

شماره
۴۷۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۶ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





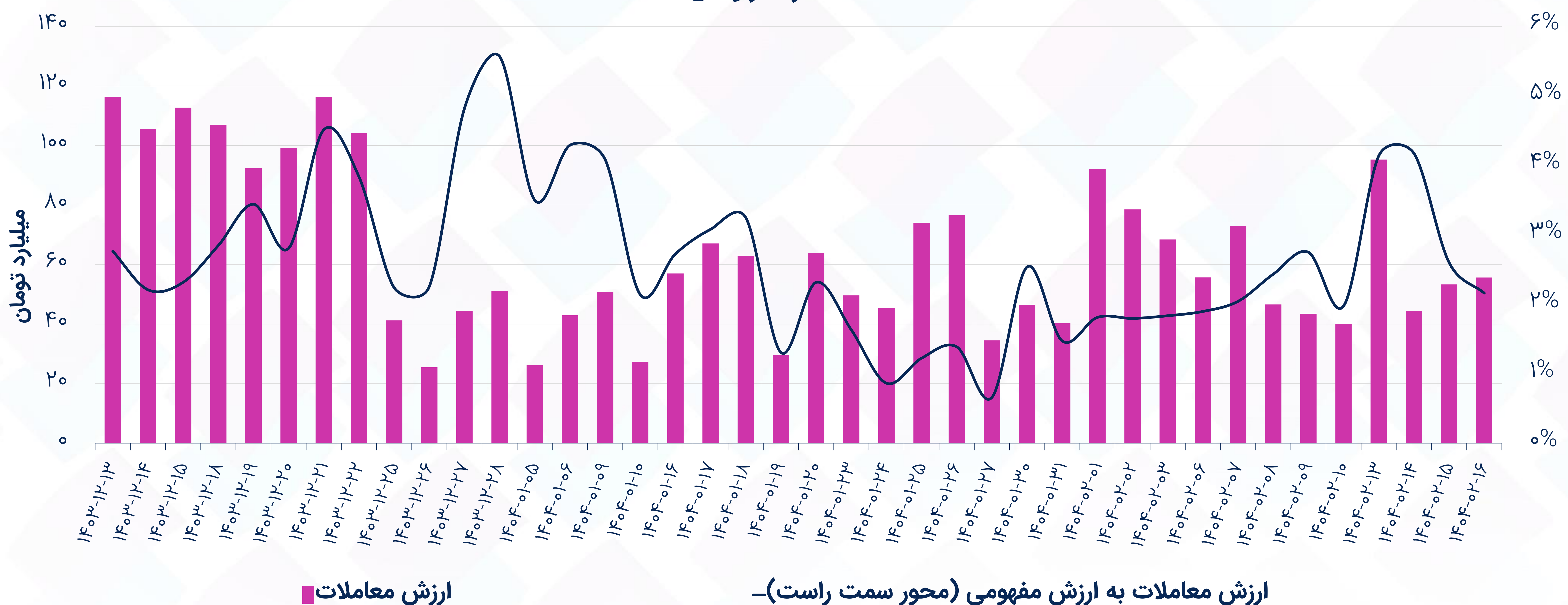
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



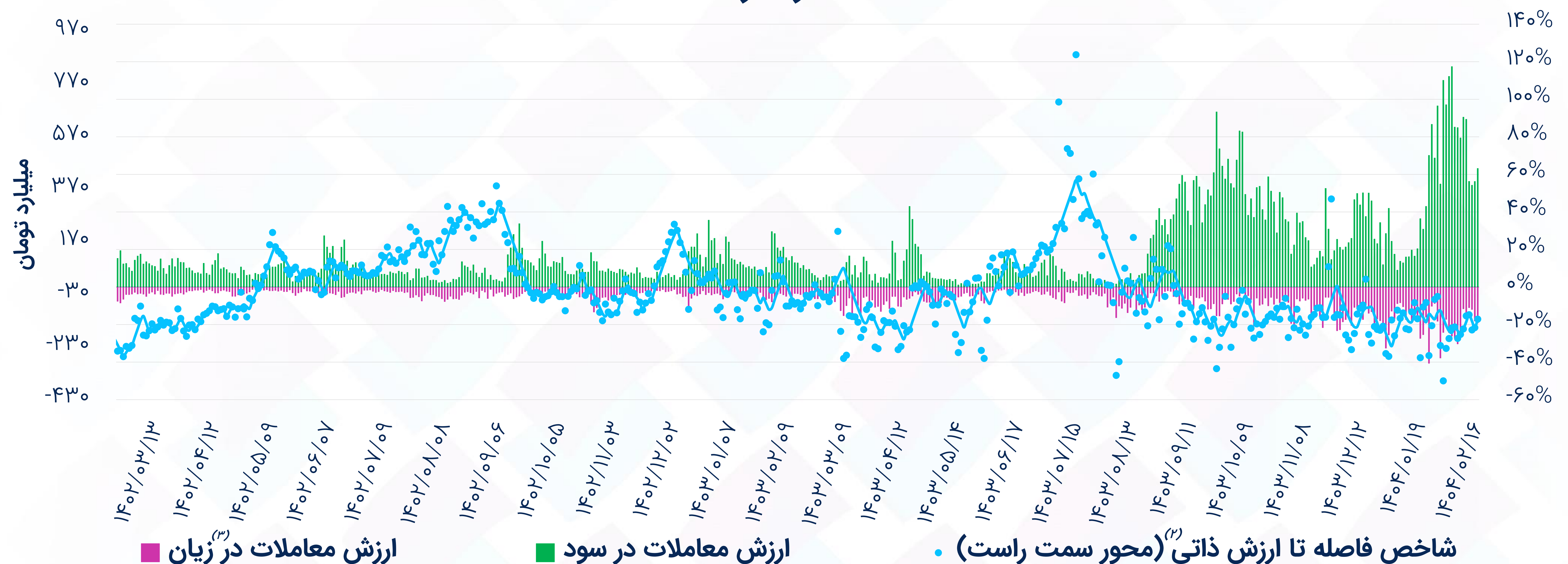
اختیار فروش



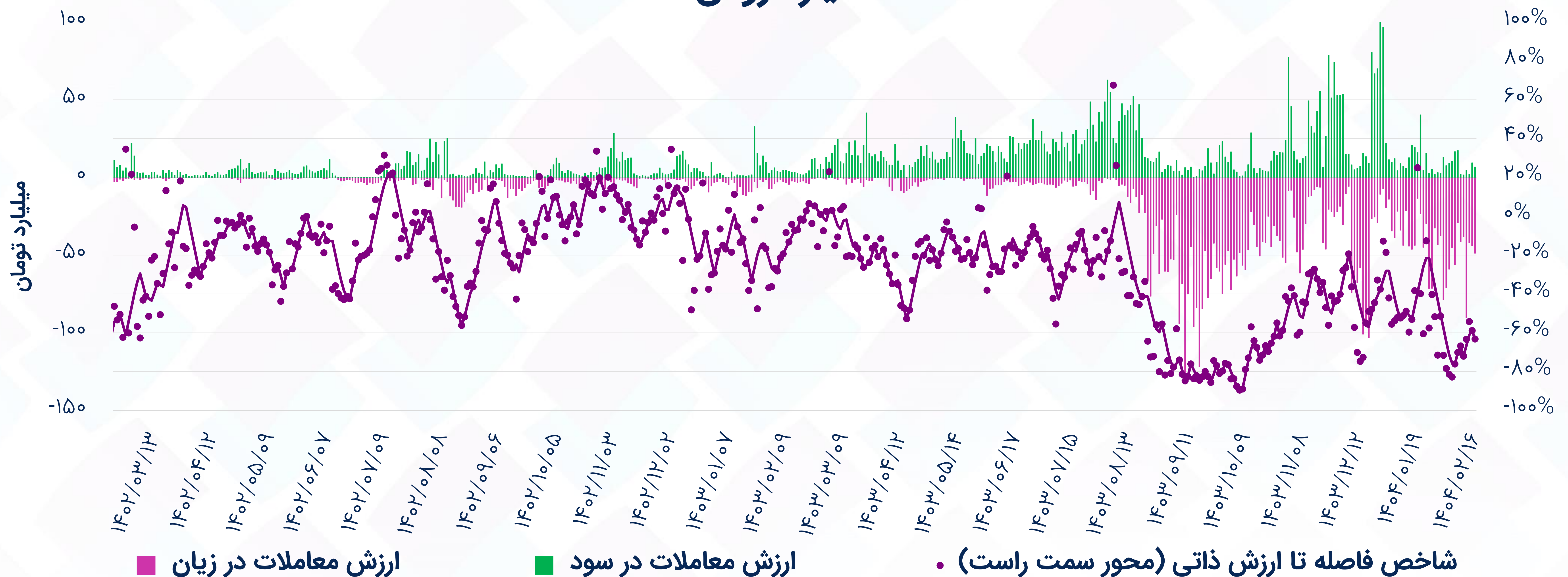
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۲۷۳.۷	۳,۹۵۳.۴	۱۶۱.۰	۱۱۲.۷	(۳۰.۶%)
خودرو	۱۳	۱۷۹.۳	۱,۲۹۵.۵	۱۷۷.۶	۱.۷	۱.۹%
شستا	۴۰	۴۴.۳	۶۷۲.۰	۳۳.۴	۱۰.۹	(۱۸.۰%)
ذوب	۲۴	۲۸.۹	۳۱۴.۵	۲۵.۹	۲.۹	(۱۵.۸%)
وتجارت	۲۳	۲۶.۳	۲۲۲.۳	۲۴.۷	۱.۶	(۴.۵%)
وبملت	۲۴	۹.۶	۱۵۸.۱	۳.۷	۵.۹	(۴۳.۹%)
وبصادر	۱۵	۸.۱	۴۶.۵	۷.۶	۰.۵	(۱۵.۵%)

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	۸	۳۱,۷۰۸.۱	۸۶۷,۵۷۴.۴	۲۶.۶	۳۱,۶۸۱.۵	(۶۶.۱%)
اهرم	۲۸	۲۱,۲۲۰.۶	۱,۵۲۴,۷۶۴.۹	۶,۷۴۰.۷	۱۴,۴۷۹.۹	(۵۶.۹%)
شستا	۸	۲,۴۱۲.۱	۱۵۸,۱۰۴.۴	۳۴.۸	۲,۳۷۷.۳	(۸۰.۸%)
ذوب	۴	۲۳۶.۰	۲۰,۴۱۳.۶	۰.۰	۲۳۶.۰	(۶۶.۰%)
وتعاون	۳	۲۹.۱	۱,۶۳۳.۰	۲.۷	۲۶.۳	(۷۶.۳%)
وبملت	۲	۱۸.۸	۸۱۰.۰	۱۲.۷	۶.۱	(۴۱.۵%)
وتجارت	۵	۹.۵	۵۵۴.۸	۹.۰	۰.۵	۴.۲%

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۵۹۹,۱۵۲

شستا ۱۲۳,۸۵۱

وبملت ۹۸,۸۸۲

فولاد ۳۵,۳۲۰

ذوب ۲۱,۸۹۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۱۴۹,۵۵۷.۹)

وتجارت (۲۴,۱۶۵.۷)

کرومیت (۱۴.۹)

خاور (۱۴.۷)

سامان (۰.۲)

میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۱۳,۱۳۷

خودرو ۲,۴۶۴

شستا ۲,۳۷۳

ذوب ۱,۵۶۵

وبملت ۱,۳۷۸

وتجارت ۷۳۲

وبصادر ۵۸۵

فولاد ۵۲۳

شتاب ۲۴۴

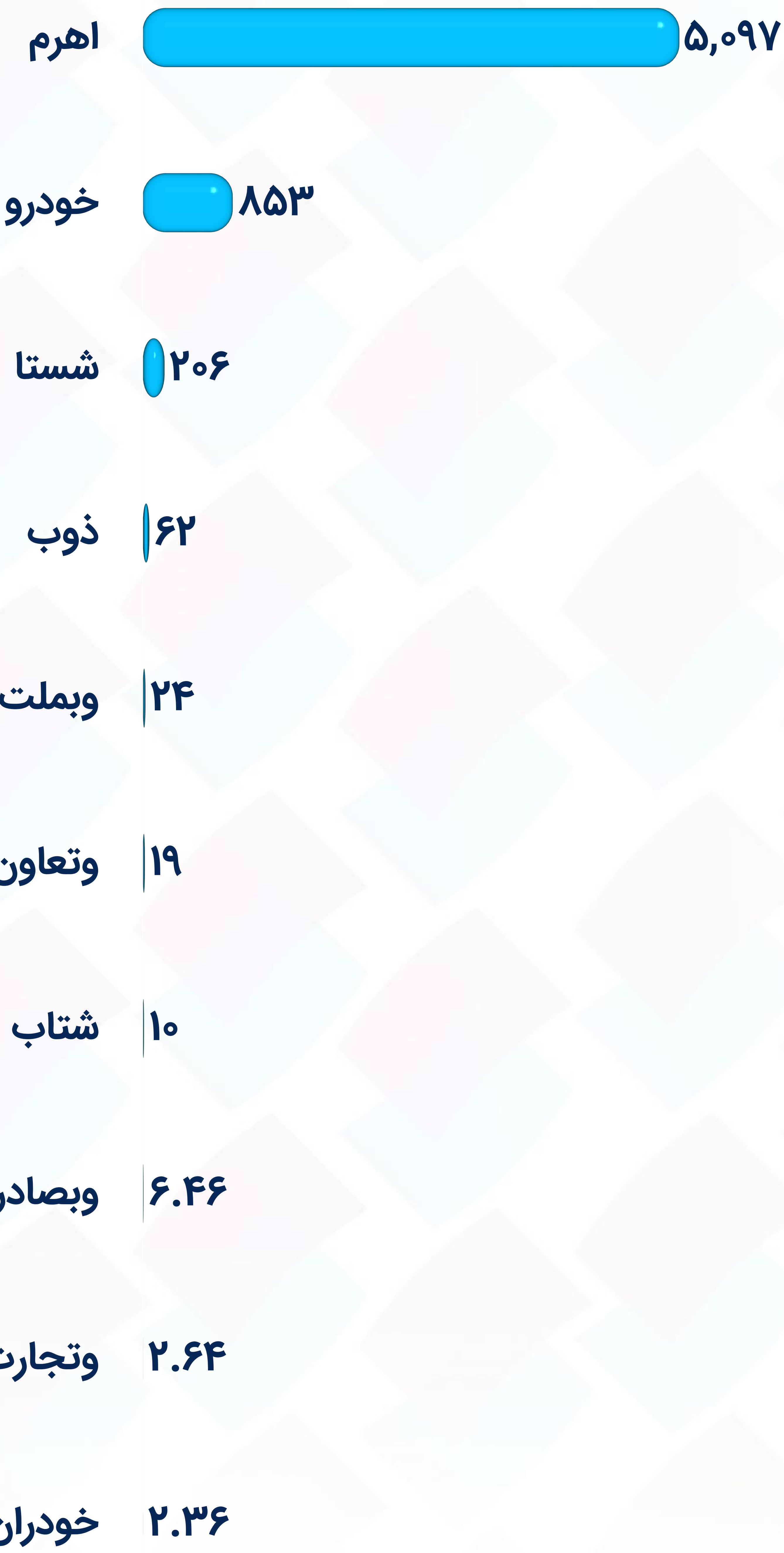
شپنا ۲۱۳

میلیارد تومان

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

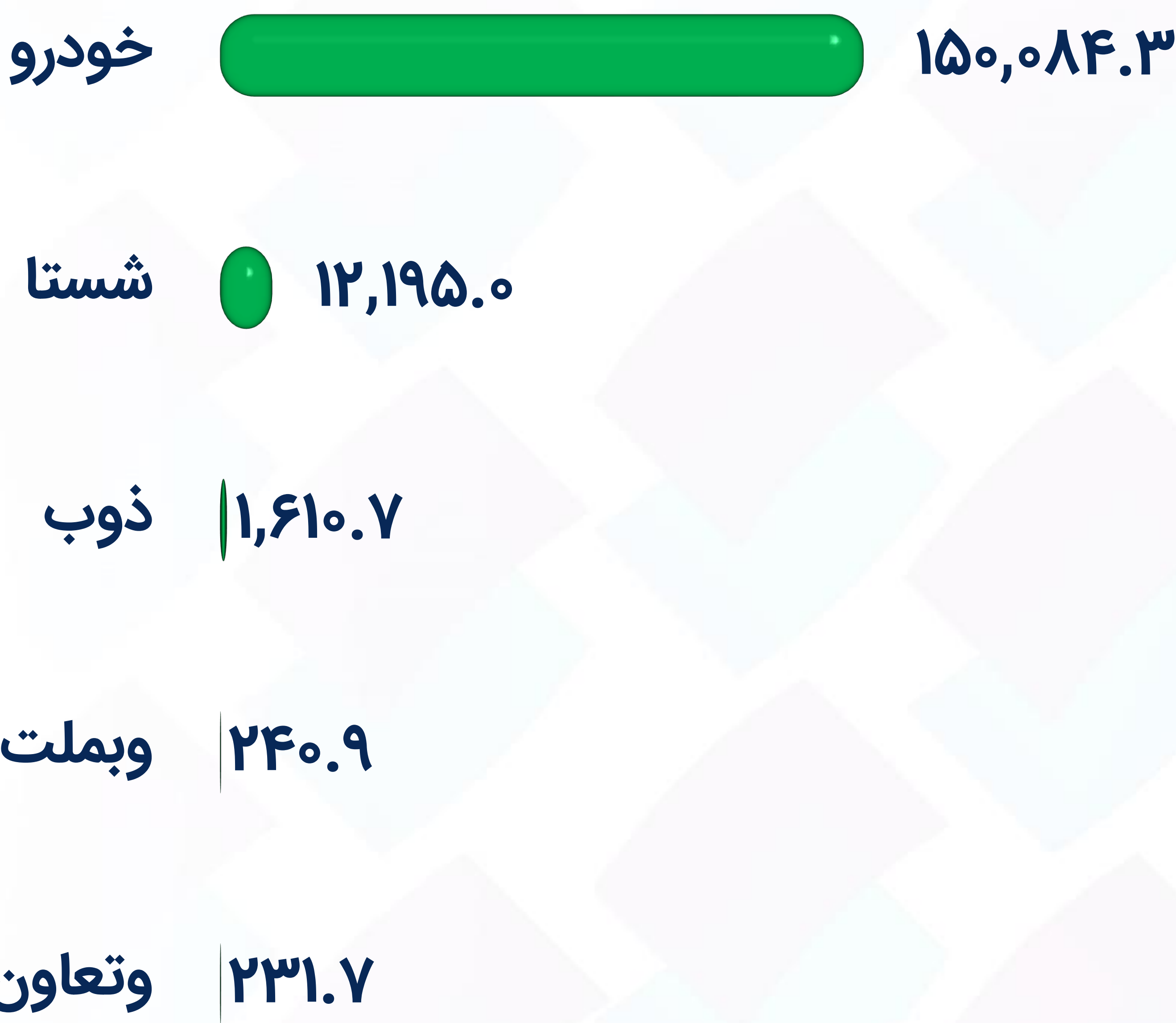
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



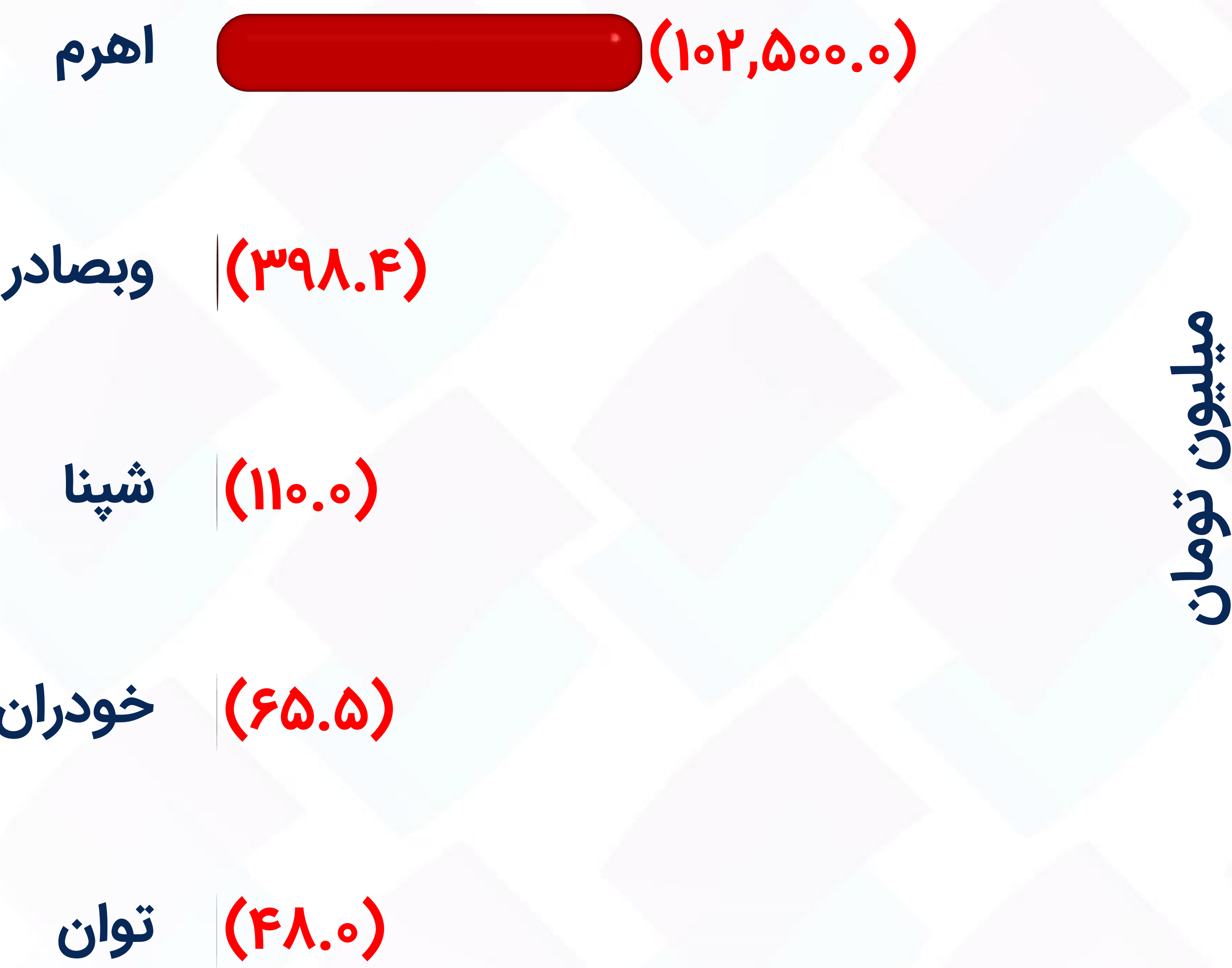
میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

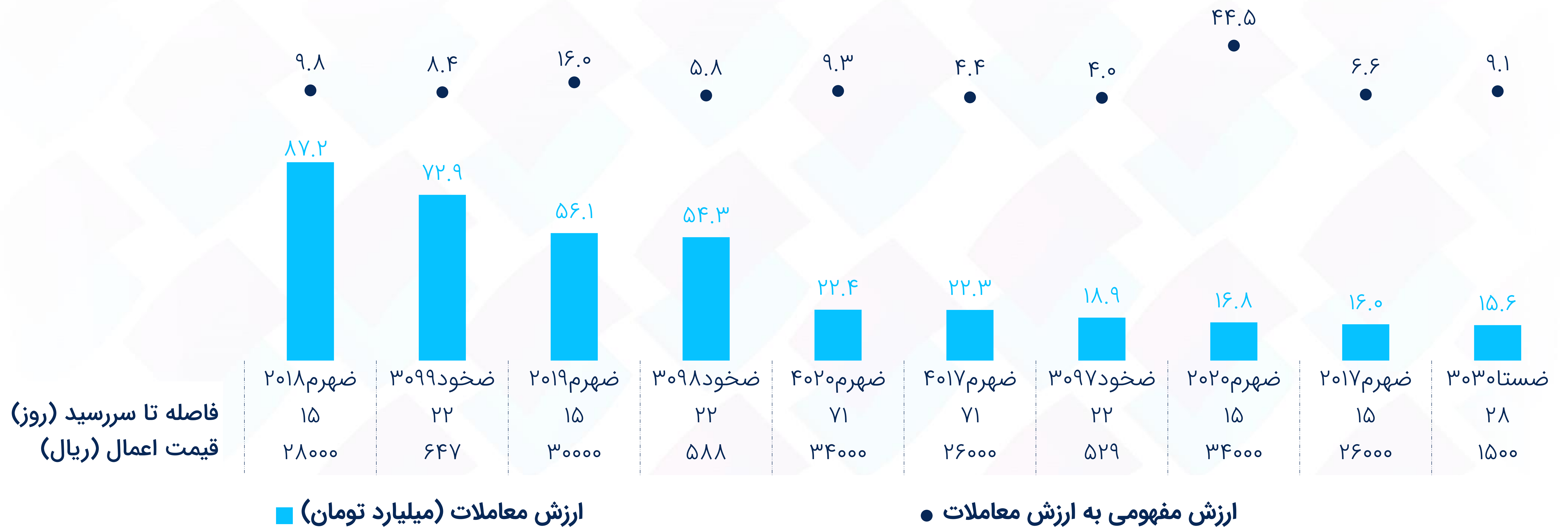
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضبیید ۲۰۰۴	بیدار	۱۳,۰۰۰	۱۵	۳.۶	۳,۲۲۷	۱۶,۹۰۰	۱۶,۲۲۷	(۴.۰%)	۵.۰	۱.۰۰	۴,۱۱۳	۲۷%
ضسامان ۲۰۰۵	سامان	۱,۵۰۰	۵	۲.۲	۶۰۷	۲,۲۳۷	۲,۱۰۷	(۵.۸%)	۳.۵	۱.۰۰	۷۴۵	۲۳%
ضشنا ۴۰۱۶	شپنا	۳,۱۶۹	۶۴	۸۷۴.۷	۸۸۰	۴,۰۱۳	۴,۰۴۹	۰.۹%	۴.۶	۰.۹۹	۱,۰۲۵	۱۶%
ضموج ۲۱۸	موج	۲۴,۰۰۰	۵	۶۴.۰	۴,۲۴۱	۲۸,۷۶۱	۲۸,۲۴۱	(۱.۸%)	۶.۷	۱.۰۰	۴,۸۹۳	۱۵%
ضتوان ۲۰۲	توان	۱۷,۰۰۰	۵	۲۴۰.۳	۹,۰۰۰	۲۷,۱۸۹	۲۶,۰۰۰	(۴.۴%)	۲.۹	۱.۰۰	۱۰,۲۸۲	۱۴%

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	۳۶	۵۳.۱	۹	۵۲۷	۱,۰۰۹	۹۱%	۱۱۲.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۸	۷.۴	۸	۳,۹۸۹	۶,۴۸۸	۶۳%	۸۱۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۳۰۴۳	ذوب	۹۰۰	۳۶	۵.۲	۸	۵۲۷	۹۰۸	۷۲%	۱۱۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۵	۷۳۱.۶	۷۴	۲۹,۸۹۰	۴۲,۰۷۴	۴۱%	۵۶۸.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۱	فولاد	۵,۴۰۰	۲۸	۱۷.۹	۳۲	۳,۹۸۹	۵,۴۳۲	۳۶%	۱۶۹.۸	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 ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۲۸	۲۶.۳	۵۲۵	۱,۶۳۳	۱,۶۷۵	۲.۶%	۳.۲	-۱.۰۰	۵۰۴	(۳.۹%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۵	۱,۹۷۸.۹	۳,۹۰۱	۲۹,۸۹۰	۳۰,۰۹۹	۰.۷%	۷.۷	-۰.۹۱	۳,۶۴۴	(۶.۶%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴۳	۹۶.۶	۳,۵۷۸	۲۹,۸۹۰	۳۰,۴۲۲	۱.۸%	۸.۵	-۰.۷۴	۳,۳۱۷	(۷.۳%)
طهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۵	۵۰.۰	۱۲,۵۰۰	۲۹,۸۹۰	۲۹,۵۰۰	(۱.۳%)	۲.۴	-۱.۰۰	۱۱,۴۲۲	(۸.۶%)
طهرم ۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۵	۱۵.۳	۸,۵۰۰	۲۹,۸۹۰	۲۹,۵۰۰	(۱.۳%)	۳.۵	-۱.۰۰	۷,۴۹۰	(۱۱.۹%)

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
طهرم ۲۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۵	۰.۰	۱	۲۹,۸۹۰	۱۵,۹۹۹	(۴۶.۵%)	۱۵,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۲۲	۰.۰	۲	۷۰۲	۲۸۰	(۶۰.۱%)	۱۴۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۵	۰.۰	۲	۲۹,۸۹۰	۱۷,۹۹۸	(۳۹.۸%)	۸,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۹۲	خودرو	۳۵۳	۲۲	۰.۰	۶	۷۰۲	۳۴۷	(۵۰.۶%)	۵۷.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۵	۱۲.۴	۲۴	۲۹,۸۹۰	۱۹,۹۷۶	(۳۳.۲%)	۸۳۲.۳	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

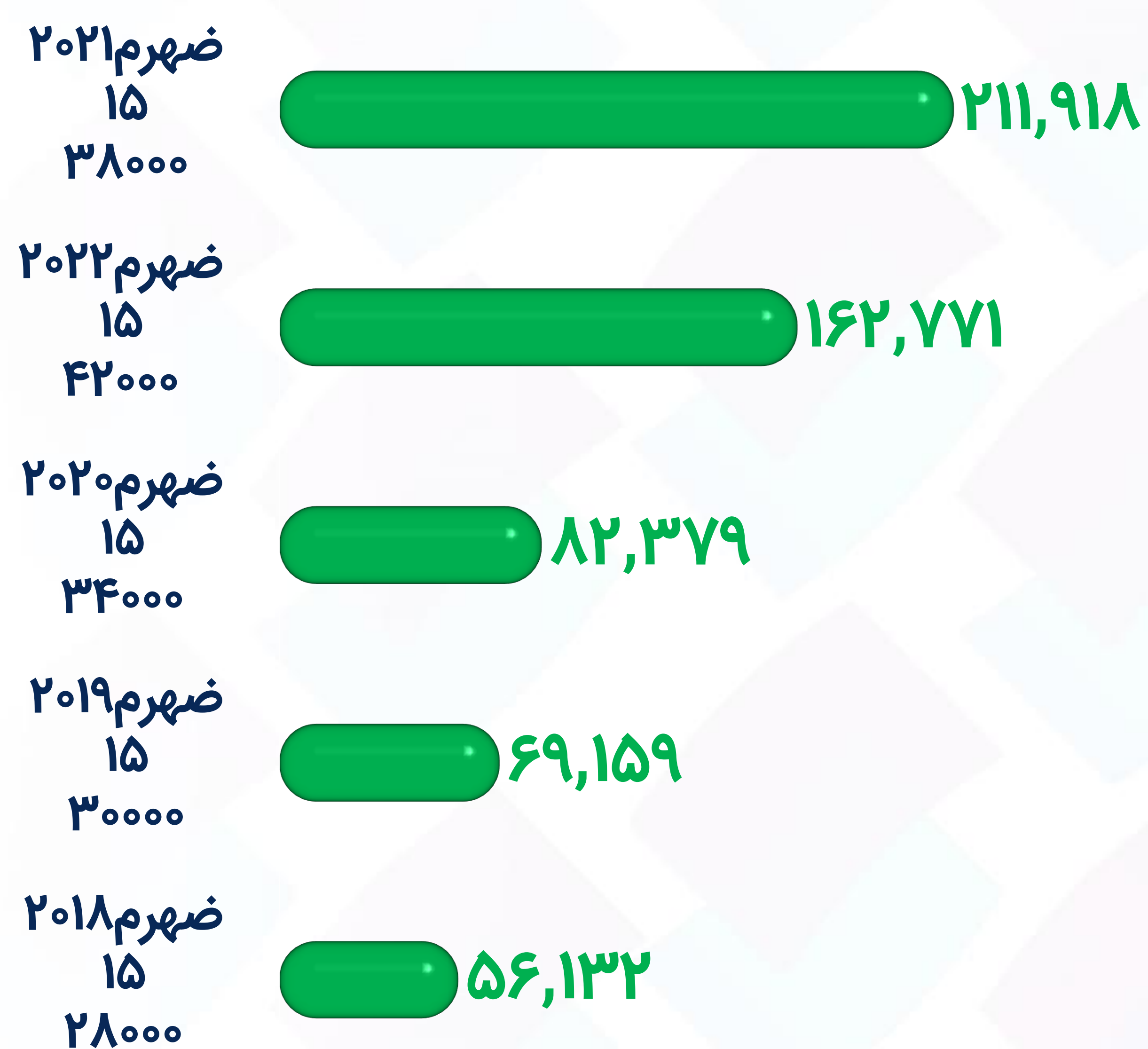
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

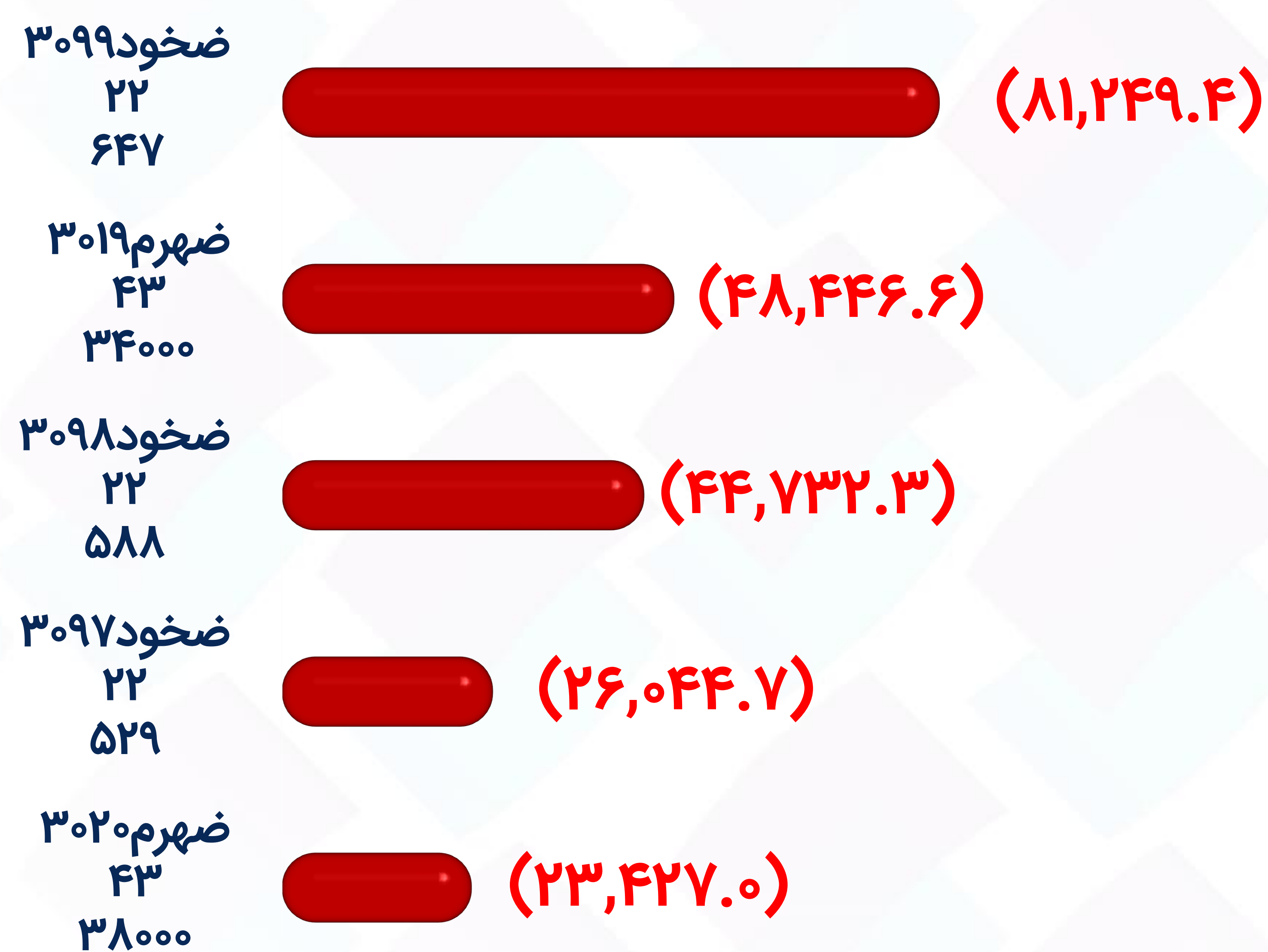
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

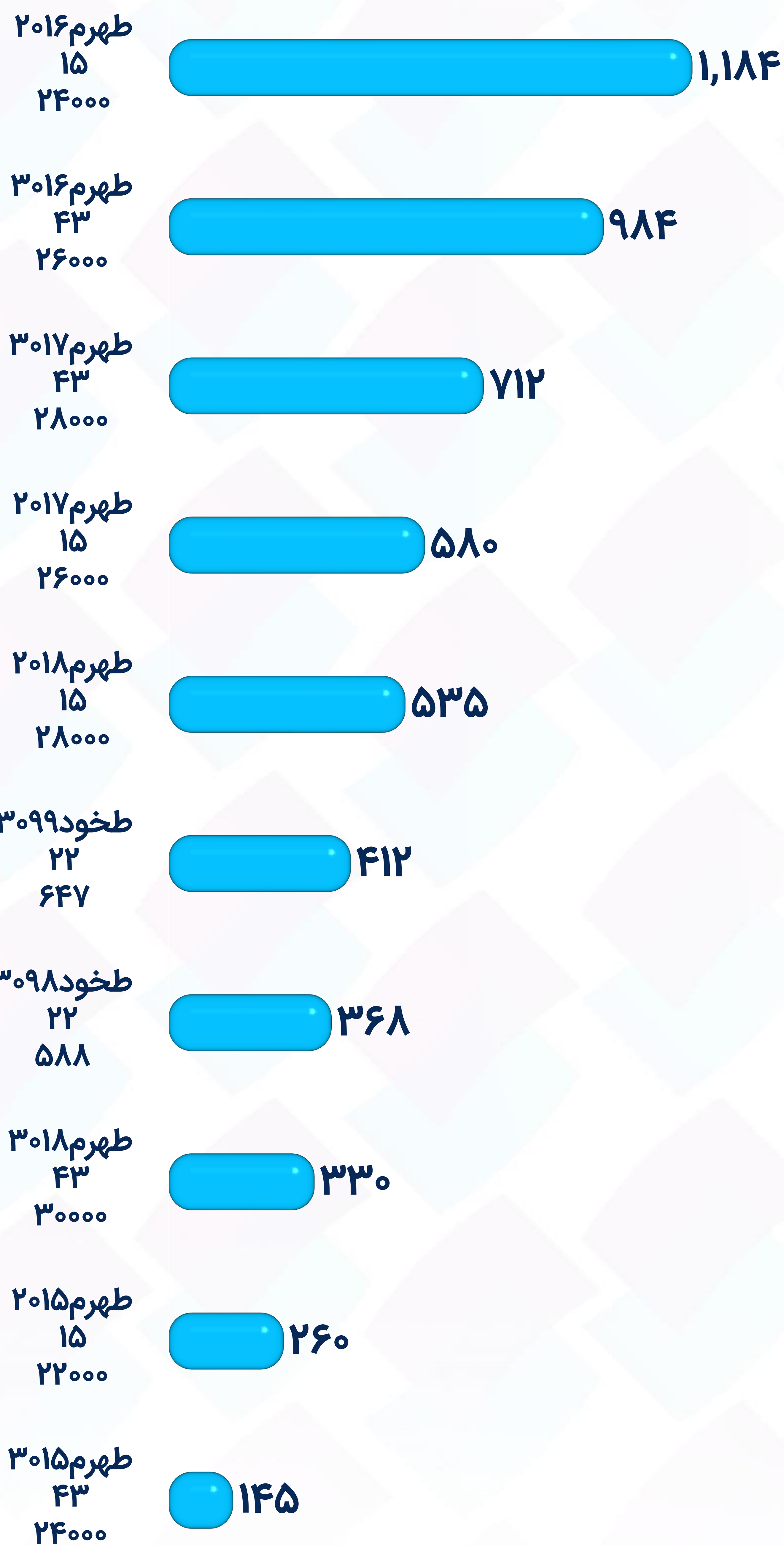


میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

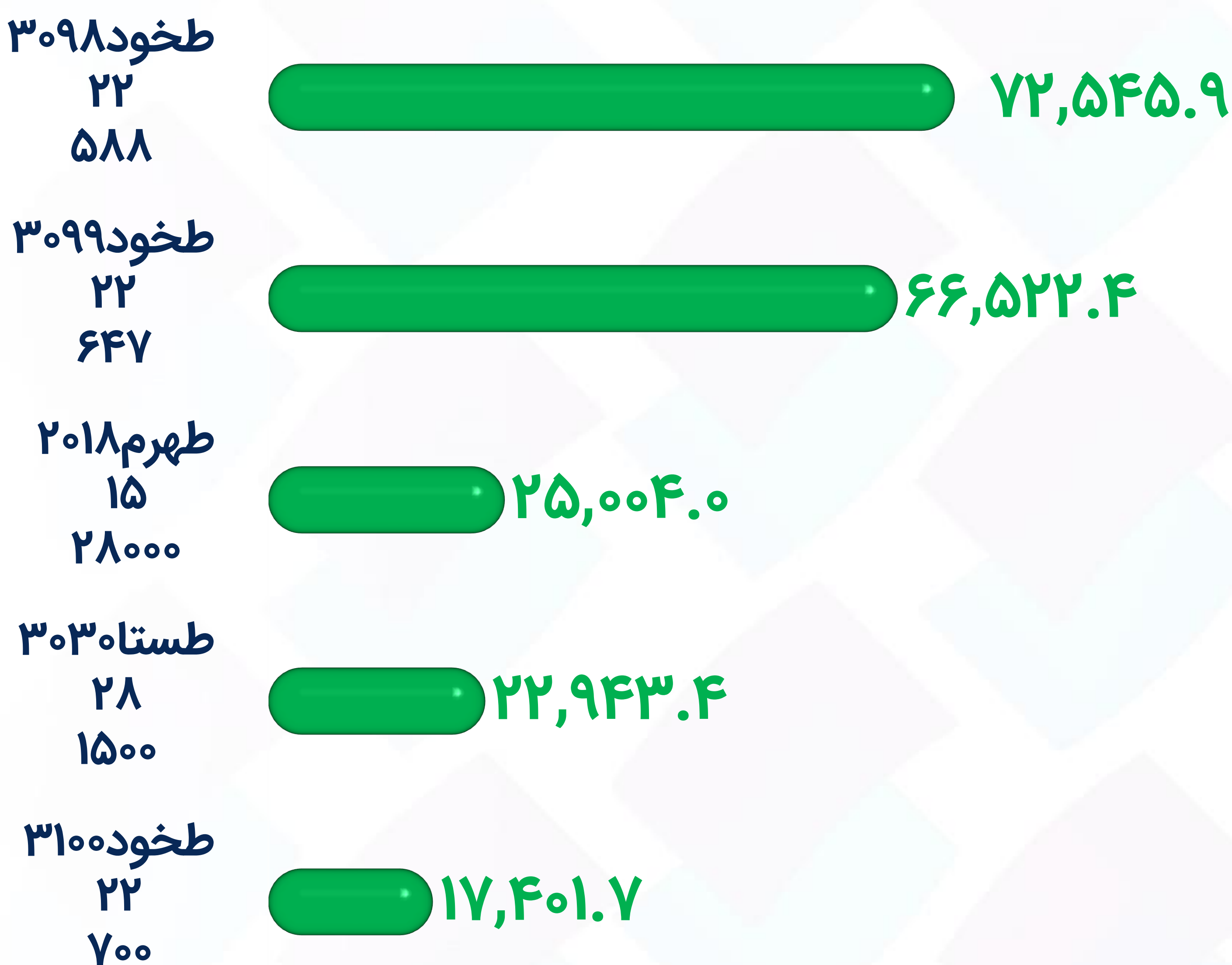
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

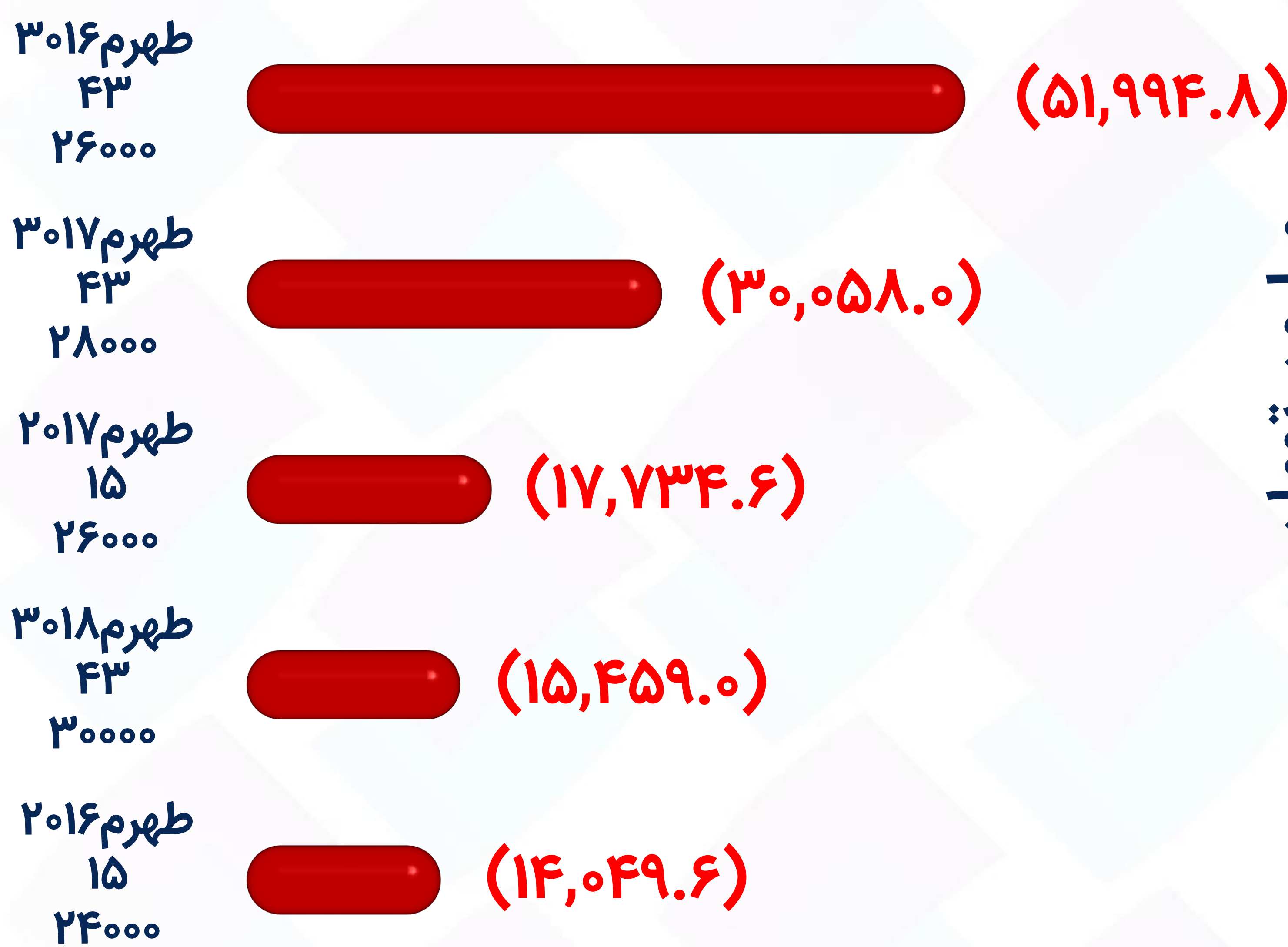
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



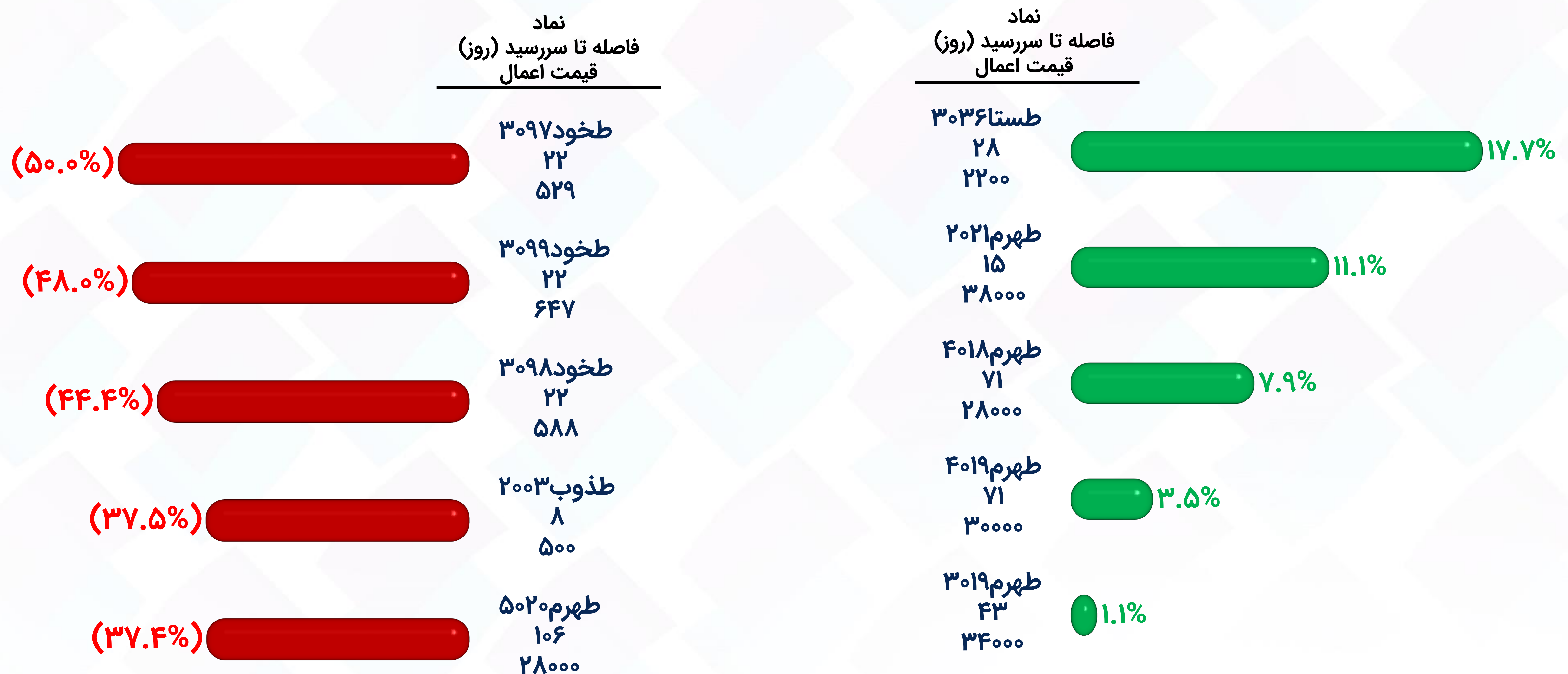
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

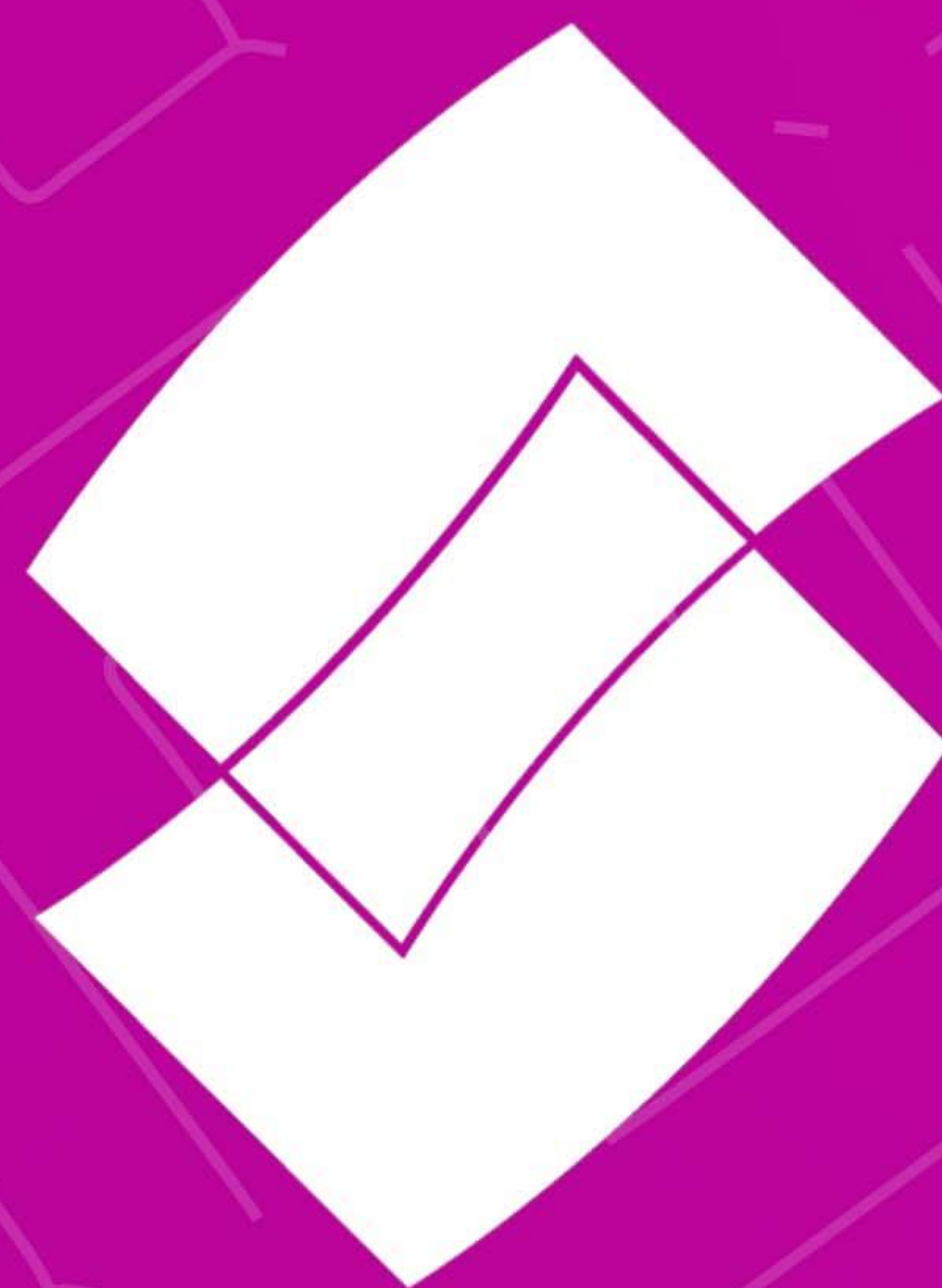
اختیار خرید



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.