

شماره
۴۹۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ خرداد ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





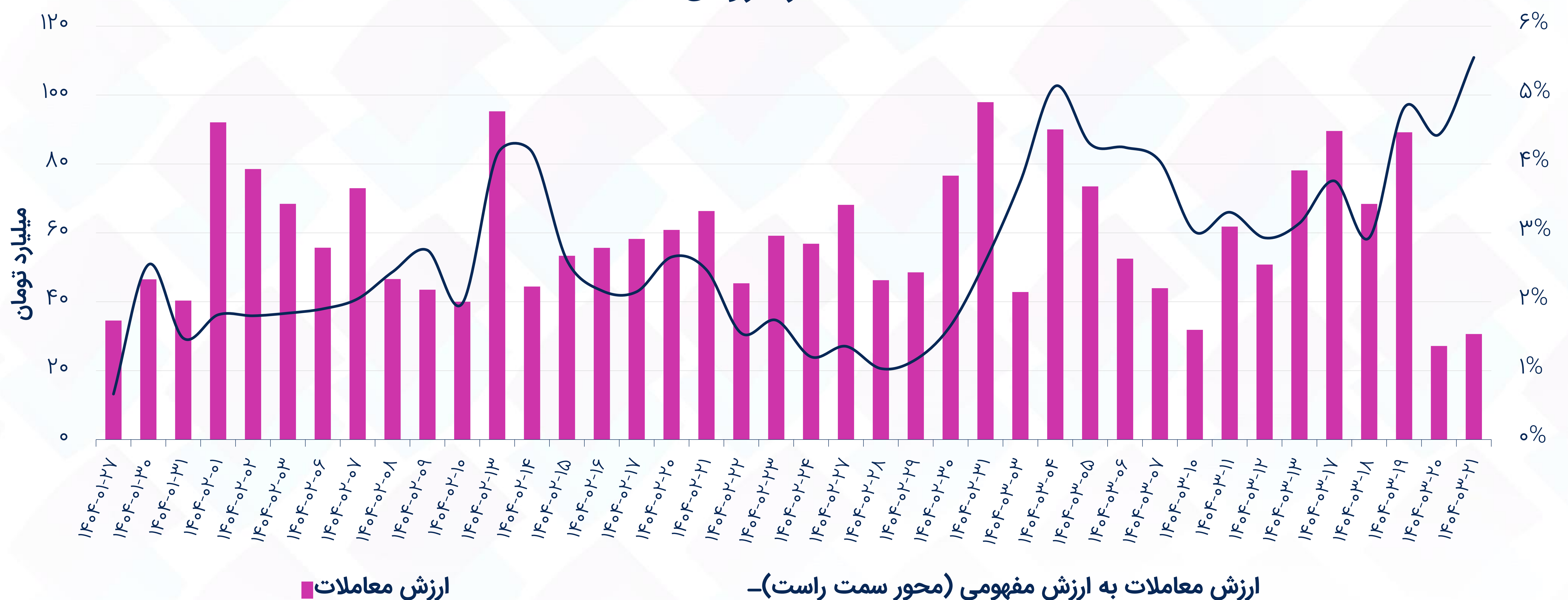
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



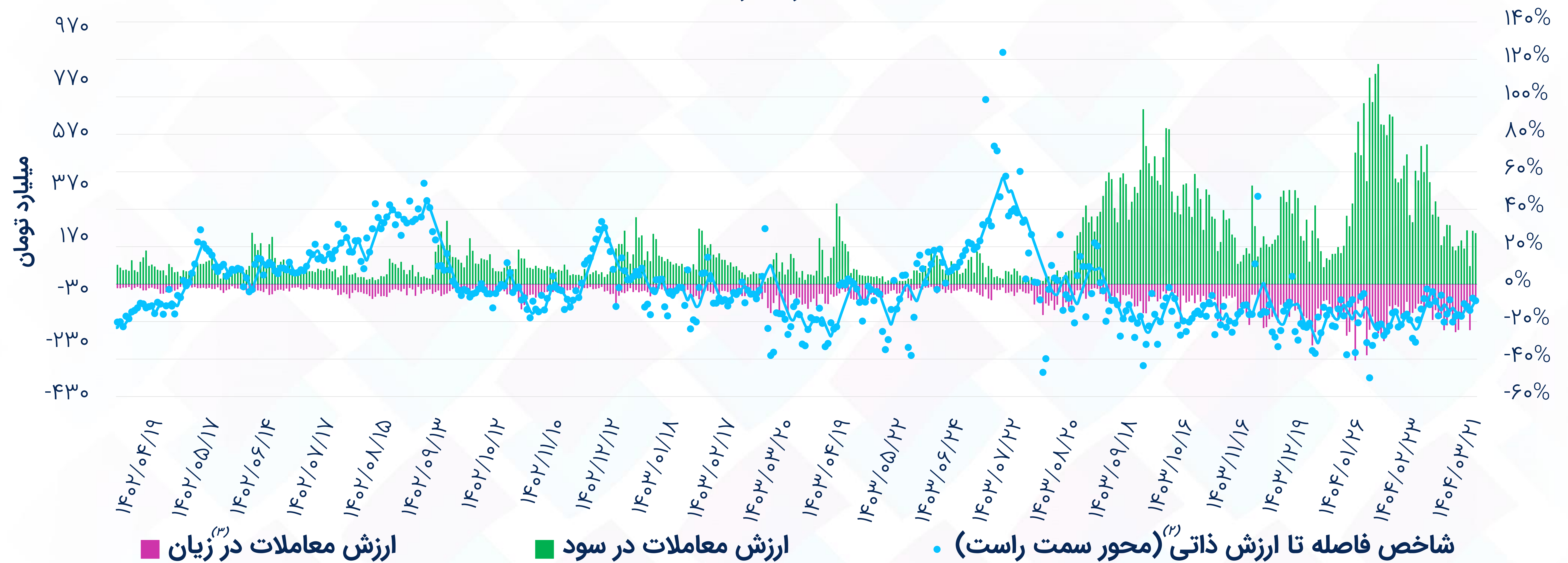
اختیار فروش



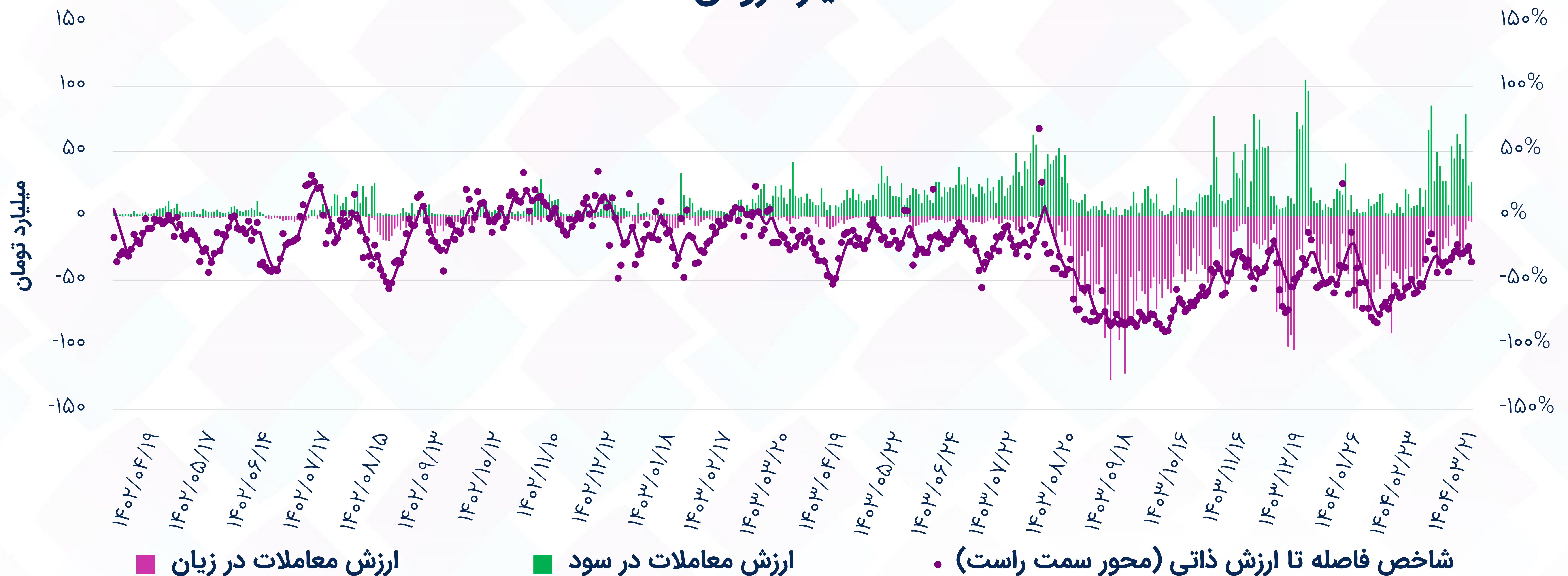
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

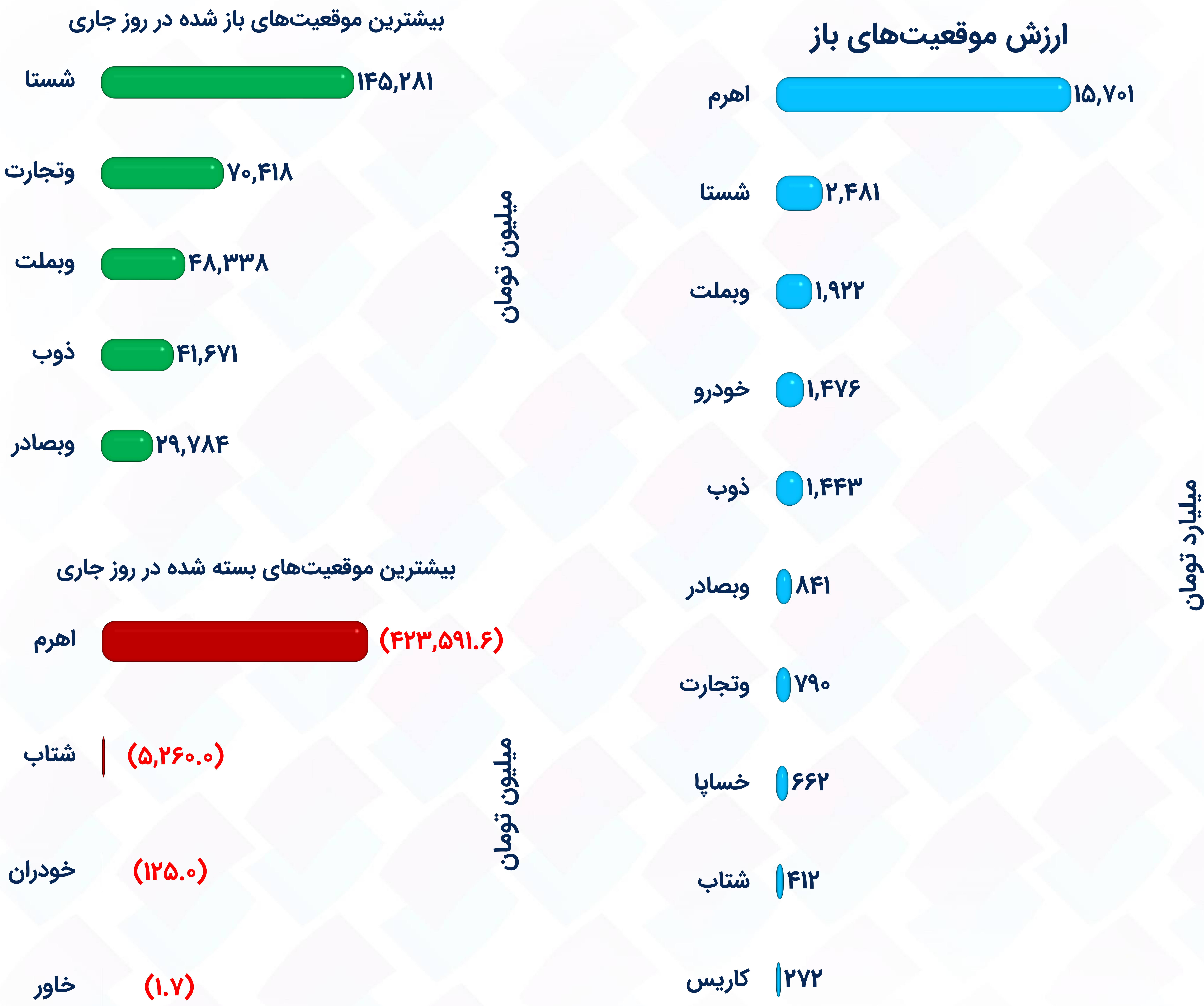
اختیار خرید

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	۱۷۴.۰	۲,۲۸۰.۵	۱۳۱.۵	۴۲.۶	(۱۴.۷%)
وبملت	۳۰	۲۱.۴	۳۶۹.۹	۱۸.۷	۲.۶	۲۵.۳%
وبصادر	۱۸	۲۰.۲	۱۹۱.۱	۱۹.۲	۱.۰	۱۰.۲%
شستا	۳۲	۱۶.۱	۶۲۲.۶	۵.۰	۱۱.۱	(۱۷.۱%)
ذوب	۲۳	۱۳.۴	۲۰۹.۴	۱۲.۲	۱.۲	۲.۳%
وتجارت	۱۴	۶.۰	۱۳۲.۰	۳.۶	۲.۴	(۴۵.۴%)
خودران	۱۱	۰.۷	۸.۹	۰.۷	۰.۰	۳.۱%

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	۱۶	۲۳,۲۹۸.۱	۳۱۳,۳۵۸.۱	۲۱,۱۲۰.۷	۲,۱۷۷.۴	(۳۵.۷%)
شستا	۱۰	۶,۳۳۲.۷	۲۱۸,۶۹۷.۴	۴,۰۸۵.۲	۲,۲۴۷.۴	(۳۸.۸%)
وبملت	۴	۷۲۱.۱	۱۶,۷۴۸.۶	۷۱۸.۴	۲.۷	(۱۳.۲%)
وبصادر	۲	۱۴۲.۶	۱,۲۵۰.۳	۱۴۲.۶	۰.۰	(۱۷.۸%)
ذوب	۴	۹۴.۰	۵۰۷.۷	۹۳.۹	۰.۱	(۲.۷%)
توان	۳	۴۴.۳	۱,۰۶۸.۶	۲۵.۳	۱۹.۰	(۳۴.۵%)
خودران	۴	۴.۶	۵۲۲.۶	۳.۴	۱.۲	(۰.۸%)

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

اهرم ۳,۳۹۲

خودرو ۳۷۲

شستا ۱۹۸

وبملت ۳۰

وتعاون ۲۱

وبصادر ۱۹

شتاب ۱۴

ذوب ۹.۷۱

توان ۵.۱۶

موج ۴.۸۰

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۶۷,۴۳۶.۳

فولاد ۸۵.۸

خودرا
ن ۵۴.۳

توان ۴۶.۰

ذوب ۷.۵

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۵۵,۶۵۶.۶)

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
ضفر ۶۰۸	فزر	۴۸,۰۰۰	۸۱	۲۵۰	۲۵۰	۴۴,۶۰۰	۴۸,۲۵۰	۸.۲%	۱۹۳.۰	۰.۵۳	۲,۴۹۶	۸۹۸%
ضفر ۶۰۷	فزر	۴۶,۰۰۰	۸۱	۵۰۰	۵۰۰	۴۴,۶۰۰	۴۶,۵۰۰	۴.۳%	۹۳.۰	۰.۶۵	۳,۴۸۶	۵۹۷%
ضفر ۶۰۶	فزر	۴۴,۰۰۰	۸۱	۲,۵۰۰	۲,۵۰۰	۴۴,۶۰۰	۴۶,۵۰۰	۴.۳%	۱۸.۶	۰.۷۶	۴,۶۹۷	۸۸%
ضران ۳۰۰۹	خودران	۱۳,۰۰۰	۷	۱.۳	۳۹	۱۲,۳۶۰	۱۳,۰۳۹	۵.۵%	۳۳۴.۳	۰.۱۹	۶۴	۶۳%
ضفر ۶۰۴	فزر	۴۰,۰۰۰	۸۱	۵۰	۴,۹۵۰	۴۴,۶۰۰	۴۴,۹۵۰	۰.۸%	۹.۱	۰.۹۲	۷,۷۰۰	۵۶%

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
ضهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷	۴.۲	۲	۲۶,۲۳۰	۴۲,۰۰۲	۶۰%	۲۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۲۰	وتجارت	۱,۰۰۰	۲۸	۱.۵	۳	۵۱۶	۱,۰۰۳	۹۴%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۷	۶.۷	۵	۲۶,۲۳۰	۳۸,۰۰۵	۴۵%	۷,۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۳۵	شستا	۲,۲۰۰	۲۱	۶۳.۲	۳	۱,۴۵۸	۲,۲۰۳	۵۱%	۷۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۵۰۱۷	ذوب	۹۰۰	۶۳	۱.۶	۶	۴۲۵	۹۰۶	۱۱۳%	۱۵۱.۰	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
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۵	۱.۶	۱۱	۱,۹۰۶	۱,۸۸۹	(۰.۹%)	۱۷۱.۷	-۰.۴۰	۱۷	۵۳.۴%
طران ۳۰۰۸	خودران	۱۲,۰۰۰	۷	۱.۱	۵۴	۱۲,۳۶۰	۱۱,۹۴۶	(۳.۳%)	۲۲۱.۲	-۰.۲۲	۷۹	۴۶.۰%
طهرم ۳۰۱۵	اهرم	۲۴,۰۰۰	۷	۱۲.۹	۱۰	۲۶,۲۳۰	۲۳,۹۹۰	(۸.۵%)	۲,۳۹۹.۰	-۰.۰۳	۱۴	۴۲.۱%
طستا ۴۰۳۲	شستا	۱,۸۰۰	۲۱	۴۲.۹	۳۰۲	۱,۴۵۸	۱,۴۹۸	۲.۷%	۵.۰	-۰.۹۹	۳۰۵	۱.۰%
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۹۲.۷	۷,۶۵۹	۲۶,۲۳۰	۲۶,۳۴۱	۰.۴%	۳.۴	-۱.۰۰	۷,۵۳۴	(۱.۶%)

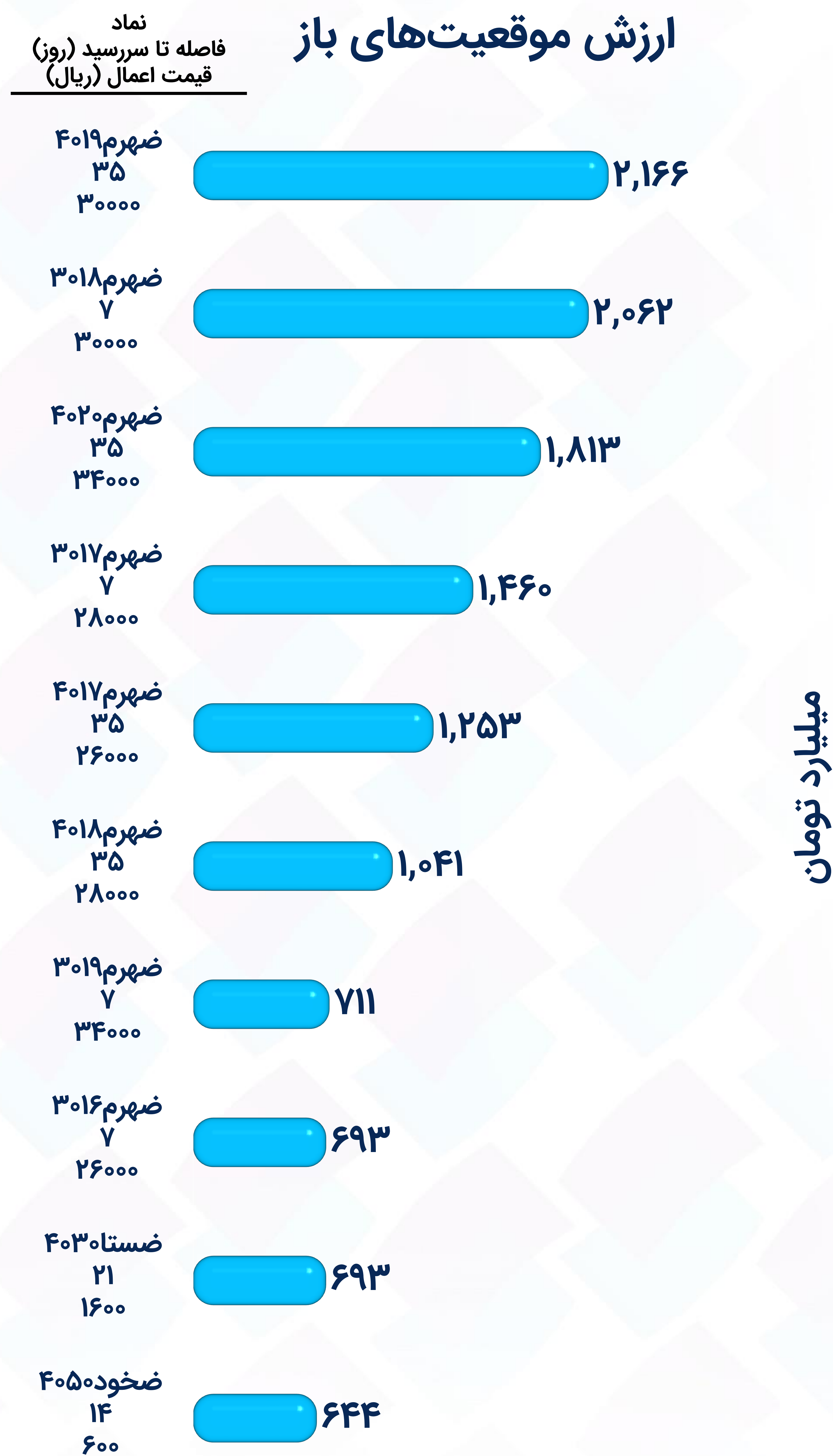
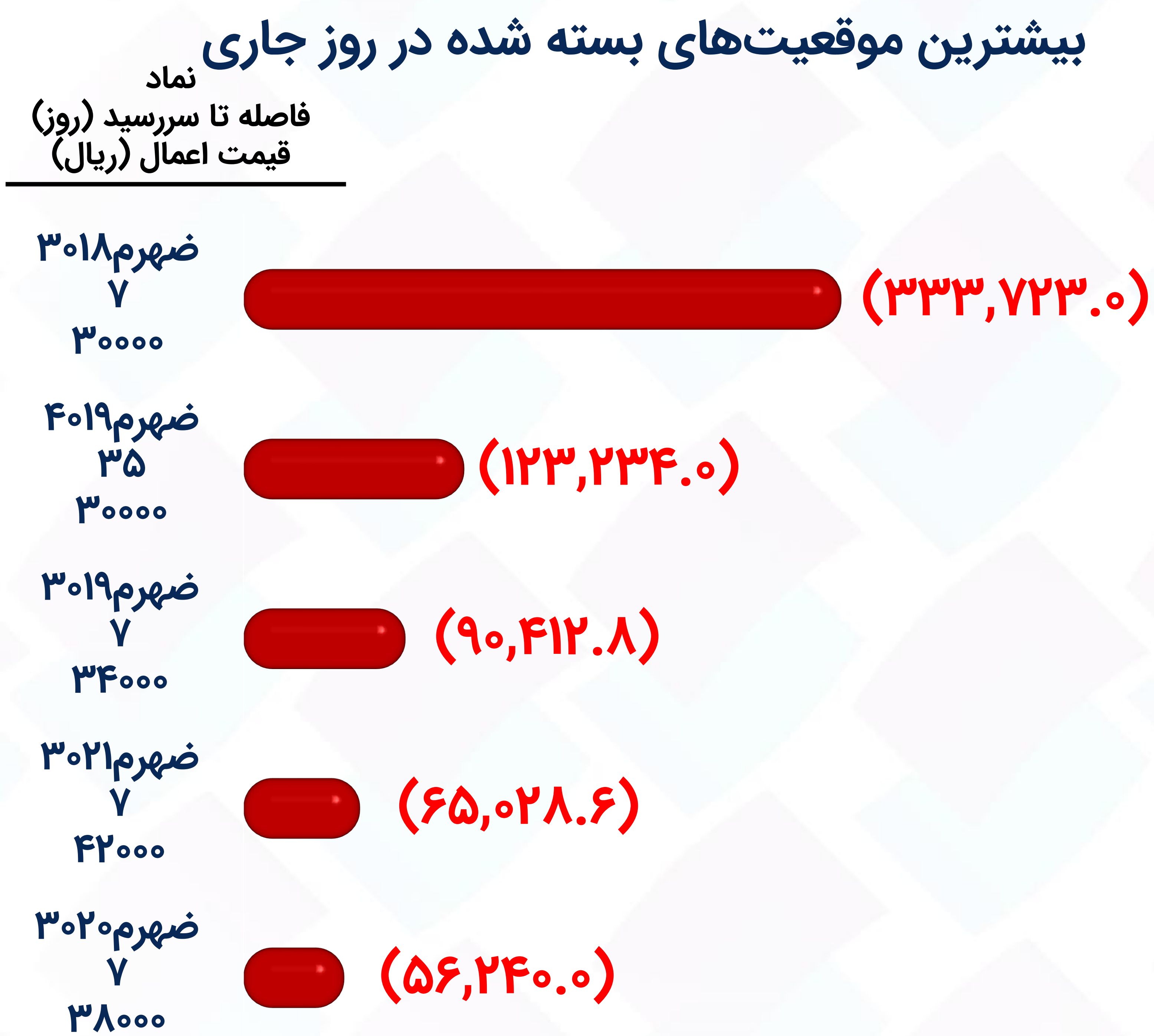
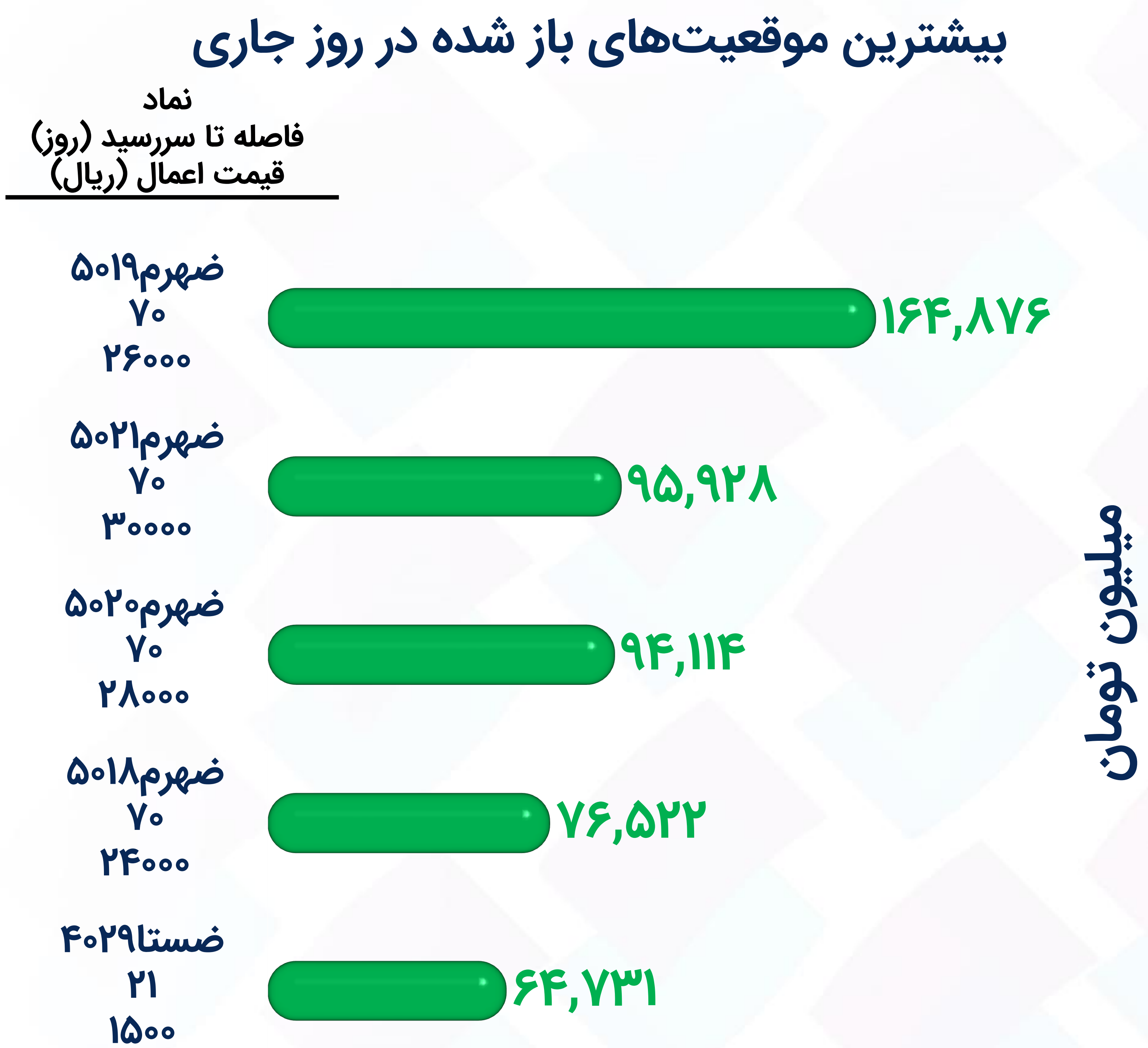
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طران ۳۰۰۷	خودران	۱۱,۰۰۰	۷	۰.۱	۶	۱۲,۳۶۰	۱۰,۹۹۴	(۱۱.۱%)	۱,۸۳۲.۳	-۰.۰۱	۱	(۸۲.۰%)
طستا ۴۰۲۷	شستا	۱,۳۰۰	۲۱	۵۷.۲	۵	۱,۴۵۸	۱,۲۹۵	(۱۱.۲%)	۲۵۹.۰	-۰.۰۳	۱	(۷۳.۶%)
طهرم ۵۰۱۷	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷۰	۴۵.۶	۳۱۹	۲۶,۲۳۰	۲۱,۶۸۱	(۱۷.۳%)	۶۸.۰	-۰.۰۵	۹۵	(۷۰.۱%)
طهرم ۵۰۱۸	اهرم	۲۴,۰۰۰	۷۰	۷۱۸.۵	۸۶۷	۲۶,۲۳۰	۲۳,۱۳۳	(۱۱.۸%)	۲۶.۷	-۰.۱۴	۳۲۱	(۶۳.۰%)
طهرم ۴۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳۵	۰.۲	۶۵	۲۶,۲۳۰	۲۱,۹۳۵	(۱۶.۴%)	۳۳۷.۵	-۰.۰۲	۲۷	(۵۸.۱%)

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



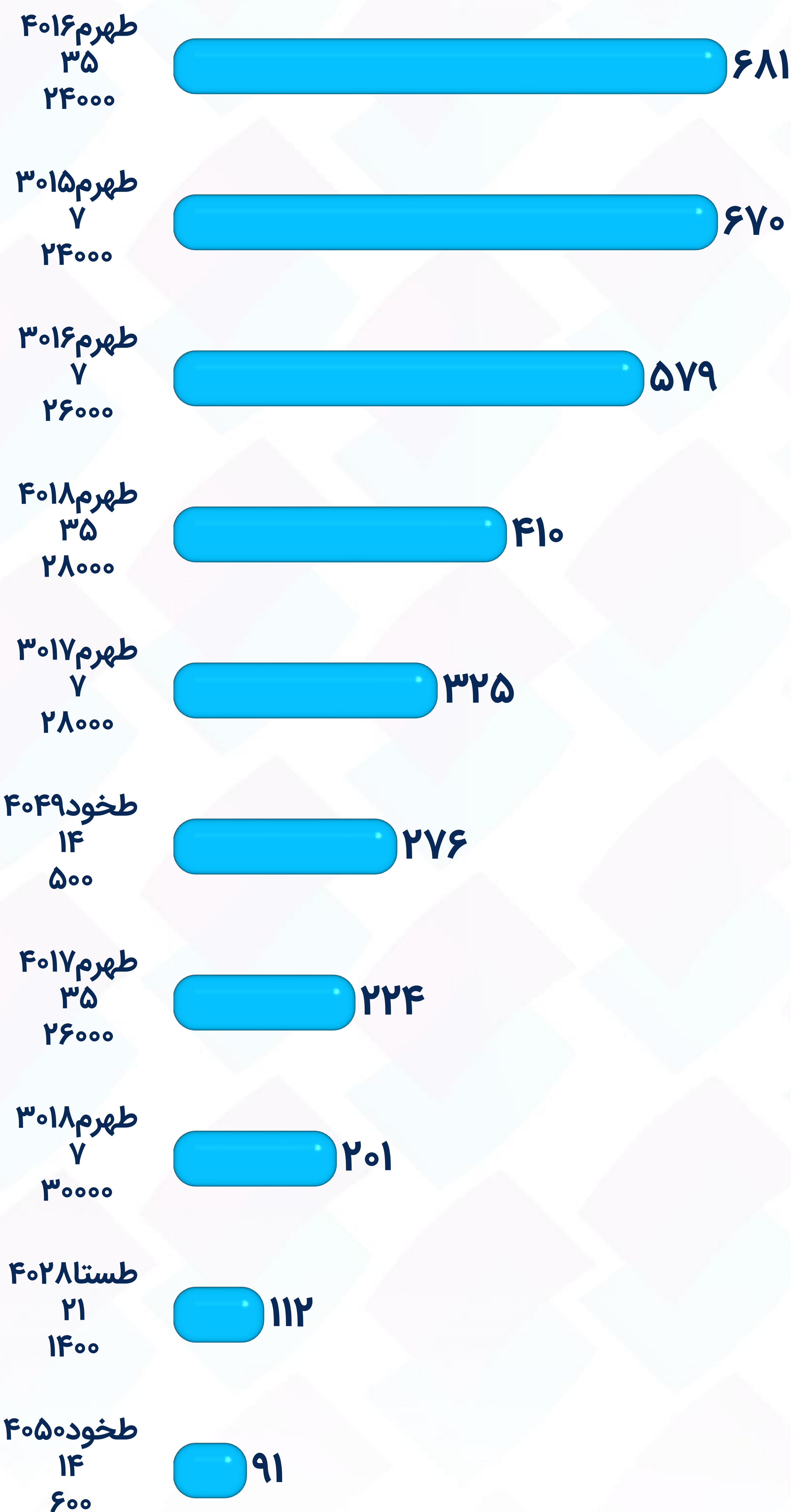
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

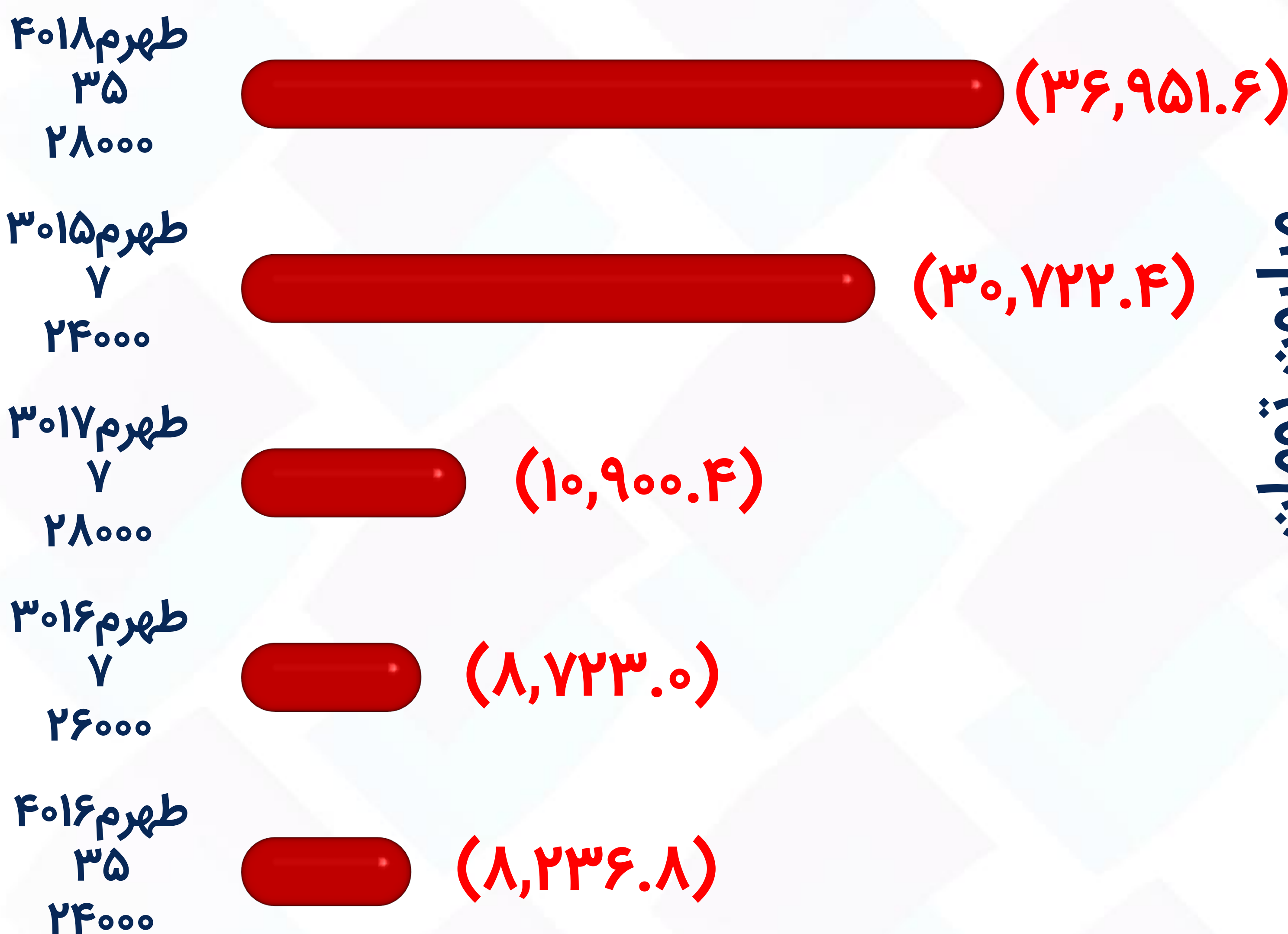
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

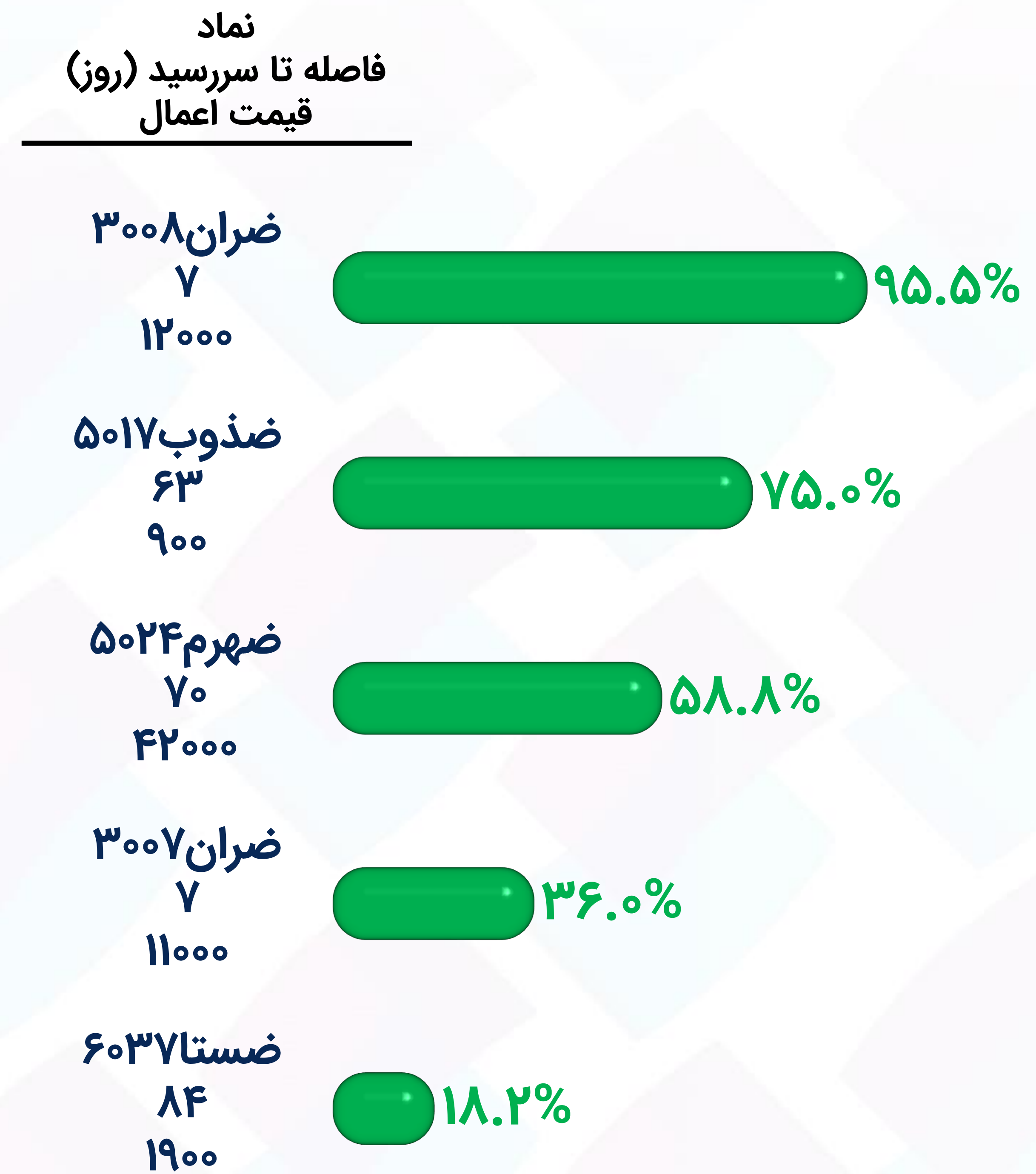
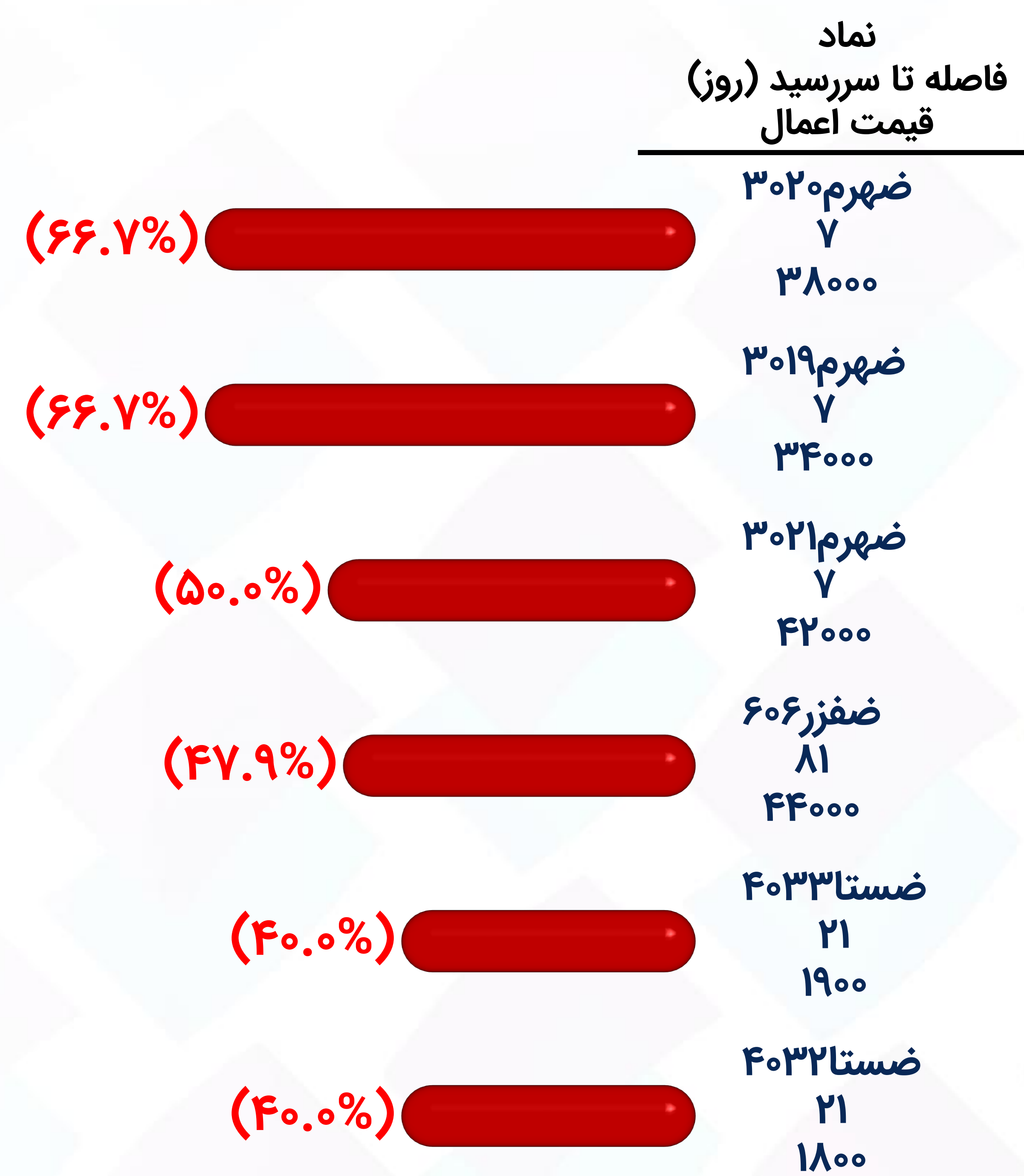
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



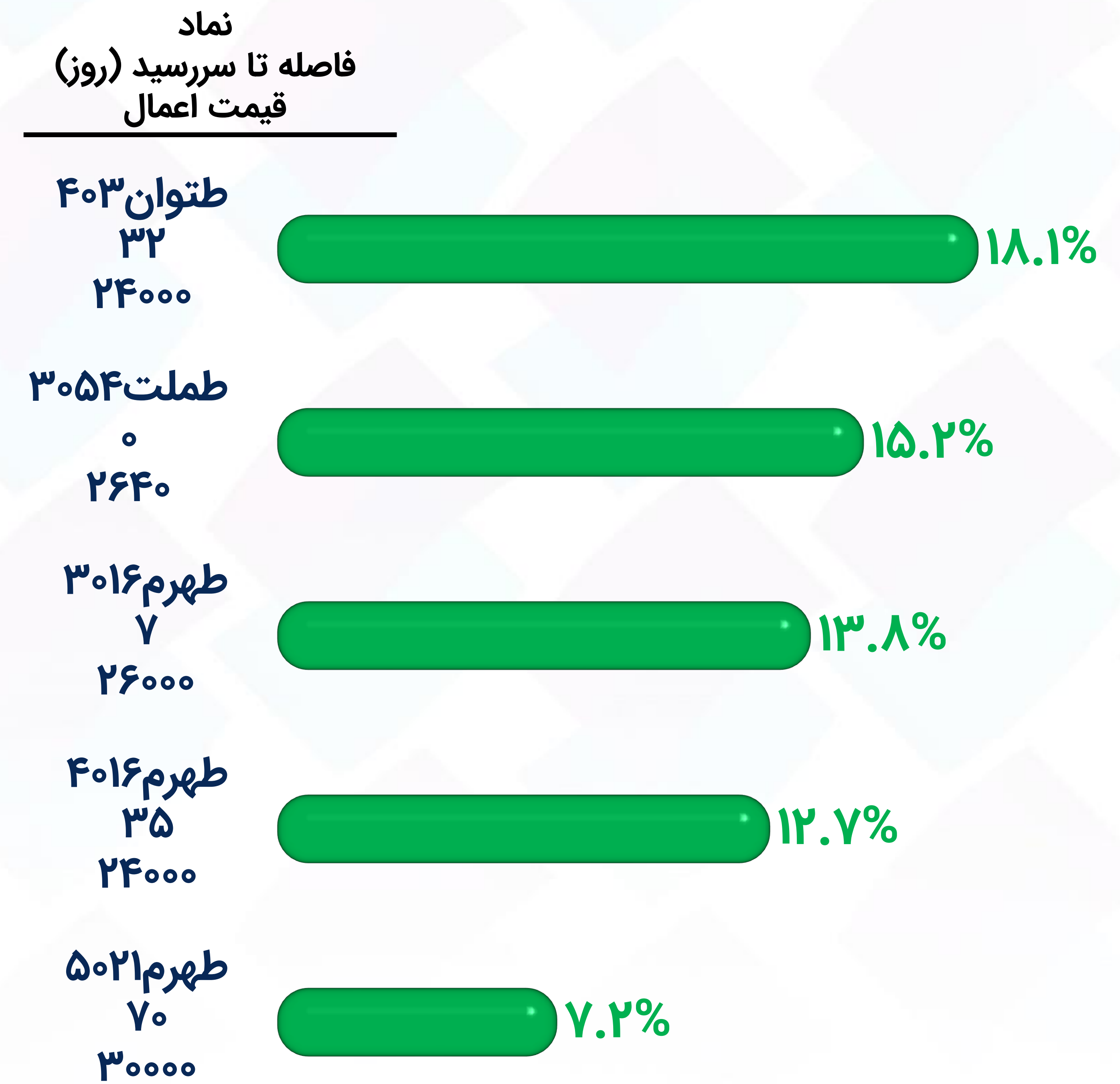
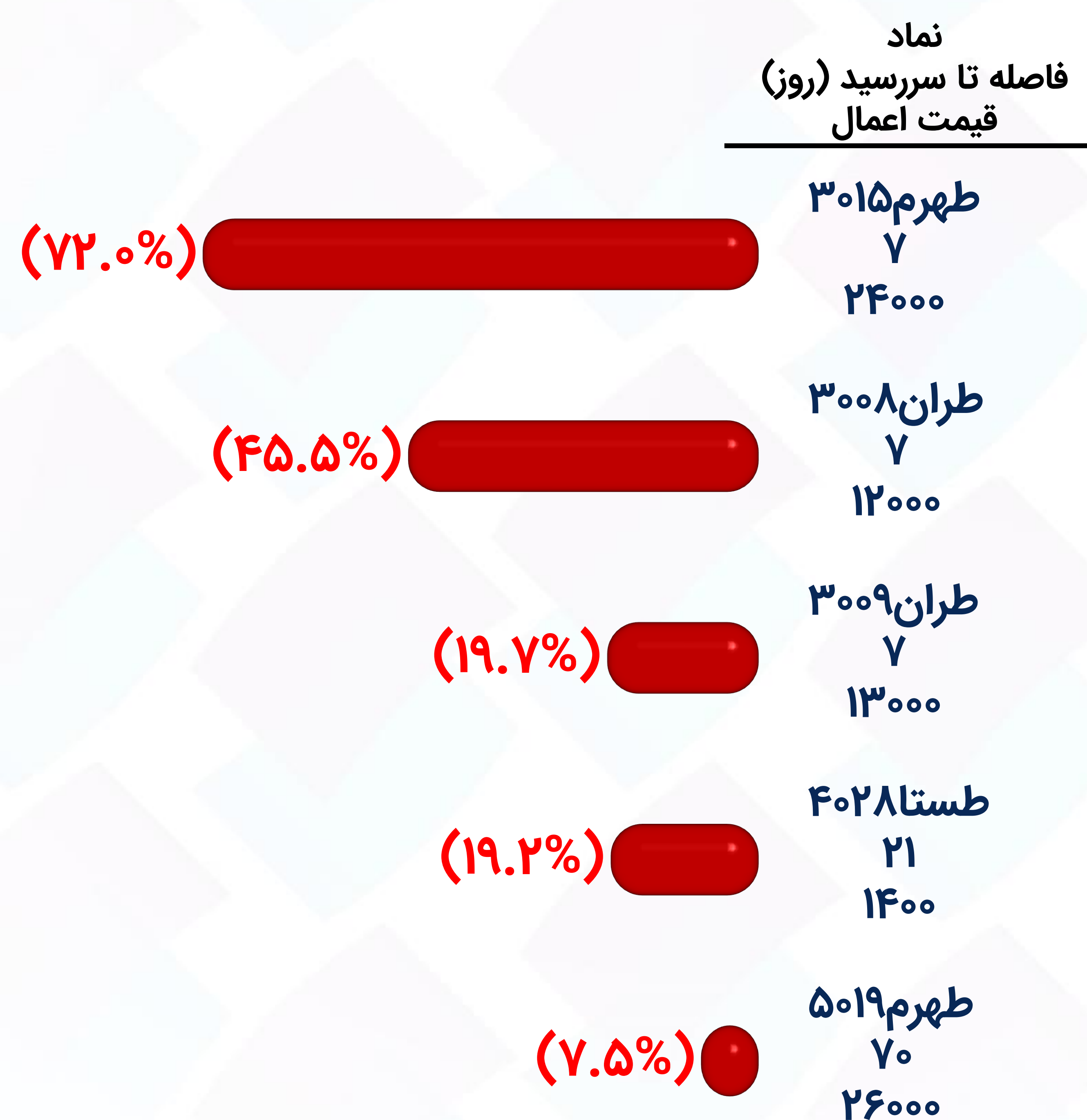
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

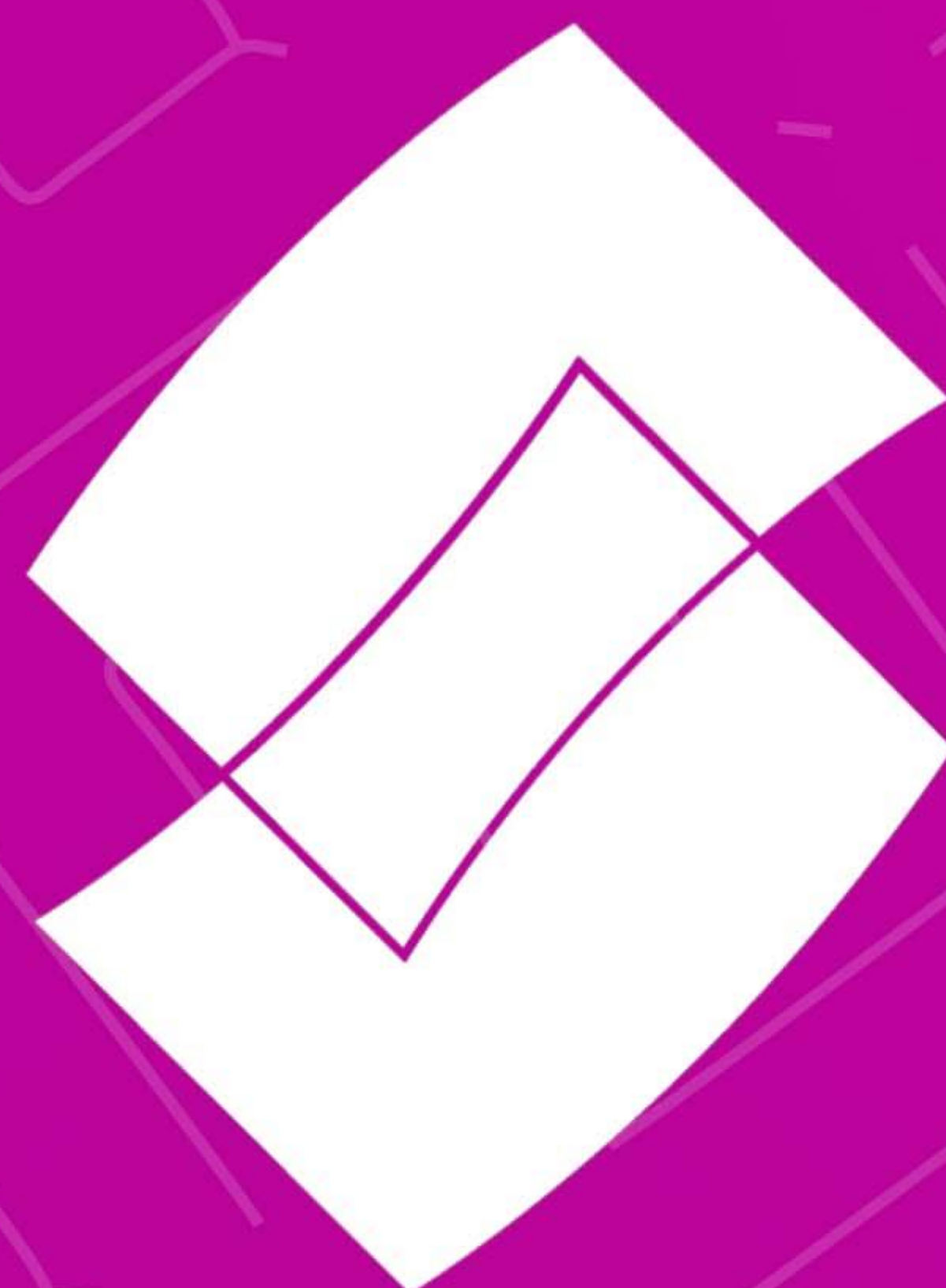
اختیار خرید



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.