

شماره
۴۸۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۷ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

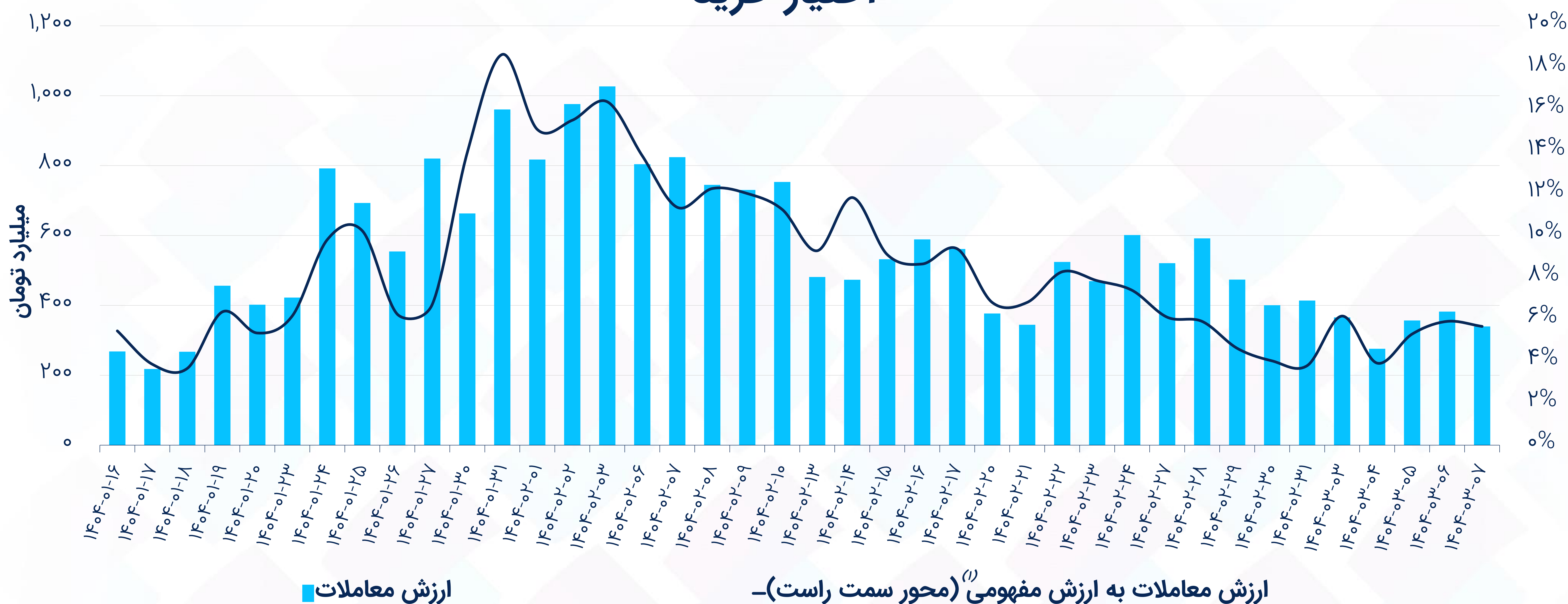




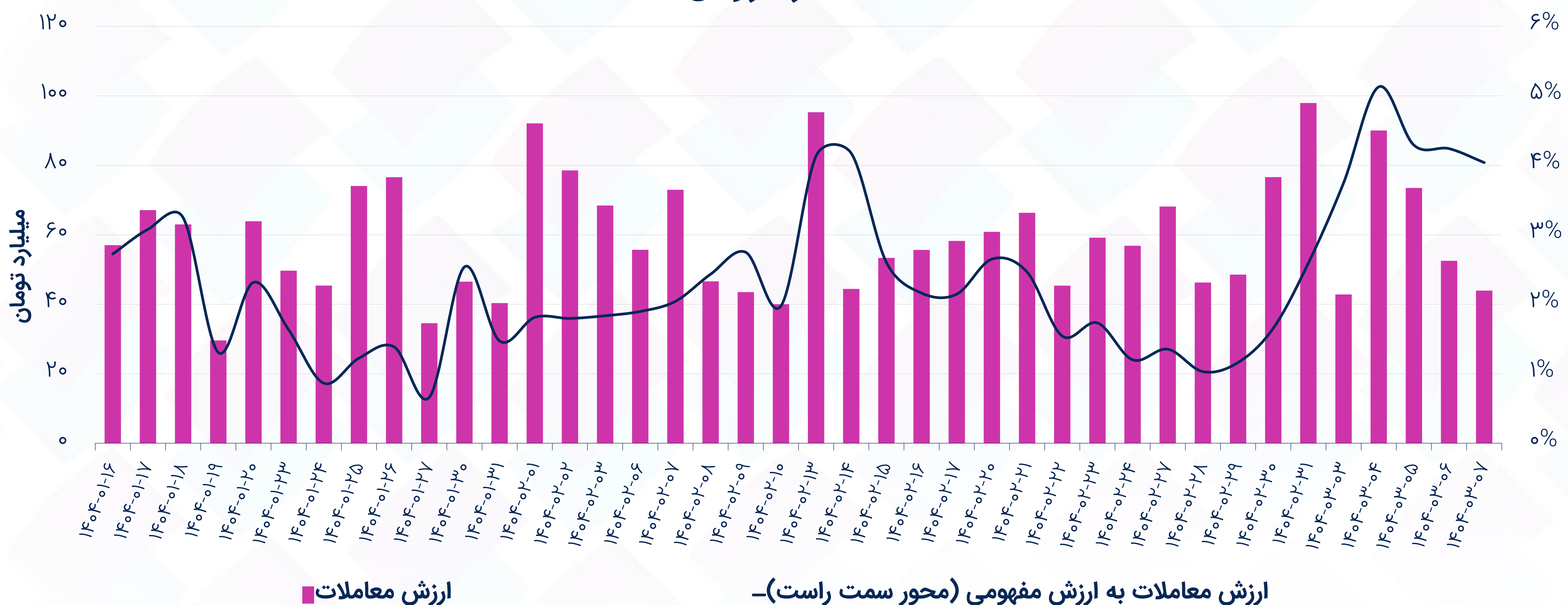
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



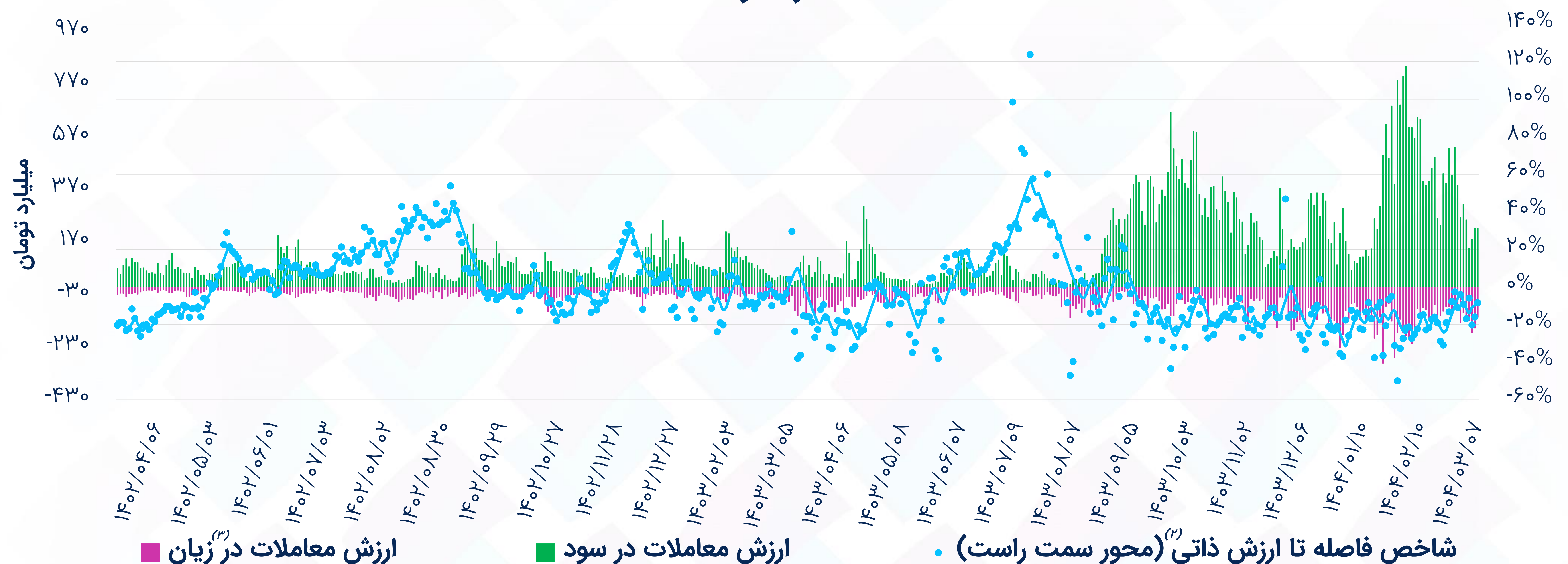
اختیار فروش



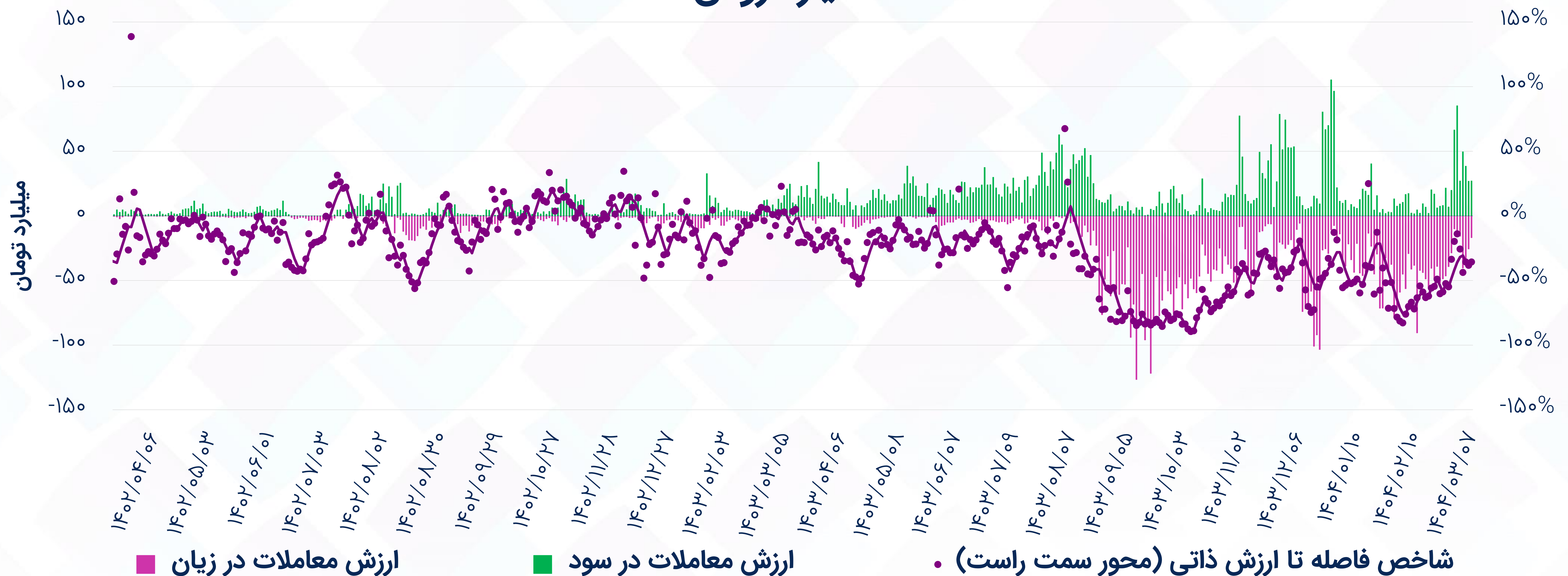
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۵	۱۶۱.۵	۲,۱۸۹.۹	۷۳.۴	۸۸.۱	(۲۷.۷%)
خودرو	۳۱	۱۰۳.۰	۲,۲۳۲.۲	۹۳.۴	۹.۶	۲۱.۳%
شستا	۴۵	۱۶.۶	۷۵۸.۵	۹.۸	۶.۷	(۱۱.۵%)
وبصادر	۱۵	۱۰.۵	۱۰۵.۸	۹.۴	۱.۱	(۸.۴%)
ذوب	۲۶	۹.۵	۱۴۲.۰	۵.۲	۴.۳	(۲۴.۷%)
شتاب	۱۳	۸.۵	۴۰.۵	۸.۵	۰.۰	۱.۲%
وبملت	۲۸	۶.۵	۱۲۰.۷	۵.۸	۰.۸	(۱.۲%)

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	۱۲	۲۳,۱۰۰.۱	۴۴۳,۱۱۵.۱	۲۲,۳۰۸.۳	۷۹۱.۸	(۲۵.۱%)
اهرم	۱۵	۱۷,۸۴۳.۹	۴۳۶,۰۲۸.۲	۲,۲۵۱.۰	۱۵,۵۹۳.۰	(۴۹.۹%)
شستا	۸	۲,۸۳۴.۵	۱۹۶,۳۳۱.۲	۲,۳۹۲.۶	۴۴۱.۹	(۳۴.۸%)
وتعاون	۲	۹۱.۸	۳,۰۴۵.۵	۹۱.۸	۰.۰	۸۱.۹%
وبملت	۳	۳۷.۴	۳,۳۸۱.۷	۰.۰	۳۷.۴	(۶۷.۲%)
وبصادر	۲	۱۱.۴	۴,۱۷۲.۱	۰.۰	۱۱.۴	(۹۵.۸%)
ذوب	۳	۸.۸	۲۳۰.۵	۸.۵	۰.۲	(۳۰.۱%)

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



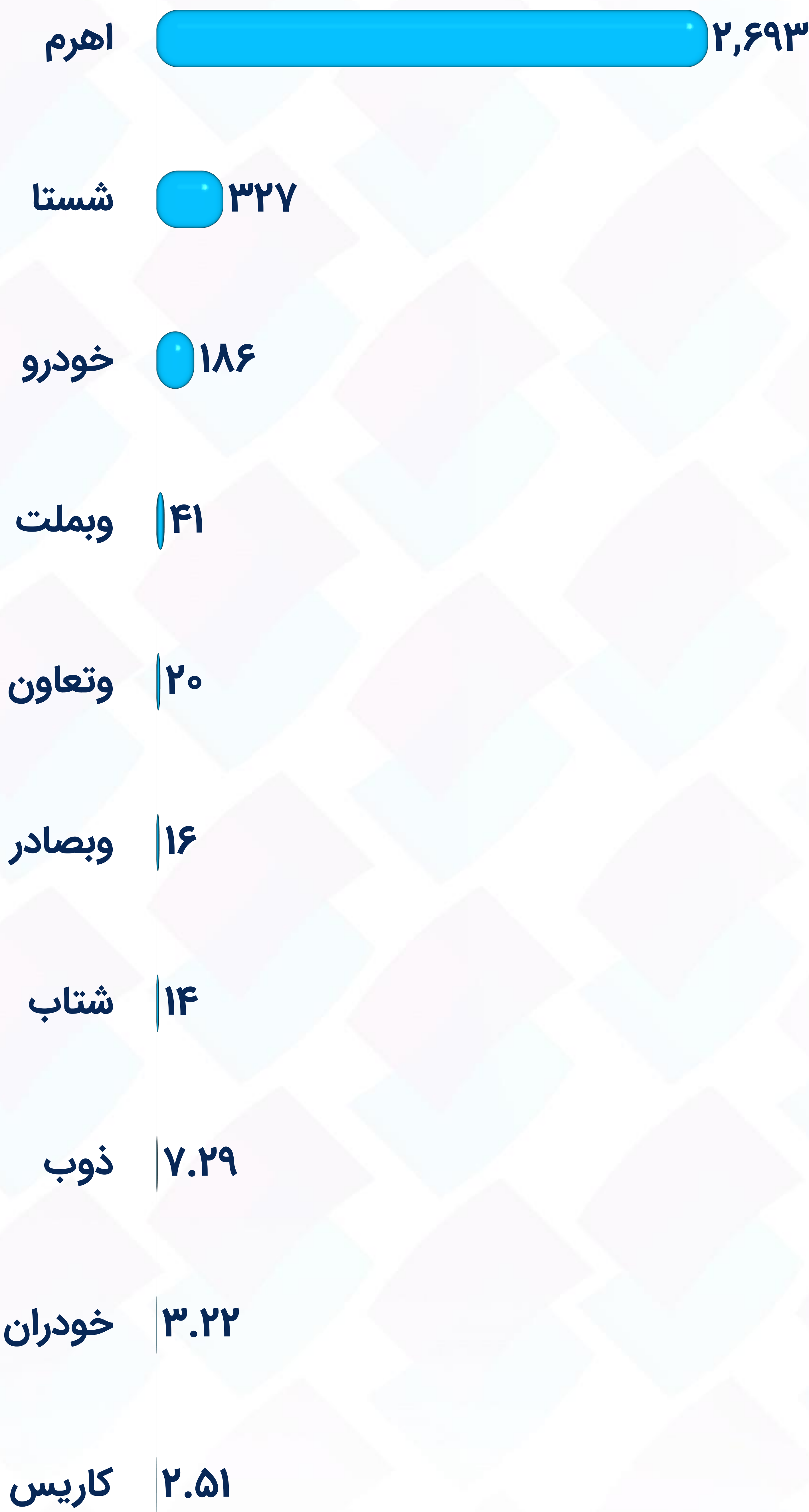
میلیون تومان



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

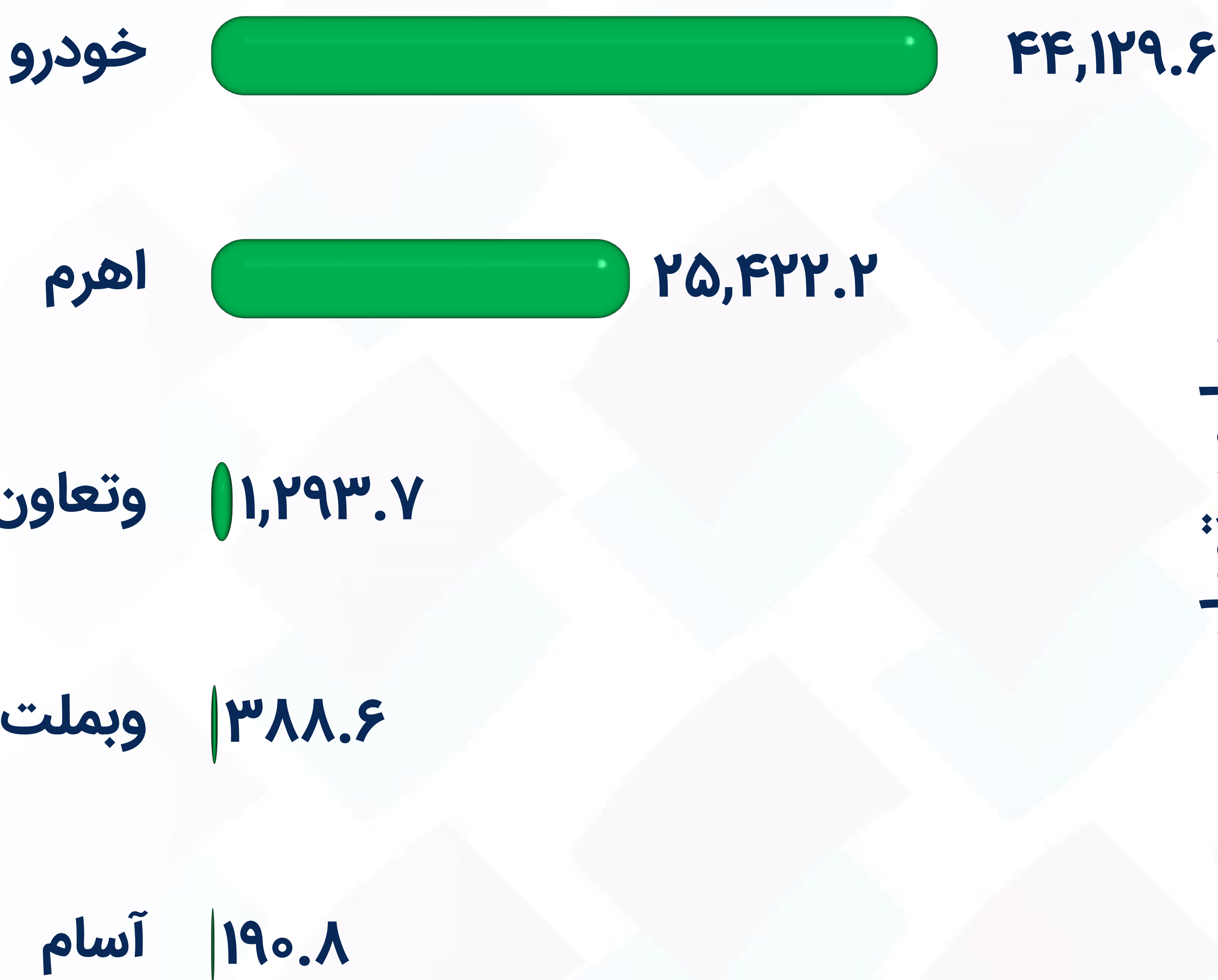
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



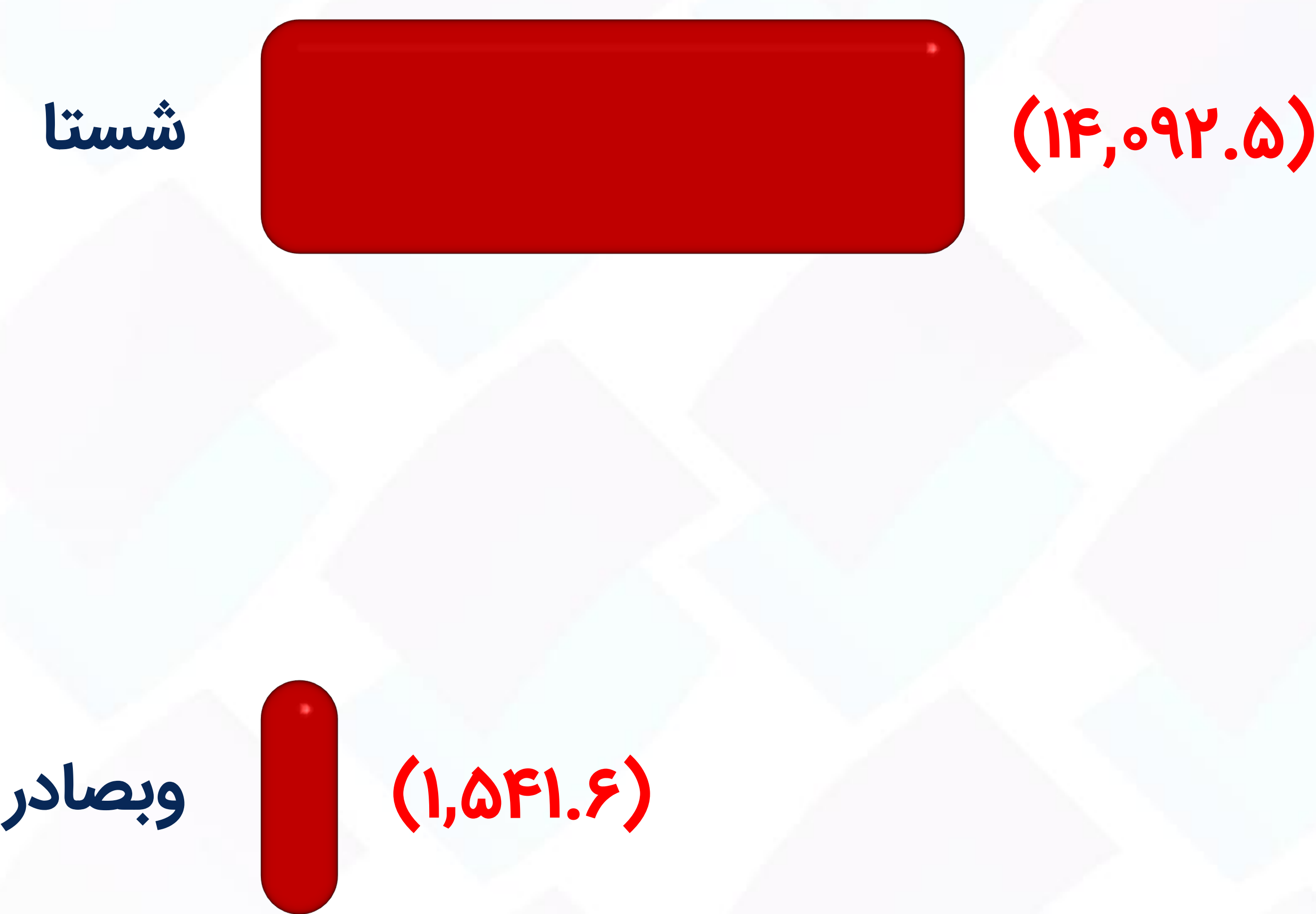
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

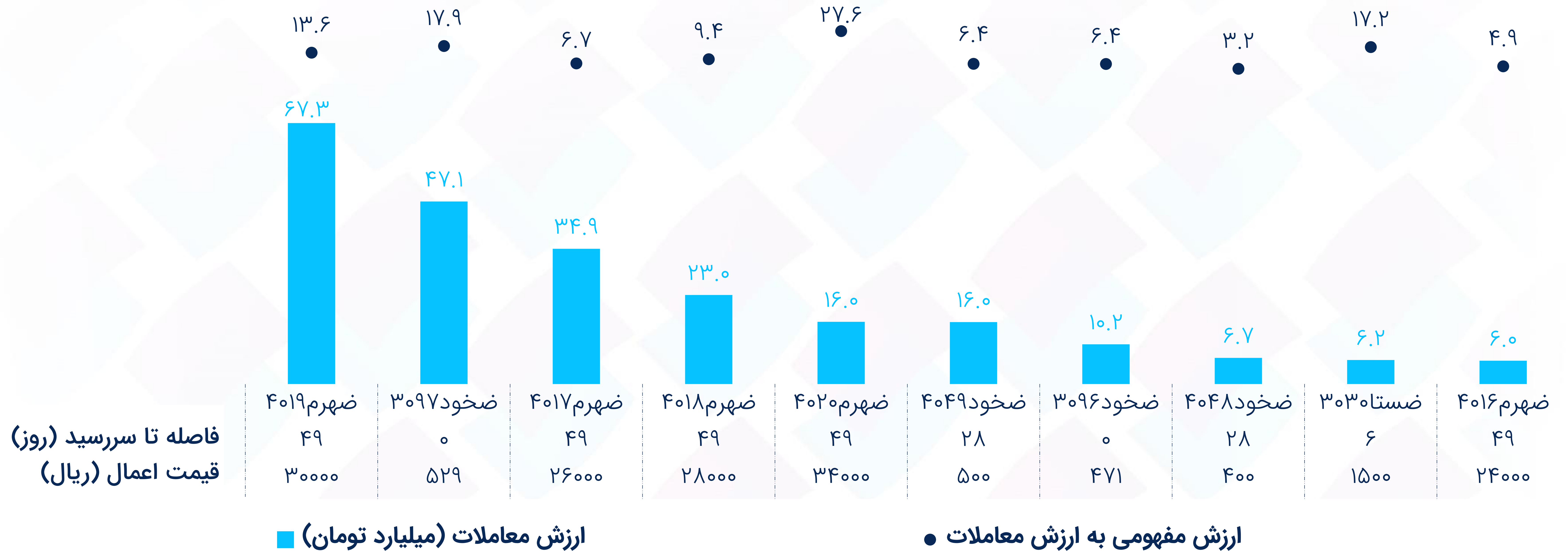
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۲۱	۴۷۱.۲	۵	۵۲۸	۶۰۸	۱۵.۲%	۱۲۱.۶	۰.۲۷	۱۴	۱۷۲%
ضنارنج ۳۰۹	نارنج اهرم	۱۸,۰۰۰	۴	۲.۲	۵۵۵	۱۹,۳۰۳	۱۸,۵۵۵	(۳.۹%)	۳۳.۴	۰.۹۶	۱,۳۹۱	۱۵۱%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۲۱	۲,۲۷۳.۱	۲۱	۵۲۸	۵۶۴	۶.۸%	۲۶.۹	۰.۵۱	۳۳	۵۶%
ضبساما ۷۱۱	بساما	۶,۵۰۰	۱۲۳	۱۷۴.۲	۲,۰۰۰	۸,۵۶۰	۸,۵۰۰	(۰.۷%)	۴.۳	۱.۰۰	۲,۷۳۸	۳۷%
ضبساما ۷۱۲	بساما	۷,۰۰۰	۱۲۳	۱۷۸.۷	۱,۷۰۰	۸,۵۶۰	۸,۷۰۰	۱.۶%	۵.۱	۱.۰۰	۲,۲۹۰	۳۵%

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 ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۱۴	۴.۴	۲	۴۸۲	۸۰۲	۶۶%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۶	۵.۶	۱	۱,۵۸۵	۲,۲۰۱	۳۹%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۶	۱.۲	۱	۳,۸۳۳	۵,۰۴۱	۳۲%	۵,۰۴۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۴	۴.۵	۱	۶۹۰	۱,۰۰۱	۴۵%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۱۴	۱۸.۴	۱	۴۸۲	۷۰۱	۴۵%	۷۰۱.۰	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	۱۹	۷.۴	۲۲	۱,۷۷۰	۱,۷۷۸	۰.۵%	۸۰.۸	-۰.۵۰	۴۲	۹۱.۲%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۱۹	۸۴.۳	۶۱	۱,۷۷۰	۱,۸۳۹	۳.۹%	۳۰.۱	-۰.۸۲	۱۱۰	۸۱.۱%
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۱	۵۹.۸	۴,۷۰۵	۲۸,۶۳۰	۲۹,۲۹۵	۲.۳%	۶.۲	-۰.۹۷	۴,۷۹۰	۱.۸%
طستا ۳۰۳۲	شستا	۱,۷۰۰	۶	۵۱۶.۷	۱۲۱	۱,۵۸۵	۱,۵۷۹	(۰.۴%)	۱۳.۰	-۰.۹۳	۱۰۵	(۱۳.۰%)
طهرم ۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۱۲	۱۱۰.۴	۱۲,۶۹۱	۲۸,۶۳۰	۲۹,۳۰۹	۲.۴%	۲.۳	-۰.۹۱	۹,۵۶۳	(۲۴.۶%)

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
طملت ۳۰۵۰	ویملت	۱,۹۰۷	۱۴	۰.۰	۳	۲,۷۶۵	۱,۹۰۴	(۳۱.۱%)	۶۳۴.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۱	وبصادر	۵۰۰	۱۴	۰.۷	۱	۶۹۰	۴۹۹	(۲۷.۷%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۴۹	۰.۴	۴۳	۲۸,۶۳۰	۱۴,۹۵۷	(۴۷.۸%)	۳۴۷.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۴۹	۲.۶	۸۰	۲۸,۶۳۰	۱۹,۹۲۰	(۳۰.۴%)	۲۴۹.۰	۰.۰۰	۱	(۹۹.۲%)
طذوب ۳۰۳۸	ذوب	۴۰۰	۱۴	۰.۲	۱	۴۸۲	۳۹۹	(۱۷.۲%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۲%)

(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

ارزش موقعیت‌های باز

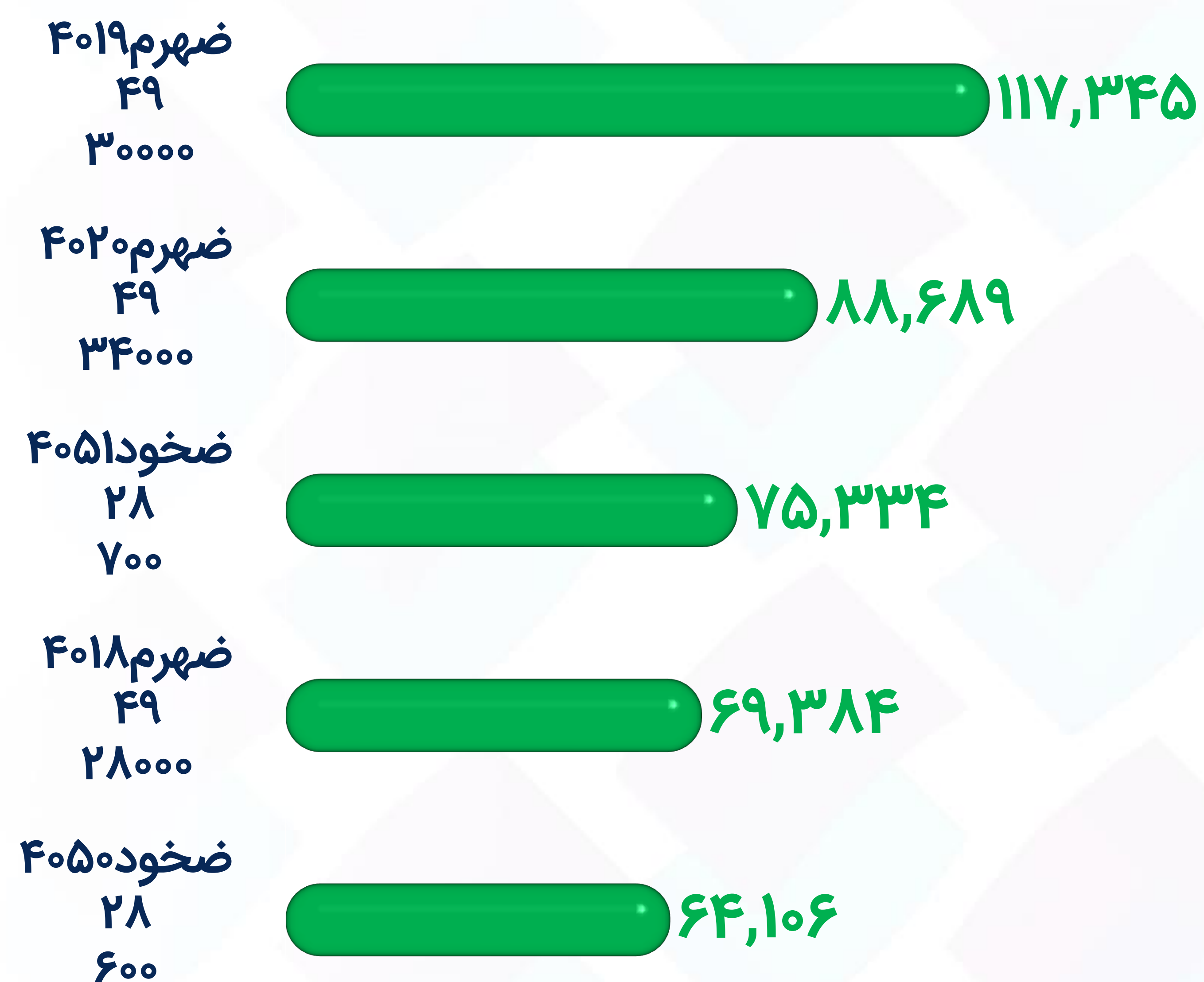
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

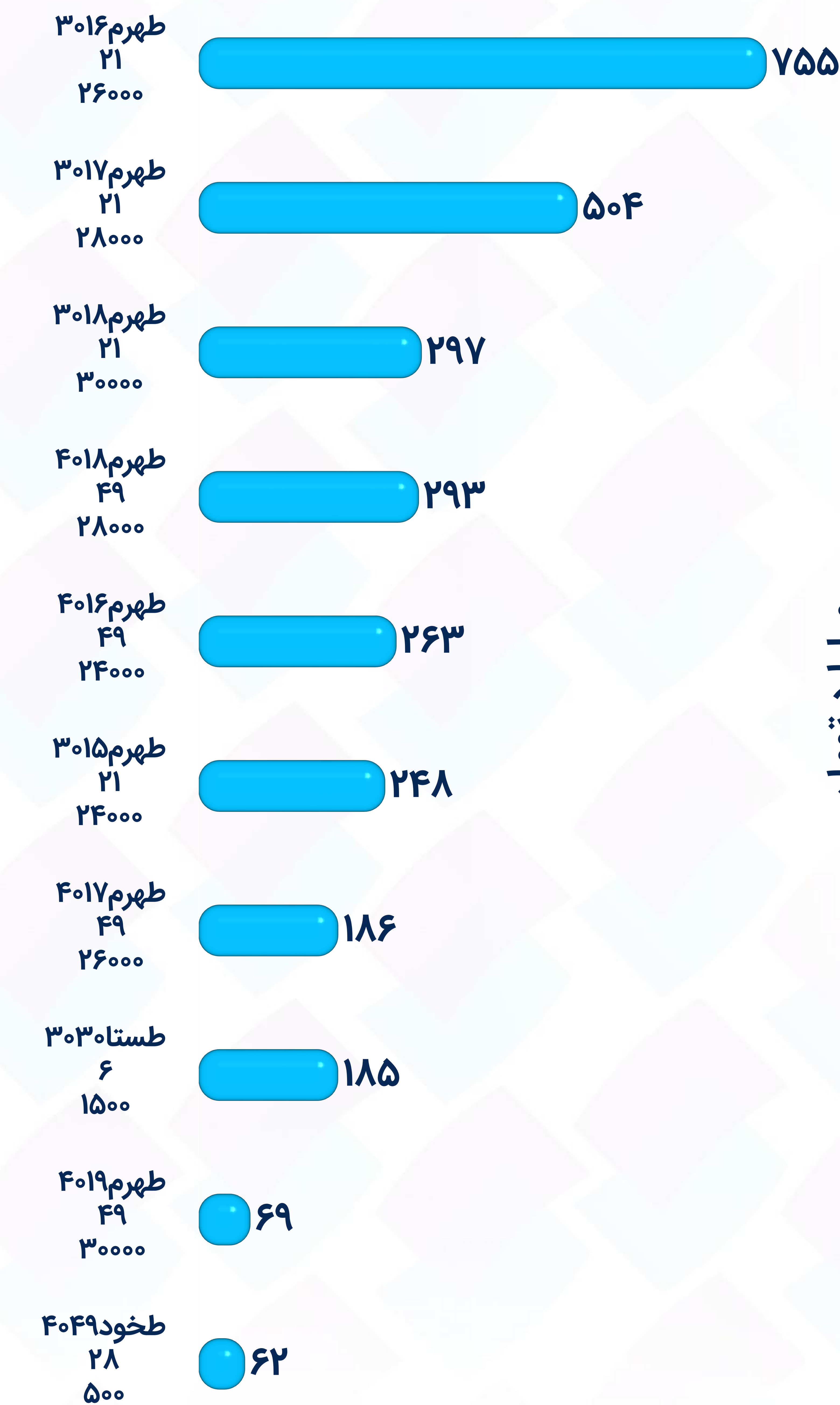


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

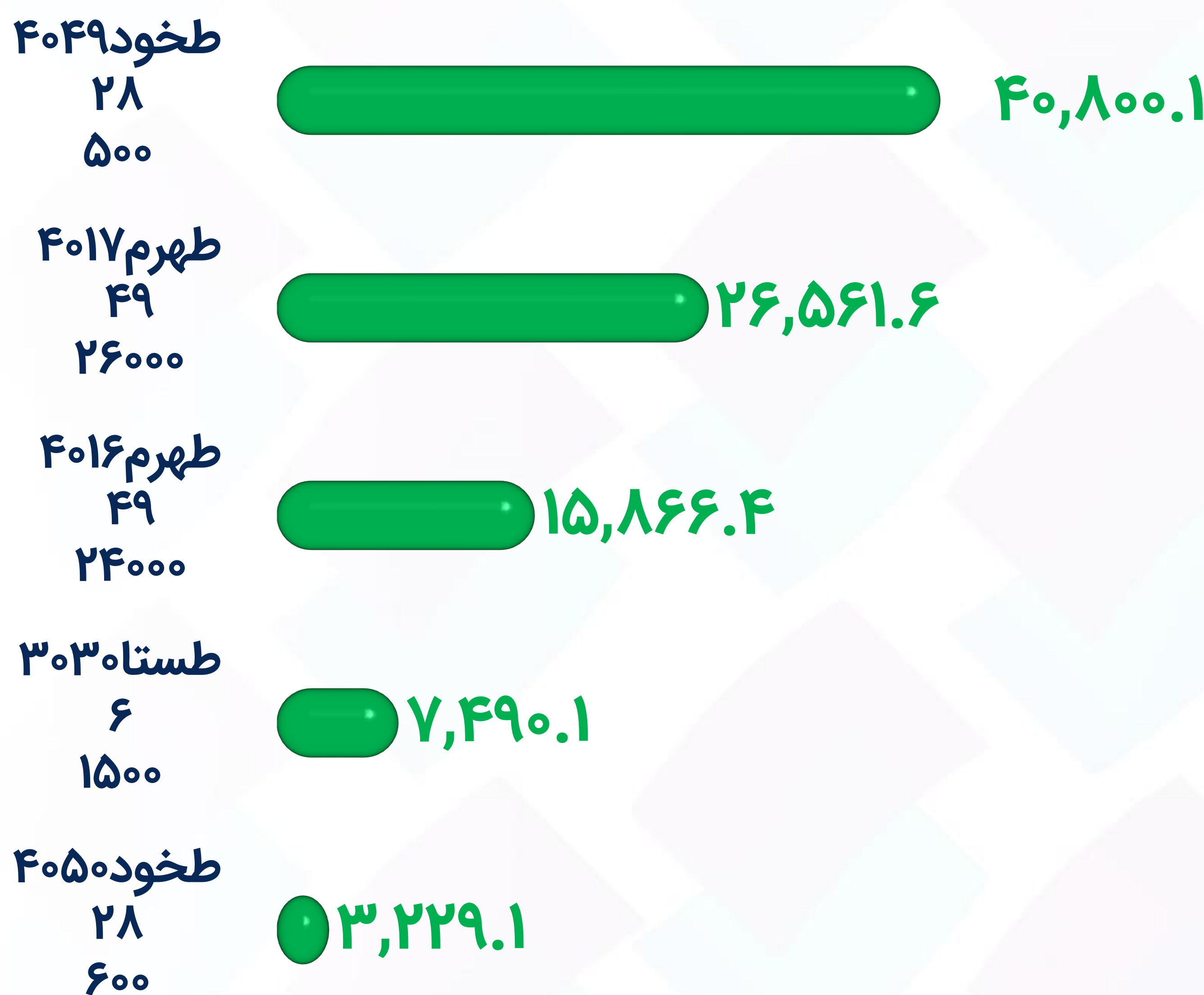
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

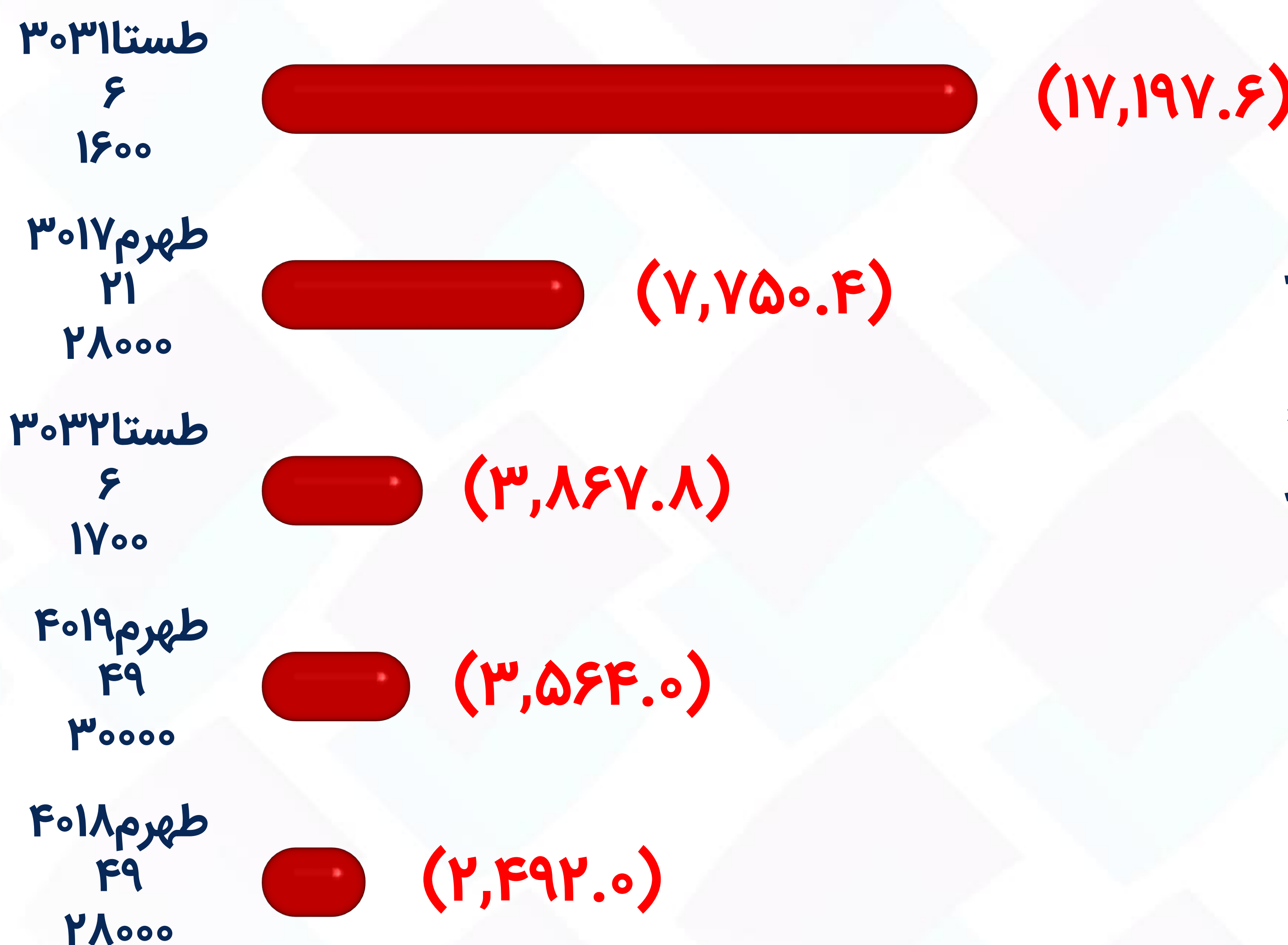
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

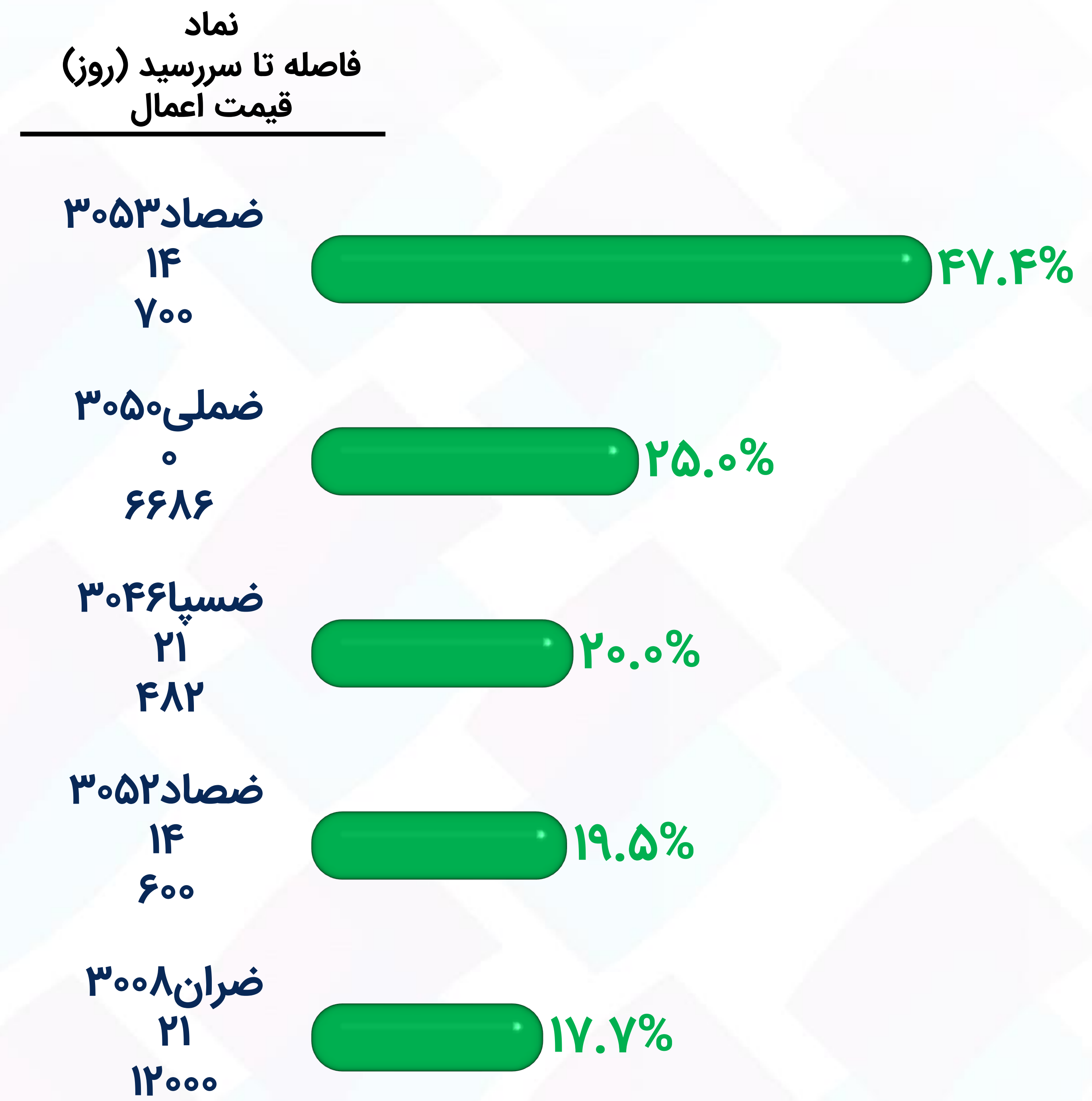
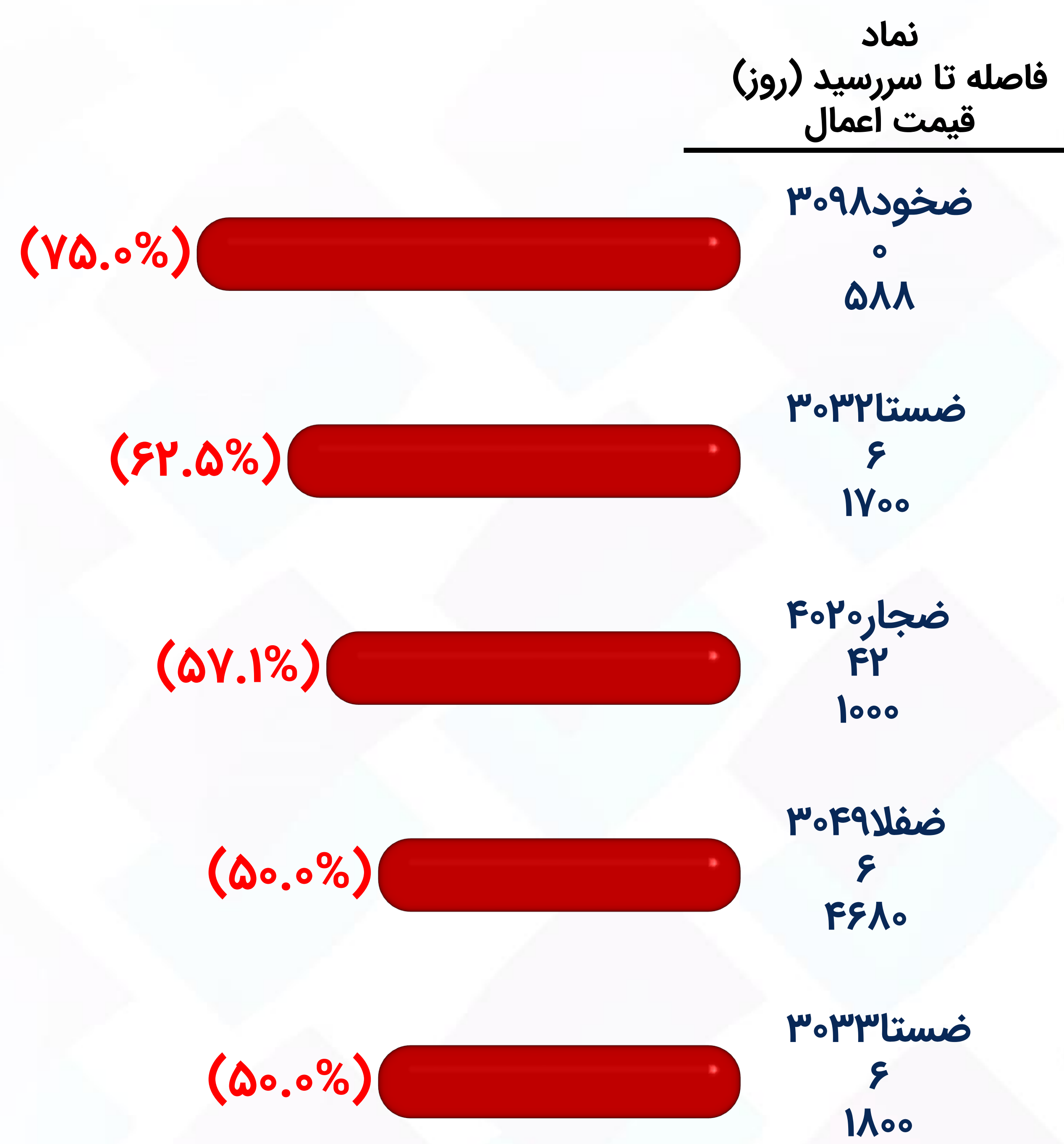
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



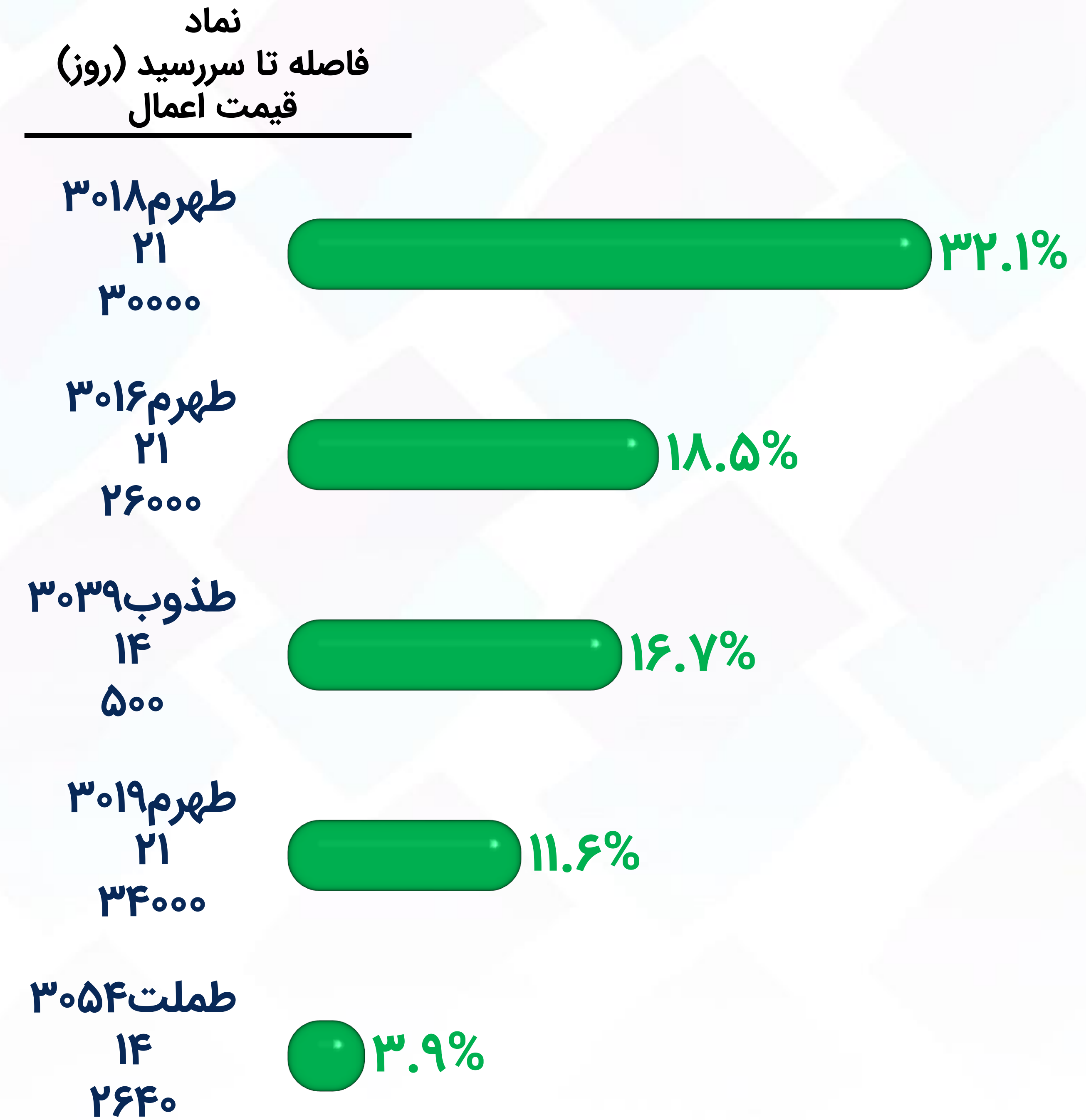
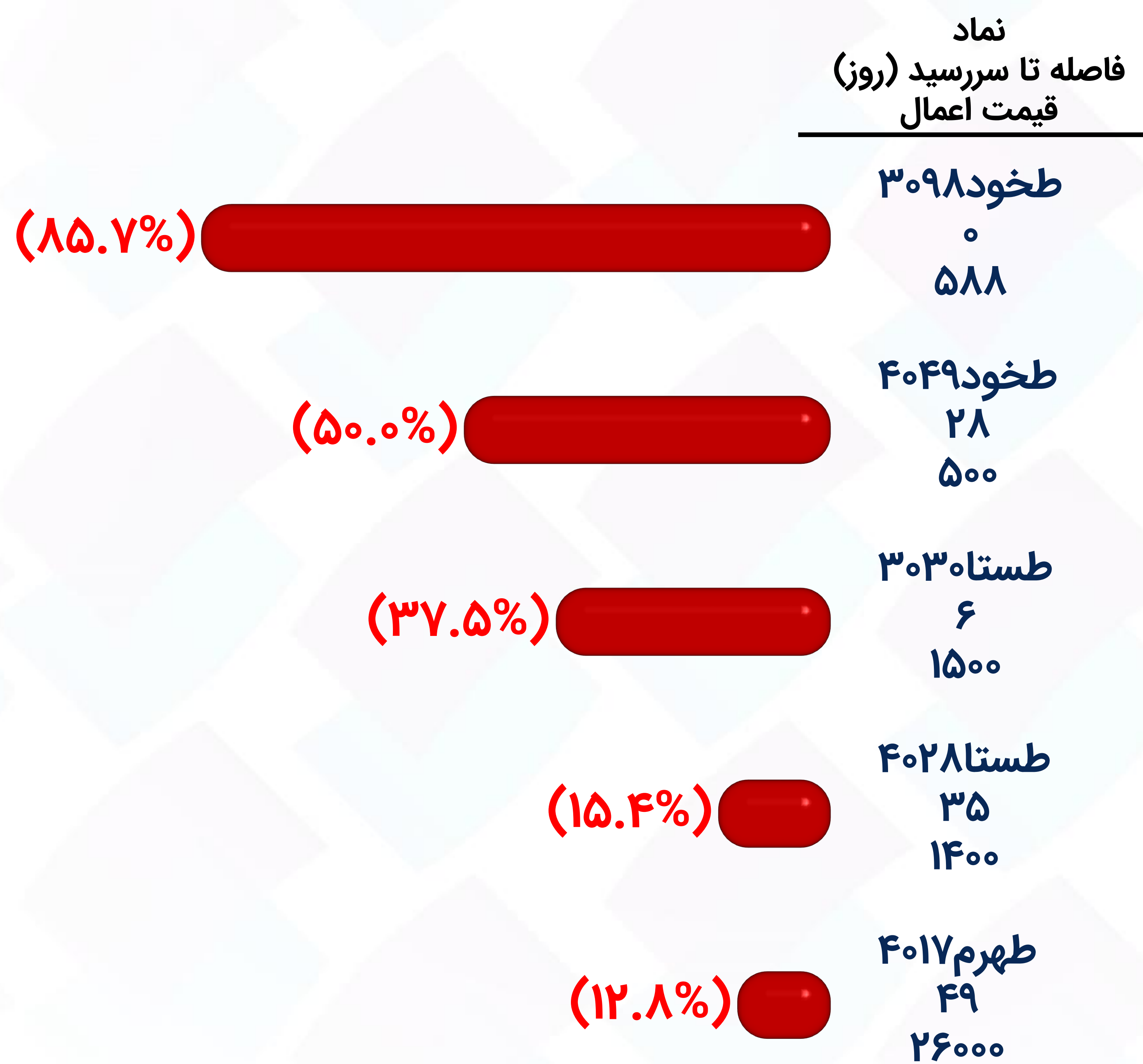
میلیون تومان

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.