

شماره
۴۶۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





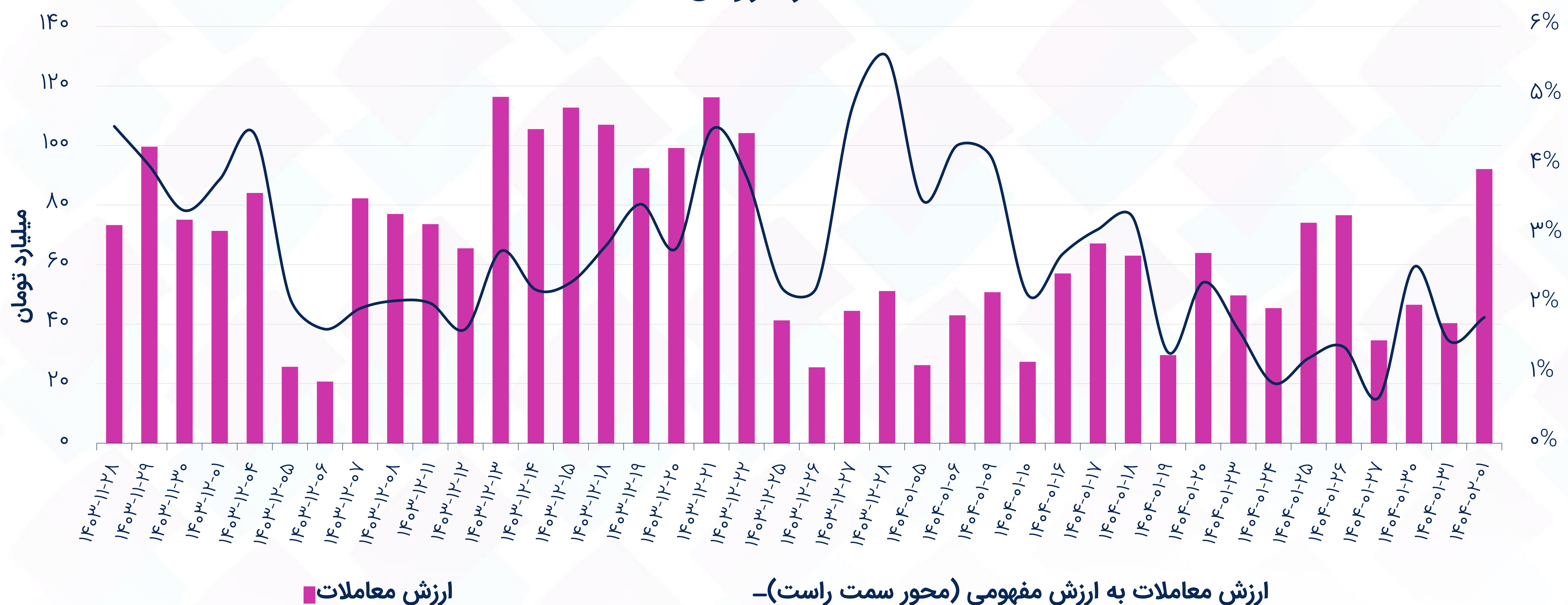
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



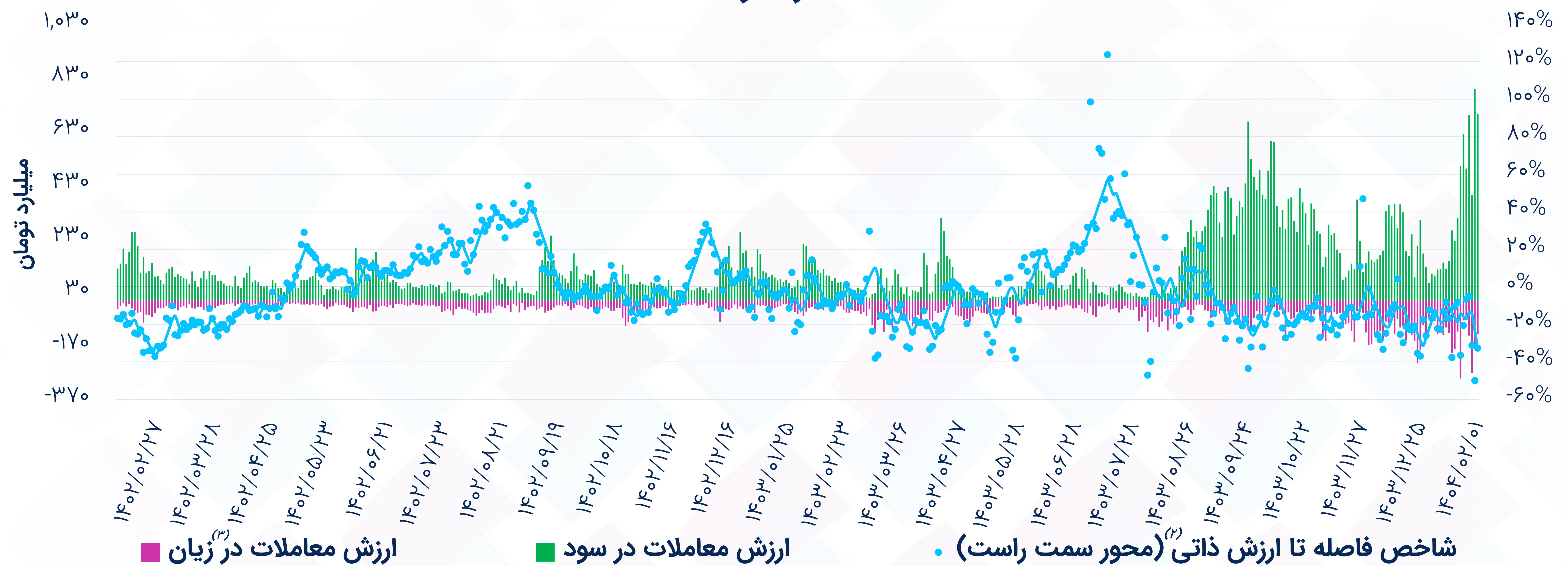
اختیار فروش



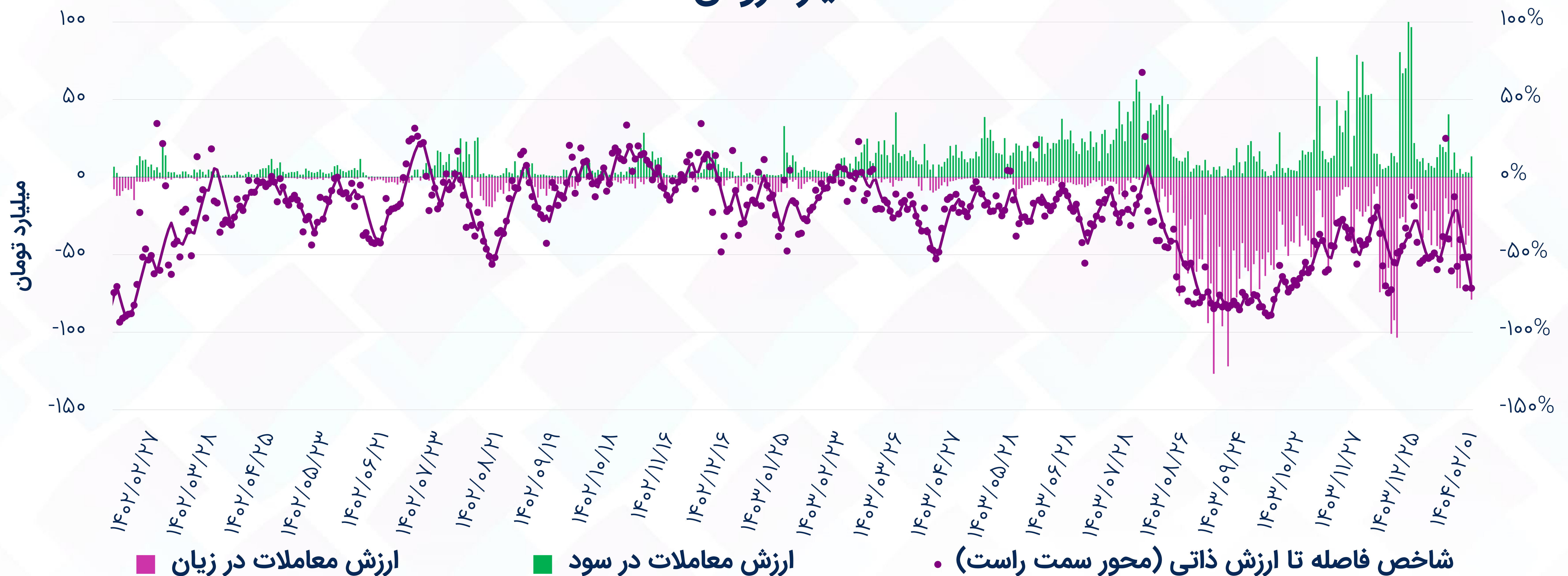
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

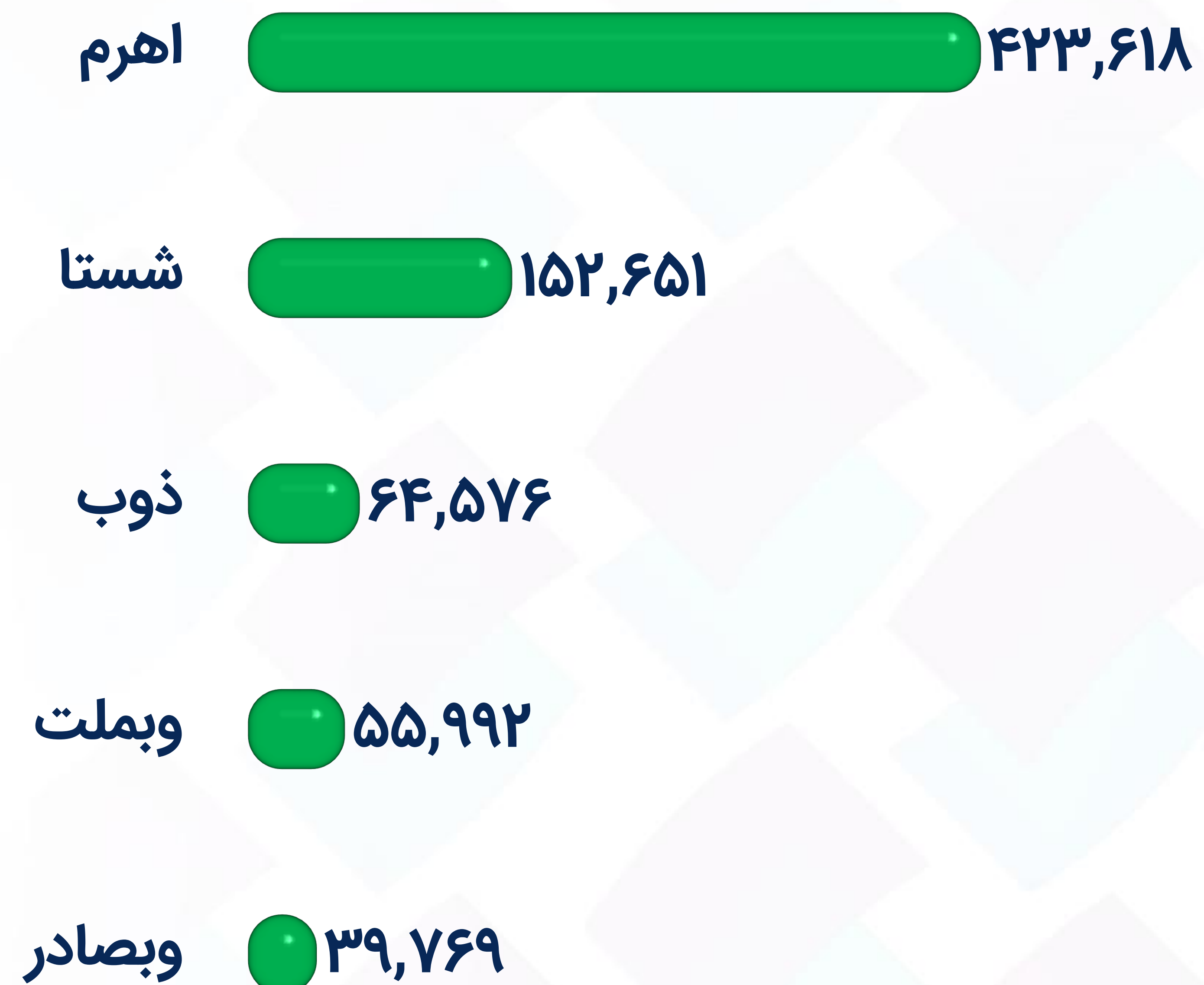
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۷	۴۷۵.۵	۲,۷۷۴.۹	۳۹۴.۱	۸۱.۴	(۳۸.۷%)
شستا	۵۸	۱۵۰.۴	۱,۷۲۳.۱	۱۲۱.۵	۲۸.۸	(۲۶.۶%)
ذوب	۲۷	۵۰.۲	۲۸۷.۷	۴۵.۰	۵.۱	(۲۸.۶%)
وبملت	۲۱	۴۲.۹	۲۲۱.۴	۴۲.۸	۰.۱	(۱۲.۲%)
وبصادر	۱۶	۳۴.۹	۹۱.۵	۳۰.۶	۴.۳	(۳۷.۳%)
وتجارت	۲۱	۲۸.۷	۱۳۰.۰	۲۶.۴	۲.۴	(۲۳.۴%)
خگستر	۱۴	۱۰.۵	۵۵.۱	۱۰.۵	۰.۰	(۱۸.۸%)

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	۱۴	۷۹,۸۰۷.۴	۴,۲۰۶,۹۸۶.۶	۷,۳۳۷.۸	۷۲,۴۶۹.۶	(۷۲.۲%)
شستا	۱۰	۱۱,۷۰۴.۵	۸۴۲,۳۲۷.۴	۵,۸۵۰.۶	۵,۸۵۳.۹	(۶۷.۴%)
وبملت	۴	۲۸۶.۱	۱۴,۱۳۷.۸	۰.۰	۲۸۶.۱	(۸۵.۲%)
ذوب	۲	۲۲۶.۸	۱۵,۰۲۴.۳	۰.۰	۲۲۶.۸	(۷۸.۳%)
وتعاون	۲	۲۱.۳	۵۶۲.۶	۲۰.۸	۰.۴	(۱۳.۱%)
بساما	۱	۱۹.۹	۱,۴۷۴.۶	۱۹.۹	۰.۰	(۳۴.۰%)
شتاب	۱	۱۰.۰	۳,۳۴۲.۰	۰.۰	۱۰.۰	(۸۴.۲%)

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

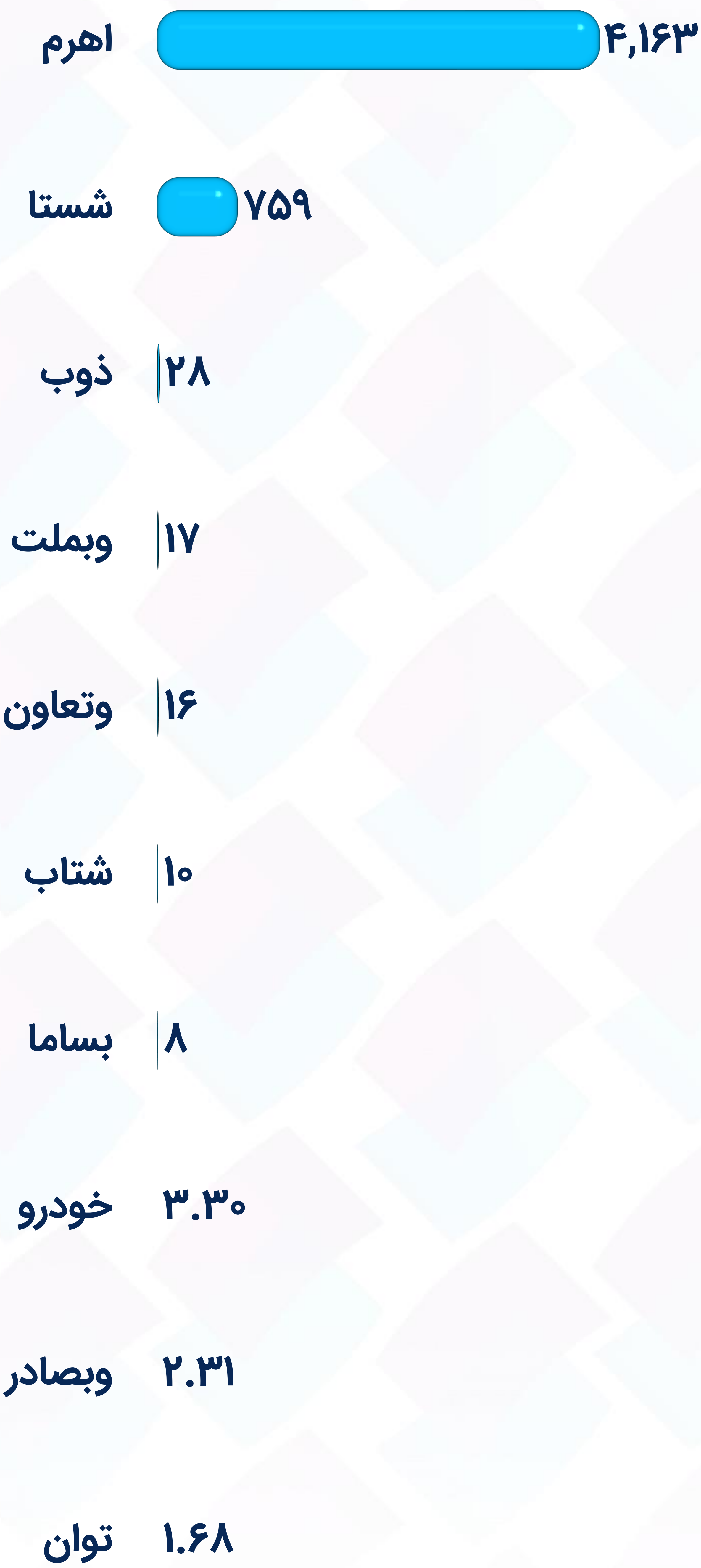


میلیارد تومان

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

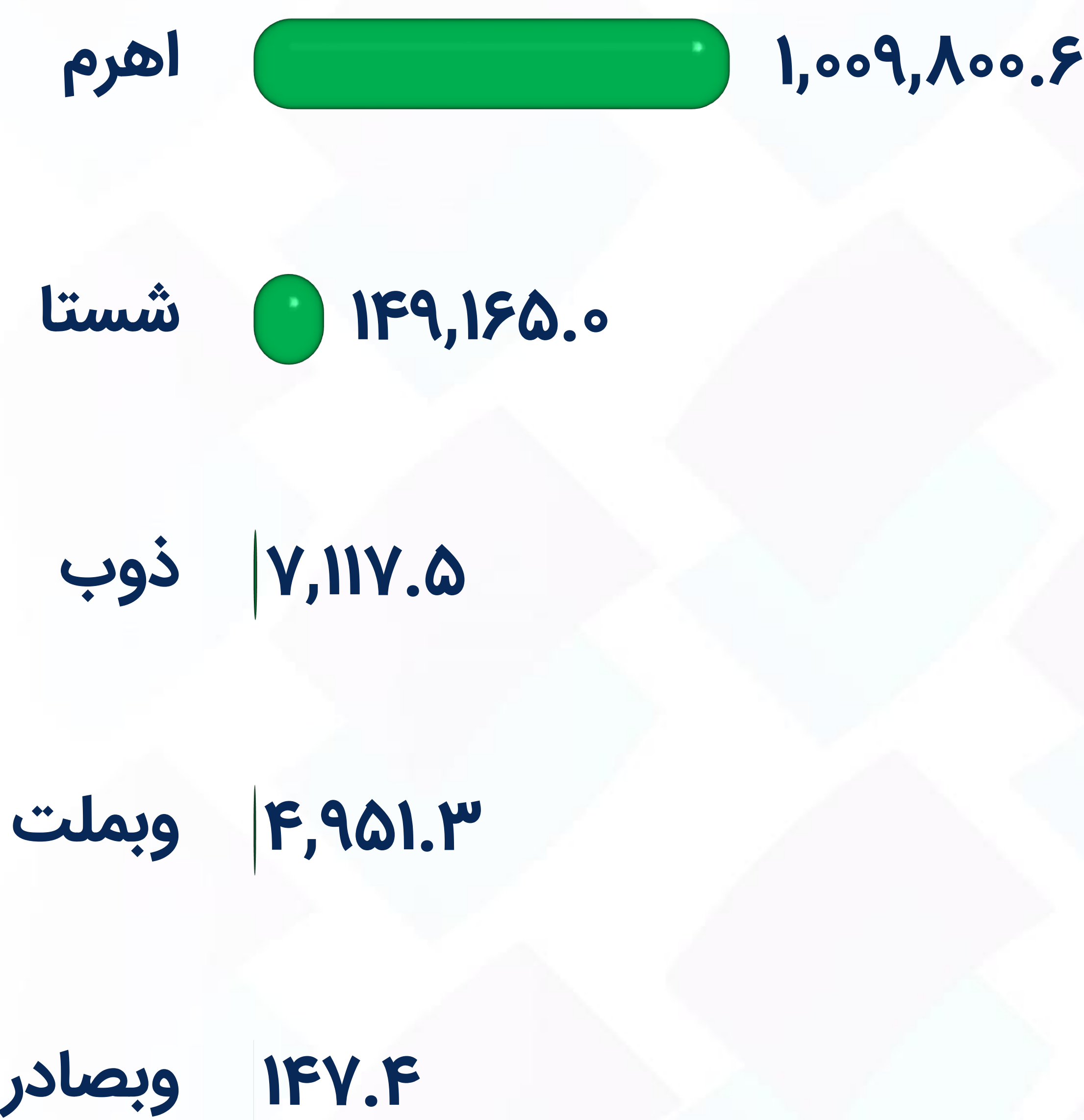
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

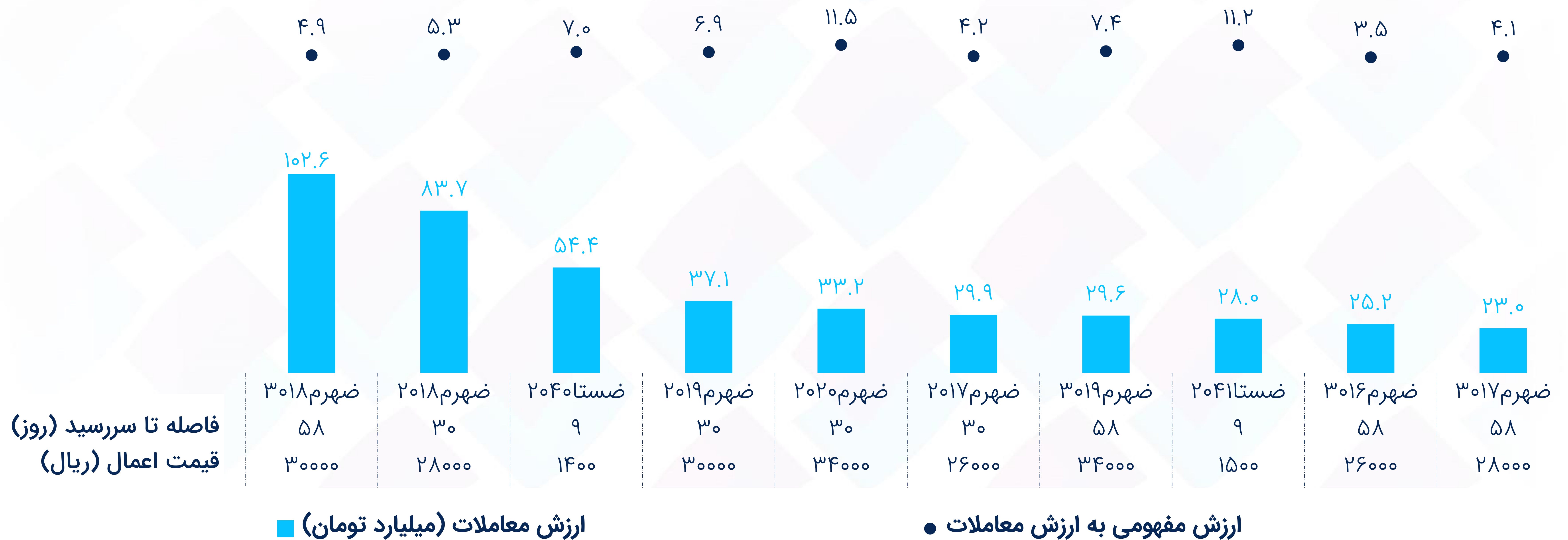
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



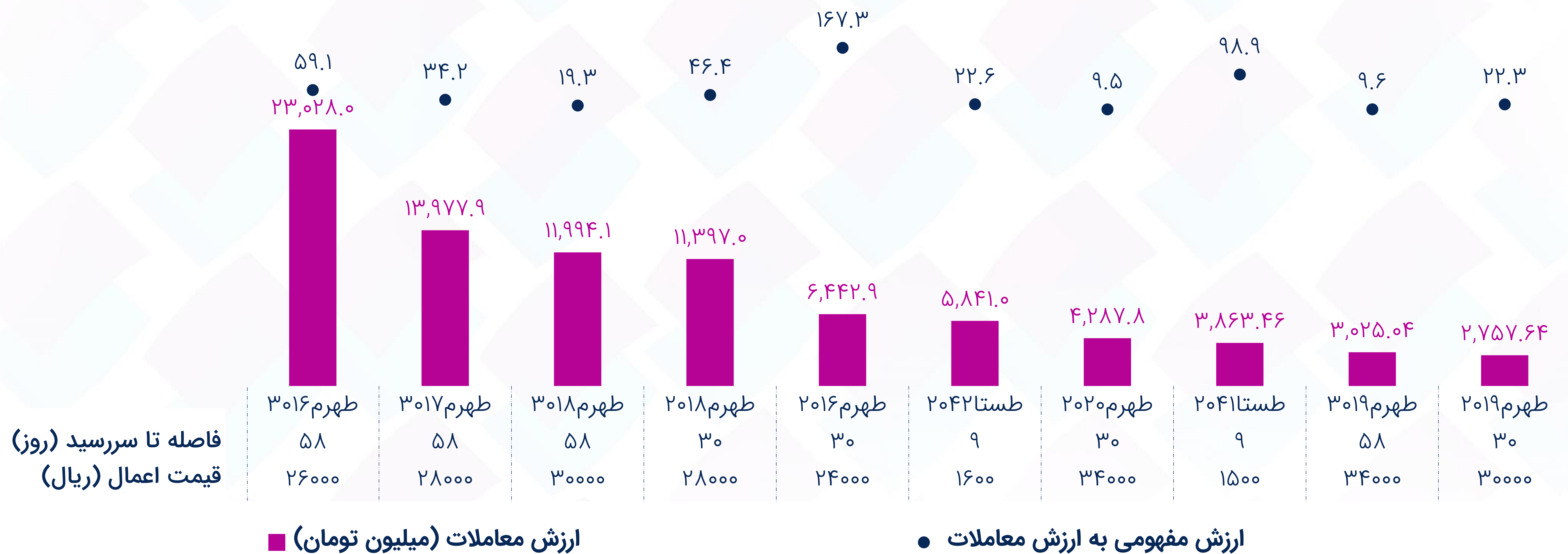
میلیون تومان

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
ضبساما ۲۲۳	بساما	۸,۹۱۱	۶	۶.۷	۸۰	۸,۹۱۰	۸,۹۹۱	۰.۹%	۱۱۲.۴	۰.۶۰	۱۴۰	۷۵%
ضرویین ۲۰۵	رویین	۱۱,۰۰۰	۲۷	۲۷.۱	۱,۸۴۳	۱۳,۶۶۳	۱۲,۸۴۳	(۶.۰%)	۷.۰	۱.۰۰	۲,۹۶۴	۶۱%
ضپاد۲۱ ۴۰	پادا	۱۷۰,۰۰۰	۶۹	۳۱۶.۸	۵۷,۹۹۹	۲۳۶,۶۴۴	۲۲۷,۹۹۹	(۳.۷%)	۳.۹	۱.۰۰	۷۷,۳۵۷	۳۳%
ضپاد۳۱ ۴۰	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۶۹	۶۸.۱	۵۳,۱۱۰	۲۳۶,۶۴۴	۲۳۳,۱۱۰	(۱.۵%)	۴.۴	۱.۰۰	۶۷,۹۸۸	۲۸%
ضشنا ۲۰۴۹	شنا	۳,۱۶۹	۱۶	۳۸.۱	۵۹۶	۳,۸۰۹	۳,۷۶۵	(۱.۲%)	۶.۳	۱.۰۰	۶۹۷	۱۷%

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
ضشنا ۲۰۵۶	شنا	۵,۶۳۴	۱۶	۳.۸	۳۵	۳,۸۰۹	۵,۶۶۹	۴۹%	۱۶۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۲۳	۴۹.۲	۶	۵۱۸	۸۰۶	۵۶%	۱۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۵۱	۳۰۶.۶	۵۳	۶۵۶	۱,۰۵۳	۶۱%	۱۹.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضشنا ۲۰۵۵	شنا	۵,۲۸۲	۱۶	۱.۵	۳	۳,۸۰۹	۵,۲۸۵	۳۹%	۱,۷۶۱.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۲۰۴۵	شستا	۱,۹۰۰	۹	۱۶۶.۵	۵	۱,۵۸۳	۱,۹۰۵	۲۰%	۳۸۱.۰	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
طستا ۲۰۴۴	شستا	۱,۸۰۰	۹	۹.۶	۱۶۰	۱,۵۸۳	۱,۶۴۰	۳.۶%	۱۰.۳	-۰.۹۹	۱۹۷	۲۳.۴%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۸	۲۴.۹	۹,۲۳۴	۳۱,۱۲۰	۳۲,۷۶۶	۵.۳%	۳.۵	-۰.۹۵	۸,۷۰۶	(۵.۷%)
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۵۶	۲۰.۸	۷۲	۱,۸۳۸	۱,۸۲۸	(۰.۵%)	۲۵.۴	-۰.۴۱	۶۳	(۱۲.۲%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۰	۴,۲۸۷.۸	۳,۲۷۳	۳۱,۱۲۰	۳۰,۷۲۷	(۱.۳%)	۹.۴	-۰.۶۸	۲,۴۷۷	(۲۴.۳%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۵۸	۳,۰۲۵.۰	۳,۲۴۷	۳۱,۱۲۰	۳۰,۷۵۳	(۱.۲%)	۹.۵	-۰.۵۶	۲,۳۷۶	(۲۶.۸%)

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
طستا ۲۰۳۸	شستا	۱,۲۰۰	۹	۷.۴	۱	۱,۵۸۳	۱,۱۹۹	(۲۴.۳%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۵۱	۰.۰	۲	۶۵۶	۳۹۸	(۳۹.۳%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۳۰	۸۴.۷	۷۳	۳۱,۱۲۰	۱۹,۹۲۷	(۳۶.۰%)	۲۷۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۵۰	وبملت	۱,۹۰۷	۵۱	۵.۸	۲۲	۲,۹۶۷	۱,۸۸۵	(۳۶.۵%)	۸۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۹	۶۱.۹	۳	۱,۵۸۳	۱,۲۹۷	(۱۸.۱%)	۴۳۲.۳	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

ارزش موقعیت‌های باز

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

ضهرم ۲۰۱۸
۳۰
۲۸۰۰۰ ۱,۰۷۷

ضهرم ۳۰۱۸
۵۸
۳۰۰۰۰ ۸۷۹

ضهرم ۲۰۲۰
۳۰
۳۴۰۰۰ ۷۲۲

ضهرم ۲۰۱۹
۳۰
۳۰۰۰۰ ۶۳۶

ضستا ۲۰۴۰
۹
۱۴۰۰ ۶۰۳

ضهرم ۳۰۱۹
۵۸
۳۴۰۰۰ ۵۱۳

ضهرم ۲۰۱۶
۳۰
۲۴۰۰۰ ۴۵۱

ضهرم ۲۰۱۷
۳۰
۲۶۰۰۰ ۴۲۸

ضستا ۲۰۴۱
۹
۱۵۰۰ ۴۲۵

ضستا ۲۰۴۲
۹
۱۶۰۰ ۳۷۰

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۲۰۲۲
۳۰
۴۲۰۰۰ ۱۰۰,۱۲۸

ضهرم ۲۰۲۱
۳۰
۳۸۰۰۰ ۸۲,۹۹۶

ضهرم ۲۰۲۰
۳۰
۳۴۰۰۰ ۸۲,۴۷۴

ضهرم ۲۰۱۹
۳۰
۳۰۰۰۰ ۷۶,۷۲۲

ضستا ۲۰۴۴
۹
۱۸۰۰ ۵۶,۷۶۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضستا ۲۰۴۰
۹
۱۴۰۰ (۴۹,۷۰۴.۸)

ضهرم ۲۰۱۸
۳۰
۲۸۰۰۰ (۳۷,۵۰۳.۲)

ضاساس ۲۰۵
۲۷
۴۰۰۰۰ (۲۱,۶۶۸.۰)

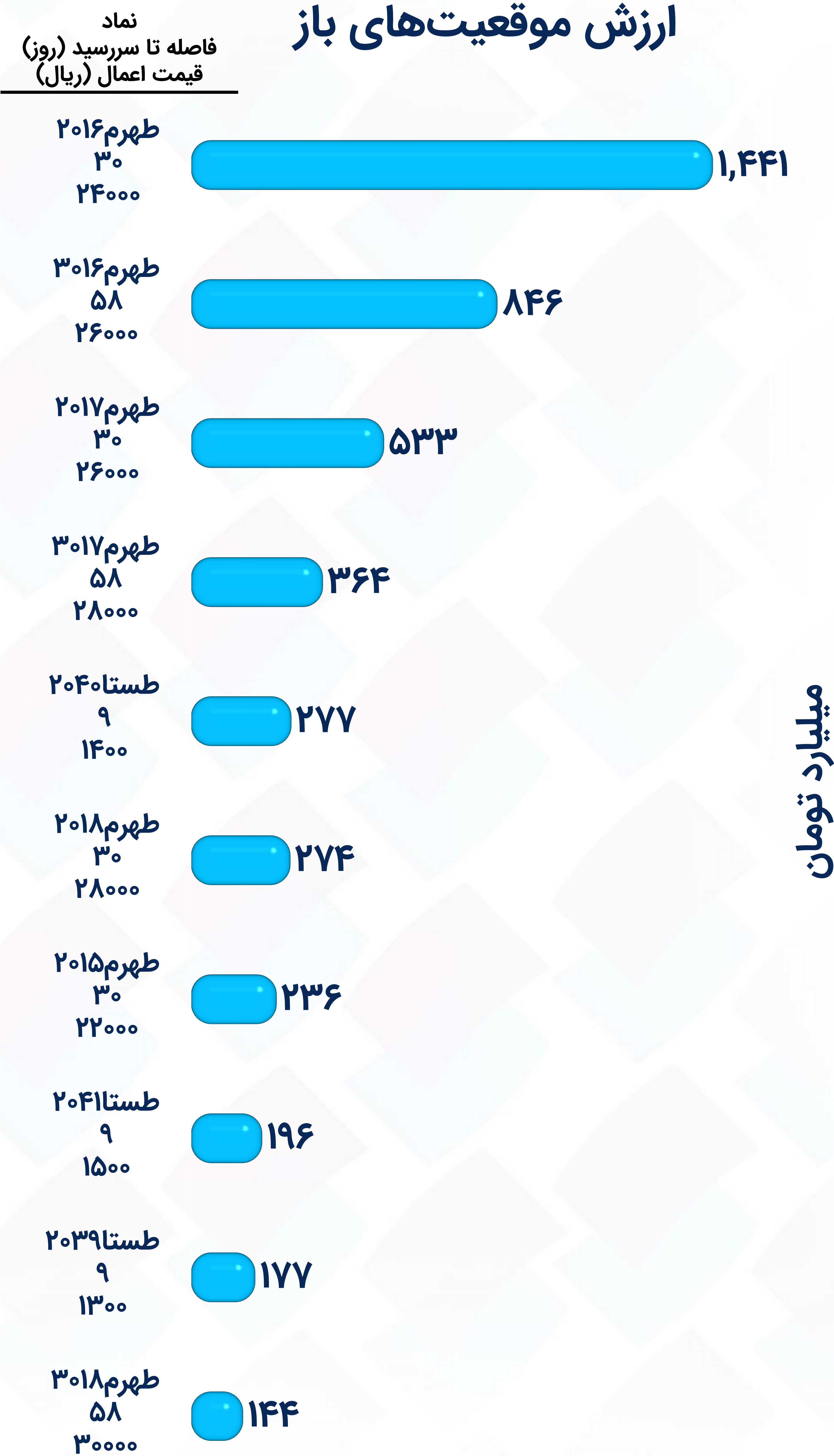
ضهرم ۲۰۱۶
۳۰
۲۴۰۰۰ (۱۱,۷۸۱.۶)

ضهرم ۲۰۱۷
۳۰
۲۶۰۰۰ (۸,۳۳۵.۶)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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.