

شماره
۴۸۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۱ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





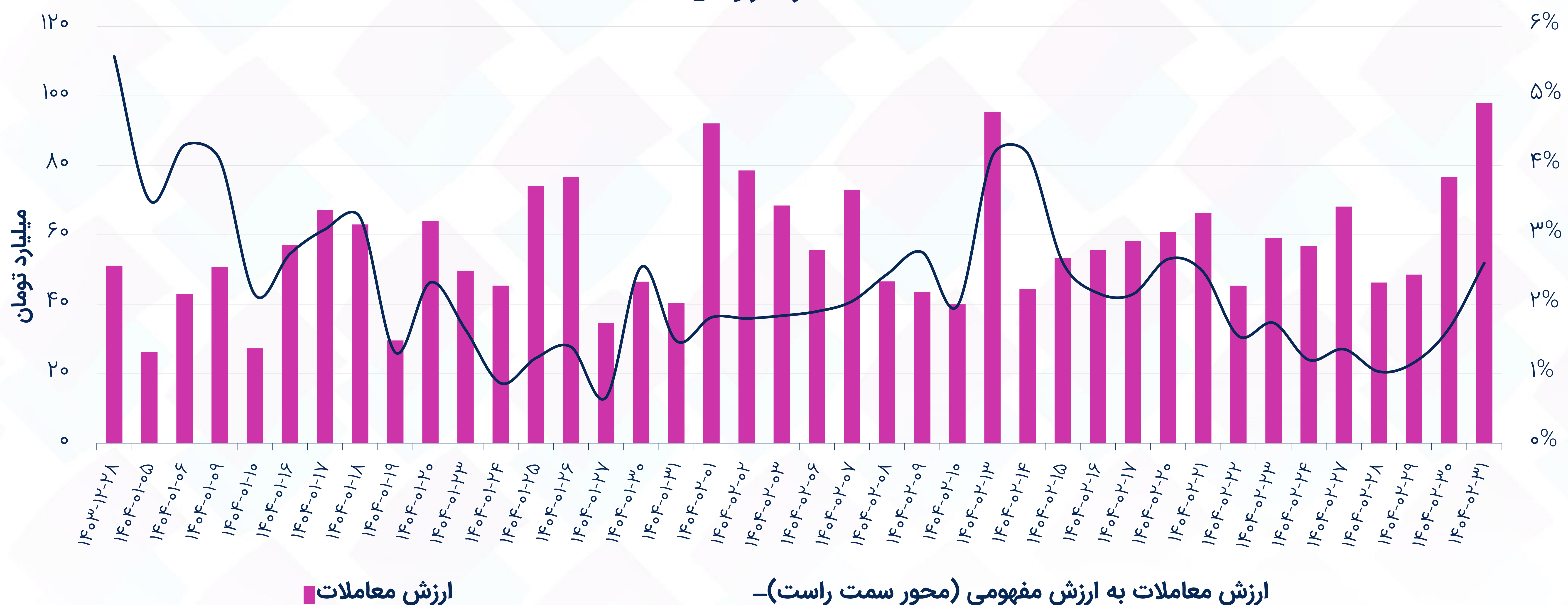
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



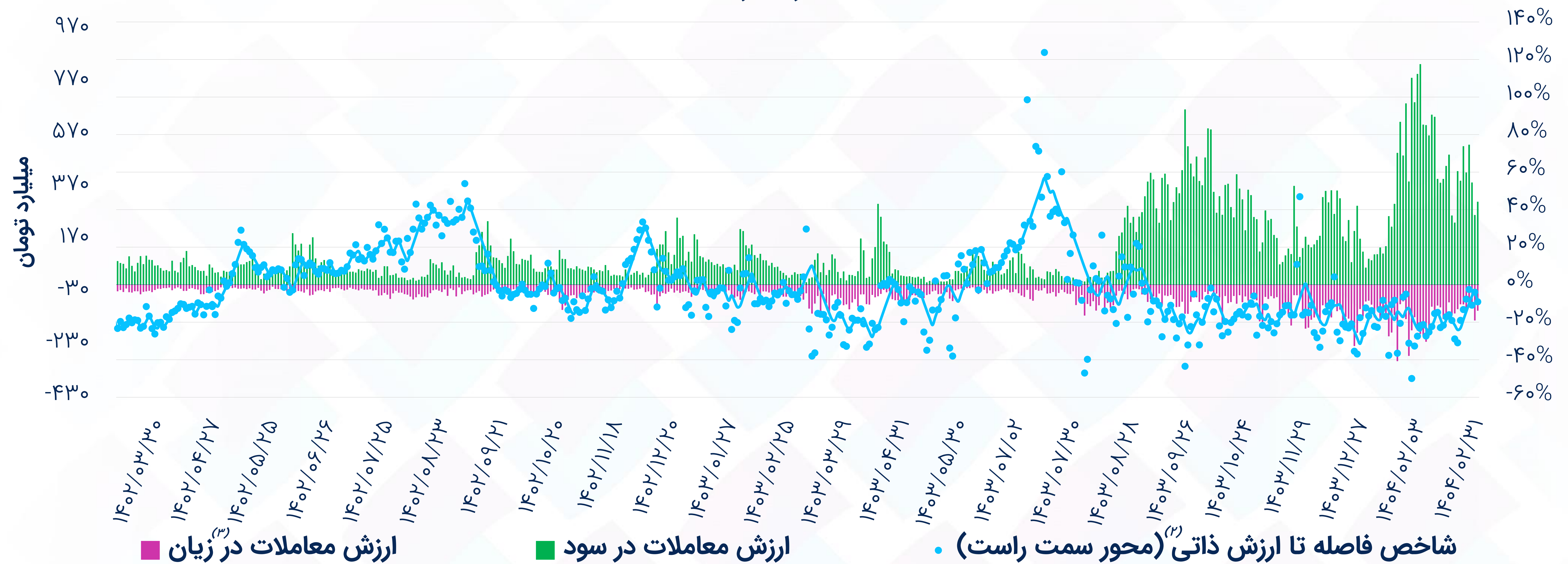
اختیار فروش



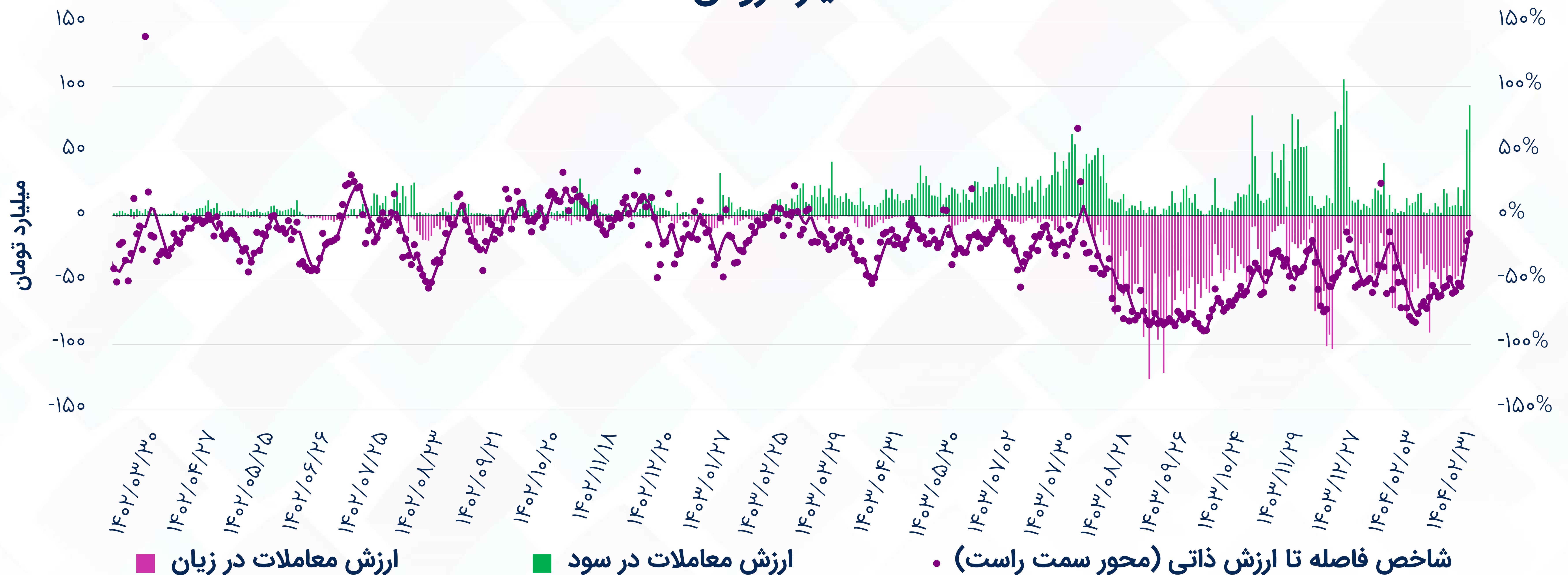
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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
اهرم	۵۰	۲۸۴.۷	۷,۹۹۳.۷	۲۲۵.۴	۵۹.۳	(۴.۶%)
خودرو	۲۶	۵۶.۳	۱,۶۸۳.۳	۴۲.۰	۱۴.۴	(۱۷.۱%)
شستا	۳۵	۱۶.۶	۴۸۳.۴	۱۱.۷	۵.۰	(۱۶.۹%)
ذوب	۲۷	۱۴.۶	۱۶۷.۰	۵.۸	۸.۸	(۳۱.۷%)
وبملت	۲۷	۹.۲	۱۶۸.۰	۵.۷	۳.۵	(۲۷.۵%)
وبصادر	۱۶	۹.۲	۱۰۲.۴	۸.۱	۱.۱	(۲۲.۱%)
وتجارت	۱۴	۶.۷	۳۸.۰	۴.۵	۲.۲	(۲۴.۷%)

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	۲۵	۶۶,۷۴۸.۸	۳,۰۶۰,۳۱۰.۲	۵۹,۶۷۲.۱	۷,۰۷۶.۷	(۱۹.۴%)
خودرو	۵	۲۸,۳۷۸.۸	۵۱۸,۹۲۶.۸	۲۴,۱۱۸.۸	۴,۲۵۹.۹	۱.۹%
شستا	۶	۲,۴۴۹.۴	۱۷۵,۶۴۱.۰	۱,۲۸۴.۴	۱,۱۶۵.۰	(۴۵.۱%)
بیدار	۱	۱۰۰.۰	۳,۳۸۲.۰	۰.۰	۱۰۰.۰	(۹۹.۶%)
خسپا	۲	۵۷.۱	۴,۳۹۹.۱	۵۷.۱	۰.۰	۹۶.۳%
وبملت	۳	۴۶.۱	۱,۱۰۵.۷	۴۴.۴	۱.۷	(۳۰.۶%)
ذوب	۳	۴۴.۸	۷,۰۳۰.۱	۱۷.۷	۲۷.۱	(۸۲.۷%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۴,۱۱۲

خودرو ۴۷۰

شستا ۳۳۳

وبملت ۲۹

وتعاون ۱۹

شتاب ۱۴

وبصادر ۱۰

ذوب ۶.۳۸

خودران ۳.۳۳

بیدار ۳.۲۰

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۰,۳۸۵.۵

اهرم ۸,۲۰۴.۲

ذوب ۳,۵۱۳.۶

وبصادر ۲۶۹.۴

وبملت ۲۰۴.۲

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۱۱۷,۲۰۲.۰)

فملی (۴۵۵.۴)

وتعاون (۱۴۱.۵)

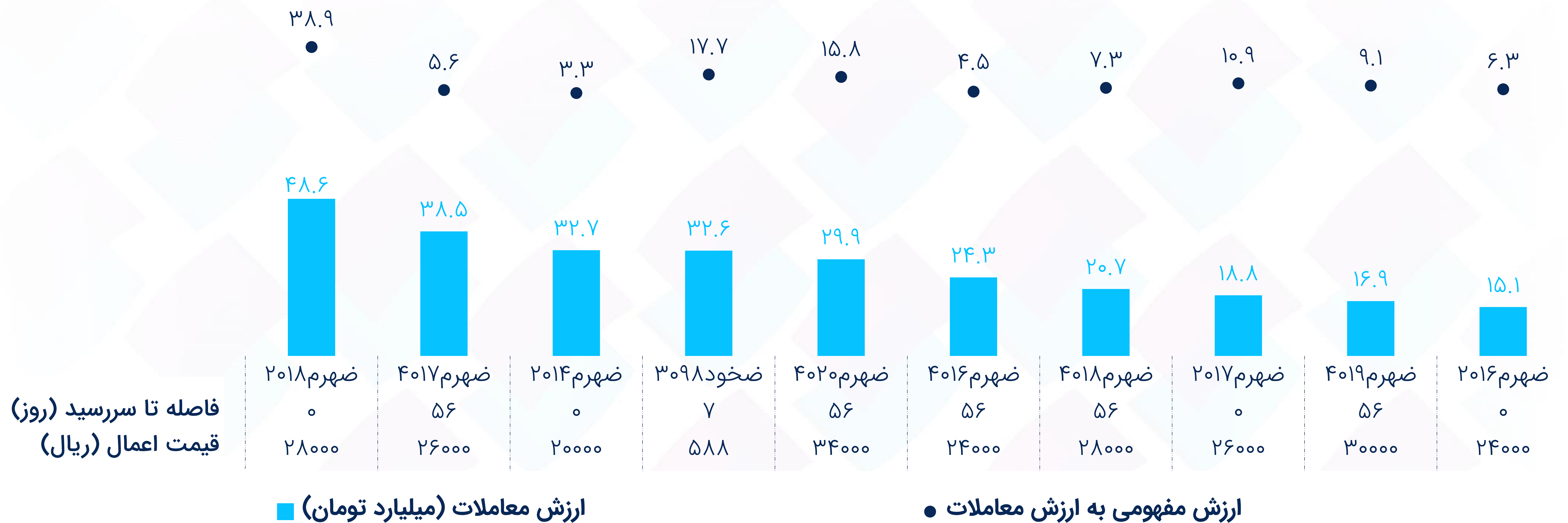
خودران (۹۱.۴)

اطلس (۳۹.۰)

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
ضفسوژ ۳۰۵	فسوژ	۴,۶۰۰	۱۱	۴.۲	۳۰۰	۵,۰۶۰	۴,۹۰۰	(۳.۲%)	۱۶.۳	۰.۹۷	۵۱۵	۷۲%
ضنارنج ۳۰۶	نارنج اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۱	۲۴۹.۵	۴,۰۳۱	۱۹,۸۹۴	۱۹,۰۳۱	(۴.۳%)	۴.۷	۱.۰۰	۵,۰۶۲	۲۶%
ضفسوژ ۳۰۰	فسوژ	۳,۶۰۰	۱۱	۲.۴	۱,۲۰۳	۵,۰۶۰	۴,۸۰۳	(۵.۱%)	۴.۰	۱.۰۰	۱,۵۰۰	۲۵%
ضهرم ۳۰۱۴	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲۸	۱۲.۴	۶,۲۱۰	۲۹,۰۸۰	۲۸,۲۱۰	(۳.۰%)	۴.۵	۱.۰۰	۷,۶۳۲	۲۳%
ضنارنج ۳۰۸	نارنج اهرم	۱۷,۰۰۰	۱۱	۳.۰	۲,۵۳۷	۱۹,۸۹۴	۱۹,۵۳۷	(۱.۸%)	۷.۷	۰.۹۹	۳,۰۸۸	۲۲%

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 ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۲۱	۱.۹	۳	۴۹۷	۱,۰۰۳	۱۰۲%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۲۱	۱.۶	۳	۴۹۷	۹۰۳	۸۲%	۳۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۱	۴۱.۴	۴	۶۶۲	۱,۰۰۴	۵۲%	۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۰	فولاد	۵,۰۴۰	۱۳	۷.۸	۷	۳,۷۳۳	۵,۰۴۷	۳۵%	۷۲۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۱۳	۲۰.۴	۳	۱,۶۴۴	۲,۲۰۳	۳۴%	۷۳۴.۳	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 ۳۰۸	وتعاون	۱,۷۰۰	۲۶	۱۰.۳	۱۸	۱,۶۷۱	۱,۶۸۲	۰.۷%	۹۳.۴	-۰.۴۶	۴۲	۱۳۱.۸%
طهرم ۳۰۲	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲۸	۷.۴	۷,۴۰۰	۲۹,۰۸۰	۳۰,۶۰۰	۵.۲%	۴.۱	-۰.۹۹	۷,۹۷۵	۷.۸%
طخود ۳۰۹	خودرو	۶۴۷	۷	۲۰,۱۲۴.۲	۴۴	۶۰۲	۶۰۳	۰.۲%	۱۳.۷	-۰.۷۷	۴۶	۴.۲%
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۲۶	۳۰.۵	۱۹۱	۱,۶۷۱	۱,۷۰۹	۲.۳%	۸.۹	-۰.۹۳	۱۹۰	(۰.۵%)
طخود ۳۱۰	خودرو	۷۰۰	۷	۳,۹۷۷.۱	۹۴	۶۰۲	۶۰۶	۰.۷%	۶.۴	-۰.۹۶	۹۳	(۱.۱%)

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
طصاد ۳۰۵	وبصادر	۴۰۰	۲۱	۰.۱	۱	۶۶۲	۳۹۹	(۳۹.۷%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵	وبصادر	۵۰۰	۲۱	۲.۶	۲	۶۶۲	۴۹۸	(۲۴.۸%)	۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۳۰۳	ذوب	۴۰۰	۲۱	۲۷.۱	۲	۴۹۷	۳۹۸	(۱۹.۹%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۱%)
طستا ۳۰۲	شستا	۱,۴۰۰	۱۳	۸.۳	۳	۱,۶۴۴	۱,۳۹۷	(۱۵.۰%)	۴۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۹۸.۵%)
طهرم ۳۰۱	اهرم	۲۴,۰۰۰	۲۸	۵.۸	۹۳	۲۹,۰۸۰	۲۳,۹۰۷	(۱۷.۸%)	۲۵۷.۱	-۰.۰۱	۱۲	(۸۷.۵%)

(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)

۳۰۱۸
۲۸
۳۰۰۰۰
۲,۰۴۲

۳۰۱۹
۲۸
۳۴۰۰۰
۱,۷۱۸

۳۰۹۹
۷
۶۴۷
۱,۳۰۵

۳۰۲۰
۲۸
۳۸۰۰۰
۱,۱۶۰

۳۰۱۷
۲۸
۲۸۰۰۰
۹۸۹

۳۰۲۱
۲۸
۴۲۰۰۰
۹۵۸

۳۰۹۸
۷
۵۸۸
۷۲۲

۴۰۲۰
۵۶
۳۴۰۰۰
۶۷۹

۳۰۱۶
۲۸
۲۶۰۰۰
۶۴۱

۳۱۰۱
۷
۸۰۰
۵۹۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

۴۰۲۰
۵۶
۳۴۰۰۰
۱۷۳,۵۲۶

۴۰۱۷
۵۶
۲۶۰۰۰
۱۱۸,۰۱۴

۴۰۱۸
۵۶
۲۸۰۰۰
۱۰۳,۰۱۵

۴۰۲۱
۵۶
۳۸۰۰۰
۹۳,۴۲۷

۳۰۹۹
۷
۶۴۷
۹۲,۰۴۲

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

۳۱۰۰
۷
۷۰۰
(۱۱۶,۰۹۴.۰)

۳۰۲۱
۲۸
۴۲۰۰۰
(۵۹,۶۶۹.۴)

۳۰۳۴
۱۳
۱۹۰۰
(۳۶,۱۲۷.۴)

۳۰۱۹
۲۸
۳۴۰۰۰
(۲۸,۹۰۶.۸)

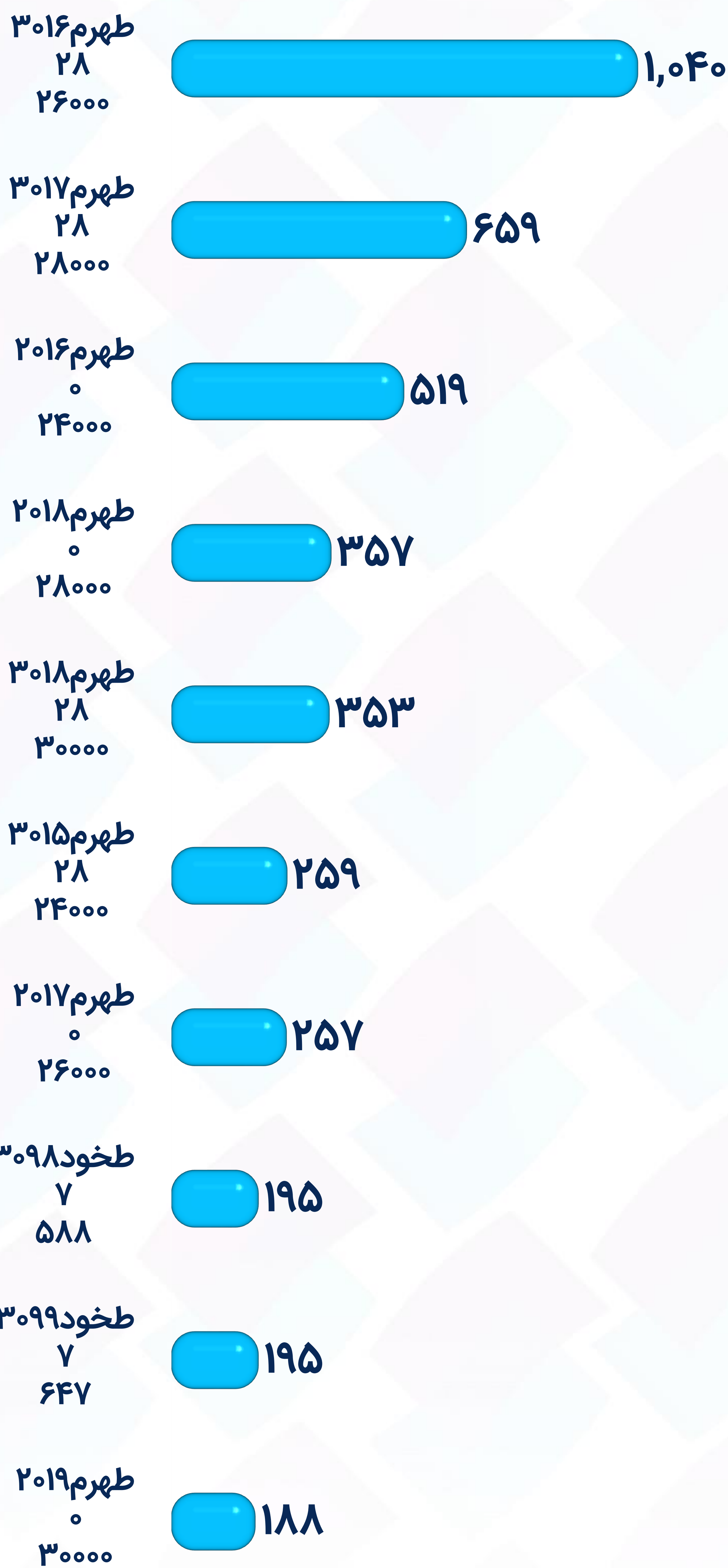
۳۰۱۸
۲۸
۳۰۰۰۰
(۲۳,۳۴۳.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

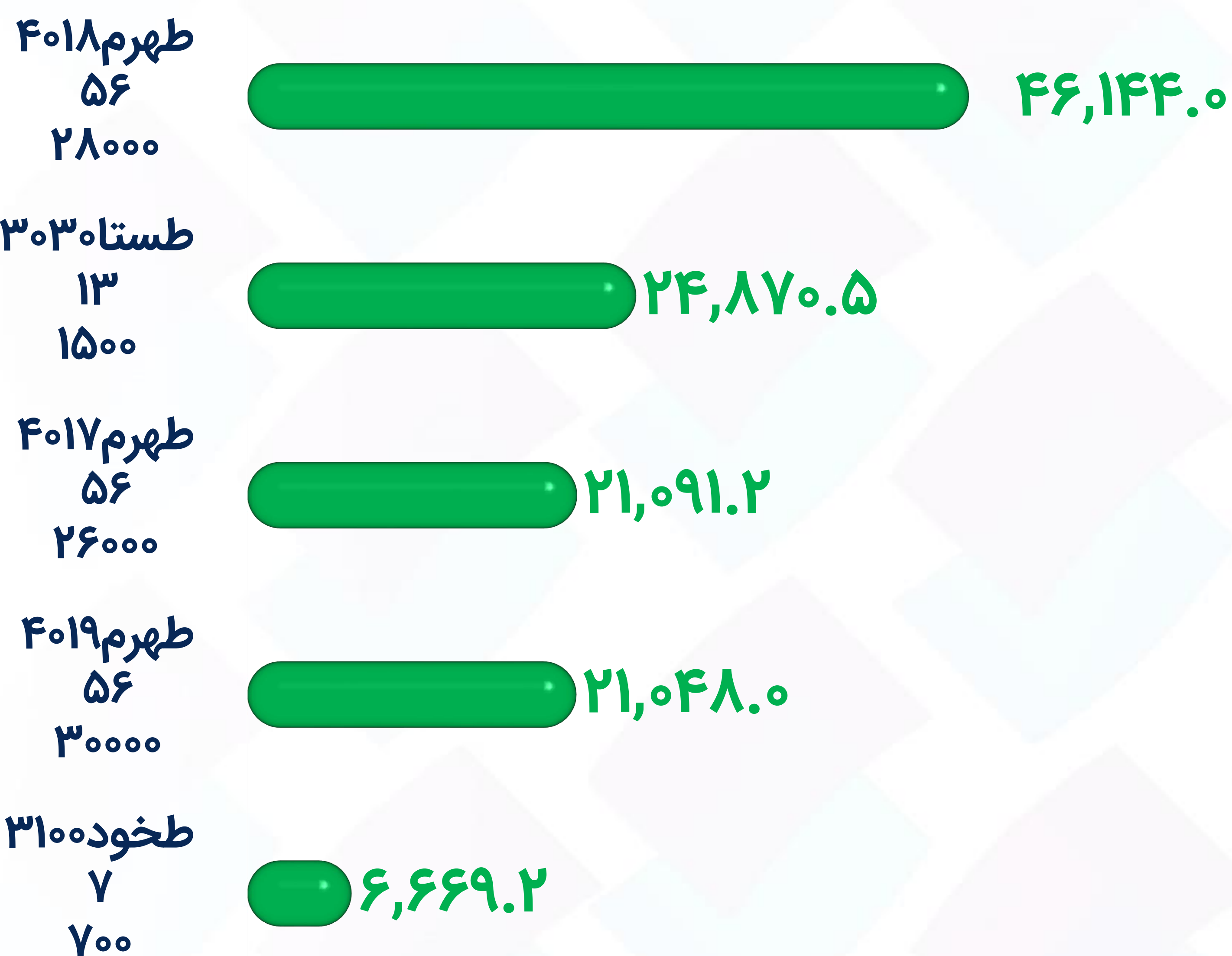
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

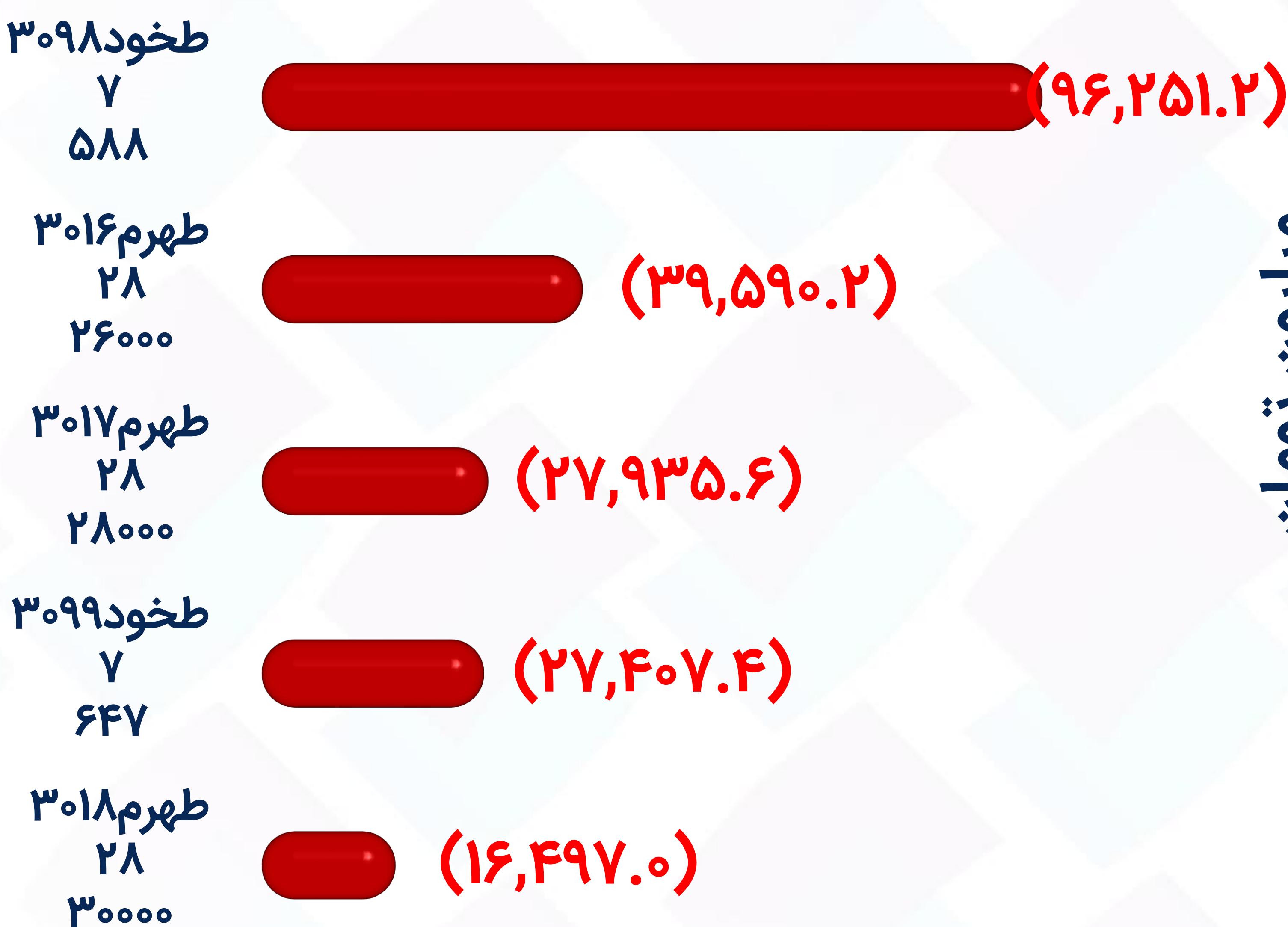
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.