷۲.۶	(۱۳.۴%)
شستا	۹	۵,۹۳۷.۳	۲۷۸,۲۲۵.۶	۵,۱۳۰.۲	۸۰۷.۱	(۳۷.۲%)
وبملت	۹	۱۱۹.۴	۱۰,۹۸۱.۱	۰.۳	۱۱۹.۱	(۶۲.۴%)
خودران	۲	۵۳.۳	۵۰۲.۳	۵۳.۳	۰.۰	(۱۲.۴%)
وبصادر	۲	۴۹.۷	۵,۷۴۰.۷	۰.۰	۴۹.۷	(۷۷.۹%)
کاریس	۱	۴۱.۰	۱,۹۸۳.۳	۰.۰	۴۱.۰	(۷۷.۶%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۲,۶۱۵

شستا ۳۱۰

خودرو ۲۷۰

وبملت ۳۲

وتعاون ۱۹

وبصادر ۱۵

شتاب ۱۴

ذوب ۷.۲۹

خودران ۳.۲۱

کاریس ۲.۵۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۰۴,۴۴۴.۶

وبصادر ۲,۴۲۳.۷

کاریس ۱,۷۸۵.۰

فملی ۱,۲۶۹.۸

وبملت ۶۴۳.۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۹۸,۴۸۹.۴)

خودران (۵۴.۸)

وتعاون (۴۱.۳)

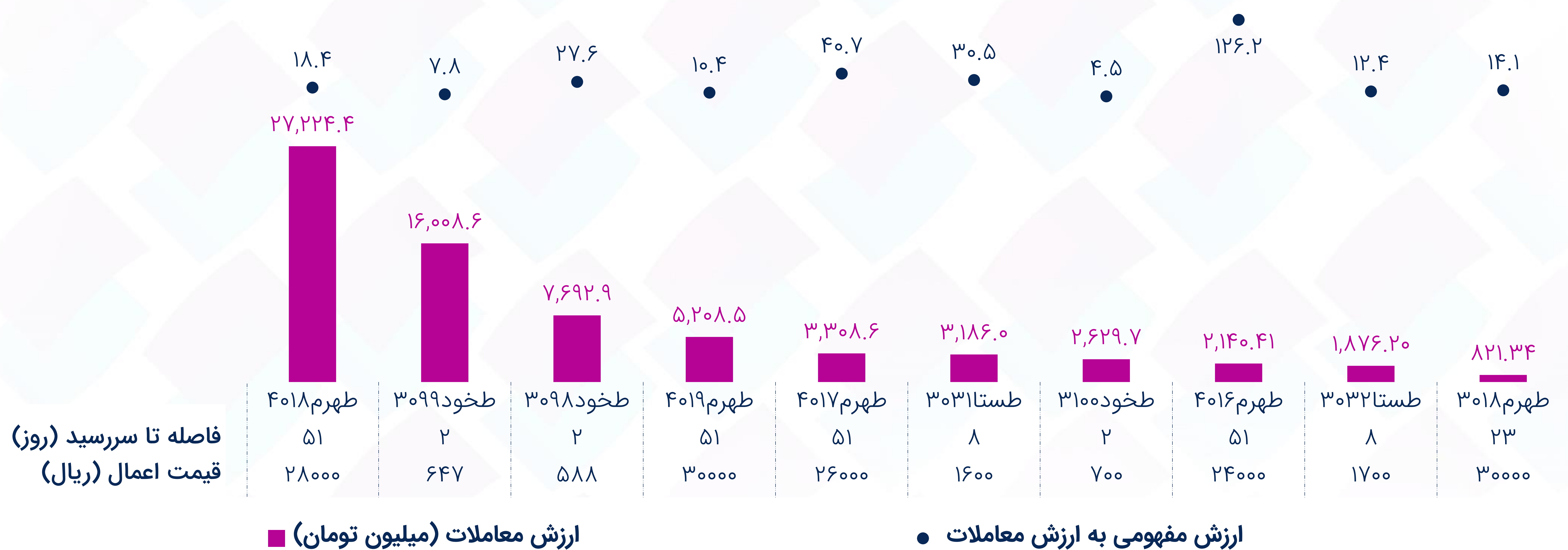
میلیون تومان

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
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۲۳	۶۵۶.۲	۷	۵۲۶	۶۱۰	۱۶.۰%	۸۷.۱	۰.۲۹	۱۶	۱۲۳%
ضخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۲	۷,۴۹۹.۵	۶	۵۷۹	۵۹۴	۲.۶%	۹۹.۰	۰.۴۳	۱۰	۷۳%
ضبساما ۷۱۳	بساما	۷,۵۰۰	۱۲۵	۸۵.۵	۱,۲۱۵	۸,۵۵۰	۸,۷۱۵	۱.۹%	۷.۲	۰.۹۹	۱,۸۶۳	۵۳%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۲۳	۱,۱۸۴.۷	۲۳	۵۲۶	۵۶۶	۷.۶%	۲۴.۶	۰.۵۱	۳۵	۵۲%
ضملی ۳۰۵۰	فملي	۶,۶۸۶	۲	۷۷.۸	۲۱۸	۶,۹۷۰	۶,۹۰۴	(۰.۹%)	۳۱.۷	۰.۹۳	۳۱۸	۴۶%

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 ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۱۶	۱.۲	۲	۴۸۳	۹۰۲	۸۷%	۴۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۸	۳.۰	۱	۳,۸۷۸	۶,۴۸۱	۶۷%	۶,۴۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۱۶	۲.۰	۲	۴۸۳	۸۰۲	۶۶%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۸	۱۱.۲	۱	۱,۵۸۶	۲,۲۰۱	۳۹%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۶	۴۹.۰	۲	۶۵۳	۱,۰۰۲	۵۳%	۵۰۱.۰	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 ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۲۱	۳.۰	۲۶	۱,۶۷۰	۱,۶۷۴	۰.۲%	۶۴.۴	-۰.۴۸	۴۱	۵۷.۸%
طوتعاون ۳۰۹	وتعاون	۱,۸۰۰	۲۱	۱.۸	۸۳	۱,۶۷۰	۱,۷۱۷	۲.۸%	۲۰.۷	-۰.۸۱	۱۰۸	۲۹.۹%
طدوب ۳۰۴	ذوب	۶۰۰	۱۶	۴.۲	۸۸	۴۸۳	۵۱۲	۶.۰%	۵.۸	-۱.۰۰	۱۰۸	۲۲.۵%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۲۱	۵.۸	۱۶۹	۱,۶۷۰	۱,۷۳۱	۳.۷%	۱۰.۲	-۰.۹۶	۱۹۷	۱۶.۶%
طهرم ۵۰۲	اهرم	۲۸,۰۰۰	۸۶	۱.۶	۸۲۵	۲۸,۴۰۰	۲۷,۱۷۵	(۴.۳%)	۳۲.۹	-۰.۲۶	۸۶۲	۴.۵%

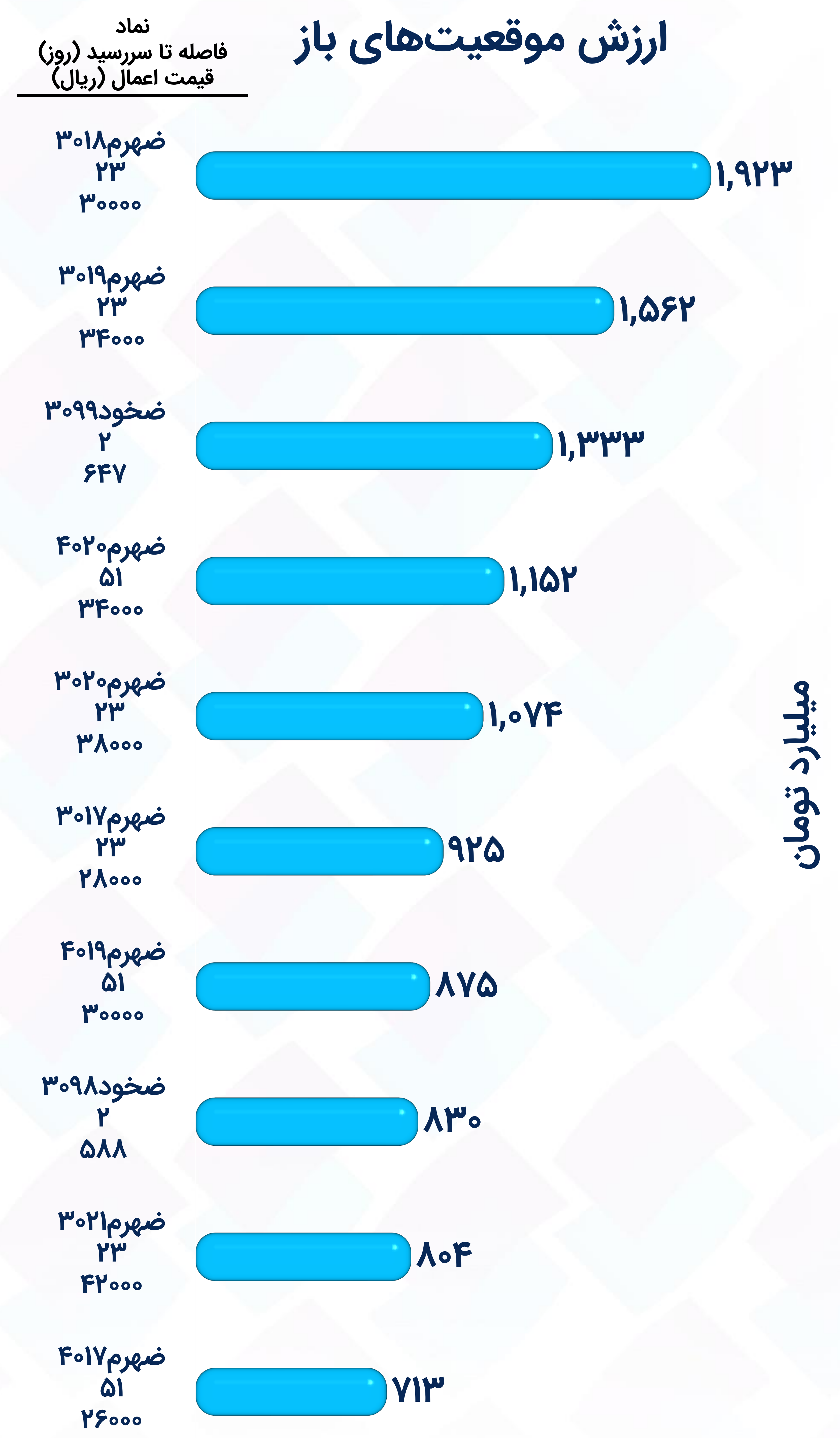
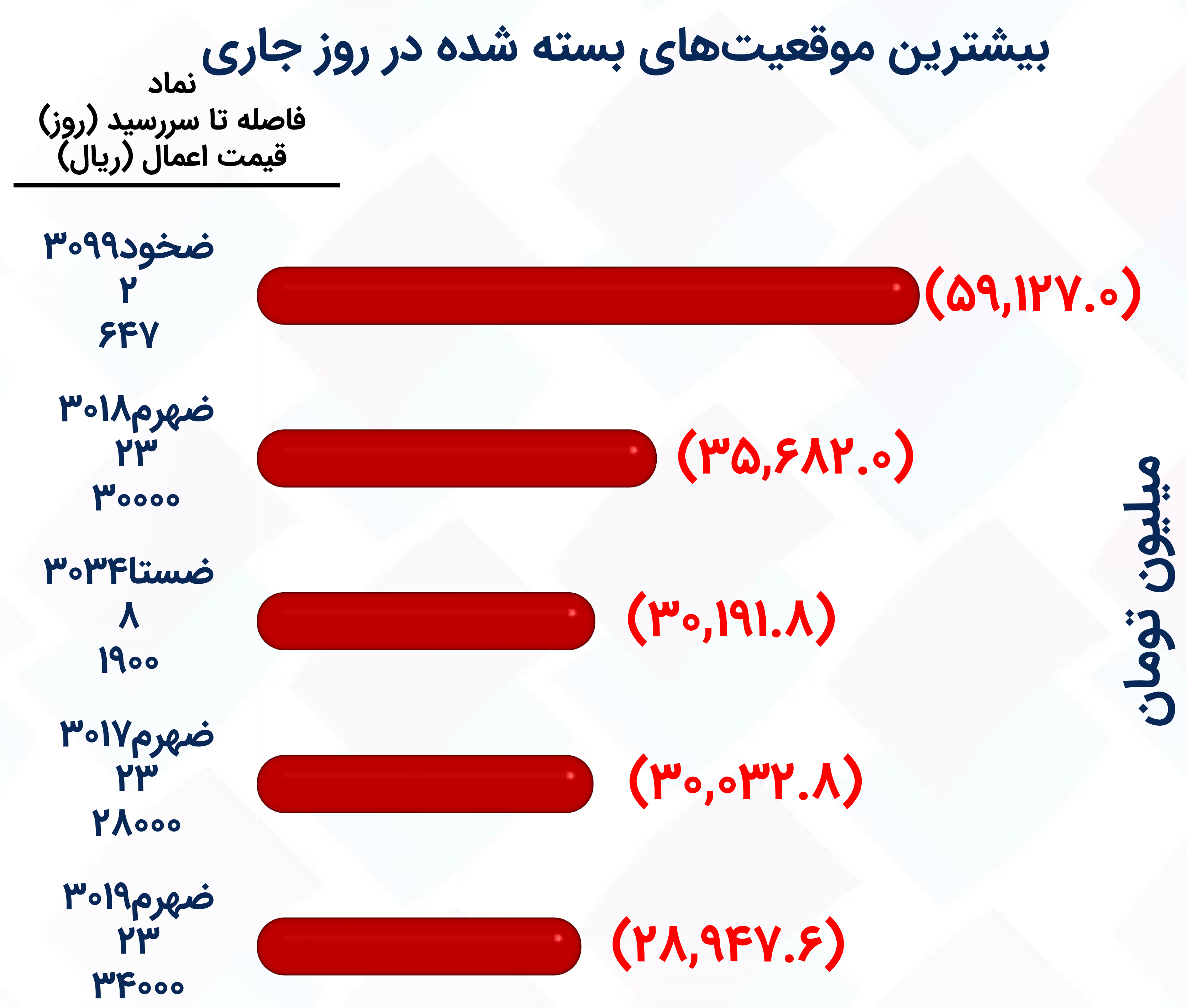
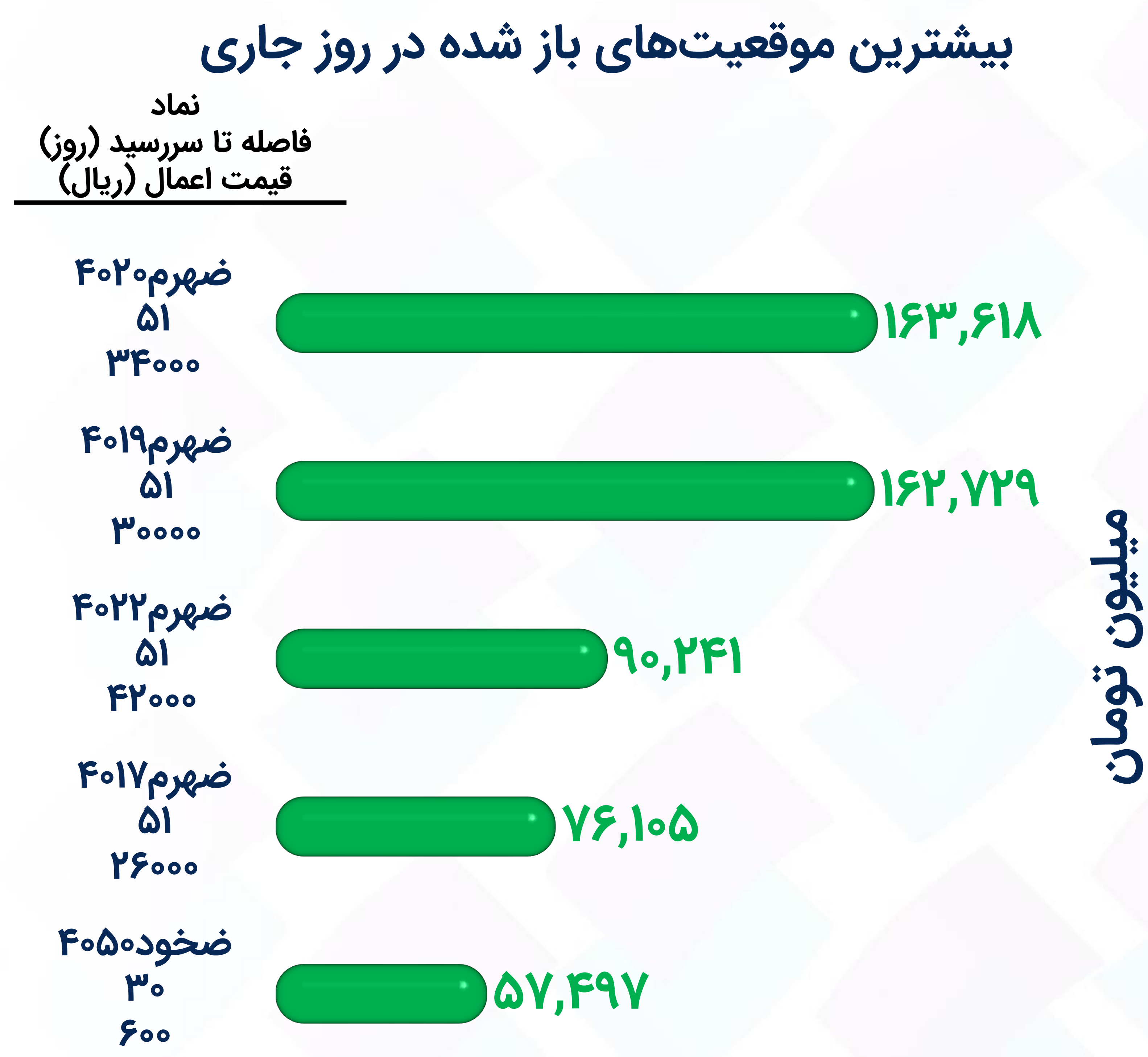
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۲	۰.۰	۱	۵۷۹	۲۸۱	(۵۱.۵%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۳۰۲۴	شستا	۹۰۰	۸	۰.۰	۱	۱,۵۸۶	۸۹۹	(۴۳.۳%)	۸۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۱۶	۰.۱	۳	۲,۶۴۵	۱,۹۰۴	(۲۸.۰%)	۶۳۴.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۴۰۴۷	خودرو	۳۰۰	۳۰	۰.۲	۱	۵۷۹	۲۹۹	(۴۸.۴%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۱	وبصادر	۵۰۰	۱۶	۰.۶	۱	۶۵۳	۴۹۹	(۲۳.۶%)	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.



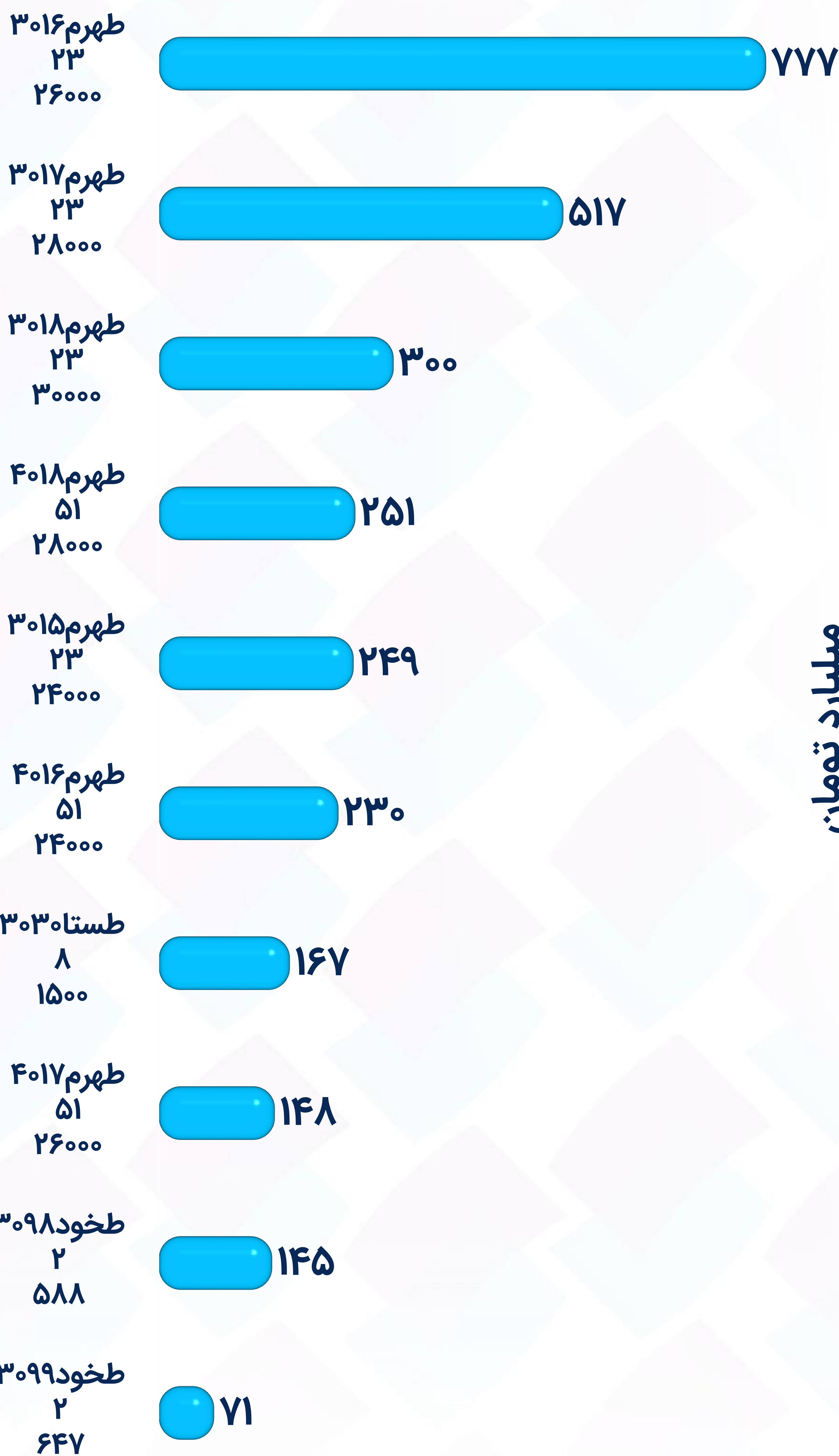
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

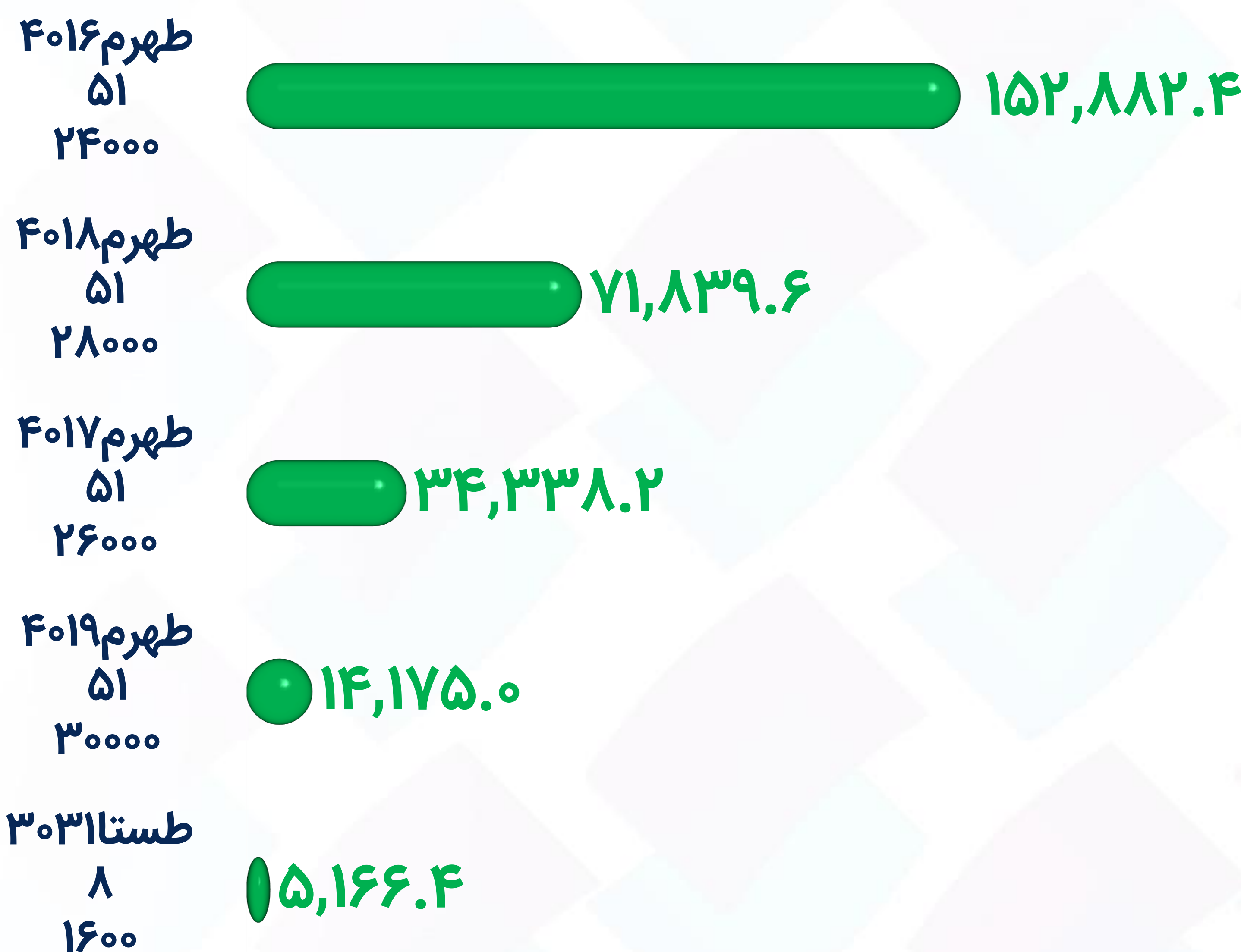
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.