

شماره
۴۹۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

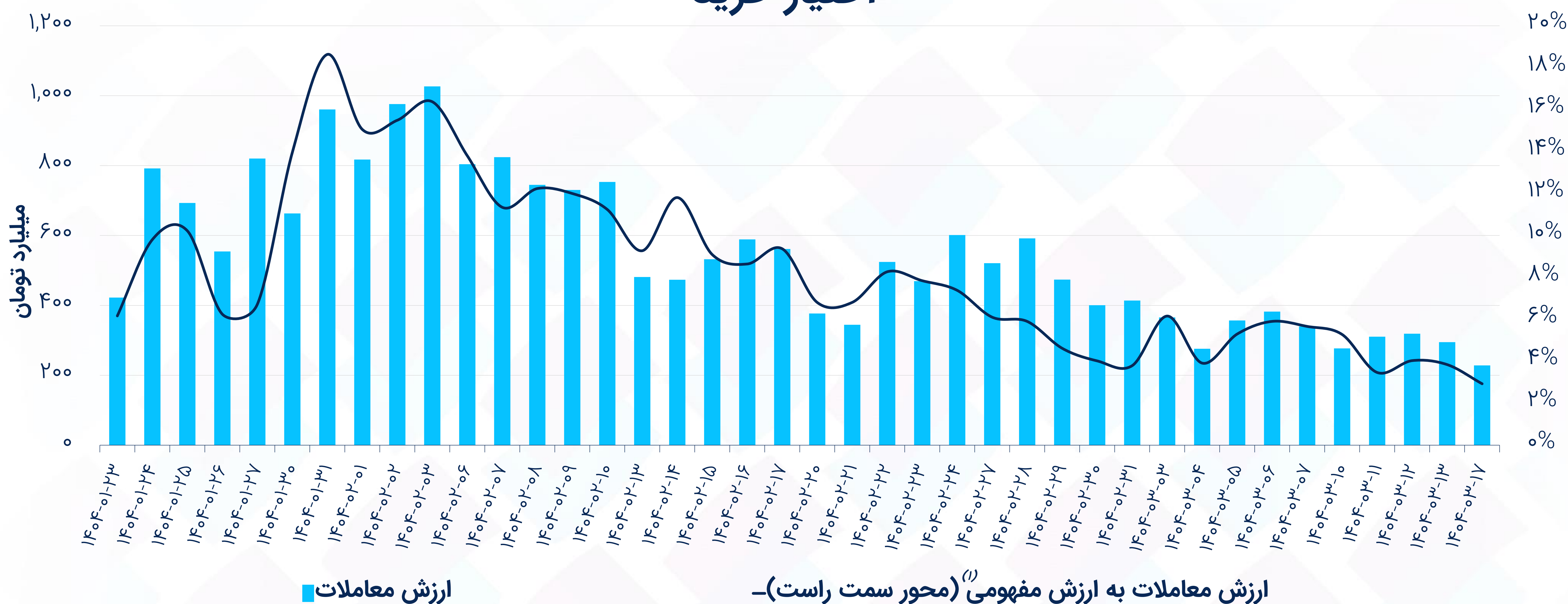




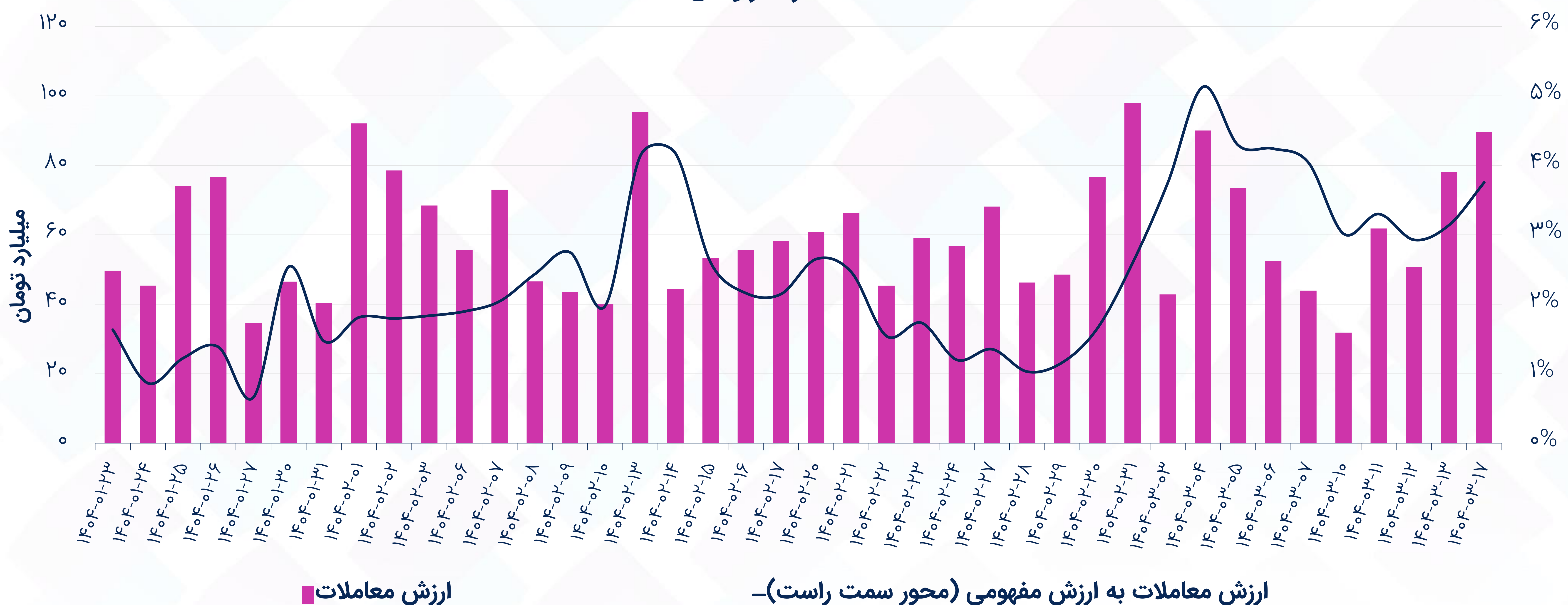
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



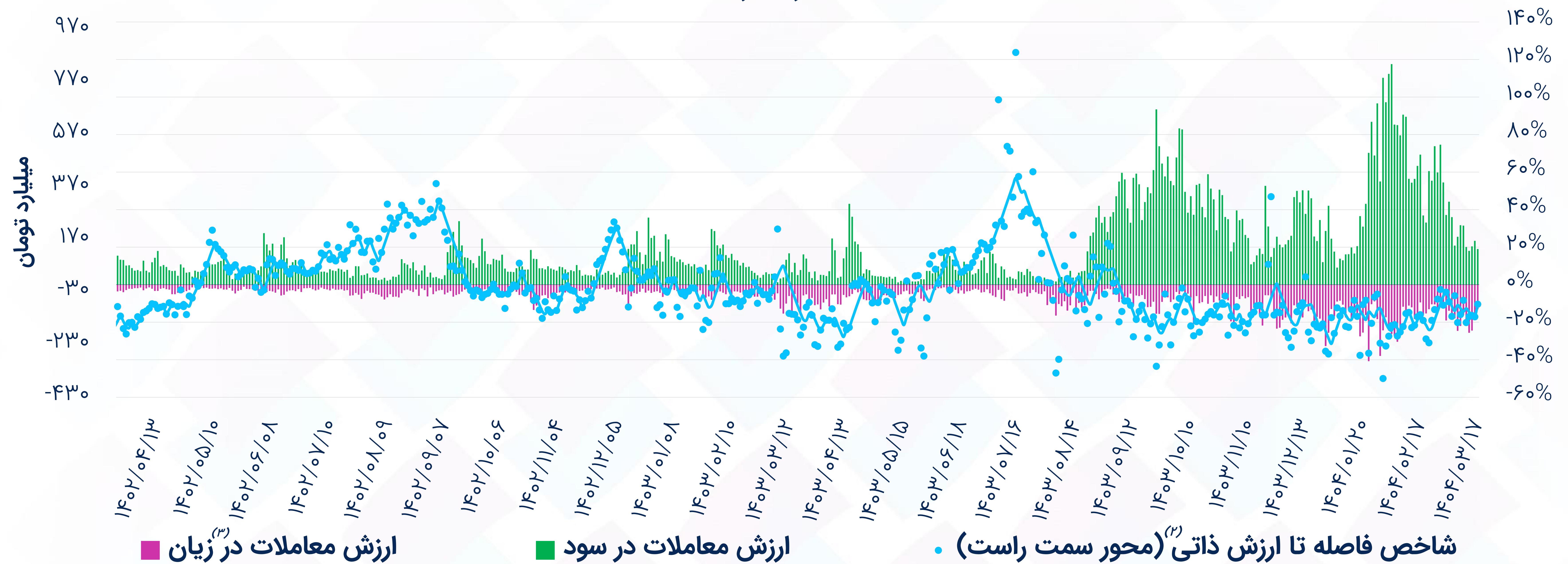
اختیار فروش



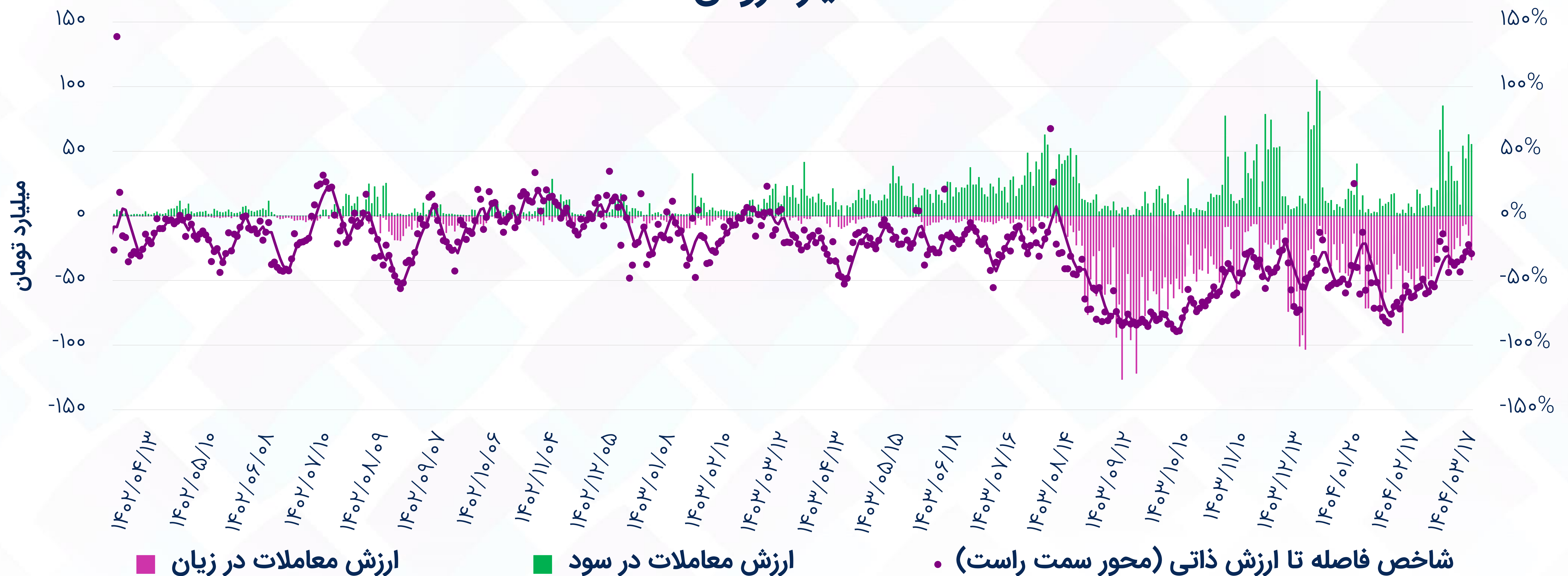
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۹	۱۵۱.۲	۵,۹۸۷.۷	۸۰.۲	۷۱.۱	(۲۰.۷%)
شتاب	۷	۱۸.۲	۷۷.۱	۱۶.۰	۲.۲	(۱۱.۸%)
خودرو	۲۵	۱۶.۳	۳۵۸.۷	۹.۸	۶.۵	۱۳.۶%
وبصادر	۱۵	۸.۱	۱۳۵.۶	۷.۲	۰.۹	۳۲.۱%
ذوب	۲۷	۷.۵	۱۷۱.۰	۵.۹	۱.۵	۱۳.۲%
شستا	۳۴	۷.۵	۳۶۴.۲	۰.۸	۶.۶	۸.۹%
وبملت	۲۱	۶.۷	۳۴۱.۶	۵.۵	۱.۳	۲۲.۰%

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	۲۱	۸۳,۲۸۸.۶	۲,۲۳۱,۴۷۳.۵	۵۰,۴۰۲.۴	۳۲,۸۸۶.۱	(۲۸.۹%)
خودرو	۷	۴,۸۳۹.۵	۹۸,۰۶۳.۴	۳,۹۳۲.۲	۹۰۷.۴	(۳۳.۴%)
شستا	۵	۸۶۲.۴	۳۱,۱۳۵.۸	۵۸۲.۷	۲۷۹.۷	(۳۷.۱%)
وبملت	۲	۲۴۲.۰	۱۴,۳۴۷.۹	۲۲۱.۰	۲۱.۰	(۲۸.۳%)
توان	۵	۱۴۰.۲	۳,۲۲۹.۹	۱۰۶.۴	۳۳.۸	(۲۰.۹%)
وبصادر	۲	۸۱.۶	۱,۰۸۰.۵	۸۱.۴	۰.۲	(۵۰.۱%)
ذوب	۴	۷۰.۳	۶,۳۶۴.۶	۴۲.۸	۲۷.۴	(۴۸.۹%)

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



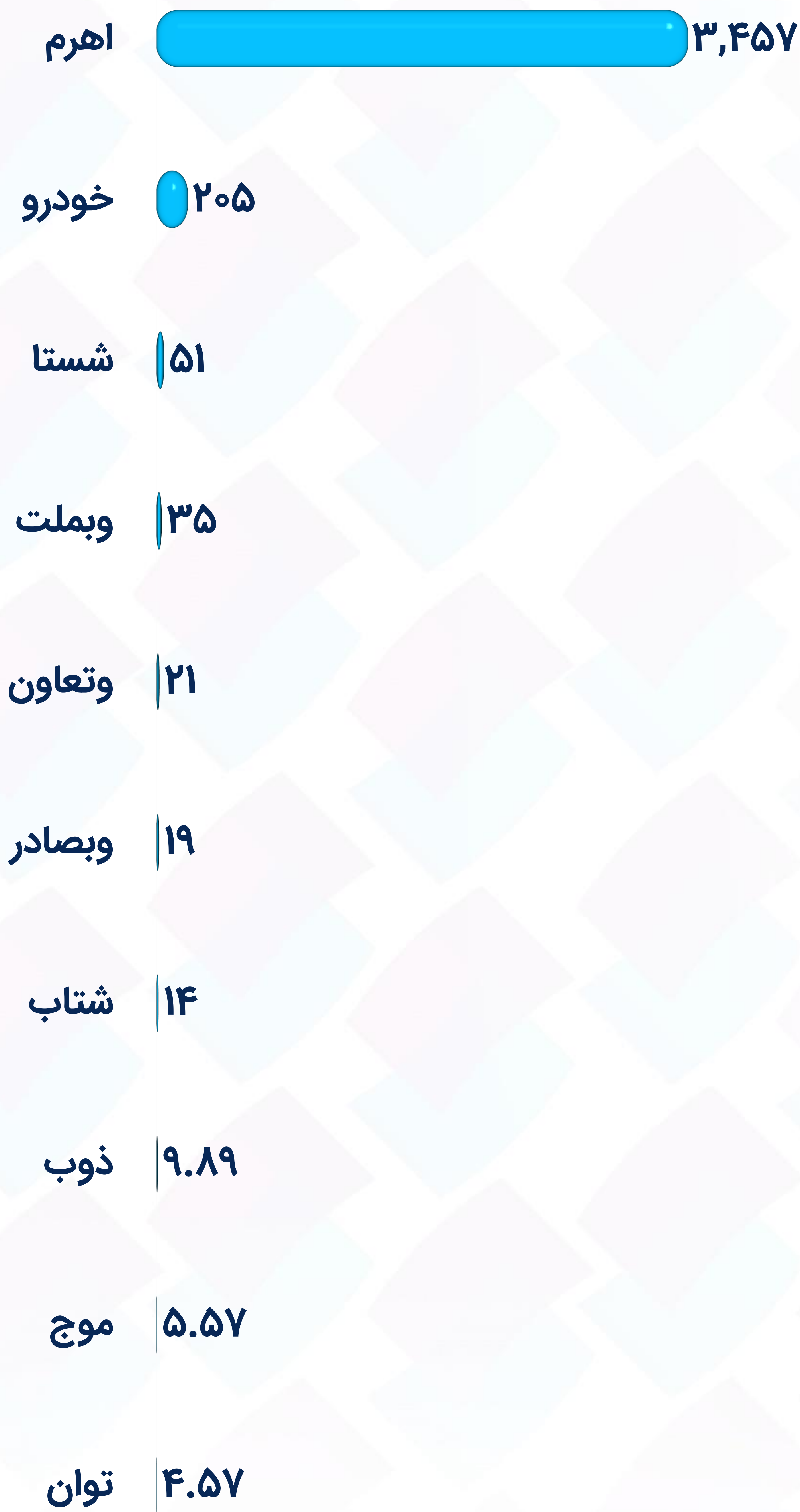
میلیون تومان



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

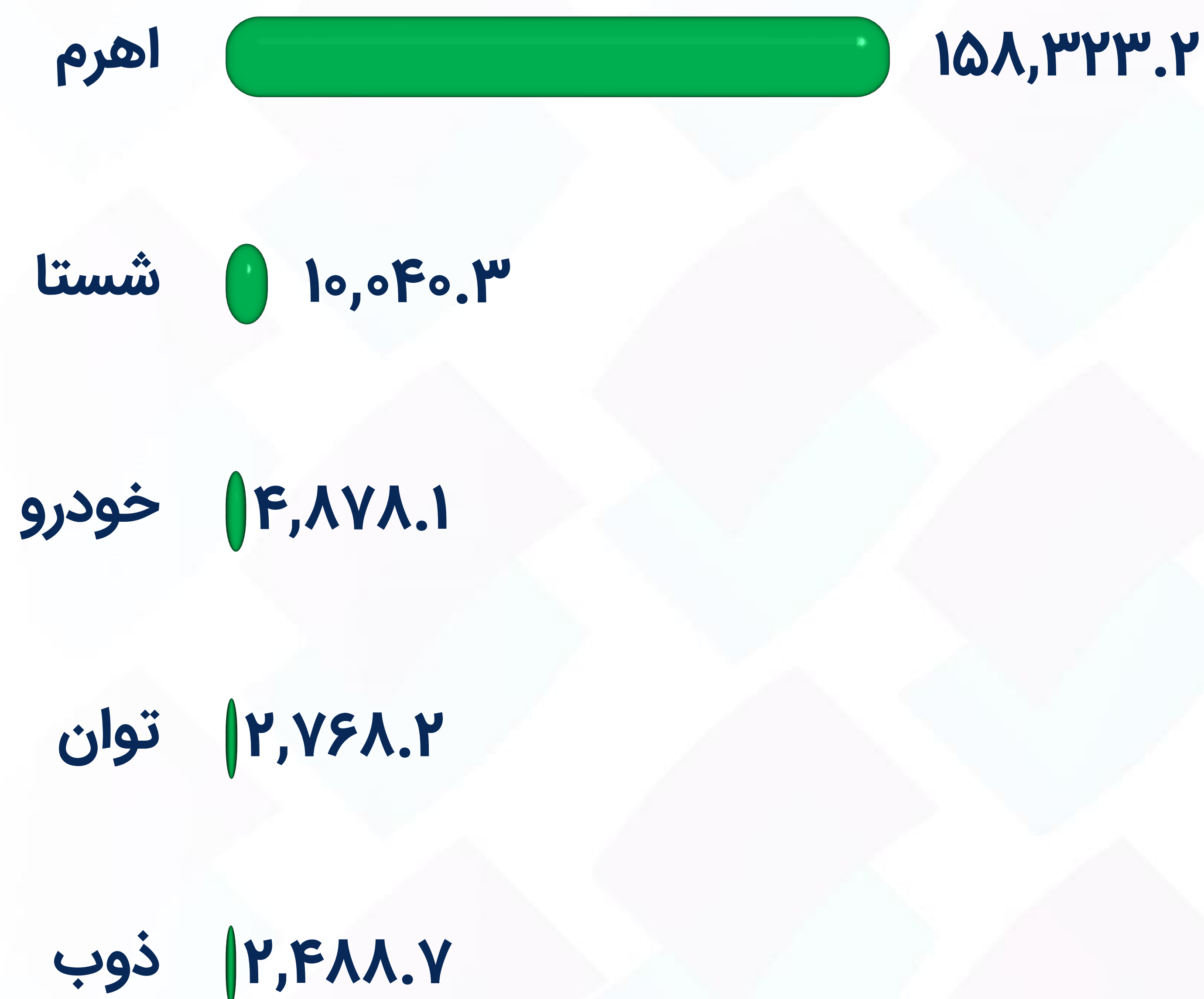
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



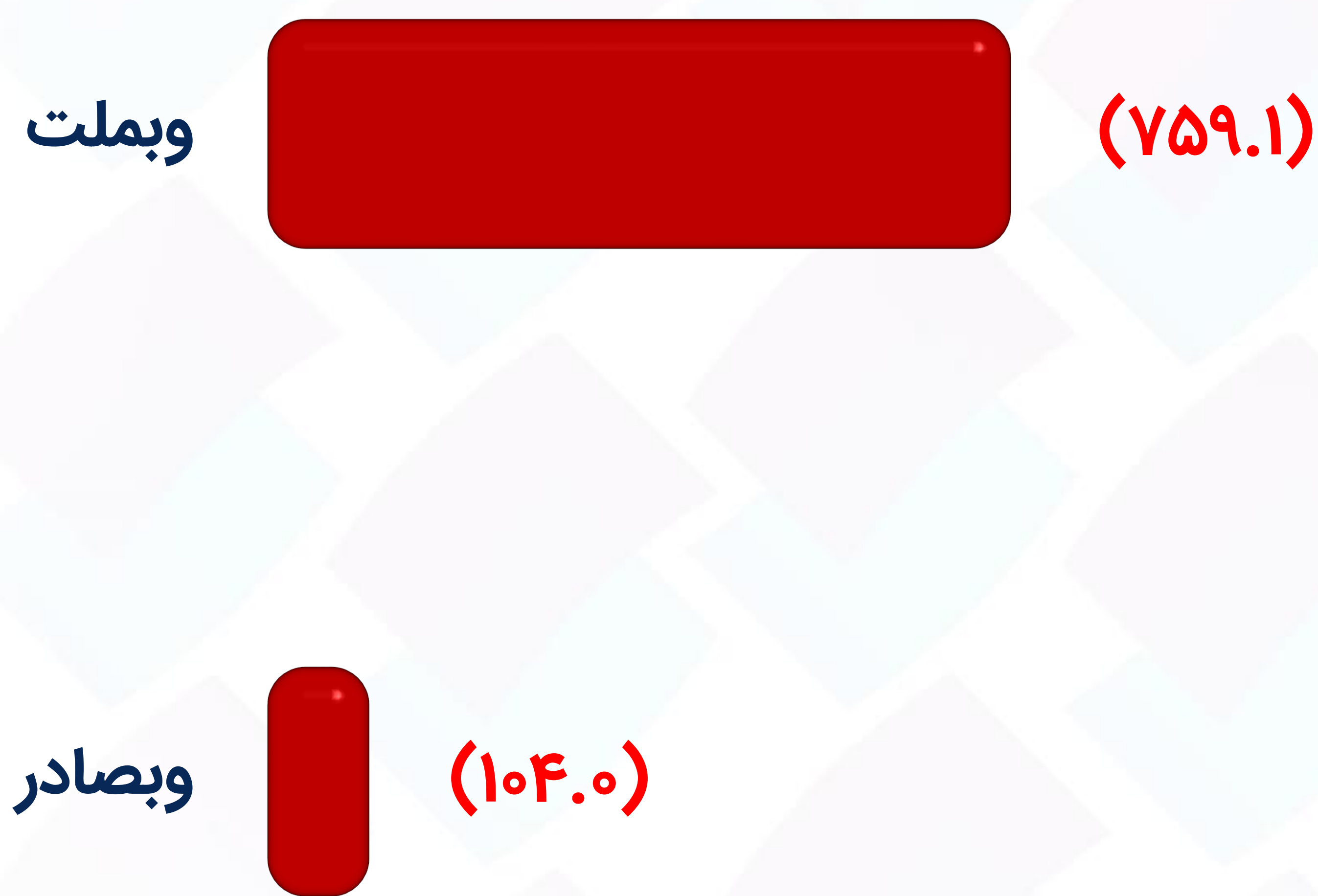
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



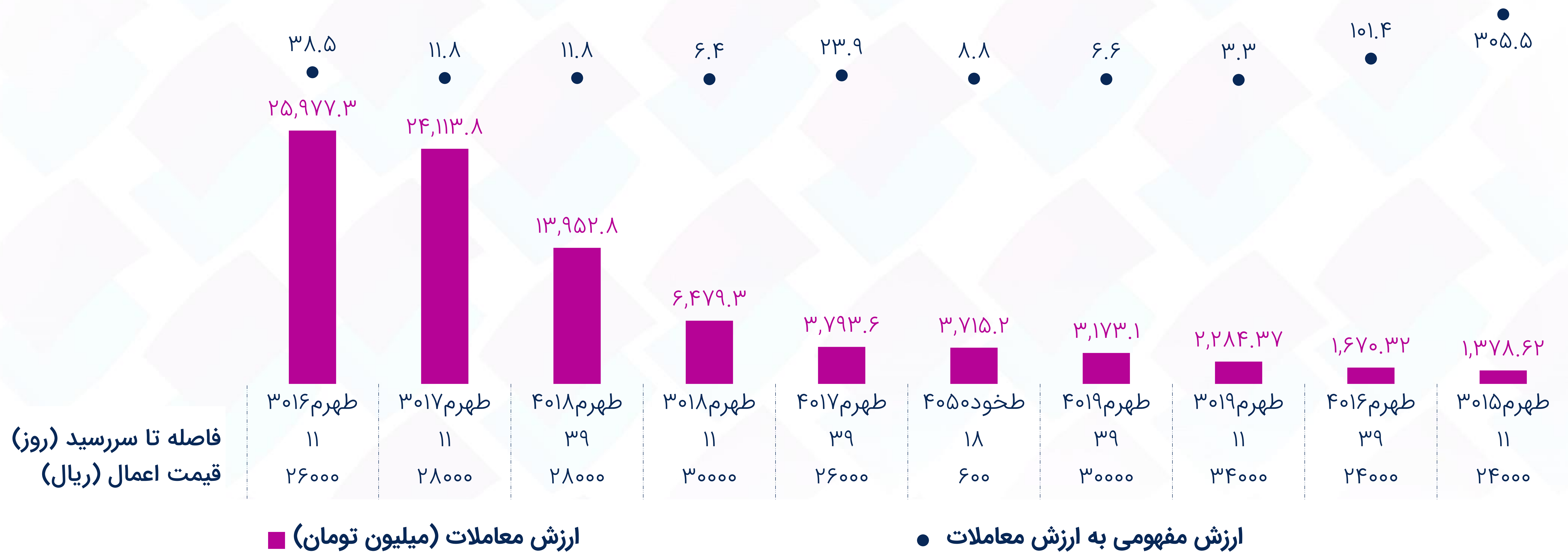
میلیون تومان

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
ضخاور ۵۲۲	خاور	۱,۷۰۰	۶۴	۱.۶	۱۶	۱,۶۲۷	۱,۷۱۶	۵.۵%	۱۰۷.۳	۰.۵۸	۱۱۲	۵۹۸%
ضسپا ۳۰۴۸	خسپا	۶۰۳	۱۱	۱۶۱.۹	۱	۵۰۲	۶۰۴	۲۰.۳%	۶۰۴.۰	۰.۱۲	۴	۳۰۲%
ضسپا ۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۱۱	۸۰۴.۲	۵	۵۰۲	۵۴۸	۹.۲%	۱۰۹.۶	۰.۳۴	۱۵	۱۹۷%
ضسپا ۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۳۲	۱۲۲.۹	۲۶	۵۰۲	۵۲۶	۴.۸%	۲۰.۲	۰.۶۱	۵۲	۱۰۰%
ضسپا ۳۰۴۶	خسپا	۴۸۲	۱۱	۸۲.۱	۲۲	۵۰۲	۵۰۴	۰.۴%	۲۲.۹	۰.۶۷	۴۲	۹۱%

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 ۳۰۴۱	ذوب	۷۰۰	۴	۴.۲	۱	۴۴۳	۷۰۱	۵۸%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۱	۲۲.۵	۱۲	۲۶,۲۷۰	۴۲,۰۱۲	۶۰%	۳,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضبساما ۵۱۰	بساما	۱۳,۰۰۰	۵۰	۳.۲	۶۴۰	۸,۶۳۰	۱۳,۶۴۰	۵۸%	۲۱.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۰	ذوب	۶۰۰	۴	۱.۲	۱	۴۴۳	۶۰۱	۳۶%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضبساما ۵۰۹	بساما	۱۲,۰۰۰	۵۰	۷.۴	۹۵۶	۸,۶۳۰	۱۲,۹۵۶	۵۰%	۱۳.۶	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
طسپا ۳۰۴۶	خسپا	۴۸۲	۱۱	۲.۸	۱۵	۵۰۲	۴۶۷	(۷.۰%)	۳۱.۱	-۰.۳۳	۱۶	۶.۸%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۱	۳.۰	۱۵,۰۰۰	۲۶,۲۷۰	۲۷,۰۰۰	۲.۸%	۱.۸	-۱.۰۰	۱۵,۱۹۹	۱.۳%
طتوان ۳۲۸	توان	۲۸,۰۰۰	۲	۶.۰	۳,۰۰۰	۲۴,۹۳۴	۲۵,۰۰۰	۰.۳%	۸.۳	-۱.۰۰	۲,۹۴۸	(۱.۷%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۹	۱۴.۵	۱۴,۵۰۰	۲۶,۲۷۰	۲۷,۵۰۰	۴.۷%	۱.۹	-۱.۰۰	۱۴,۱۵۷	(۲.۴%)
طهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳۹	۳۱.۰	۱۱,۰۷۱	۲۶,۲۷۰	۲۶,۹۲۹	۲.۵%	۲.۴	-۱.۰۰	۱۰,۳۱۰	(۶.۹%)

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
طذوب ۳۰۳۶	ذوب	۲۰۰	۴	۰.۰	۱	۴۴۳	۱۹۹	(۵۵.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۴۰۴۷	خودرو	۳۰۰	۱۸	۰.۱	۱	۵۶۲	۲۹۹	(۴۶.۸%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۳۹	۱.۰	۳۴	۲۶,۲۷۰	۱۷,۹۶۶	(۳۱.۶%)	۵۲۸.۴	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طخود ۴۰۴۸	خودرو	۴۰۰	۱۸	۱.۹	۱	۵۶۲	۳۹۹	(۲۹.۰%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۶.۷%)
طذوب ۳۰۳۸	ذوب	۴۰۰	۴	۲۷.۴	۲	۴۴۳	۳۹۸	(۱۰.۲%)	۱۹۹.۰	-۰.۰۱	۰	(۹۵.۸%)

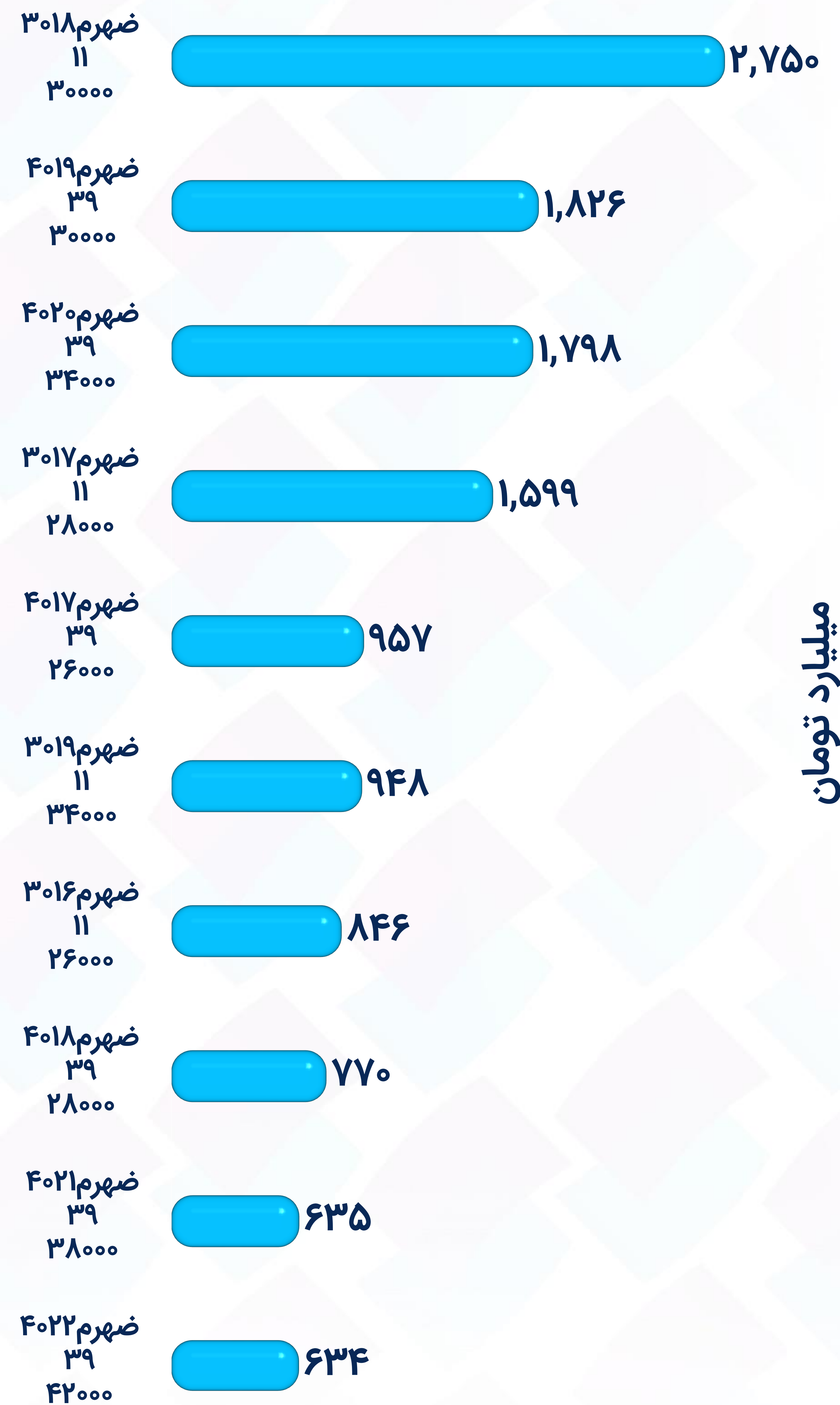
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

ارزش موقعیت‌های باز

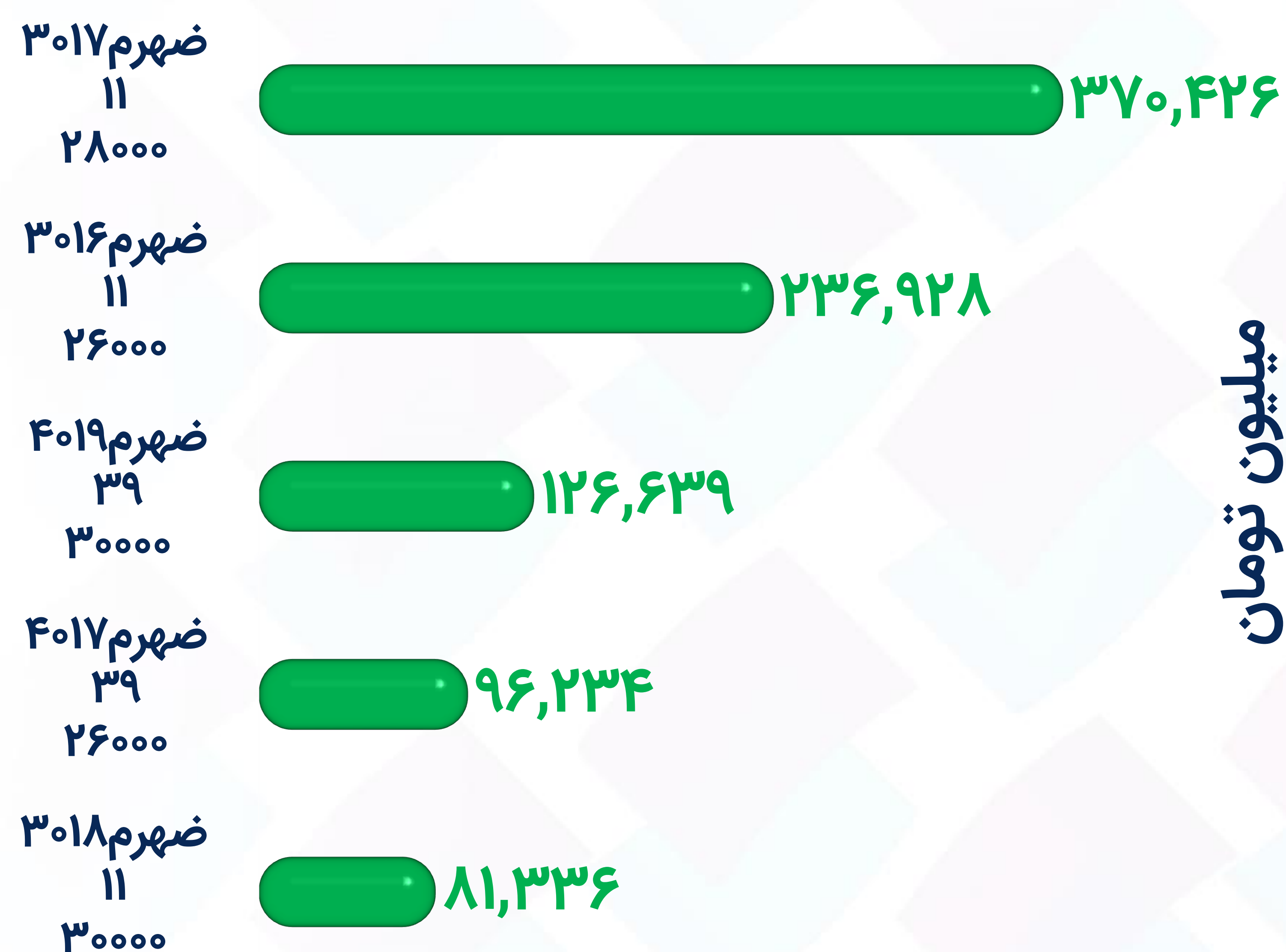
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

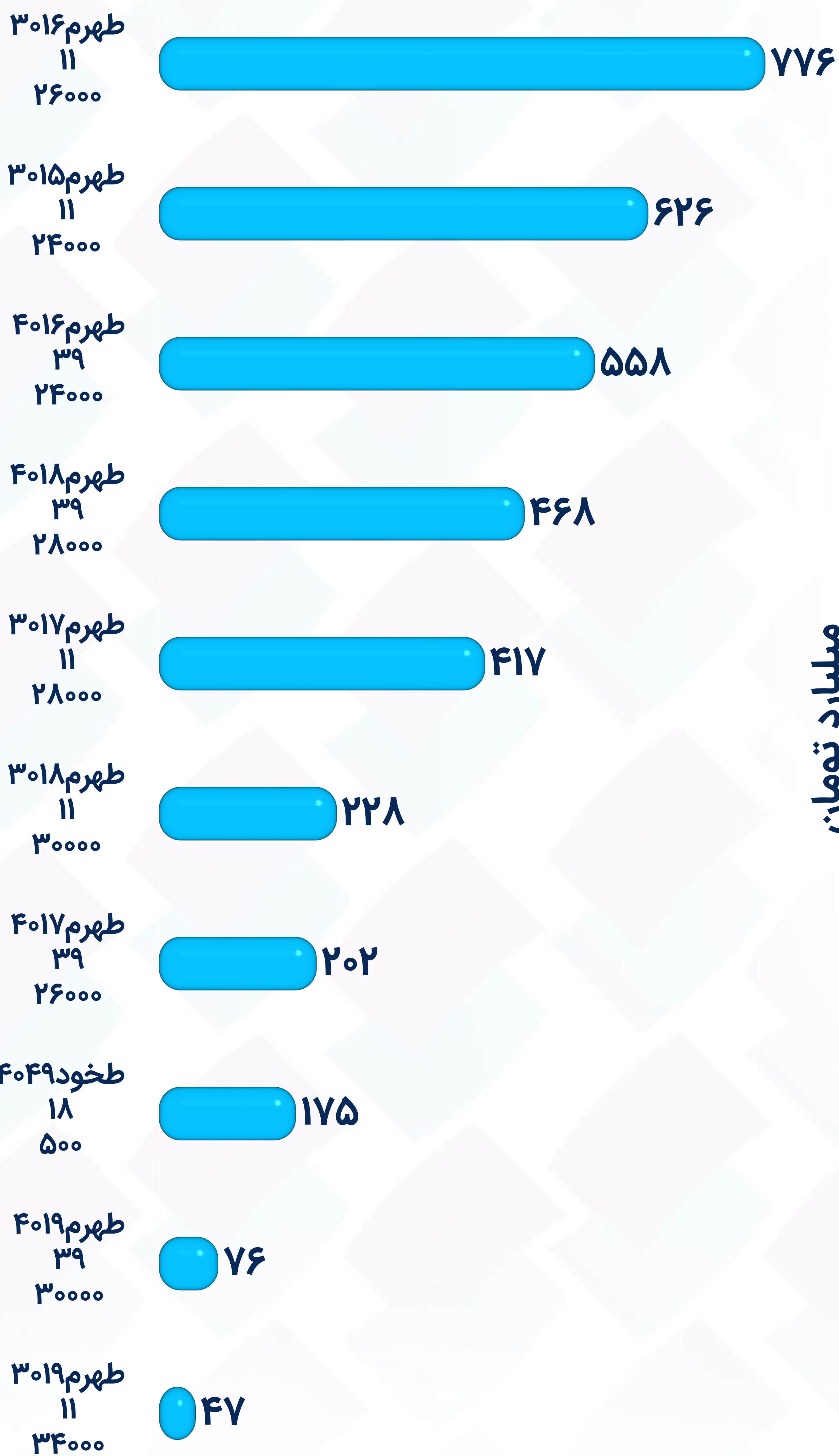


میلیون تومان

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

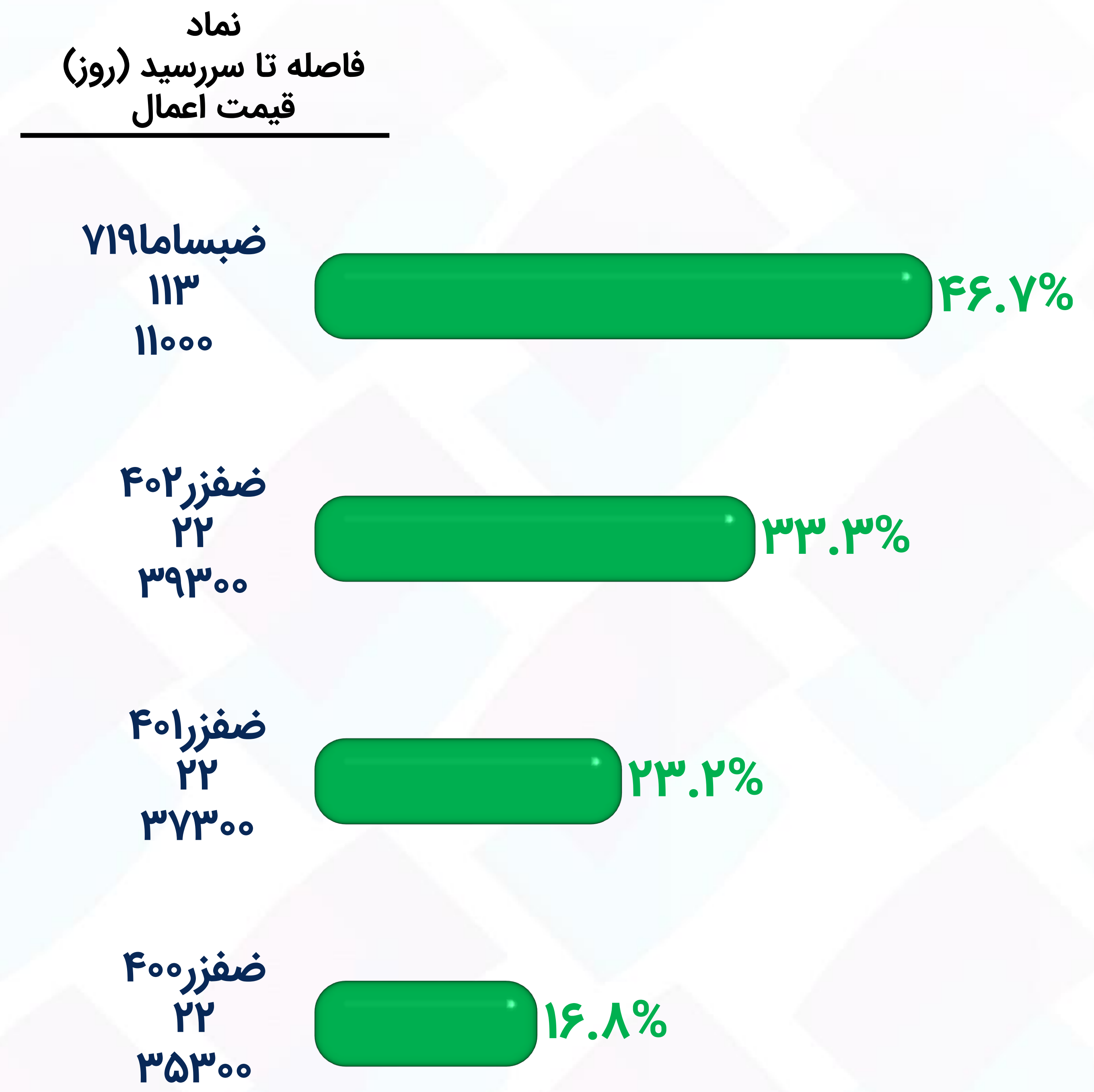
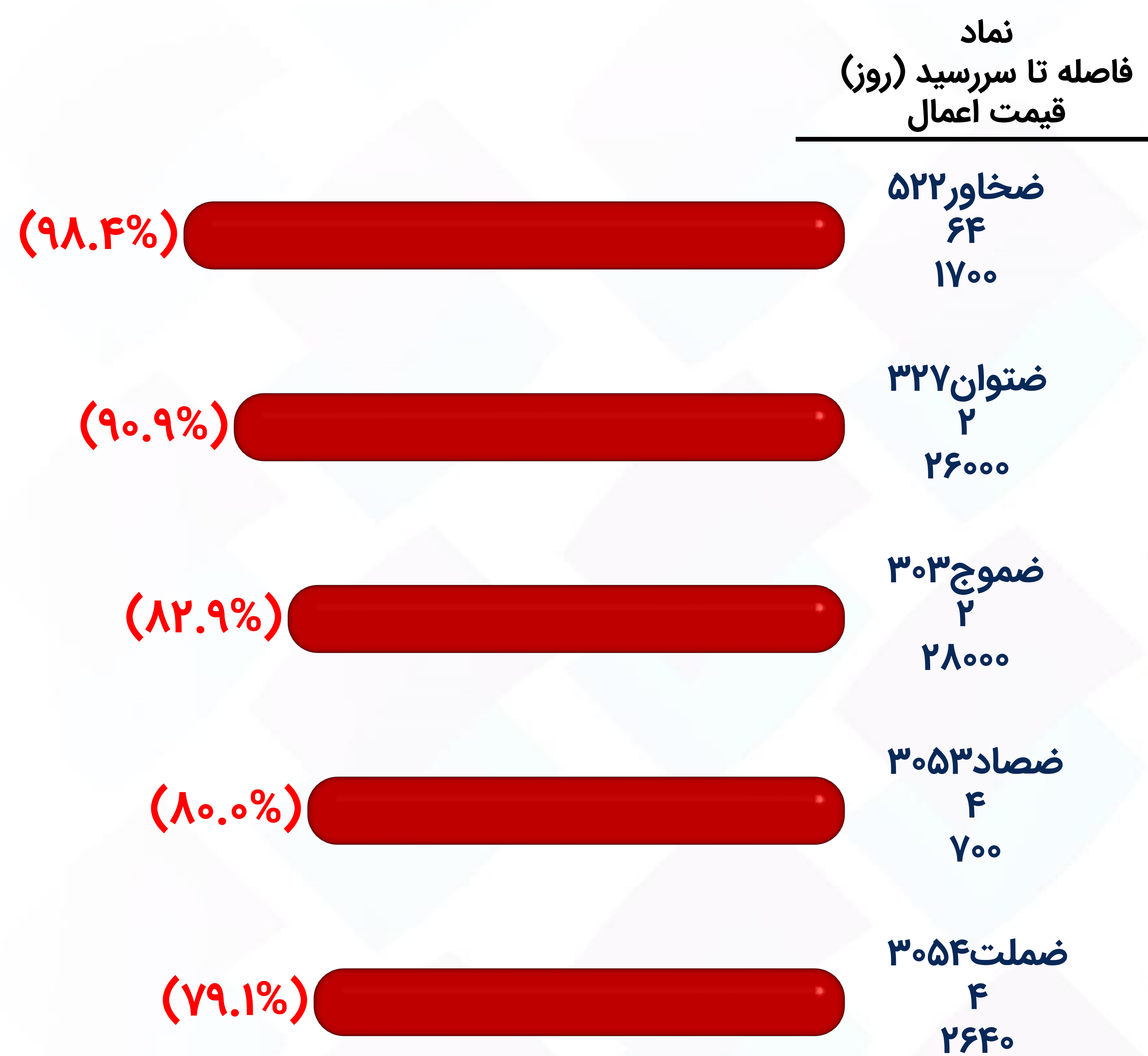
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



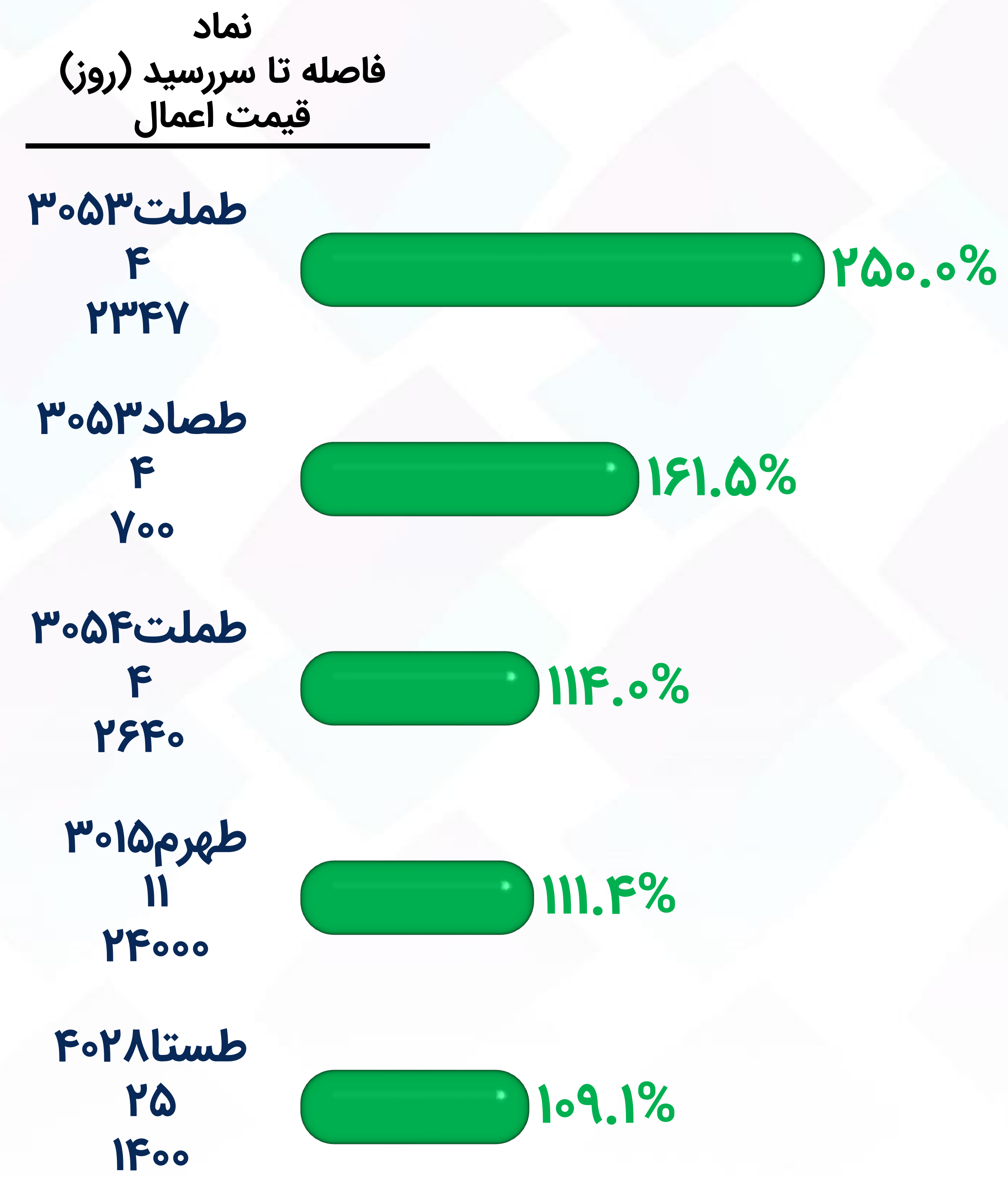
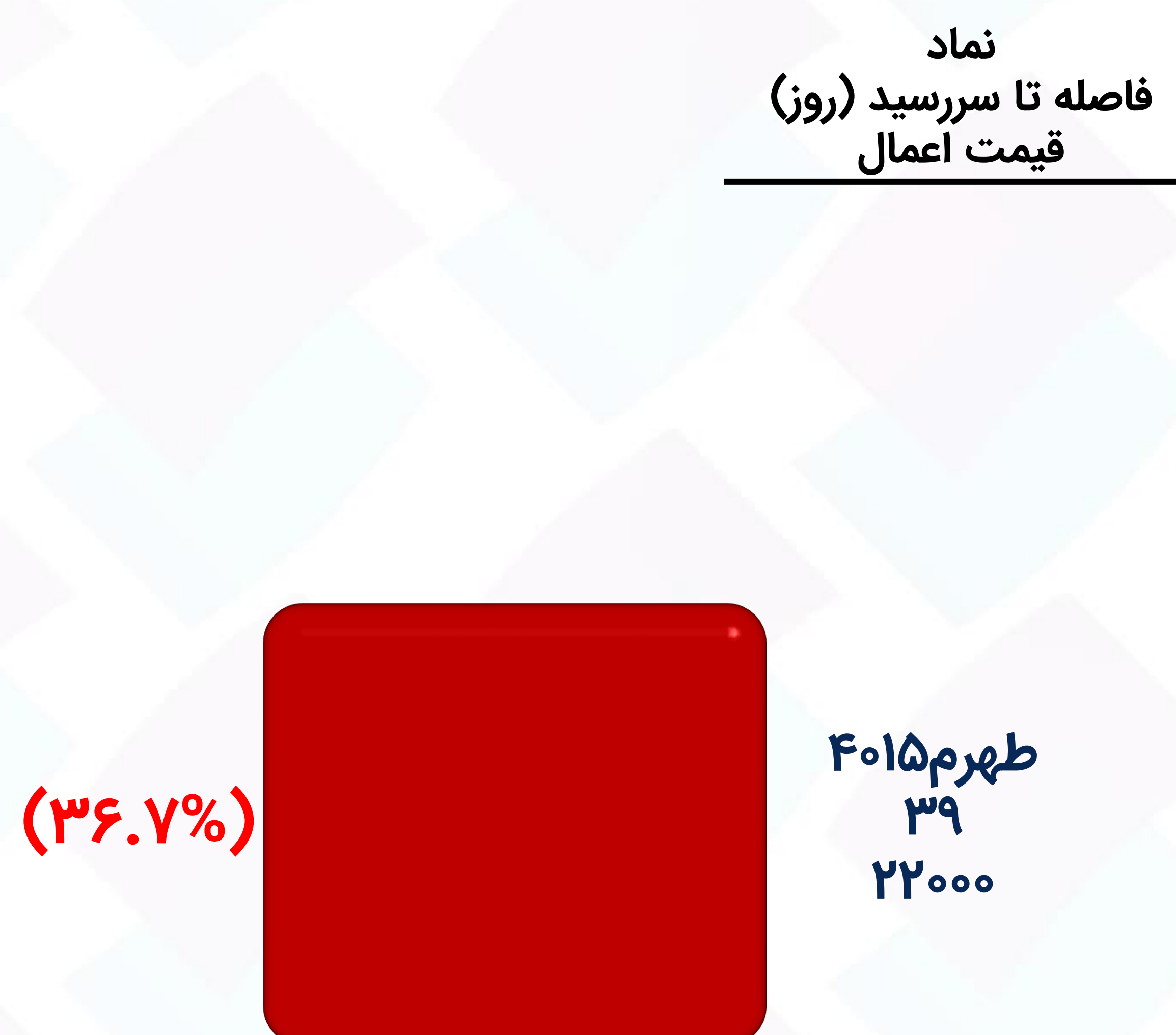
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

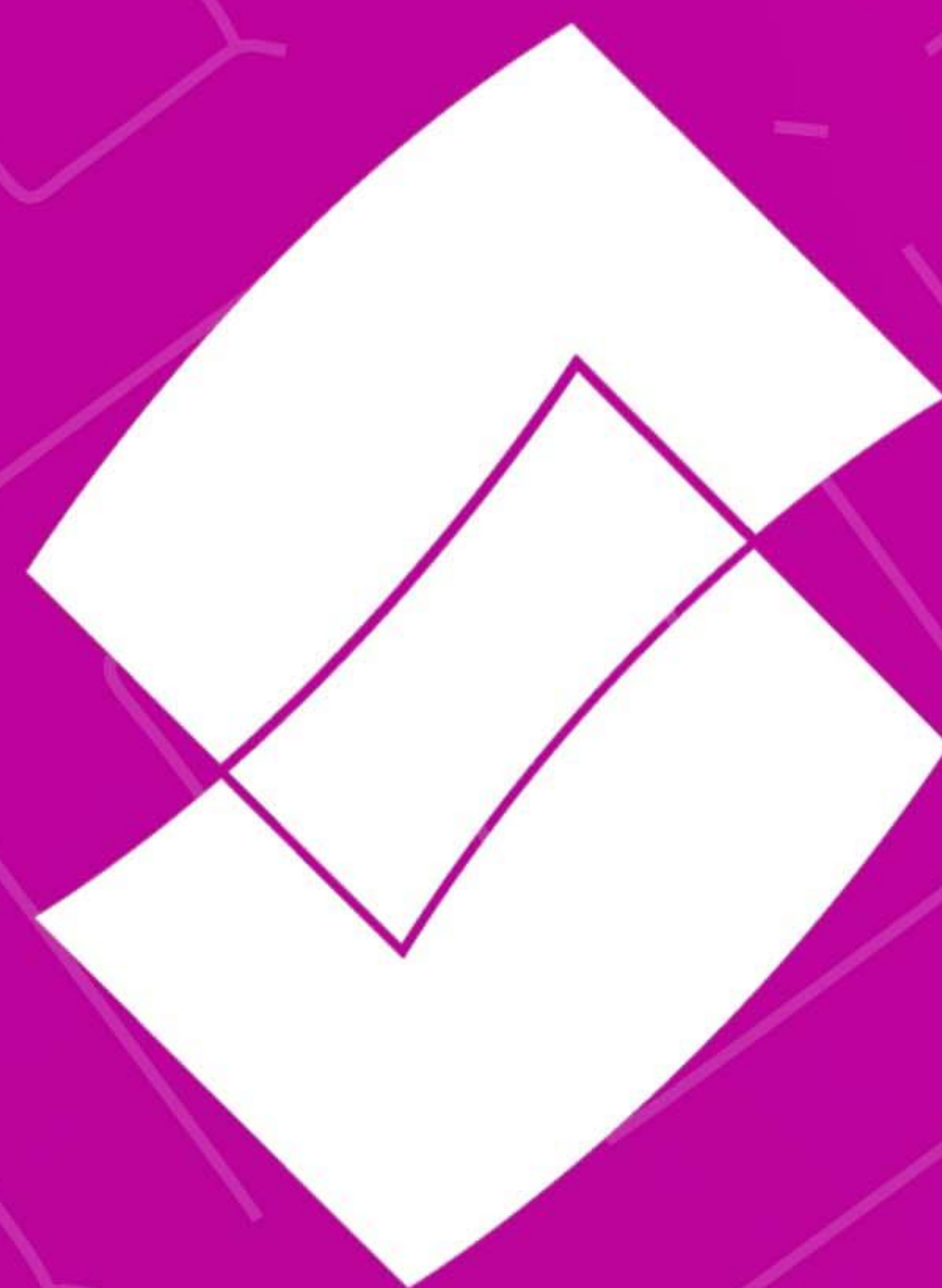
اختیار خرید



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.