

شماره
۴۶۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





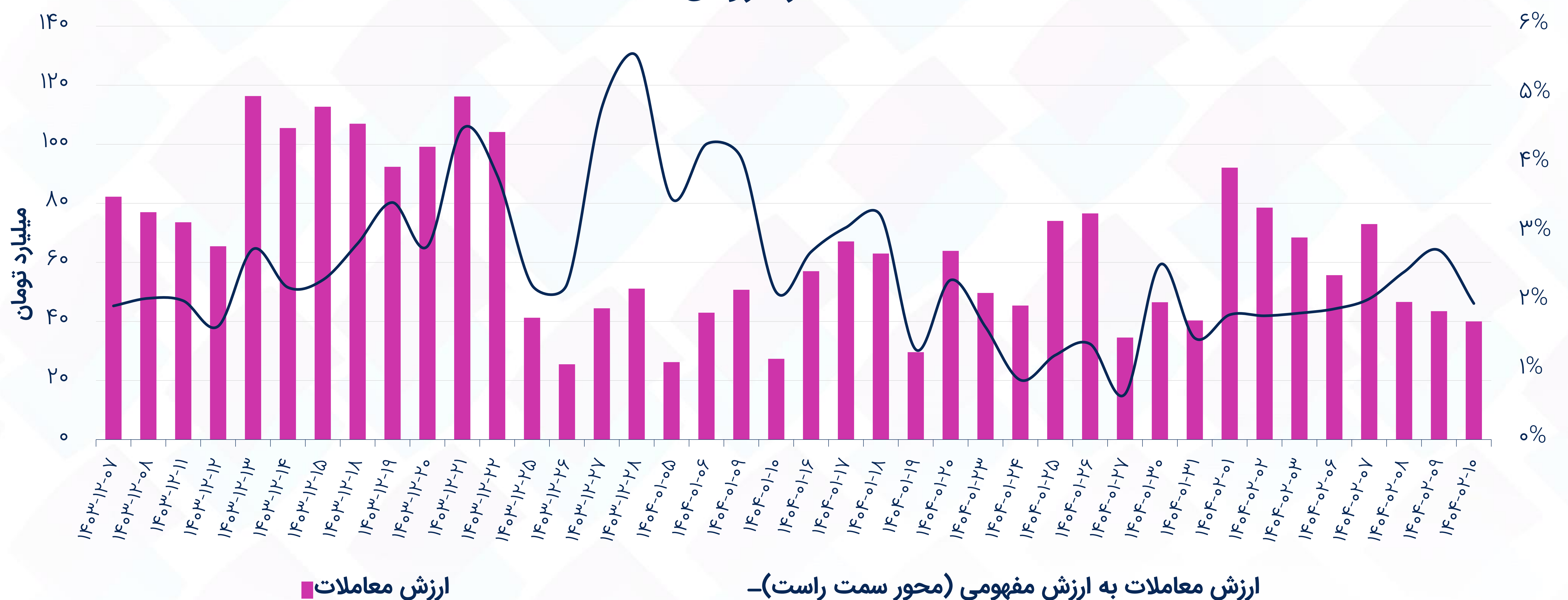
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



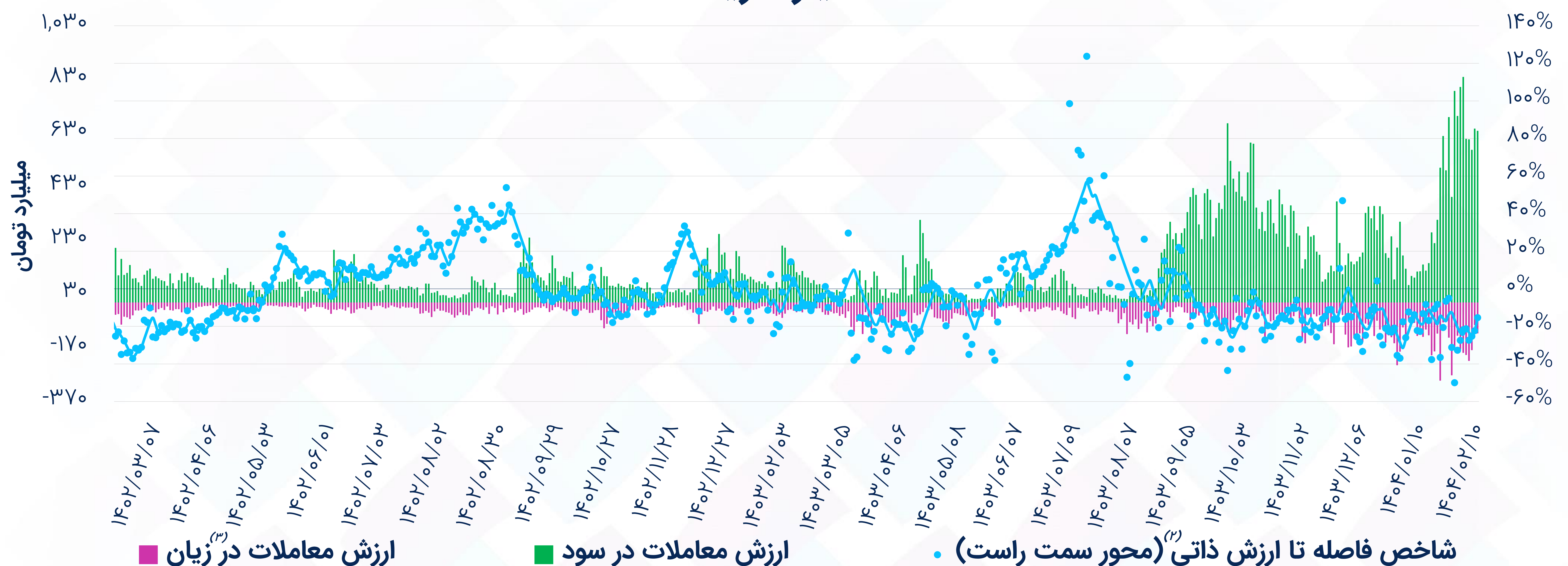
اختیار فروش



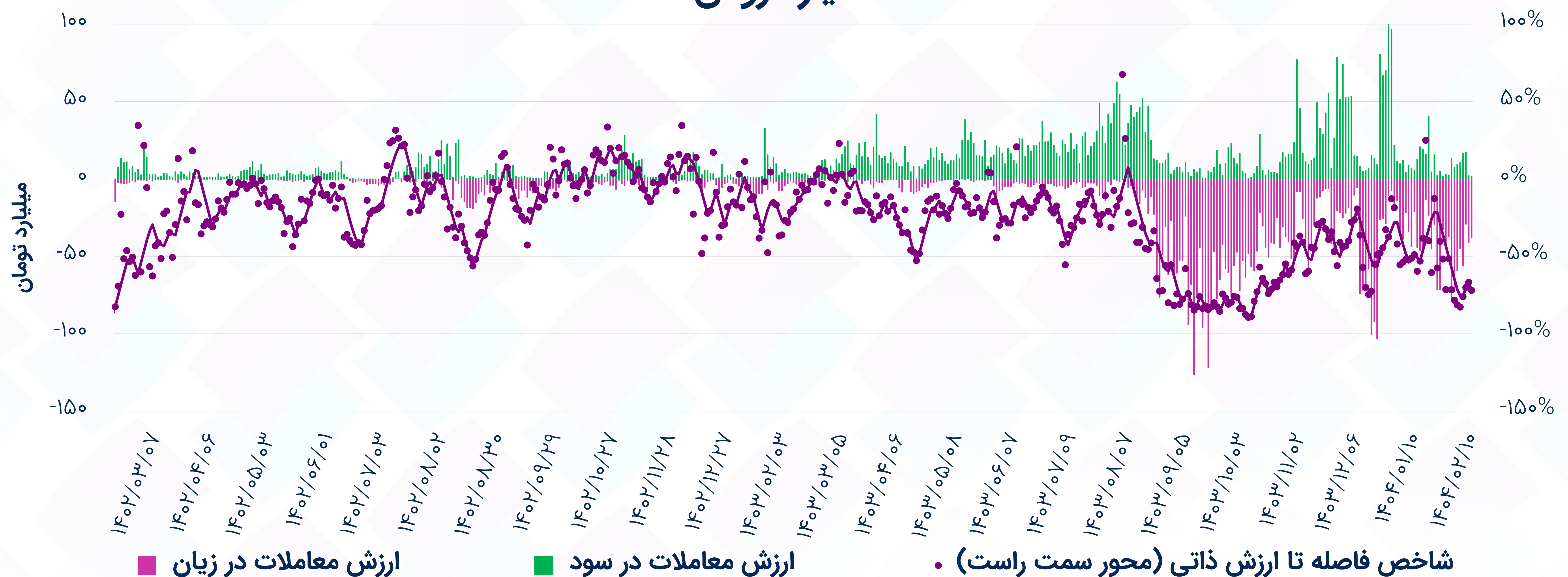
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۶	۳۳۵.۵	۲,۲۴۰.۳	۲۵۵.۲	۸۰.۳	(۲۹.۹%)
شستا	۵۷	۱۷۲.۵	۲,۸۰۰.۲	۱۶۱.۲	۱۱.۳	۱۷.۱%
خودرو	۱۳	۱۴۷.۵	۹۶۶.۹	۱۳۸.۵	۹.۱	(۲۰.۳%)
ذوب	۲۹	۳۴.۸	۲۴۰.۴	۳۰.۱	۴.۷	(۱۲.۹%)
وبصادر	۱۷	۱۸.۹	۹۶.۳	۱۷.۴	۱.۵	(۱۰.۶%)
وبملت	۲۶	۱۵.۷	۱۱۹.۸	۱۱.۵	۴.۲	(۲۶.۹%)
وتجارت	۲۱	۱۱.۵	۱۱۴.۶	۱۰.۰	۱.۵	(۲۷.۴%)

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
اهرم	۲۵	۲۶,۵۴۰.۸	۱,۴۶۹,۹۹۲.۵	۱,۲۶۹.۵	۲۵,۲۷۱.۴	(۷۸.۴%)
خودرو	۵	۱۱,۵۴۰.۹	۲۱۴,۵۶۷.۷	۹۷.۱	۱۱,۴۴۳.۸	(۵۷.۴%)
شستا	۱۵	۱,۶۹۶.۹	۳۱۵,۹۴۹.۹	۳۱۸.۸	۱,۳۷۸.۱	(۷۰.۸%)
ذوب	۴	۱۴۴.۰	۲۱,۰۳۳.۴	۰.۶	۱۴۳.۴	(۸۹.۲%)
وبملت	۲	۳۵.۷	۹۳۳.۹	۰.۰	۳۵.۷	(۵۸.۵%)
وتعاون	۳	۱۷.۲	۹۰۹.۰	۸.۱	۹.۱	(۲۹.۷%)
وبصادر	۲	۱۳.۸	۱,۱۹۰.۸	۰.۰	۱۳.۸	(۹۸.۱%)

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



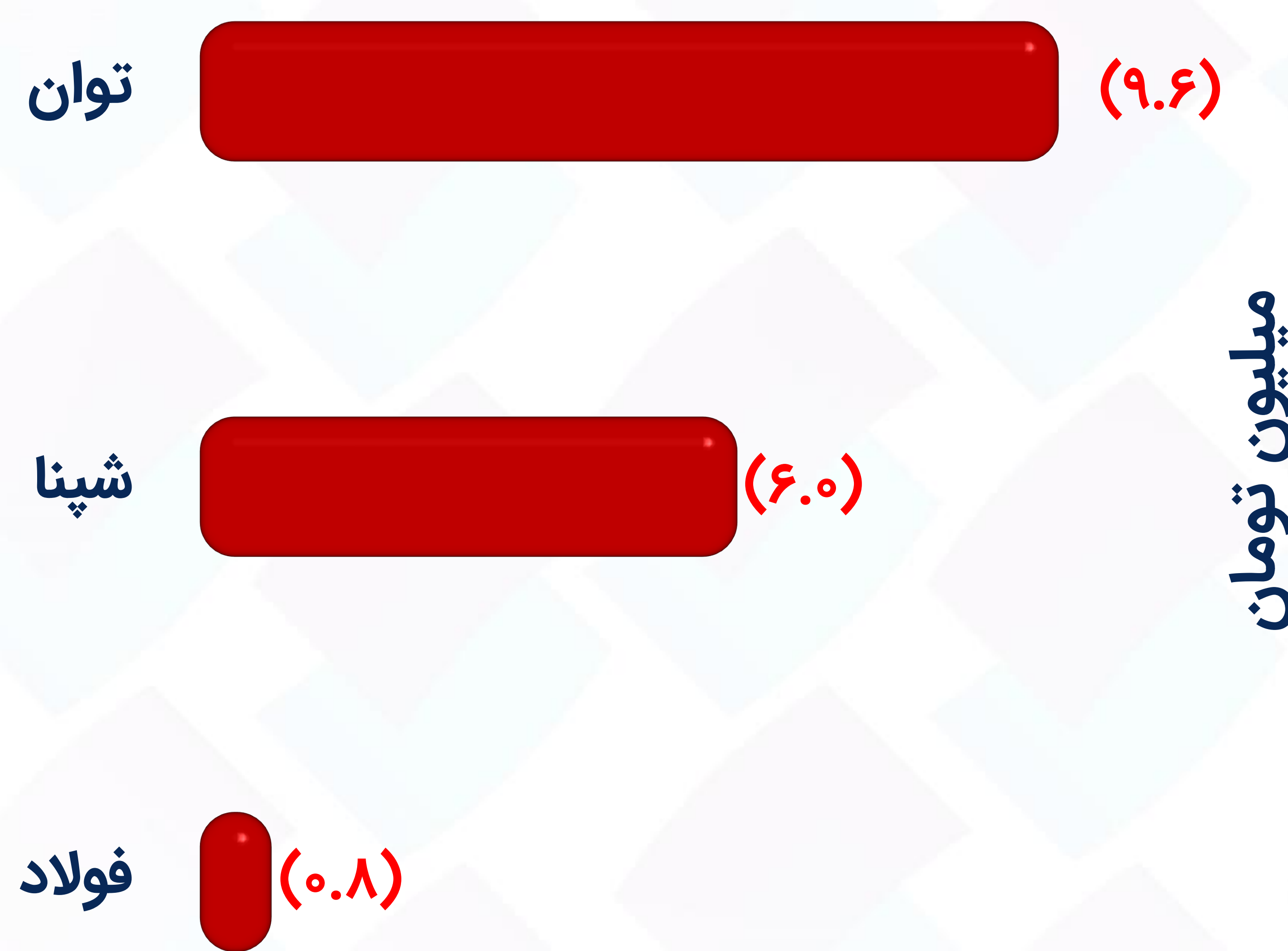
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



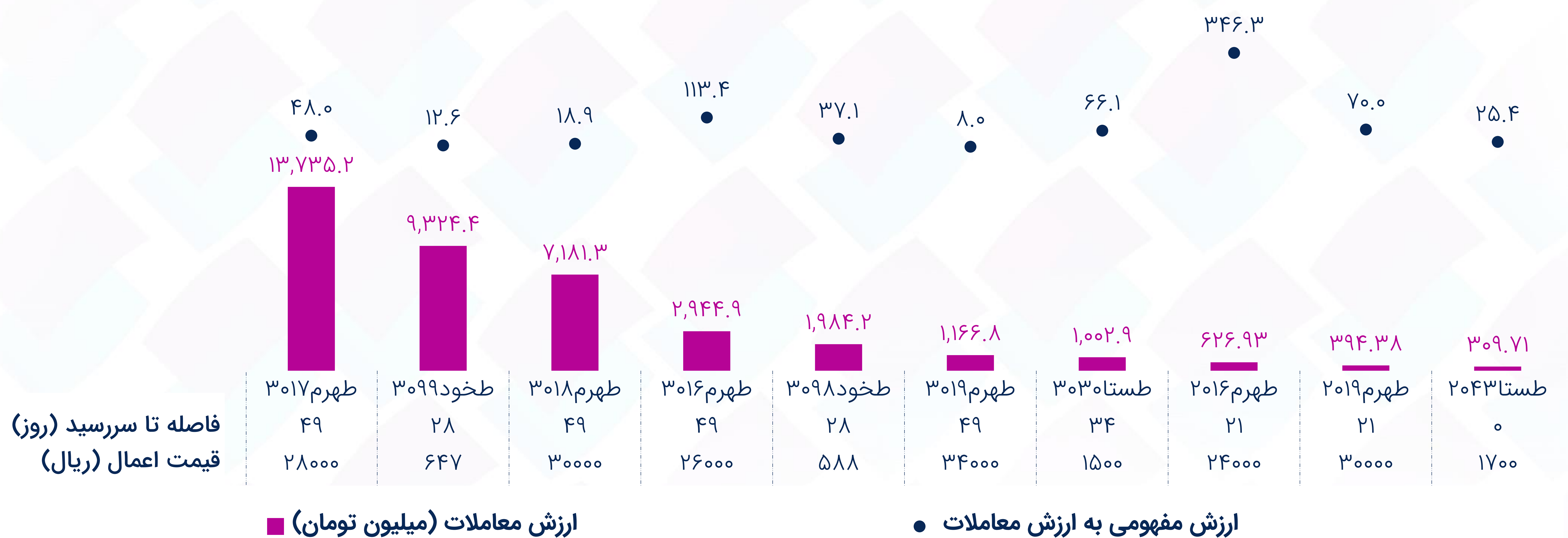
میلیون تومان

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
ضتوان ۴۰۲	توان	۲۲,۰۰۰	۷۴	۷.۴	۲,۷۵۸	۲۸,۹۲۰	۲۴,۷۵۸	(۱۴.۴%)	۹.۰	۰.۹۹	۸,۳۵۳	۲۰۳%
ضیاداد ۲۰۲۱	پادا	۱۵۰,۰۰۰	۴	۱.۶	۴۱,۰۰۰	۲۱۵,۶۵۳	۱۹۱,۰۰۰	(۱۱.۴%)	۴.۷	۱.۰۰	۶۶,۲۷۲	۶۲%
ضیپروآبان ۳۰۳	پتروآبان	۱۴,۰۰۰	۴۰	۱۹.۶	۲,۱۵۶	۱۵,۹۶۲	۱۶,۱۵۶	۱.۲%	۷.۵	۰.۹۷	۲,۴۹۰	۱۵%
ضهمن ۳۰۱۵	خبهمن	۲,۰۰۰	۴۹	۱۱.۳	۶۰۷	۲,۵۸۰	۲,۶۰۷	۱.۰%	۴.۳	۱.۰۰	۶۶۹	۱۰%
ضهم وزن ۳۰۷	هم وزن	۲۲,۰۰۰	۲۵	۱.۱	۷۵۰	۲۱,۷۹۱	۲۲,۷۵۰	۴.۴%	۳۰.۳	۰.۶۰	۸۲۴	۱۰%

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	۴۲	۲۷.۹	۹	۵۵۵	۱,۰۰۹	۸۲%	۱۱۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۴	۱۱.۳	۱	۵۵۵	۸۰۱	۴۴%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۳۴	۲۲.۱	۲۳	۴,۲۷۱	۶,۵۰۳	۵۲%	۲۸۲.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۴۲	۹.۰	۱۴	۵۵۵	۹۱۴	۶۵%	۶۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۲۰	وتجارت	۱,۰۰۰	۷۰	۴.۵	۲۵	۶۰۹	۱,۰۲۵	۶۸%	۴۱.۰	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
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۱	۲۸.۵	۱,۳۴۶	۳۲,۲۱۰	۳۲,۶۵۴	۱.۴%	۲۴.۳	-۰.۶۲	۱,۷۸۸	۳۲.۸%
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷۷	۳۹.۳	۷,۵۵۹	۳۲,۲۱۰	۳۴,۴۴۱	۶.۹%	۴.۶	-۰.۸۷	۷,۲۶۳	(۳.۹%)
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۹	۲۵.۸	۹,۵۵۹	۳۲,۲۱۰	۳۲,۴۴۱	۰.۷%	۳.۴	-۰.۹۵	۸,۰۱۲	(۱۶.۲%)
طوتعاون ۳۱۰	وتعاون	۱,۹۰۰	۴۷	۷.۲	۱۱۱	۱,۷۹۵	۱,۷۸۹	(۰.۳%)	۱۶.۱	-۰.۵۴	۸۵	(۲۳.۹%)
طهرم ۳۰۲۰	اهرم	۳۸,۰۰۰	۴۹	۷.۸	۶,۵۰۰	۳۲,۲۱۰	۳۱,۵۰۰	(۲.۲%)	۴.۸	-۰.۸۰	۴,۵۳۷	(۳۰.۲%)

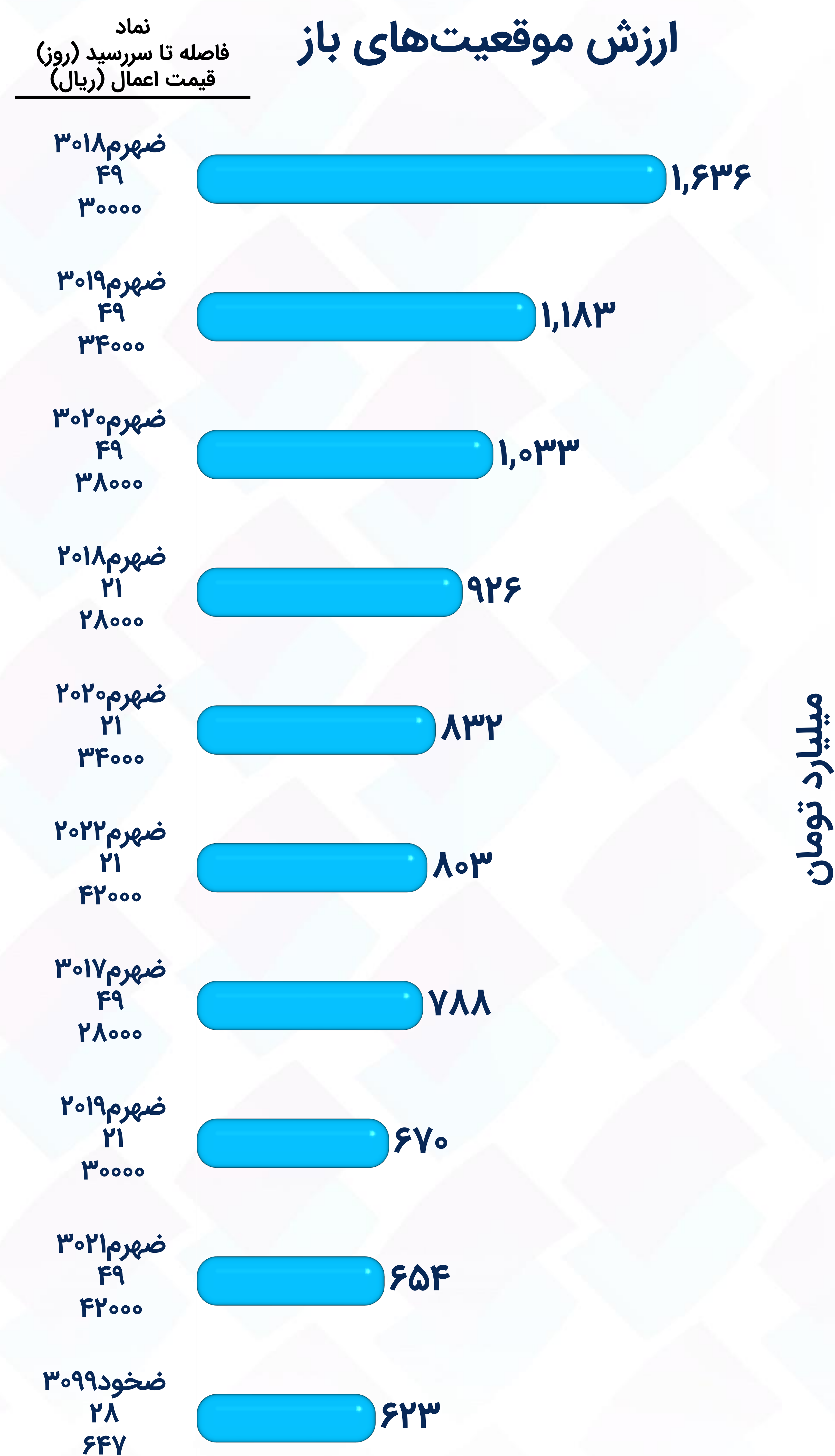
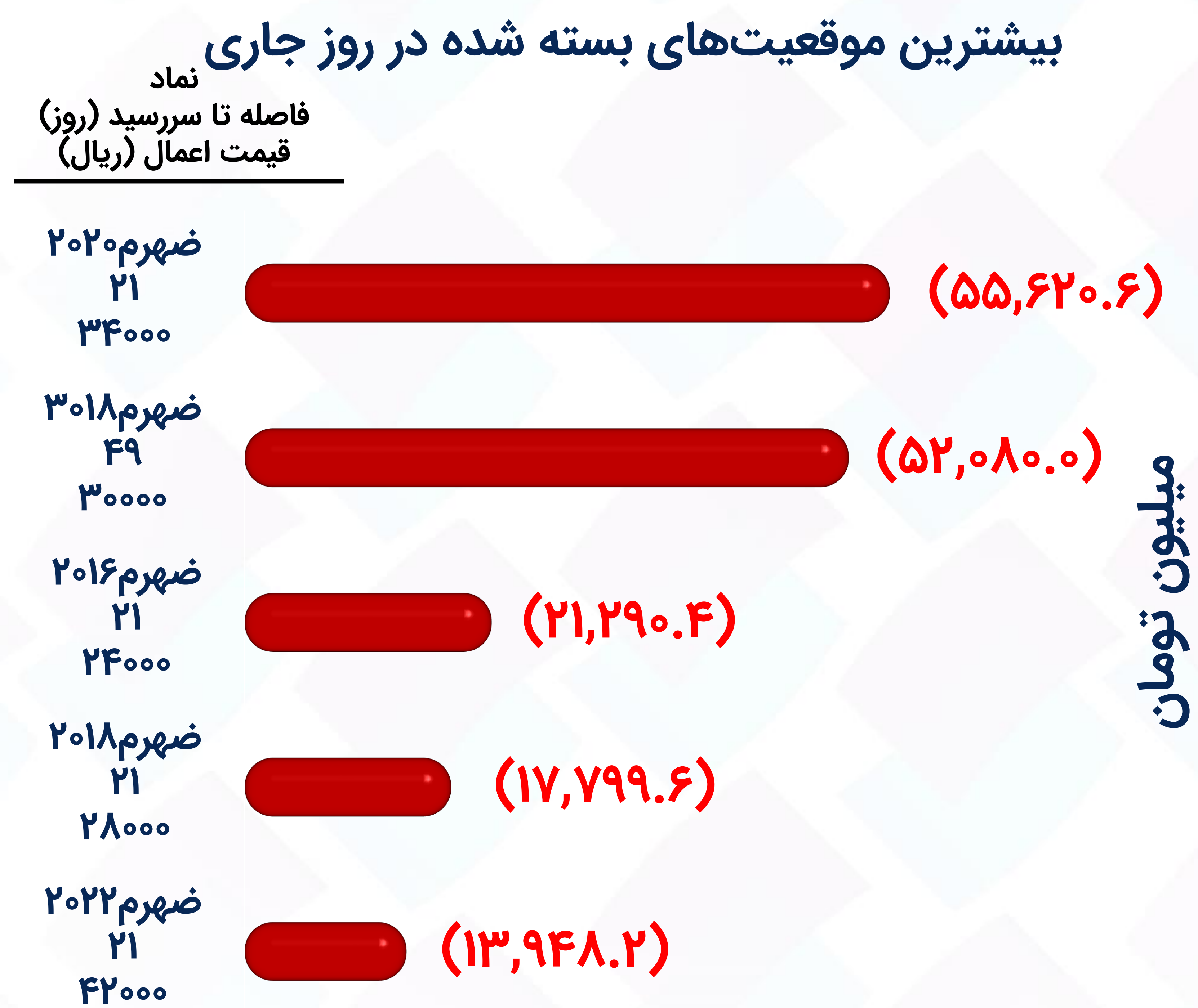
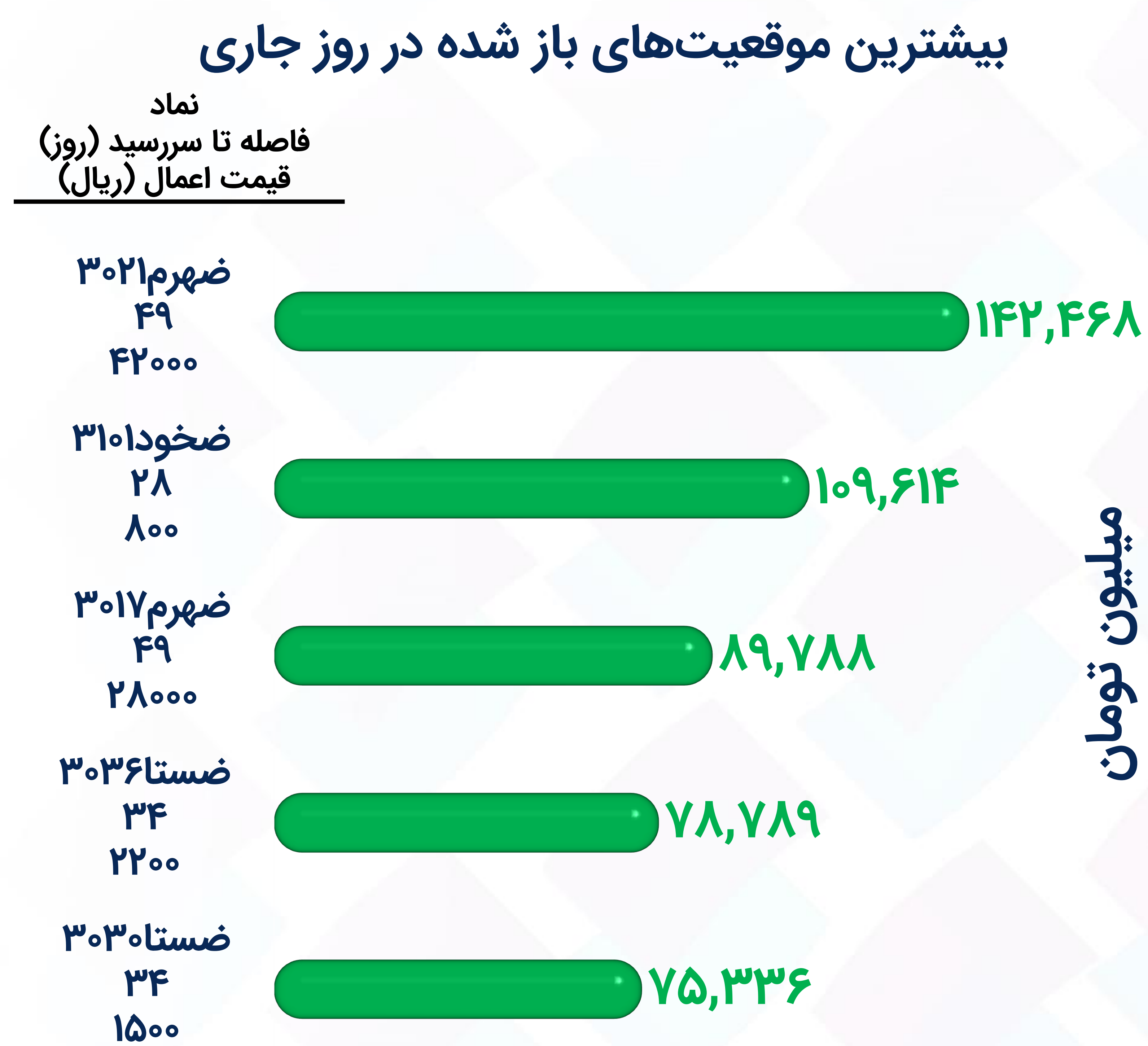
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طجارا ۲۰۵۱	وتجارت	۴۵۴	۷	۰.۳	۱	۶۰۹	۴۵۳	(۲۵.۶%)	۴۵۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۲۱	۰.۵	۳۴	۳۲,۲۱۰	۱۹,۹۶۶	(۳۸.۰%)	۵۸۷.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۱۴	۱۷.۱	۱	۵۵۵	۳۹۹	(۲۸.۱%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طفلا ۳۰۴۴	فولاد	۲,۸۸۰	۳۴	۰.۰	۲	۴,۲۷۱	۲,۸۷۸	(۳۲.۶%)	۱,۴۳۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲۱	۲۱.۹	۵۹	۳۲,۲۱۰	۲۱,۹۴۱	(۳۱.۹%)	۳۷۱.۹	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.



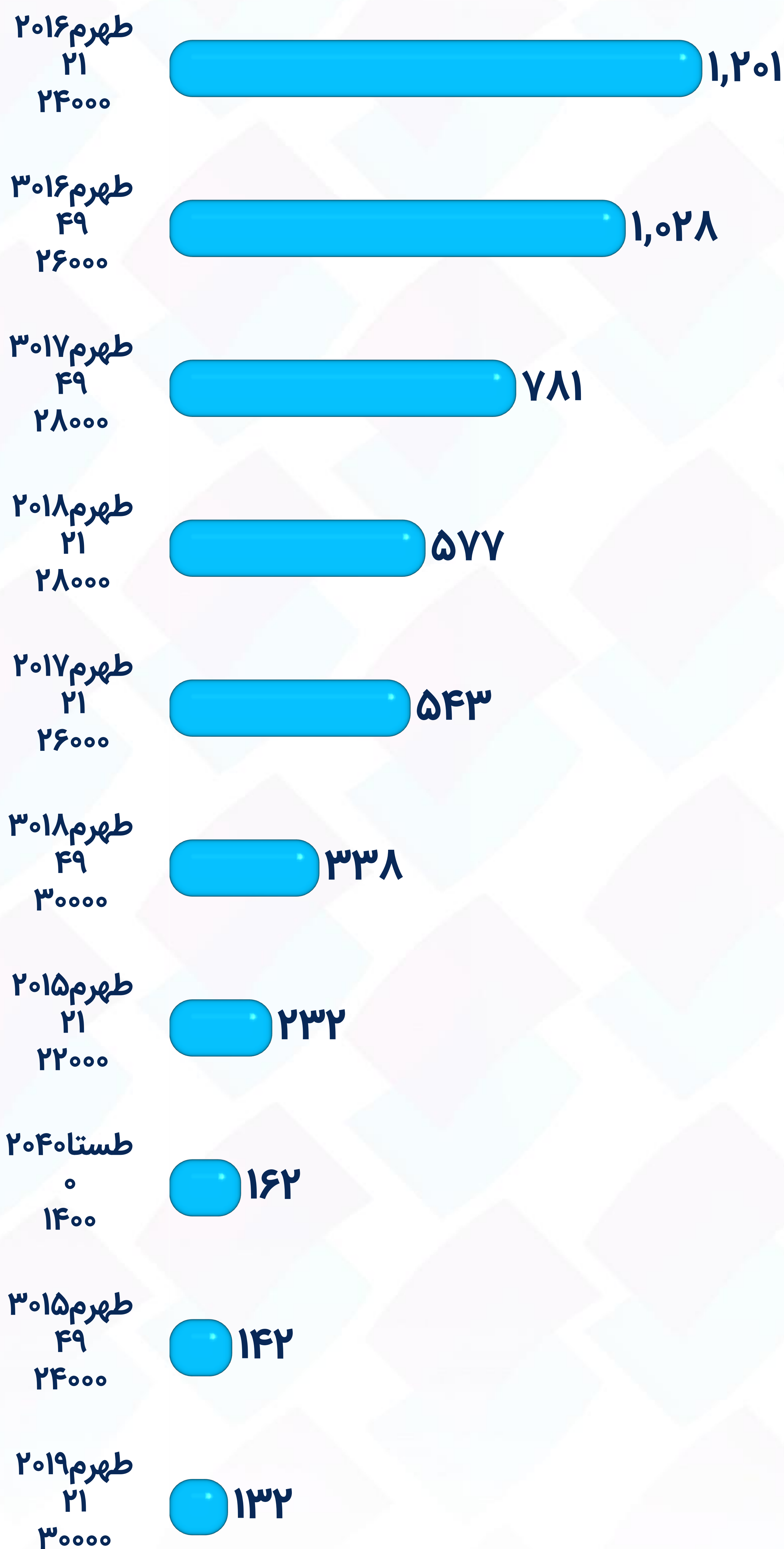
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

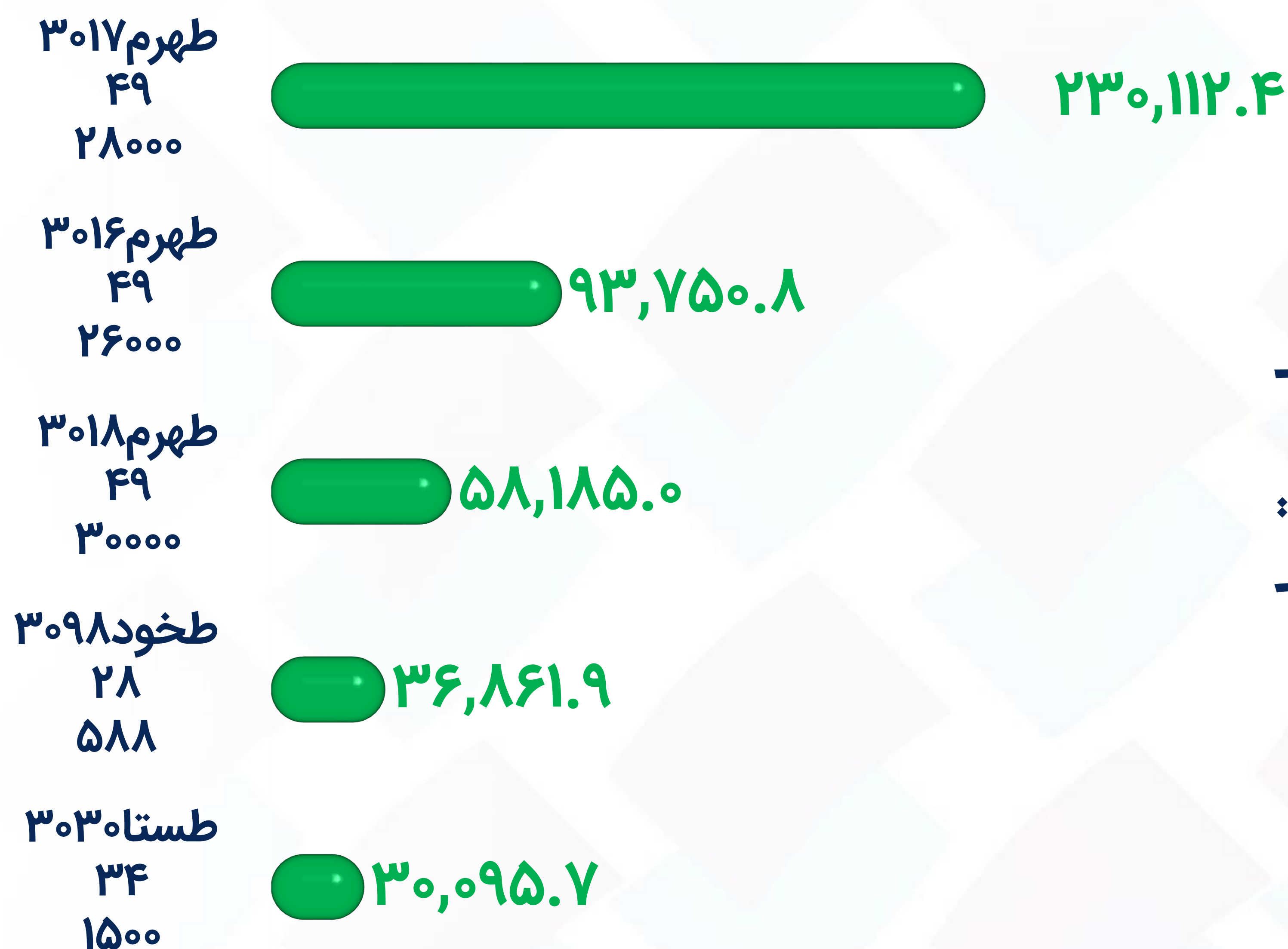
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

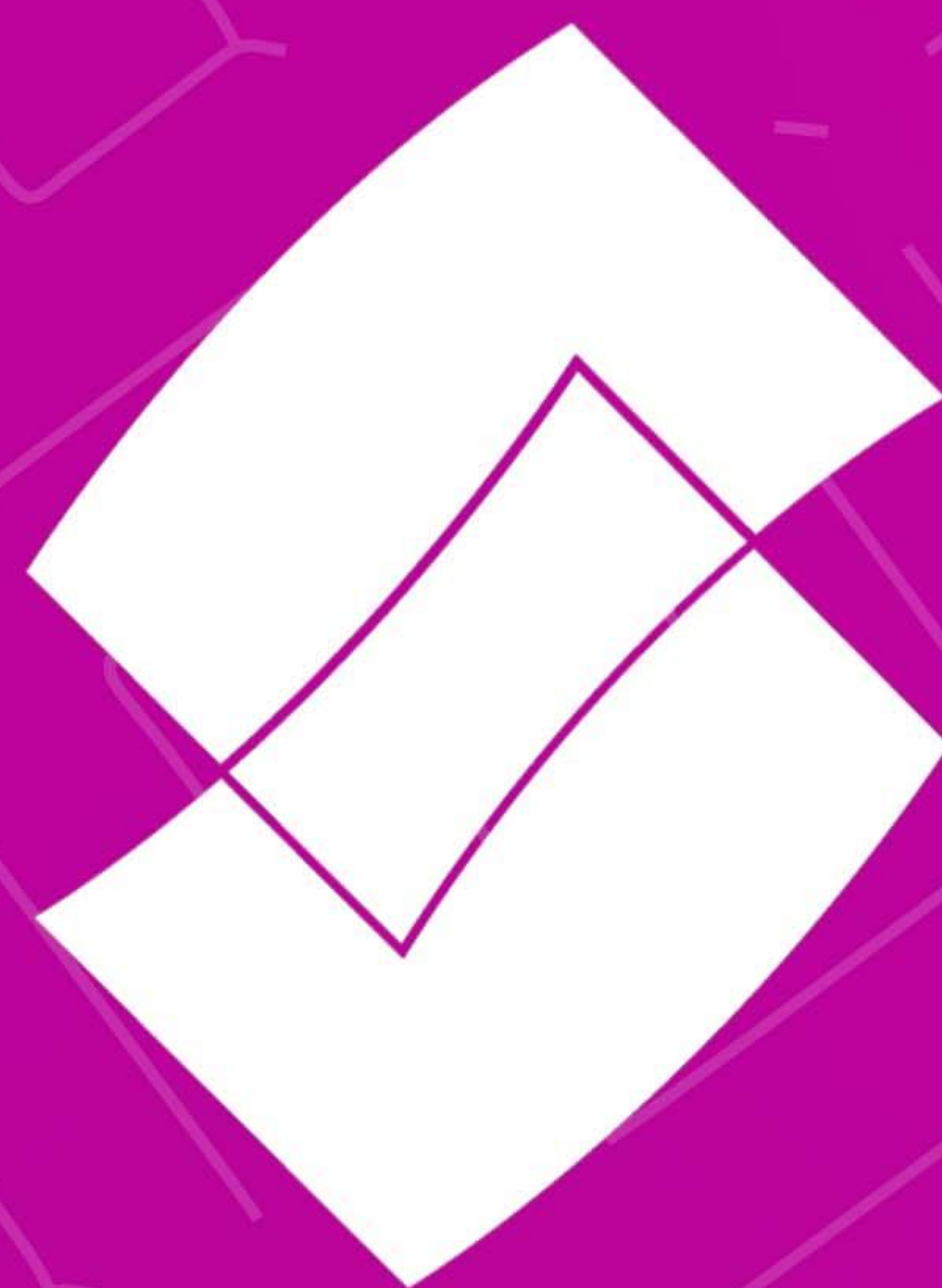
اختیار خرید



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.