

شماره
۴۹۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۱ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

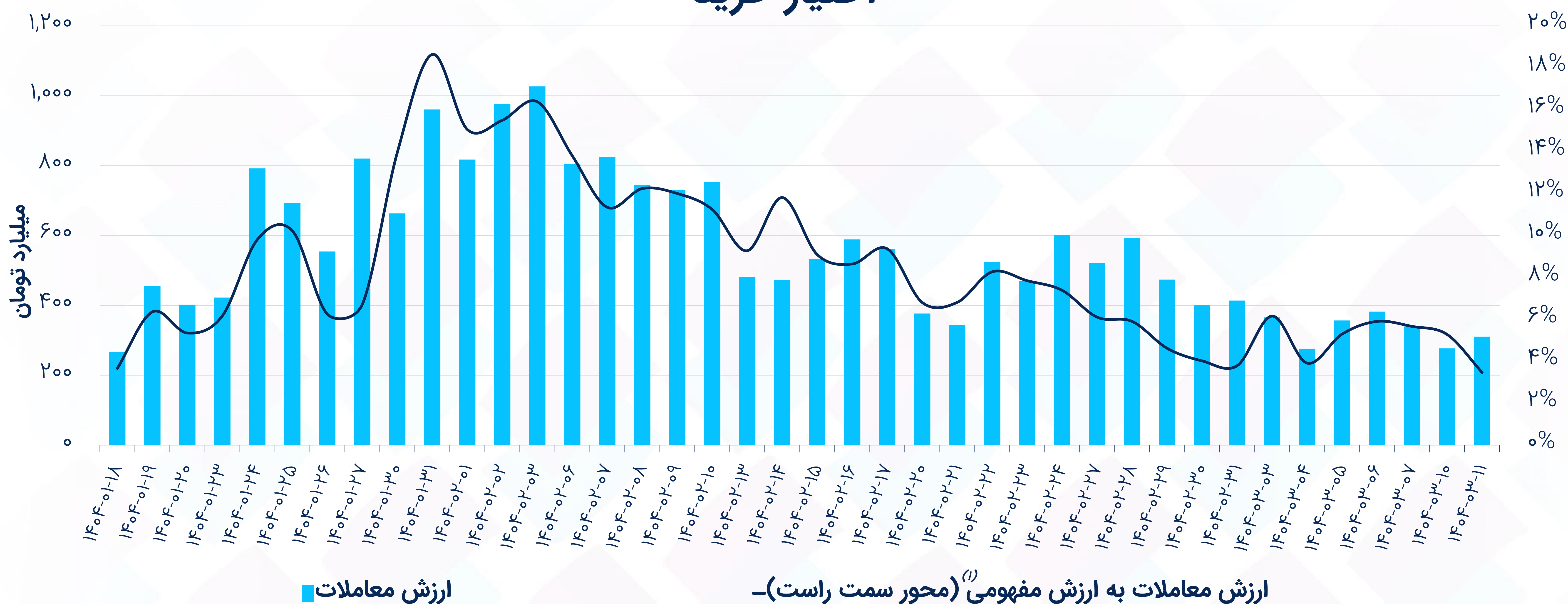




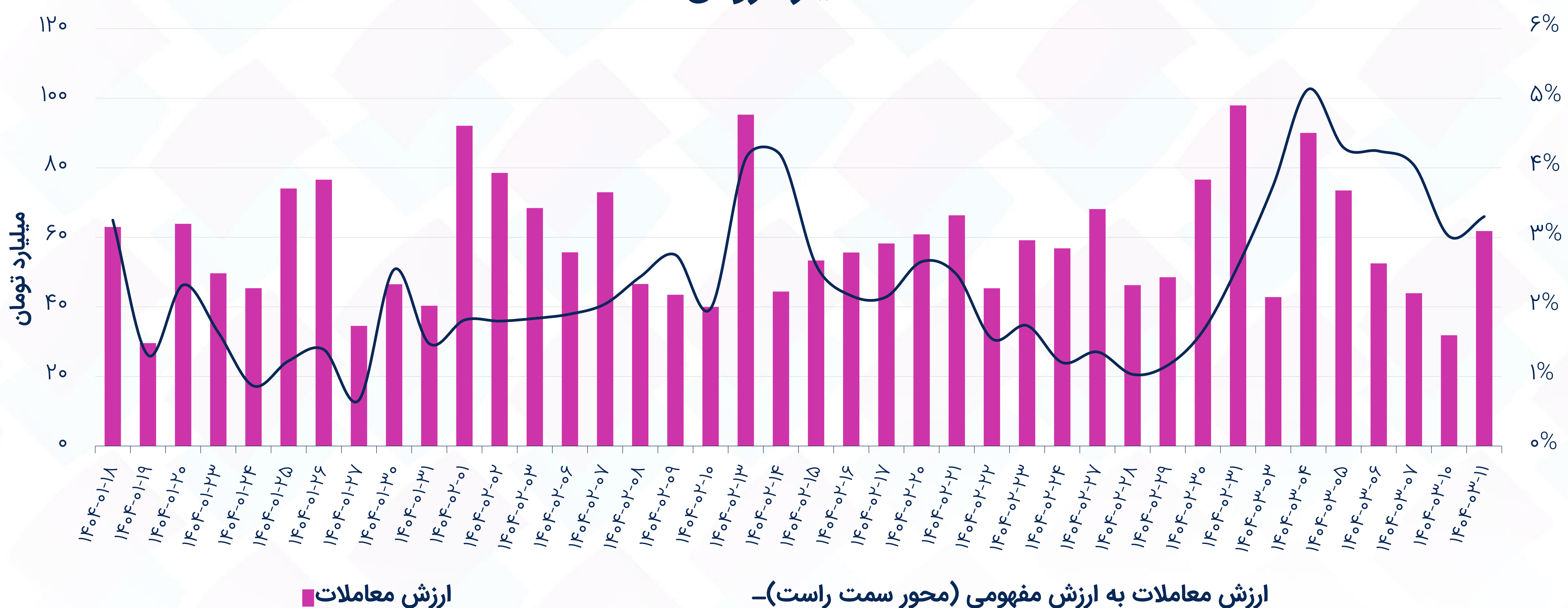
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



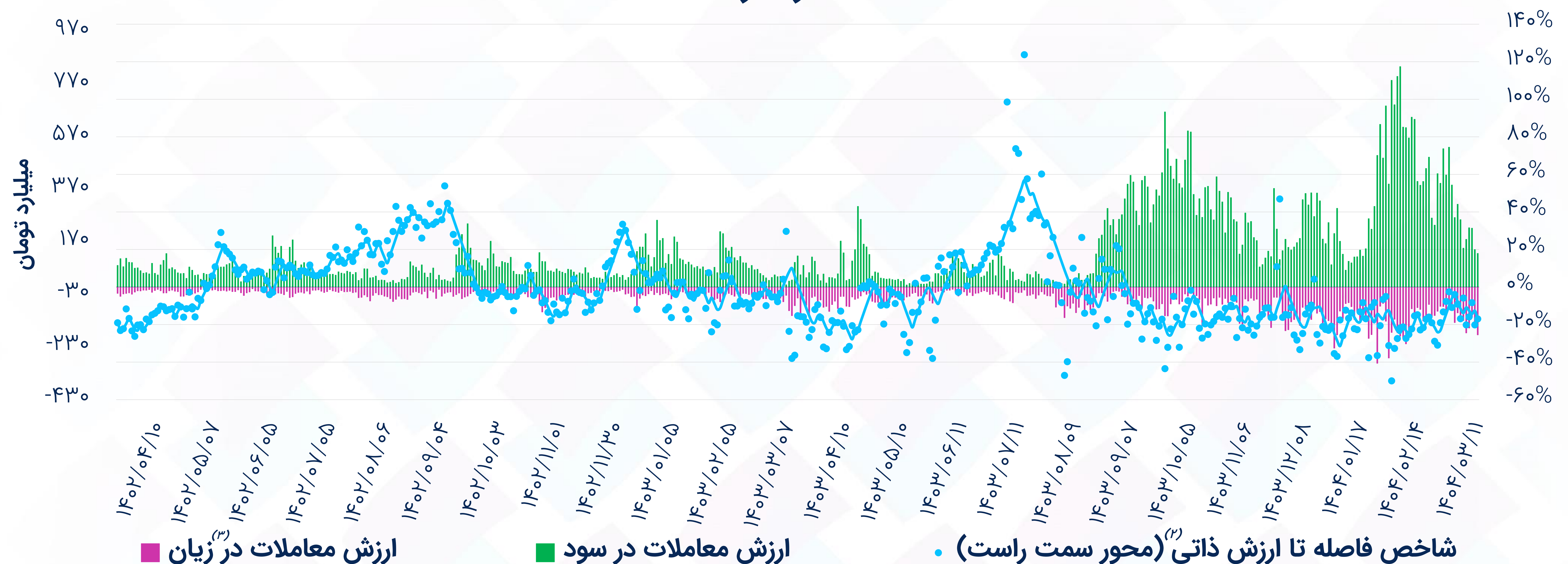
اختیار فروش



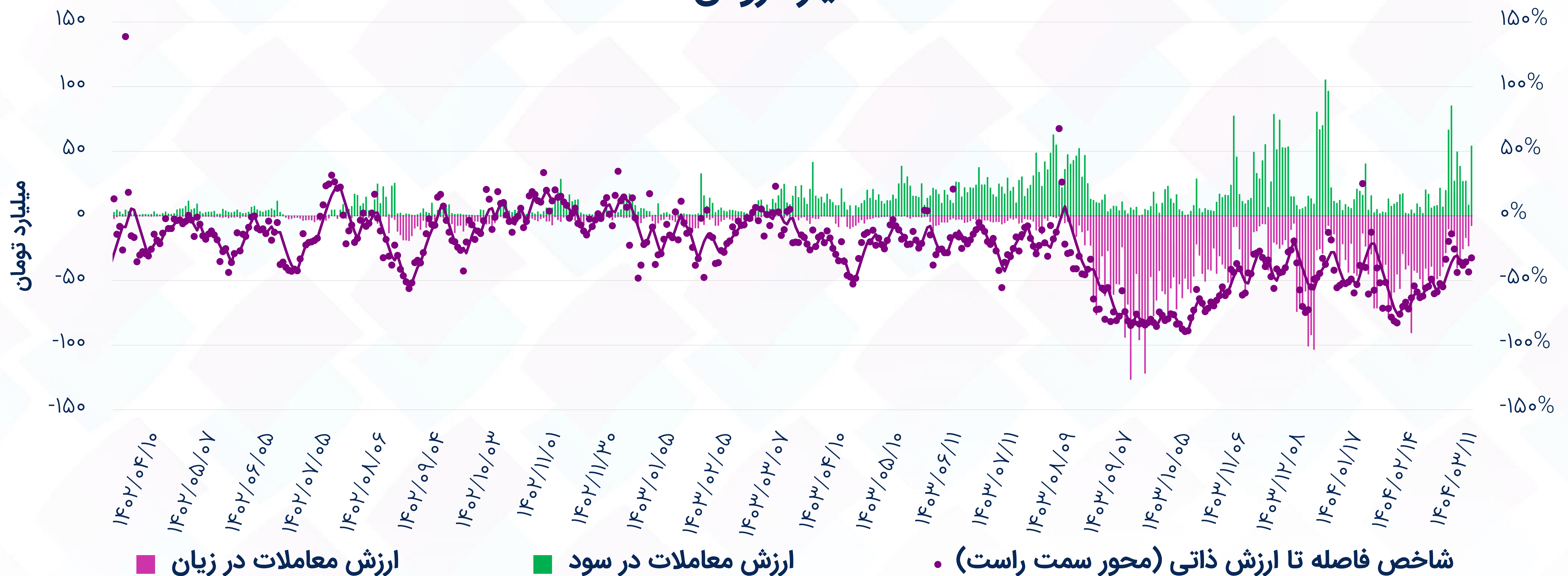
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

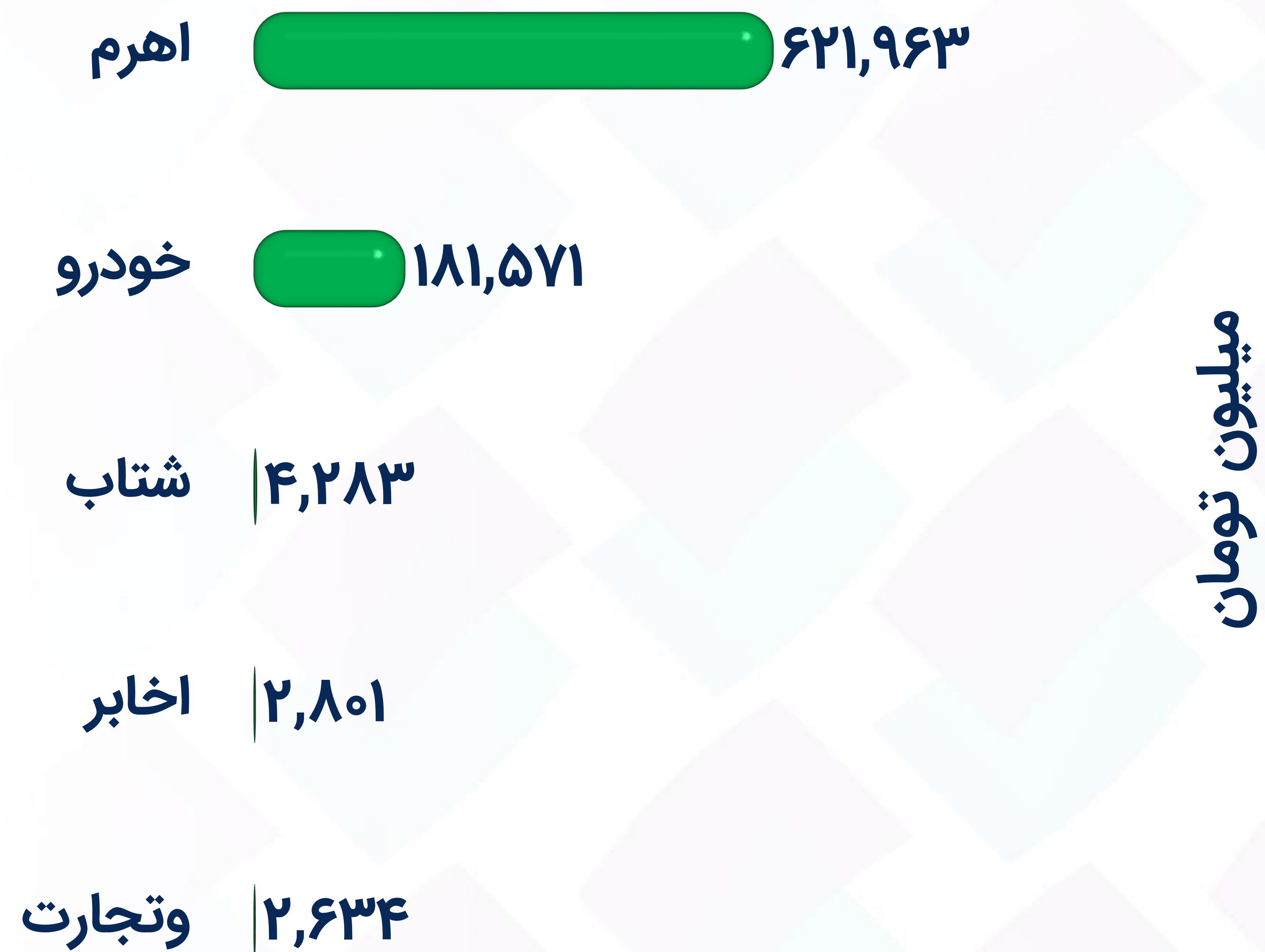
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۶	۲۰۷.۰	۶,۳۱۷.۲	۵۶.۹	۱۵۰.۱	(۲۷.۲%)
خودرو	۲۵	۳۰.۳	۴۴۵.۹	۱۷.۷	۱۲.۶	(۹.۶%)
شستا	۴۸	۲۶.۴	۱,۲۱۲.۸	۱۹.۳	۷.۱	۲۶.۱%
ذوب	۲۷	۱۲.۰	۱۷۴.۱	۸.۵	۳.۴	(۱۲.۶%)
وبصادر	۱۶	۱۱.۰	۱۱۰.۴	۹.۲	۱.۸	(۱.۲%)
وبملت	۲۷	۶.۰	۲۷۷.۷	۵.۳	۰.۶	(۱.۹%)
خسپا	۱۹	۵.۹	۲۲۱.۰	۲.۰	۴.۰	۳۶.۲%

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
اهرم	۱۹	۵۰,۷۸۷.۶	۱,۴۸۱,۶۵۱.۴	۴۴,۴۶۸.۹	۶,۳۱۸.۶	(۳۴.۳%)
شستا	۸	۶,۵۱۳.۵	۲۷۸,۹۵۱.۲	۶,۱۹۳.۱	۳۲۰.۴	(۲۵.۷%)
خودرو	۵	۴,۱۹۱.۲	۹۲,۸۴۴.۷	۳,۴۱۲.۹	۷۷۸.۴	(۱۹.۶%)
وبملت	۷	۲۱۹.۱	۱۶,۸۸۱.۶	۱.۷	۲۱۷.۴	(۴۷.۱%)
وبصادر	۴	۵۷.۳	۲,۶۸۴.۴	۵۳.۹	۳.۴	(۴۸.۰%)
ذوب	۳	۳۴.۸	۴۵۷.۹	۳۰.۶	۴.۲	(۳۹.۹%)
توان	۴	۱۲.۳	۲۲۴.۴	۱۰.۳	۲.۰	(۷.۷%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۳,۰۶۴

شستا ۳۴۹

خودرو ۱۲۵

وبملت ۳۵

وتعاون ۲۰

وبصادر ۱۸

شتاب ۱۴

ذوب ۷.۳۷

خودران ۳.۲۰

کاریس ۲.۵۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۳۳,۶۴۷.۰

خودرو ۱۳,۴۵۳.۷

وبصادر ۳۲۷.۹

ذوب ۱۹۳.۳

شپنا ۹۹.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۲۳,۵۶۴.۵)

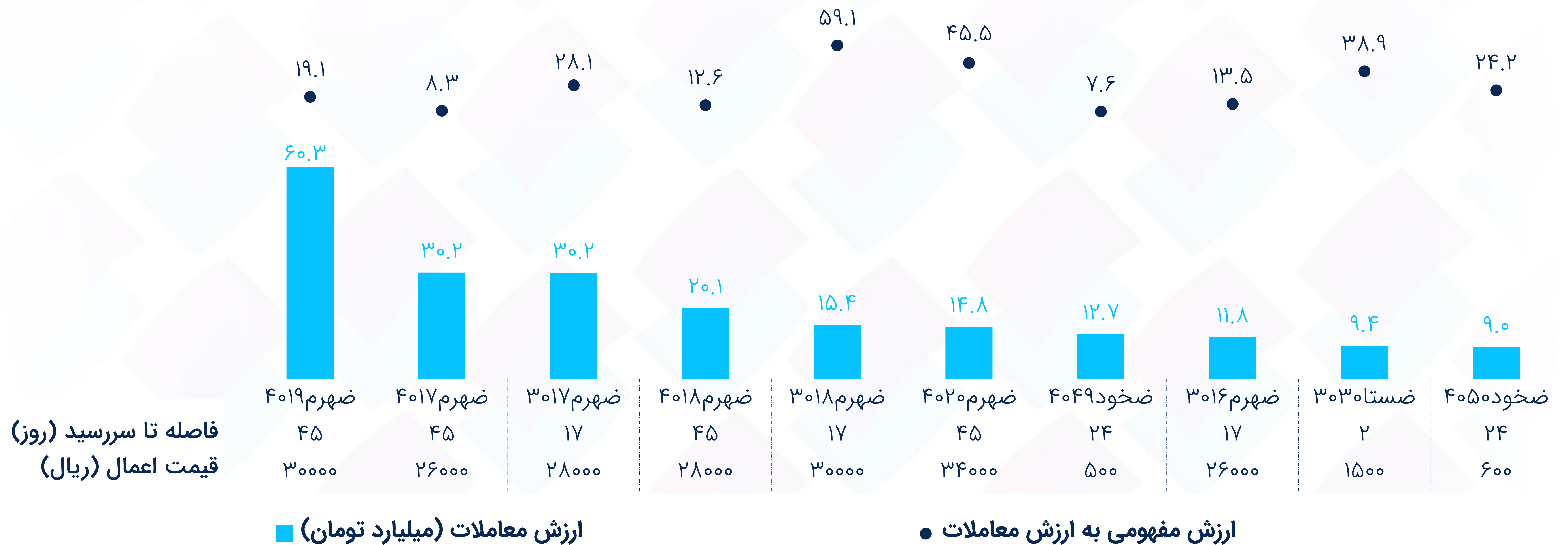
وبملت (۷,۶۱۰.۶)

توان (۱۱۴.۰)

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
خسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۱۷	۸۵۰.۳	۴	۵۱۴	۶۰۷	۱۸.۱%	۱۵۱.۸	۰.۱۹	۸	۹۸%
خستا ۳۰۳۱	خستا	۱,۶۰۰	۲	۱,۱۳۳.۵	۴	۱,۵۵۷	۱,۶۰۴	۳.۰%	۴۰۱.۰	۰.۲۵	۷	۸۲%
خستا ۳۰۳۰	خستا	۱,۵۰۰	۲	۹,۳۹۱.۶	۴۰	۱,۵۵۷	۱,۵۴۰	(۱.۱%)	۳۸.۵	۰.۹۰	۶۶	۶۴%
خبساما ۷۱۴	بساما	۸,۰۰۰	۱۱۹	۱۸.۲	۱,۰۰۰	۸,۵۷۰	۹,۰۰۰	۵.۰%	۹.۰	۰.۹۷	۱,۴۰۷	۴۱%
خفزر ۴۰۲	فزر	۳۹,۳۰۰	۲۸	۵۶.۴	۳,۹۷۲	۴۳,۸۰۰	۴۳,۲۷۲	(۱.۲%)	۱۰.۹	۰.۹۶	۵,۵۵۷	۴۰%

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
خذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۱۰	۱.۰	۱	۴۶۵	۸۰۱	۷۲%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
خستا ۳۰۳۵	خستا	۲,۰۰۰	۲	۳.۷	۱	۱,۵۵۷	۲,۰۰۱	۲۹%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
خفلا ۳۰۴۹	فولاد	۴,۶۸۰	۲	۱.۲	۱	۳,۷۵۸	۴,۶۸۱	۲۵%	۴,۶۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
خبساما ۵۱۰	بساما	۱۳,۰۰۰	۵۶	۱.۱	۲۵۹	۸,۵۷۰	۱۳,۲۵۹	۵۵%	۵۱.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
خستا ۳۰۳۴	خستا	۱,۹۰۰	۲	۲.۶	۱	۱,۵۵۷	۱,۹۰۱	۲۲%	۱,۹۰۱.۰	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 ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۱۵	۱.۳	۴۱	۱,۸۷۵	۱,۸۵۹	(۰.۹%)	۴۵.۳	-۰.۴۹	۴۰	(۲.۹%)
طتوان ۳۲۸	توان	۲۸,۰۰۰	۸	۹.۳	۱,۸۵۰	۲۶,۰۸۹	۲۶,۱۵۰	۰.۲%	۱۴.۱	-۰.۸۹	۱,۷۸۳	(۳.۶%)
طران ۳۰۰۹	خودران	۱۳,۰۰۰	۱۷	۲.۱	۱,۰۰۴	۱۱,۹۱۰	۱۱,۹۹۶	۰.۷%	۱۱.۹	-۰.۸۳	۹۶۵	(۳.۹%)
طملت ۳۰۵۵	وبملت	۲,۹۳۴	۱۰	۱.۷	۲۵۱	۲,۶۷۴	۲,۶۸۳	۰.۳%	۱۰.۷	-۰.۹۲	۲۳۶	(۵.۹%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۷	۶۶۸.۵	۶,۲۰۷	۲۷,۷۱۰	۲۷,۷۹۳	۰.۳%	۴.۵	-۰.۹۹	۵,۷۶۸	(۷.۱%)

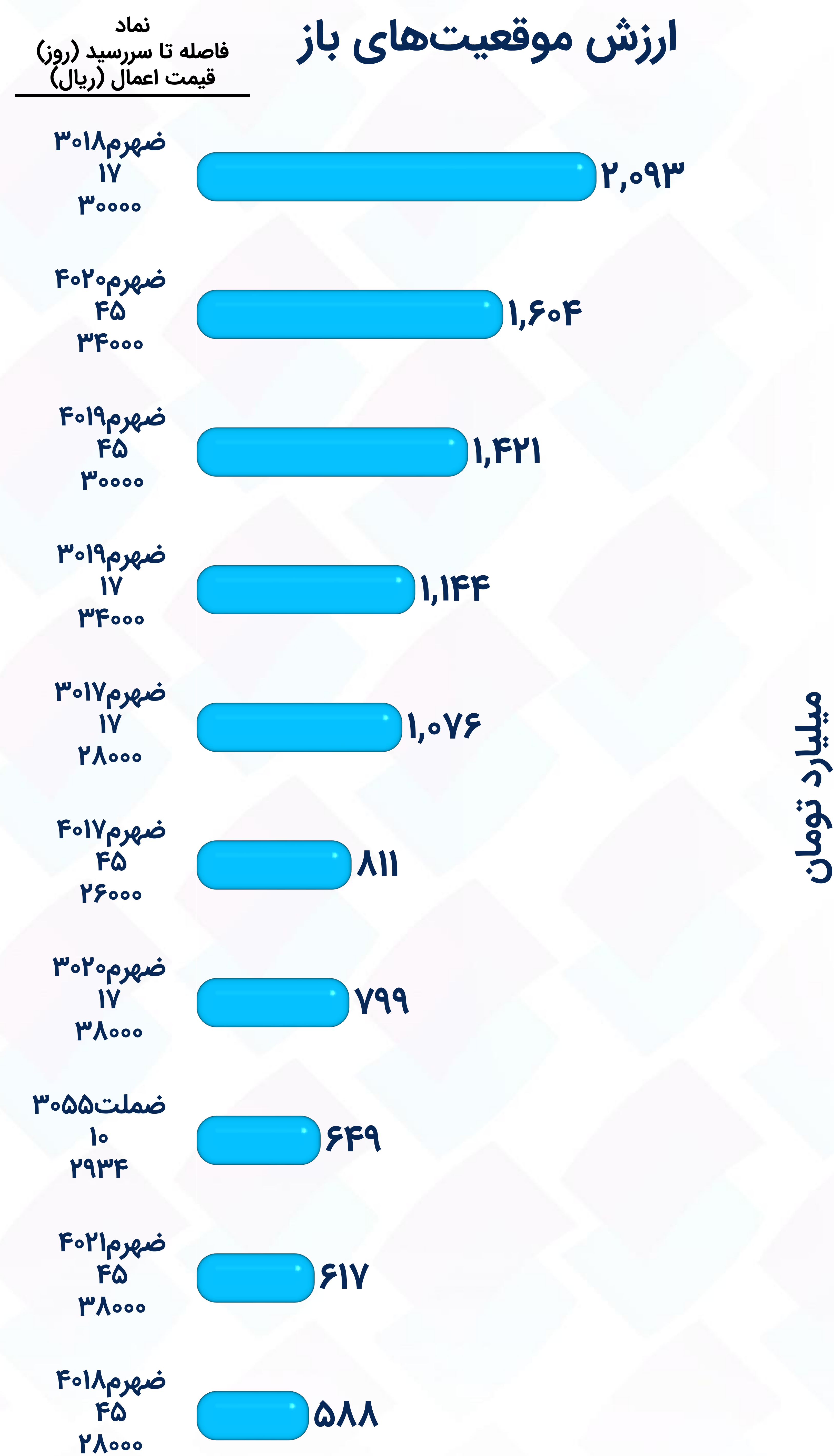
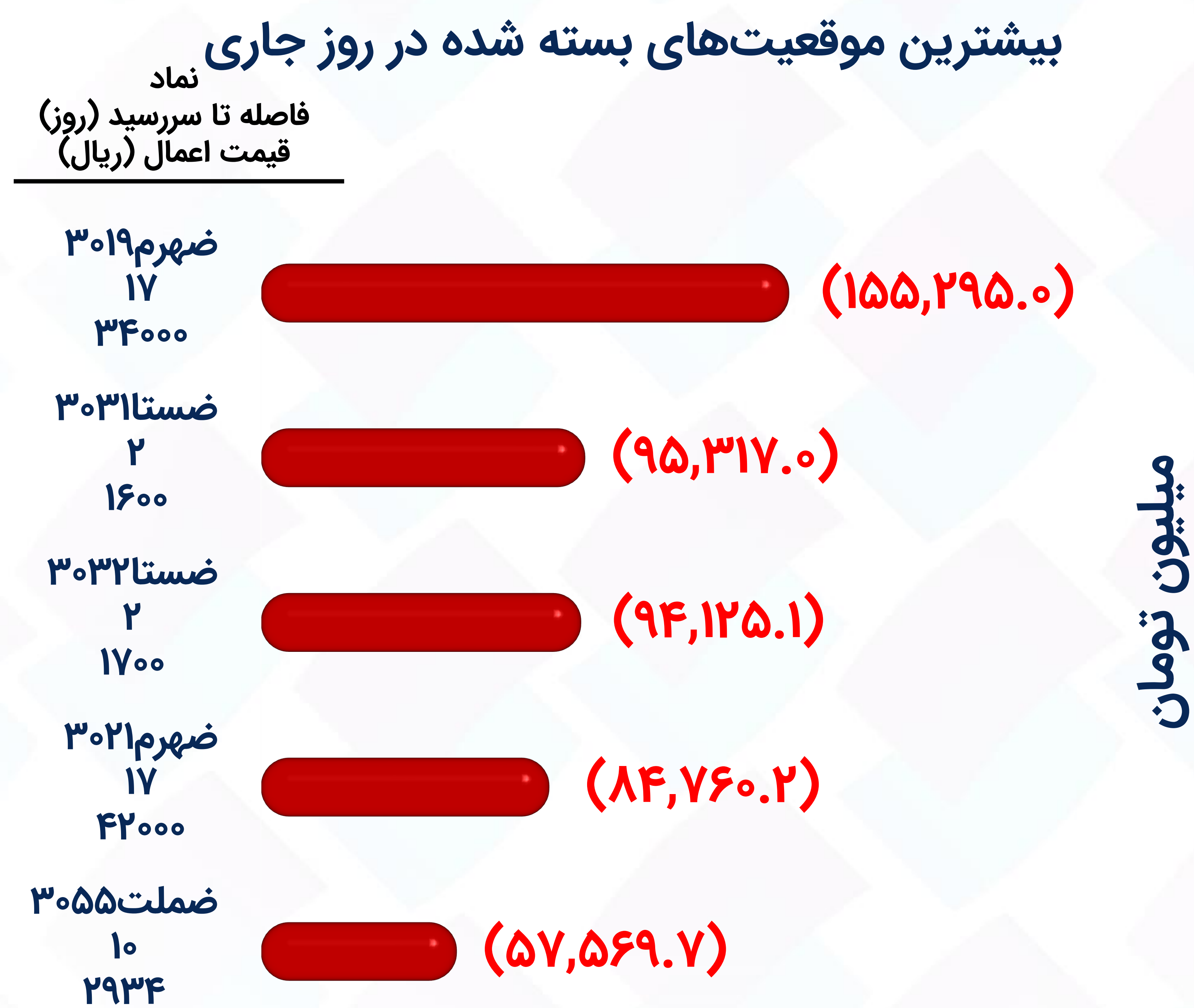
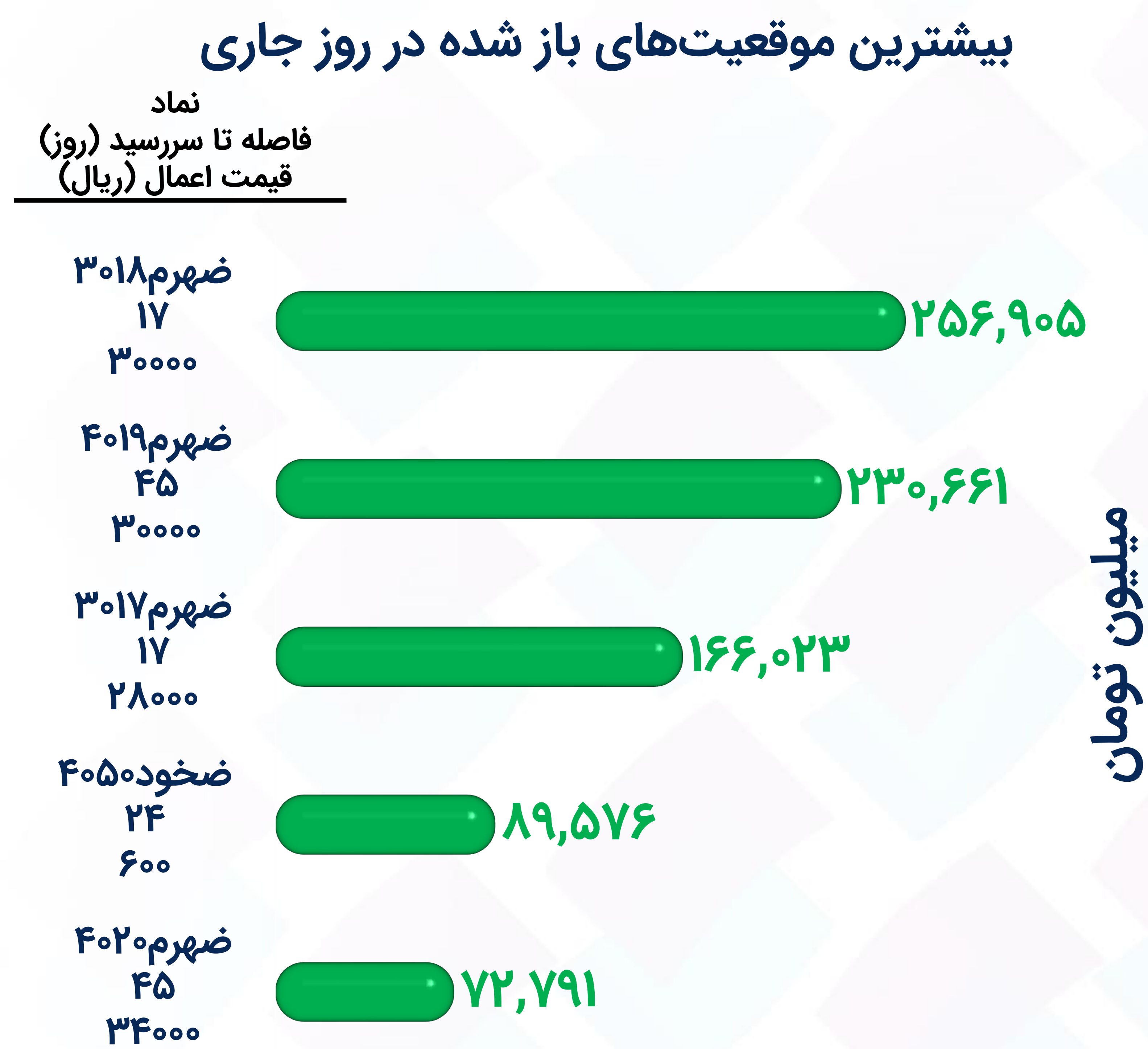
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	وبملت	۱,۹۰۷	۱۰	۰.۱	۱	۲,۶۷۴	۱,۹۰۶	(۲۸.۷%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۱	وبملت	۲,۰۵۴	۱۰	۰.۱	۳	۲,۶۷۴	۲,۰۵۱	(۲۳.۳%)	۶۸۳.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۵۰۱۵	وبصادر	۵۰۰	۷۳	۰.۰	۲۰	۶۹۶	۴۸۰	(۳۱.۰%)	۲۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طستا ۳۰۲۹	شستا	۱,۴۰۰	۲	۰.۰	۱	۱,۵۵۷	۱,۳۹۹	(۱۰.۱%)	۱,۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طملت ۳۰۵۲	وبملت	۲,۲۰۰	۱۰	۰.۱	۱	۲,۶۷۴	۲,۱۹۹	(۱۷.۸%)	۲,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۵%)

(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

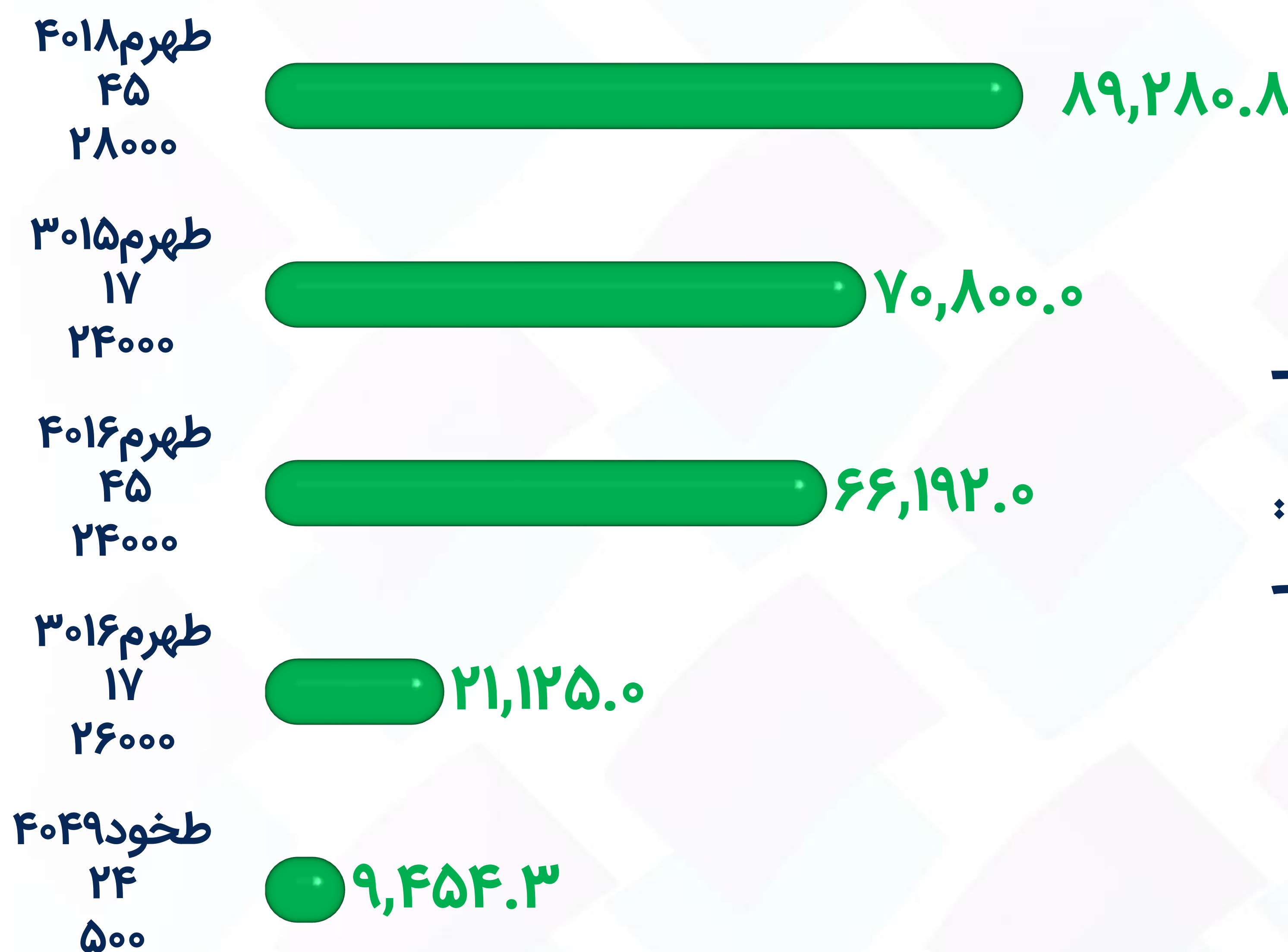
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

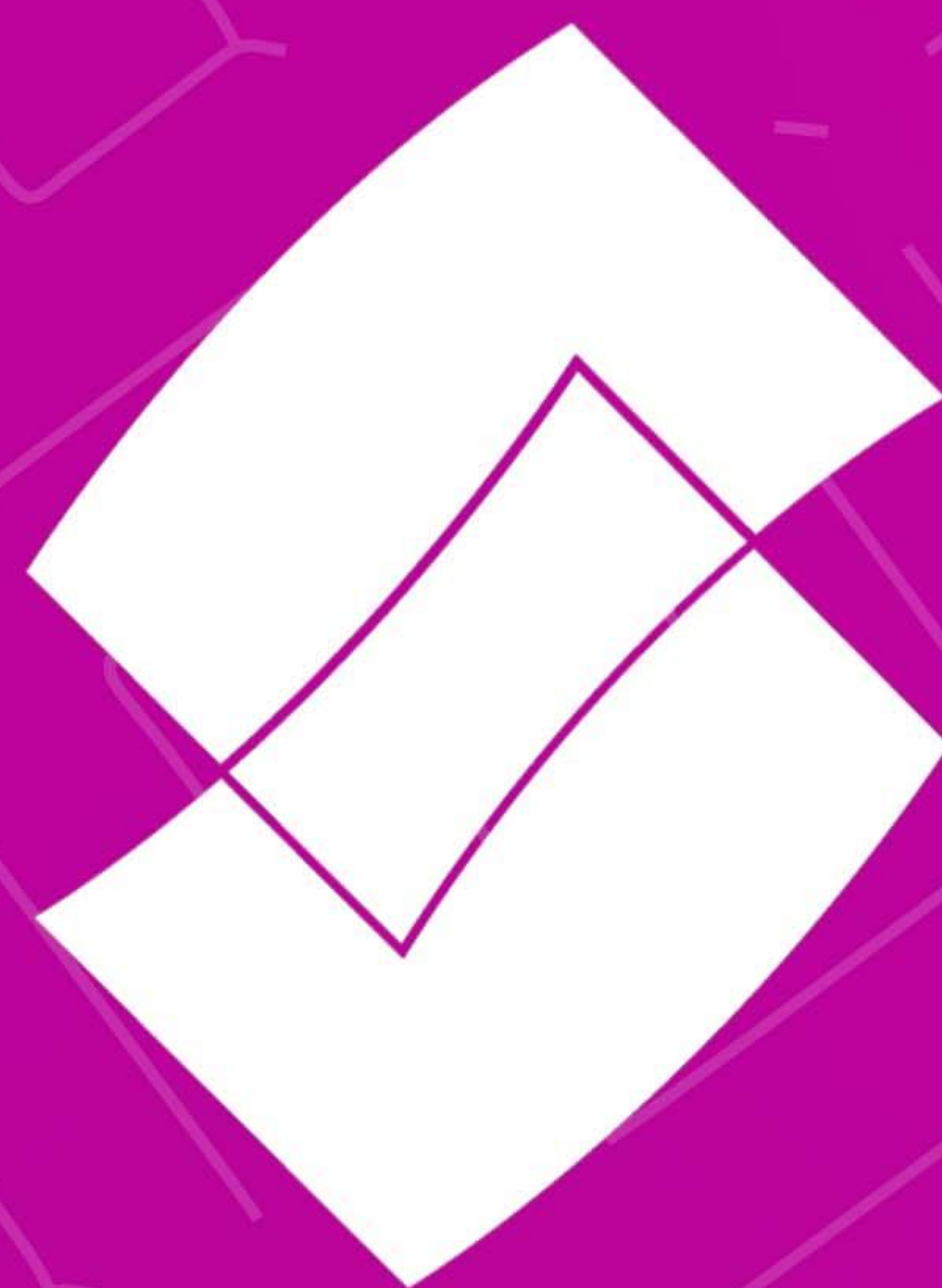
اختیار خرید



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.