

شماره
۴۷۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۴ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





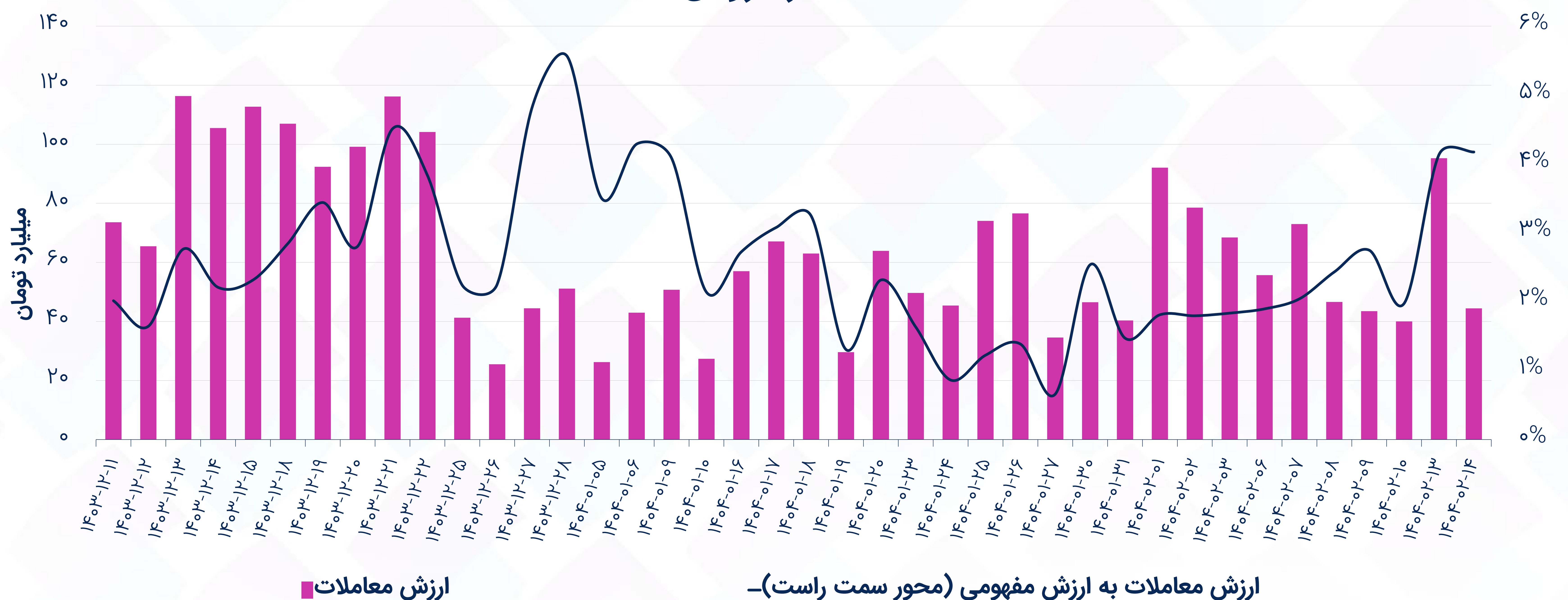
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



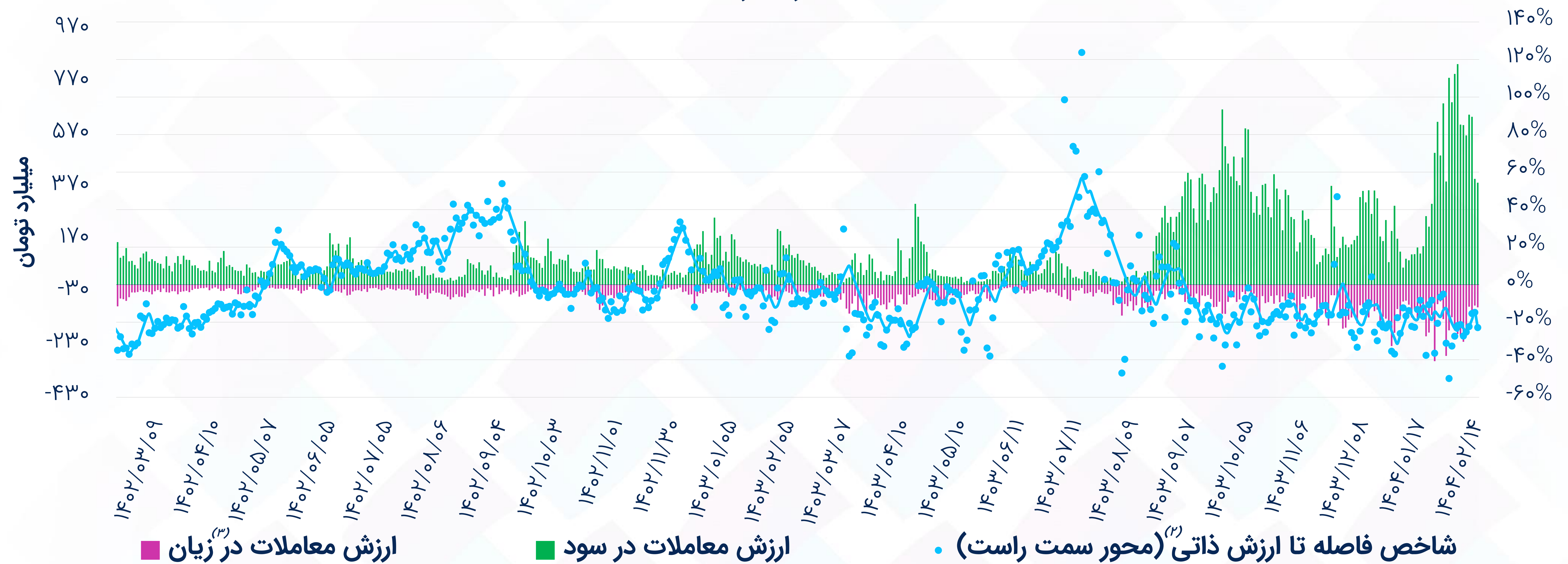
اختیار فروش



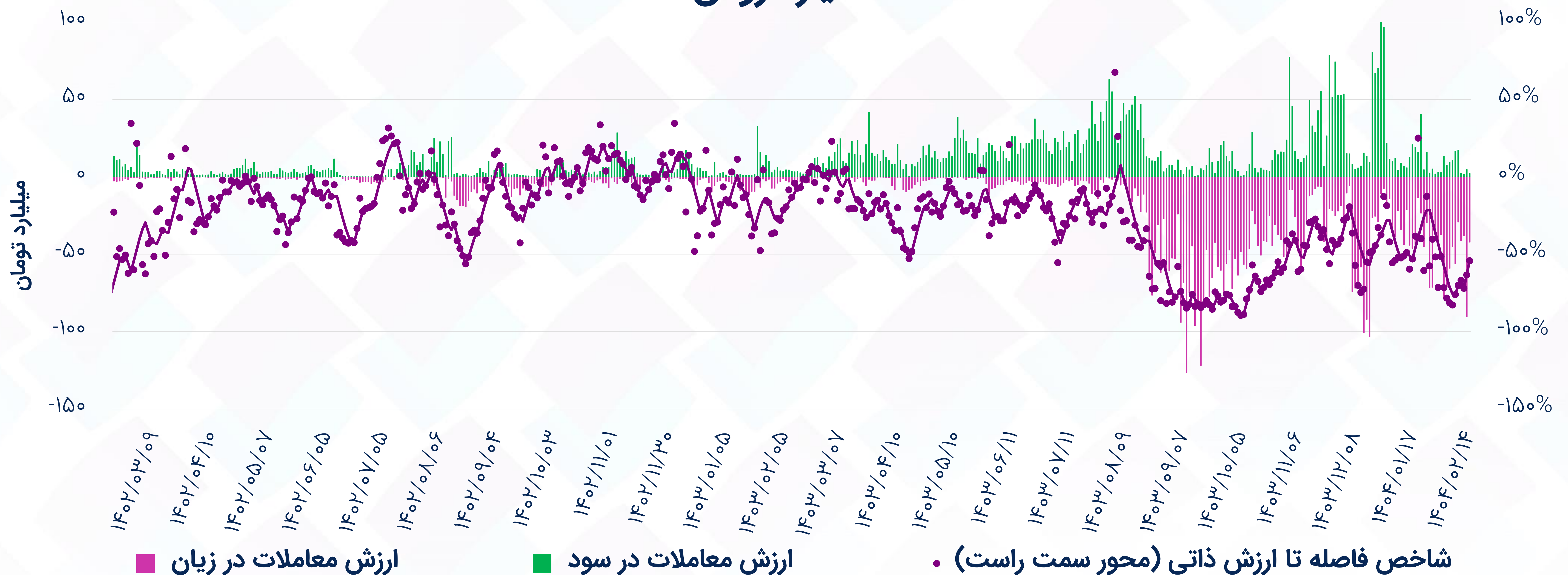
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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
خودرو	۱۳	۲۲۰.۳	۱,۶۶۳.۶	۲۰۸.۸	۱۱.۵	(۲۰.۱%)
اهرم	۴۷	۹۳.۶	۶۵۶.۱	۵۷.۶	۳۶.۰	(۳۲.۷%)
شستا	۴۱	۵۴.۹	۷۲۲.۶	۲۹.۸	۲۵.۱	(۳۴.۳%)
ذوب	۲۸	۳۱.۲	۲۸۰.۷	۲۸.۵	۲.۷	(۱۸.۸%)
وتجارت	۲۲	۱۶.۴	۲۰۳.۵	۱۳.۵	۳.۰	(۱۰.۸%)
پادا	۲	۱۵.۱	۶۷.۰	۱۵.۱	۰.۰	۲.۰%
وبملت	۲۵	۱۳.۰	۱۴۷.۵	۷.۵	۵.۵	(۳۵.۴%)

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
خودرو	۶	۳۴,۳۷۶.۸	۶۳۵,۴۳۱.۲	۸۳۲.۶	۳۳,۵۴۴.۱	(۵۳.۶%)
اهرم	۲۲	۵,۲۶۱.۶	۱۹۲,۲۲۶.۶	۹۲۹.۴	۴,۳۳۲.۲	(۴۸.۶%)
شستا	۸	۴,۵۳۰.۱	۲۲۰,۱۶۷.۳	۳۲۹.۲	۴,۲۰۰.۸	(۶۵.۸%)
ذوب	۴	۱۸۳.۶	۱۲,۱۳۷.۲	۰.۰	۱۸۳.۶	(۶۱.۱%)
وتجارت	۳	۳۷.۰	۸۴۳.۴	۳۵.۶	۱.۴	۴.۹%
وبملت	۳	۲۹.۶	۶۶۴.۳	۲۶.۲	۳.۴	(۴۱.۲%)
وبصادر	۲	۹.۳	۱,۶۰۲.۵	۰.۰	۹.۳	(۹۹.۸%)

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

میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۵,۱۳۶

خودرو ۵۸۷

شستا ۱۹۴

ذوب ۵۸

وبملت ۲۴

وتعاون ۱۹

شتاب ۱۰

وبصادر ۶.۳۳

وتجارت ۲.۳۷

خودران ۲.۱۹

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

خودرو ۱۵۰,۷۸۱.۶

شستا ۳۰,۵۹۸.۹

ذوب ۲,۰۲۵.۴

وبصادر ۵۴۶.۷

وتجارت ۳۹۲.۱

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۱۵۳,۴۹۲.۸)

خودران (۷.۸)

جهش (۱.۳)

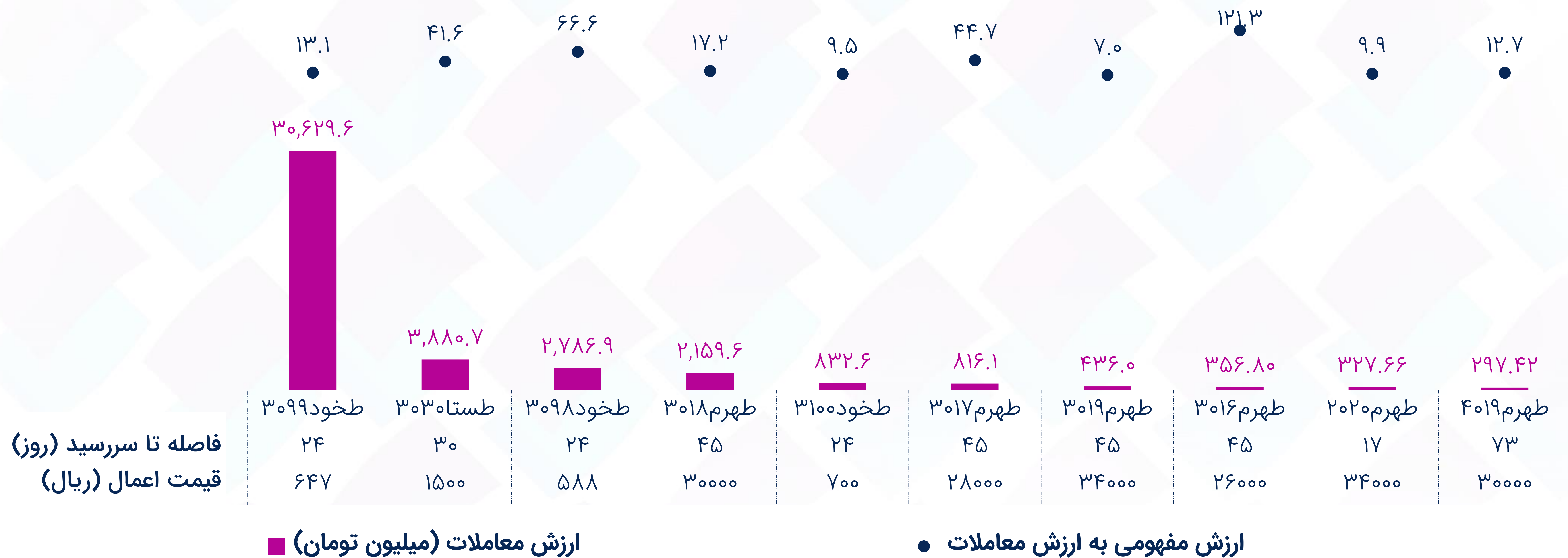
میلیون تومان

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
ضشنا ۲۰۵۲	شپنا	۴,۲۲۵	۳	۱۴.۶	۲	۳,۹۱۶	۴,۲۲۷	۷.۹%	۲,۱۱۳.۵	۰.۰۵	۴	۷۷%
ضتاب ۴۰۱۶	شتاب	۱۳,۰۰۰	۵۹	۴۸۳.۷	۲,۸۲۷	۱۶,۸۲۰	۱۵,۸۲۷	(۵.۹%)	۵.۶	۰.۹۸	۴,۵۵۳	۶۱%
ضهرم ۶۰۳۴	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۳۶	۴۰.۰	۱,۰۰۰	۳۰,۳۲۰	۳۹,۰۰۰	۲۸.۶%	۳۹.۰	۰.۳۶	۱,۴۵۰	۴۵%
ضنارنج ۳۰۴	نارنج اهرم	۱۳,۰۰۰	۲۸	۶.۵	۵,۰۰۰	۱۹,۷۳۸	۱۸,۰۰۰	(۸.۸%)	۳.۶	۱.۰۰	۷,۱۱۱	۴۲%
ضموج ۲۱۹	موج	۲۶,۰۰۰	۷	۱۷۱.۵	۲,۷۰۰	۲۹,۳۲۶	۲۸,۷۰۰	(۲.۱%)	۱۰.۶	۰.۹۸	۳,۵۵۴	۳۲%

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 ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۰	۵.۵	۱	۵۲۴	۸۰۱	۵۳%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۳۸	۱۶.۹	۶	۵۲۴	۱,۰۰۶	۹۲%	۱۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۳۰	۹۳.۱	۱۰	۴,۰۳۴	۶,۴۹۰	۶۱%	۶۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۳۸	۱.۲	۲۳	۵۲۴	۹۲۳	۷۶%	۴۰.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۰	۱۱.۵	۱	۵۲۴	۷۰۱	۳۴%	۷۰۱.۰	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
طجار۵۵۲۰	و تجارت	۶۳۵	۳	۳۵.۵	۴۸	۵۸۰	۵۸۷	۱.۲%	۱۲.۲	-۰.۹۷	۵۲	۷.۸%
طهرم۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۷	۳۲۷.۷	۳,۰۶۸	۳۰,۳۲۰	۳۰,۹۳۲	۲.۰%	۱۰.۱	-۰.۸۶	۳,۲۱۱	۴.۷%
طهرم۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷۳	۵۱.۱	۱۰,۸۷۱	۳۰,۳۲۰	۳۱,۱۲۹	۲.۷%	۲.۹	-۰.۹۴	۹,۰۴۹	(۱۶.۸%)
طهرم۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۷	۸۱.۴	۷۹۹	۳۰,۳۲۰	۲۹,۲۰۱	(۳.۷%)	۳۶.۵	-۰.۳۵	۶۳۸	(۲۰.۲%)
طهرم۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۷۳	۱۱.۰	۷,۳۰۰	۳۰,۳۲۰	۳۰,۷۰۰	۱.۳%	۴.۲	-۰.۸۲	۵,۶۳۹	(۲۲.۸%)

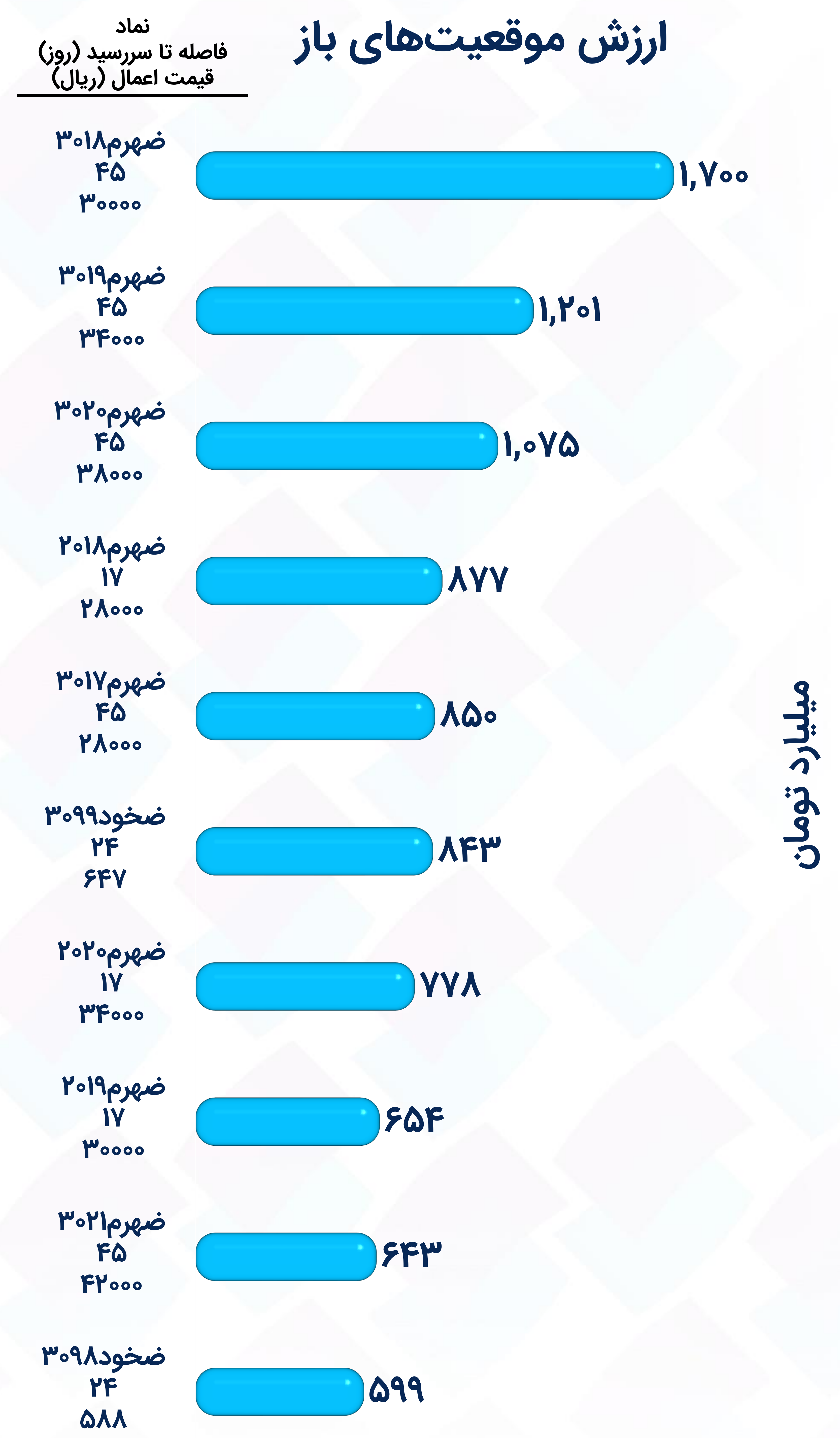
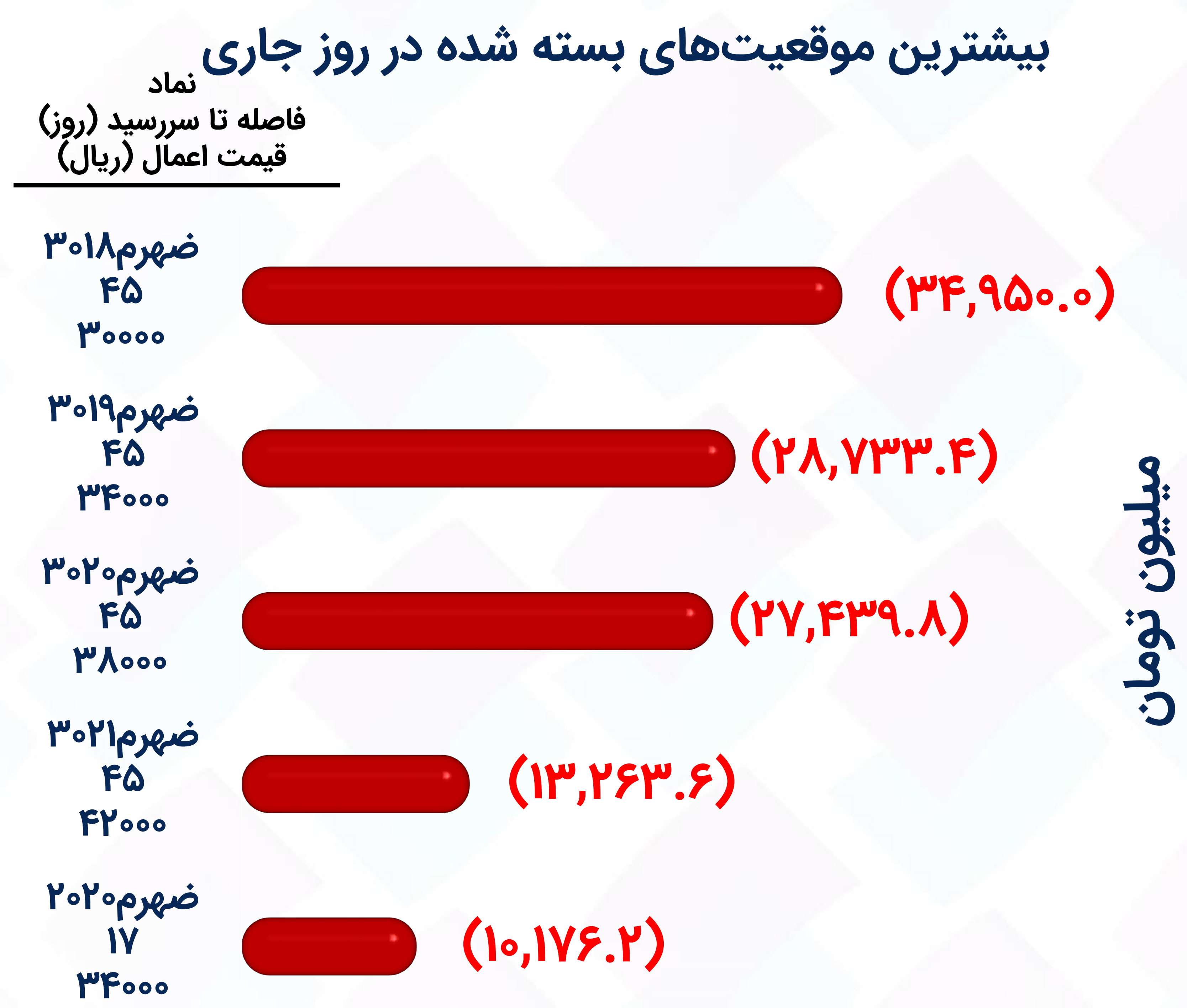
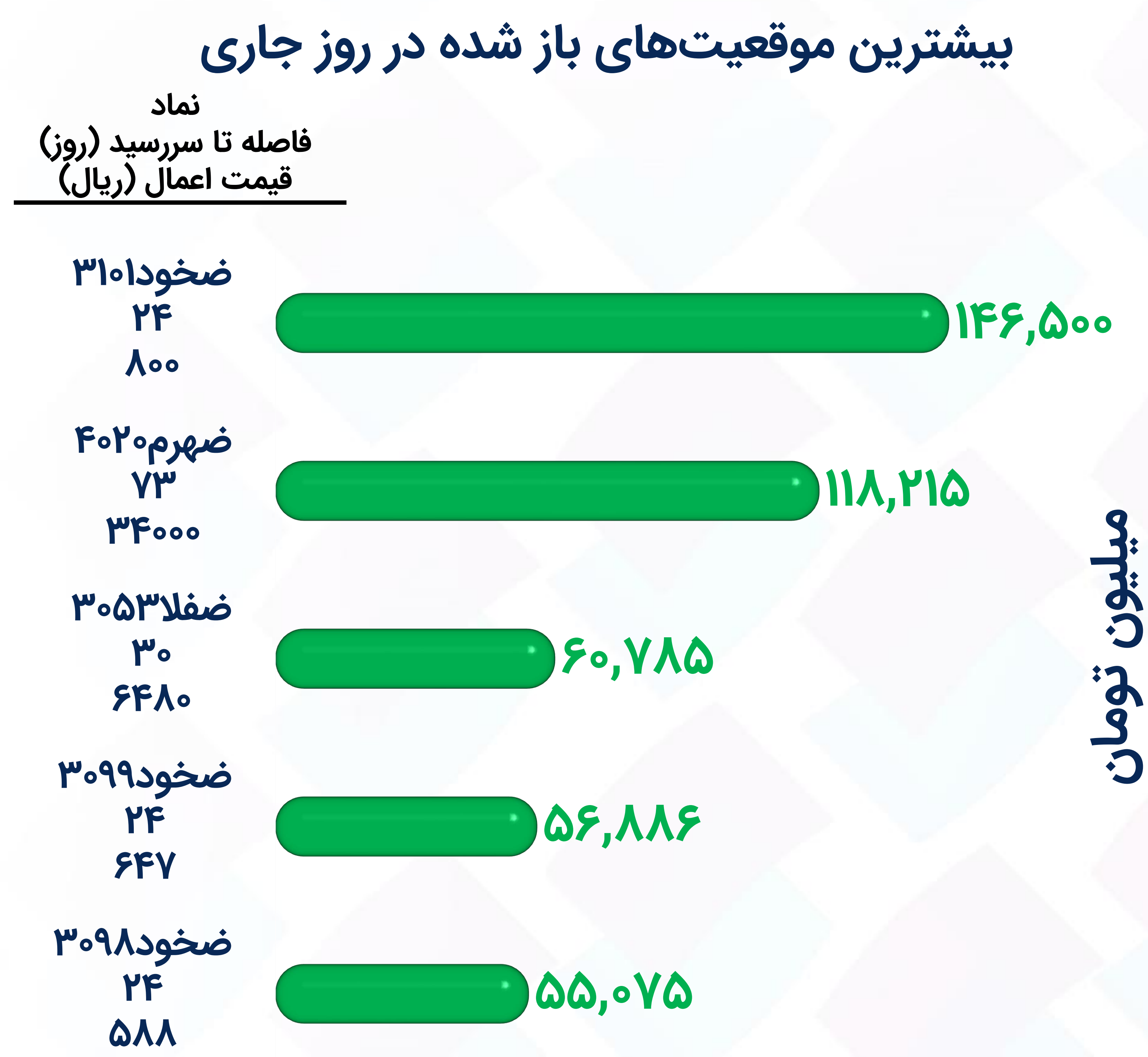
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طخود۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۲۴	۳.۴	۴	۶۶۶	۲۷۸	(۵۸.۳%)	۶۹.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۷	۳.۵	۳۰	۳۰,۳۲۰	۱۹,۹۷۰	(۳۴.۱%)	۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طشنا۲۰۴۹	شپنا	۳,۱۶۹	۳	۰.۱	۱	۳,۹۱۶	۳,۱۶۸	(۱۹.۱%)	۳,۱۶۸.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۰	۲.۸	۱	۵۲۴	۳۹۹	(۲۳.۹%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۷	۱.۶	۵۲	۳۰,۳۲۰	۲۱,۹۴۸	(۲۷.۶%)	۴۲۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)

(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

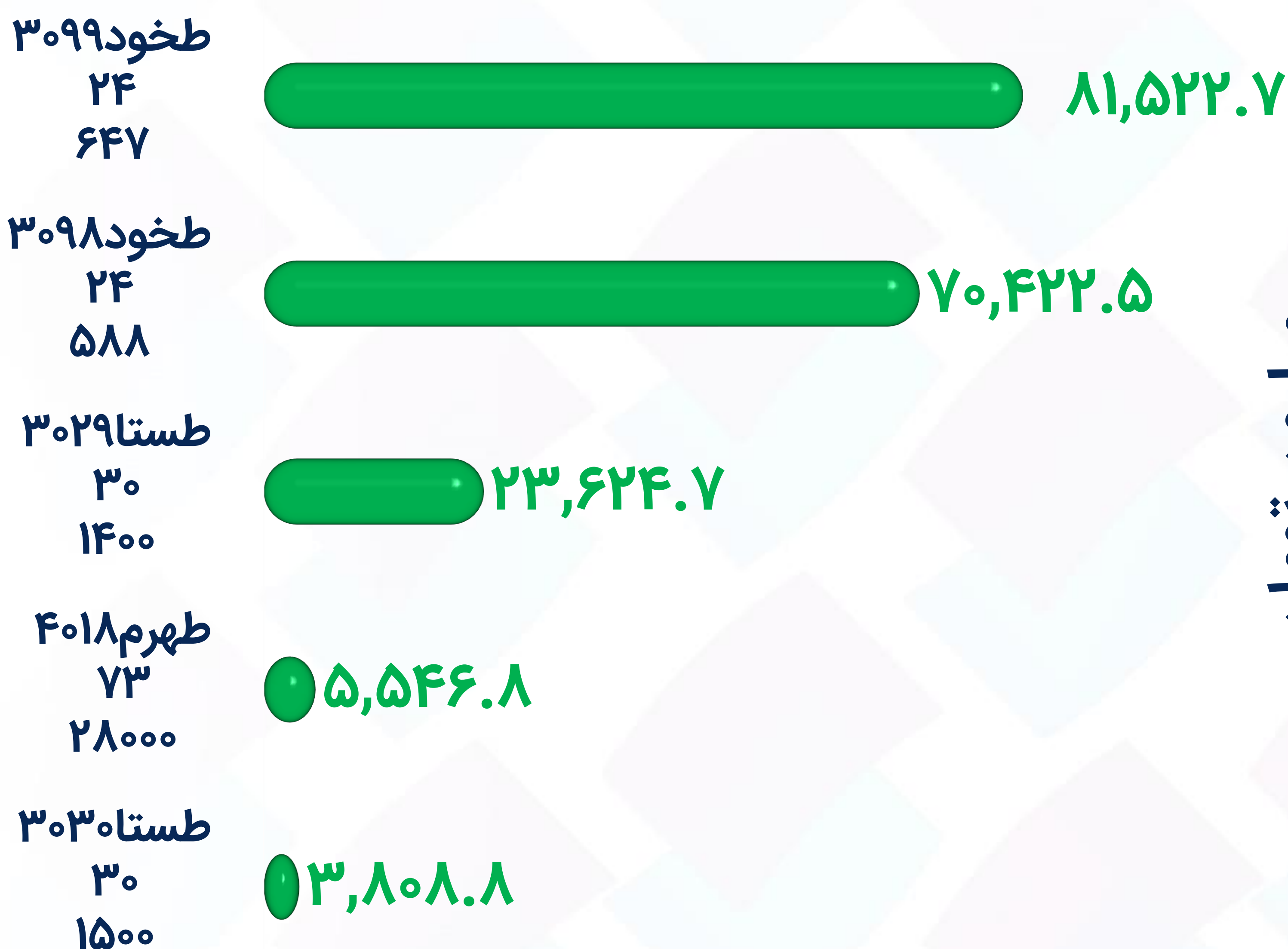
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

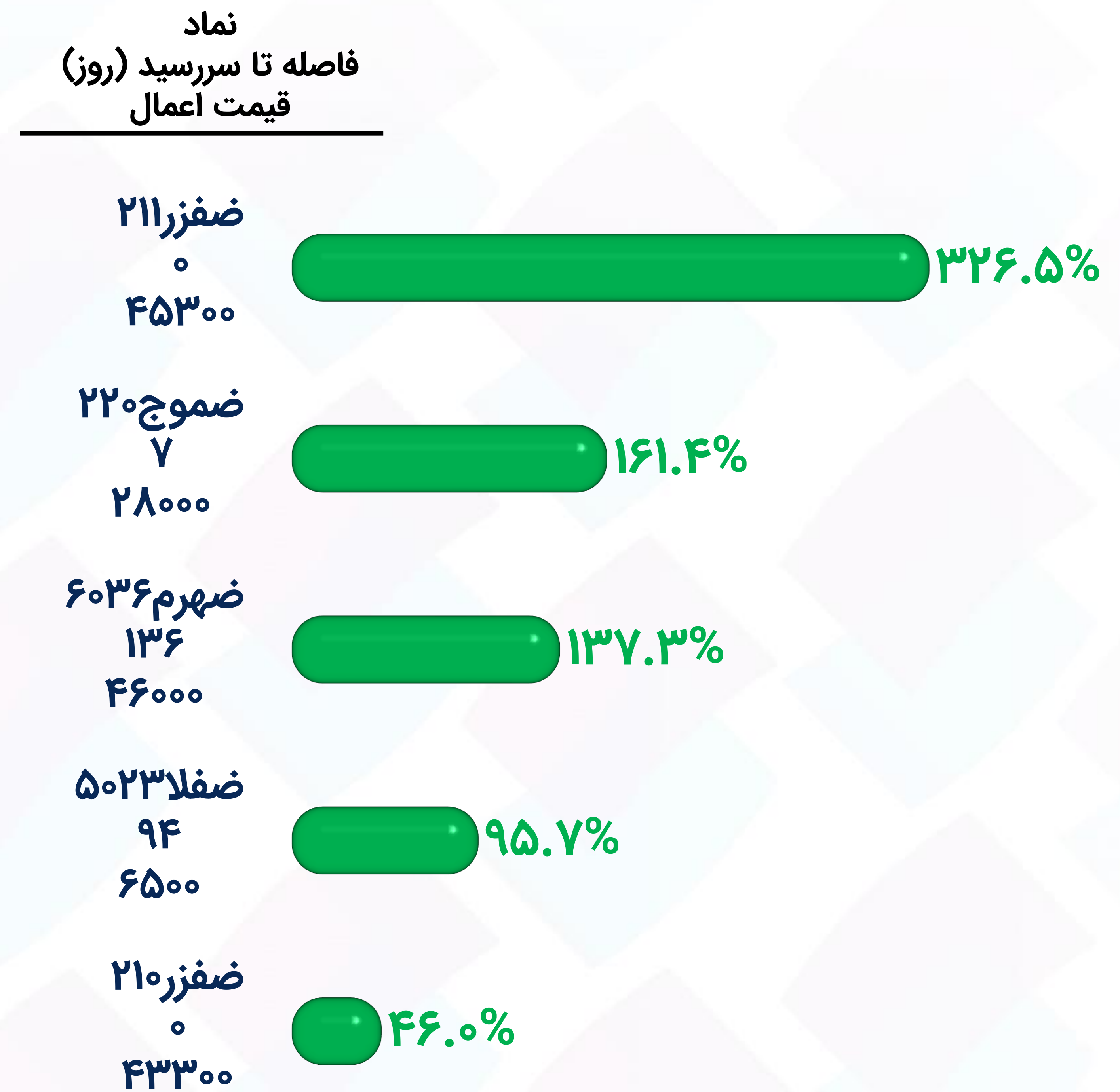
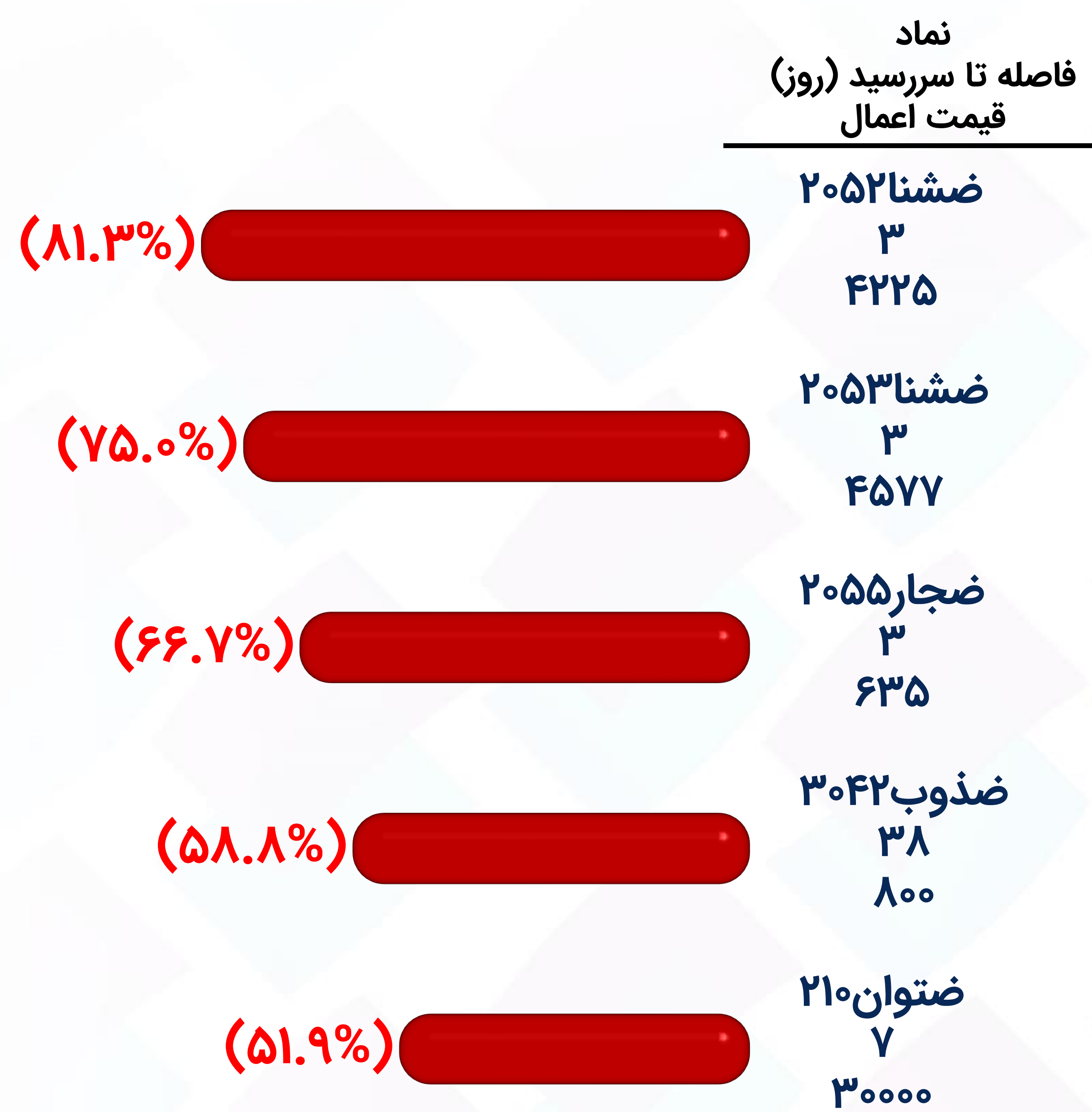
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



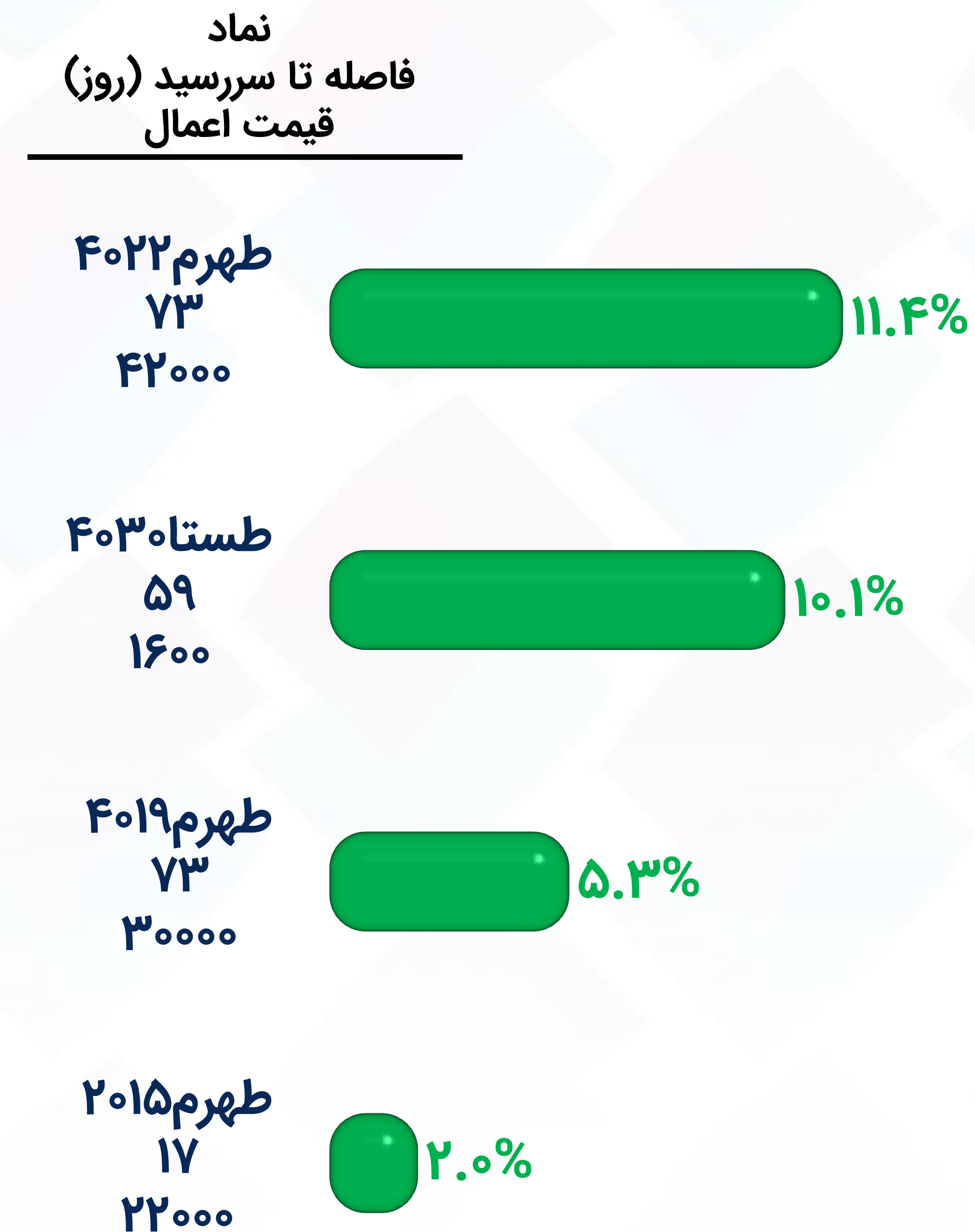
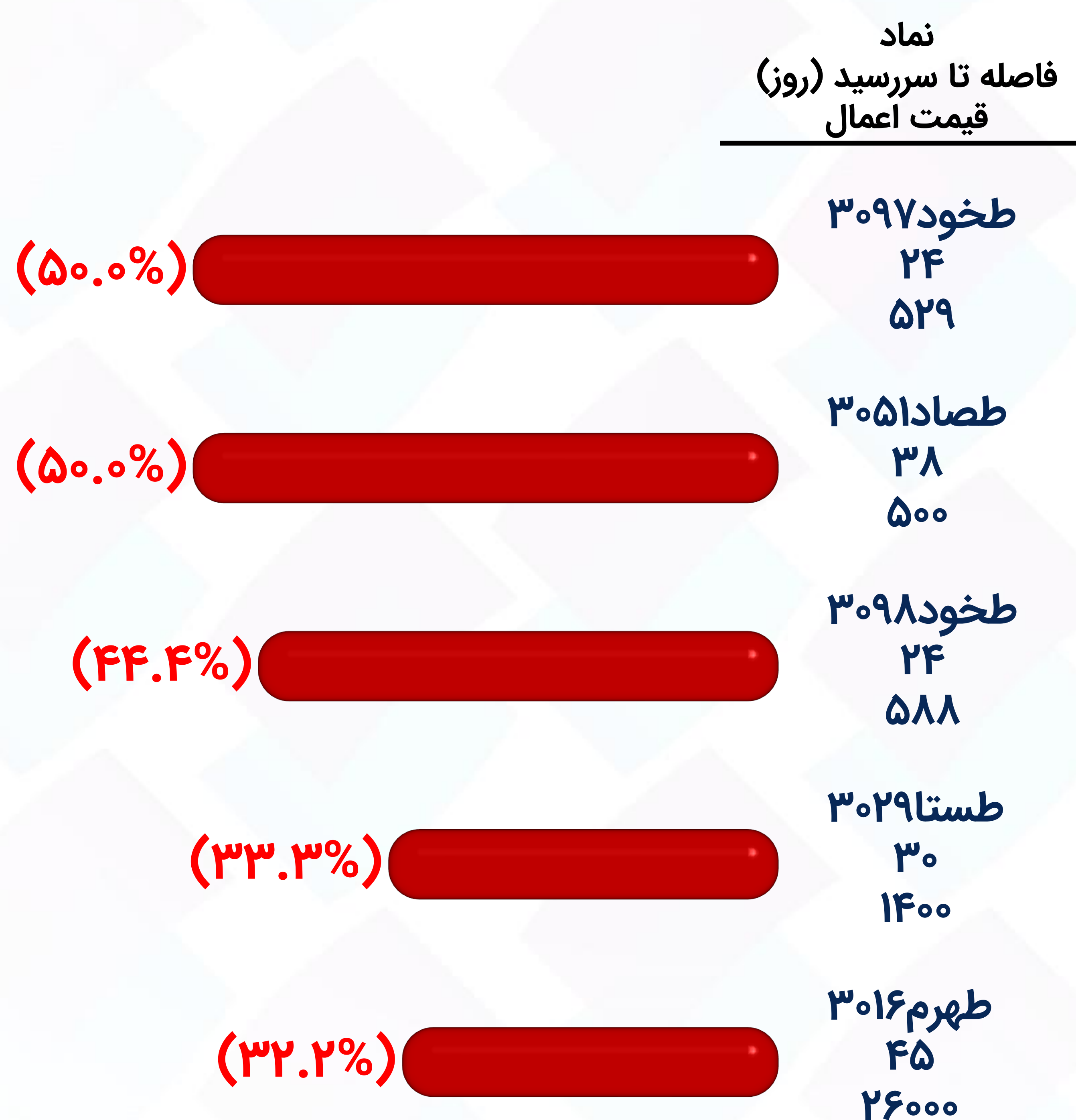
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

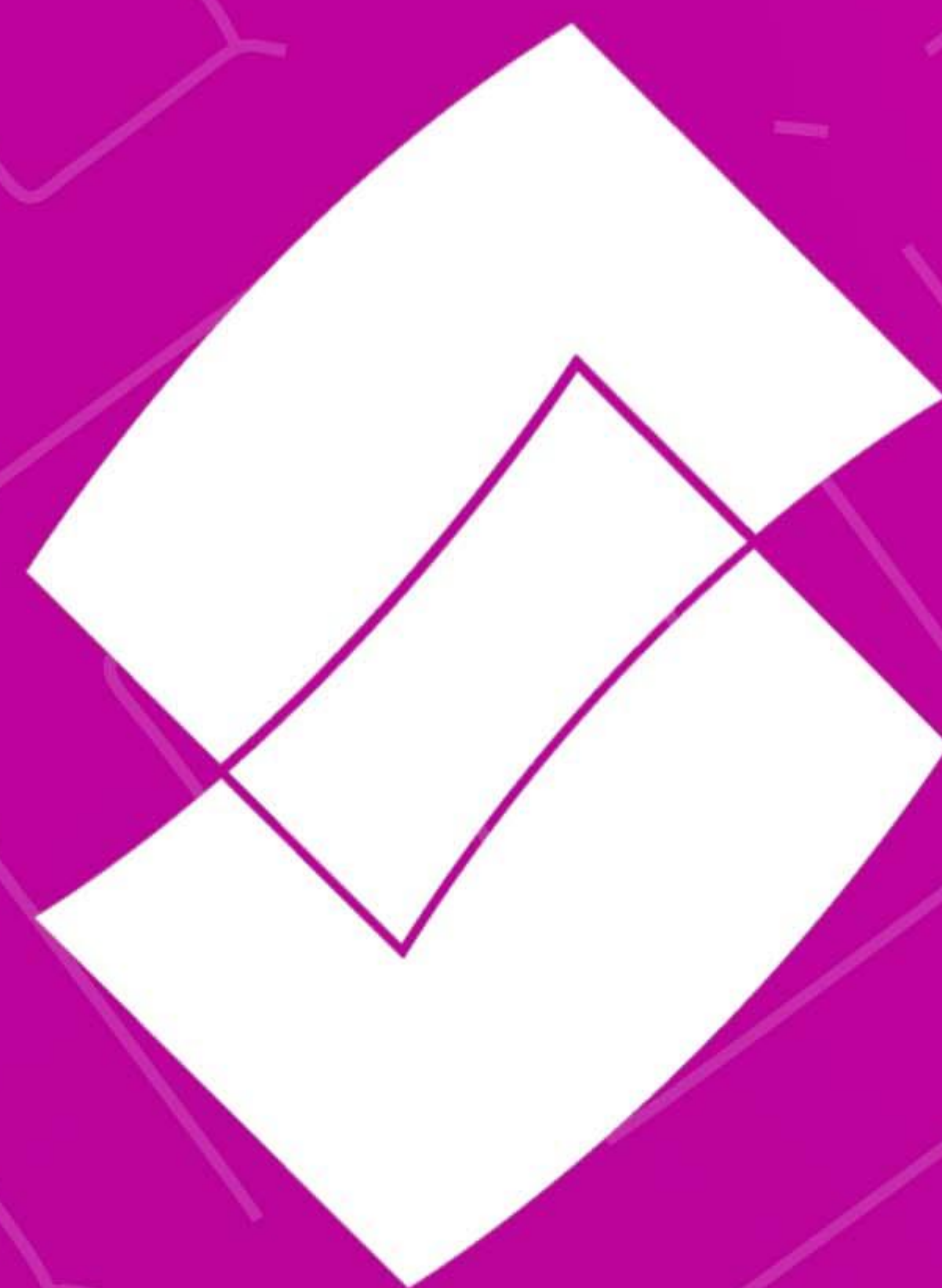
اختیار خرید



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.