

شماره
۴۹۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۹ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





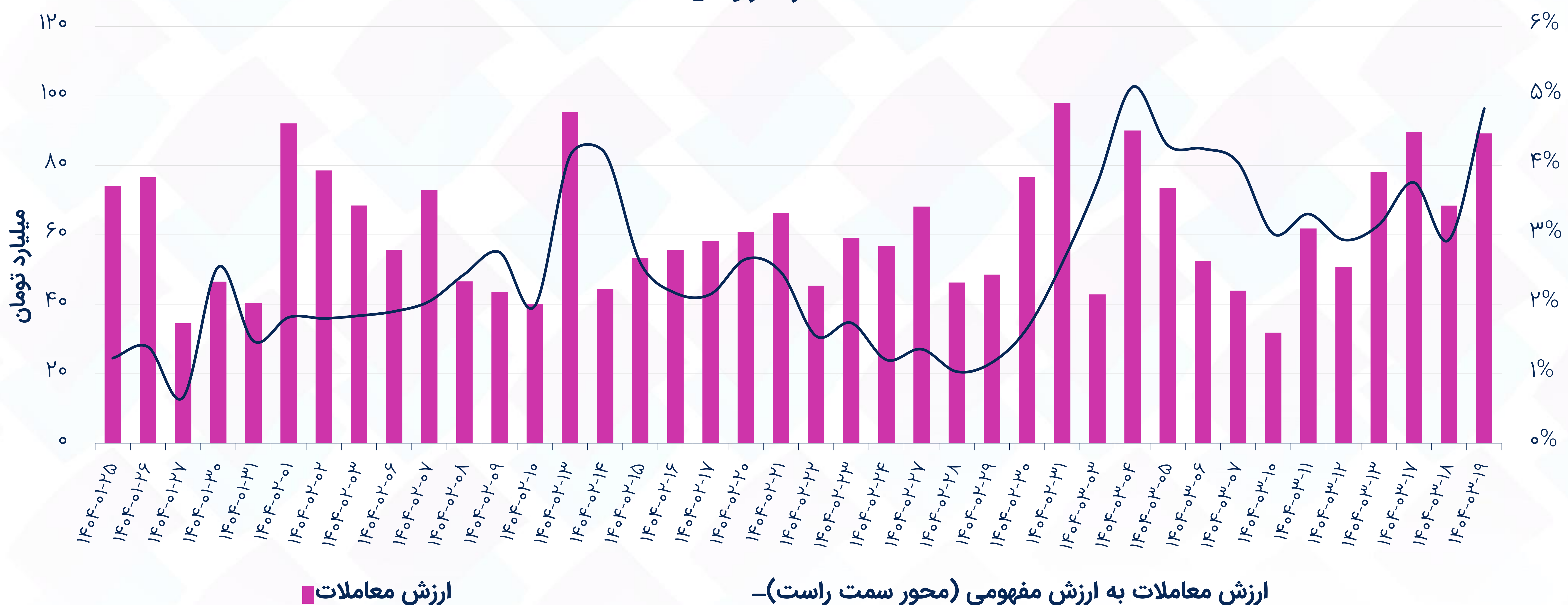
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



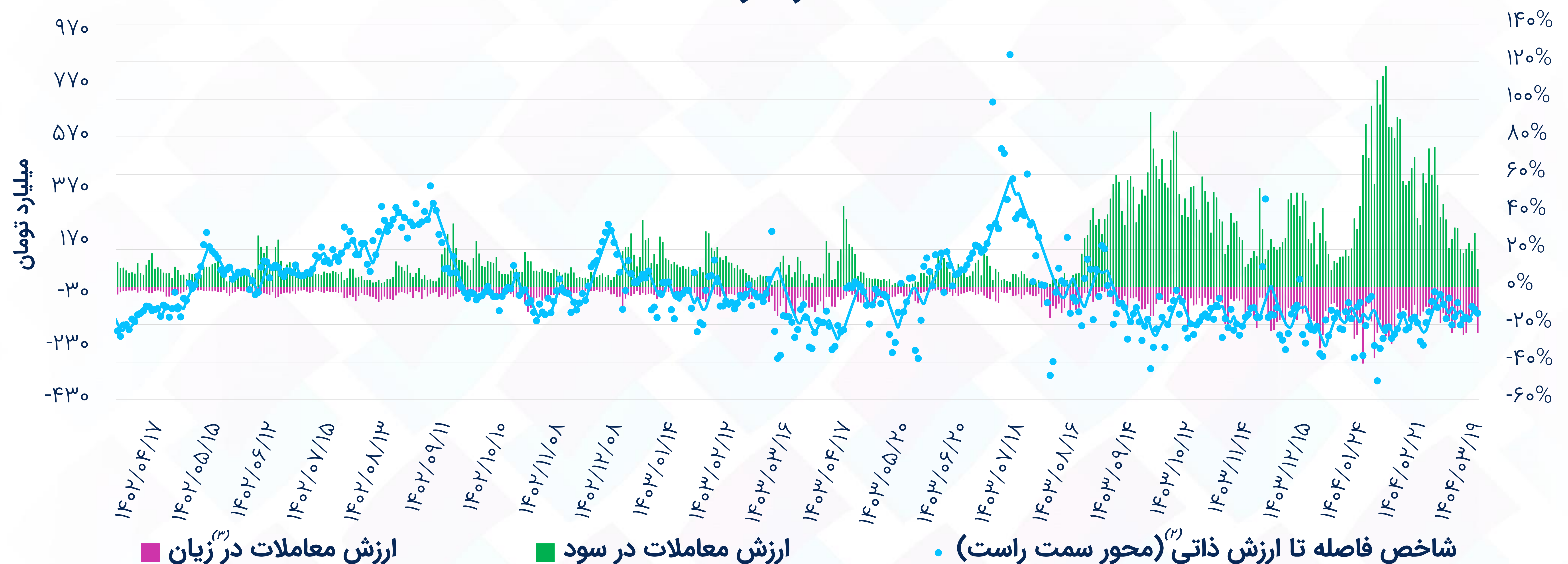
اختیار فروش



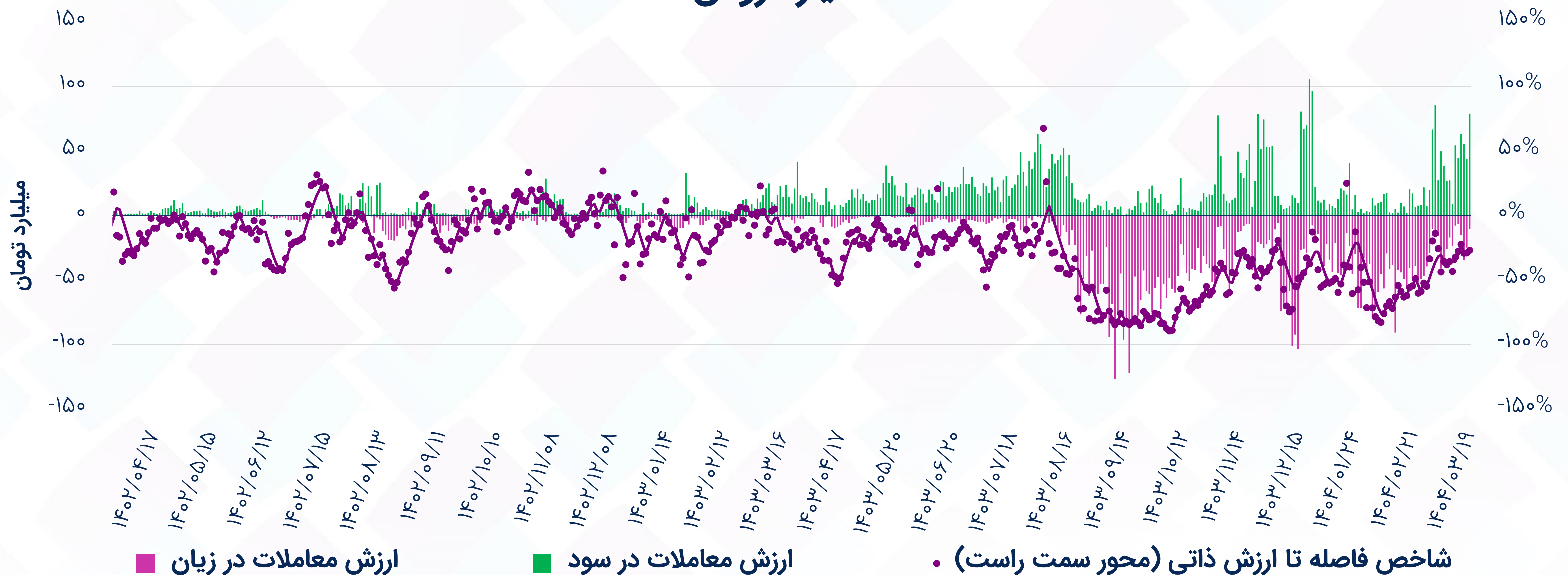
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۷۴.۷	۵,۱۷۶.۲	۲۱.۶	۱۵۳.۰	(۲۱.۸%)
خودرو	۲۶	۲۳.۸	۴۴۵.۸	۱۵.۹	۷.۹	۱۱.۸%
وبصادر	۱۶	۱۲.۱	۱۱۱.۰	۱۱.۶	۰.۵	۱۵.۹%
شستا	۳۲	۹.۹	۴۸۷.۷	۲.۳	۷.۶	(۵.۹%)
ذوب	۲۴	۸.۱	۱۳۴.۸	۶.۱	۲.۰	(۱۲.۰%)
وبملت	۲۷	۶.۳	۳۳۸.۷	۵.۴	۰.۹	۲۶.۵%
توان	۲۰	۱.۵	۸۹.۳	۰.۸	۰.۶	(۲۵.۳%)

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	۲۰	۷۶,۵۷۵.۳	۱,۵۴۱,۴۹۱.۳	۶۷,۹۰۱.۴	۸,۶۷۳.۹	(۲۶.۹%)
خودرو	۸	۹,۲۰۹.۳	۱۹۹,۵۸۰.۵	۸,۳۳۸.۱	۸۷۱.۲	(۲۴.۸%)
شستا	۸	۳,۱۵۲.۶	۱۰۱,۶۴۲.۳	۲,۲۹۴.۲	۸۵۸.۴	(۳۶.۳%)
توان	۴	۱۰۳.۱	۱,۹۴۰.۸	۷۶.۴	۲۶.۸	(۱۴.۲%)
وبملت	۴	۵۷.۳	۶,۰۵۱.۵	۵۵.۳	۲.۰	(۲۳.۰%)
ذوب	۳	۵۰.۶	۱,۰۹۴.۸	۴۸.۶	۲.۰	(۱۱.۱%)
وبصادر	۳	۵۰.۳	۴۹۸.۸	۵۰.۲	۰.۱	(۲۴.۰%)

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

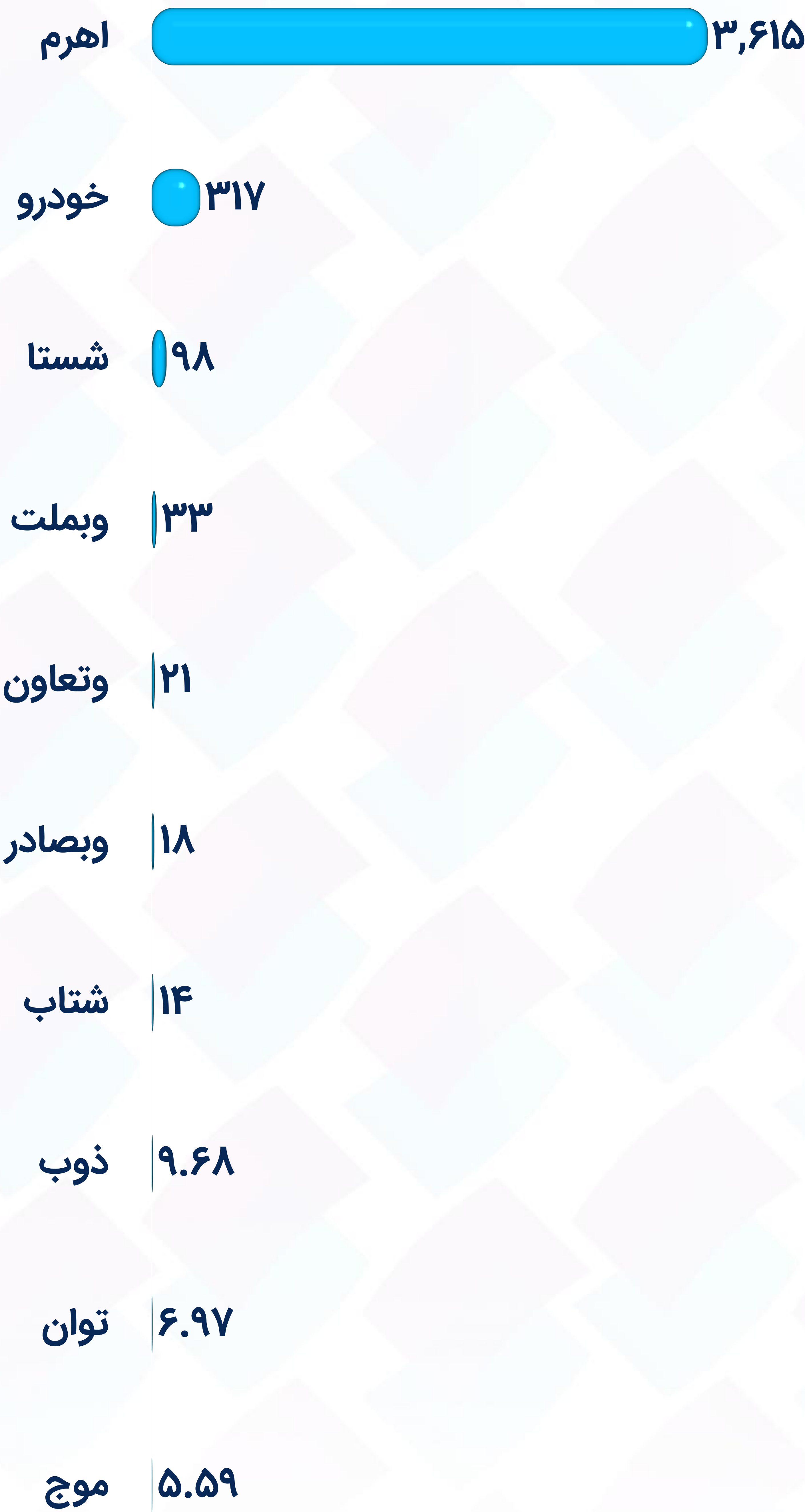


میلیون تومان

(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
ضسپا۳۰۴۷	خسپا	۵۴۳	۹	۱۰۹.۷	۲	۴۸۸	۵۴۵	۱۱.۷%	۲۷۲.۵	۰.۲۳	۸	۲۸۴%
ضمخا۳۰۵۵	اخابر	۷۰۰	۲	۱۹.۱	۱	۶۷۱	۷۰۱	۴.۵%	۷۰۱.۰	۰.۲۱	۴	۲۶۵%
ضسپا۳۰۴۶	خسپا	۴۸۲	۹	۳۲.۸	۱۴	۴۸۸	۴۹۶	۱.۶%	۳۵.۴	۰.۶۰	۲۹	۱۱۰%
ضسپا۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۳۰	۹.۶	۲۱	۴۸۸	۵۲۱	۶.۸%	۲۴.۸	۰.۵۵	۴۱	۹۶%
ضملت۳۰۵۴	وبملت	۲,۶۴۰	۲	۳۸۱.۹	۴	۲,۵۲۹	۲,۶۴۴	۴.۵%	۶۶۱.۰	۰.۱۶	۸	۹۰%

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
ضملت۳۰۵۶	وبملت	۳,۲۵۰	۲	۱.۴	۱	۲,۵۲۹	۳,۲۵۱	۲۹%	۳,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۹	۶.۱	۱۰	۲۵,۸۰۰	۳۸,۰۱۰	۴۷%	۳,۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد۳۰۵۴	وبصادر	۸۰۰	۲	۲.۱	۱	۶۴۷	۸۰۱	۲۴%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار۴۰۱۹	وتجارت	۹۰۰	۳۰	۲.۴	۳	۵۲۷	۹۰۳	۷۱%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب۵۰۱۷	ذوب	۹۰۰	۶۵	۵.۴	۷	۴۲۳	۹۰۷	۱۱۴%	۱۲۹.۶	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

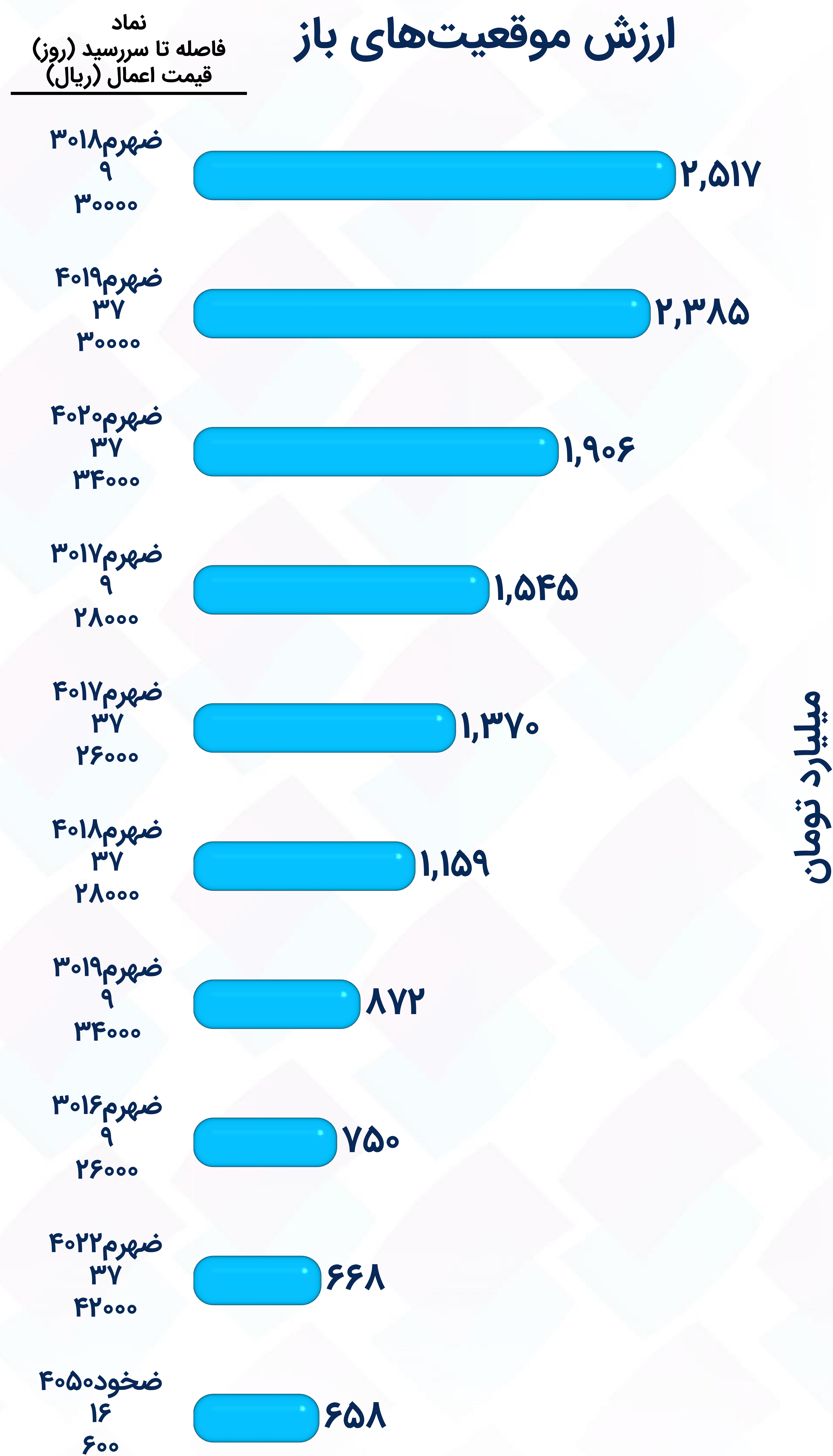
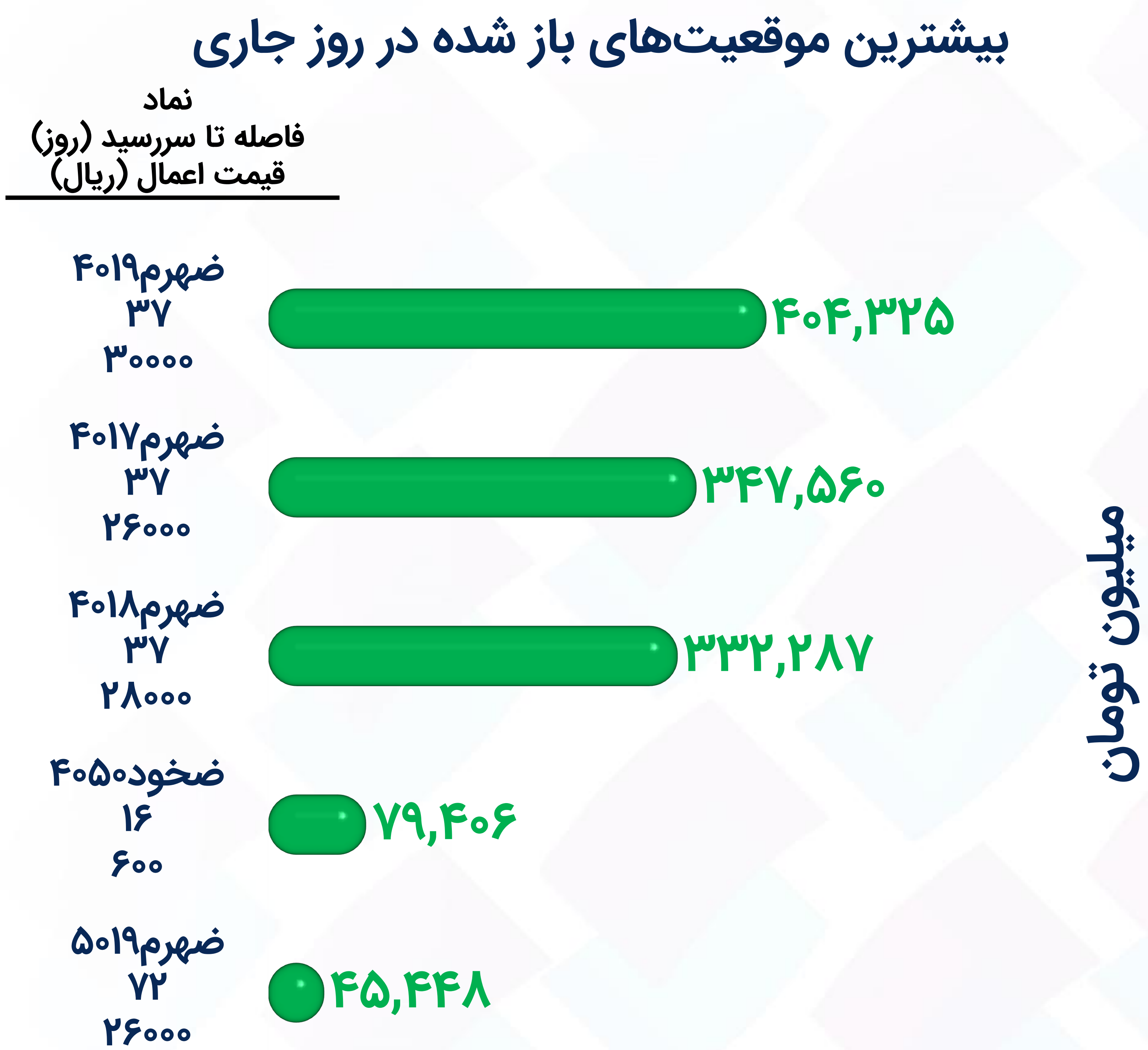
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۳۰۱۵	اهرم	۲۴,۰۰۰	۹	۱۳۸.۶	۵۷	۲۵,۸۰۰	۲۳,۹۴۳	(۷.۲%)	۴۲۰.۱	-۰.۰۸	۵۹	۲.۹%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۹	۳.۲	۱۶,۰۰۰	۲۵,۸۰۰	۲۶,۰۰۰	۰.۸%	۱.۶	-۱.۰۰	۱۵,۷۹۱	(۱.۳%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۹	۵۹.۶	۸,۲۷۸	۲۵,۸۰۰	۲۵,۷۲۲	(۰.۳%)	۳.۱	-۱.۰۰	۷,۸۶۹	(۴.۹%)
طذوب ۳۰۳۹	ذوب	۵۰۰	۲	۴۰.۶	۸۰	۴۲۳	۴۲۰	(۰.۷%)	۵.۳	-۱.۰۰	۷۵	(۶.۴%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۷	۵۸.۶	۱۵,۸۳۸	۲۵,۸۰۰	۲۶,۱۶۲	۱.۴%	۱.۷	-۱.۰۰	۱۴,۷۵۹	(۶.۸%)

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	۲	۰.۰	۱	۲,۵۲۹	۱,۹۰۶	(۲۴.۶%)	۱,۹۰۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۴۰۴۷	خودرو	۳۰۰	۱۶	۰.۱	۱	۵۶۵	۲۹۹	(۴۷.۱%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۷	۰.۰	۱	۲۵,۸۰۰	۱۴,۹۹۹	(۴۱.۹%)	۱۴,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۳۷	۰.۵	۷۵	۲۵,۸۰۰	۱۷,۹۲۵	(۳۰.۵%)	۲۳۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طخود ۴۰۴۸	خودرو	۴۰۰	۱۶	۰.۴	۱	۵۶۵	۳۹۹	(۲۹.۴%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۷%)

(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

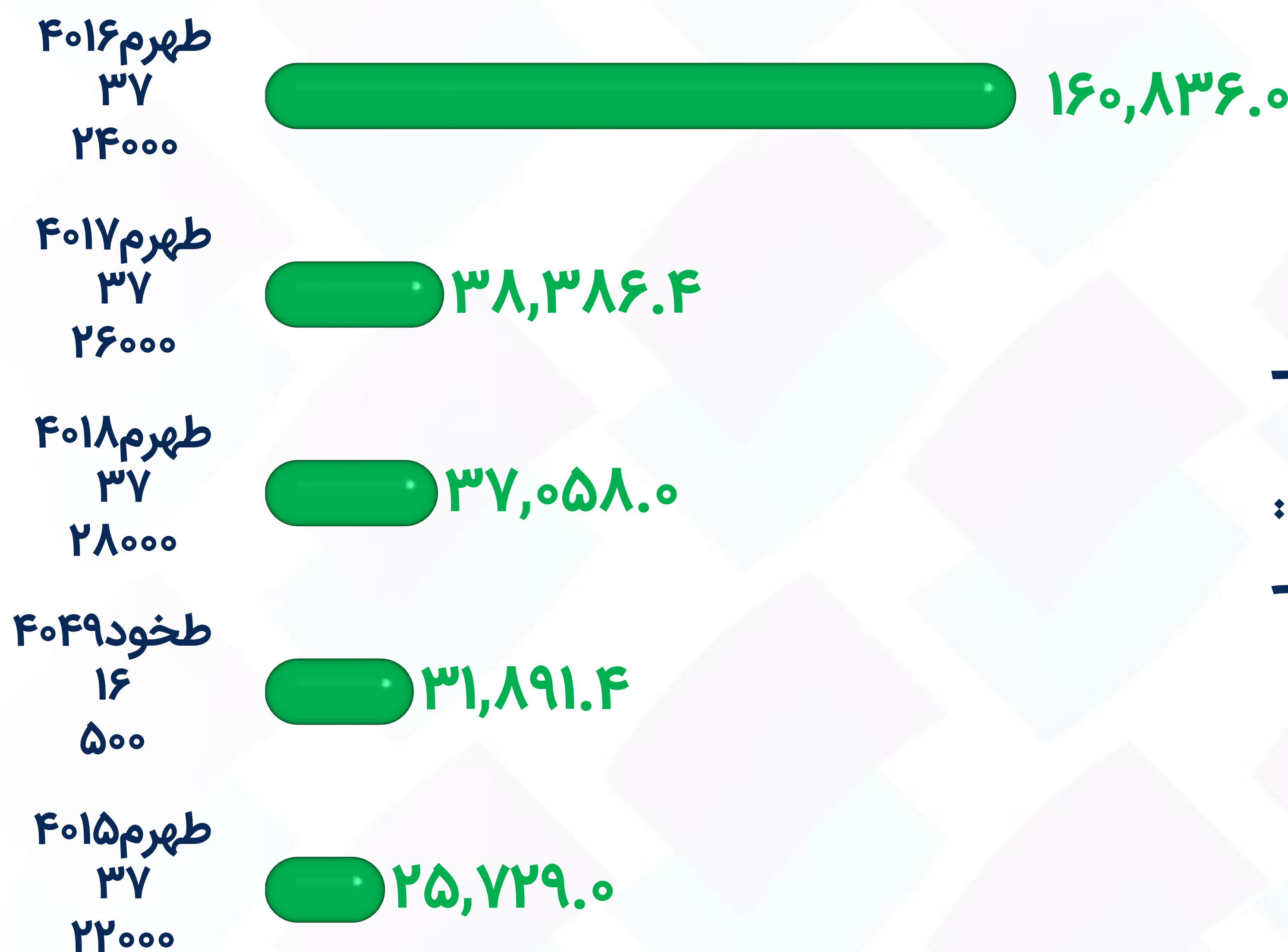
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

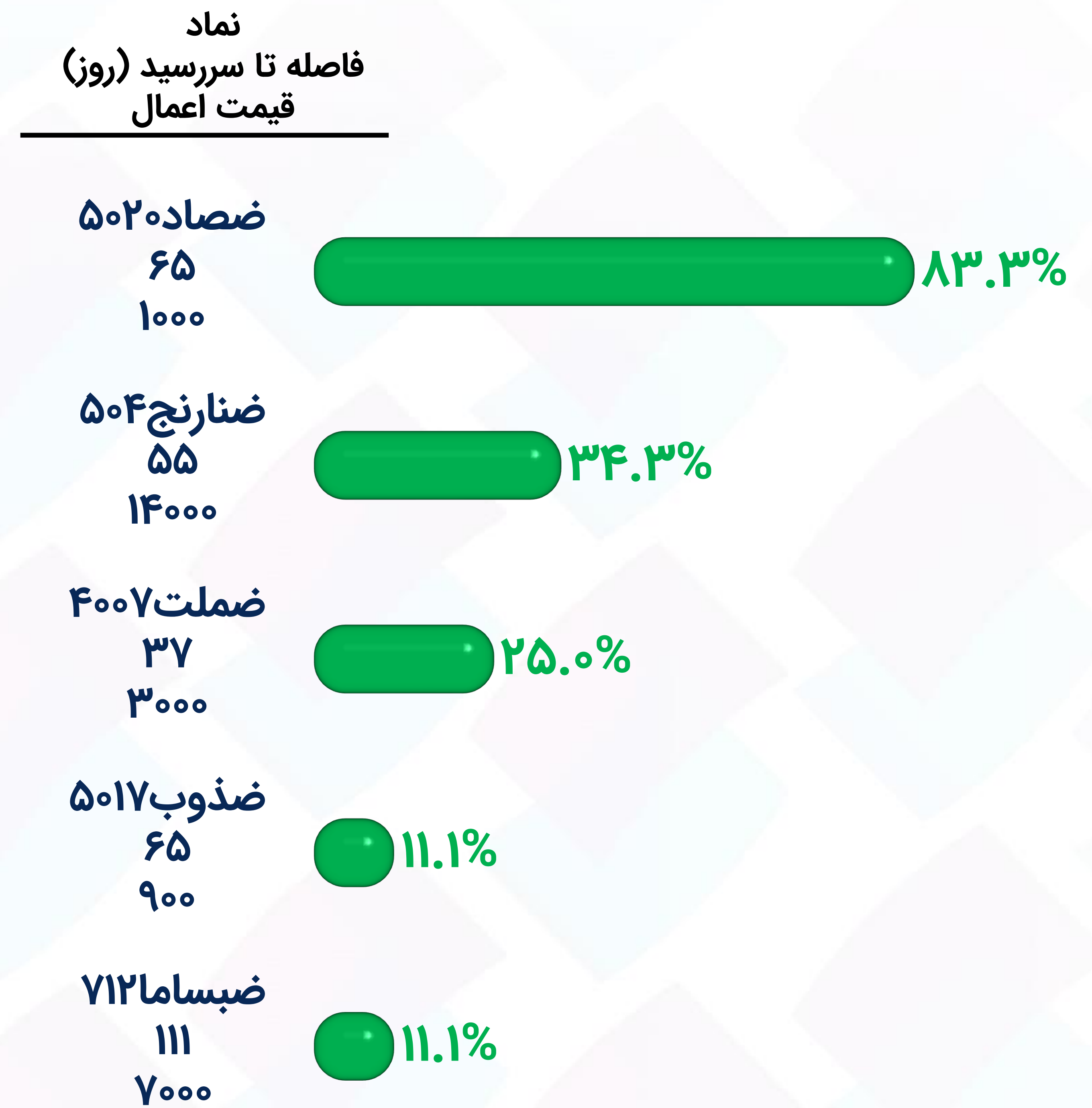
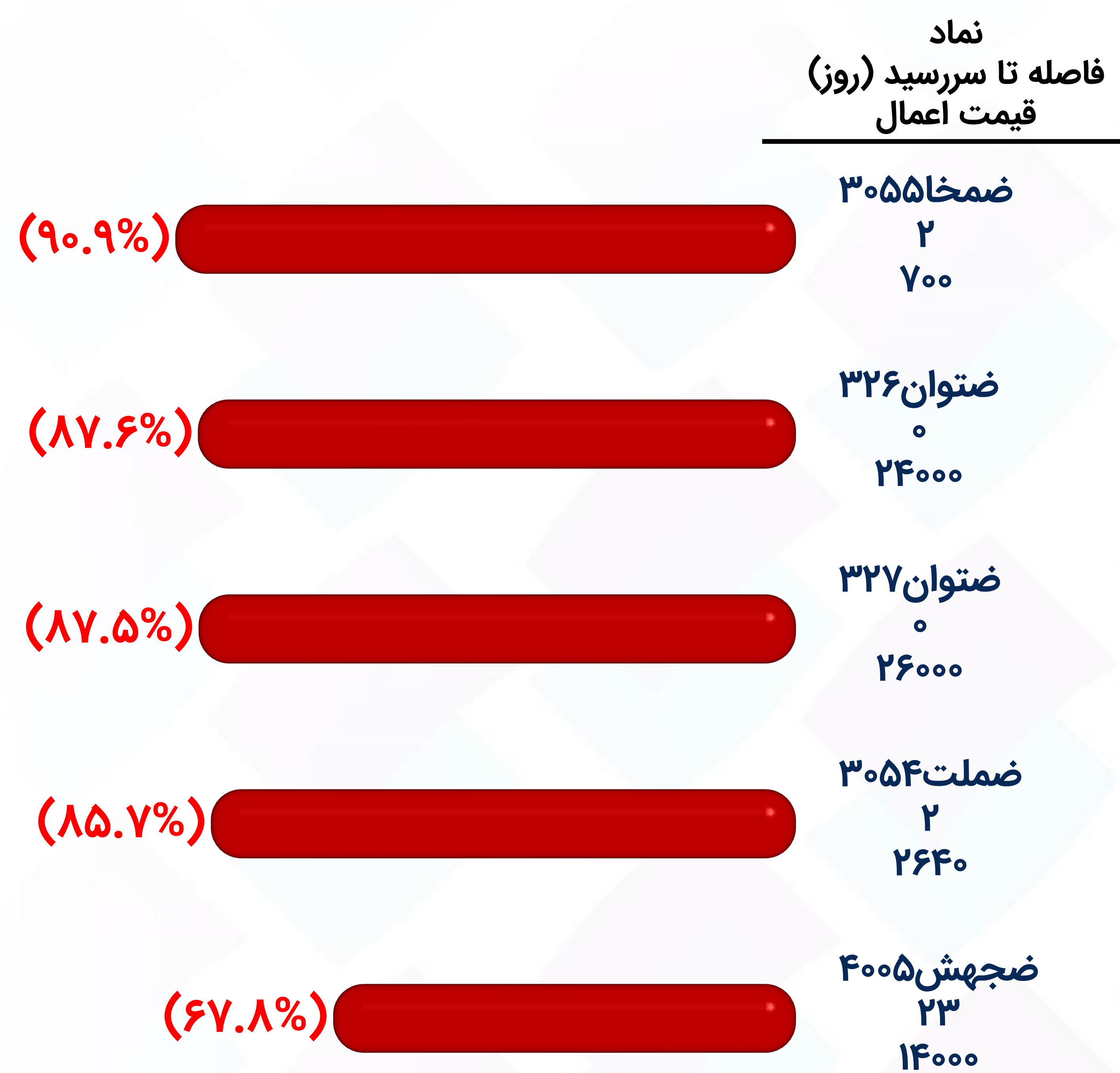
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



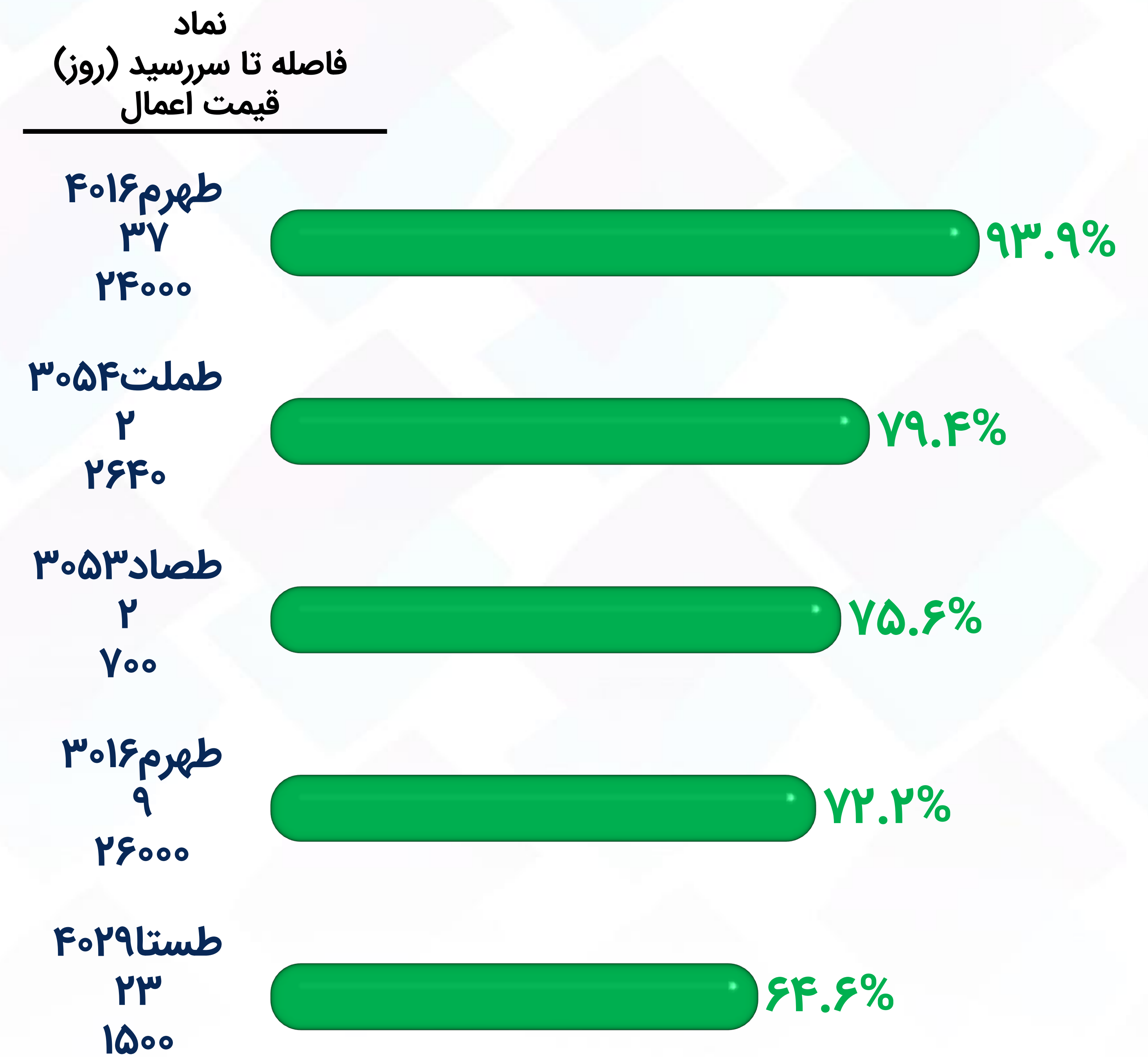
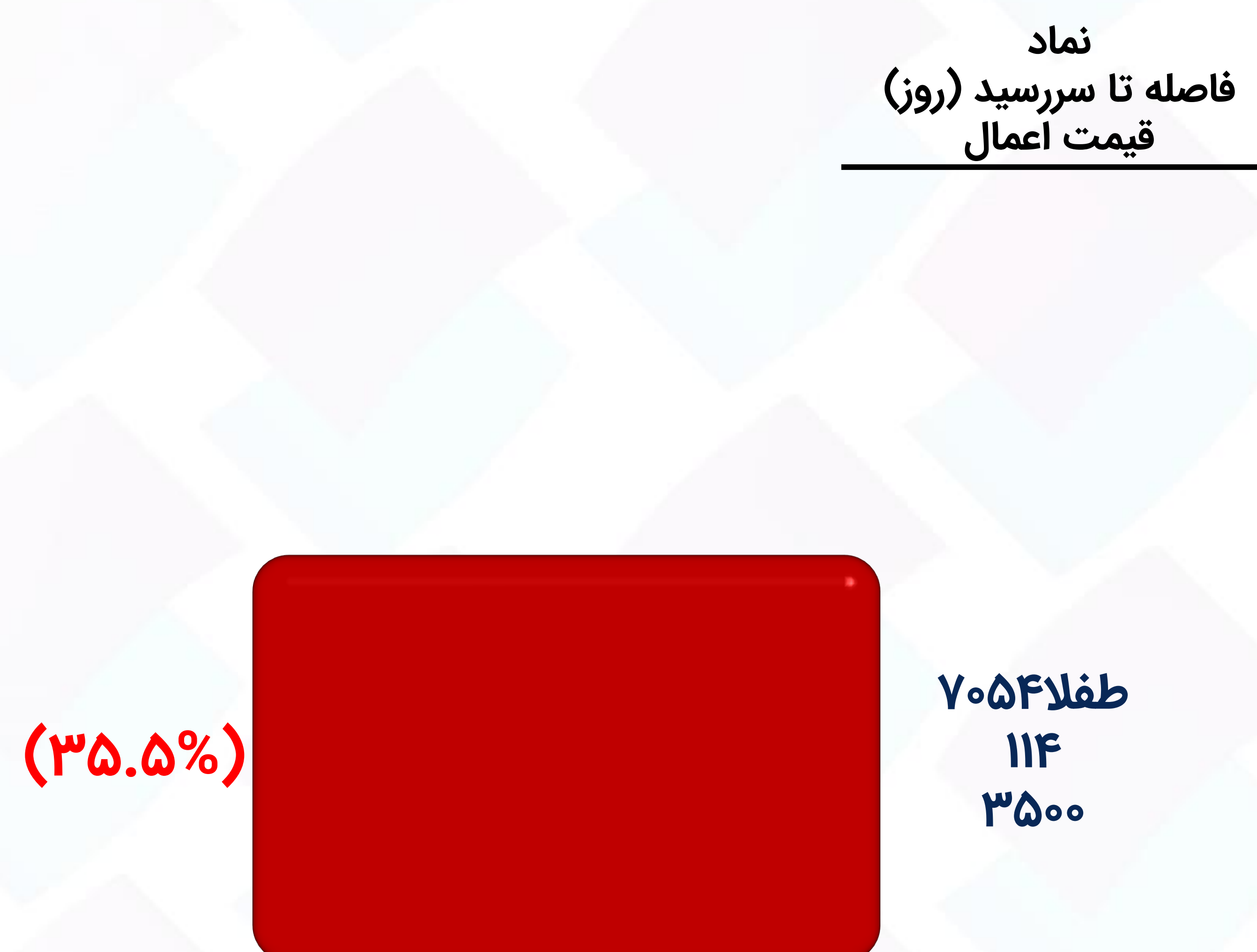
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

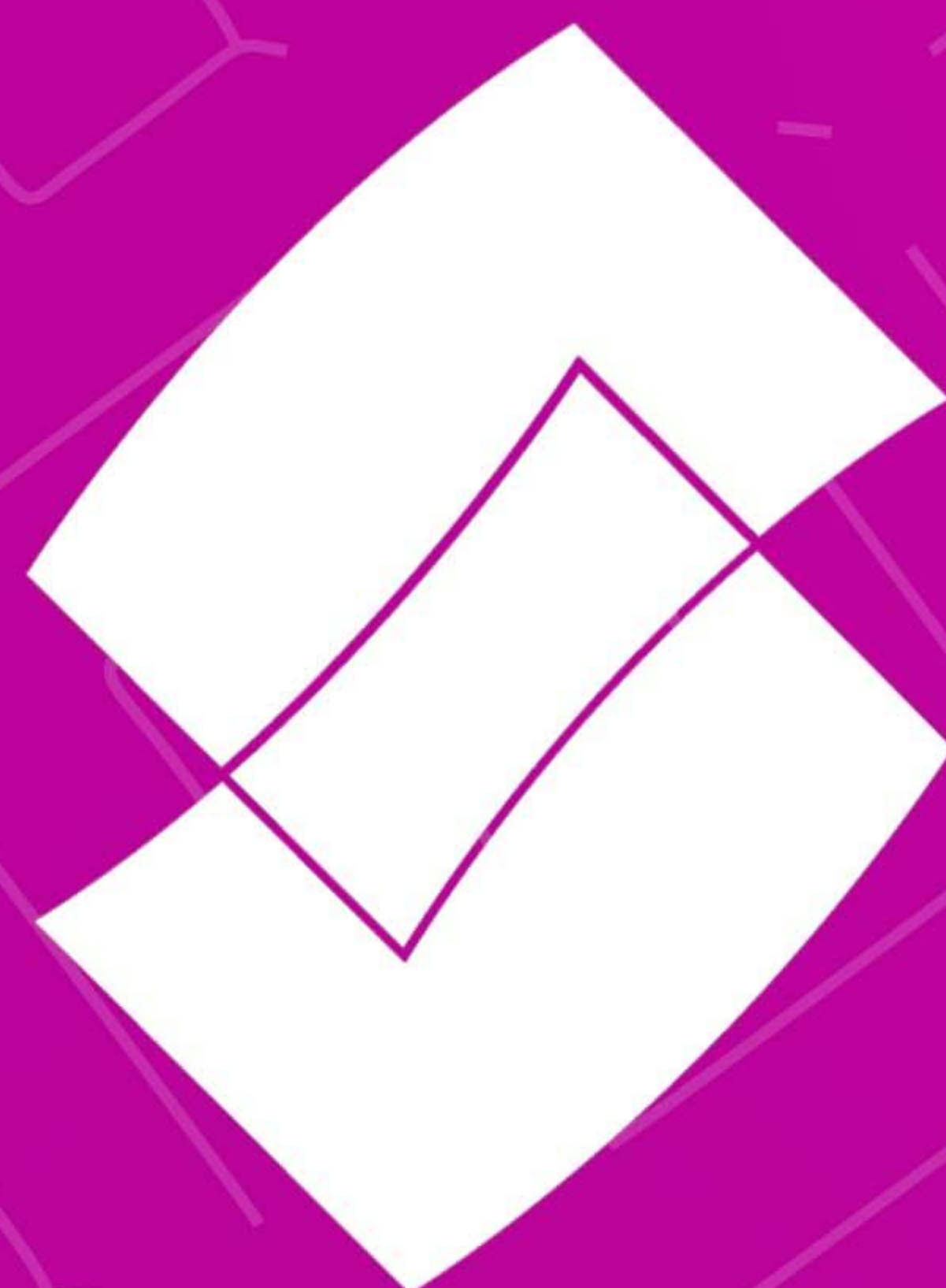
اختیار خرید



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

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.