

شماره
۴۹۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ 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



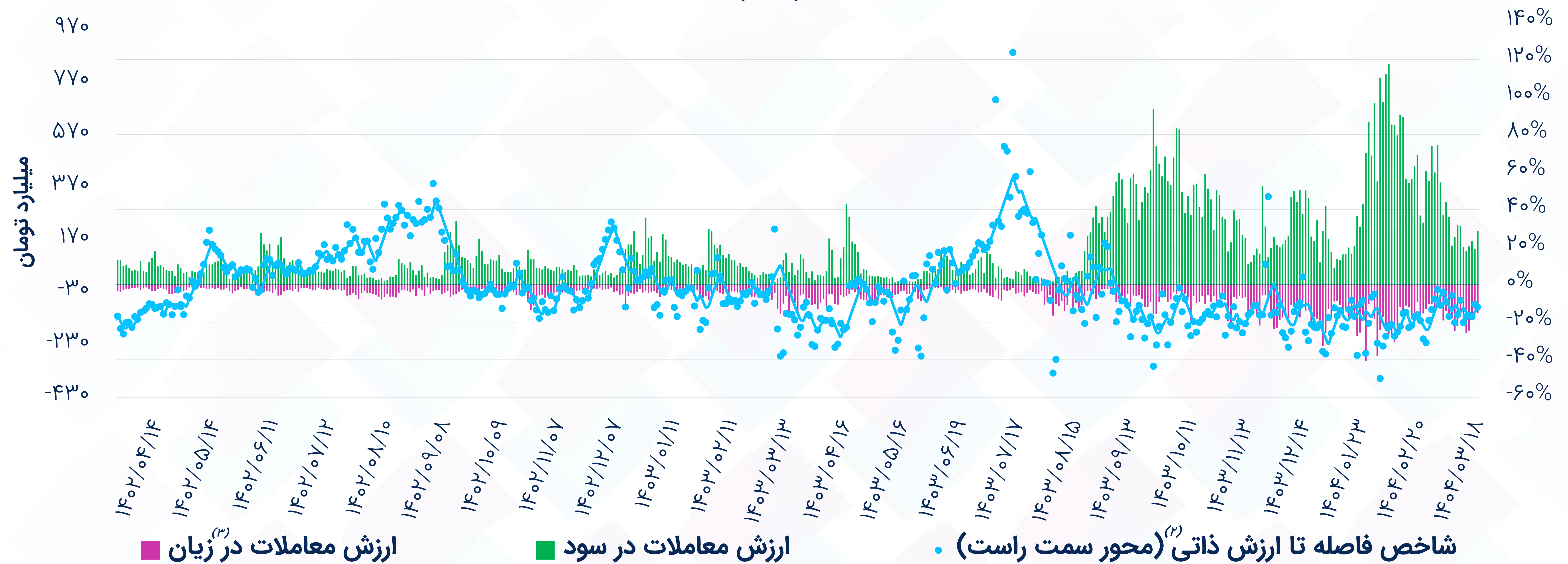
اختیار فروش



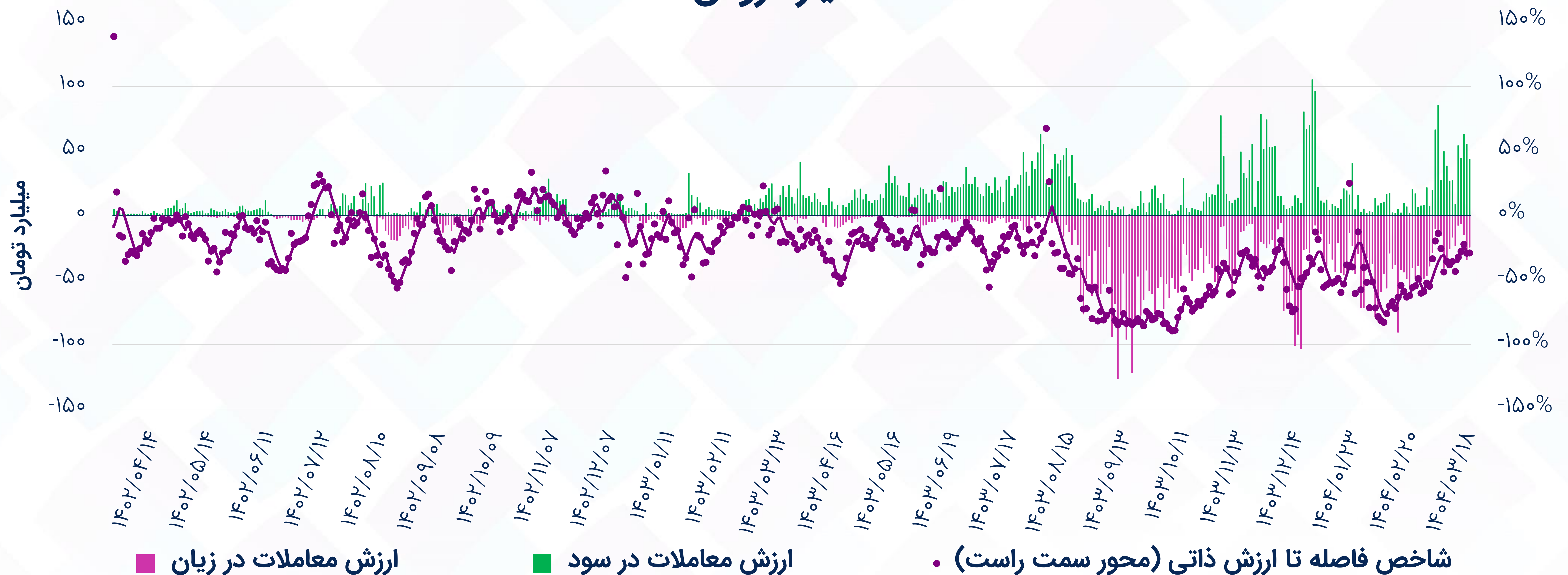
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

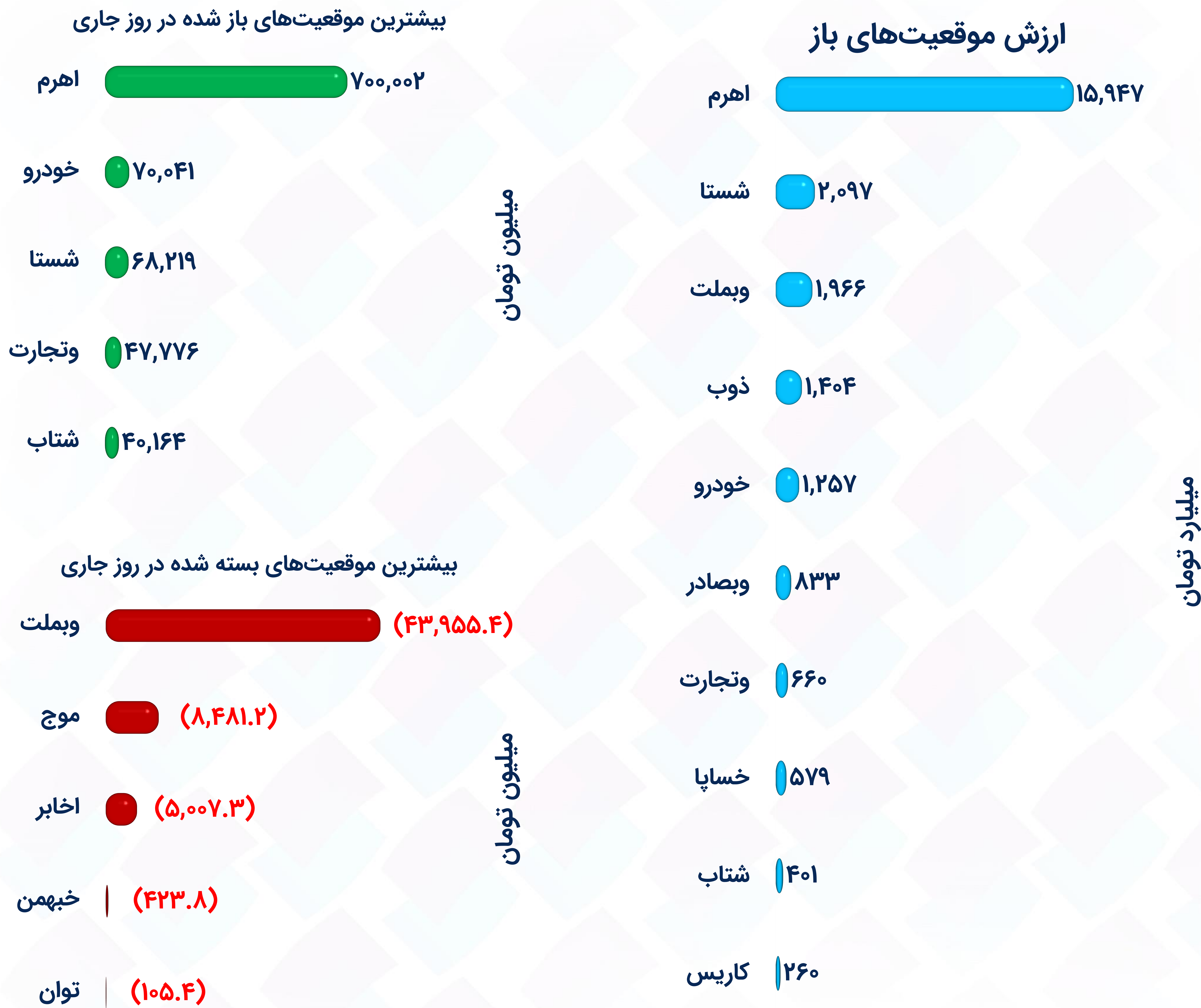
اختیار خرید

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	۴۲	۲۱۳.۵	۷,۵۰۸.۹	۱۳۰.۰	۸۳.۵	(۱۸.۷%)
خودرو	۲۴	۲۲.۱	۳۲۶.۸	۱۴.۲	۷.۹	۱۰.۸%
وبصادر	۱۸	۱۶.۳	۲۲۹.۴	۱۵.۳	۱.۰	۹.۷%
وبملت	۳۰	۱۳.۲	۲۴۳.۶	۱۱.۹	۱.۳	۲۱.۹%
ذوب	۲۷	۱۱.۲	۱۷۶.۹	۸.۸	۲.۴	(۱۱.۶%)
شستا	۳۳	۱۰.۹	۴۲۸.۷	۶.۹	۴.۱	۷.۶%
شتاب	۱۳	۹.۲	۱۱۵.۲	۵.۳	۳.۸	(۱۲.۲%)

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	۲۱	۶۲,۷۵۷.۷	۲,۱۰۵,۶۹۵.۸	۳۹,۶۷۶.۰	۲۳,۰۸۱.۷	(۲۸.۹%)
خودرو	۶	۴,۴۷۸.۱	۱۷۵,۷۲۳.۵	۳,۵۲۸.۸	۹۴۹.۳	(۳۰.۰%)
شستا	۵	۸۷۸.۳	۳۴,۸۴۶.۰	۲۹۳.۵	۵۸۴.۸	(۳۵.۷%)
وبملت	۳	۸۲.۴	۷,۵۷۷.۲	۸۰.۳	۲.۱	(۲۷.۰%)
وبصادر	۳	۷۱.۰	۱,۲۷۸.۴	۶۸.۷	۲.۳	(۲۲.۴%)
توان	۴	۵۷.۲	۱,۳۰۶.۰	۴۵.۲	۱۲.۱	(۱۹.۹%)
ذوب	۳	۳۴.۶	۷,۴۲۱.۷	۱۷.۸	۱۶.۸	(۴۵.۰%)

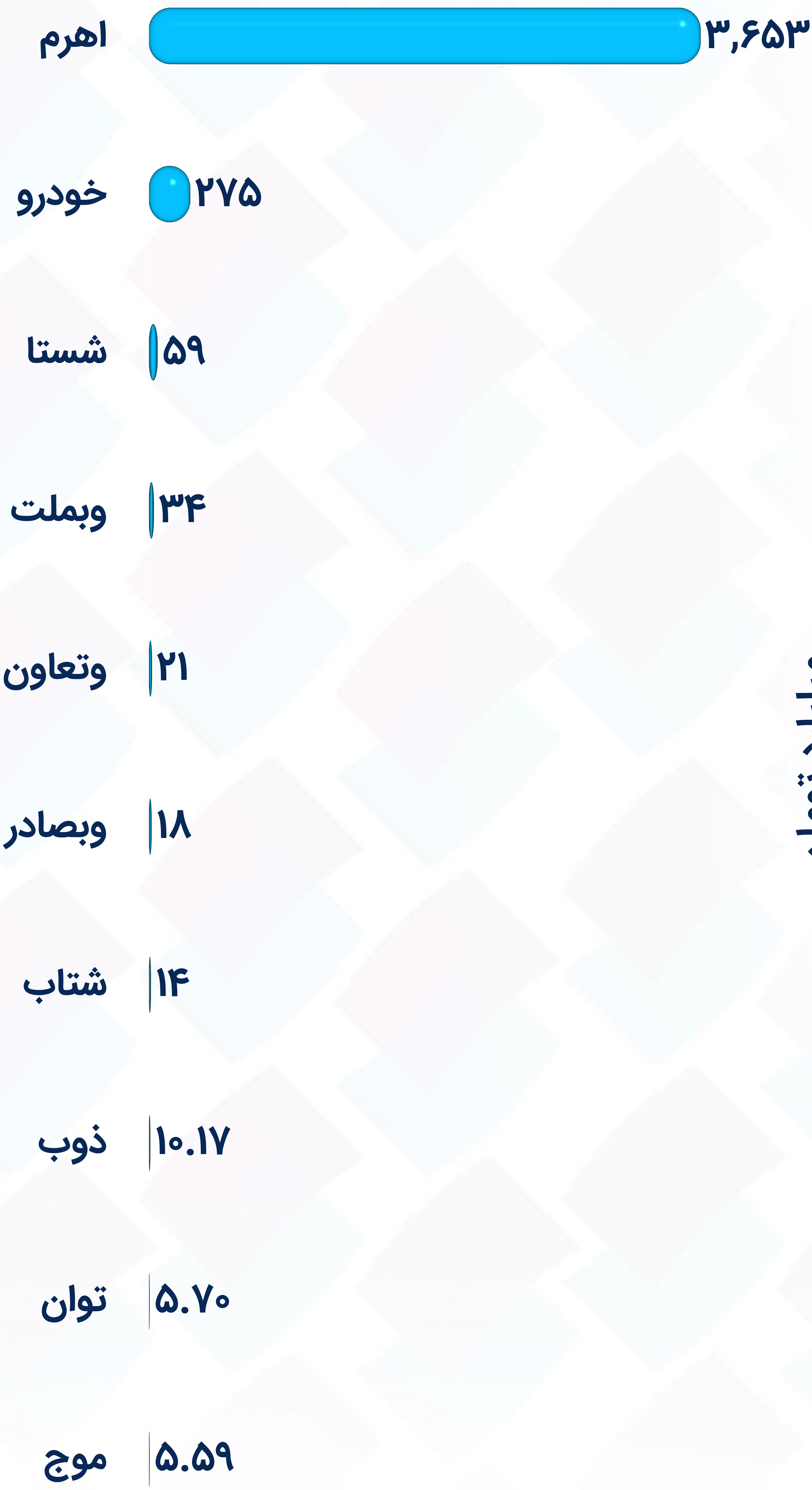
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

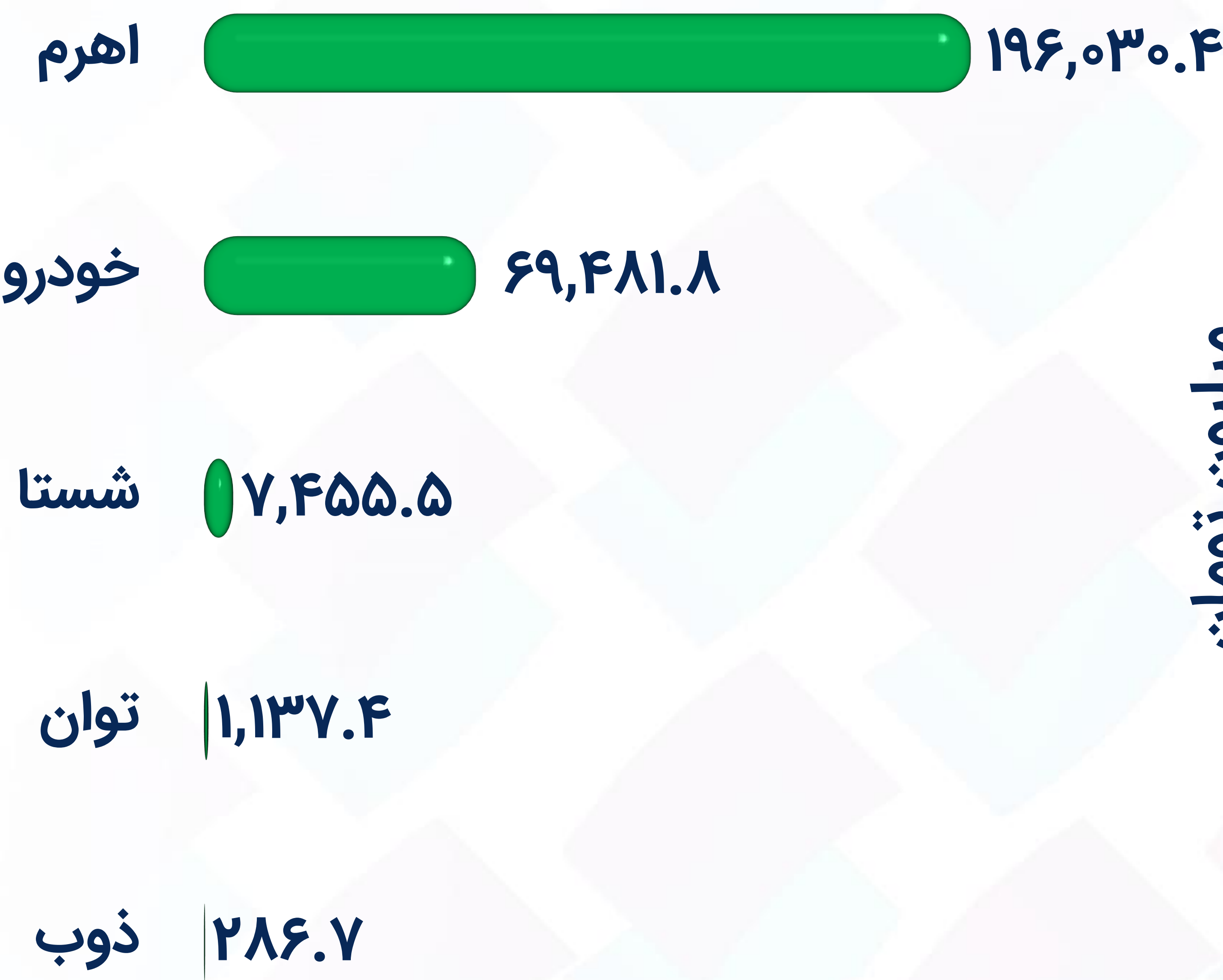
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



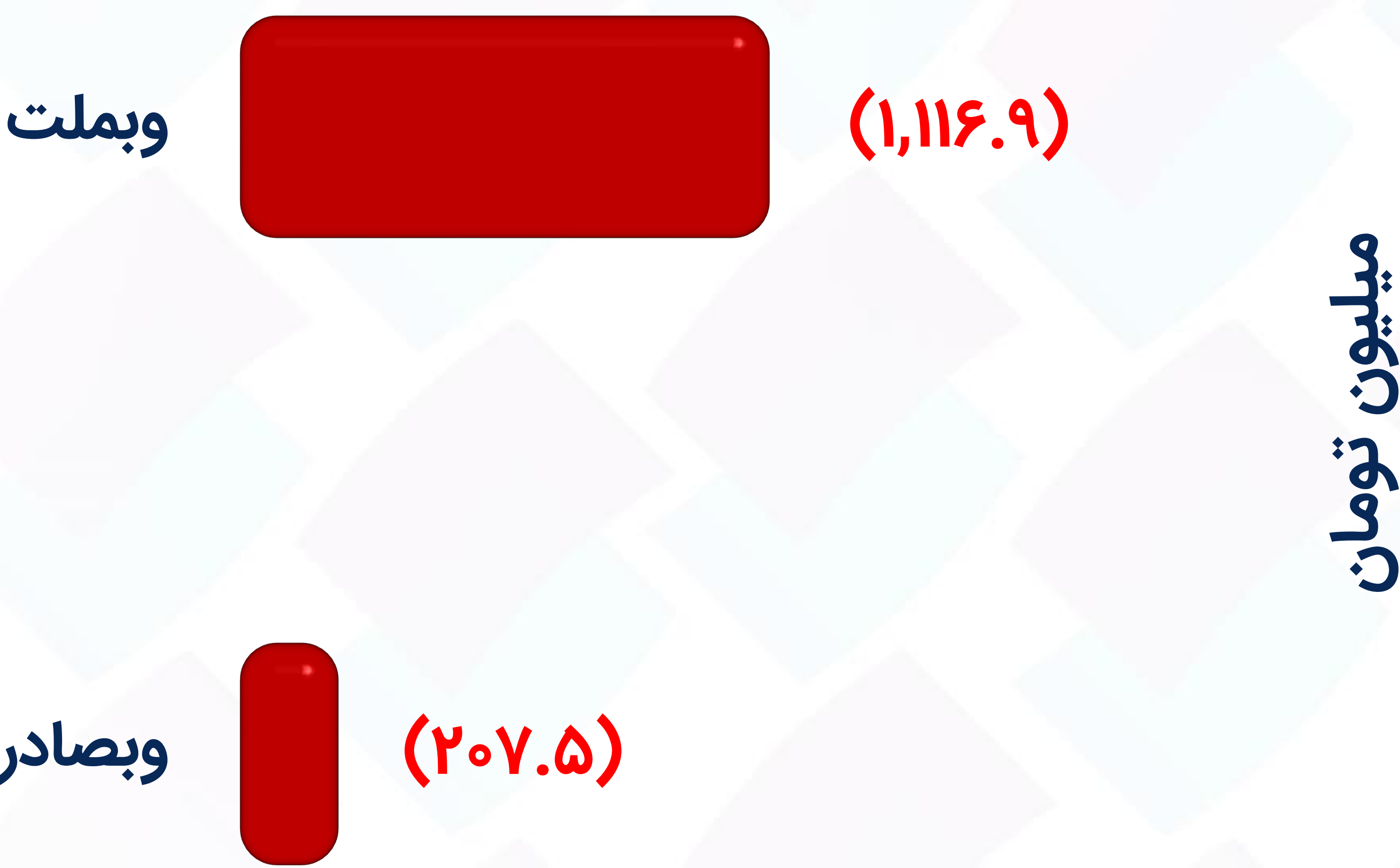
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

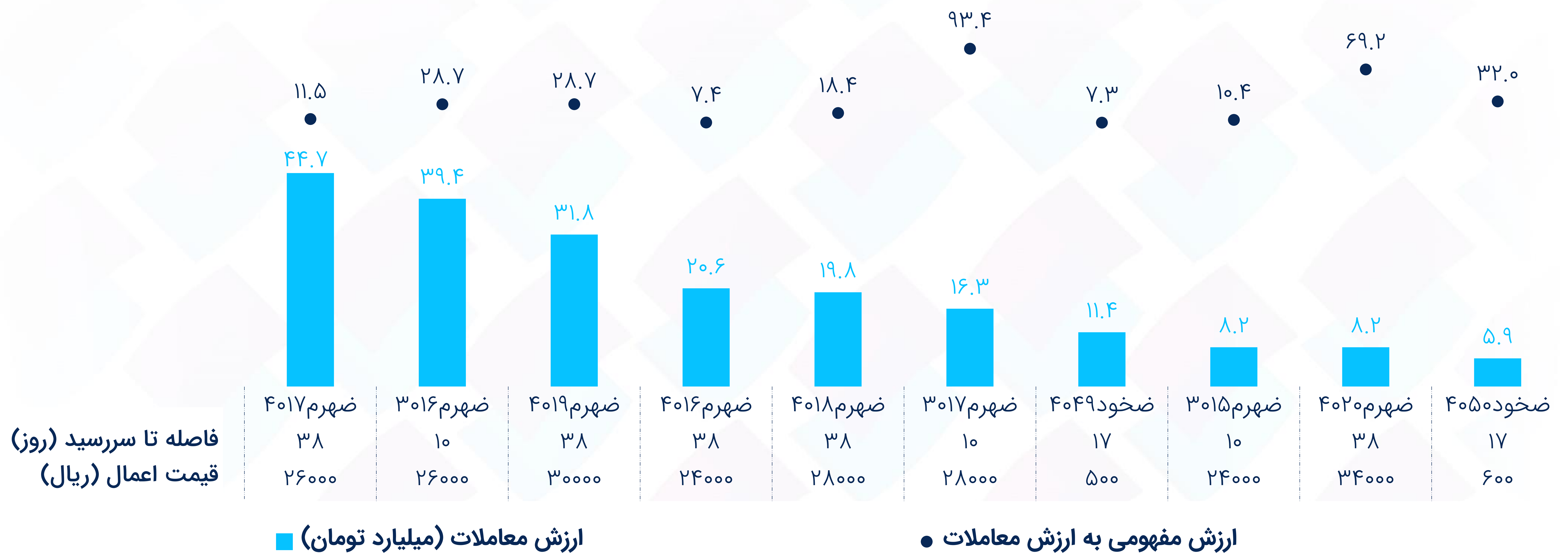
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



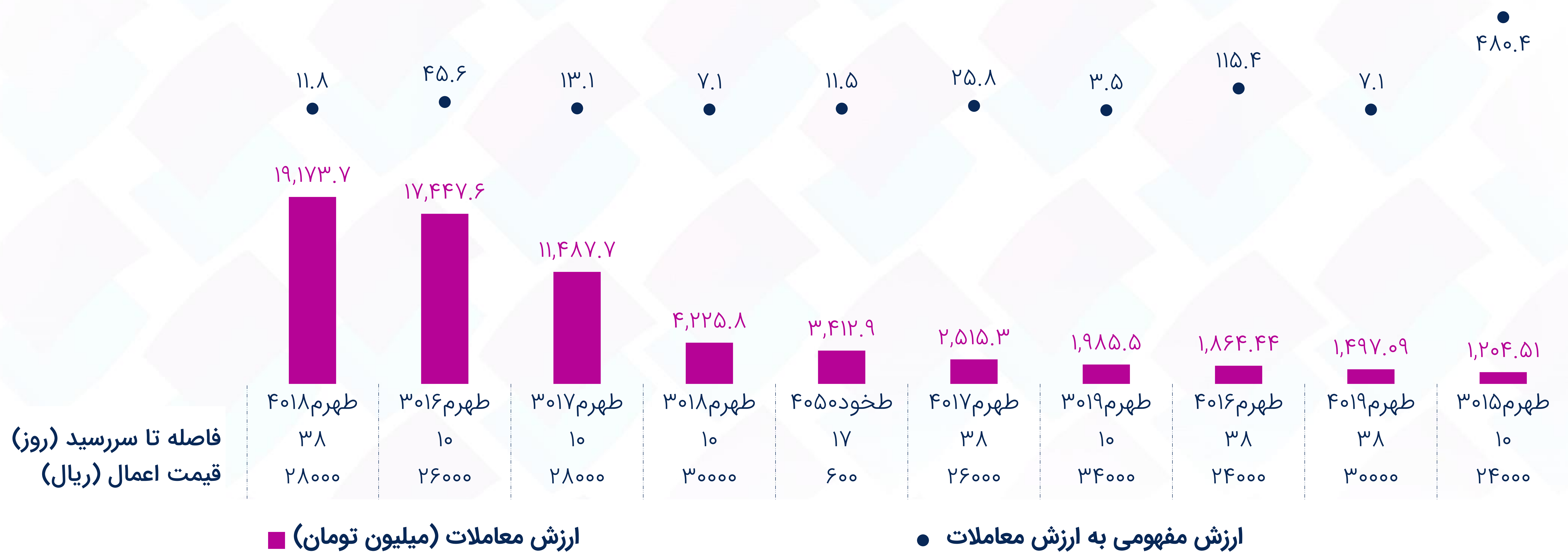
میلیون تومان

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
ضملت ۳۰۵۴	وبملت	۲,۶۴۰	۳	۴۱۵.۲	۱۴	۲,۵۸۵	۲,۶۵۴	۲.۷%	۱۸۹.۶	۰.۳۷	۲۸	۹۸%
ضران ۳۰۰۸	خودران	۱۲,۰۰۰	۱۰	۵۶.۷	۲۸۳	۱۲,۰۹۰	۱۲,۲۸۳	۱.۶%	۴۳.۴	۰.۶۳	۴۲۱	۴۹%
ضنارنج ۵۰۴	نارنج اهرم	۱۴,۰۰۰	۵۶	۱۳.۰	۲,۷۶۸	۱۷,۳۶۳	۱۶,۷۶۸	(۳.۴%)	۶.۱	۰.۹۷	۴,۱۱۸	۴۹%
ضملت ۳۰۵۳	وبملت	۲,۳۴۷	۳	۴,۱۰۶.۴	۱۸۸	۲,۵۸۵	۲,۵۳۵	(۱.۹%)	۱۳.۵	۰.۹۹	۲۵۱	۳۴%
ضصاد ۳۰۵۲	وبصادر	۶۰۰	۳	۳,۹۹۶.۲	۵۰	۶۶۲	۶۵۰	(۱.۸%)	۱۳.۰	۰.۹۹	۶۵	۳۱%

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	۳	۴.۰	۱	۴۳۴	۷۰۱	۶۲%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۰	ذوب	۶۰۰	۳	۱۳.۷	۱	۴۳۴	۶۰۱	۳۸%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۰	۵.۸	۱۰	۲۶,۴۲۰	۴۲,۰۱۰	۵۹%	۴,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۰	۳۹.۴	۱۸	۲۶,۴۲۰	۳۸,۰۱۸	۴۴%	۲,۱۱۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۹	وتجارت	۹۰۰	۳۱	۲۴.۴	۴	۵۴۰	۹۰۴	۶۷%	۲۲۶.۰	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
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۰	۱.۵	۱۵,۰۰۰	۲۶,۴۲۰	۲۷,۰۰۰	۲.۲%	۱.۸	-۱.۰۰	۱۵,۱۱۶	۰.۸%
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۸	۲.۸	۱۴,۰۵۰	۲۶,۴۲۰	۲۷,۹۵۰	۵.۸%	۲.۰	-۱.۰۰	۱۴,۰۹۰	۰.۳%
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۰	۸.۰	۱۱,۴۴۹	۲۶,۴۲۰	۲۶,۵۵۱	۰.۵%	۲.۳	-۱.۰۰	۱۱,۱۶۰	(۲.۵%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۰	۱,۹۸۵.۵	۷,۴۸۱	۲۶,۴۲۰	۲۶,۵۱۹	۰.۴%	۳.۵	-۱.۰۰	۷,۲۰۴	(۳.۷%)
طذوب ۳۰۳۹	ذوب	۵۰۰	۳	۱۷.۸	۶۸	۴۳۴	۴۳۲	(۰.۵%)	۶.۴	-۱.۰۰	۶۳	(۷.۰%)

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
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۳۸	۰.۰	۳۵	۲۶,۴۲۰	۱۵,۹۶۵	(۳۹.۶%)	۴۵۶.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۲	وبملت	۲,۲۰۰	۳	۰.۰	۲	۲,۵۸۵	۲,۱۹۸	(۱۵.۰%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۳۸	۰.۳	۲۲	۲۶,۴۲۰	۱۷,۹۷۸	(۳۲.۰%)	۸۱۷.۲	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طخود ۴۰۴۸	خودرو	۴۰۰	۱۷	۰.۲	۱	۵۷۶	۳۹۹	(۳۰.۷%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۹%)
طهرم ۳۰۱۴	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۰	۰.۴	۱۲	۲۶,۴۲۰	۲۱,۹۸۸	(۱۶.۸%)	۱,۸۳۲.۳	۰.۰۰	۱	(۹۵.۴%)

(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

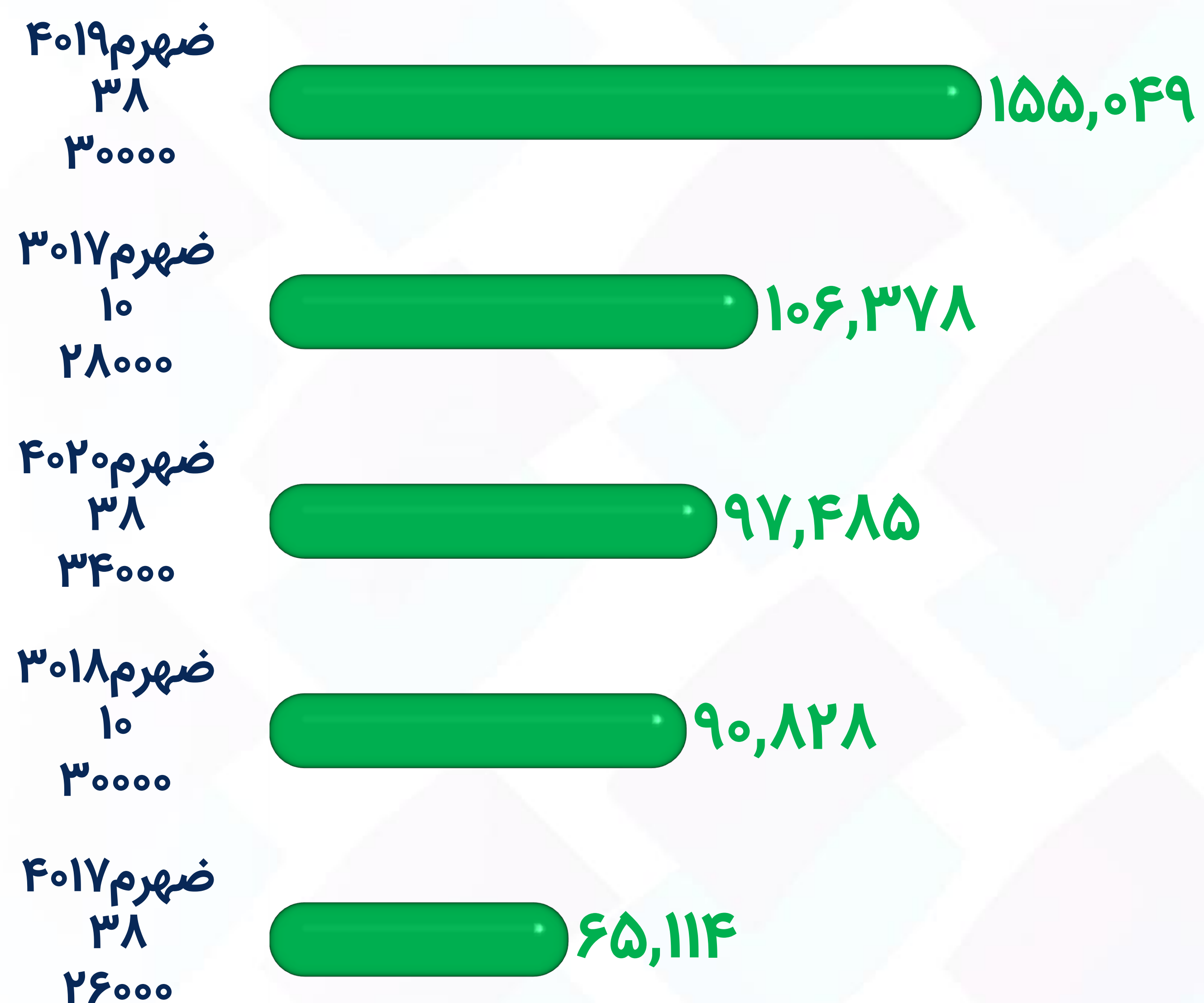
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

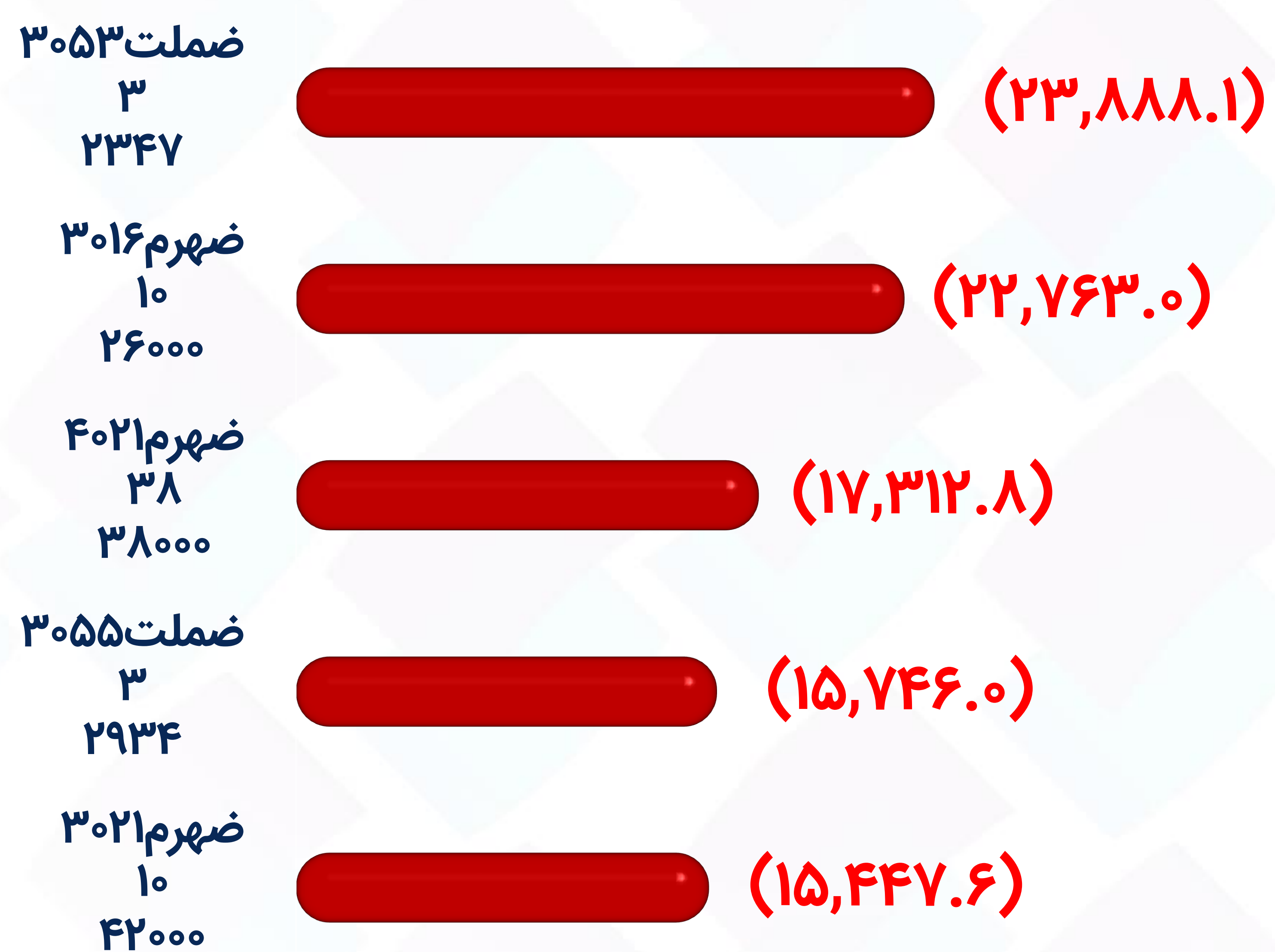
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

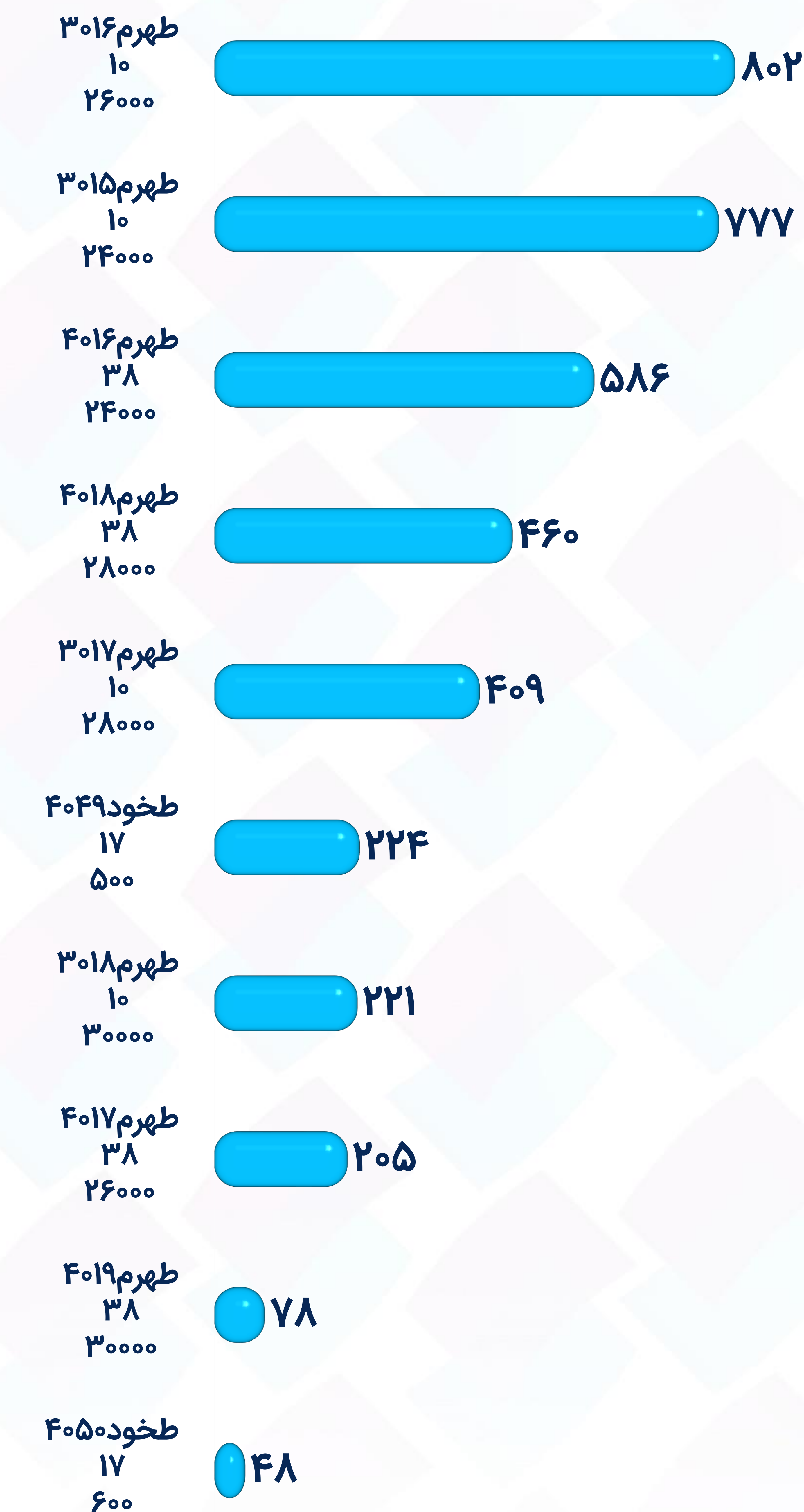


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

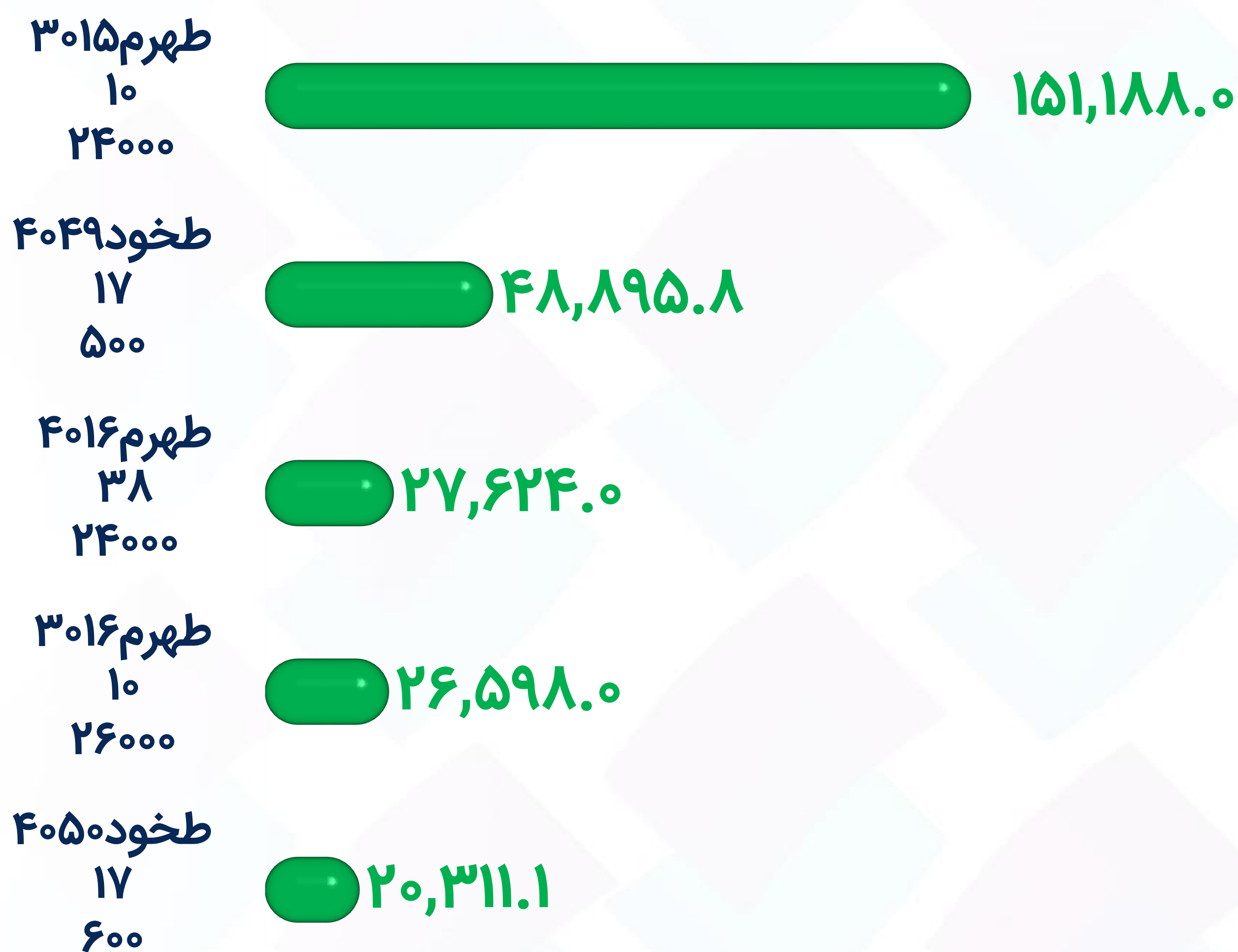
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

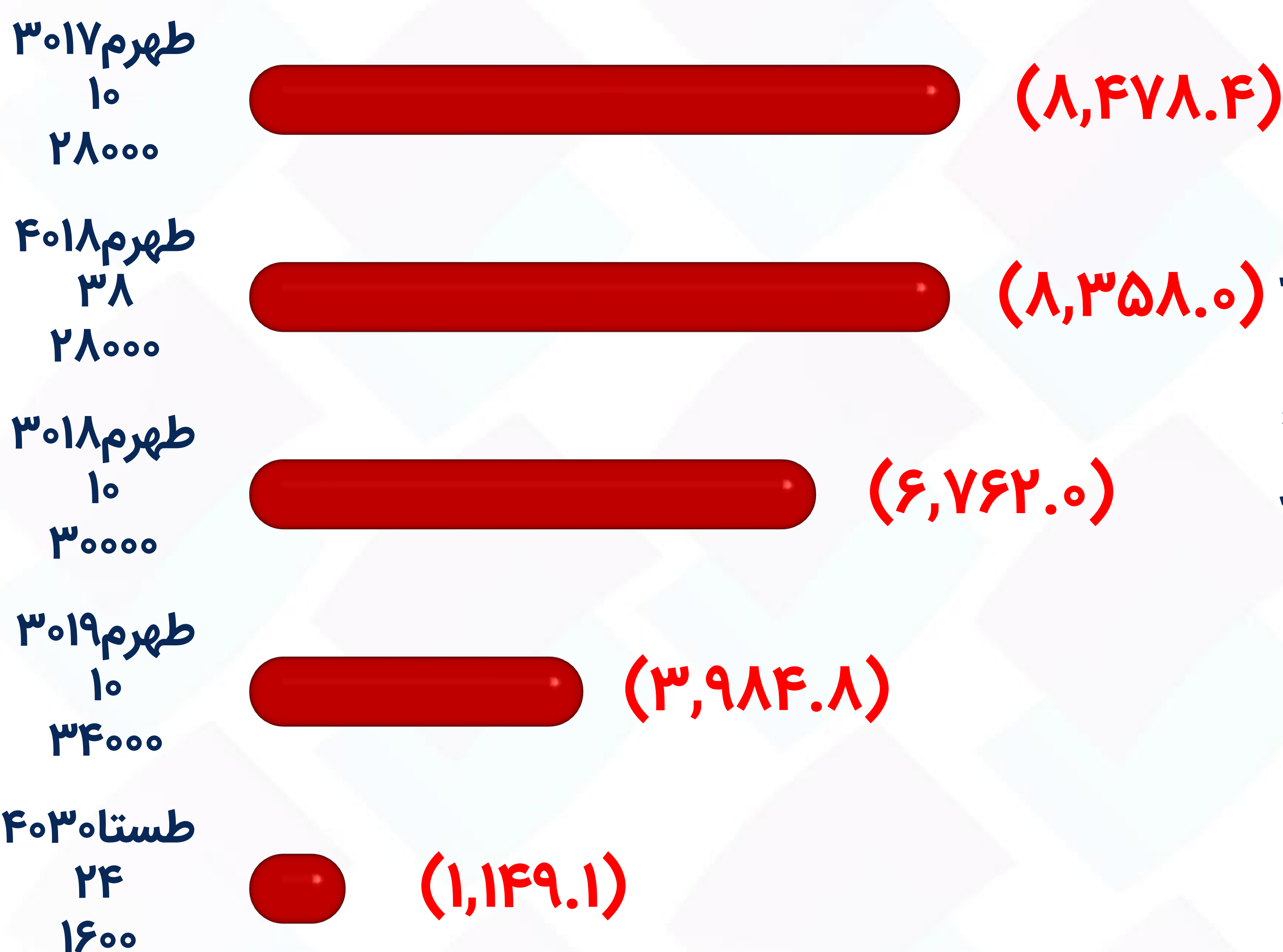
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

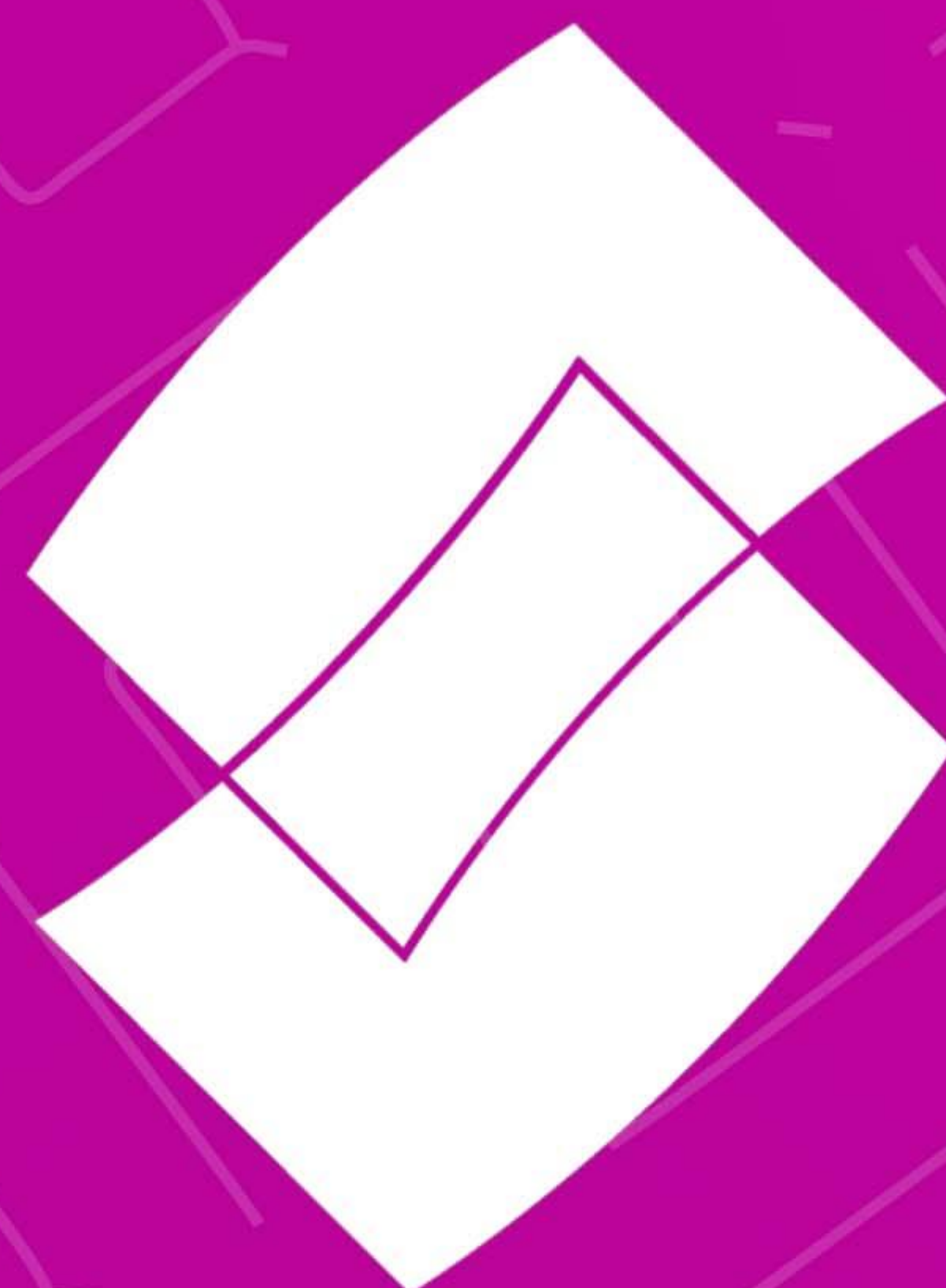
اختیار خرید



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

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.