

شماره
۴۹۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





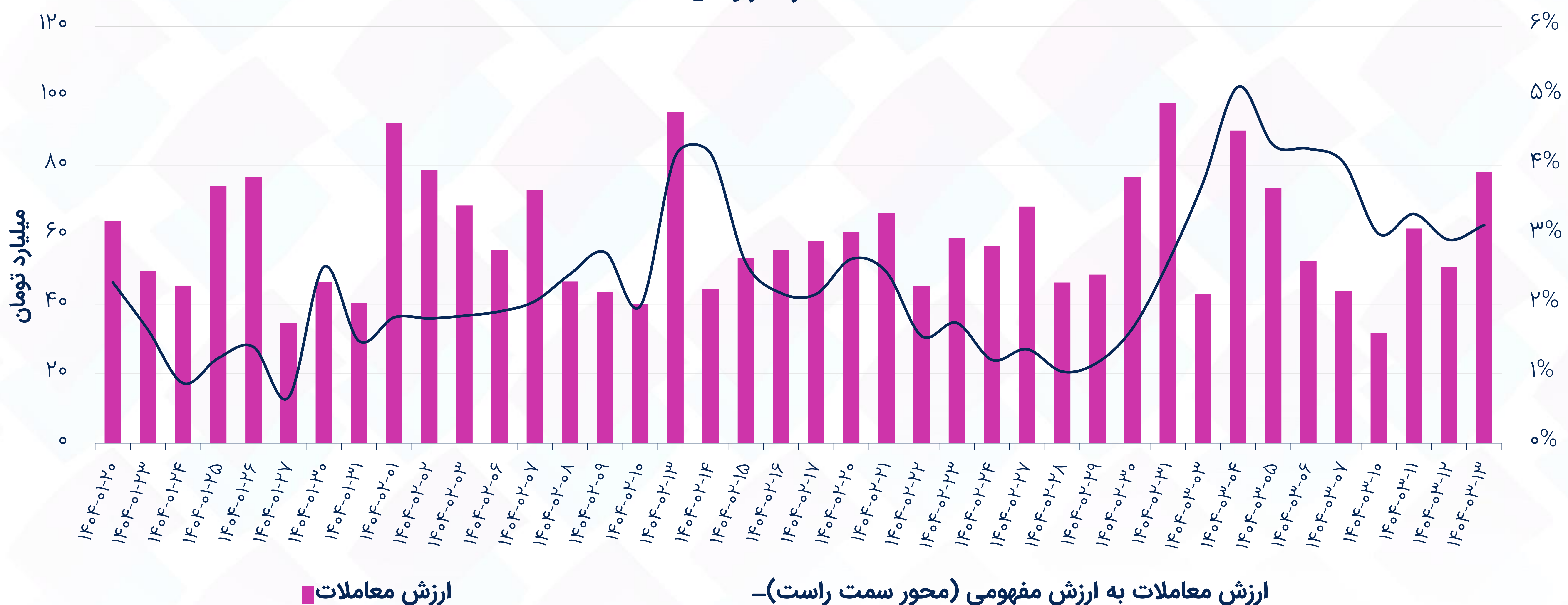
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



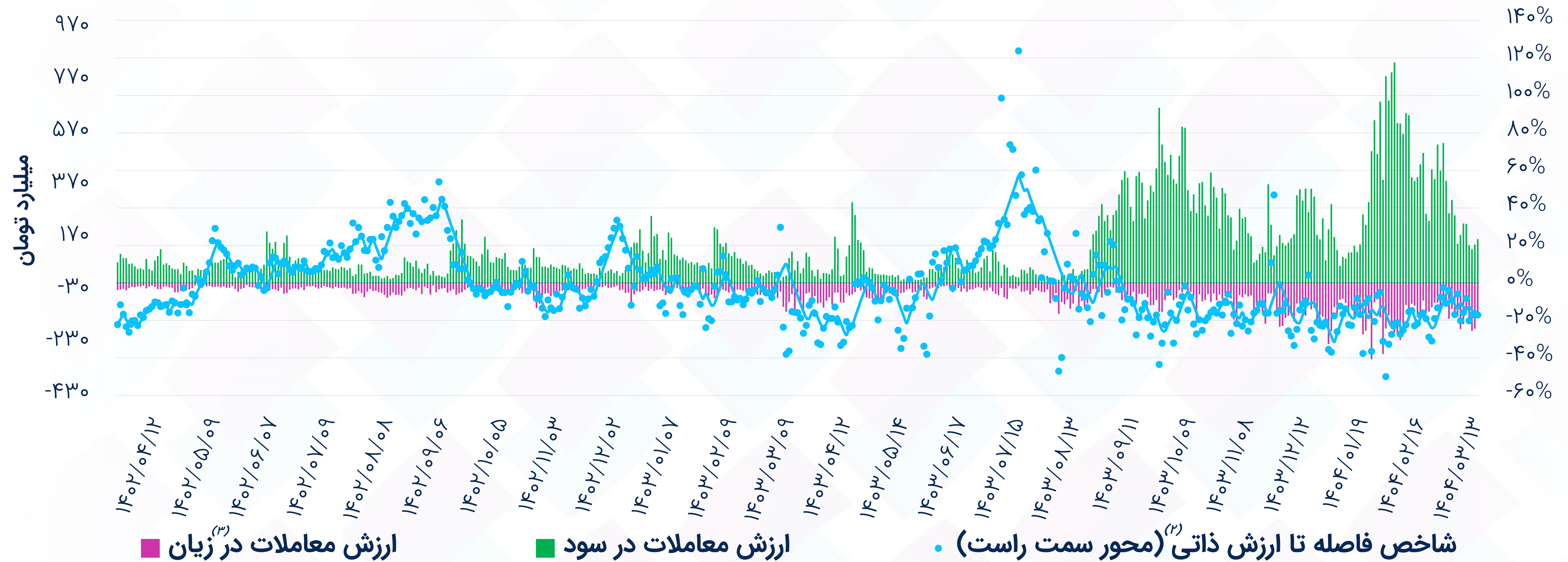
اختیار فروش



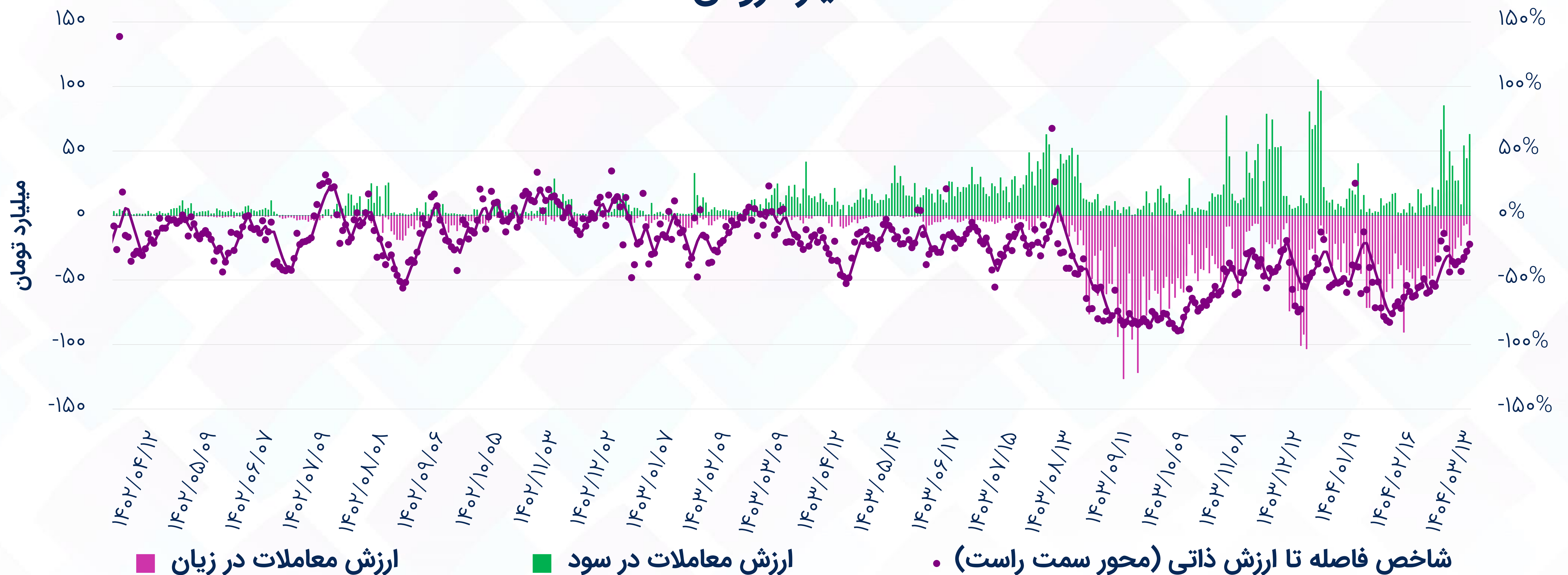
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۵۴.۲	۴,۹۹۶.۳	۵۰.۸	۱۰۳.۴	(۳۷.۴%)
شتاب	۱۵	۴۲.۳	۱۹۶.۶	۴۲.۰	۰.۳	۵.۶%
شستا	۵۳	۳۰.۷	۱,۳۲۳.۸	۲۱.۸	۸.۹	۲۱.۵%
خودرو	۲۵	۱۹.۳	۲۱۵.۲	۱۳.۳	۶.۰	۴.۸%
وبملت	۲۶	۸.۱	۳۶۴.۹	۶.۱	۲.۱	(۰.۱%)
ذوب	۲۷	۶.۷	۱۴۶.۱	۴.۹	۱.۸	(۱۴.۳%)
وبصادر	۱۵	۵.۳	۸۹.۴	۳.۹	۱.۳	۲.۶%

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	۱۸	۶۴,۴۸۶.۴	۲,۰۲۹,۸۷۰.۲	۵۰,۹۵۲.۷	۱۳,۵۳۳.۷	(۲۳.۵%)
شستا	۸	۸,۲۸۶.۶	۲۹۸,۵۰۴.۱	۷,۸۷۱.۸	۴۱۴.۸	(۲.۸%)
خودرو	۶	۵,۰۰۱.۰	۱۴۶,۷۹۰.۱	۳,۹۱۵.۷	۱,۰۸۵.۳	(۳۶.۷%)
وبملت	۴	۱۷۶.۷	۶,۵۵۴.۰	۱۷۵.۴	۱.۳	(۳۱.۱%)
شتاب	۱	۱۰۰.۰	۳,۲۷۴.۰	۰.۰	۱۰۰.۰	(۹۴.۳%)
وبصادر	۲	۳۹.۷	۲,۵۳۴.۶	۳۷.۴	۲.۲	(۴۳.۳%)
توان	۳	۲۴.۱	۴۳۹.۱	۲۴.۱	۰.۰	(۱۱.۸%)

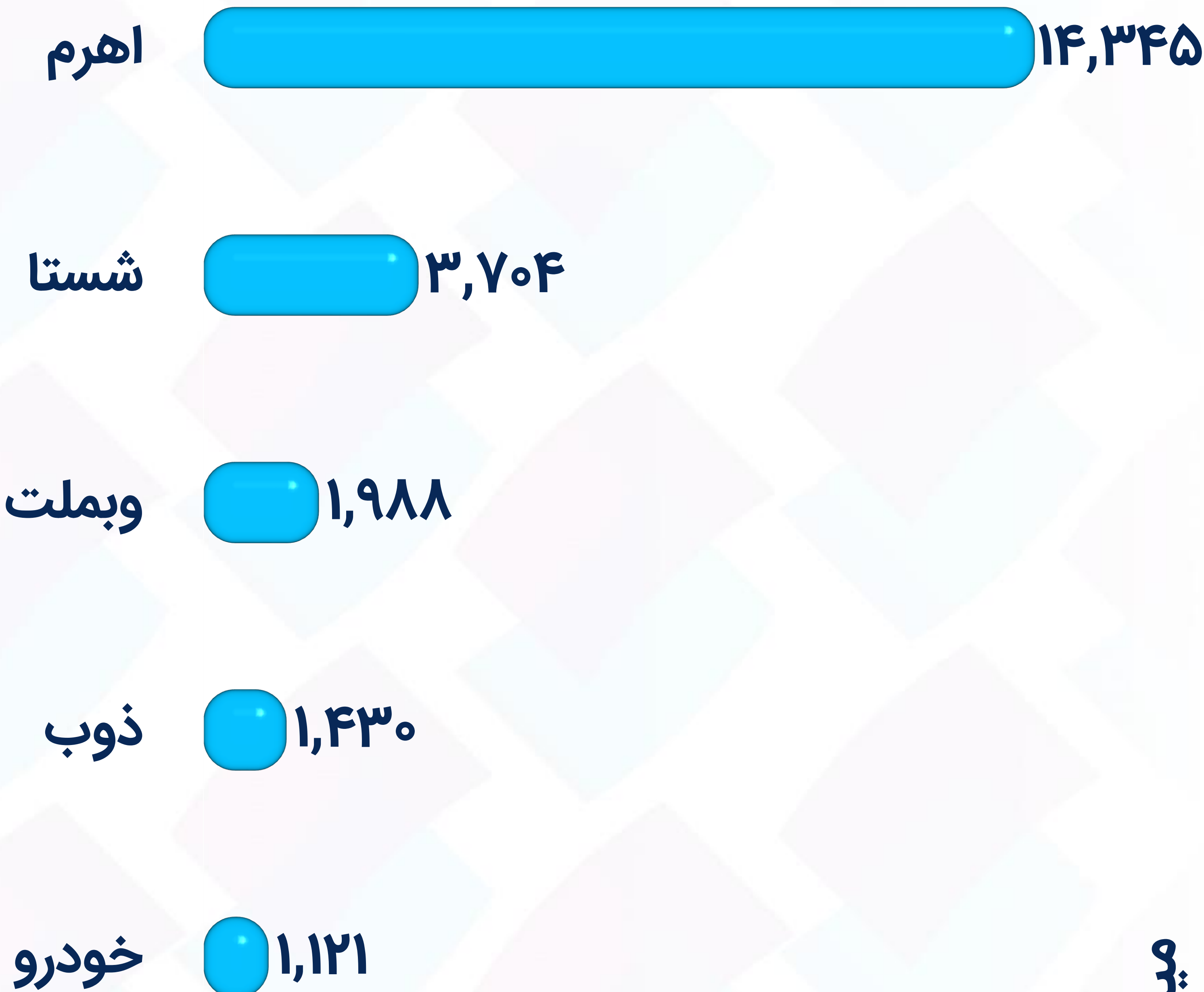
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

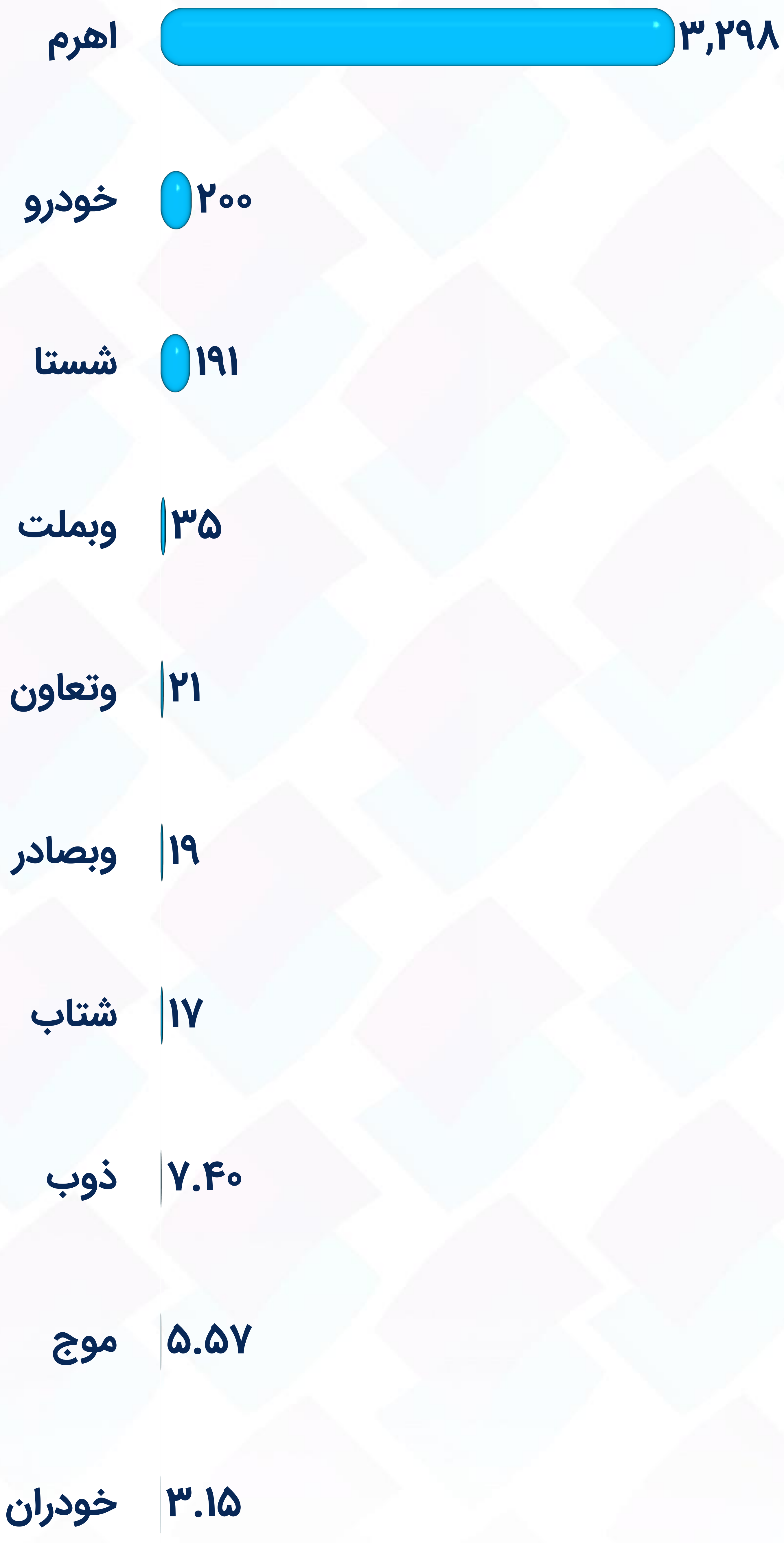


میلیون تومان

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

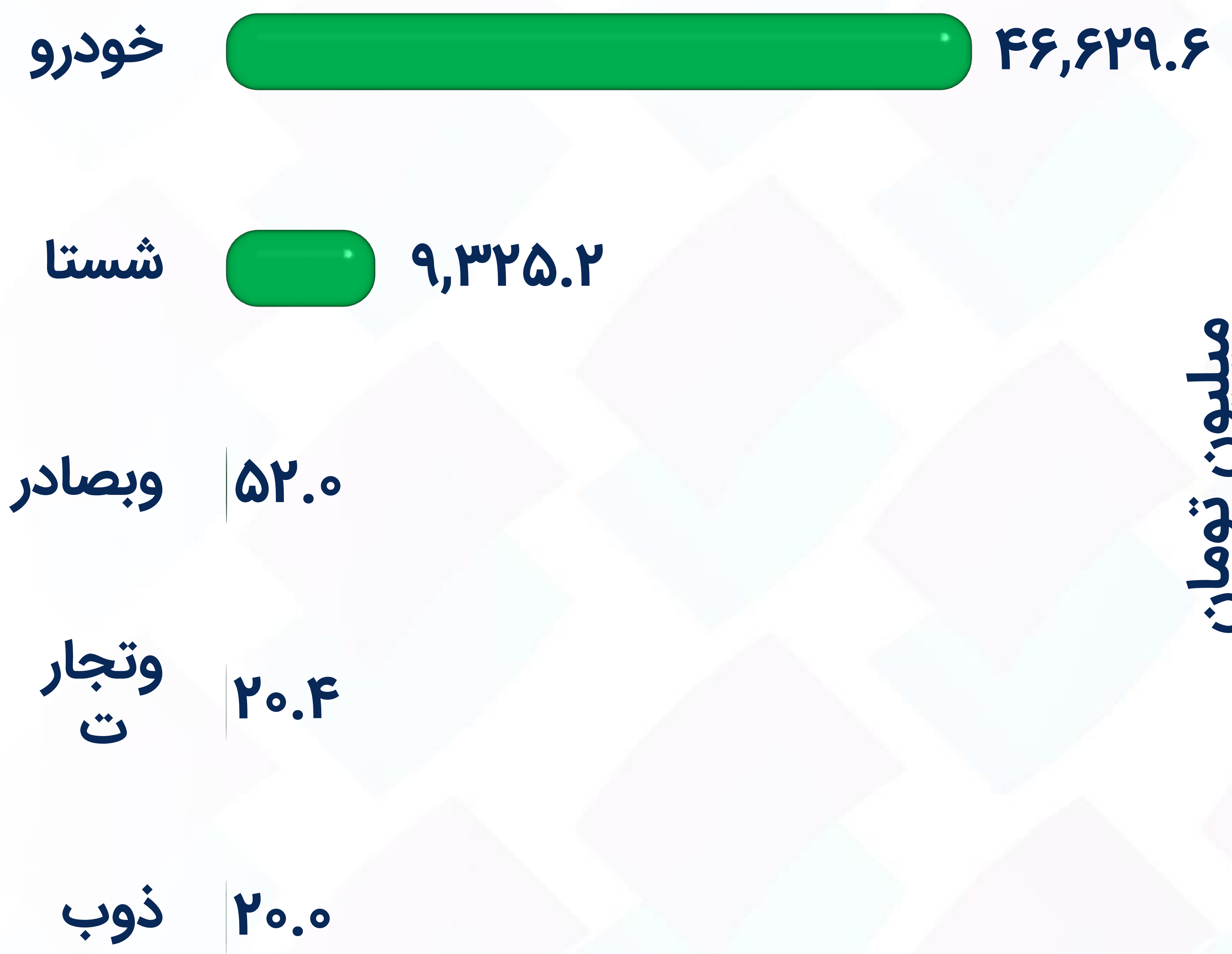
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



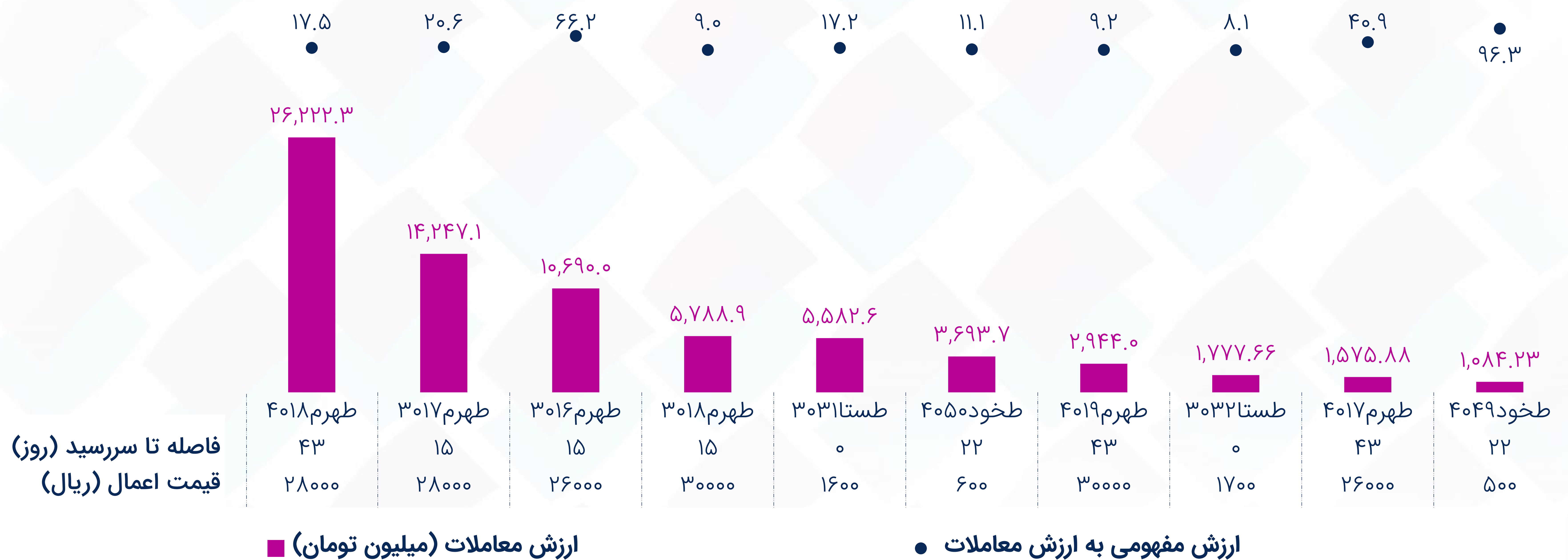
میلیون تومان

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	۱۵	۱۸۷.۰	۳	۵۱۷	۶۰۶	۱۷.۲%	۲۰۲.۰	۰.۱۷	۶	۱۰۷%
ضسپا۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۱۵	۱,۵۵۰.۶	۱۳	۵۱۷	۵۵۶	۷.۵%	۴۲.۸	۰.۴۲	۲۱	۵۸%
ضسپا۳۰۳۸	خسپا	۲۶۵	۱۵	۱.۴	۱۸۱	۵۱۷	۴۴۶	(۱۳.۷%)	۲.۵	۱.۰۰	۲۵۵	۴۱%
ضسپا۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۳۶	۳۷۸.۴	۴۴	۵۱۷	۵۴۴	۵.۲%	۱۲.۴	۰.۶۶	۶۱	۳۹%
ضفسوژ۵۰۳	فسوژ	۴,۸۰۰	۶۱	۲.۸	۲۰۰	۴,۶۱۴	۵,۰۰۰	۸.۴%	۲۵.۰	۰.۵۷	۲۶۵	۳۳%

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
ضذوب۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۸	۱.۸	۱	۴۵۵	۷۰۱	۵۴%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۸	۲.۳	۱	۶۹۰	۱,۰۰۱	۴۵%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۵	۱۵۱.۲	۲۰	۲۷,۰۷۰	۴۲,۰۲۰	۵۵%	۲,۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب۳۰۴۰	ذوب	۶۰۰	۸	۳.۵	۱	۴۵۵	۶۰۱	۳۲%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضوتعاون۳۱۳	وتعاون	۲,۴۰۰	۱۳	۵.۷	۲۱۲	۱,۸۹۶	۲,۶۱۲	۳۸%	۱۲.۳	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

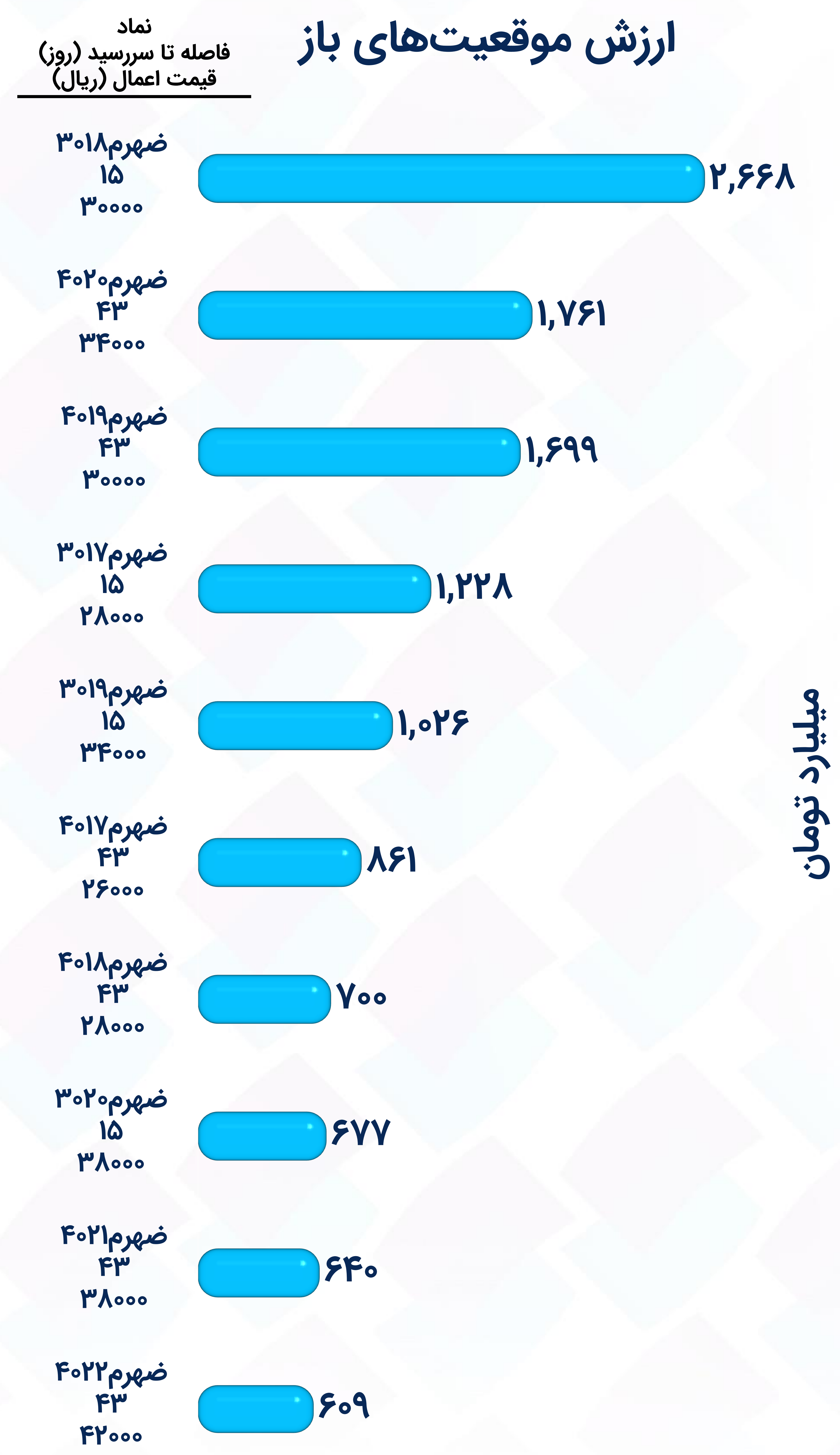
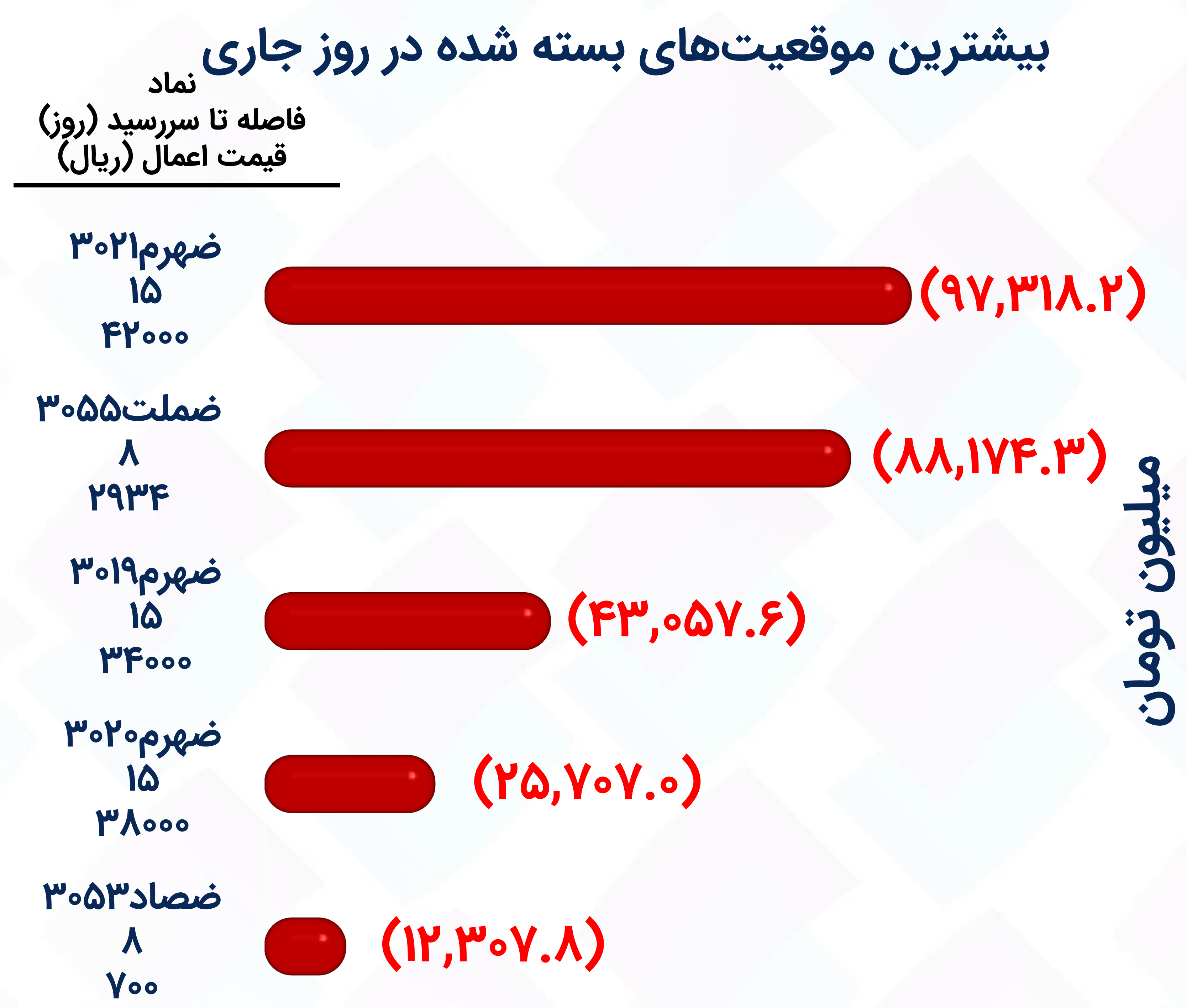
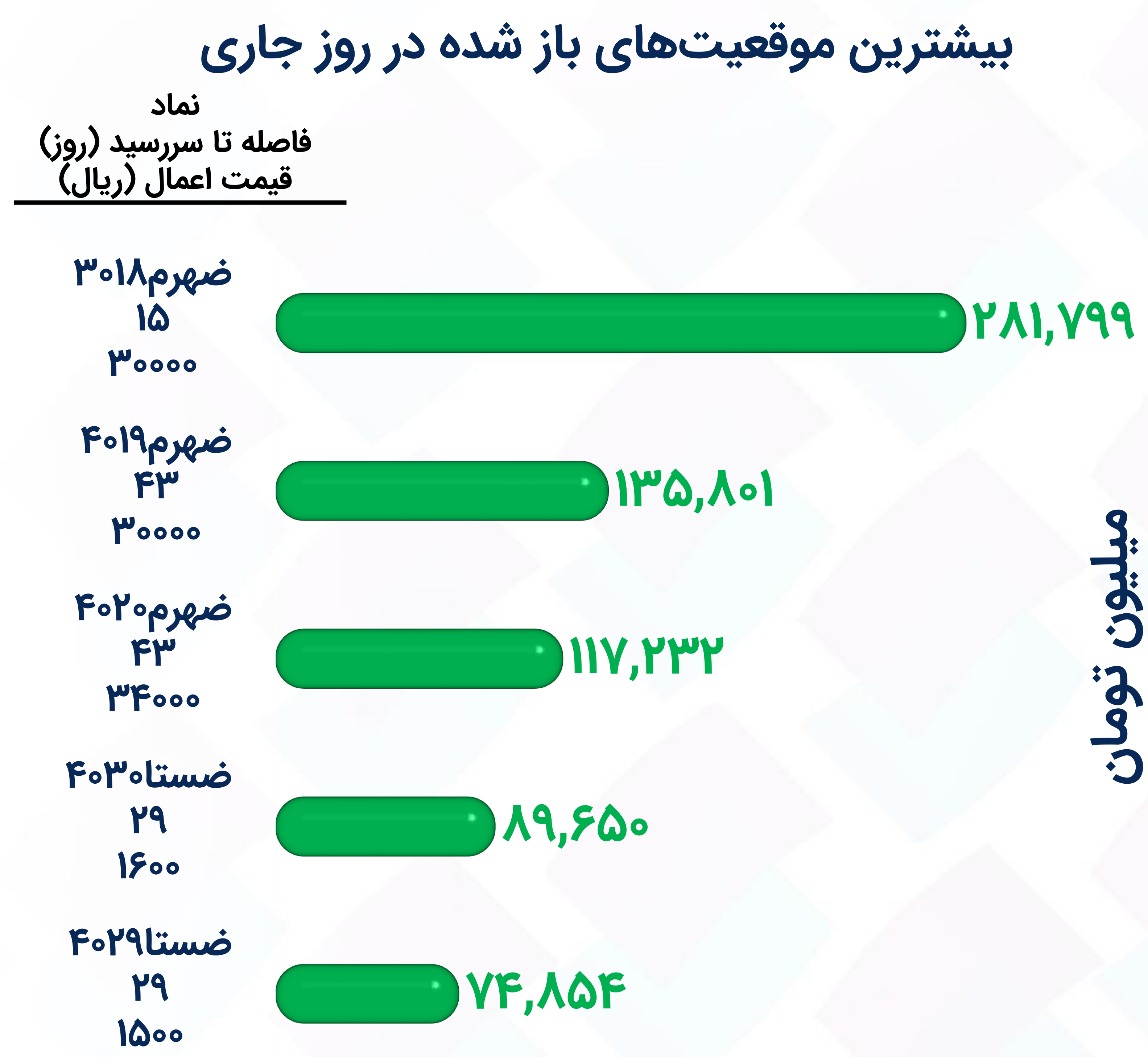
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۵	۹۱۵.۵	۶,۵۶۸	۲۷,۰۷۰	۲۷,۴۳۲	۱.۳%	۴.۲	-۱.۰۰	۶,۵۱۰	(۰.۹%)
طتوان ۳۲۸	توان	۲۸,۰۰۰	۶	۱۱.۵	۲,۲۹۰	۲۵,۶۷۹	۲۵,۷۱۰	۰.۱%	۱۱.۲	-۰.۹۸	۲,۲۱۳	(۳.۴%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۳	۵۱.۸	۱۴,۰۰۰	۲۷,۰۷۰	۲۸,۰۰۰	۳.۴%	۲.۰	-۱.۰۰	۱۳,۳۹۳	(۴.۳%)
طهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۴۳	۲۶.۶	۱۰,۲۳۳	۲۷,۰۷۰	۲۷,۷۶۷	۲.۶%	۲.۷	-۰.۹۹	۹,۵۴۵	(۶.۷%)
طهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۳	۴۹۴.۶	۶,۳۴۹	۲۷,۰۷۰	۲۷,۶۵۱	۲.۱%	۴.۴	-۰.۹۴	۵,۷۶۵	(۹.۲%)

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 ۳۰۴۷	وبملت	۱,۵۲۶	۸	۰.۰	۵	۲,۵۹۶	۱,۵۲۱	(۴۱.۴%)	۳۰۴.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۴۰۴۷	خودرو	۳۰۰	۲۲	۰.۱	۱	۵۷۸	۲۹۹	(۴۸.۳%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۴۳	۰.۰	۱	۲۷,۰۷۰	۱۵,۹۹۹	(۴۰.۹%)	۱۵,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۲	وبصادر	۶۰۰	۸	۲.۲	۱	۶۹۰	۵۹۹	(۱۳.۲%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۳%)
طخود ۴۰۴۸	خودرو	۴۰۰	۲۲	۱.۰	۲	۵۷۸	۳۹۸	(۳۱.۱%)	۱۹۹.۰	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.

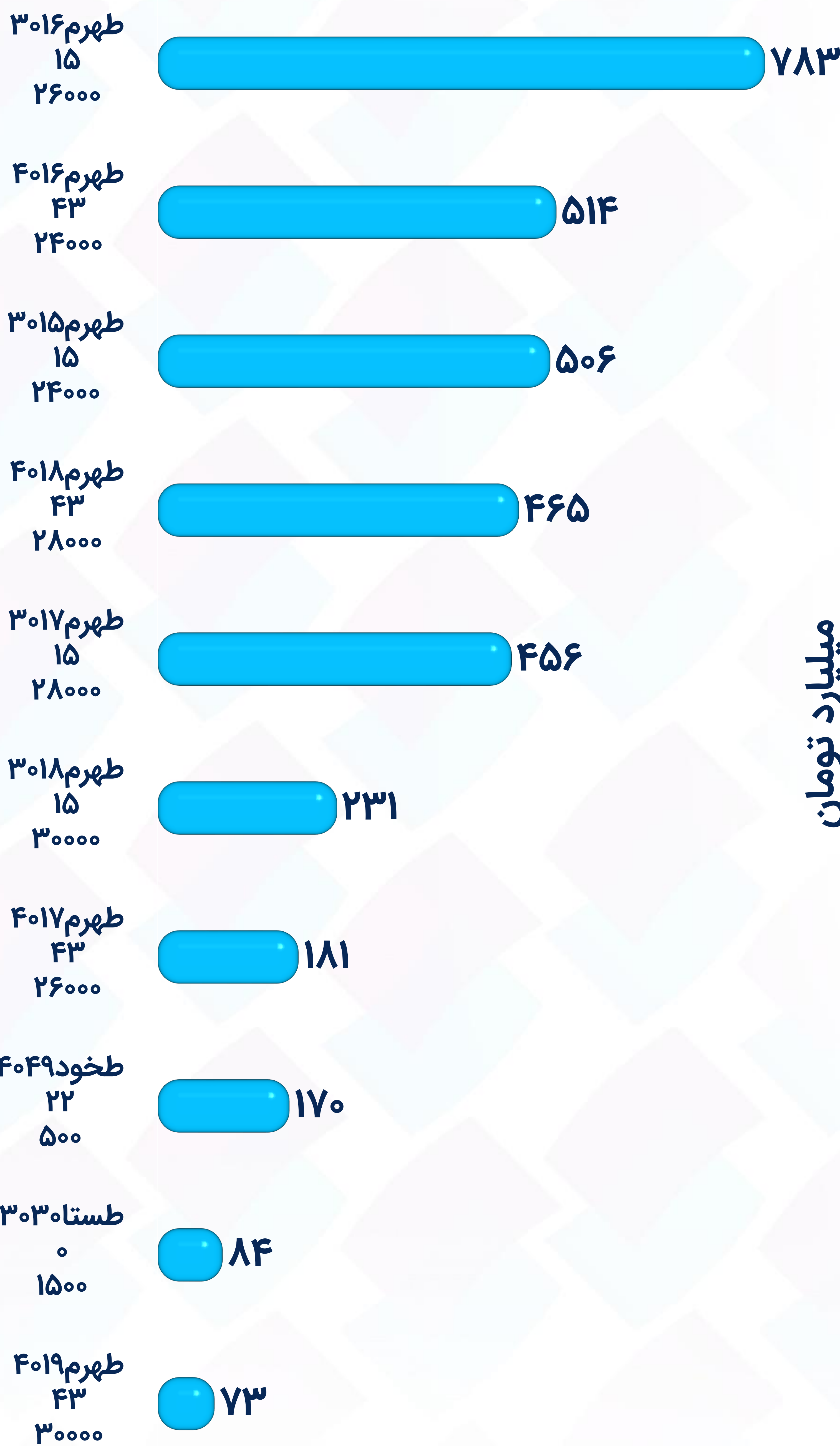
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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)

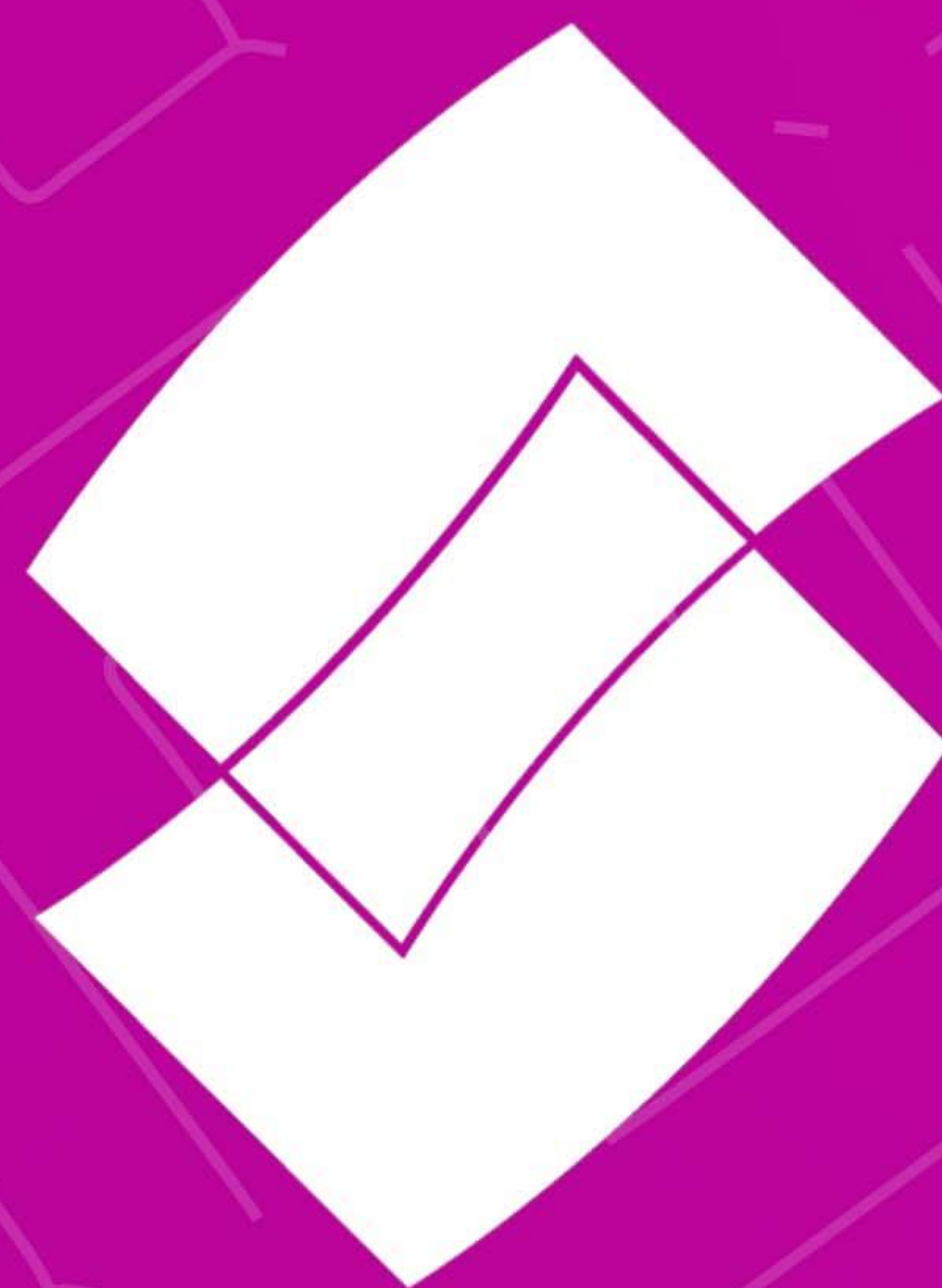
اختیار خرید



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.