

شماره
۴۸۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ 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



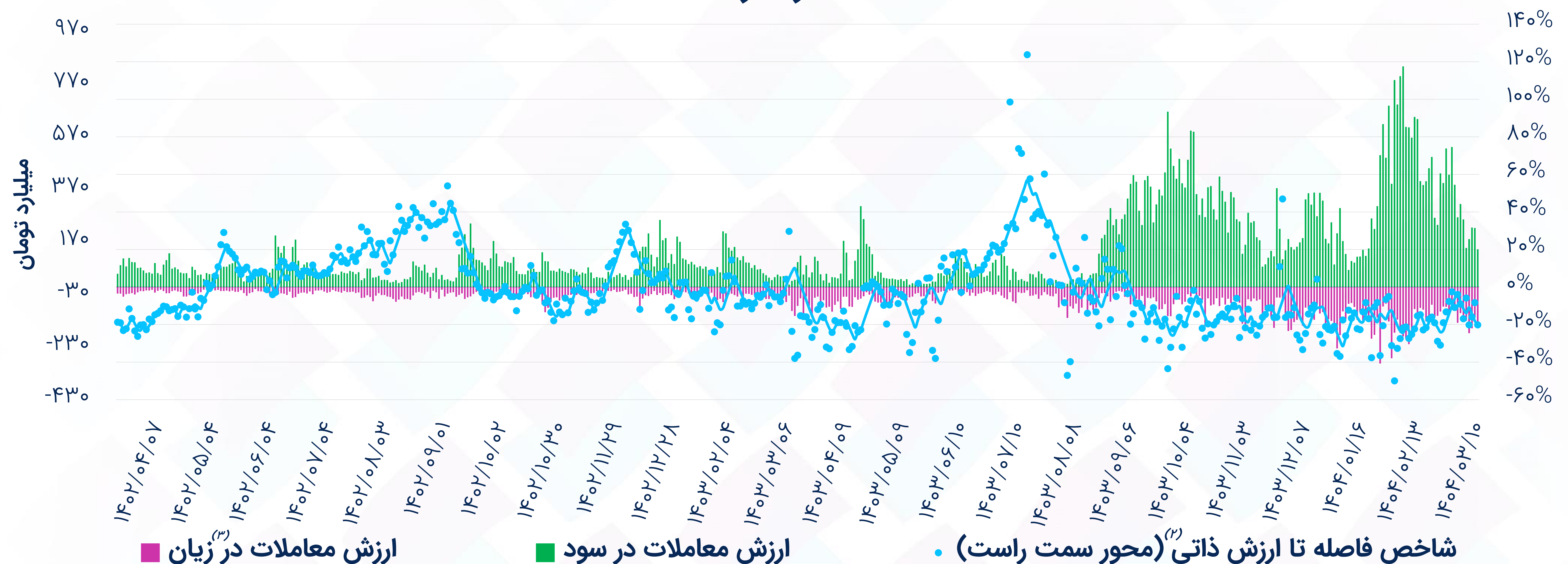
اختیار فروش



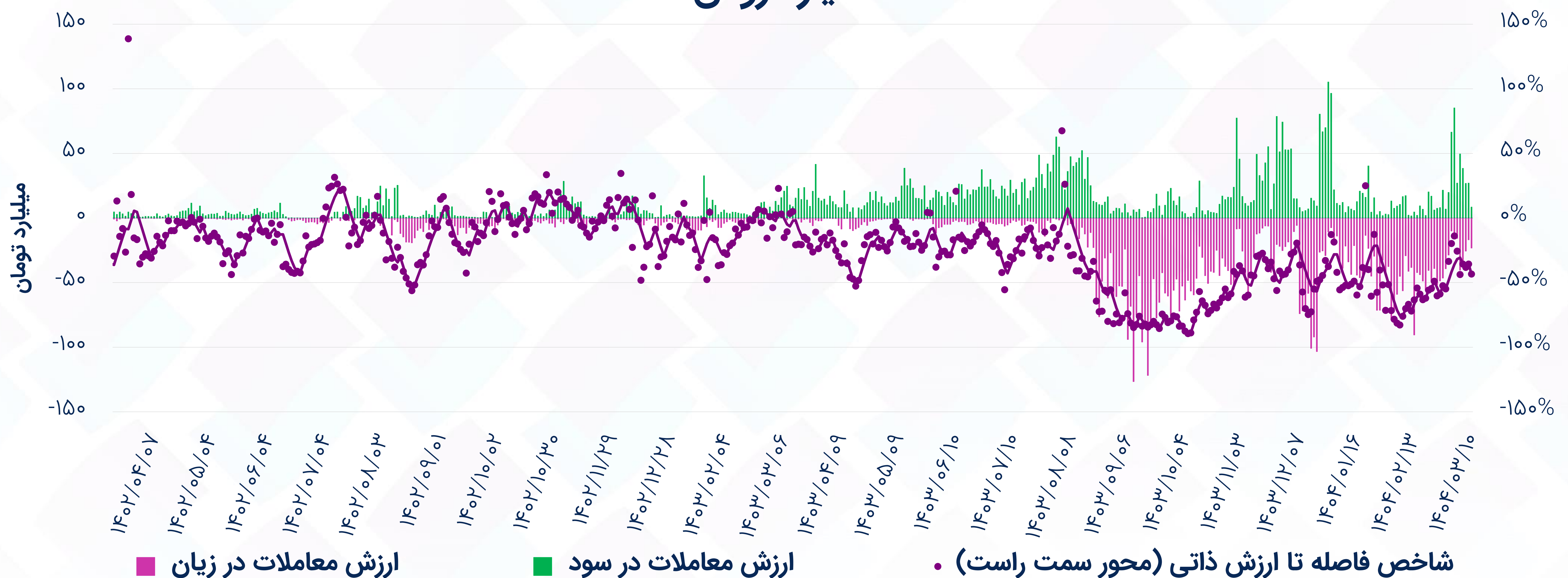
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

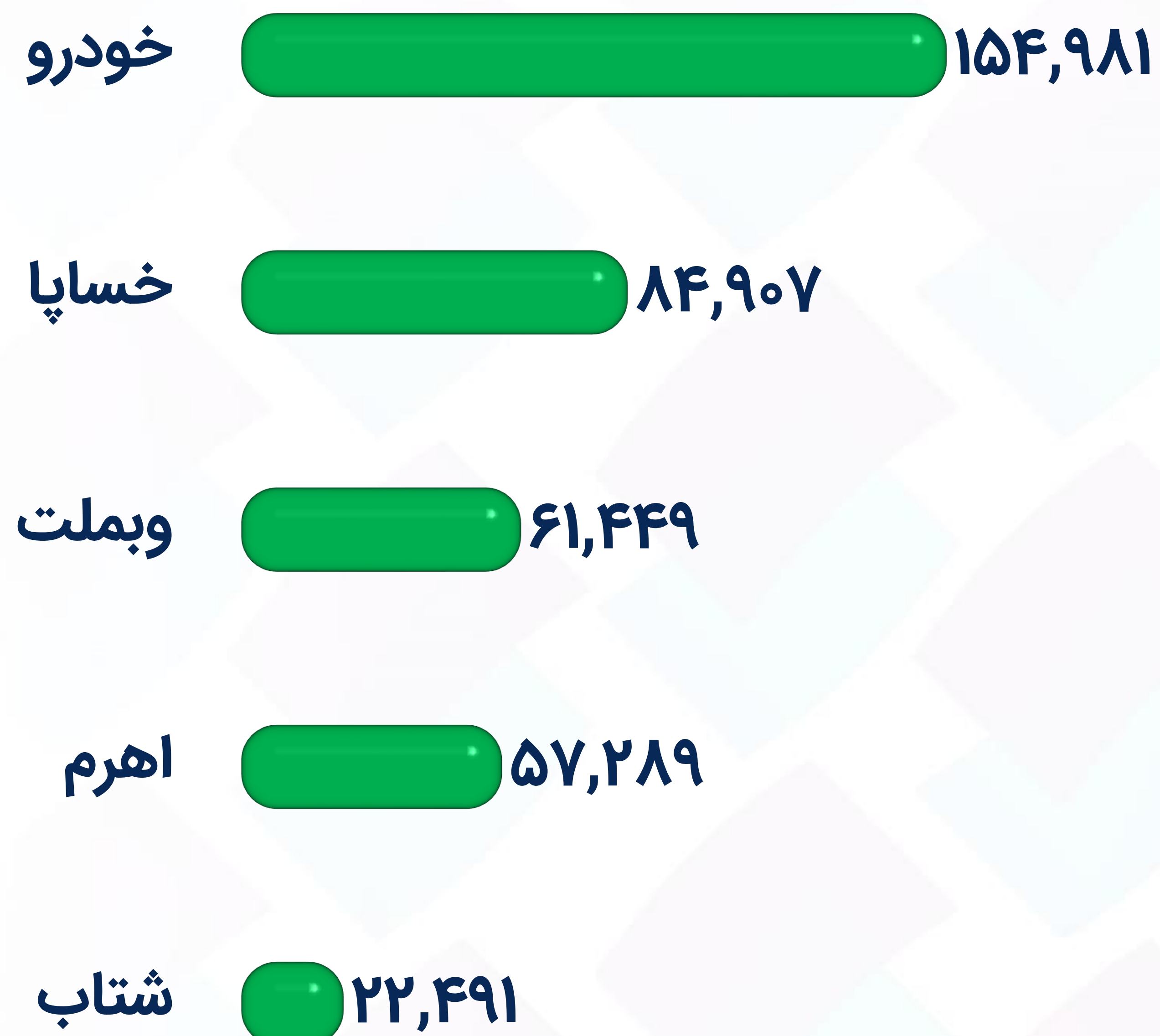
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۶	۱۵۴.۸	۲,۶۴۹.۵	۵۵.۲	۹۹.۶	(۳۵.۲%)
شستا	۴۴	۳۲.۹	۱,۱۹۰.۲	۲۱.۳	۱۱.۶	۵.۱%
خودرو	۲۲	۲۲.۶	۳۱۷.۶	۱۲.۵	۱۰.۱	(۷.۴%)
وبصادر	۱۸	۱۵.۹	۱۳۶.۰	۱۵.۷	۰.۳	(۴.۵%)
ذوب	۲۷	۱۴.۰	۲۰۸.۸	۹.۲	۴.۸	(۱۶.۸%)
شتاب	۱۱	۱۰.۵	۵۸.۷	۱۰.۴	۰.۱	۱.۲%
خسپا	۱۶	۶.۵	۲۵۲.۳	۱.۲	۵.۳	۵۳.۶%

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	۱۲	۲۶,۰۸۴.۰	۷۳۴,۵۵۱.۴	۳,۸۶۶.۳	۲۲,۲۱۷.۷	(۴۷.۳%)
خودرو	۹	۲,۸۰۶.۴	۸۷,۹۷۱.۰	۲,۰۸۶.۲	۷۲۰.۱	(۲۰.۶%)
شستا	۱۰	۲,۷۸۶.۹	۲۱۷,۳۹۱.۳	۲,۵۰۸.۸	۲۷۸.۱	(۳۰.۵%)
وبصادر	۳	۶۱.۱	۸,۶۵۷.۸	۰.۰	۶۱.۱	(۴۴.۳%)
توان	۲	۵۱.۰	۸۰۶.۰	۵۱.۰	۰.۰	(۲۸.۵%)
وبملت	۵	۲۲.۰	۵,۲۴۲.۲	۰.۶	۲۱.۴	(۶۵.۸%)
خودران	۲	۱۵.۰	۱۹۸.۶	۱۵.۰	۰.۰	(۱۲.۲%)

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

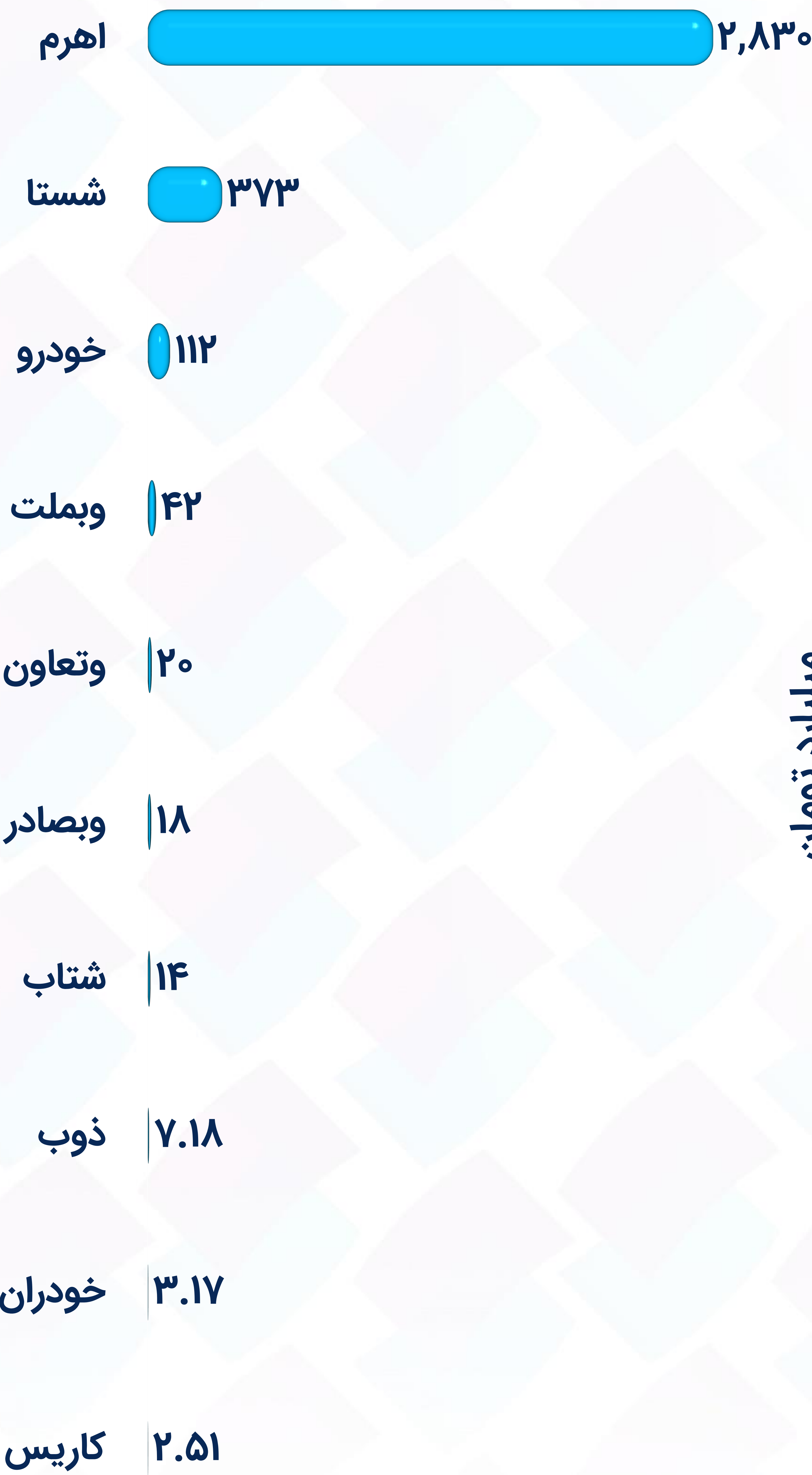


میلیون تومان

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

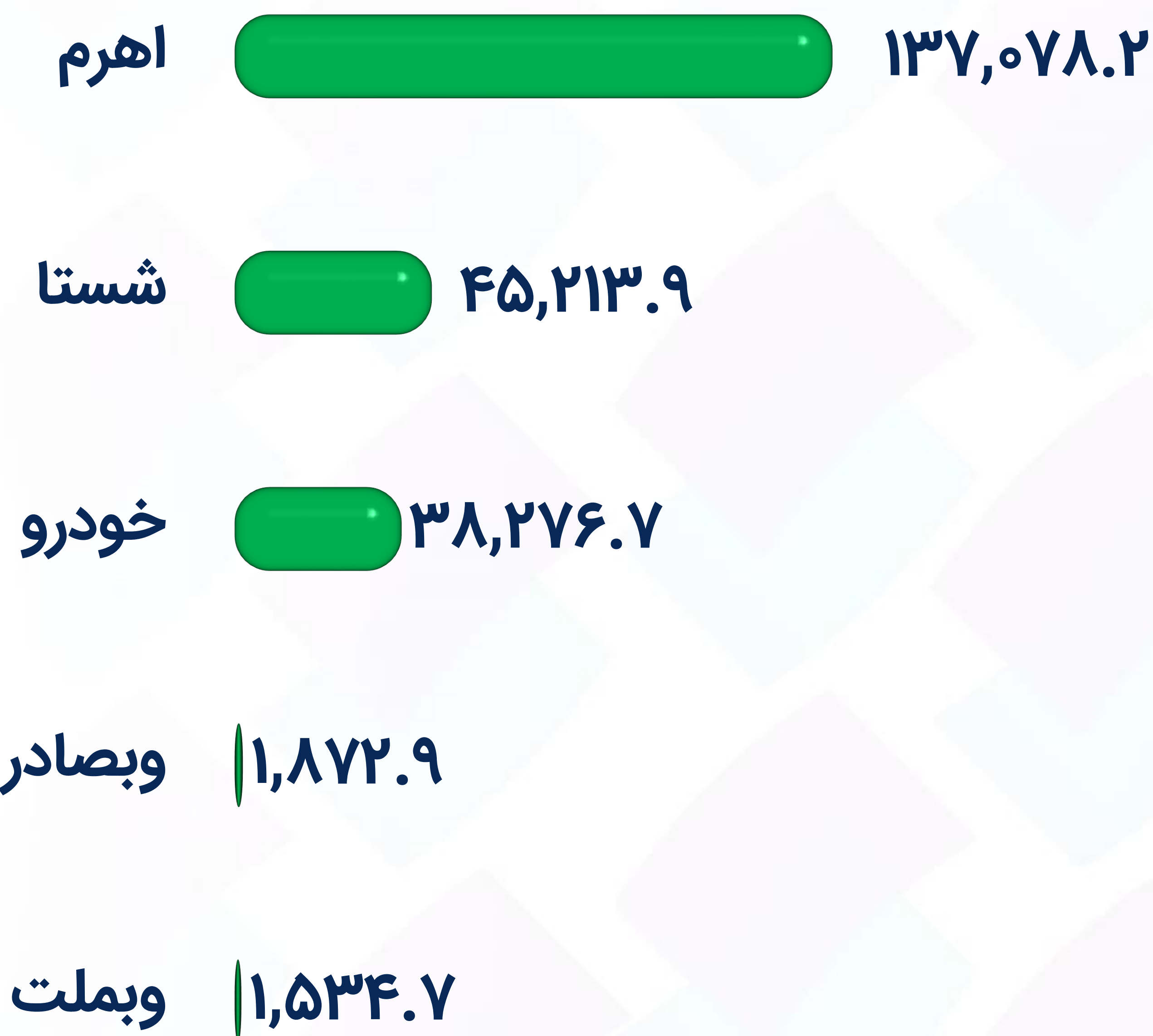
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

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
ضسپا۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۱۸	۱,۳۸۷.۳	۵	۵۲۵	۶۰۸	۱۵.۸%	۱۲۱.۶	۰.۲۵	۱۲	۱۳۲%
ضمخا۵۰۰۲	اخابر	۵۰۰	۷۴	۱.۰	۹۸	۶۷۶	۵۹۸	(۱۱.۵%)	۶.۱	۰.۹۸	۲۱۱	۱۱۵%
ضتاب۳۰۰۸	شتاب	۱۸,۰۰۰	۳	۶.۹	۴۷	۱۷,۱۵۰	۱۸,۰۴۷	۵.۲%	۳۸۴.۰	۰.۱۸	۷۸	۶۵%
ضسپا۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۱۸	۳,۹۲۵.۹	۲۱	۵۲۵	۵۶۴	۷.۴%	۲۶.۹	۰.۴۹	۳۰	۴۱%
ضبساما۷۱۲	بساما	۷,۰۰۰	۱۲۰	۱۷.۰	۱,۷۰۰	۸,۵۷۰	۸,۷۰۰	۱.۵%	۵.۱	۱.۰۰	۲,۲۹۲	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
ضستا۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۳	۲.۸	۱	۱,۵۹۱	۲,۲۰۱	۳۸%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۱۱	۱۳.۵	۱	۴۷۸	۷۰۱	۴۷%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب۴۰۰۸	ذوب	۱,۰۰۰	۴۶	۱.۱	۳	۴۷۸	۱,۰۰۳	۱۱۰%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا۳۰۳۵	شستا	۲,۰۰۰	۳	۶.۹	۱	۱,۵۹۱	۲,۰۰۱	۲۶%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۱۱	۳.۹	۱	۷۱۰	۱,۰۰۱	۴۱%	۱,۰۰۱.۰	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
تسپا ۳۰۴۶	خسپا	۴۸۲	۱۸	۵.۲	۵	۵۲۵	۴۷۷	(۹.۱%)	۹۵.۴	-۰.۲۴	۱۳	۱۵۴.۶%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۱۶	۳.۳	۴۶	۱,۸۲۳	۱,۸۵۴	۱.۷%	۴۰.۳	-۰.۶۸	۷۱	۵۴.۴%
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۸	۷۲.۲	۵,۲۷۳	۲۸,۵۳۰	۲۸,۷۲۷	۰.۷%	۵.۴	-۰.۹۸	۴,۹۲۵	(۶.۶%)
طران ۳۰۱۰	خودران	۱۴,۰۰۰	۱۸	۱.۹	۱,۷۳۱	۱۲,۱۹۰	۱۲,۲۶۹	۰.۶%	۷.۱	-۰.۹۴	۱,۶۰۱	(۷.۵%)
طخود ۴۰۴۹	خودرو	۵۰۰	۲۵	۷۱۷.۸	۶	۵۶۴	۴۹۴	(۱۲.۴%)	۸۲.۳	-۰.۱۳	۵	(۸.۸%)

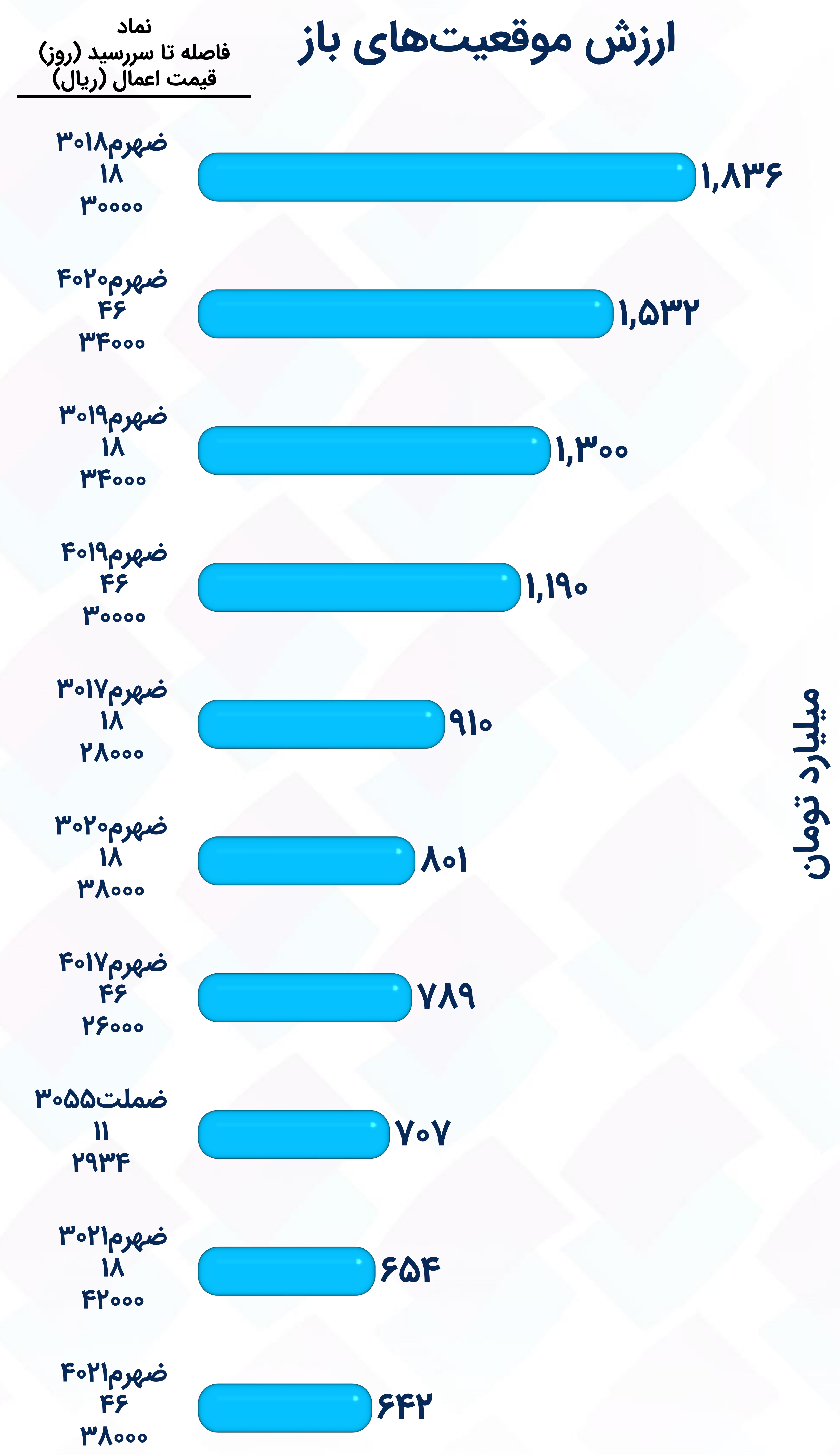
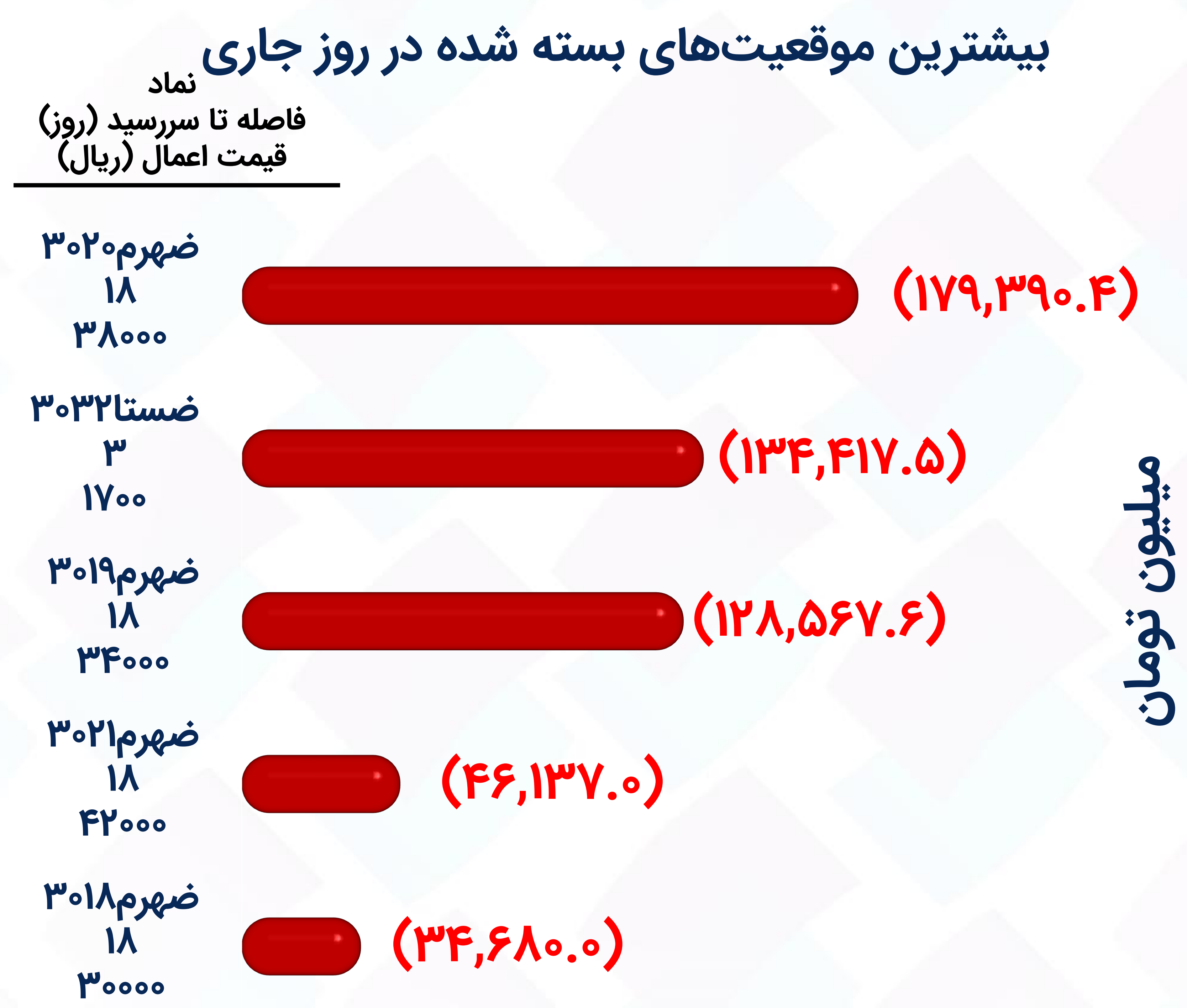
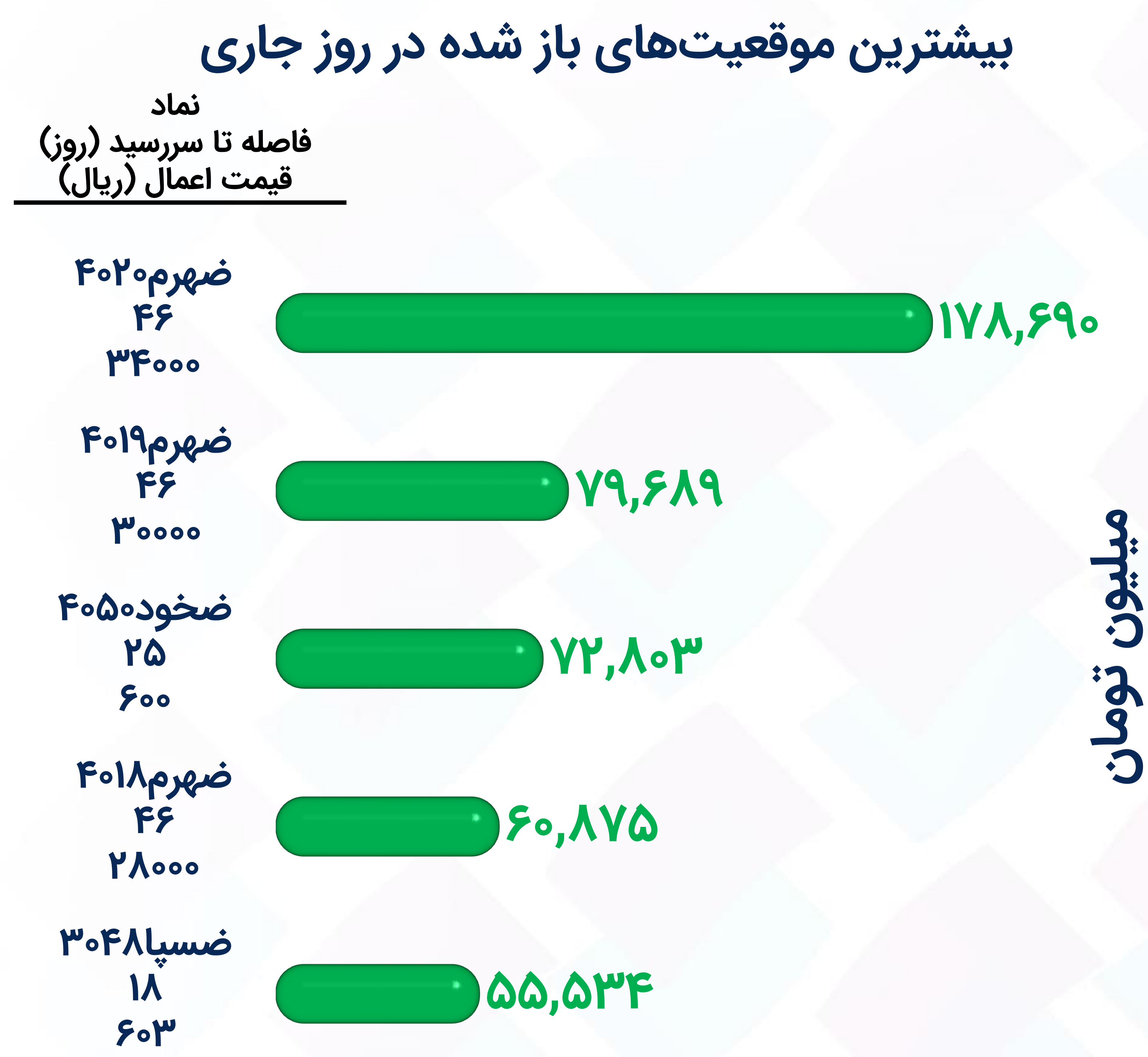
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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 ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۱۱	۰.۳	۱	۷۱۰	۳۹۹	(۴۳.۸%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۳۰۲۷	شستا	۱,۲۰۰	۳	۰.۰	۱	۱,۵۹۱	۱,۱۹۹	(۲۴.۶%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۱۱	۰.۲	۱	۲,۷۳۹	۱,۹۰۶	(۳۰.۴%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۲	وبملت	۲,۲۰۰	۱۱	۰.۷	۲	۲,۷۳۹	۲,۱۹۸	(۱۹.۸%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طستا ۳۰۲۹	شستا	۱,۴۰۰	۳	۰.۱	۱	۱,۵۹۱	۱,۳۹۹	(۱۲.۱%)	۱,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)

(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



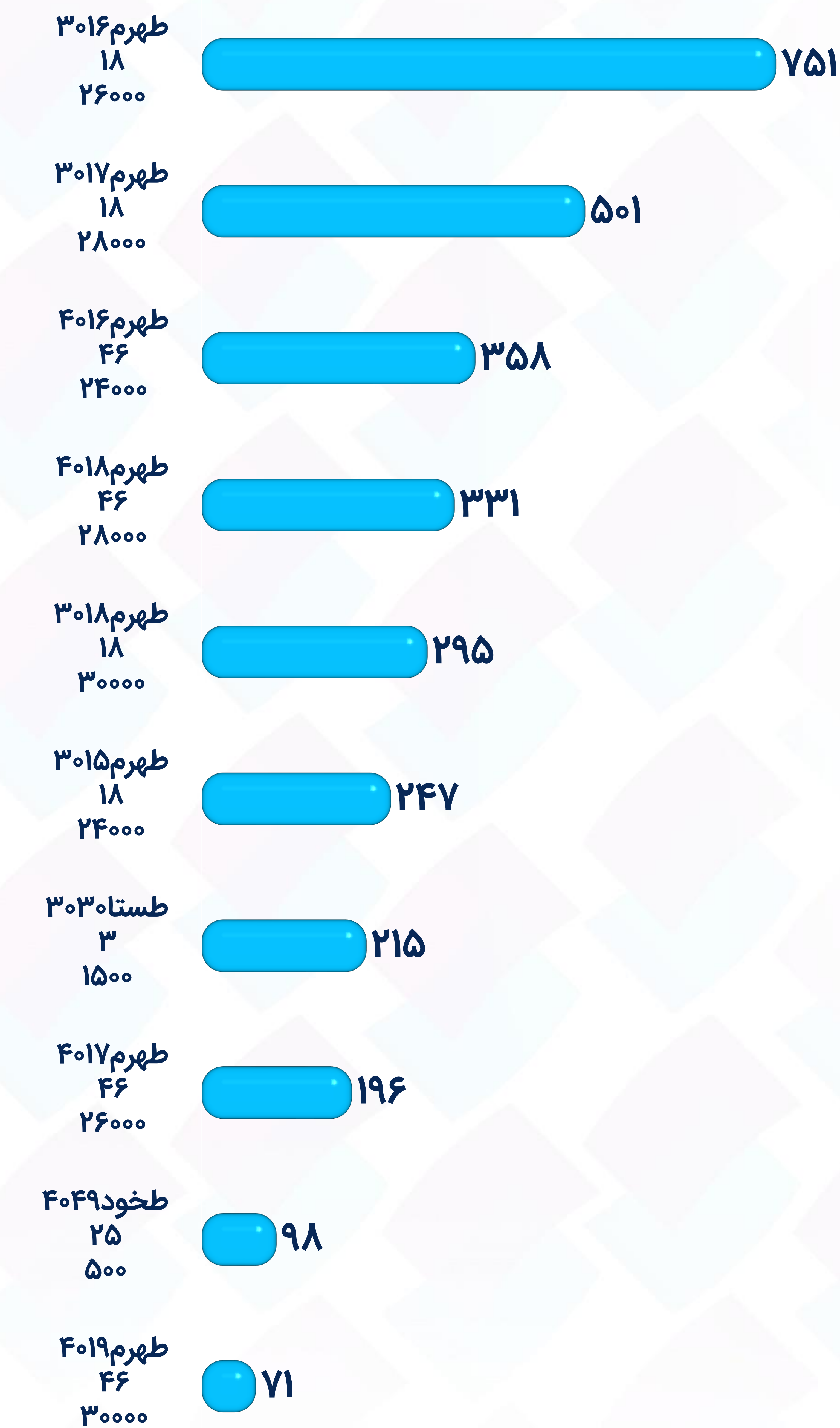
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

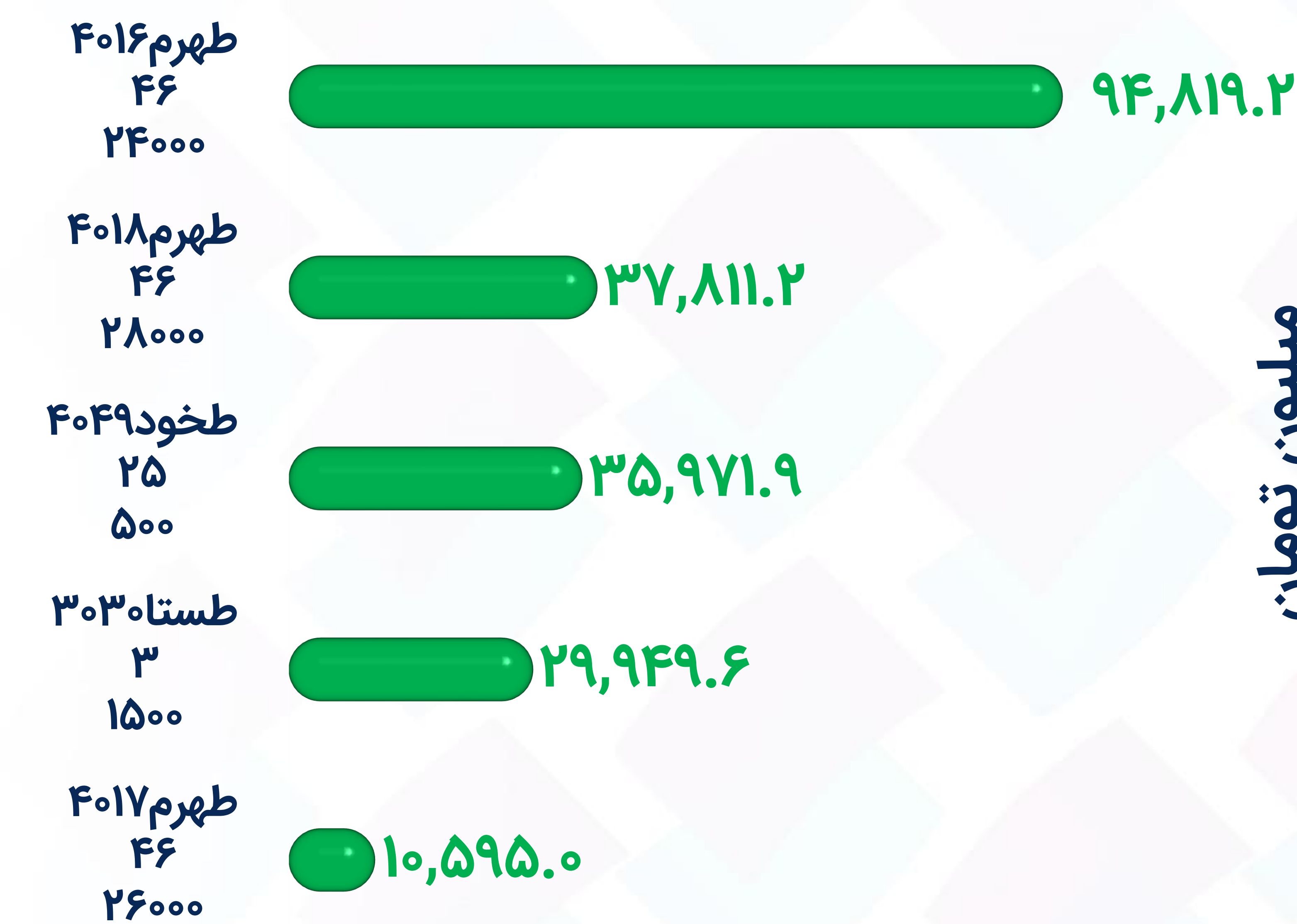
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

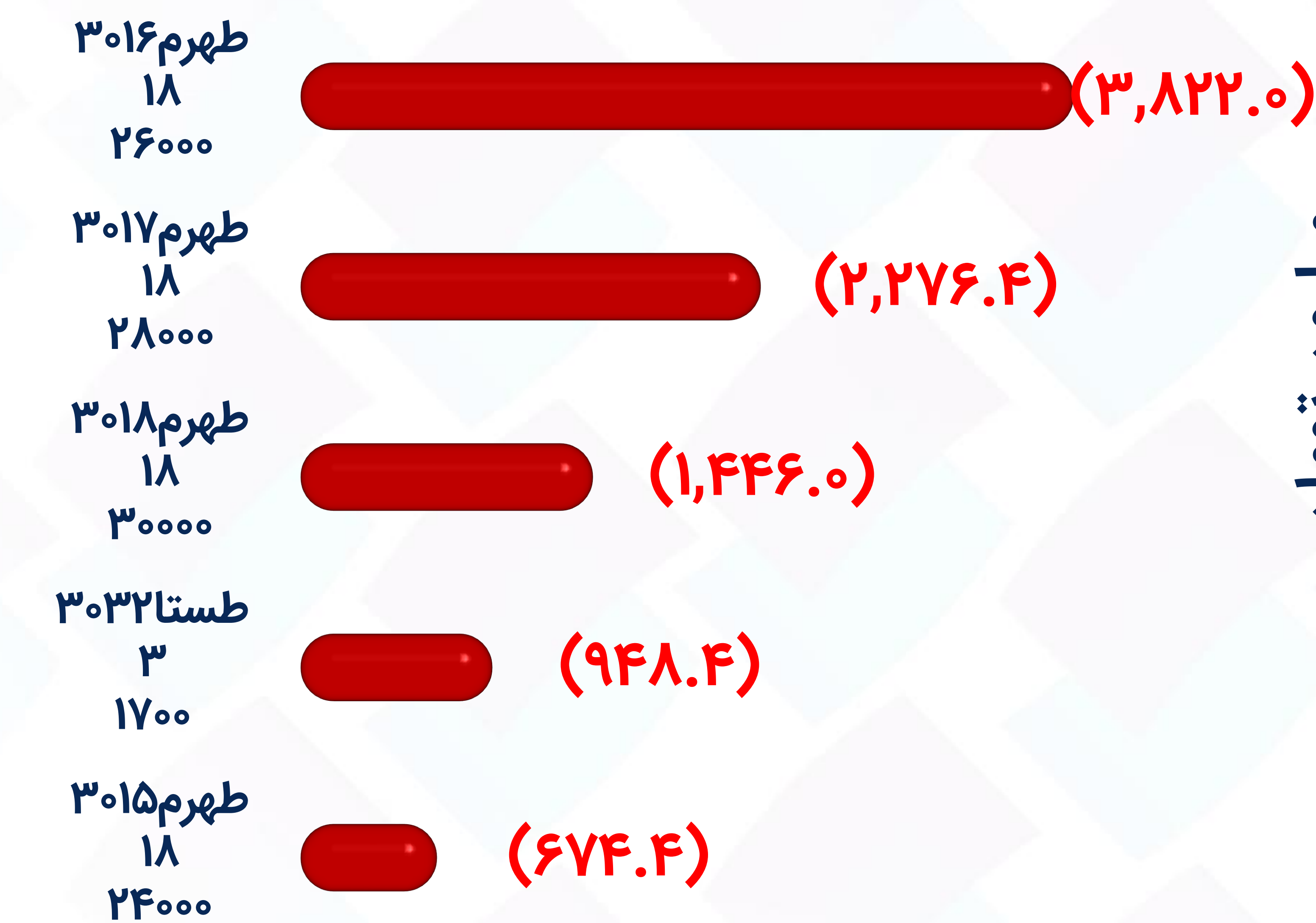
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

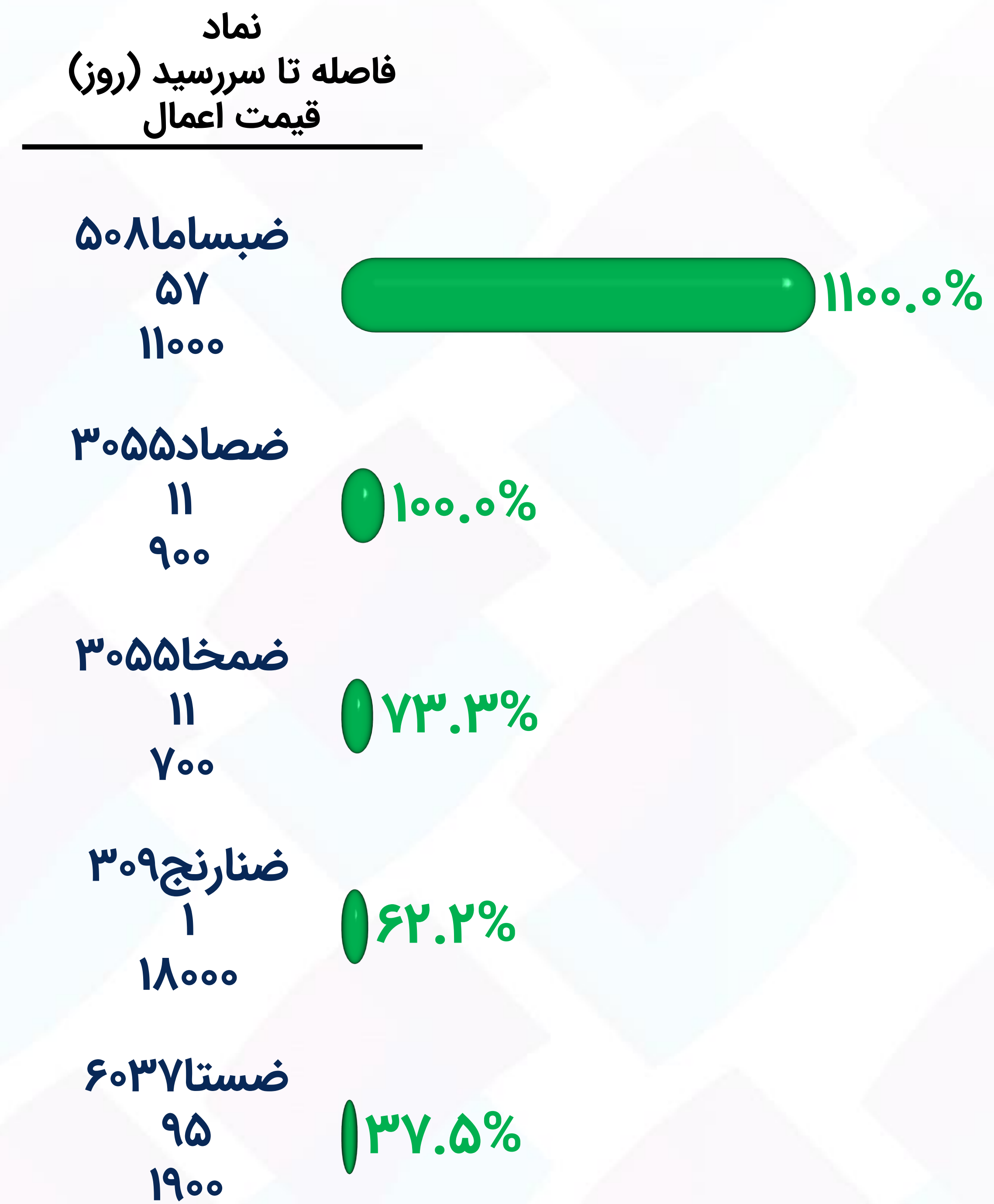
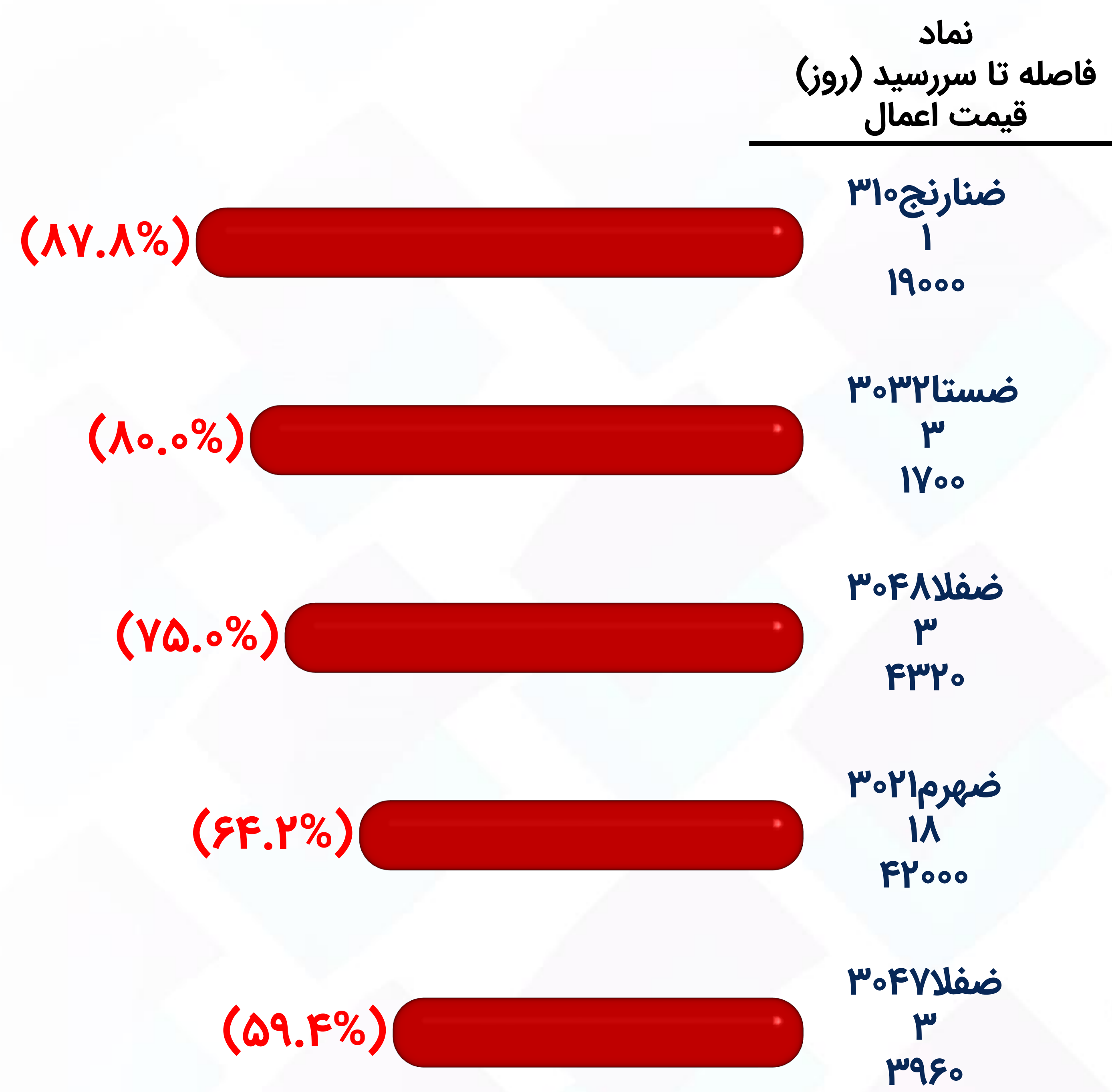
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



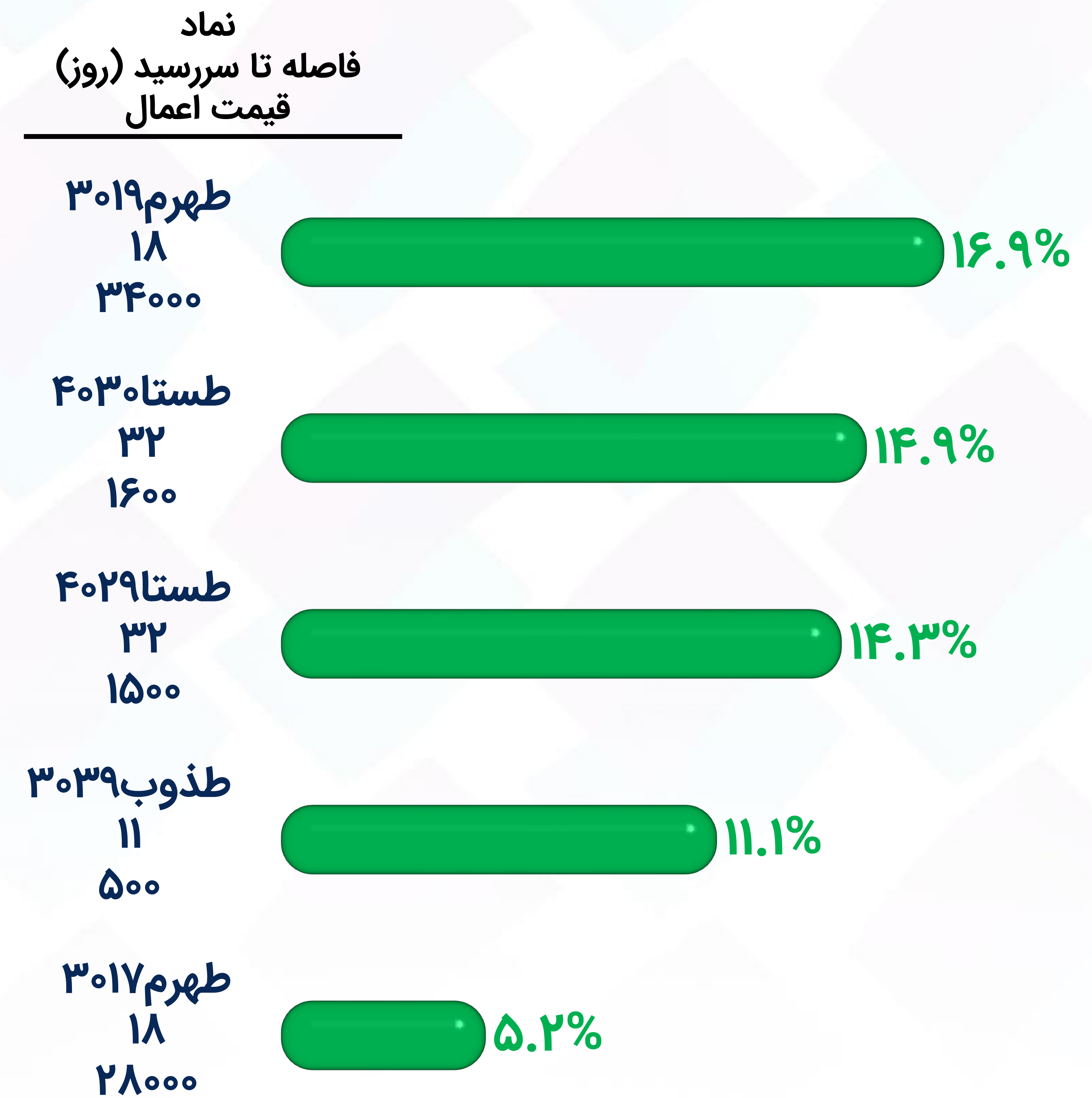
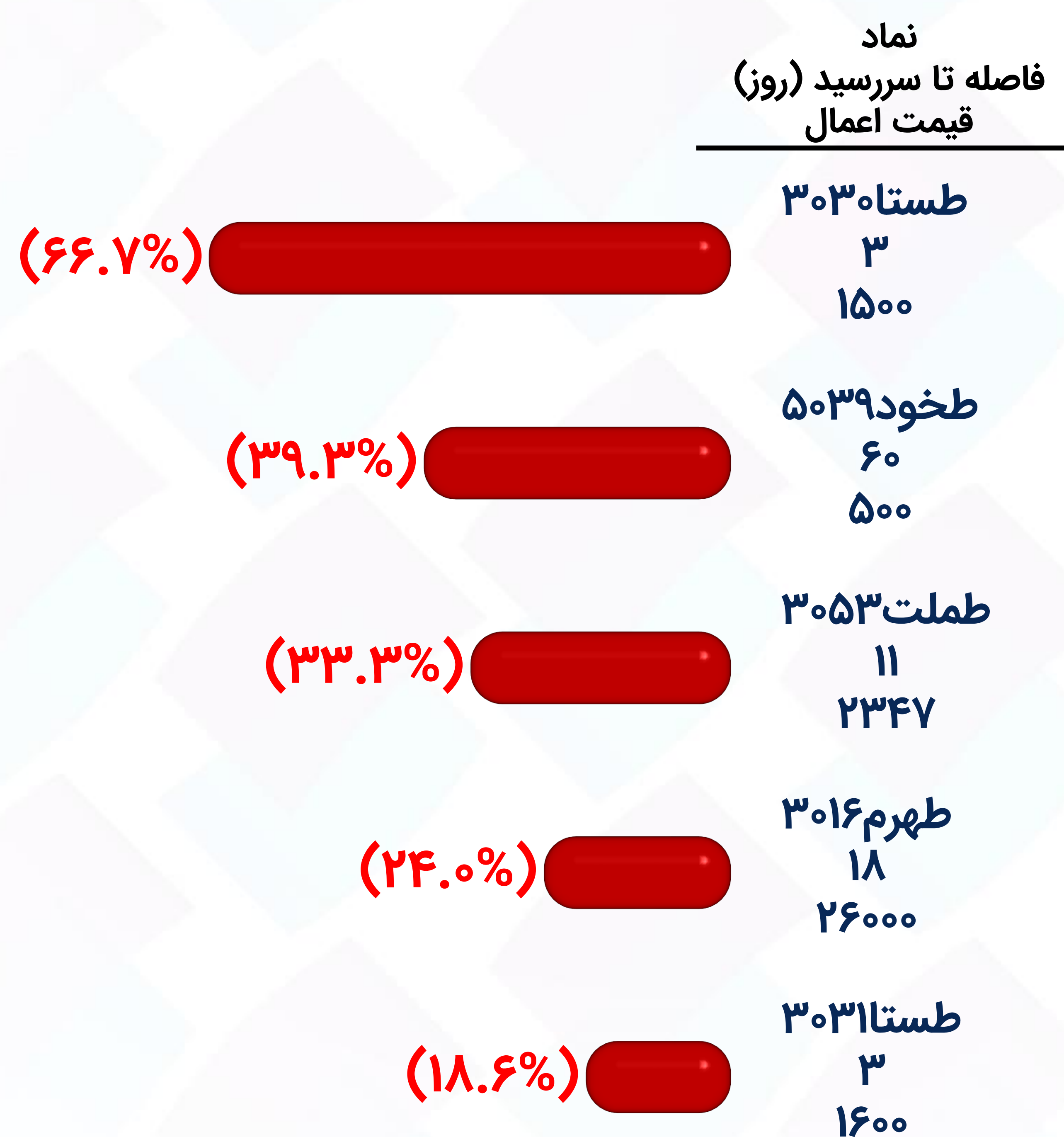
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

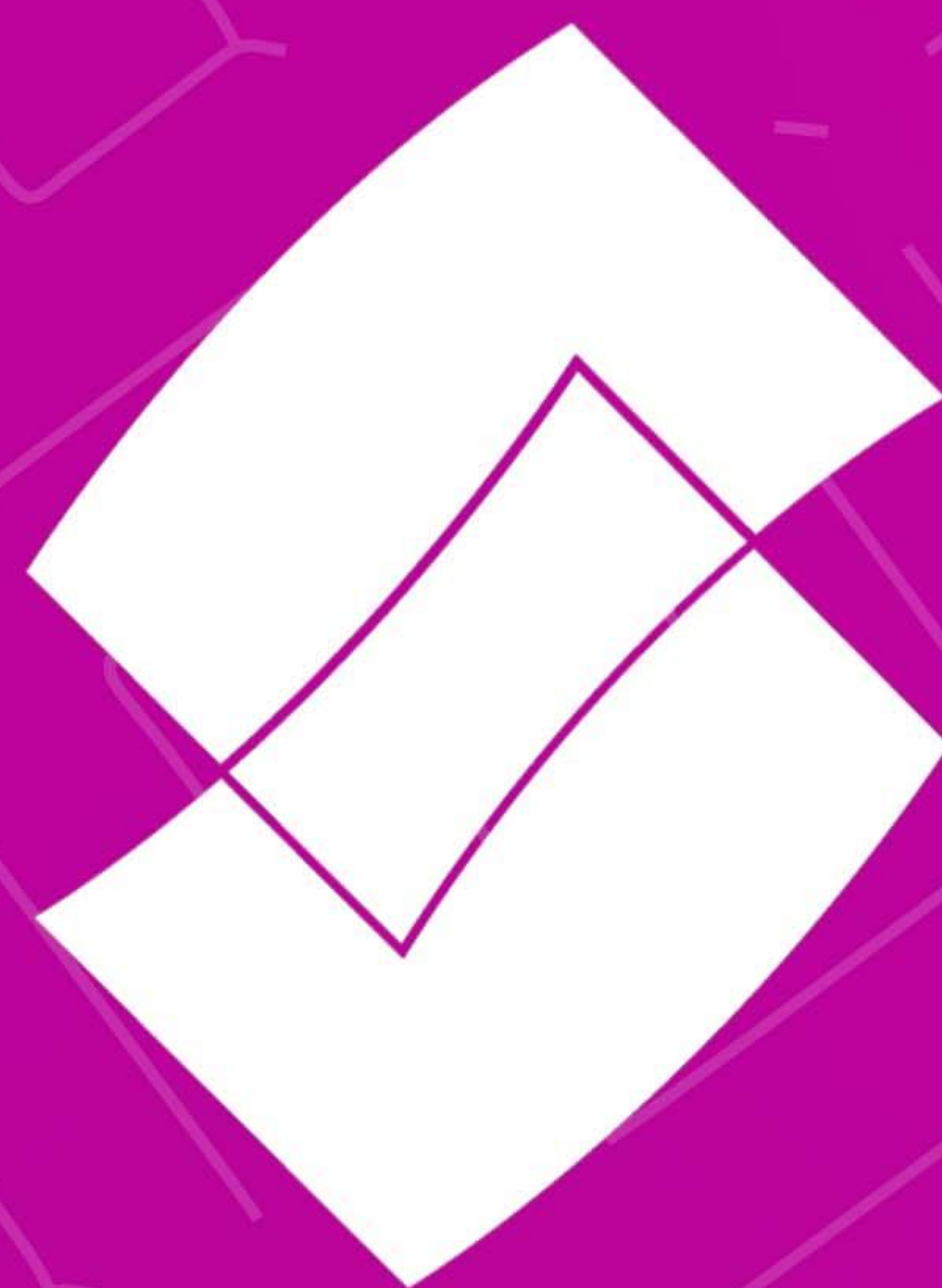
اختیار خرید



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.