

شماره
۴۸۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۶ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





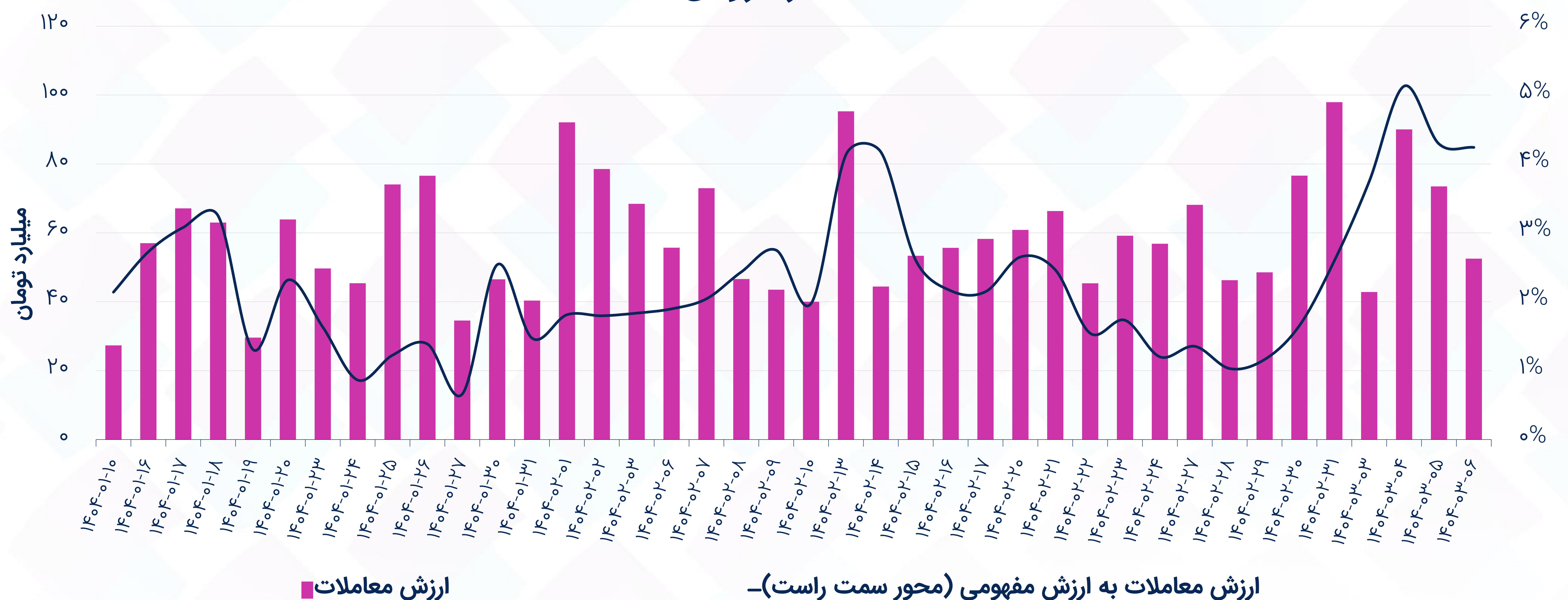
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



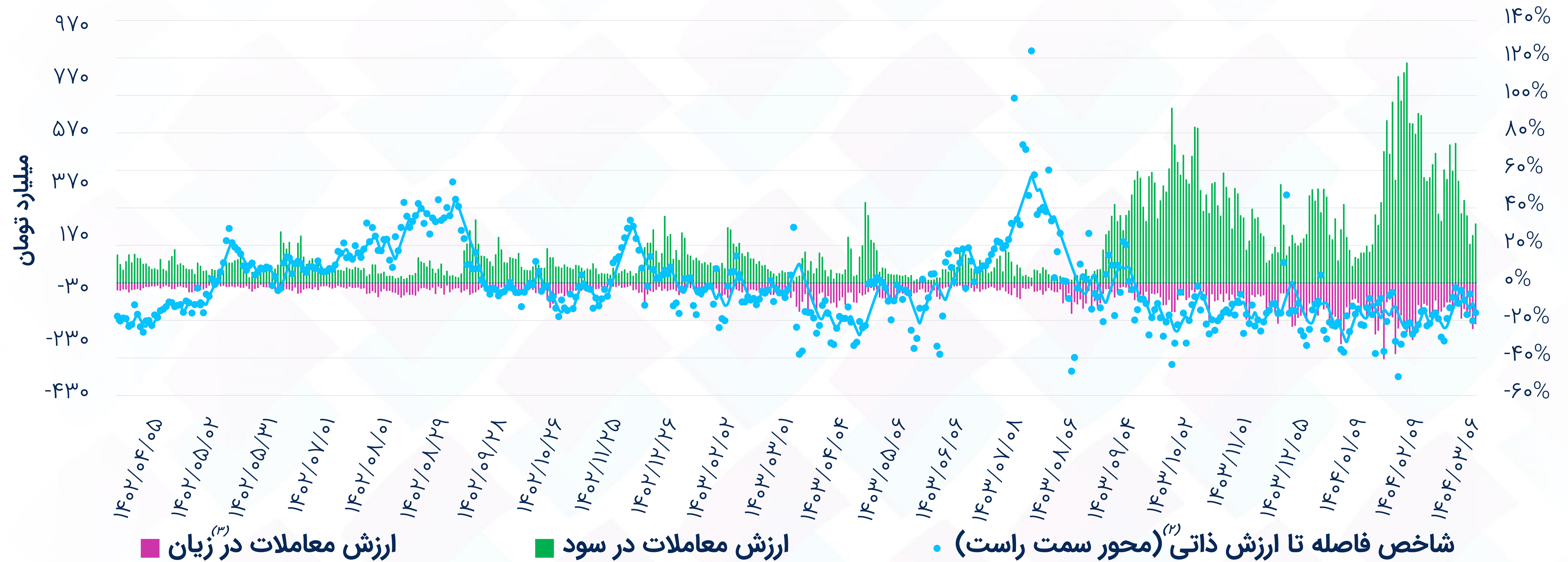
اختیار فروش



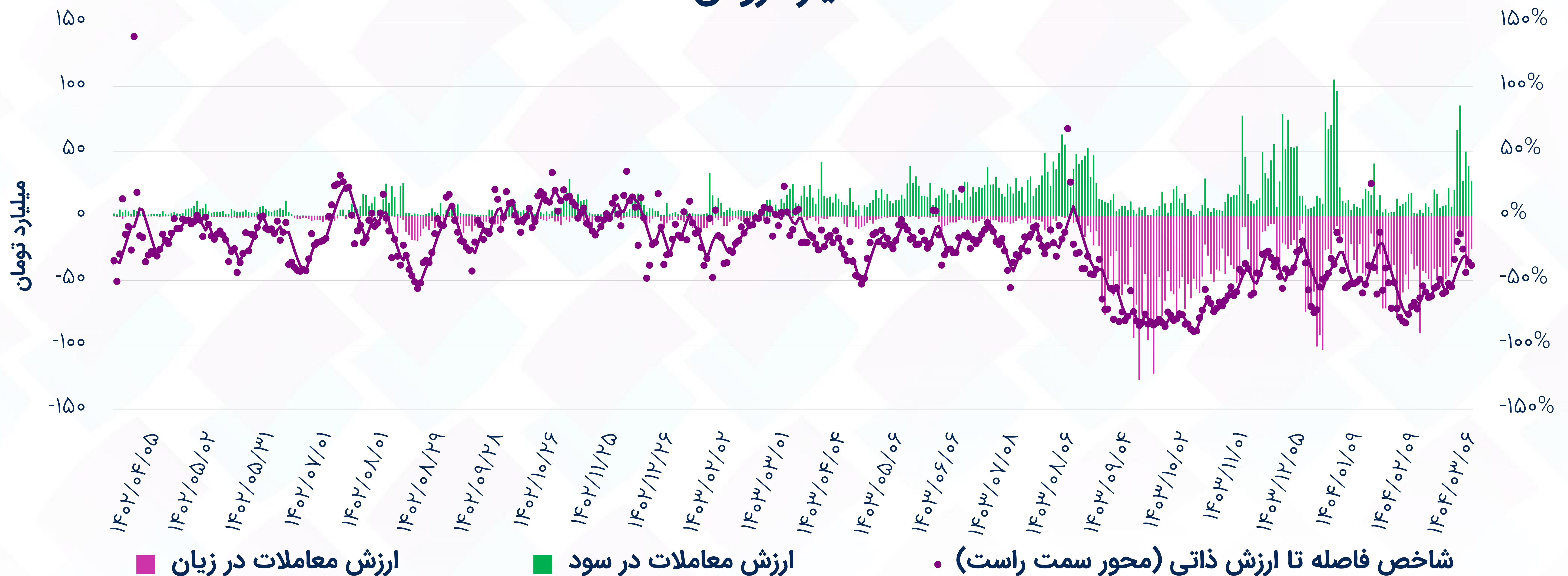
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

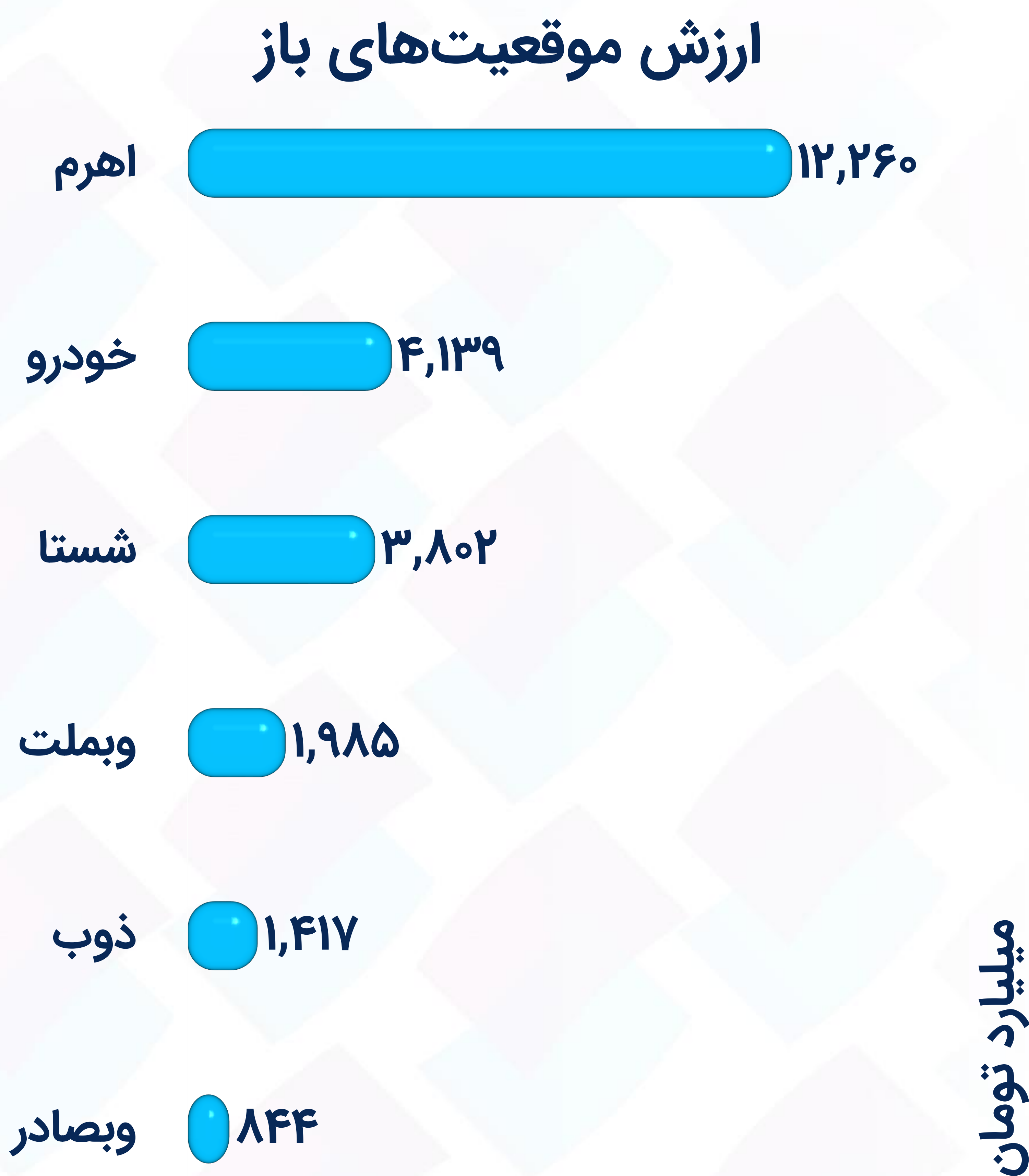
اختیار خرید

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	۴۱	۲۰۲.۰	۲,۷۳۲.۰	۸۷.۶	۱۱۴.۴	(۳۰.۹%)
خودرو	۳۱	۷۵.۷	۱,۹۶۴.۸	۵۸.۸	۱۶.۹	۱۶.۷%
شستا	۳۴	۳۰.۳	۹۳۵.۵	۱۸.۷	۱۱.۵	(۴.۷%)
شتاب	۱۳	۱۴.۷	۴۷.۴	۱۴.۷	۰.۰	۱.۴%
وبصادر	۱۶	۱۴.۵	۱۰۴.۲	۱۳.۶	۰.۹	(۱۲.۶%)
ذوب	۲۶	۱۲.۴	۱۴۱.۲	۷.۷	۴.۶	(۲۲.۲%)
وبملت	۲۸	۱۰.۵	۲۱۴.۴	۹.۲	۱.۳	(۱۶.۰%)

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	۱۹	۲۷,۹۹۹.۶	۶۵۶,۱۵۶.۵	۳,۴۶۱.۶	۲۴,۵۳۸.۰	(۵۲.۹%)
خودرو	۱۰	۲۰,۱۷۰.۵	۳۵۳,۴۰۸.۰	۱۹,۶۶۶.۱	۵۰۴.۴	(۱۷.۱%)
شستا	۹	۴,۱۵۸.۰	۲۰۶,۱۸۸.۹	۳,۷۱۸.۵	۴۳۹.۴	(۴۱.۱%)
وبملت	۴	۱۴۸.۸	۱۴,۹۱۴.۶	۰.۰	۱۴۸.۸	(۵۵.۷%)
وبصادر	۴	۲۱.۱	۴,۷۴۶.۷	۰.۰	۲۱.۱	(۸۷.۱%)
خودران	۲	۶.۶	۵۸.۳	۶.۶	۰.۰	(۱۵.۱%)
ذوب	۳	۴.۱	۷۵.۳	۴.۱	۰.۰	(۱۹.۹%)

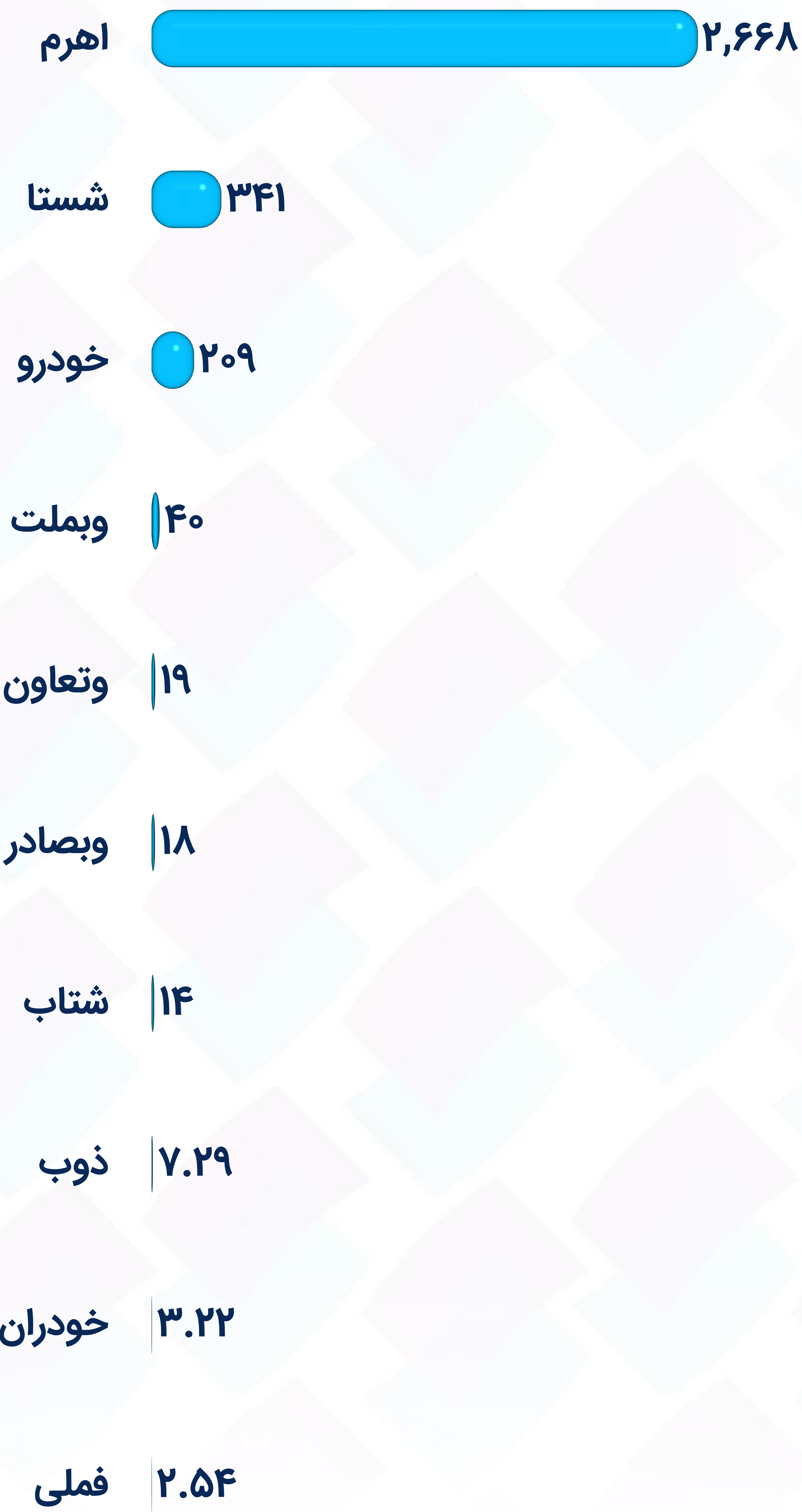
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



(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



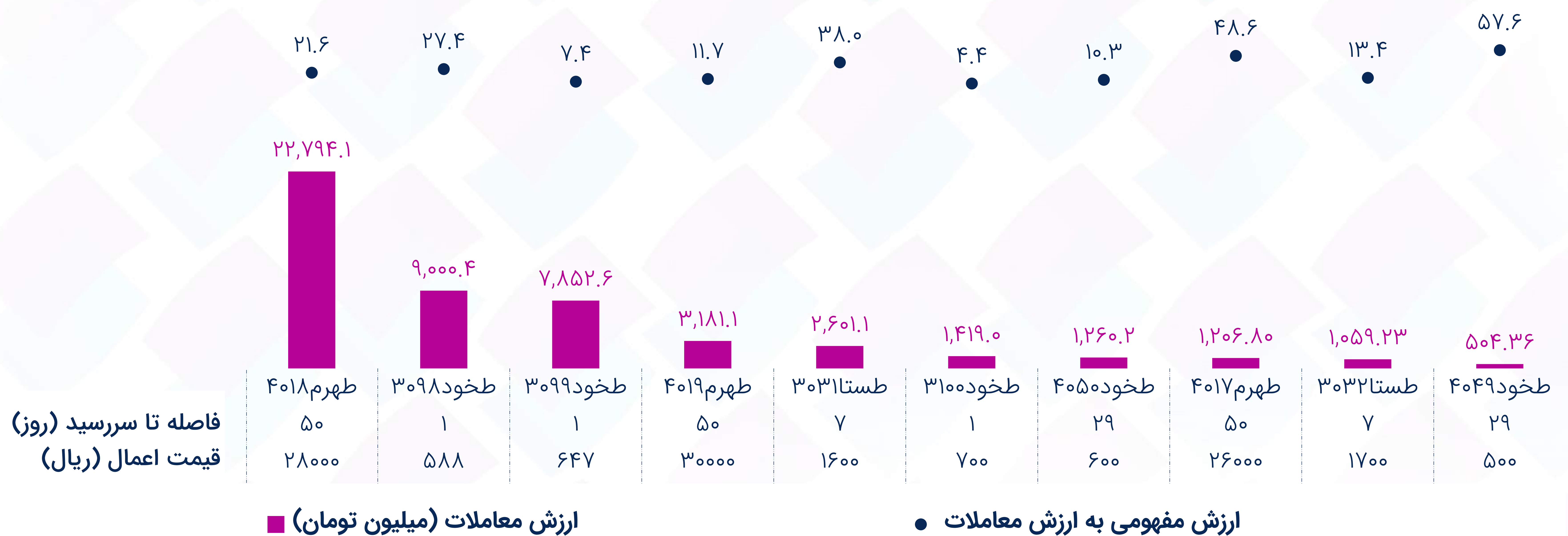
میلیون تومان

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
ضخاور ۴۱۴	خاور	۱,۰۰۰	۴۷	۱.۵	۱۱	۱,۷۱۱	۱,۰۱۱	(۴۰.۹%)	۹۱.۹	۱.۰۰	۷۵۱	۶۷۲۷%
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۲۲	۴۸۸.۳	۷	۵۲۳	۶۱۰	۱۶.۶%	۸۷.۱	۰.۲۷	۱۴	۹۴%
ضنارنج ۳۰۱	نارنج اهرم	۱۰,۰۰۰	۵	۱۰.۴	۵,۲۱۶	۱۹,۴۲۸	۱۵,۲۱۶	(۲۱.۷%)	۲.۹	۱.۰۰	۹,۴۸۴	۸۲%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۲۲	۸۳۲.۷	۲۴	۵۲۳	۵۶۷	۸.۴%	۲۳.۶	۰.۴۹	۳۲	۳۳%
ضسپا ۳۰۴۶	خسپا	۴۸۲	۲۲	۱۸۱.۰	۵۰	۵۲۳	۵۳۲	۱.۷%	۱۰.۶	۰.۷۵	۶۵	۳۱%

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	۱۵	۱.۵	۱	۴۸۴	۱,۰۰۱	۱۰۷%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۷	۸.۸	۱	۱,۵۹۸	۲,۲۰۱	۳۸%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۵	۳.۳	۲	۶۷۲	۱,۰۰۲	۴۹%	۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۷	۱.۴	۱	۳,۸۷۴	۵,۰۴۱	۳۰%	۵,۰۴۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۱۵	۹.۰	۲	۴۸۴	۷۰۲	۴۵%	۳۵۱.۰	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
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۲	۱.۳	۴,۲۱۰	۲۸,۸۹۰	۲۹,۷۹۰	۳.۱%	۷.۱	-۰.۹۵	۴,۴۹۹	۶.۹%
طوتعاون ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۲۰	۱.۶	۲۰	۱,۷۲۰	۱,۶۸۰	(۲.۳%)	۸۴.۰	-۰.۳۱	۲۱	۴.۱%
طهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۵۰	۲۲.۶	۸,۶۹۲	۲۸,۸۹۰	۲۹,۳۰۸	۱.۴%	۳.۴	-۰.۹۶	۷,۵۰۳	(۱۳.۷%)
طران ۳۰۱۰	خودران	۱۴,۰۰۰	۲۲	۴.۲	۱,۸۹۴	۱۲,۱۴۰	۱۲,۱۰۶	(۰.۳%)	۶.۴	-۰.۹۲	۱,۶۲۰	(۱۴.۵%)
طران ۳۰۰۹	خودران	۱۳,۰۰۰	۲۲	۲.۴	۹۳۶	۱۲,۱۴۰	۱۲,۰۶۴	(۰.۶%)	۱۲.۹	-۰.۷۱	۷۸۵	(۱۶.۲%)

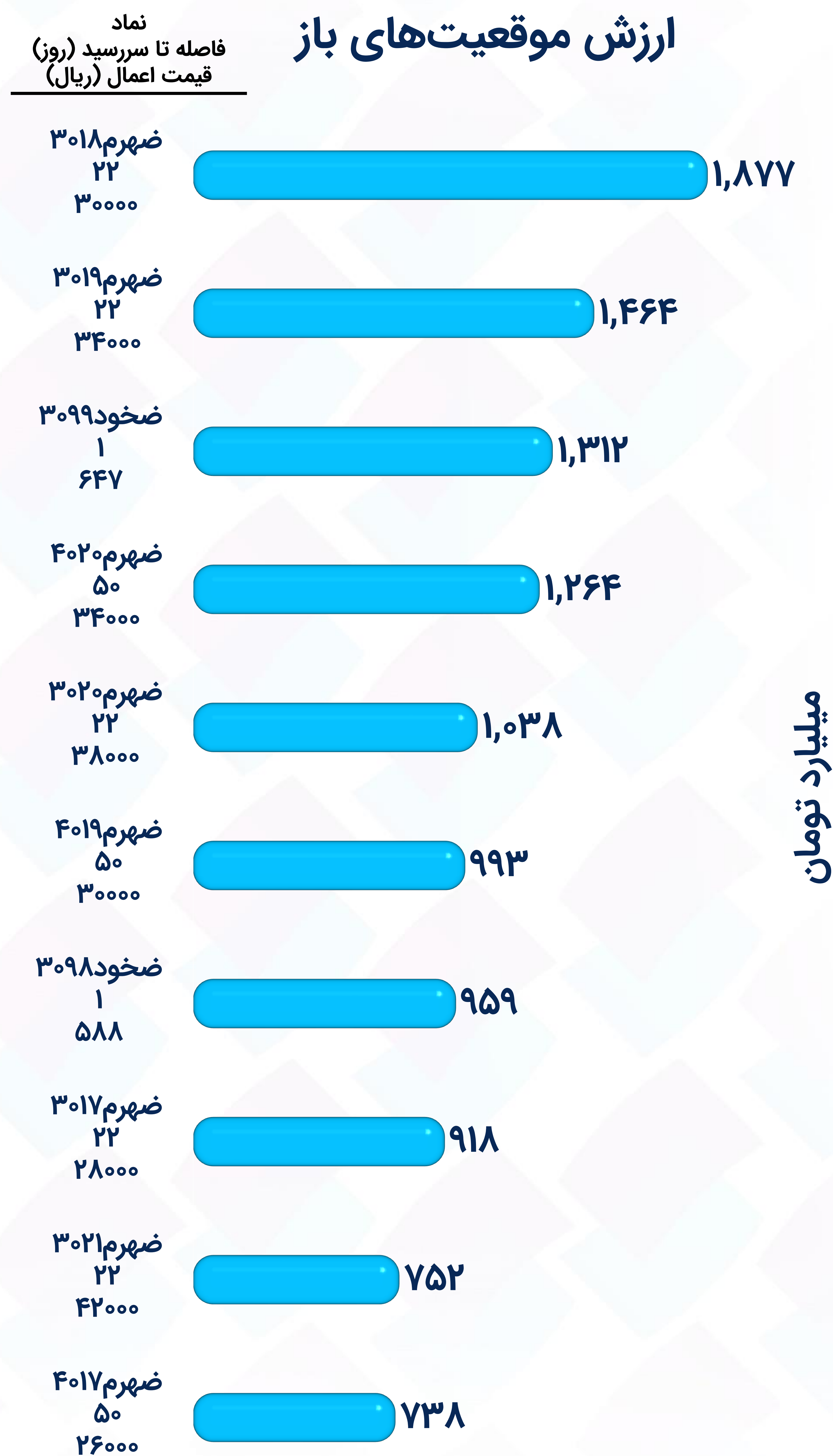
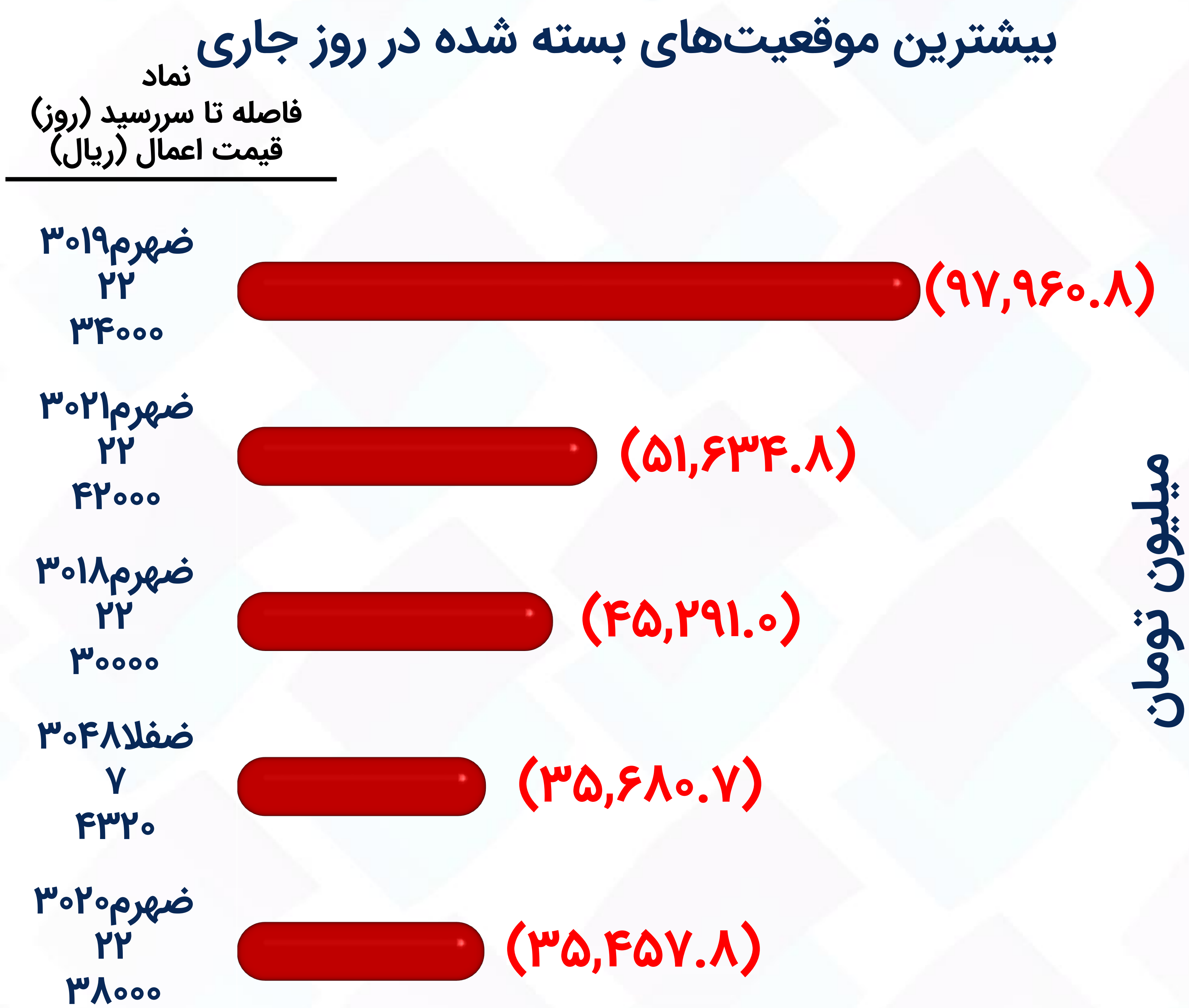
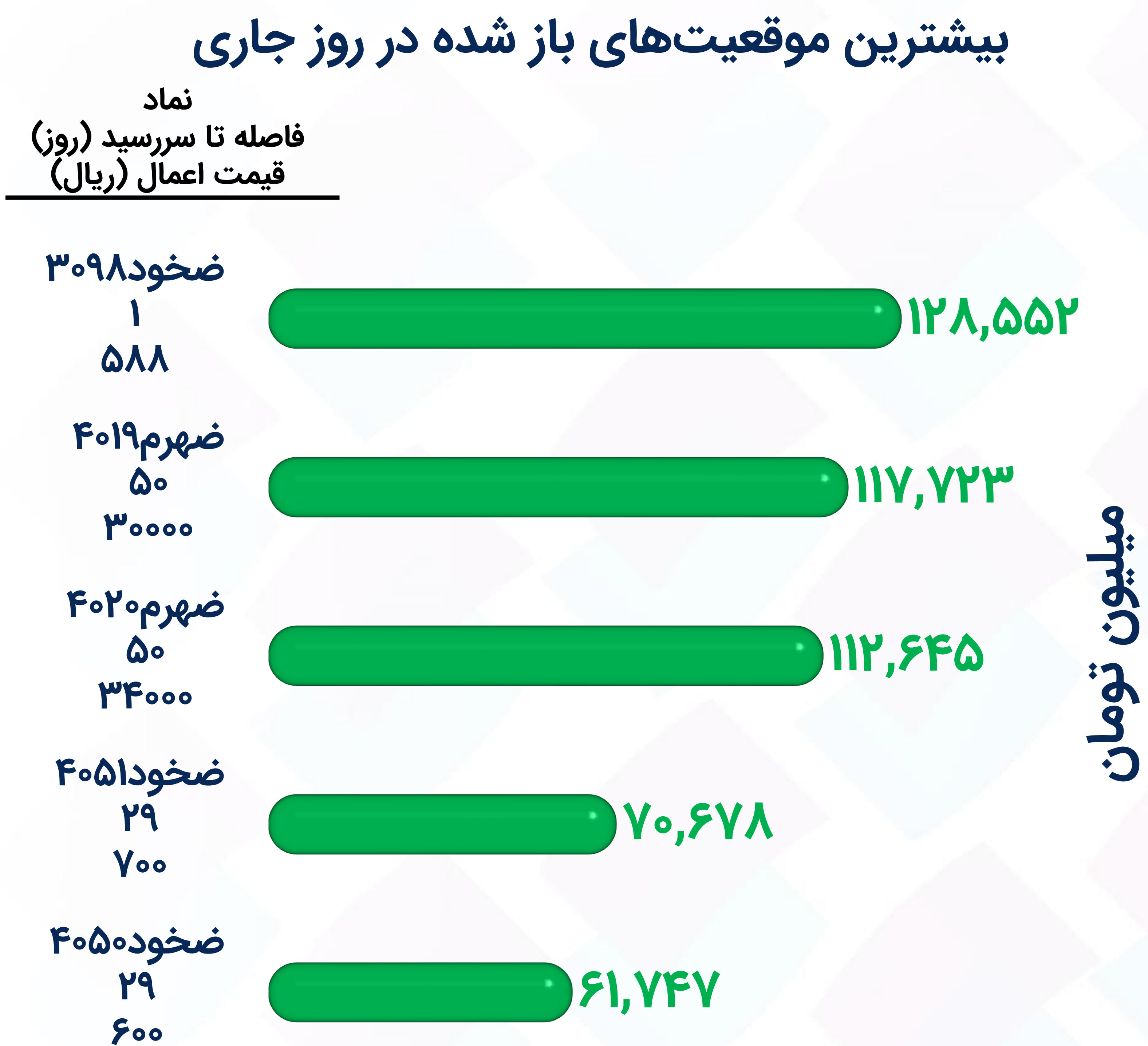
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۷۸	۰.۰	۱	۶۷۲	۱۹۹	(۷۰.۴%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۳۰۳۶	ذوب	۲۰۰	۱۵	۰.۰	۱	۴۸۴	۱۹۹	(۵۸.۹%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۱۵	۰.۰	۱	۶۷۲	۳۹۹	(۴۰.۶%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۳۰۲۷	شستا	۱,۲۰۰	۷	۰.۰	۱	۱,۵۹۸	۱,۱۹۹	(۲۵.۰%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۱۵	۰.۰	۲	۲,۷۲۴	۱,۹۰۵	(۳۰.۱%)	۹۵۲.۵	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.



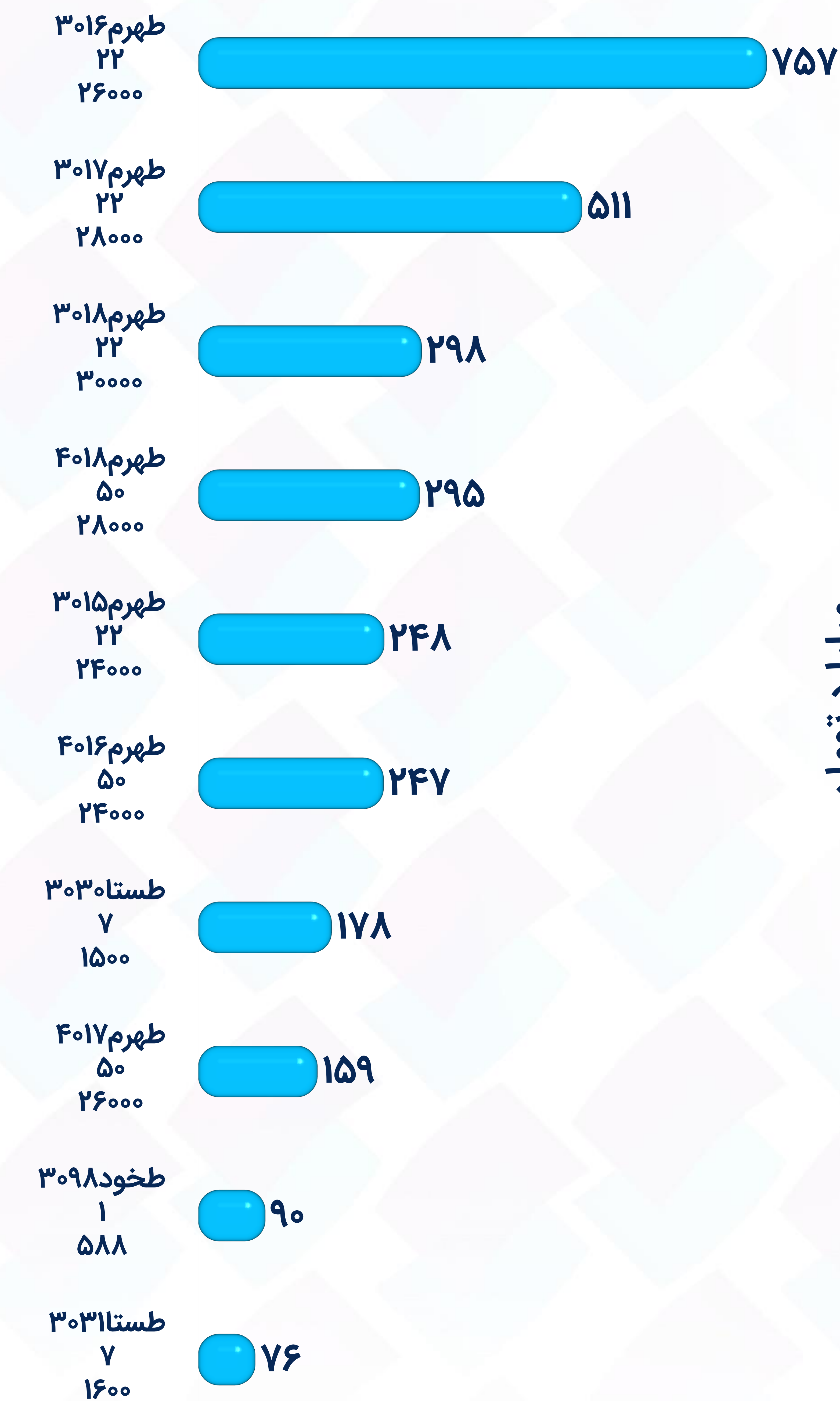
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

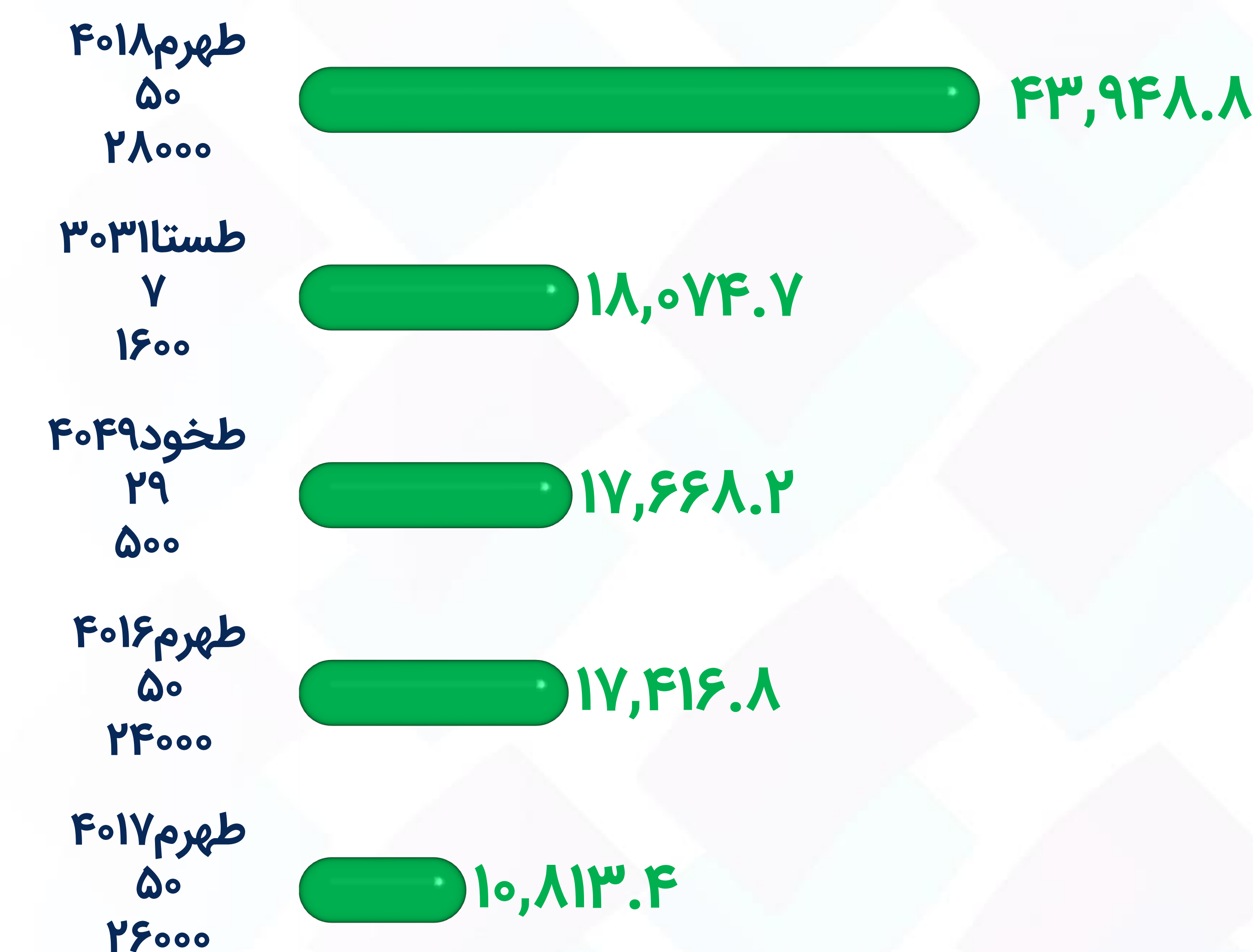
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

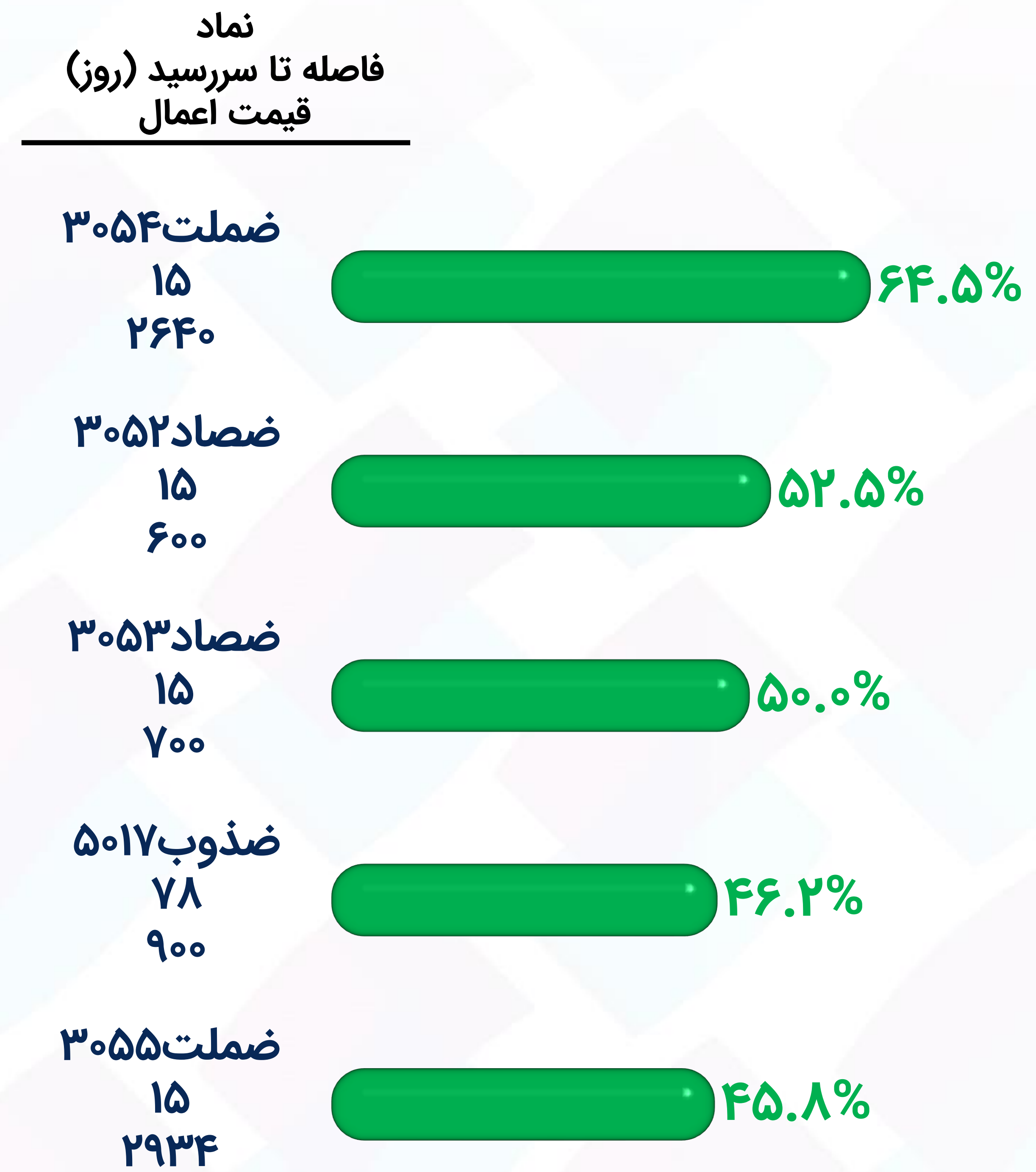
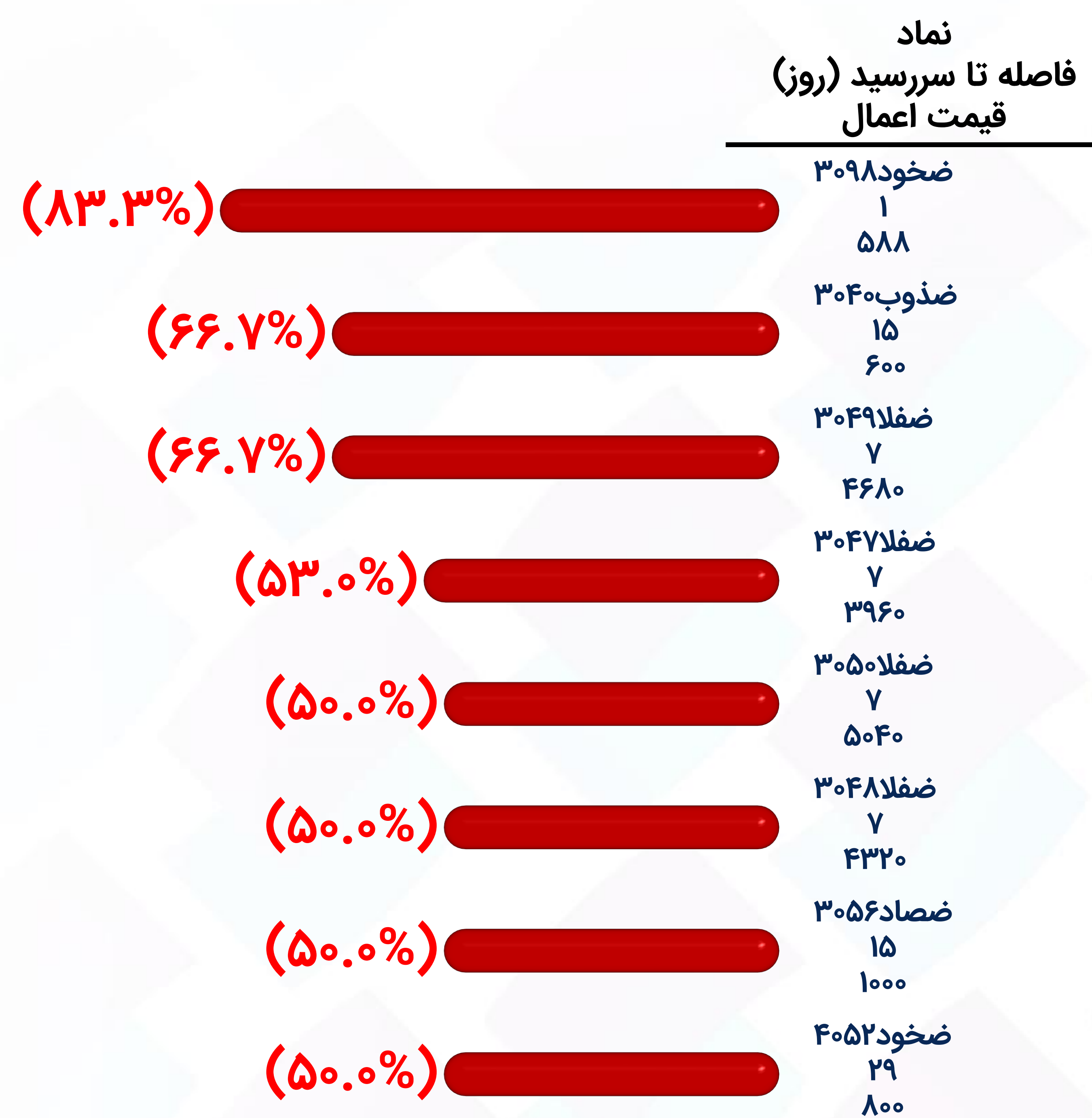
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



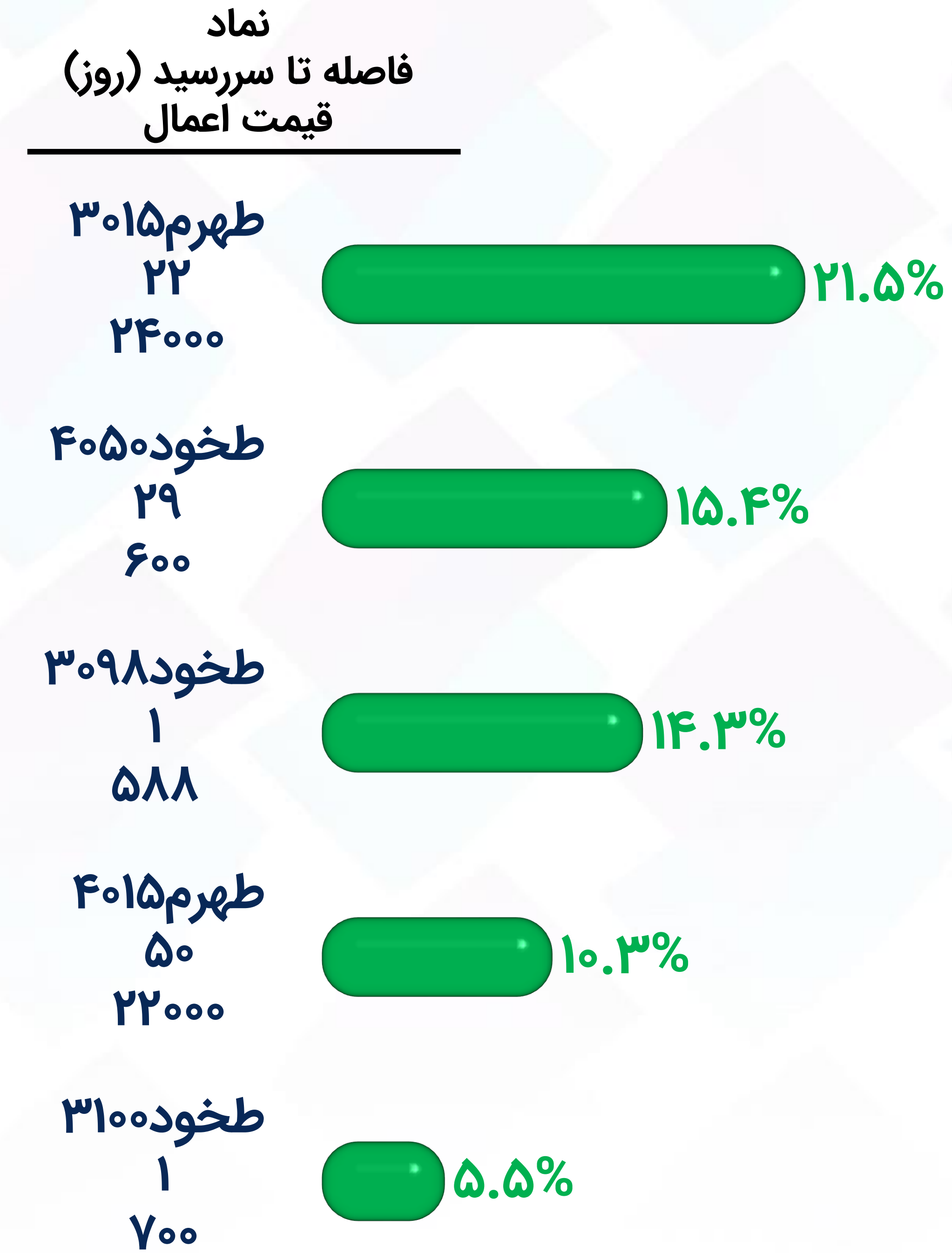
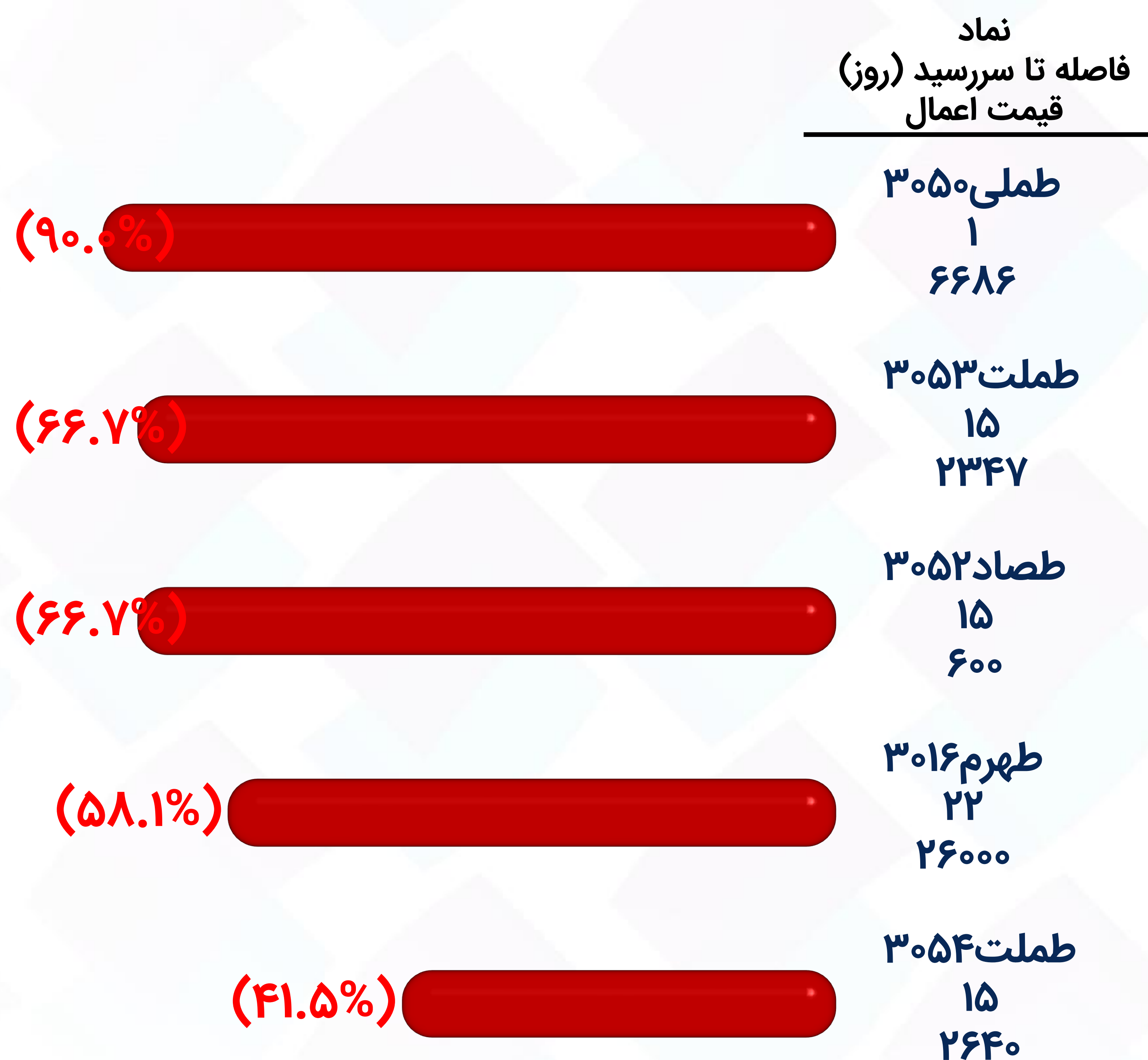
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

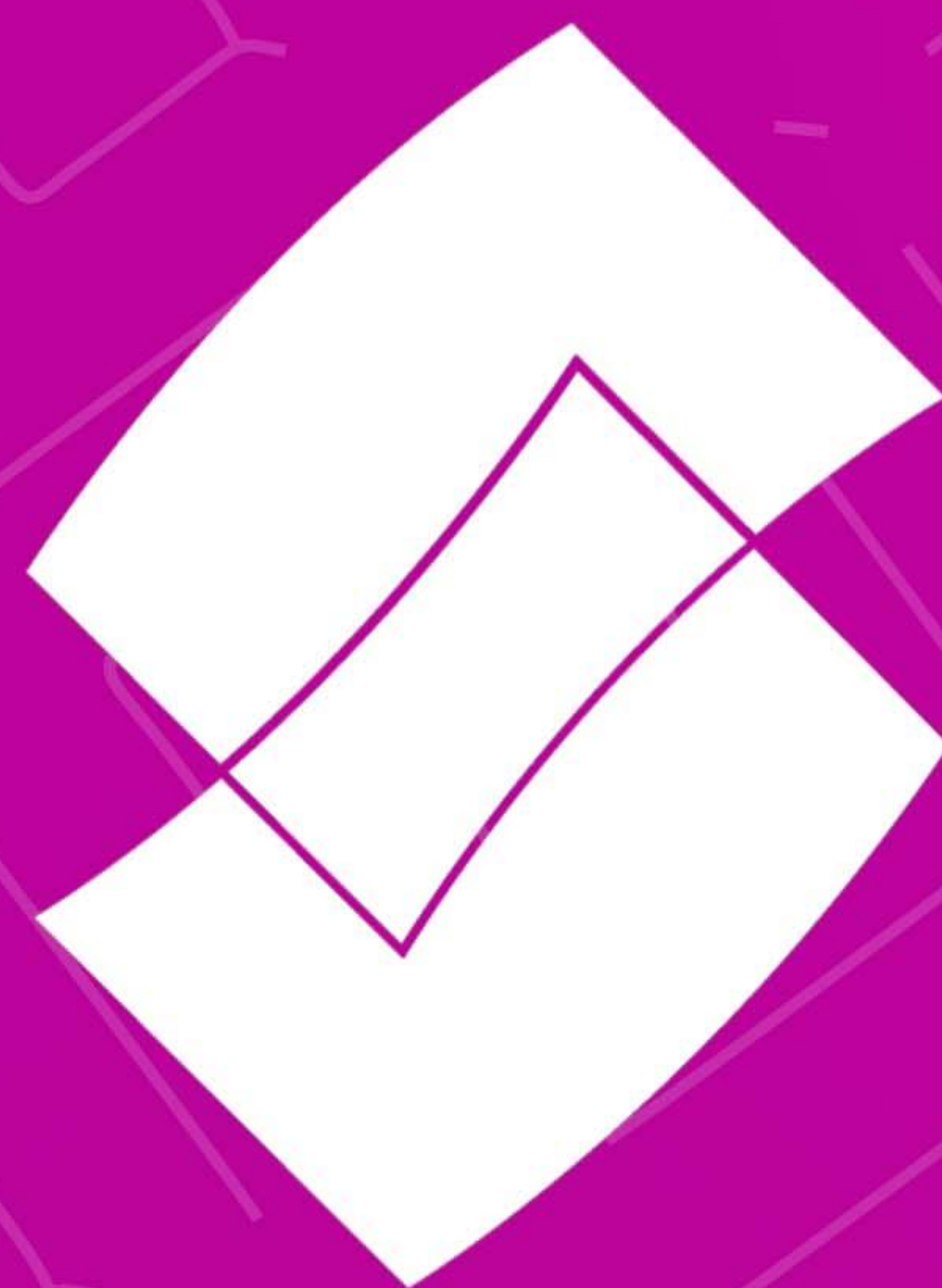
اختیار خرید



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.