

شماره
۴۶۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۶ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





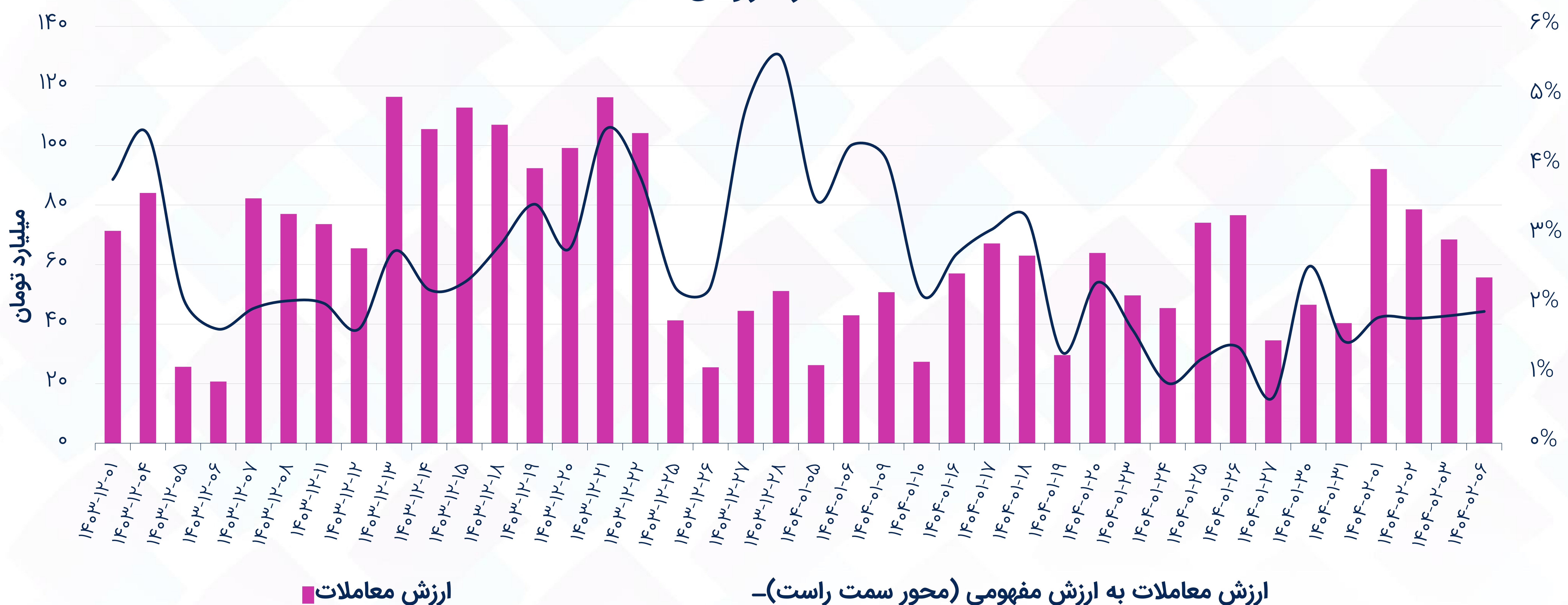
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



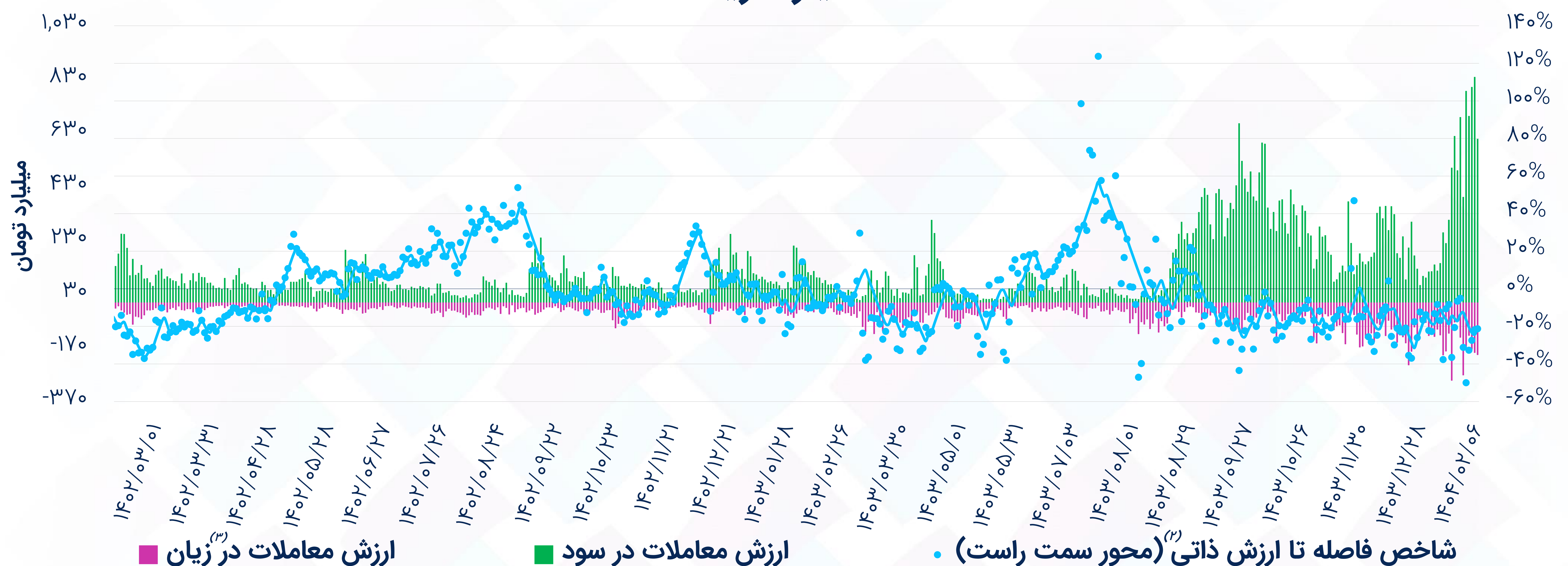
اختیار فروش



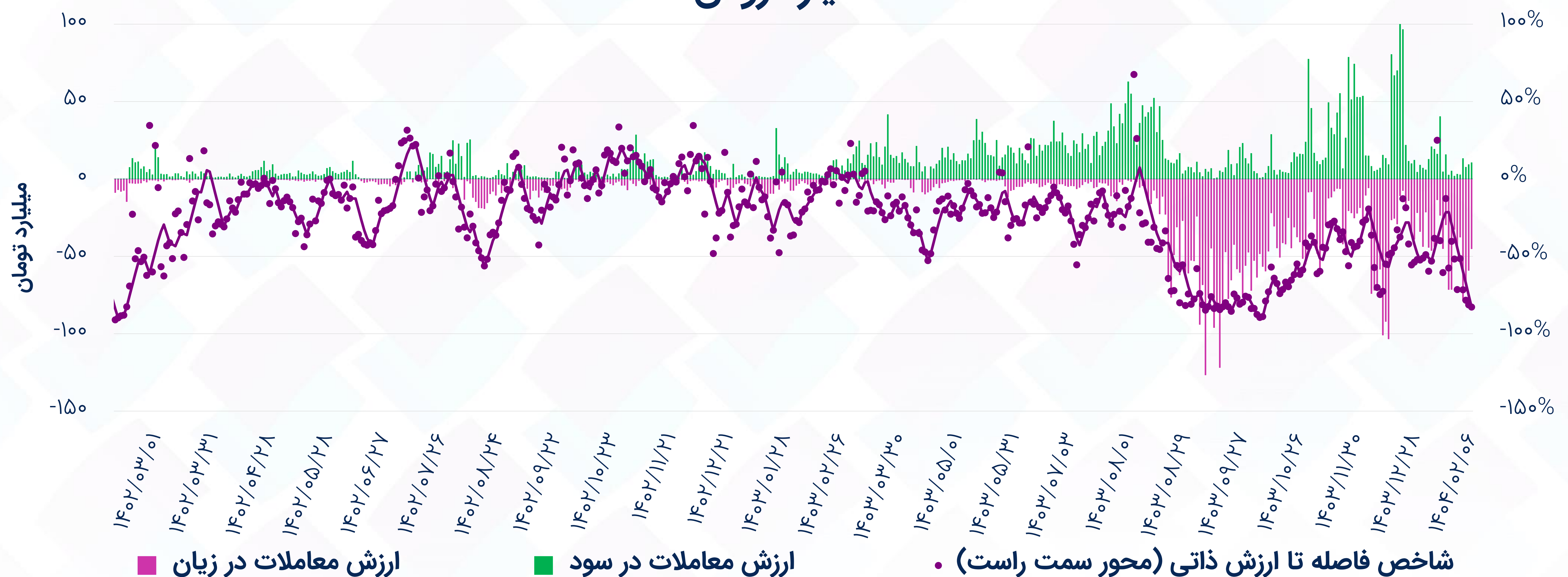
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

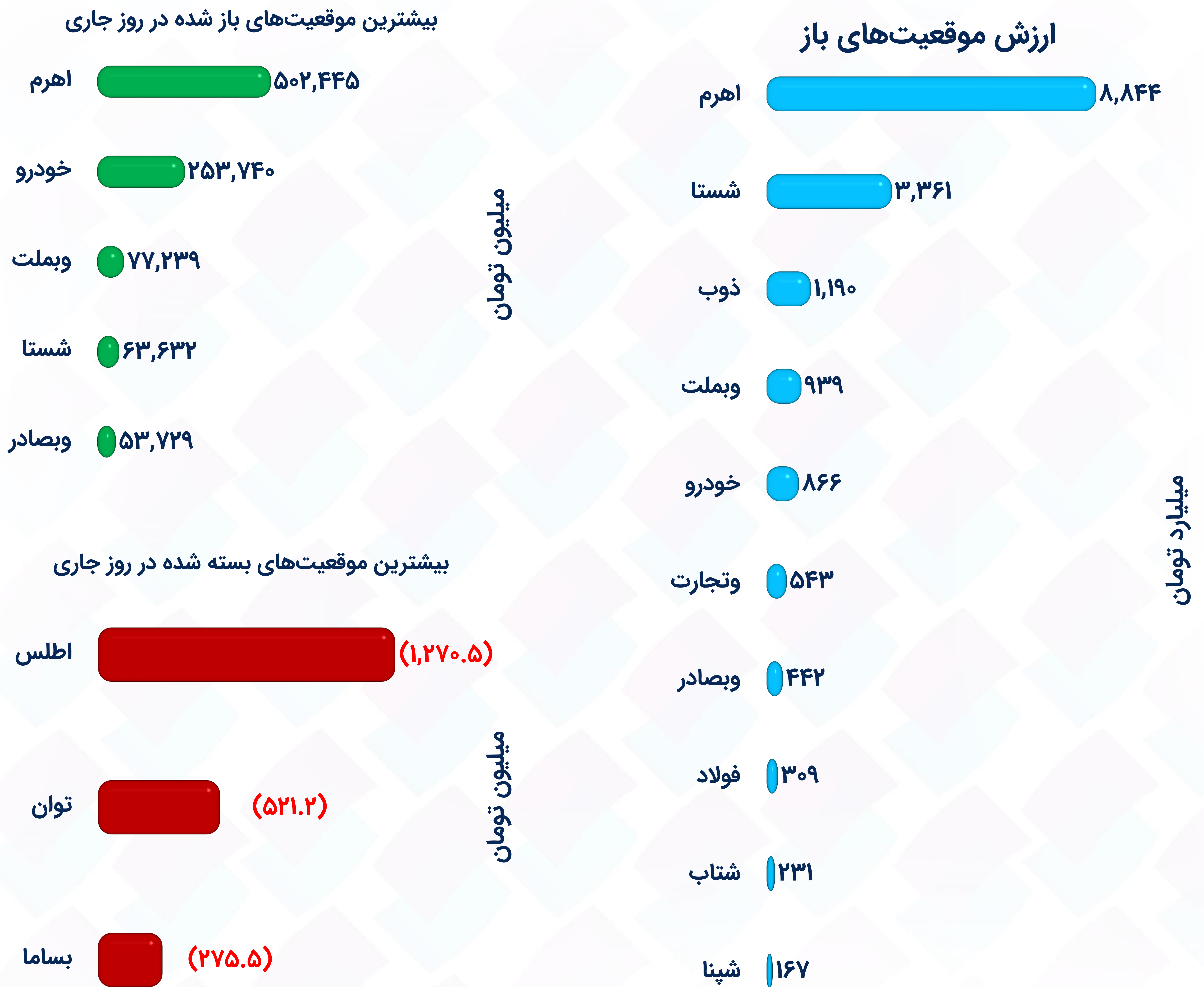
اختیار خرید

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	۴۸	۳۸۲.۷	۲,۶۵۱.۱	۲۶۵.۱	۱۱۷.۶	(۲۹.۳%)
خودرو	۱۳	۱۶۲.۵	۸۰۹.۲	۱۰۷.۸	۵۴.۷	(۲۳.۰%)
شستا	۵۳	۱۳۱.۸	۱,۵۹۹.۴	۱۲۶.۲	۵.۶	۵.۵%
ذوب	۳۱	۴۴.۱	۲۶۳.۶	۳۸.۴	۵.۸	(۱۵.۵%)
وبملت	۲۹	۳۱.۲	۱۷۳.۶	۲۶.۱	۵.۱	(۲۸.۷%)
وبصادر	۱۷	۲۲.۴	۱۰۴.۸	۲۱.۳	۱.۱	(۲۸.۴%)
وتجارت	۲۰	۱۲.۹	۱۰۲.۴	۱۰.۴	۲.۵	(۲۵.۸%)

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	۱۳	۴۰,۵۷۳.۴	۲,۱۹۰,۲۳۳.۹	۲,۶۲۳.۲	۳۷,۹۵۰.۱	(۸۶.۳%)
خودرو	۵	۸,۸۶۸.۲	۷۹,۲۶۲.۵	۷,۷۹۱.۷	۱,۰۷۶.۵	(۶۱.۱%)
شستا	۱۳	۵,۵۴۲.۳	۶۴۵,۴۹۶.۹	۵.۶	۵,۵۳۶.۷	(۹۳.۴%)
وبملت	۶	۴۵۱.۶	۱۲,۹۲۱.۰	۳.۵	۴۴۸.۱	(۷۴.۴%)
ذوب	۲	۱۳۰.۲	۵,۷۴۴.۷	۰.۰	۱۳۰.۲	(۸۹.۱%)
بساما	۲	۱۰۵.۱	۱,۷۷۱.۳	۱۰۴.۷	۰.۴	(۳۲.۳%)
وتعاون	۳	۱۱.۴	۱۷۹.۴	۱۱.۲	۰.۲	۱.۶%

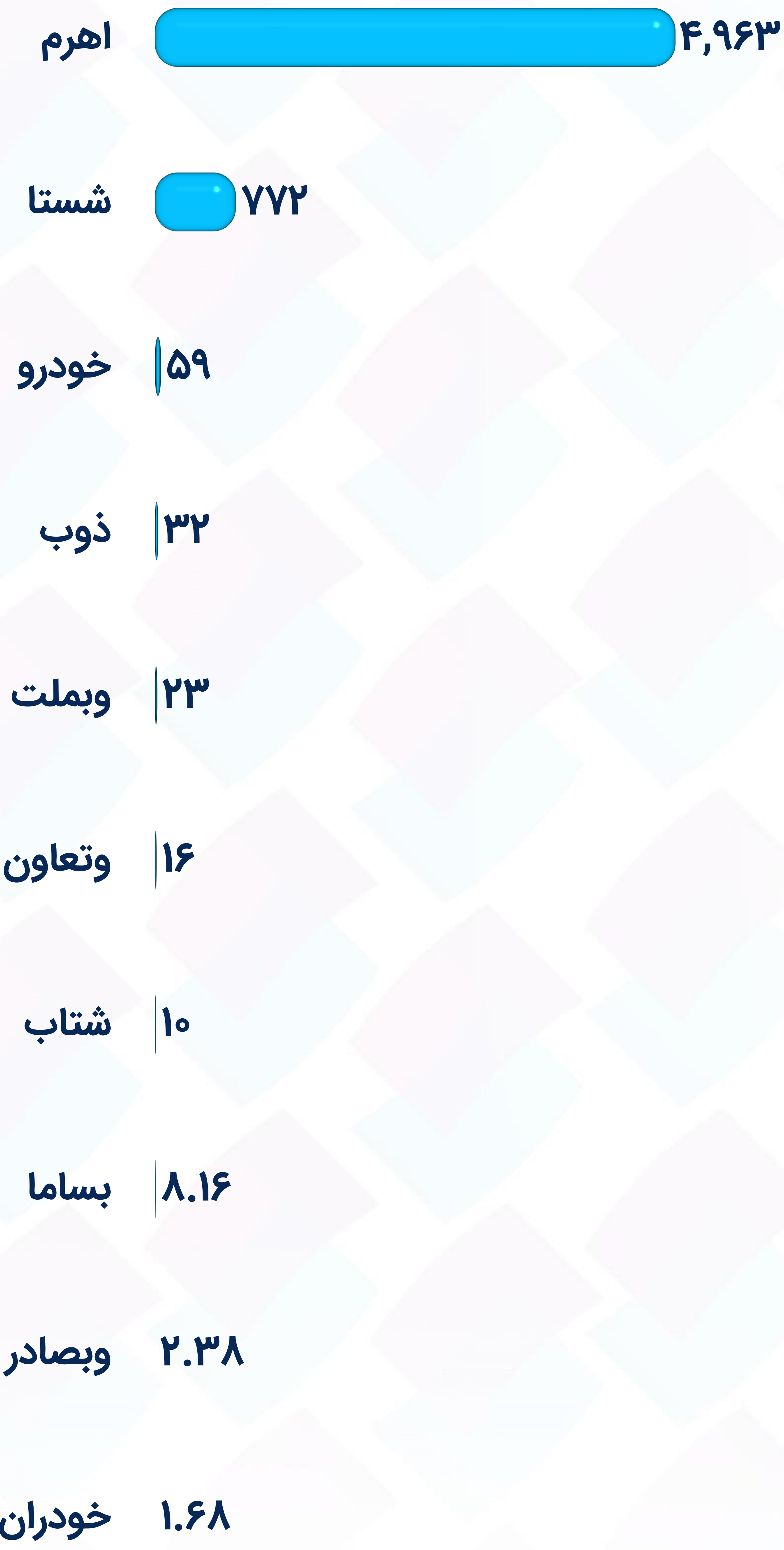
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

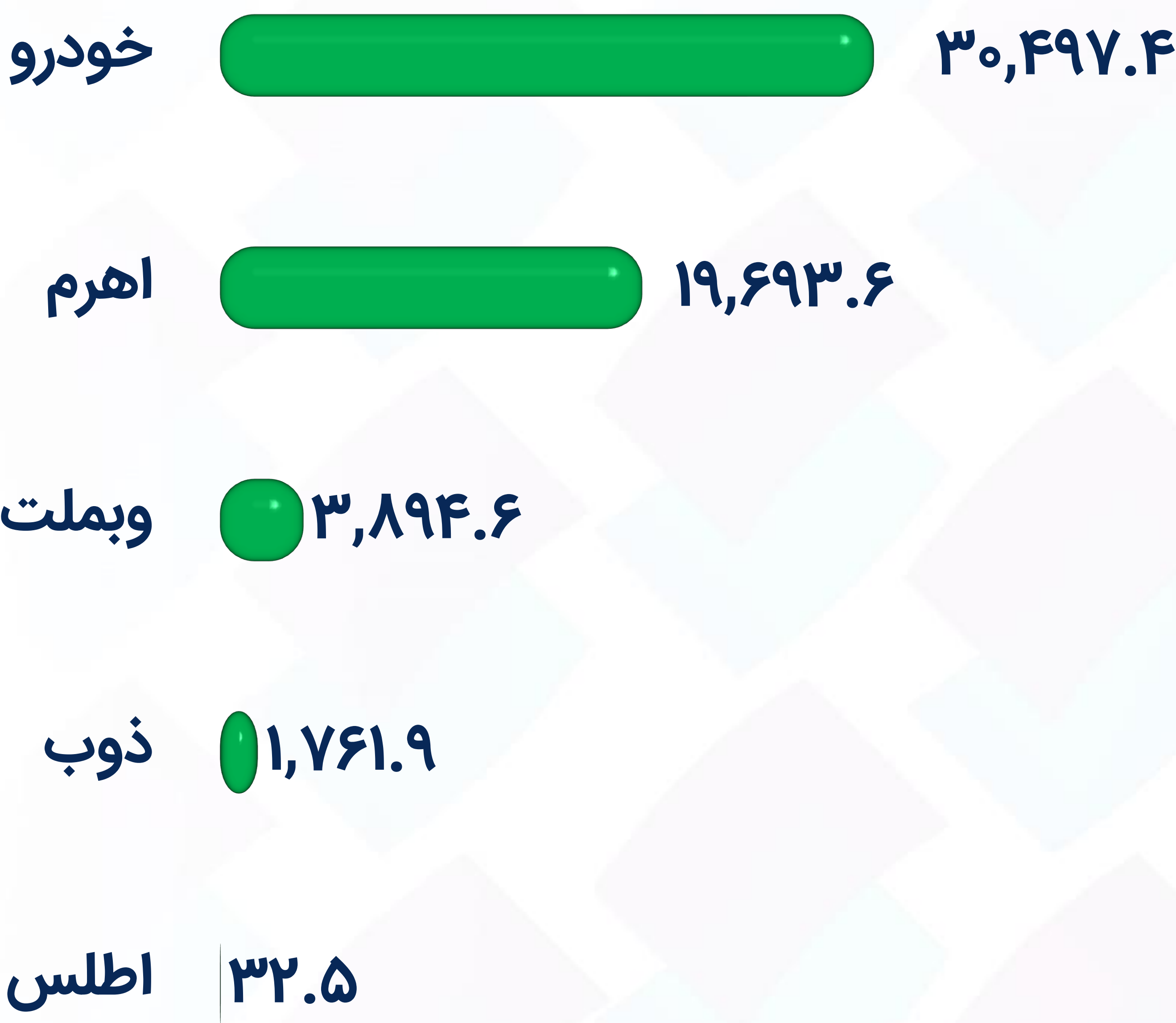
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



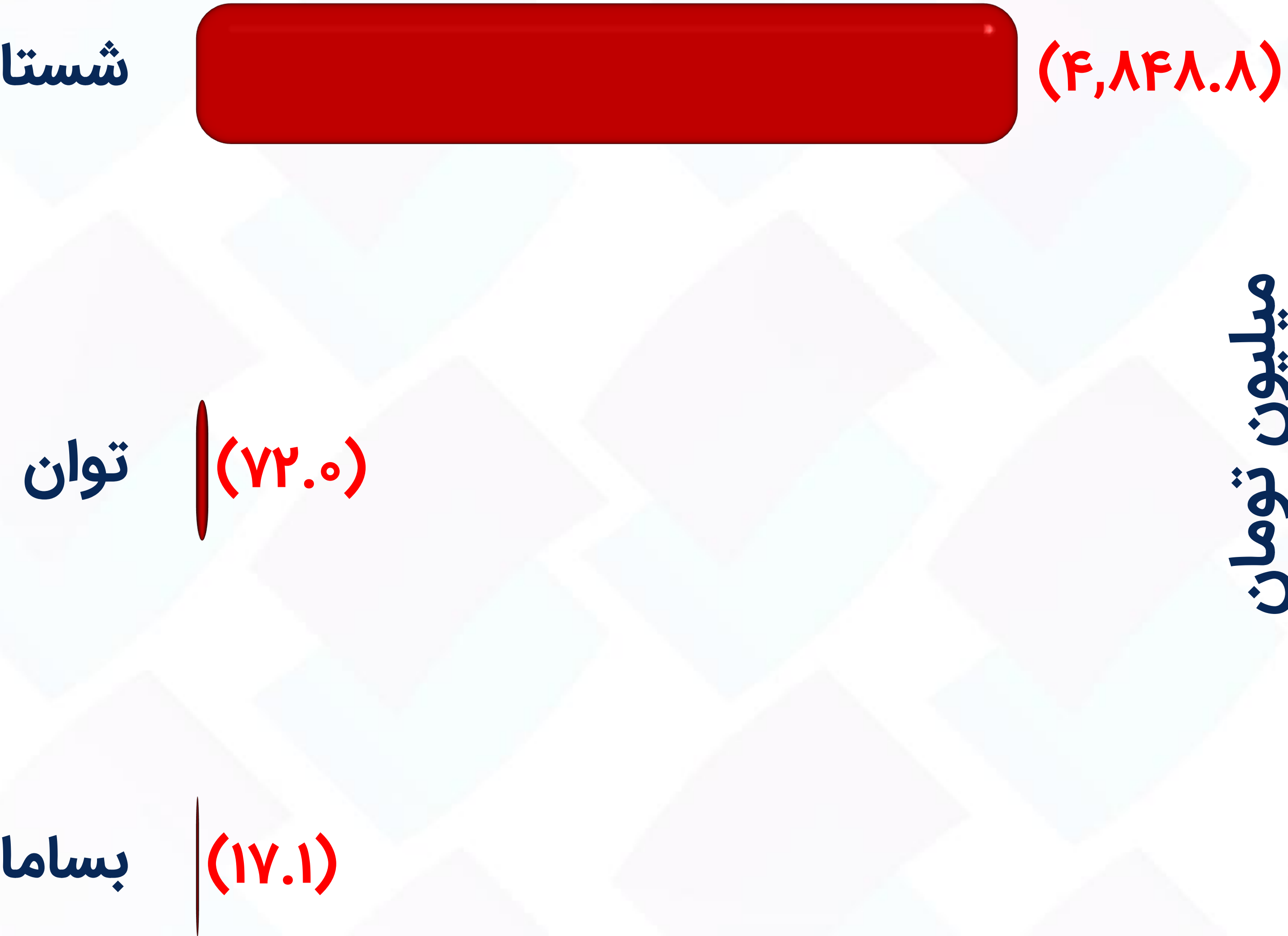
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

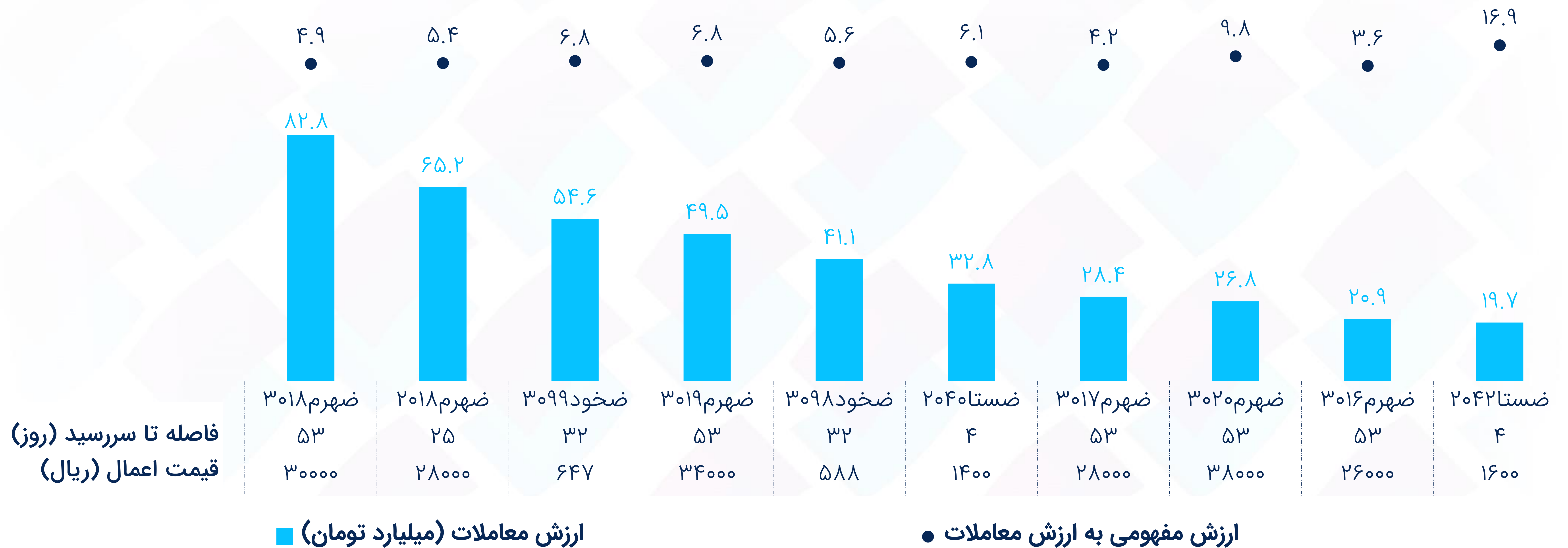
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



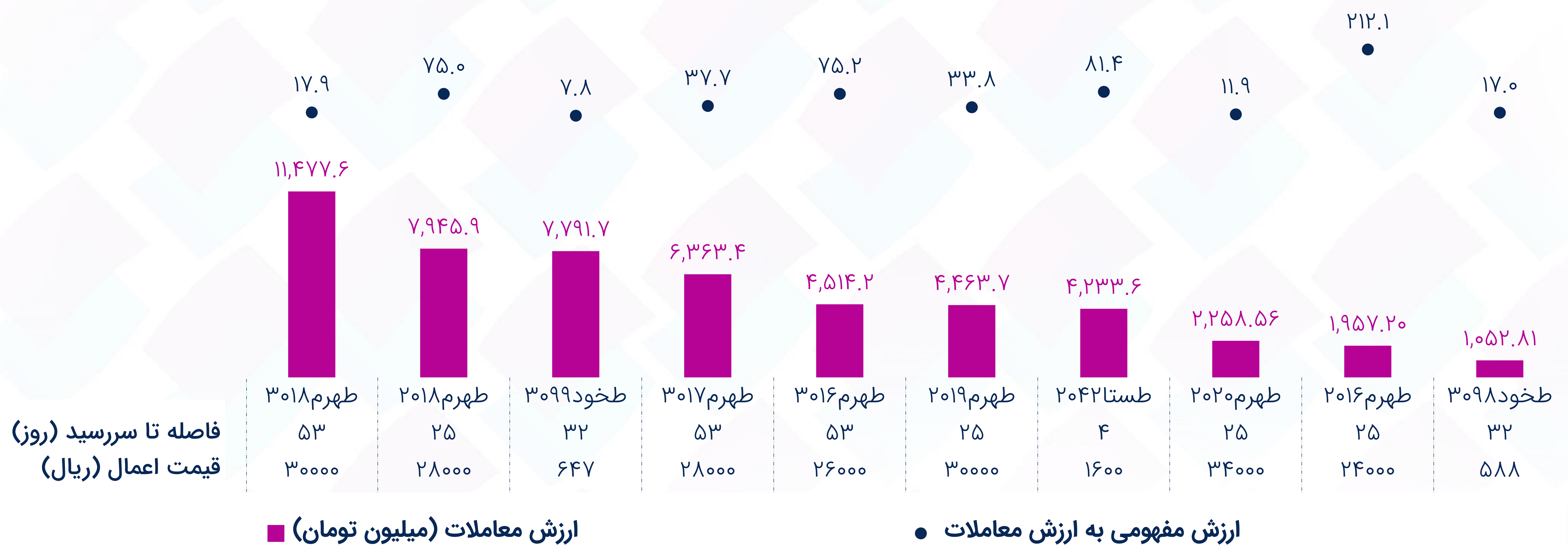
میلیون تومان

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
ضموج ۲۲۰	موج	۲۸,۰۰۰	۱۵	۷.۷	۴,۰۴۳	۳۲,۵۲۴	۳۲,۰۴۳	(۱.۵%)	۷.۹	۰.۹۷	۵,۰۰۹	۲۴%
ضهرم ۵۰۱۷	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۱۶	۱۳۲.۴	۱۱,۰۳۷	۳۳,۰۸۰	۳۳,۰۳۷	(۰.۱%)	۳.۰	۱.۰۰	۱۳,۳۷۱	۲۱%
ضستا ۲۰۴۱	شستا	۱,۵۰۰	۴	۱۹,۶۸۶.۱	۱۸۱	۱,۷۰۹	۱,۶۸۱	(۱.۶%)	۹.۳	۱.۰۰	۲۱۹	۲۱%
ضستا ۲۰۴۲	شستا	۱,۶۰۰	۴	۱۹,۶۸۸.۶	۱۰۱	۱,۷۰۹	۱,۷۰۱	(۰.۵%)	۱۶.۸	۰.۹۶	۱۲۱	۲۰%
ضسامان ۲۰۰	سامان	۱,۵۰۰	۱۵	۱۲.۹	۶۸۵	۲,۲۷۴	۲,۱۸۵	(۳.۹%)	۳.۲	۱.۰۰	۷۹۸	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
ضذوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۴۶	۳۰.۵	۲۰	۵۴۲	۱,۰۲۰	۸۸%	۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۸	۱۵.۳	۴	۵۴۲	۸۰۴	۴۸%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۴۶	۳۰.۲	۲۹	۵۴۲	۹۲۹	۷۱%	۳۲.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۳۸	۴۸.۹	۲۶	۴,۴۳۵	۶,۵۰۶	۴۷%	۲۵۰.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۴۶	۳۸.۵	۳۲	۵۴۲	۸۳۲	۵۴%	۲۶.۰	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	۵۱	۱۱.۲	۱۱۲	۱,۷۴۰	۱,۷۸۸	۲.۸%	۱۶.۰	-۰.۶۳	۱۱۵	۲.۳%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۳	۱۶.۱	۸,۹۶۶	۳۳,۰۸۰	۳۳,۰۳۴	(۰.۱%)	۳.۷	-۰.۹۰	۷,۰۴۹	(۲۱.۴%)
طملت ۳۰۵۵	وبملت	۲,۹۳۴	۴۶	۳.۵	۲۵۷	۲,۷۴۰	۲,۶۷۷	(۲.۳%)	۱۰.۴	-۰.۵۵	۱۶۷	(۳۵.۰%)
طاطلس ۳۰۶	اطلس	۶۵,۰۰۰	۲۹	۳.۹	۱,۵۶۴	۶۶,۳۵۷	۶۳,۴۳۶	(۴.۴%)	۴۰.۶	-۰.۲۴	۷۶۸	(۵۰.۹%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۵	۲,۲۵۸.۶	۲,۷۷۳	۳۳,۰۸۰	۳۱,۲۲۷	(۵.۶%)	۱۱.۳	-۰.۴۸	۱,۳۴۶	(۵۱.۵%)

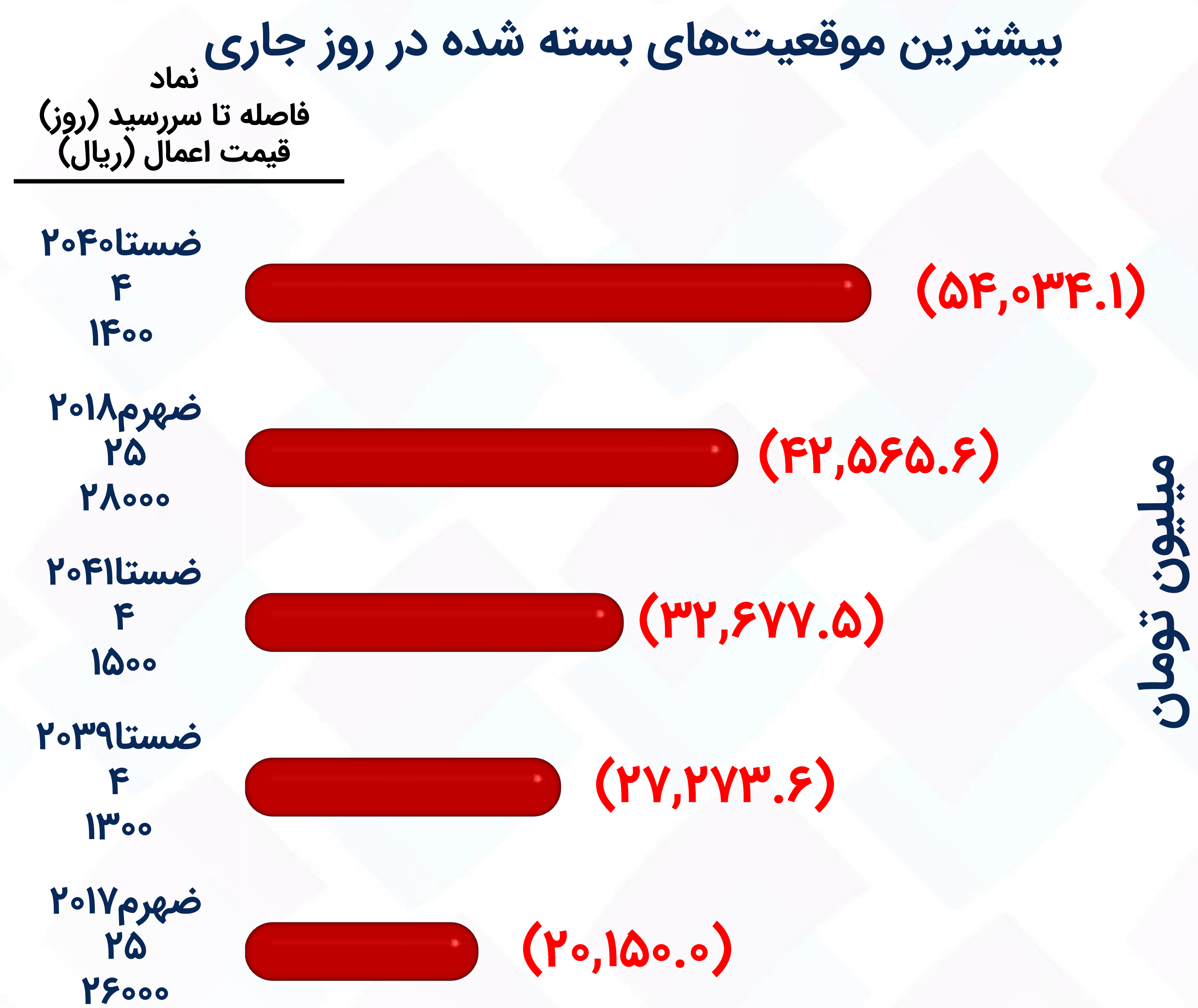
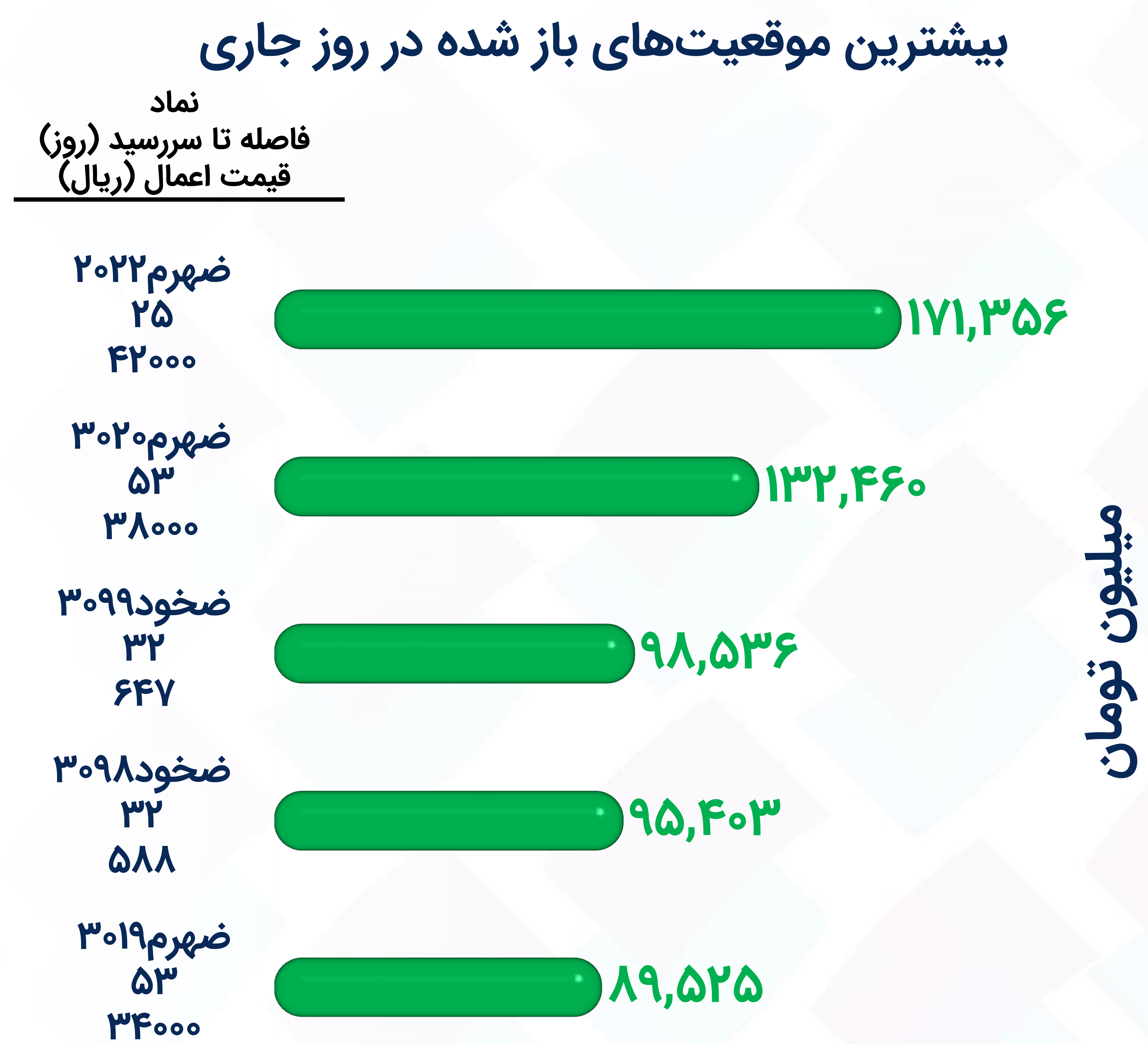
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۴	۲.۷	۱	۱,۷۰۹	۱,۱۹۹	(۲۹.۸%)	۱,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۲۰۳۹	شستا	۱,۳۰۰	۴	۳۰.۷	۱	۱,۷۰۹	۱,۲۹۹	(۲۴.۰%)	۱,۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۳۰۴۷	وبملت	۱,۵۲۶	۴۶	۰.۴	۴۶	۲,۷۴۰	۱,۴۸۰	(۴۶.۰%)	۳۲.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۳۲	۱.۹	۶	۶۴۵	۲۷۶	(۵۷.۲%)	۴۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۵	۴۳.۵	۶۳	۳۳,۰۸۰	۱۹,۹۳۷	(۳۹.۷%)	۳۱۶.۵	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

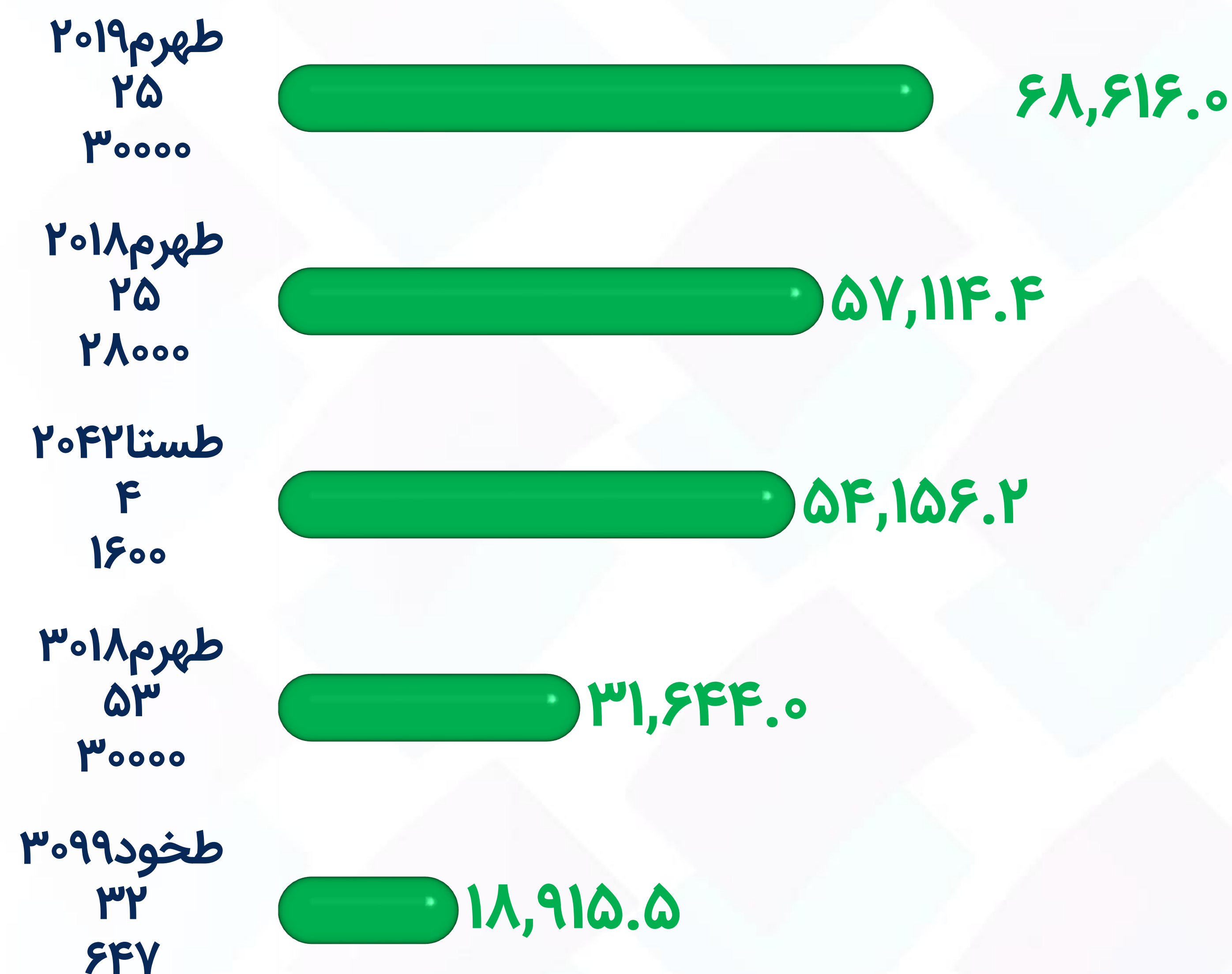
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.