

شماره
۴۹۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۲ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





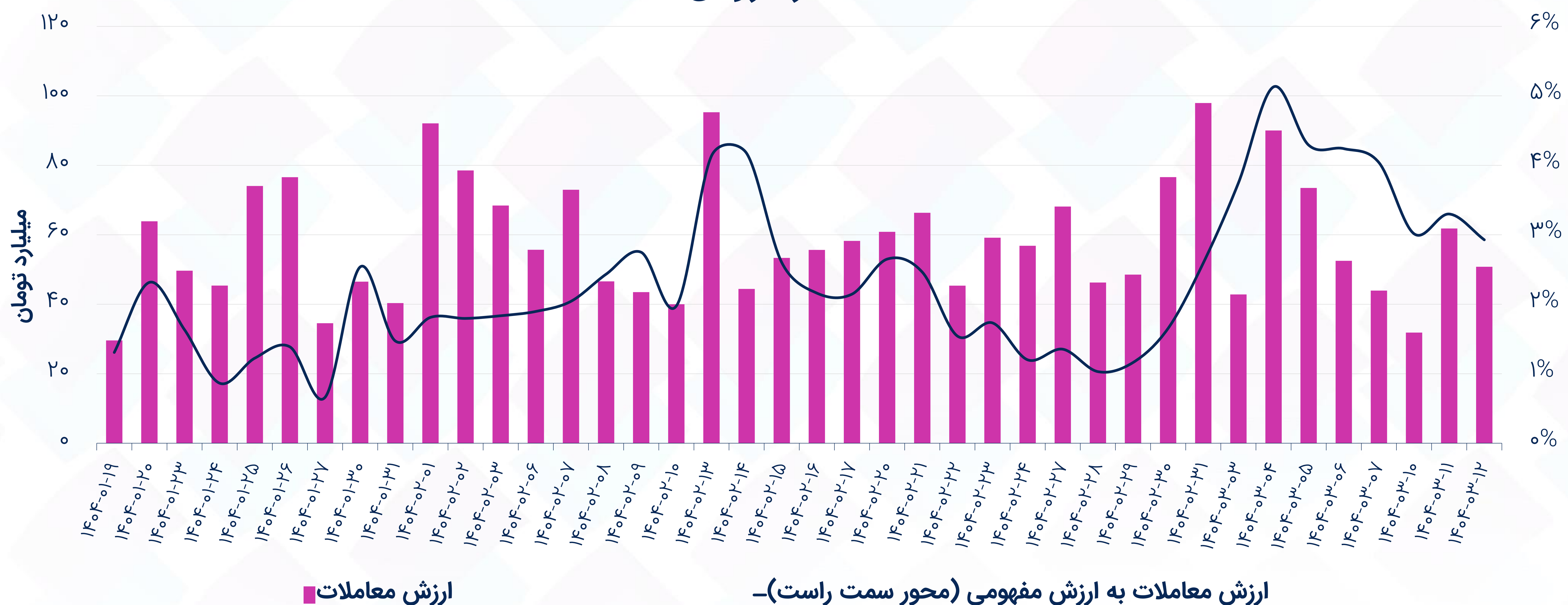
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



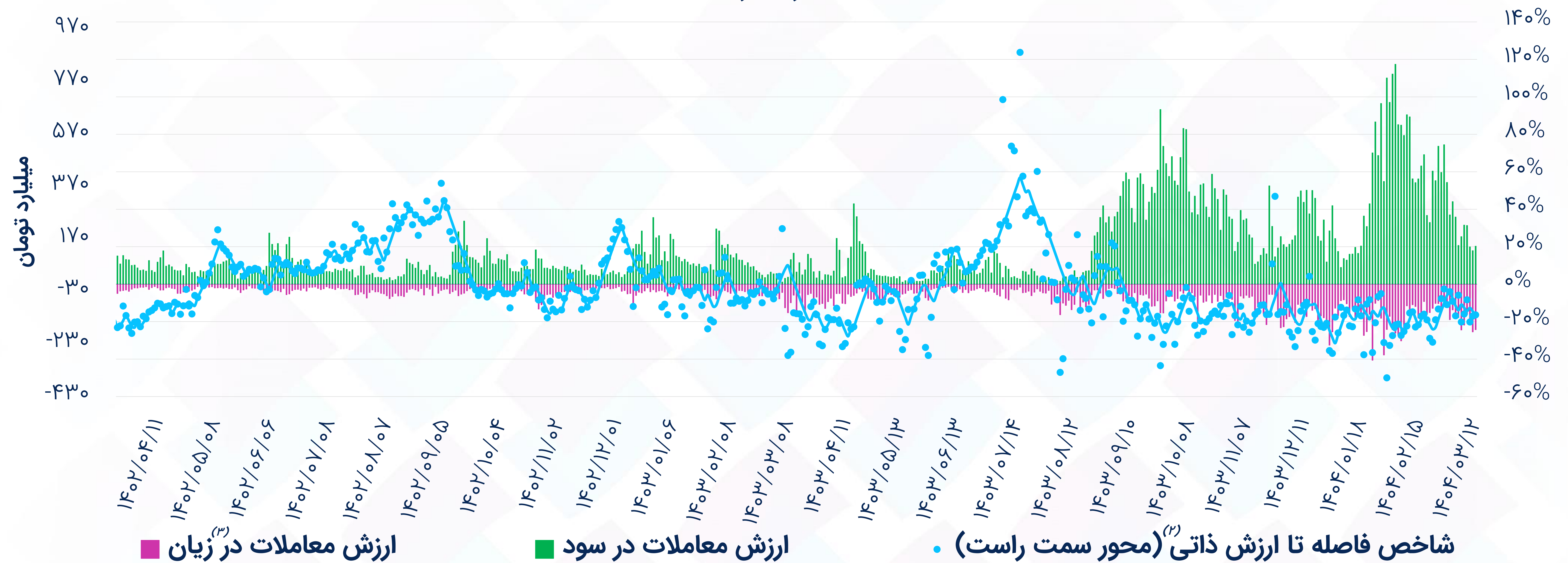
اختیار فروش



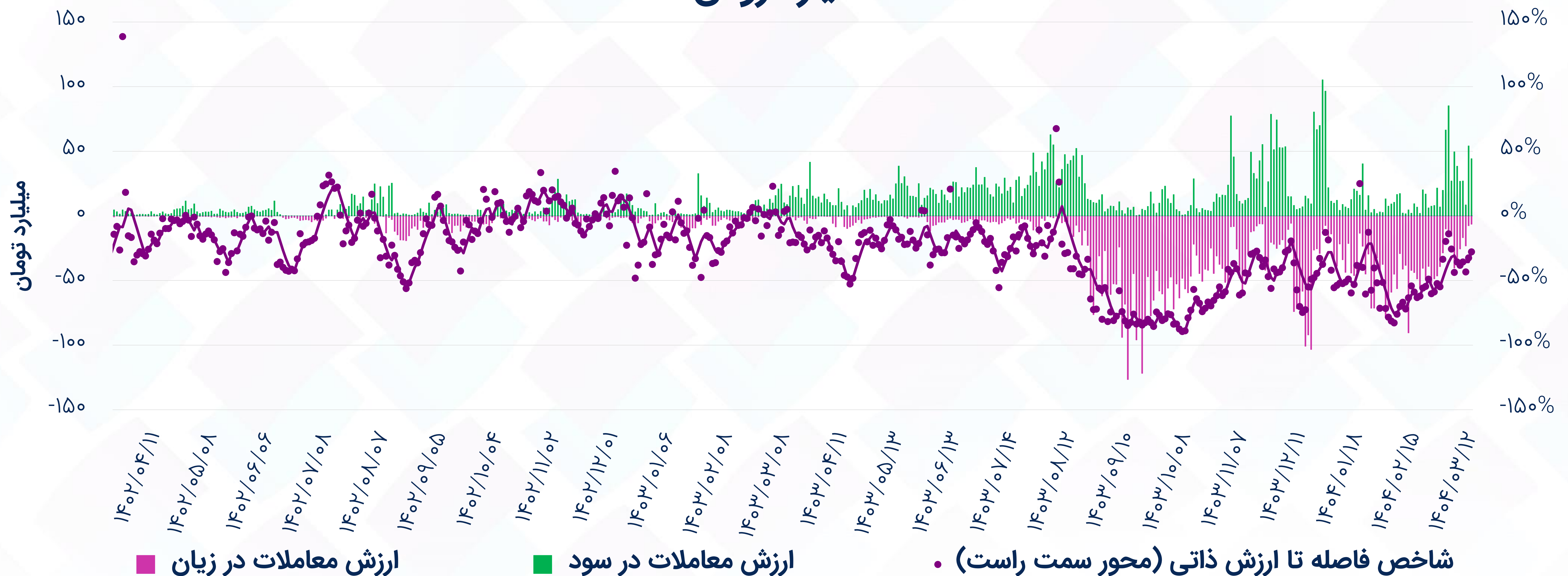
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۷۱.۳	۵,۰۱۷.۵	۳۴.۵	۱۳۶.۷	(۳۰.۵%)
خودرو	۳۰	۴۲.۵	۵۱۲.۰	۲۷.۴	۱۵.۱	(۶.۸%)
شستا	۴۱	۳۸.۵	۱,۲۹۰.۳	۲۸.۸	۹.۷	۱۱.۴%
شتاب	۱۵	۱۸.۷	۱۳۲.۵	۱۵.۶	۳.۲	(۱.۶%)
ذوب	۲۵	۱۳.۴	۲۱۲.۴	۱۰.۴	۲.۹	(۷.۸%)
وبصادر	۱۶	۹.۹	۱۰۳.۵	۹.۶	۰.۳	(۱.۶%)
وبملت	۲۵	۷.۱	۱۸۰.۵	۶.۶	۰.۵	(۴.۷%)

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	۴۱,۳۲۸.۱	۱,۳۵۰,۵۷۷.۸	۳۵,۷۱۳.۷	۵,۶۱۴.۴	(۳۰.۳%)
شستا	۸	۴,۸۲۹.۸	۲۶۸,۲۵۶.۱	۴,۵۴۵.۹	۲۸۳.۹	(۱۱.۳%)
خودرو	۴	۴,۴۴۶.۳	۹۳,۹۷۴.۰	۴,۰۲۶.۲	۴۲۰.۱	(۲۳.۵%)
وبملت	۳	۵۸.۹	۹,۷۰۰.۴	۰.۰	۵۸.۹	(۲۸.۹%)
توان	۴	۵۰.۴	۱,۲۹۱.۵	۲۷.۶	۲۲.۸	(۱۵.۲%)
وبصادر	۲	۳۰.۶	۱,۶۱۹.۹	۰.۰	۳۰.۶	(۵۶.۲%)
موج	۱	۳۰.۰	۵,۲۲۹.۰	۰.۰	۳۰.۰	۸۳.۴%

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۵۳۳,۱۲۸

خودرو ۹۴,۲۳۳

خسایا ۵۰,۵۱۳

شتاب ۵۰,۳۳۸

شتا ۳۲,۸۹۱

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

ذوب (۶,۴۵۹.۳)

اخبار (۴۲۶.۸)

پتروآبان (۳۴۵.۴)

خودران (۲۴۸.۱)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۱۳,۷۱۱

شتا ۳,۵۶۰

وبملت ۲,۰۳۸

ذوب ۱,۴۳۰

خودرو ۱,۰۸۶

وبصادر ۸۶۳

فولاد ۶۷۶

وتجارت ۵۶۹

خسایا ۵۴۶

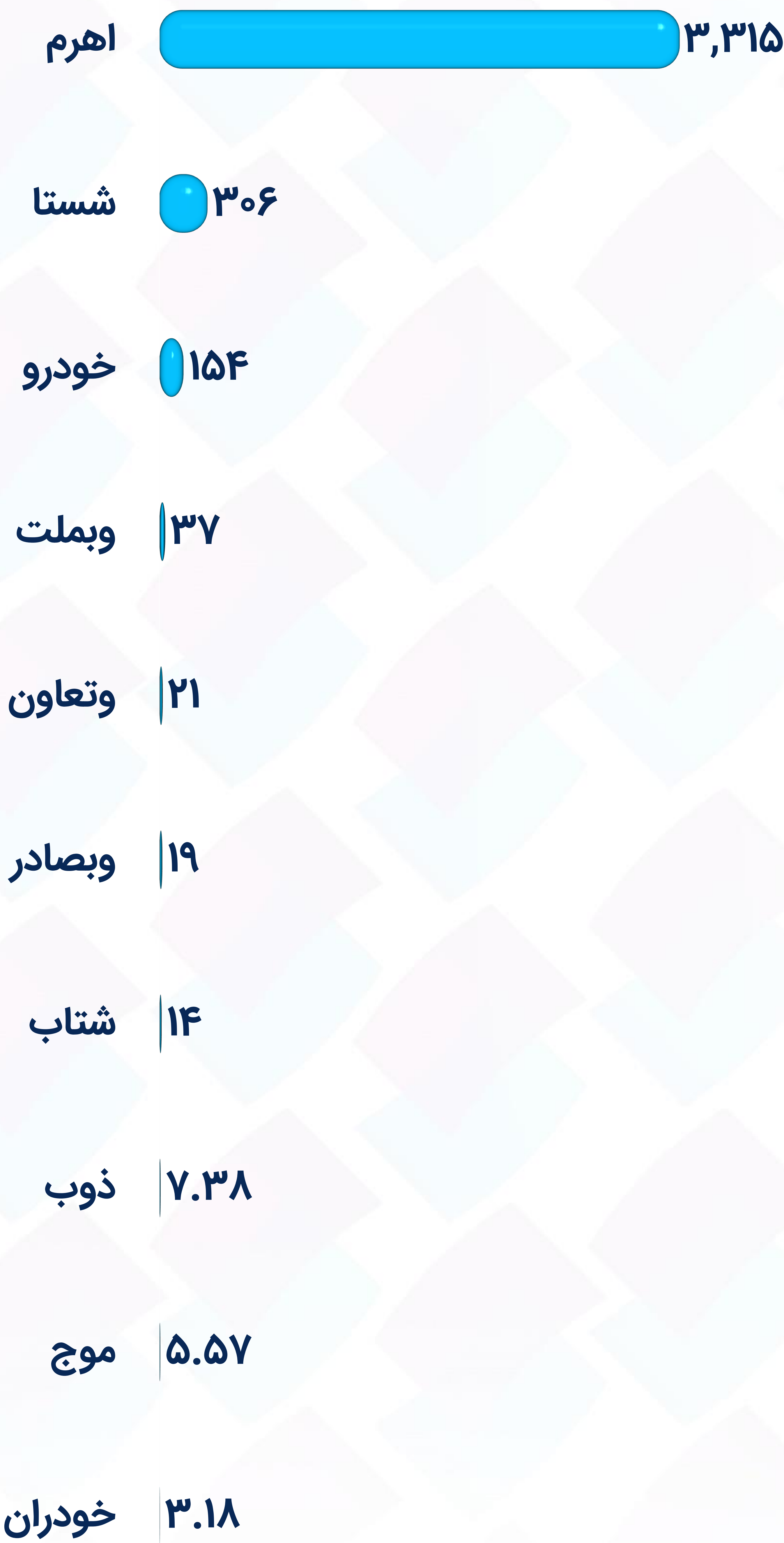
شتاب ۴۲۰

میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



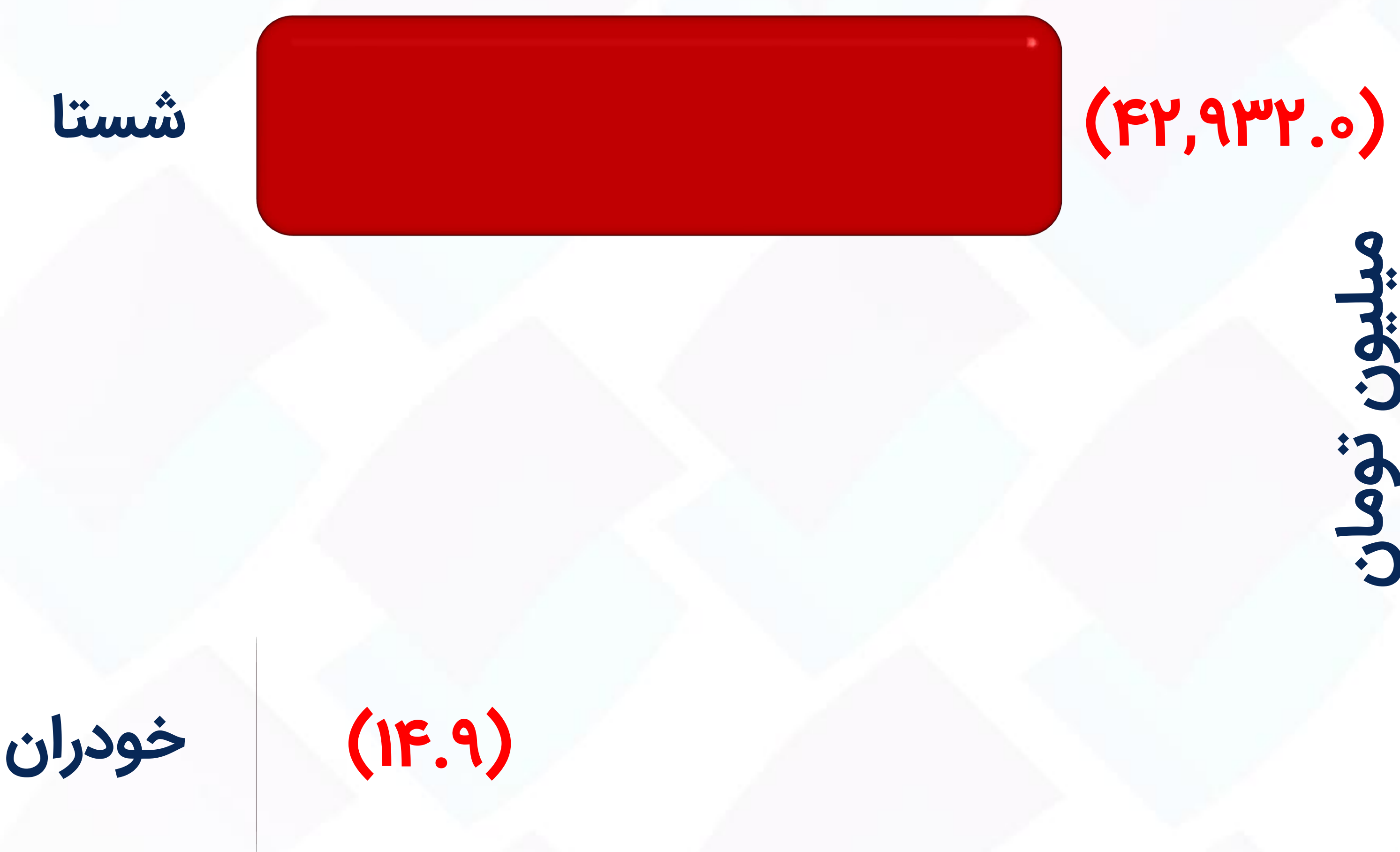
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

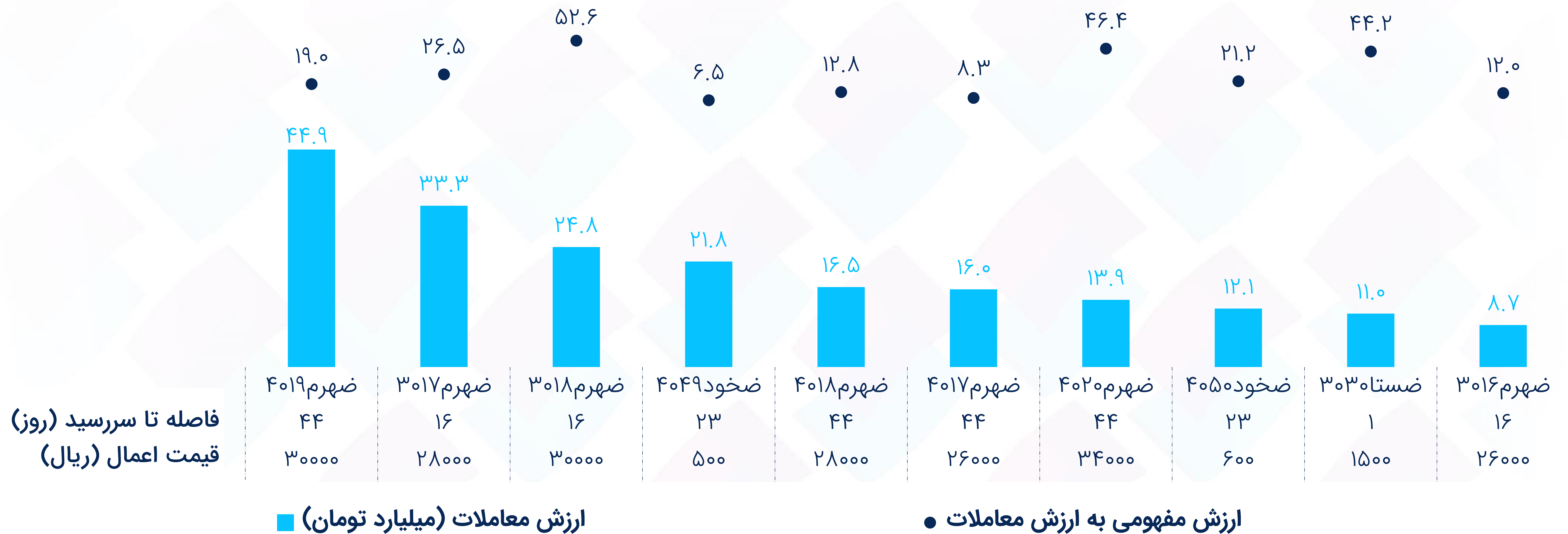
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



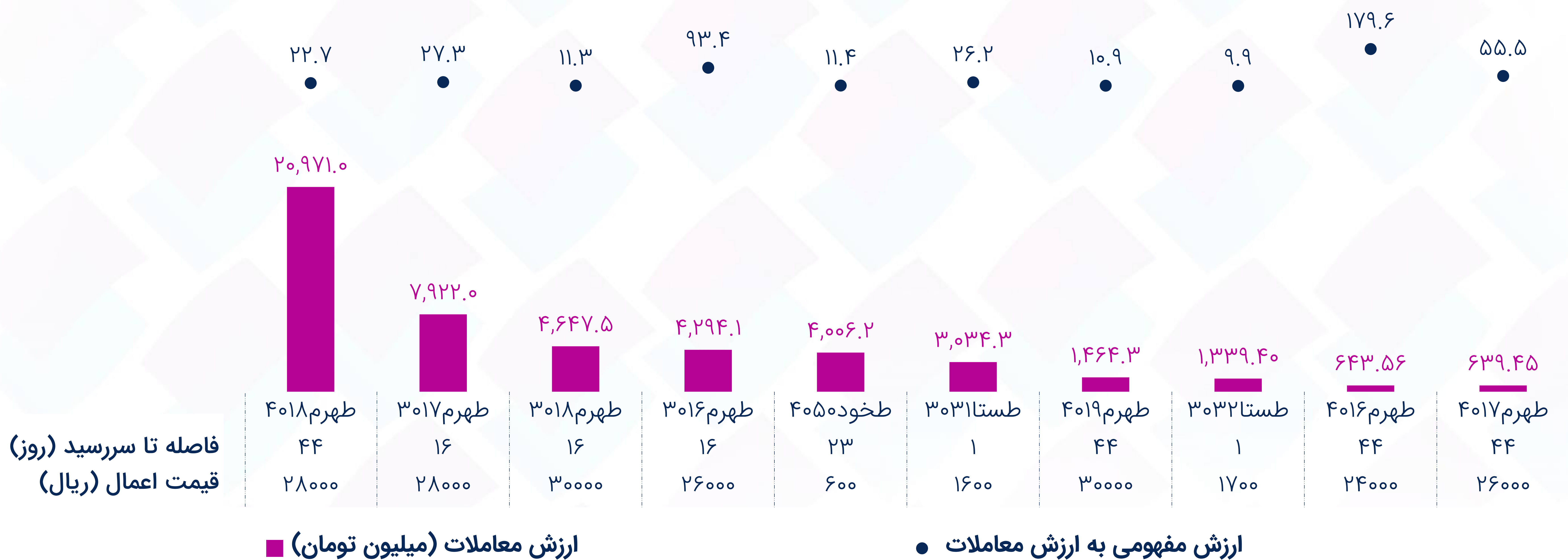
میلیون تومان

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
ضفصبا ۵۱۲	فصبا	۲,۴۰۰	۵۵	۵۰	۱۰۵	۳,۰۰۷	۲,۵۰۵	(۱۶.۷%)	۲۳.۹	۱.۰۰	۷۲۱	۵۸۷%
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۱۶	۶۴۶.۰	۴	۵۲۷	۶۰۷	۱۵.۲%	۱۵۱.۸	۰.۲۳	۹	۱۳۶%
ضثمین ۴۰۷	ثمین	۴۰,۰۰۰	۴۸	۳۰	۱۰۰	۳۴,۶۰۳	۴۰,۱۰۰	۱۵.۹%	۴۰۱.۰	۰.۱۴	۲۱۵	۱۱۵%
ضپادا ۴۰۲۱	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۲۷	۱۴.۲	۲۸,۳۲۶	۲۰۹,۰۲۴	۱۹۸,۳۲۶	(۵.۱%)	۷.۰	۱.۰۰	۴۳,۰۰۴	۵۲%
ضپتروآبان ۳۰۳	پتروآبان	۱۴,۰۰۰	۷	۳۱.۴	۱,۲۸۳	۱۵,۷۶۸	۱۵,۲۸۳	(۳.۱%)	۱۱.۹	۱.۰۰	۱,۸۴۶	۴۴%

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	۹	۲.۴	۱	۴۶۷	۱,۰۰۱	۱۱۴%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۹	۲.۰	۱	۴۶۷	۷۰۱	۵۰%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۶	۹۵.۸	۲۷	۲۷,۸۴۰	۴۲,۰۲۷	۵۱%	۱,۵۵۶.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضخود ۴۰۵۵	خودرو	۱,۱۰۰	۲۳	۳.۴	۴	۵۷۲	۱,۱۰۴	۹۳%	۲۷۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۰	ذوب	۶۰۰	۹	۲.۸	۱	۴۶۷	۶۰۱	۲۹%	۶۰۱.۰	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

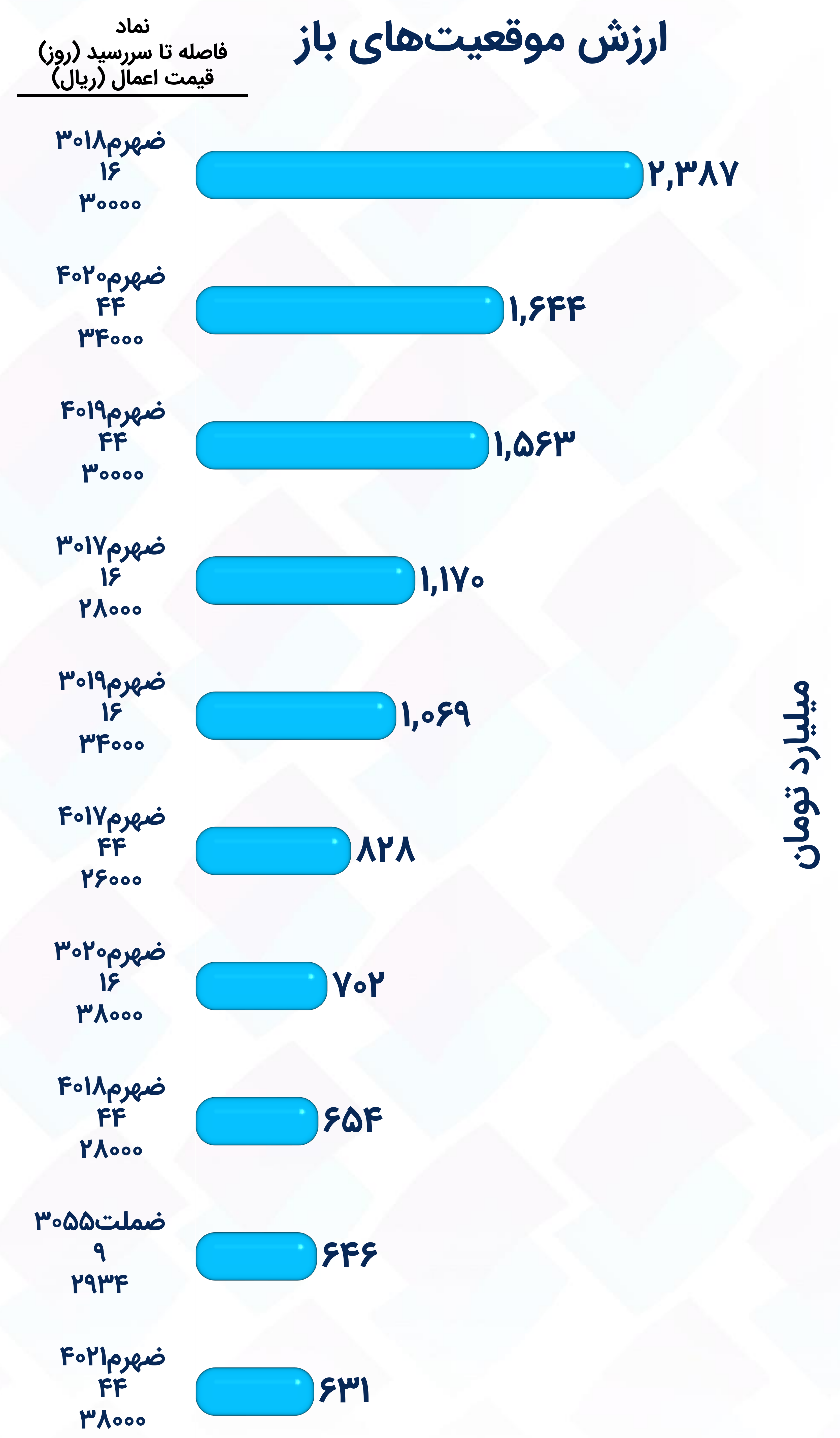
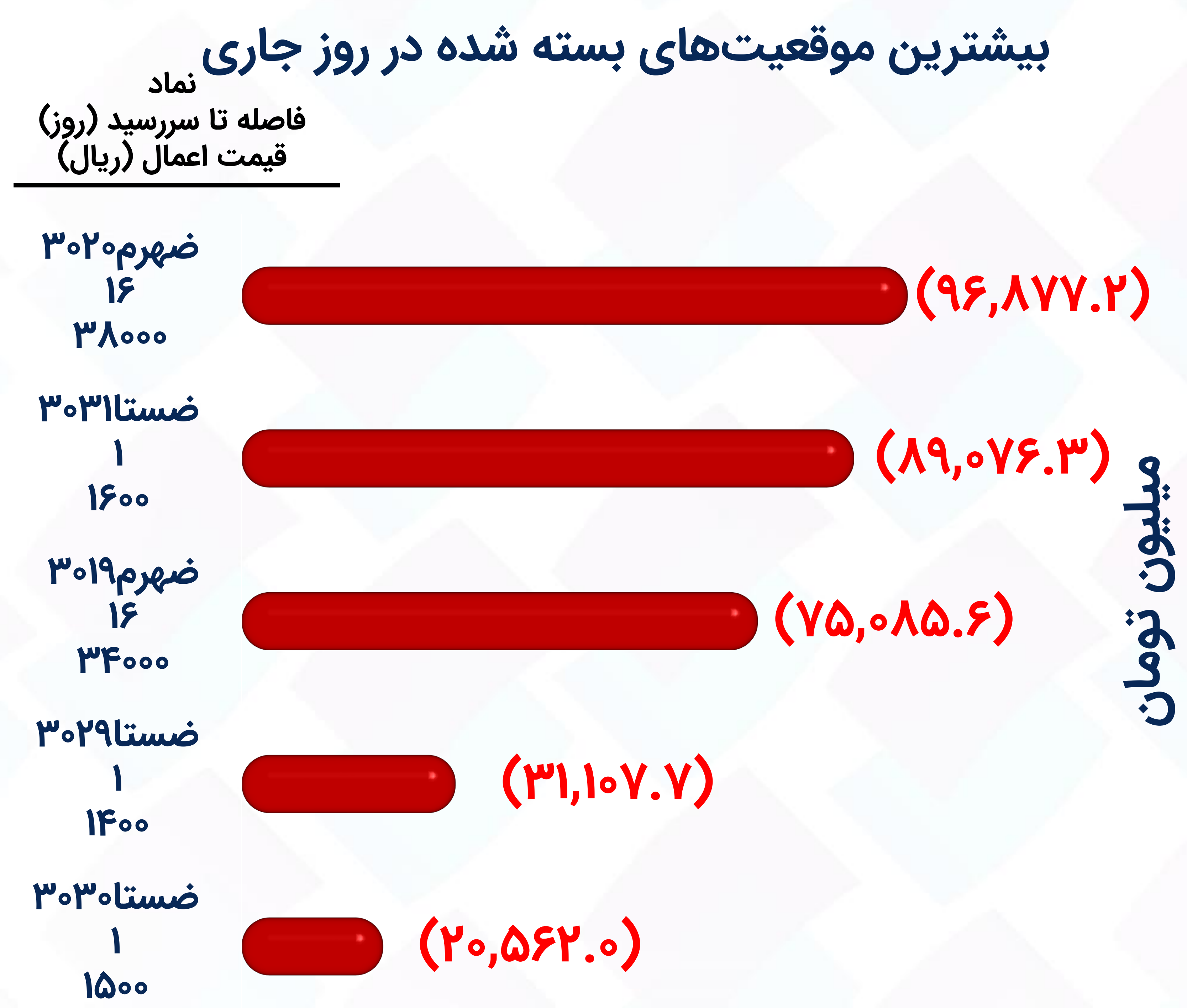
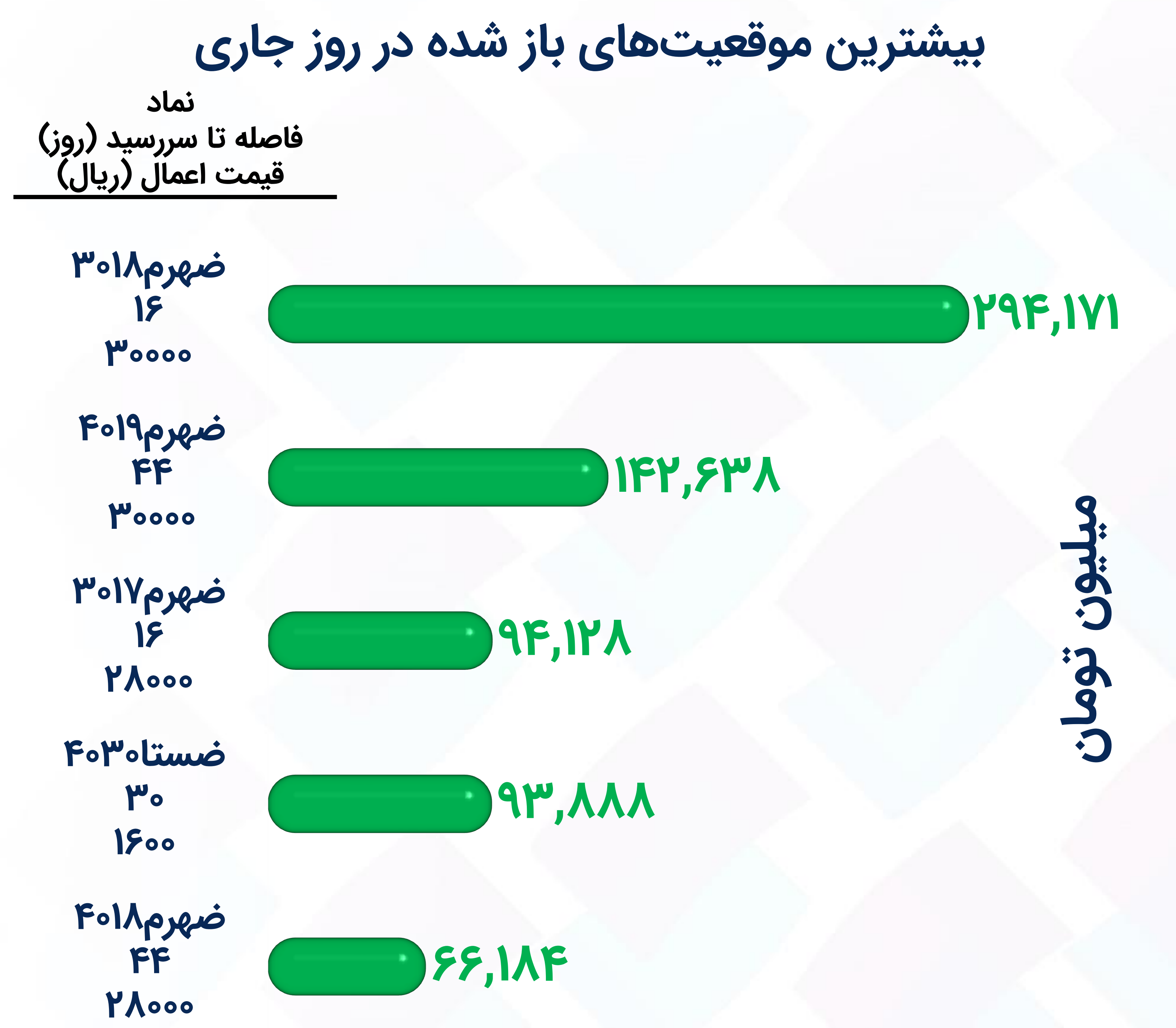
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طموج ۴۱۴	موج	۲۴,۰۰۰	۴۱	۳۰.۰	۱۵۰	۲۶,۱۴۵	۲۳,۸۵۰	(۸.۸%)	۱۵۹.۰	-۰.۱۵	۲۷۵	۸۳.۴%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۱۴	۲۲.۹	۱۲	۱,۹۳۱	۱,۸۸۸	(۲.۲%)	۱۵۷.۳	-۰.۲۸	۱۷	۴۴.۳%
طتوان ۳۲۸	توان	۲۸,۰۰۰	۷	۲۳.۶	۱,۴۷۶	۲۶,۴۱۲	۲۶,۵۲۴	۰.۴%	۱۸.۰	-۰.۸۷	۱,۵۰۹	۲.۲%
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۶	۹.۵	۹,۴۸۰	۲۷,۸۴۰	۲۸,۵۲۰	۲.۴%	۳.۰	-۱.۰۰	۹,۶۳۴	۱.۶%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۶	۲.۷	۱۳,۶۰۰	۲۷,۸۴۰	۲۸,۴۰۰	۲.۰%	۲.۱	-۱.۰۰	۱۳,۵۷۹	(۰.۲%)

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
طملت ۳۰۵۱	وبملت	۲,۰۵۴	۹	۰.۱	۲	۲,۶۶۳	۲,۰۵۲	(۲۲.۹%)	۱,۰۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۴۴	۰.۰	۵۲	۲۷,۸۴۰	۱۵,۹۴۸	(۴۲.۷%)	۳۰۶.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طران ۳۰۰۵	خودران	۹,۰۰۰	۱۶	۰.۰	۵۰	۱۲,۲۵۰	۸,۹۵۰	(۲۶.۹%)	۱۷۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۴۴	۰.۱	۵۲	۲۷,۸۴۰	۱۷,۹۴۸	(۳۵.۵%)	۳۴۵.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۲	وبصادر	۶۰۰	۹	۰.۶	۱	۷۰۹	۵۹۹	(۱۵.۵%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)

(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

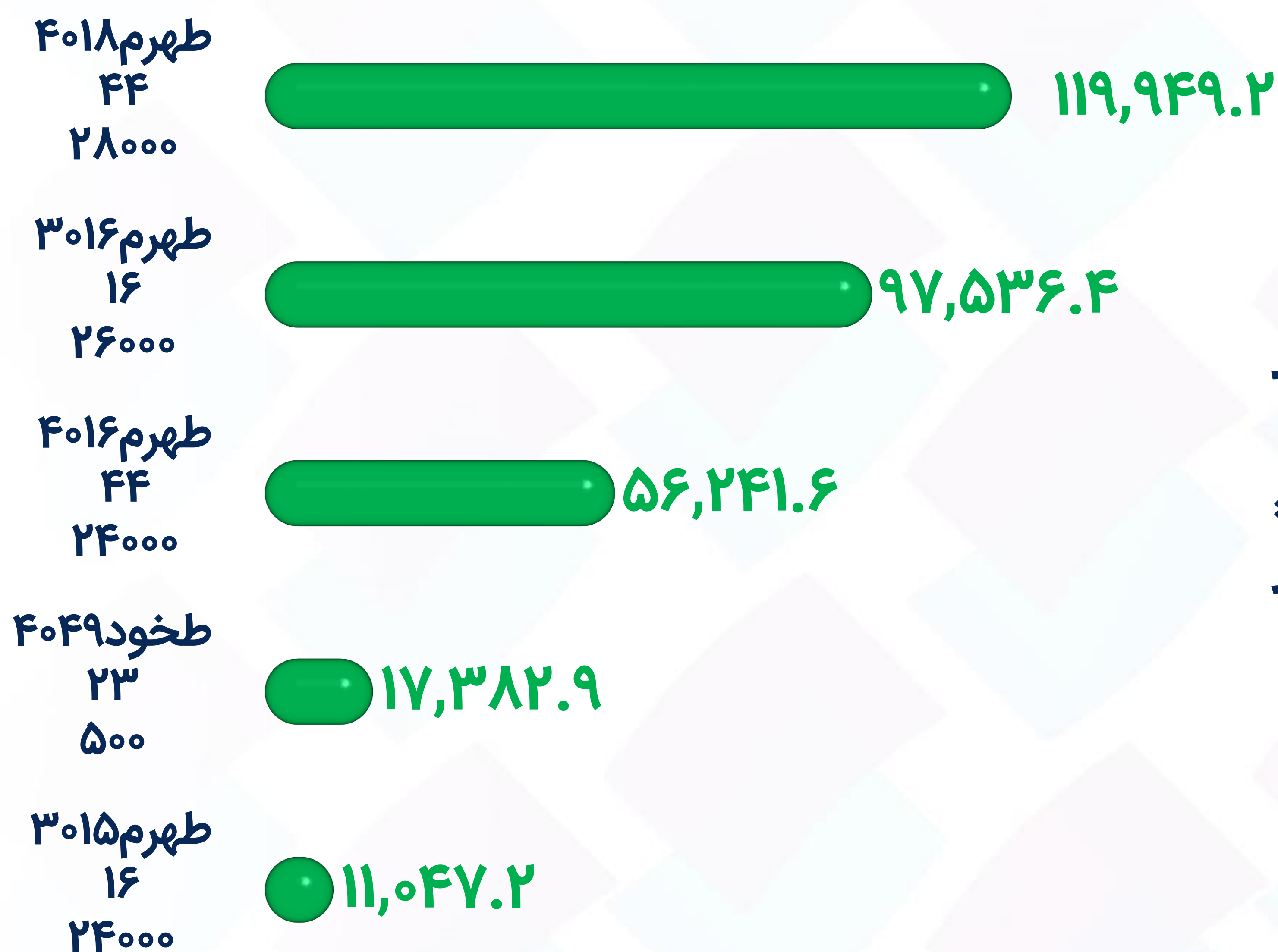
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

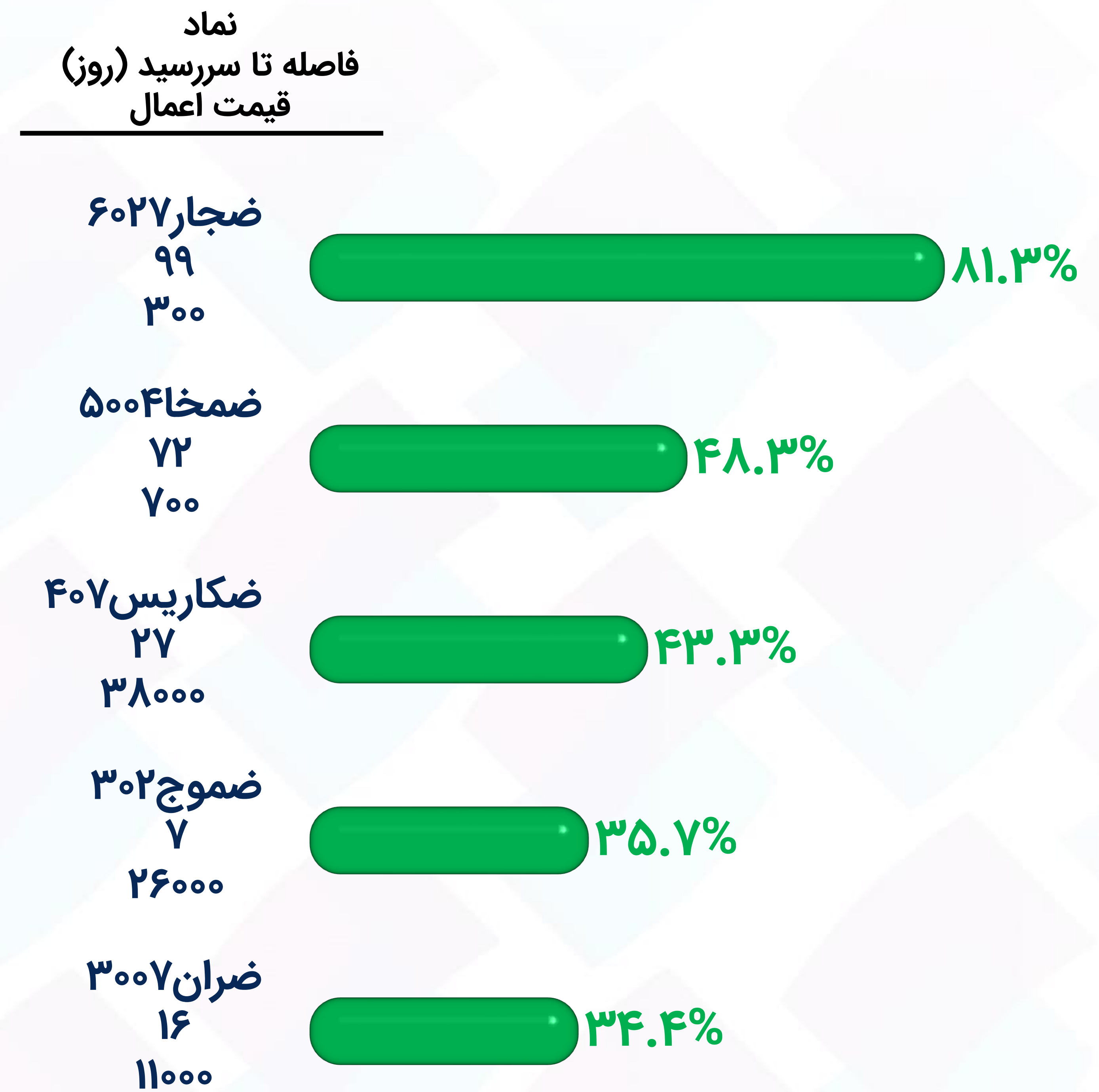
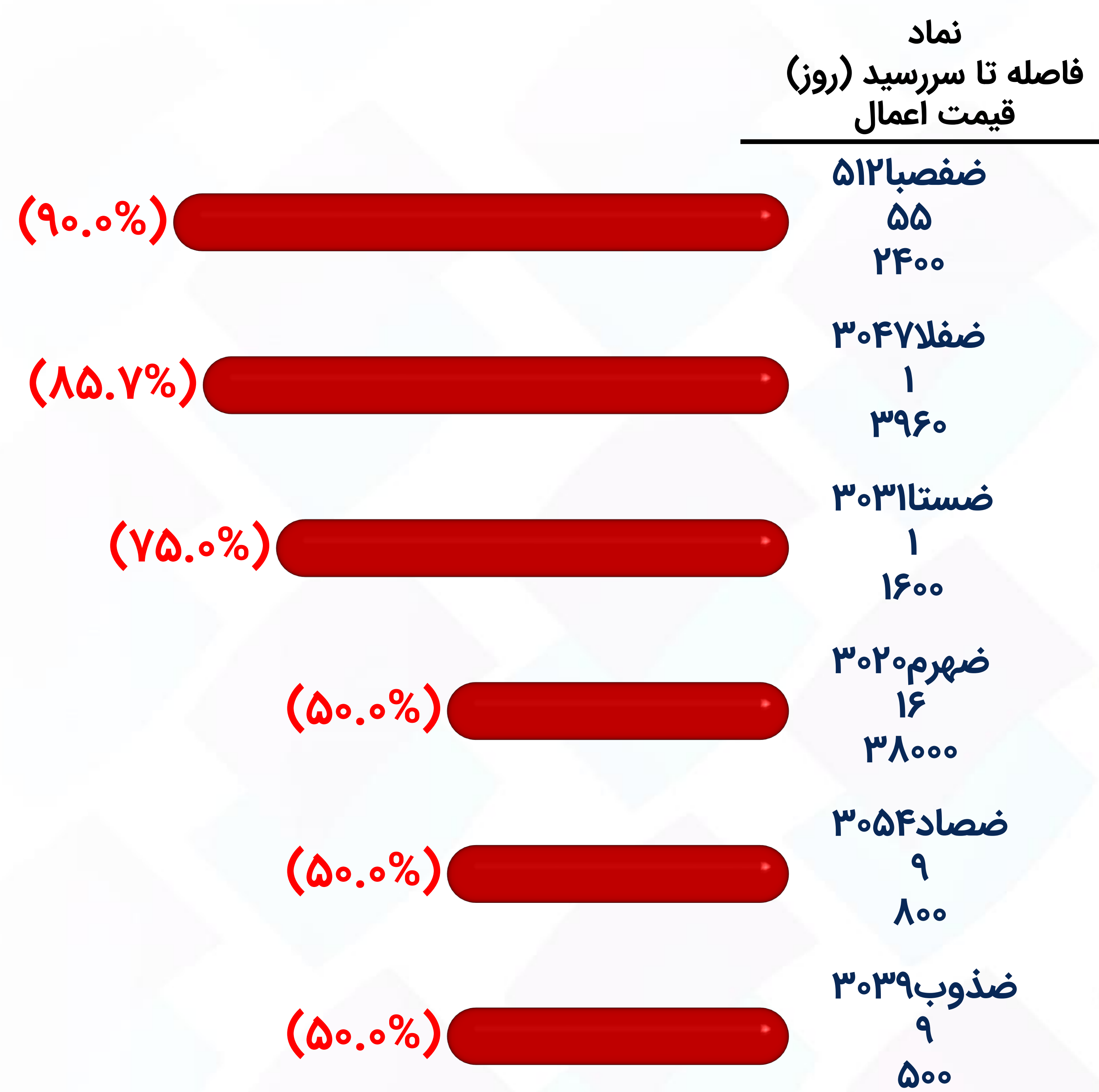
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



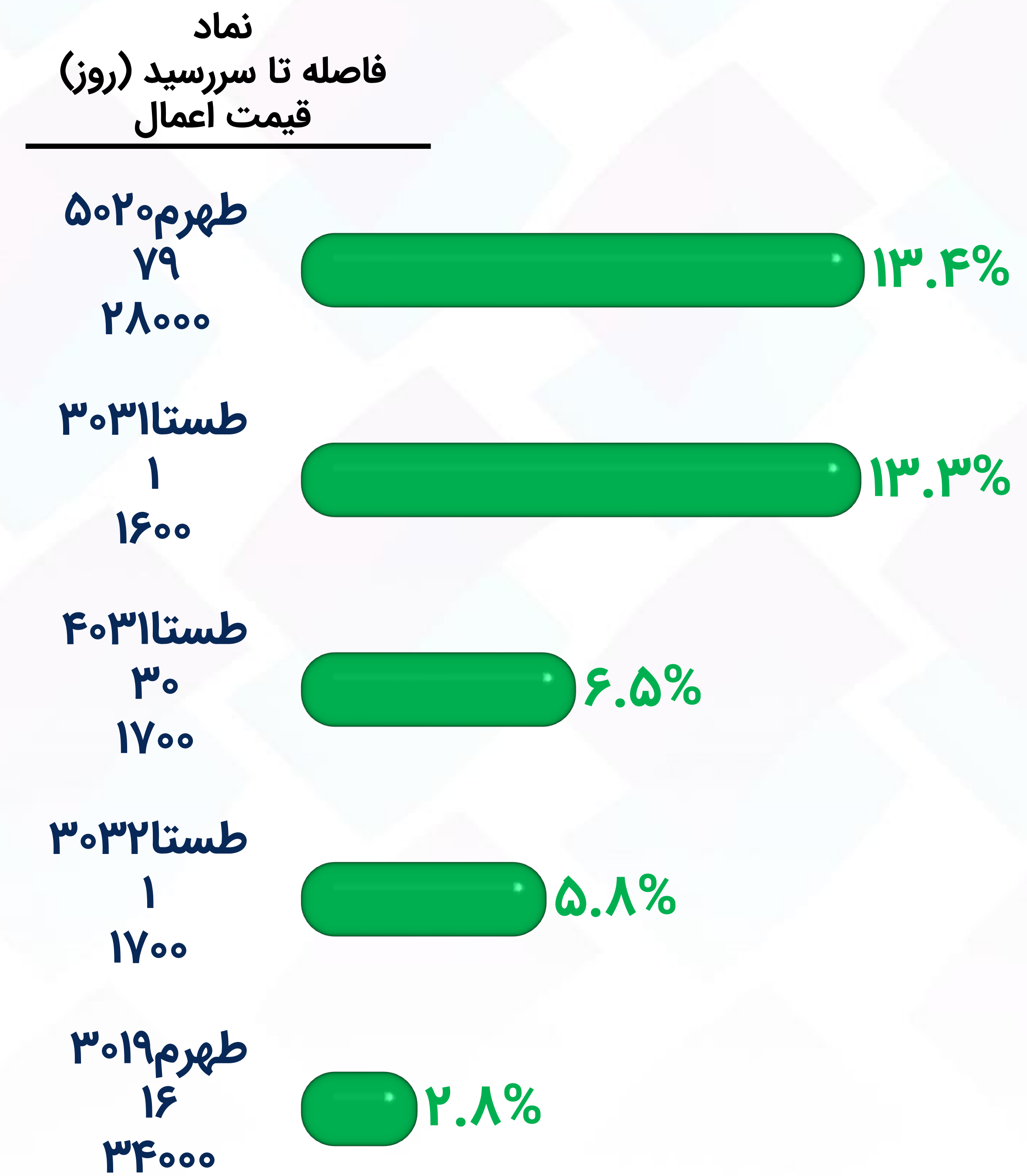
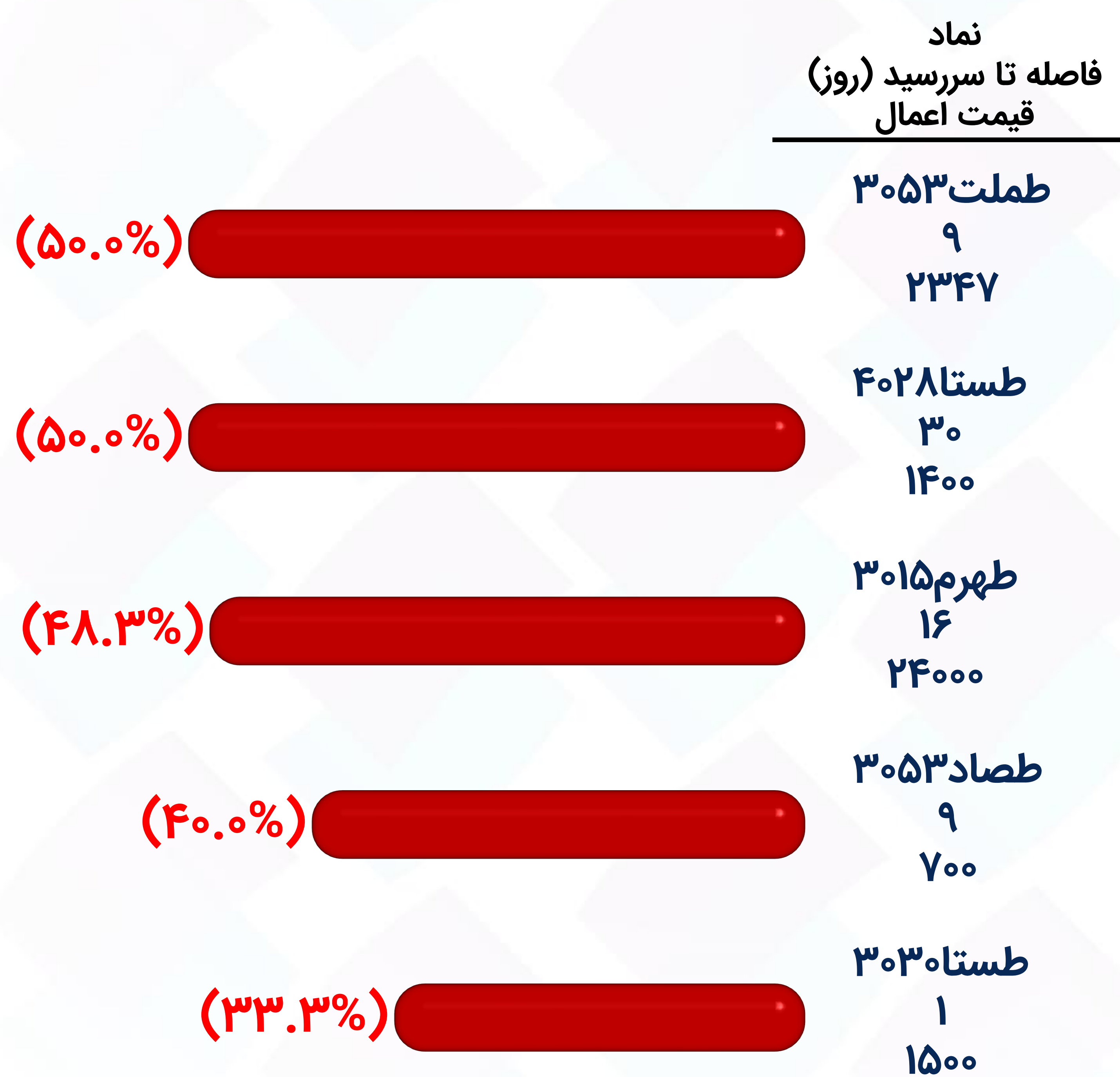
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

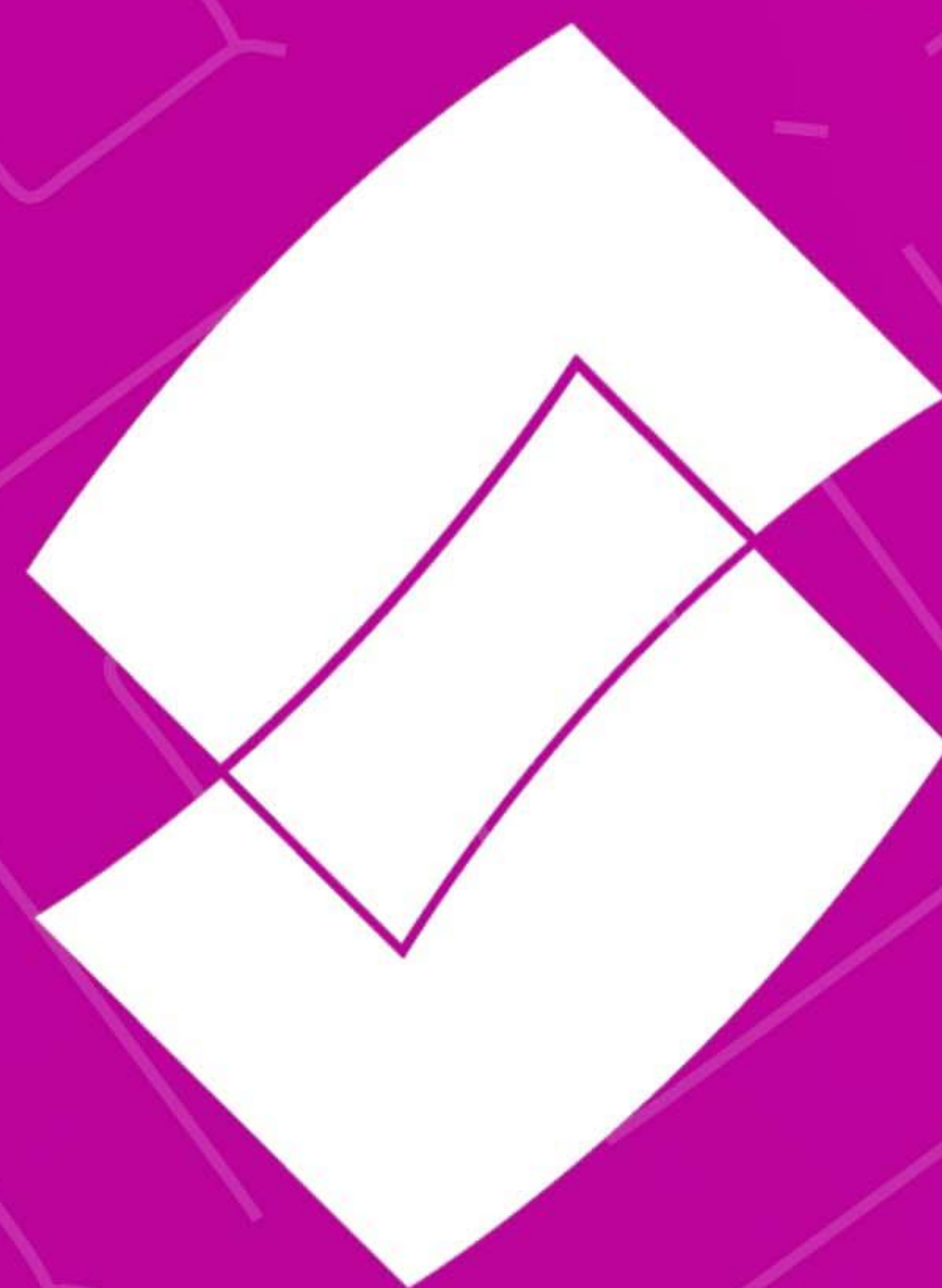
اختیار خرید



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.