

شماره
۴۶۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۳ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





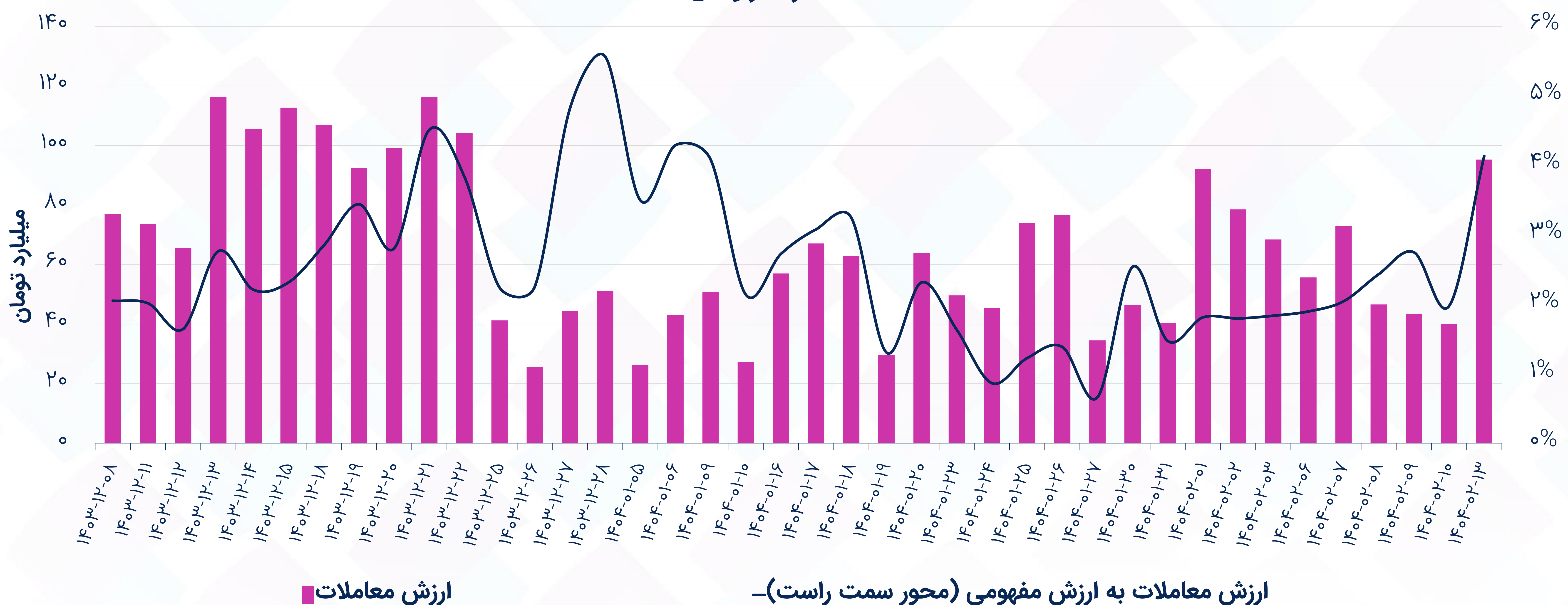
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



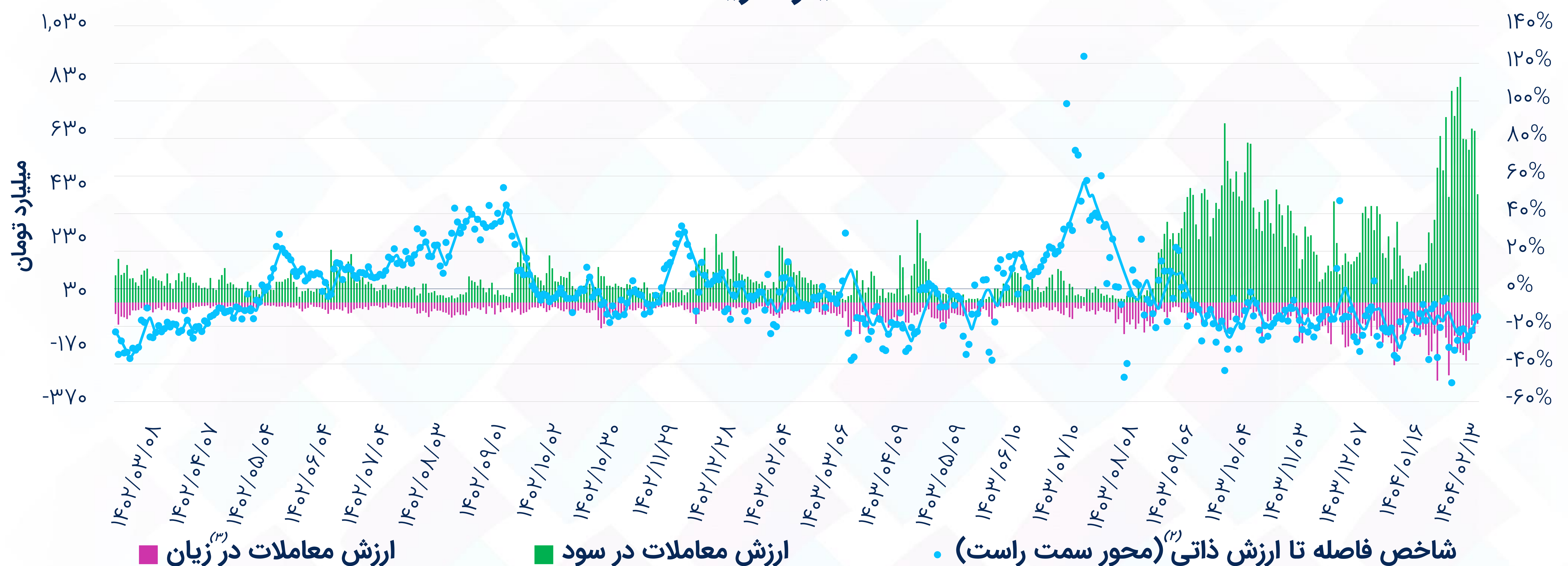
اختیار فروش



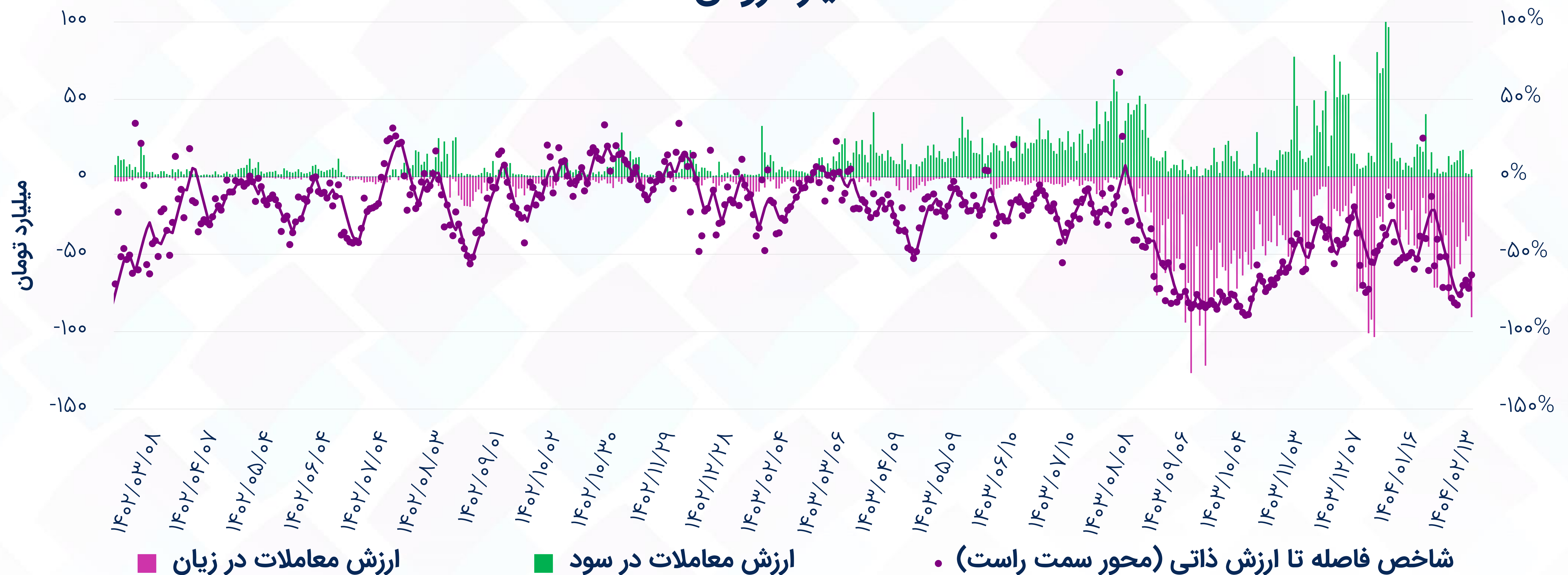
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۹	۲۲۳.۰	۲,۶۶۹.۲	۱۶۷.۴	۵۵.۶	(۱۳.۶%)
خودرو	۱۳	۱۶۵.۹	۱,۳۳۱.۸	۱۵۶.۴	۹.۵	(۲۰.۴%)
شستا	۴۳	۳۲.۷	۴۸۱.۶	۲۵.۵	۷.۱	(۱۶.۷%)
ذوب	۲۸	۲۷.۷	۲۴۸.۷	۲۵.۸	۲.۰	(۱.۲%)
وتجارت	۲۲	۹.۴	۲۳۱.۹	۷.۳	۲.۰	۶.۲%
وبملت	۲۰	۷.۵	۸۰.۲	۶.۲	۱.۳	(۸.۳%)
وبصادر	۱۶	۷.۲	۵۴.۲	۶.۳	۰.۹	(۸.۰%)

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	۴۸,۶۶۱.۳	۷۰۱,۷۷۳.۲	۳۹۶.۲	۴۸,۲۶۵.۰	(۵۴.۰%)
اهرم	۲۲	۴۱,۹۷۴.۱	۱,۳۴۸,۲۴۳.۱	۴,۲۸۲.۲	۳۷,۶۹۱.۹	(۷۳.۰%)
شستا	۱۰	۴,۲۱۲.۷	۲۲۱,۹۷۰.۲	۱۱.۶	۴,۲۰۱.۲	(۷۴.۰%)
ذوب	۳	۲۴۰.۷	۲۶,۸۰۵.۷	۰.۰	۲۴۰.۷	(۸۱.۷%)
وبملت	۳	۹۲.۲	۱,۴۸۷.۱	۰.۰	۹۲.۲	(۶۶.۱%)
وبصادر	۳	۴۵.۱	۲,۴۶۳.۷	۰.۰	۴۵.۱	(۹۸.۳%)
وتعاون	۲	۲۷.۳	۷۳۴.۲	۰.۶	۲۶.۸	(۸۱.۳%)

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



میلیون تومان



میلیون تومان



میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



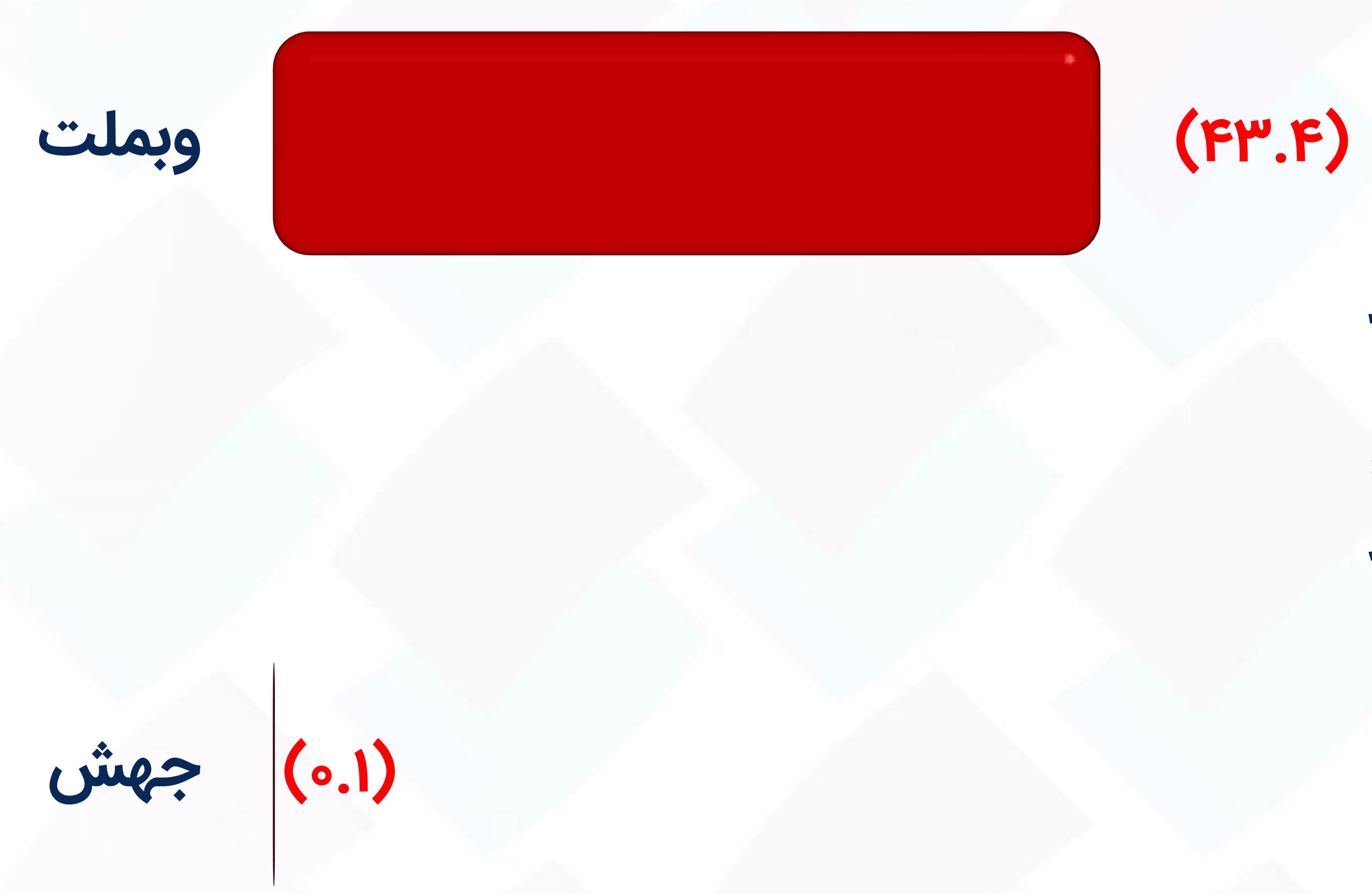
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

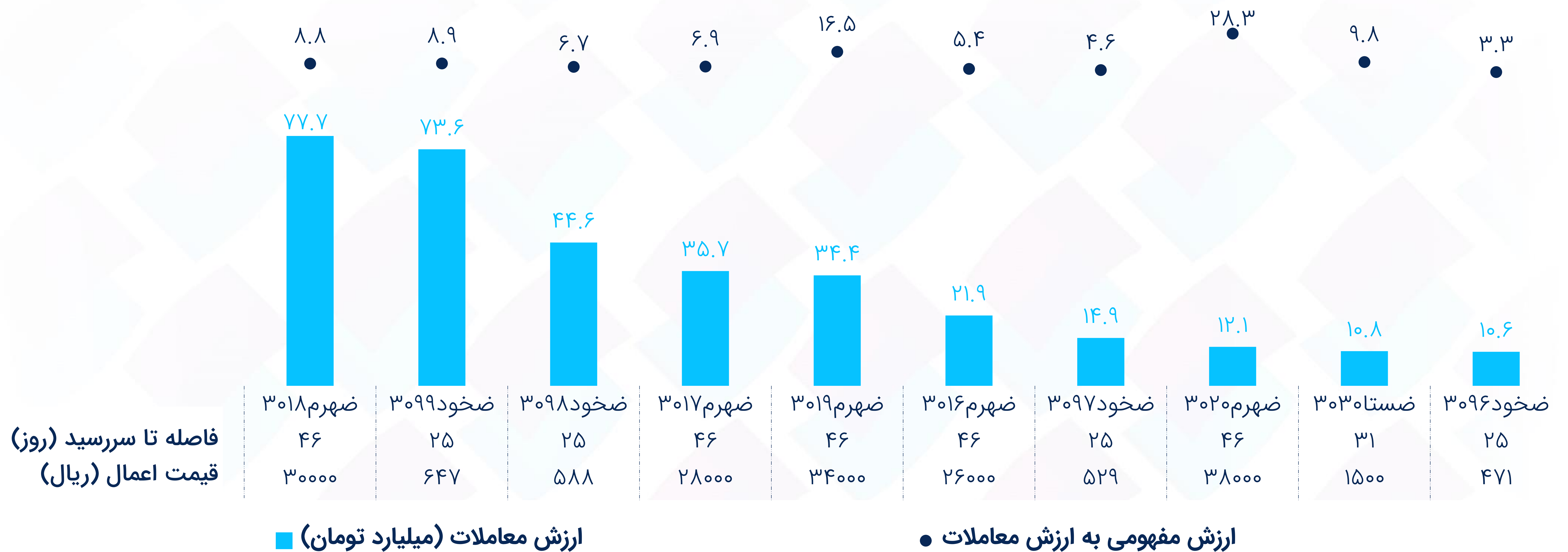
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضموج ۲۲۰	موج	۲۸,۰۰۰	۸	۵۶.۹	۷۶۵	۳۰,۲۳۲	۲۸,۷۶۵	(۴.۹%)	۳۷.۶	۰.۹۱	۲,۵۹۲	۲۳۹%
ضهرم ۲۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۱۸	۴۷۲.۳	۱,۰۹۰	۳۱,۲۵۰	۳۱,۰۹۰	(۰.۵%)	۲۸.۵	۰.۷۷	۲,۲۵۳	۱۰۷%
ضموج ۲۱۹	موج	۲۶,۰۰۰	۸	۱۰۱.۱	۲,۳۷۳	۳۰,۲۳۲	۲۸,۳۷۳	(۶.۱%)	۱۲.۰	۰.۹۹	۴,۴۸۷	۸۹%
ضشنا ۲۰۵۱	شپنا	۳,۸۷۳	۴	۵۲.۵	۱۱۲	۴,۰۲۷	۳,۹۸۵	(۱.۰%)	۳۵.۶	۰.۸۴	۱۹۷	۷۶%
ضهرم ۲۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۱۸	۳,۲۵۱.۰	۲,۲۶۰	۳۱,۲۵۰	۳۰,۲۶۰	(۳.۲%)	۱۳.۴	۰.۹۳	۳,۹۰۴	۷۳%

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	۱۱	۱۰.۲	۱	۵۳۹	۸۰۱	۴۹%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۳۹	۱۳.۵	۷	۵۳۹	۱,۰۰۷	۸۷%	۱۴۳.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضبساما ۵۱۰	بساما	۱۳,۰۰۰	۸۵	۳.۰	۵۰۰	۸,۷۷۰	۱۳,۵۰۰	۵۴%	۲۷.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۱۱	۹.۸	۲	۵۳۹	۷۰۲	۳۰%	۳۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۲	ذوب	۸۰۰	۳۹	۲.۵	۱۷	۵۳۹	۸۱۷	۵۲%	۴۸.۱	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 ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴۶	۱۵.۱	۱۱,۵۹۴	۳۱,۲۵۰	۳۰,۴۰۶	(۲.۷%)	۲.۶	-۰.۹۷	۸,۹۸۵	(۲۲.۵%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷۴	۱۲.۹	۱۰,۷۷۵	۳۱,۲۵۰	۳۱,۲۲۵	(۰.۱%)	۲.۹	-۰.۹۱	۸,۱۶۴	(۲۴.۲%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۸	۴۹۳.۰	۳,۳۲۲	۳۱,۲۵۰	۳۰,۶۷۸	(۱.۸%)	۹.۲	-۰.۷۵	۲,۴۵۲	(۲۶.۲%)
طجار ۲۰۵۵	وتجارت	۶۳۵	۴	۲۲.۳	۶۰	۵۹۱	۵۷۵	(۲.۷%)	۹.۶	-۰.۹۰	۴۱	(۳۱.۸%)
طهرم ۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۳۷	۳.۲	۱۰,۸۰۰	۳۱,۲۵۰	۳۱,۲۰۰	(۰.۲%)	۲.۹	-۰.۷۵	۶,۷۲۹	(۳۷.۷%)

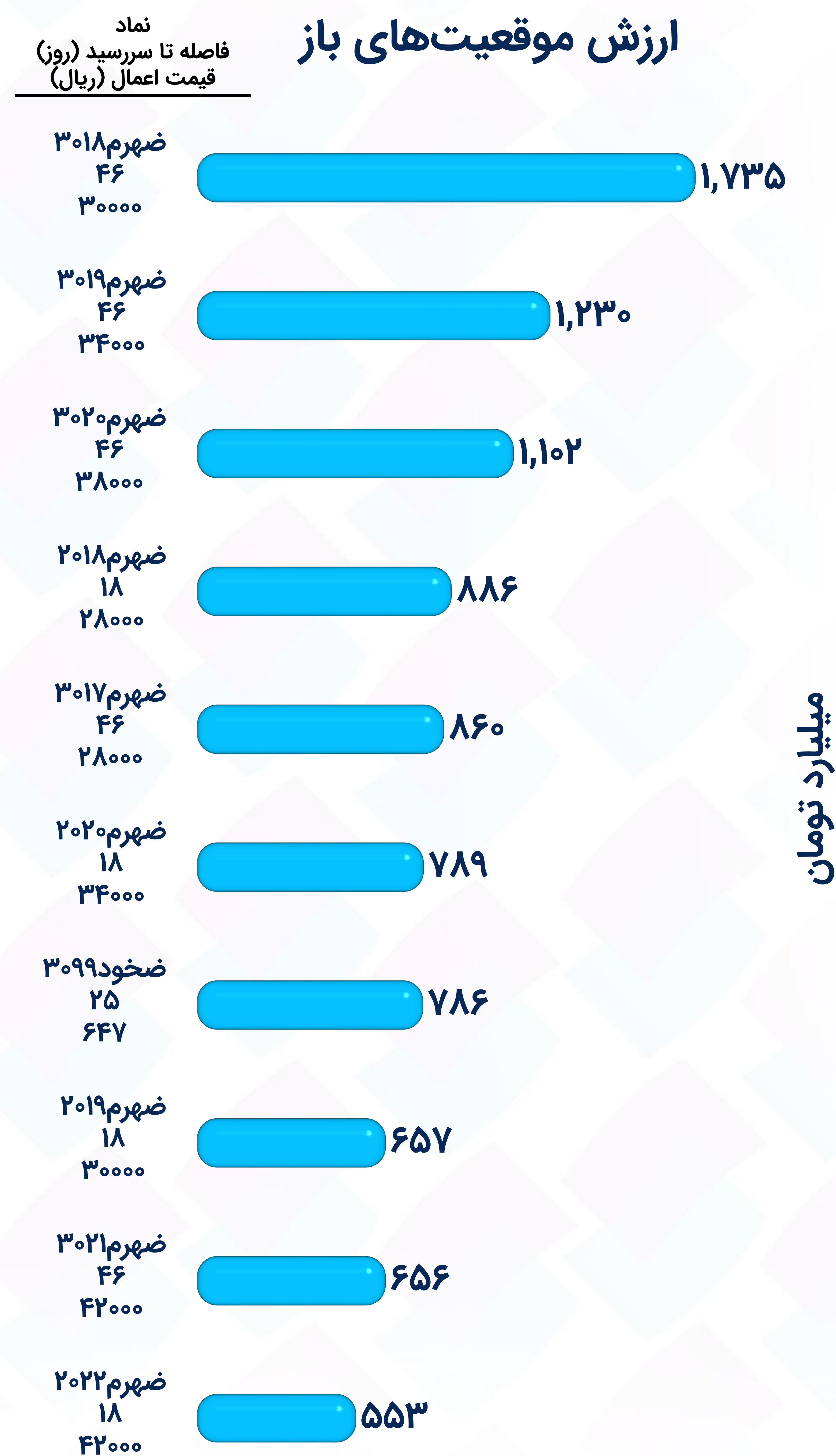
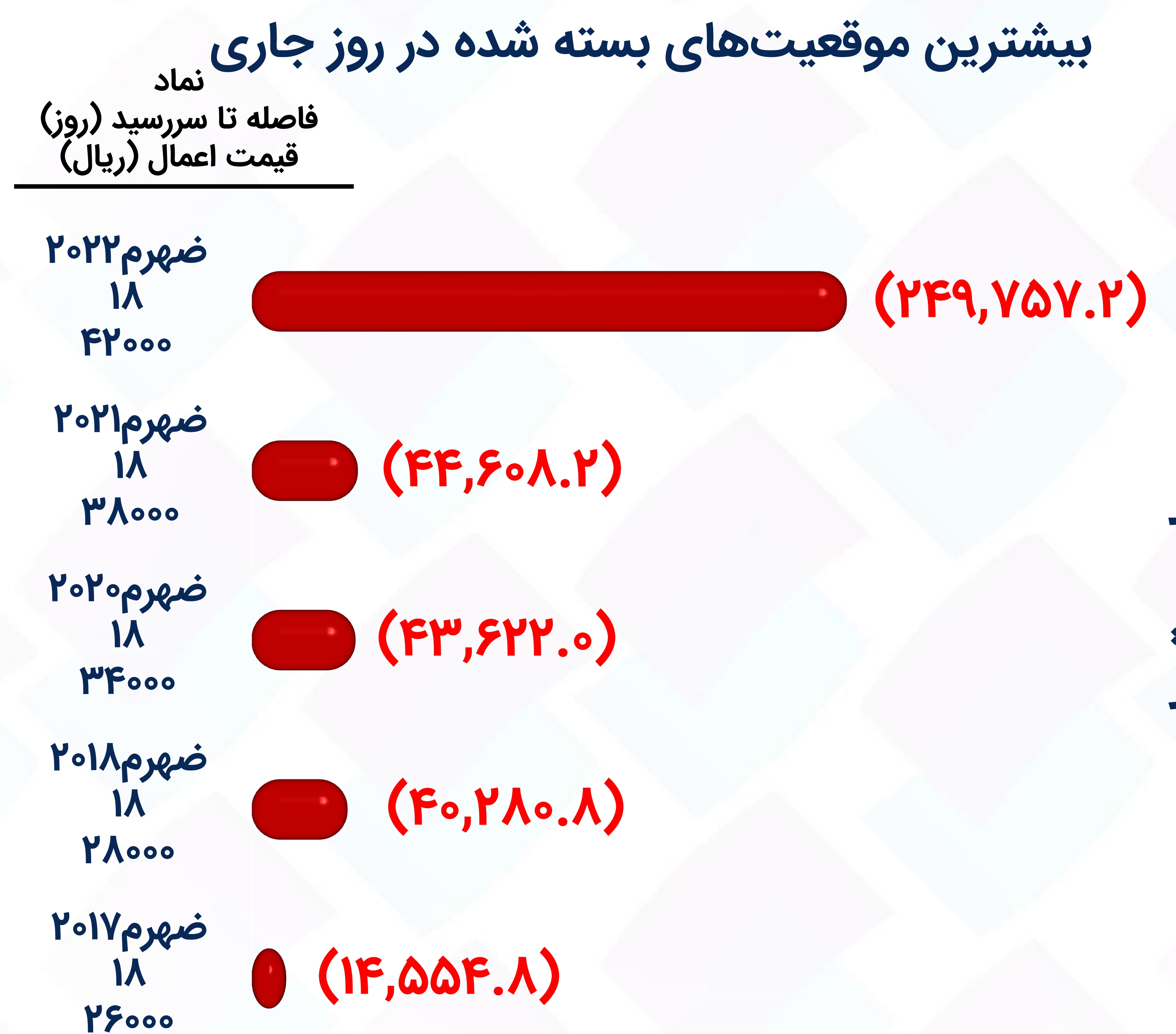
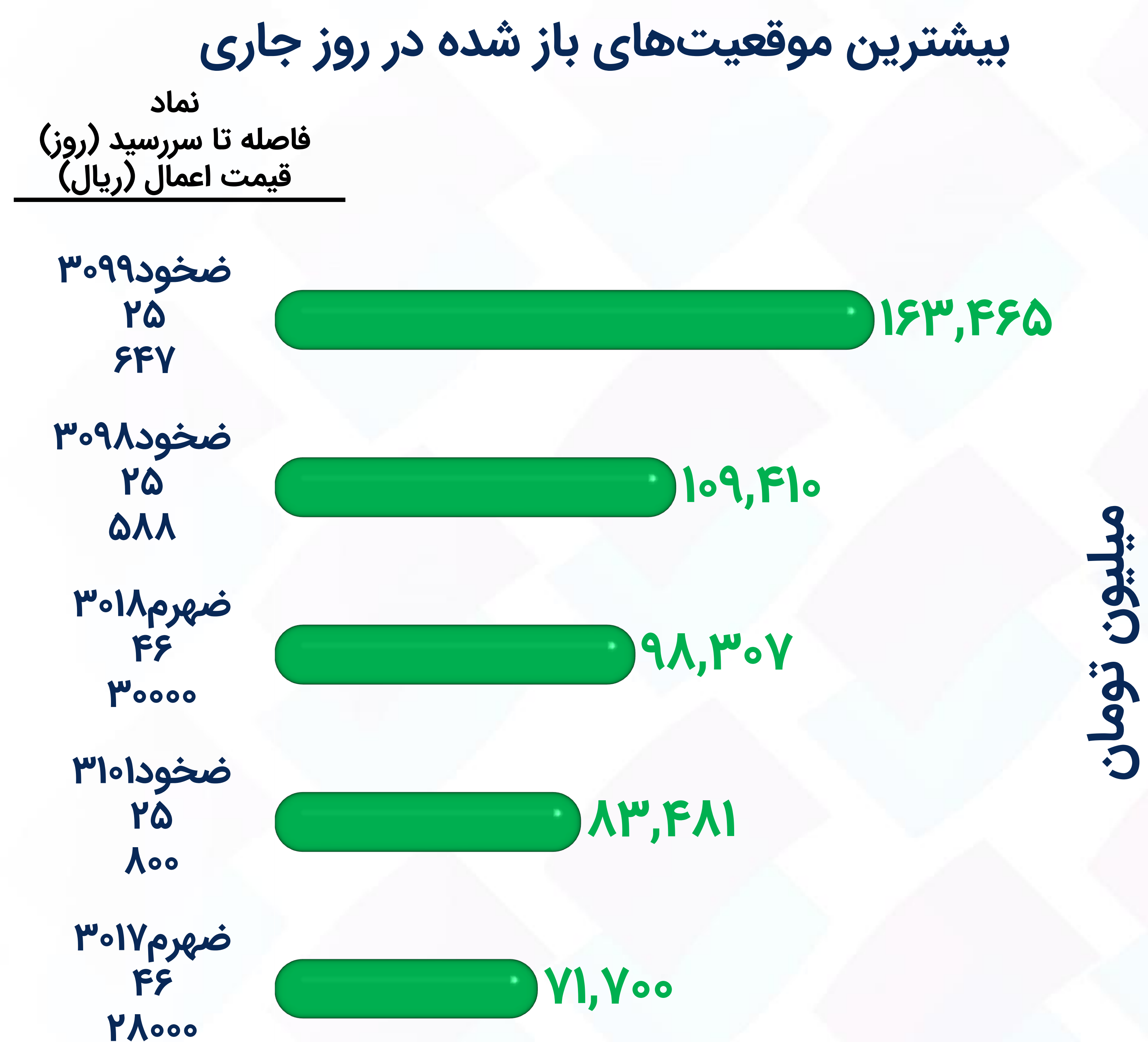
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طملت ۳۰۴۴	وبملت	۱,۱۷۴	۳۹	۰.۰	۱	۲,۶۵۷	۱,۱۷۳	(۵۵.۹%)	۱,۱۷۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۰	وبصادر	۴۰۰	۳۹	۰.۰	۵	۷۲۷	۳۹۵	(۴۵.۷%)	۷۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۲۵	۰.۰	۳	۶۴۹	۲۷۹	(۵۷.۰%)	۹۳.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۸	۱.۷	۳۰	۳۱,۲۵۰	۱۹,۹۷۰	(۳۶.۱%)	۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طشنا ۲۰۴۹	شپنا	۳,۱۶۹	۴	۰.۱	۳	۴,۰۲۷	۳,۱۶۶	(۲۱.۴%)	۱,۰۵۵.۳	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



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

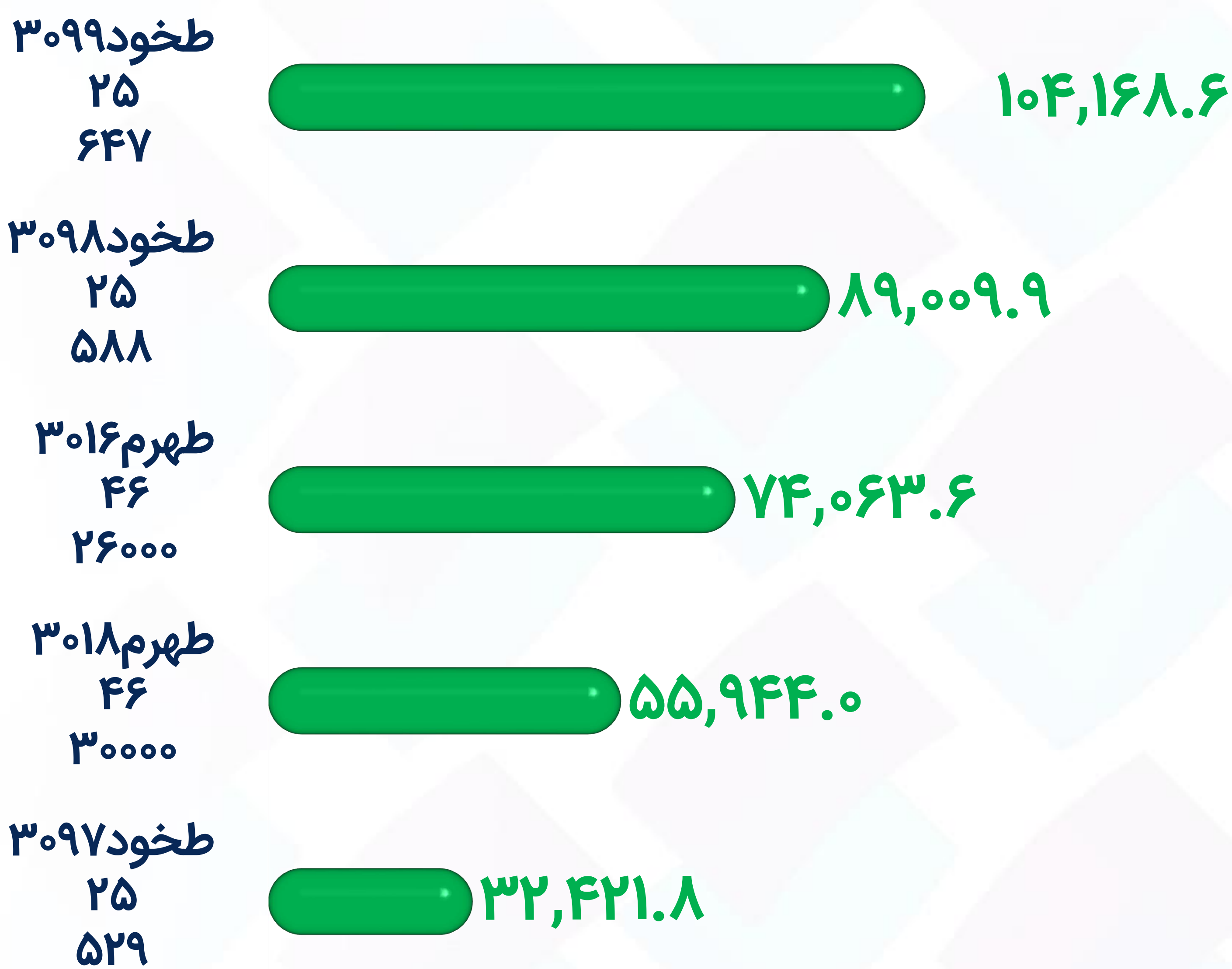
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

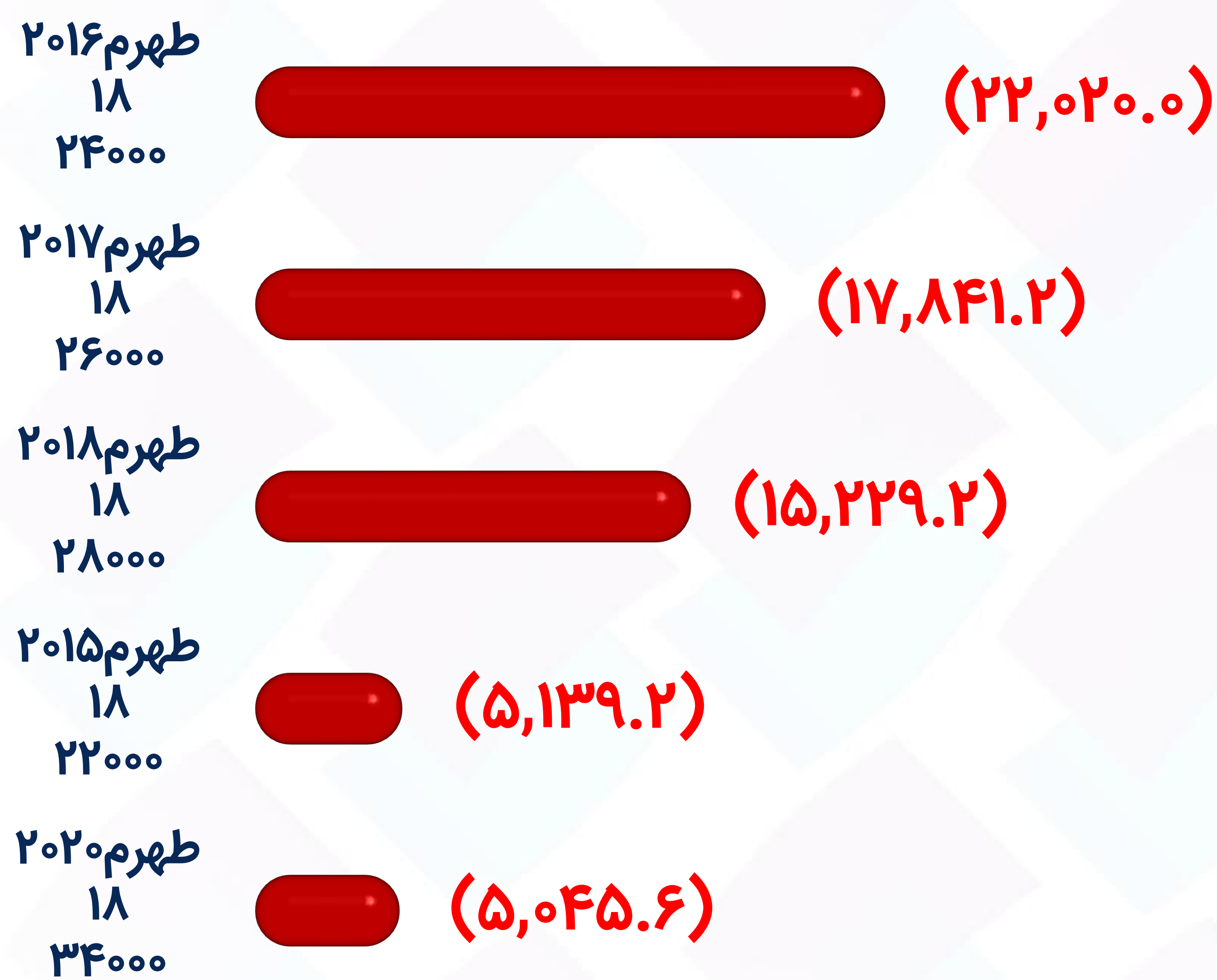
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

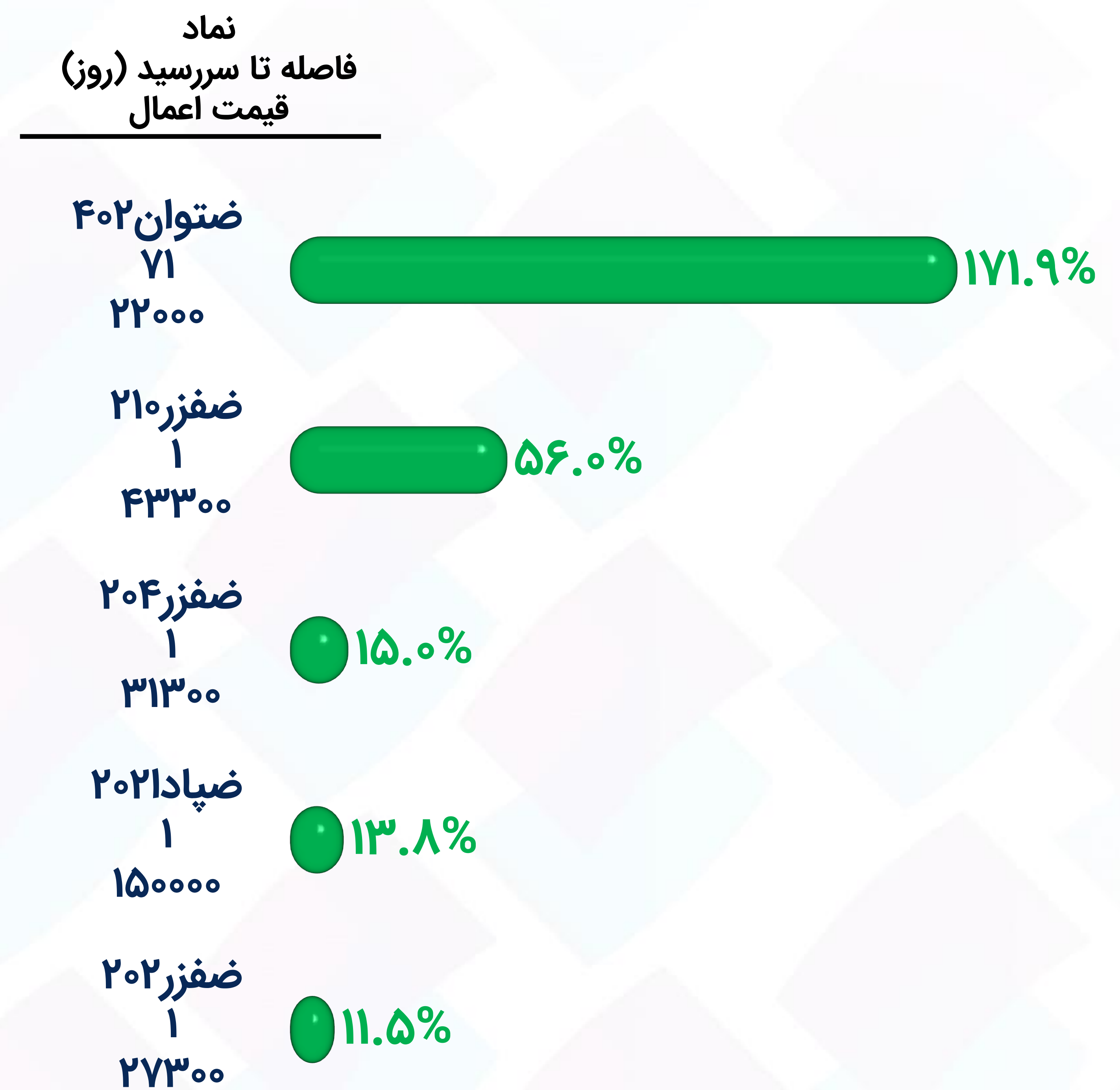
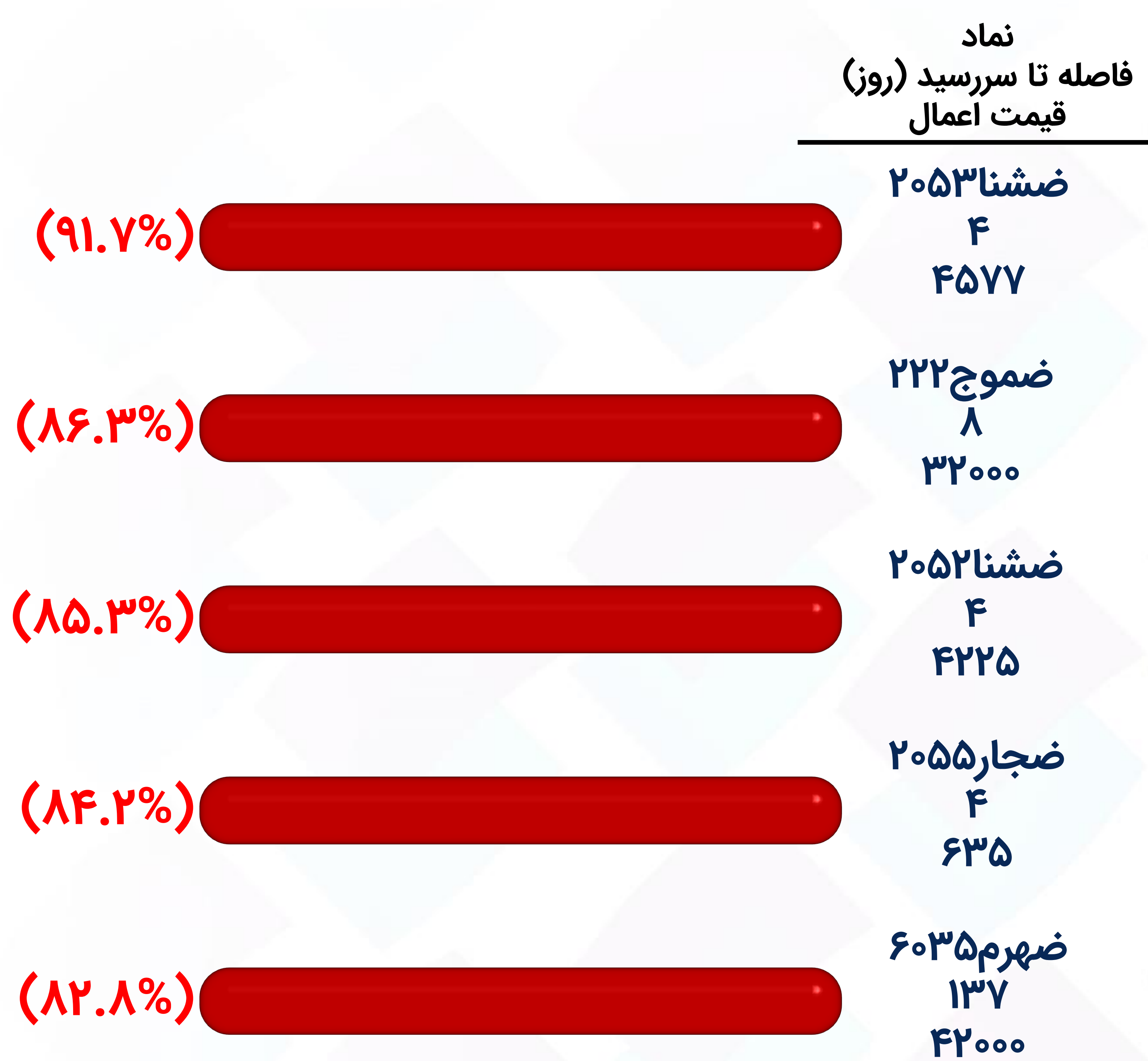
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



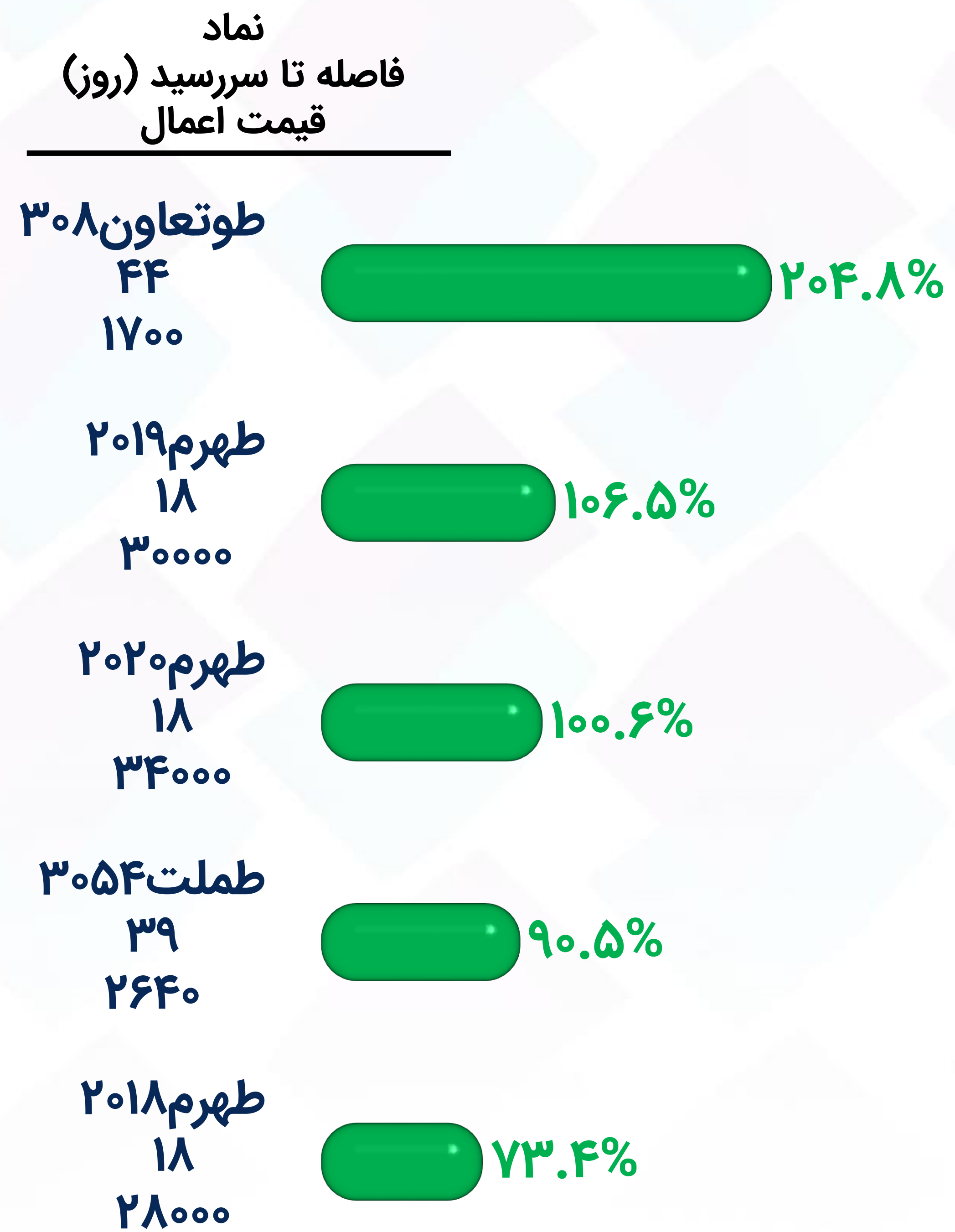
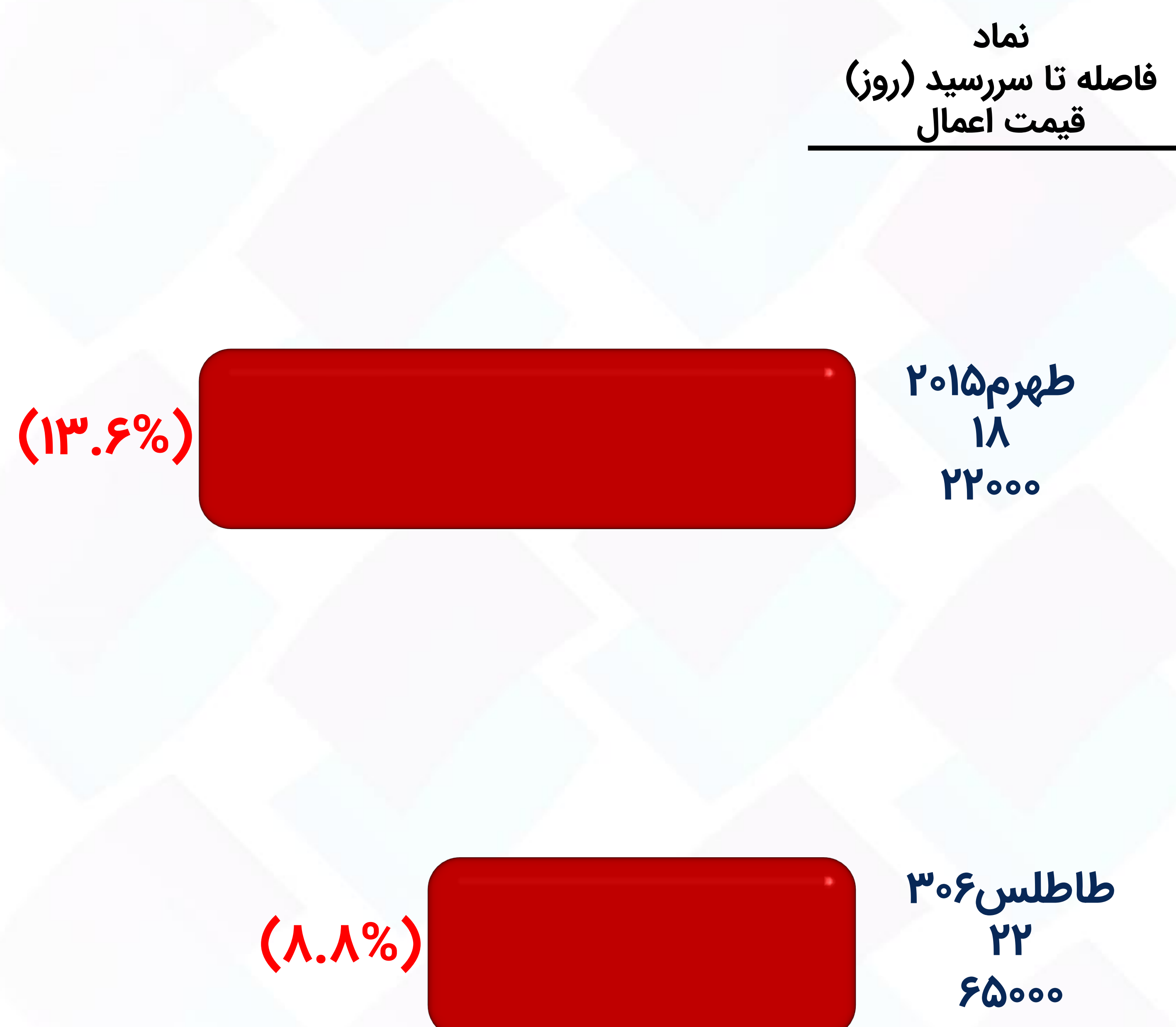
میلیون تومان

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.