

شماره
۴۷۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۰ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





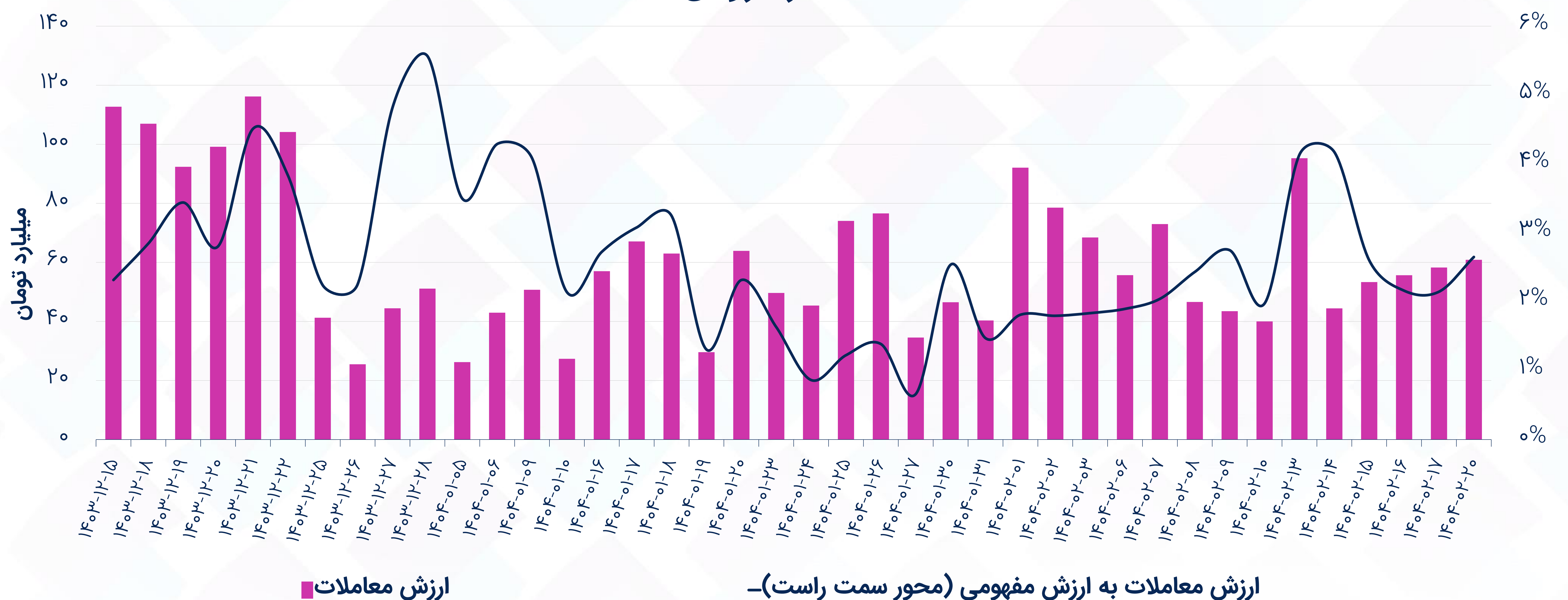
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



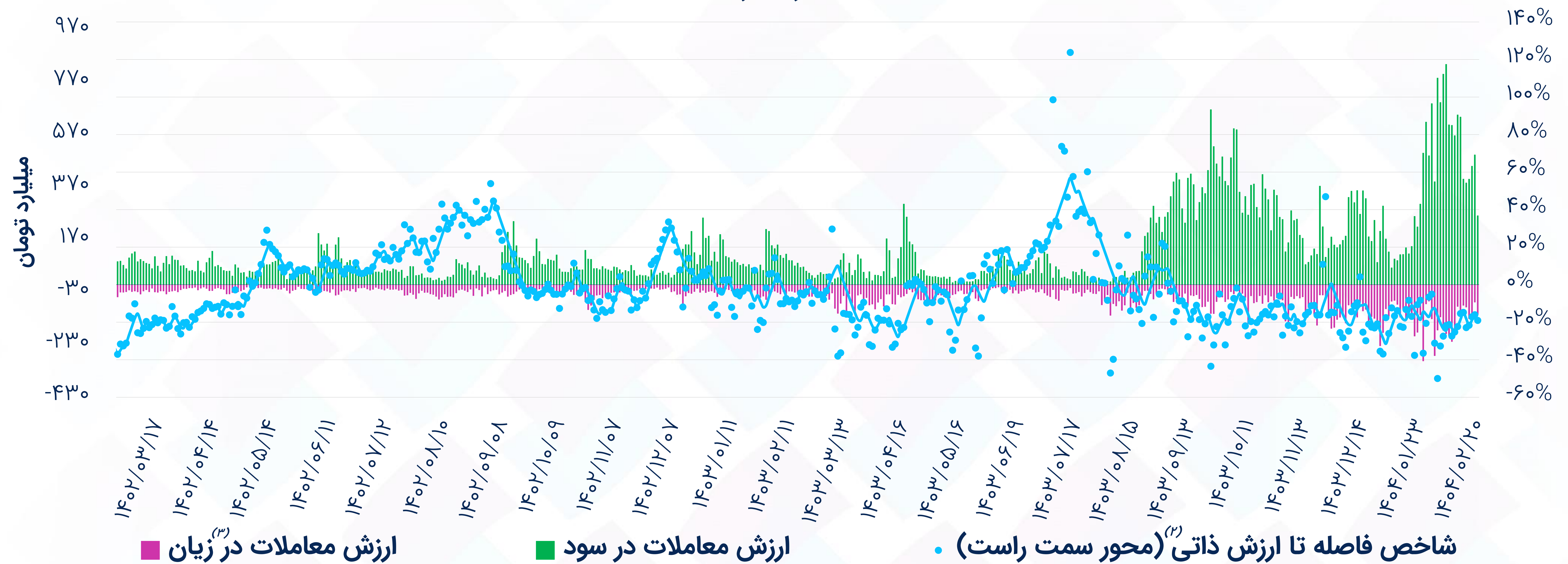
اختیار فروش



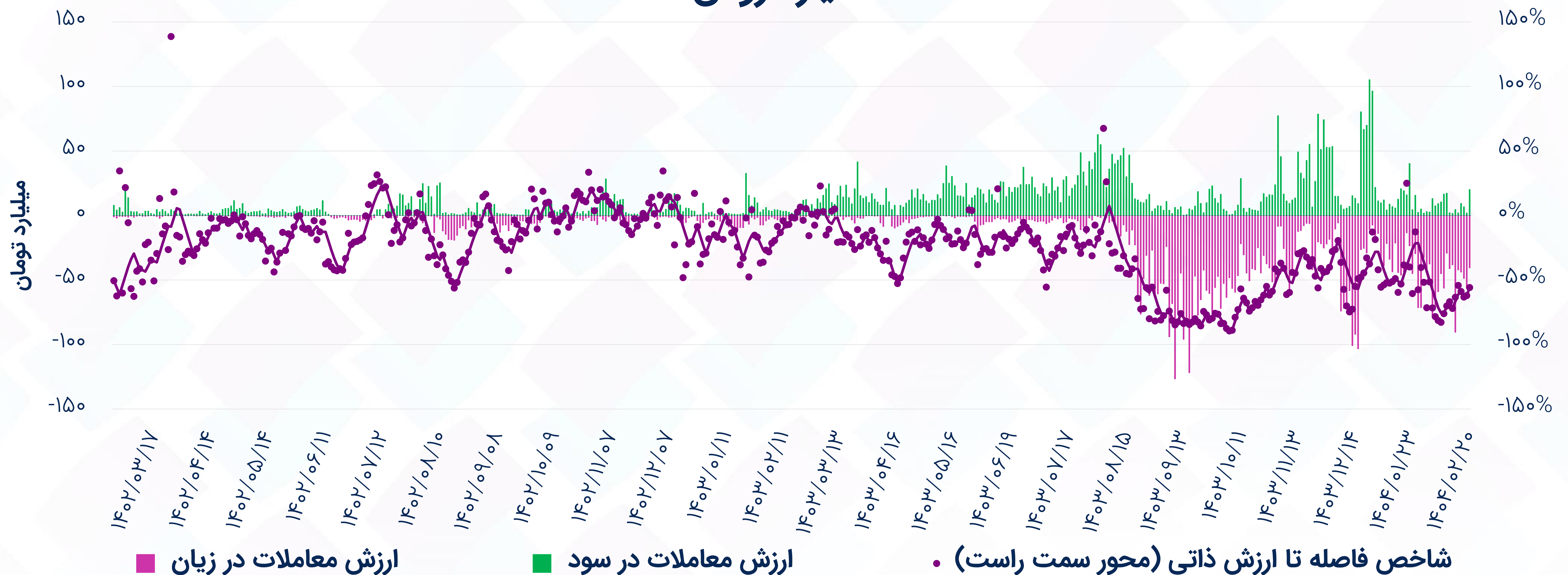
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

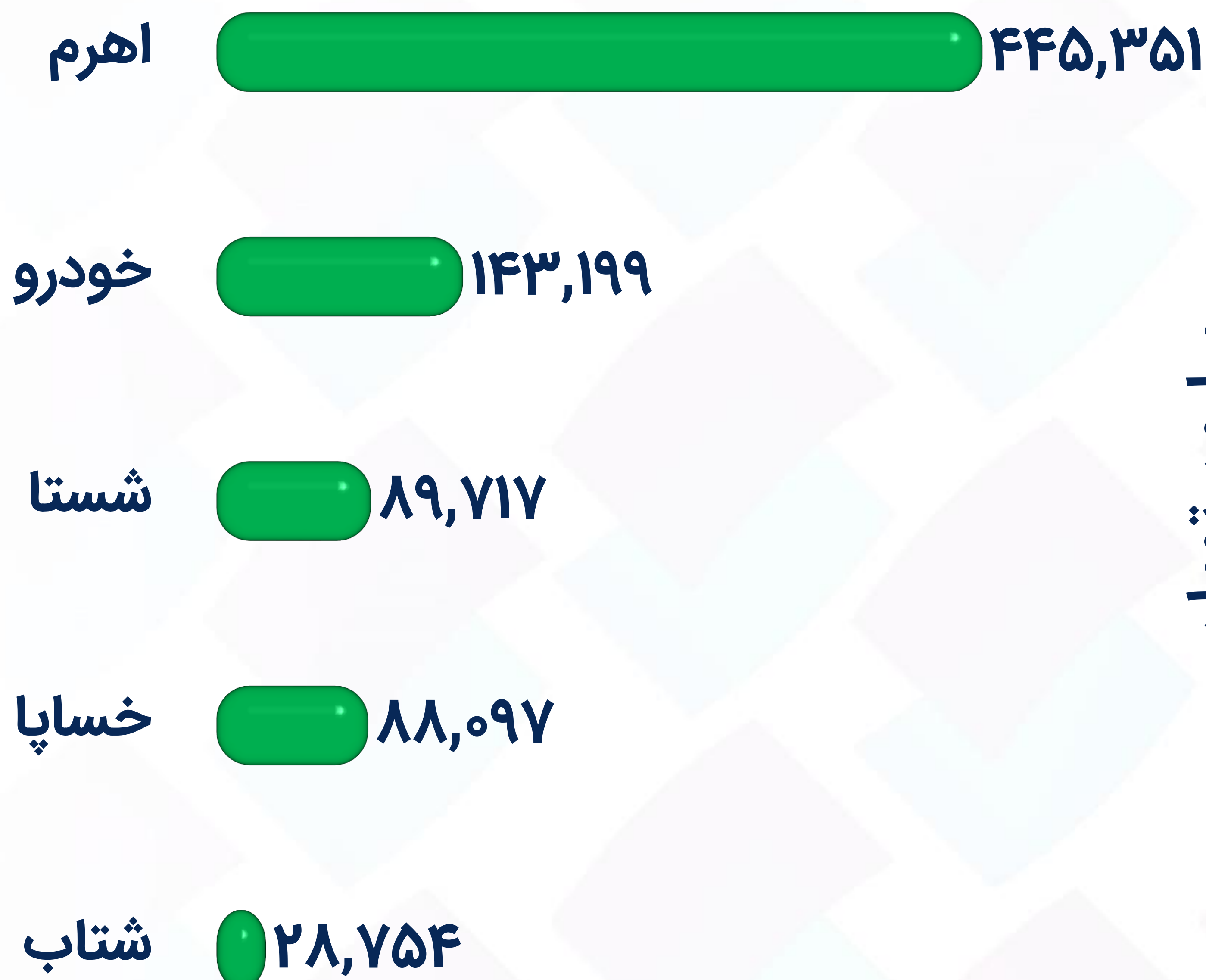
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۷	۱۷۶.۵	۳,۱۴۴.۳	۹۵.۰	۸۱.۵	(۲۹.۹%)
خودرو	۱۳	۸۹.۷	۱,۱۳۲.۹	۷۸.۵	۱۱.۲	(۳.۹%)
شستا	۳۴	۲۹.۶	۳۹۸.۹	۲۳.۸	۵.۷	(۲۰.۴%)
خسپا	۲۵	۲۵.۸	۲۶۲.۶	۱۷.۴	۸.۴	(۵.۵%)
ذوب	۲۵	۲۰.۴	۳۰۹.۲	۱۹.۲	۱.۲	(۹.۵%)
شتاب	۱۰	۱۲.۲	۴۱.۸	۱۱.۴	۰.۸	(۴.۱%)
وبملت	۲۶	۴.۲	۷۸.۹	۱.۶	۲.۶	(۳۶.۶%)

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	۲۳	۳۵,۸۴۴.۵	۱,۶۶۳,۵۶۷.۶	۱۳,۳۶۶.۱	۲۲,۴۷۸.۴	(۵۹.۷%)
خودرو	۷	۲۲,۵۰۰.۷	۴۸۰,۴۸۹.۳	۶,۸۳۰.۴	۱۵,۶۷۰.۳	(۴۸.۴%)
شستا	۵	۲,۳۲۰.۳	۱۳۴,۶۷۷.۵	۳۲.۲	۲,۲۸۸.۱	(۶۹.۴%)
ذوب	۳	۹۲.۱	۱۲,۱۳۵.۳	۰.۰	۹۲.۱	(۵۷.۷%)
خسپا	۲	۸۱.۰	۲,۴۸۸.۴	۰.۰	۸۱.۰	۷.۵%
وبملت	۴	۲۰.۵	۱,۲۰۸.۰	۱۰.۲	۱۰.۲	(۶۴.۱%)
وبصادر	۲	۴.۰	۱,۴۲۲.۶	۰.۰	۴.۰	(۱۰۰.۰%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



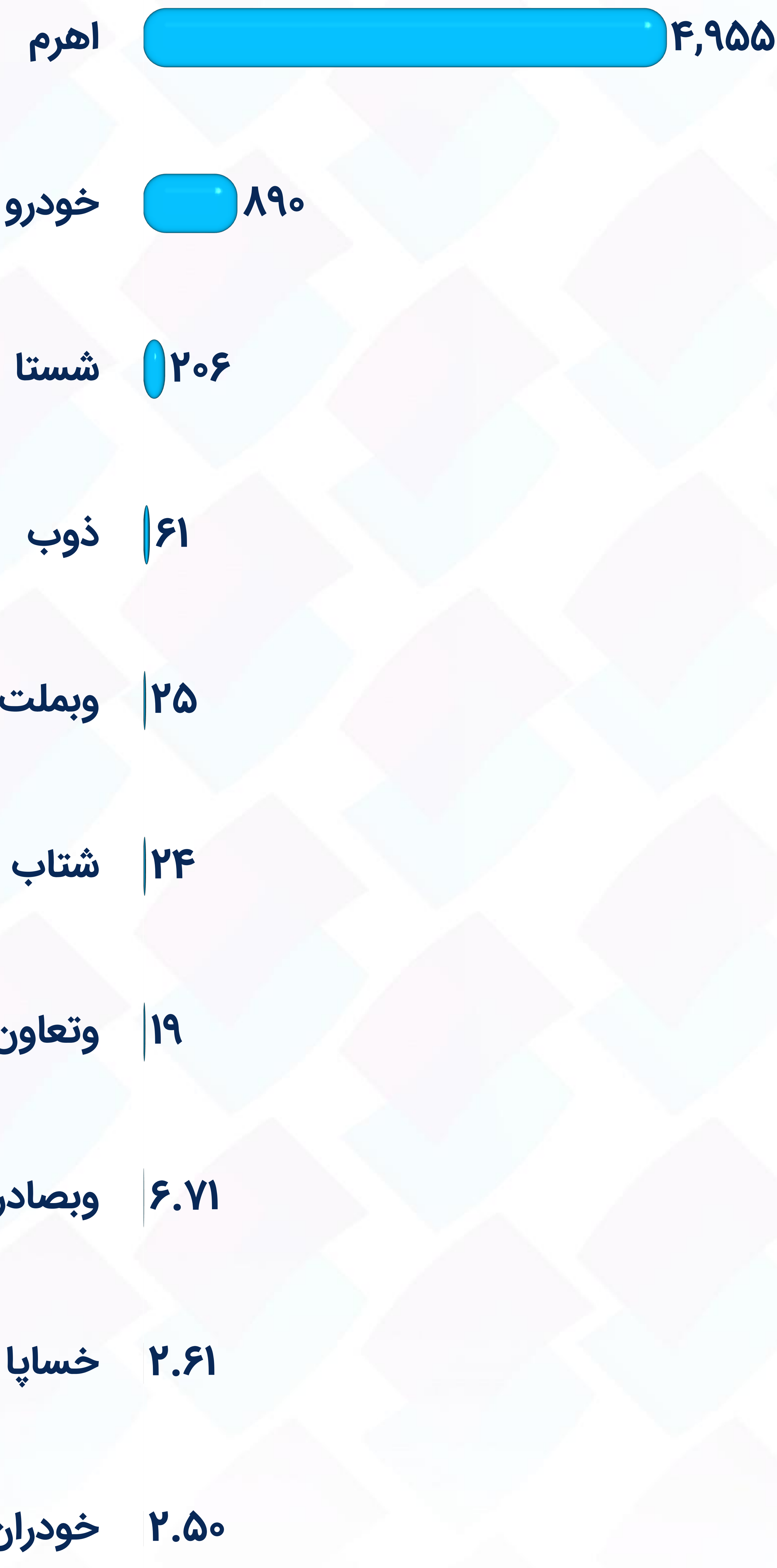
میلیون تومان



(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

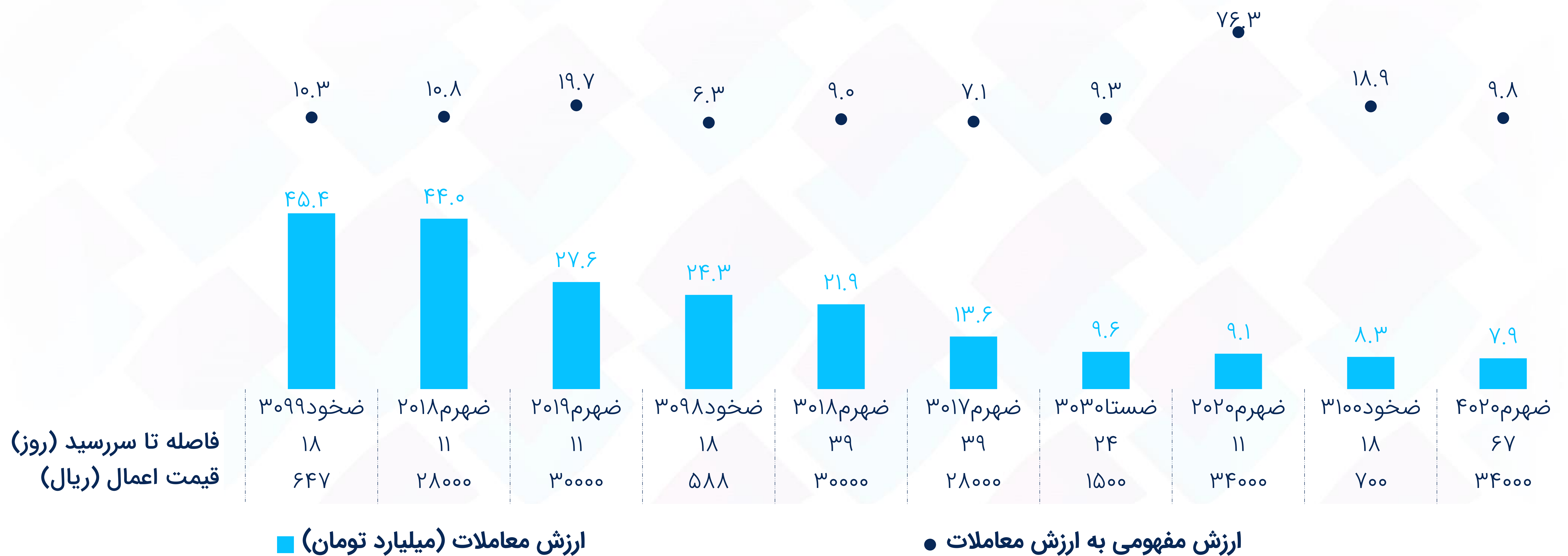
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



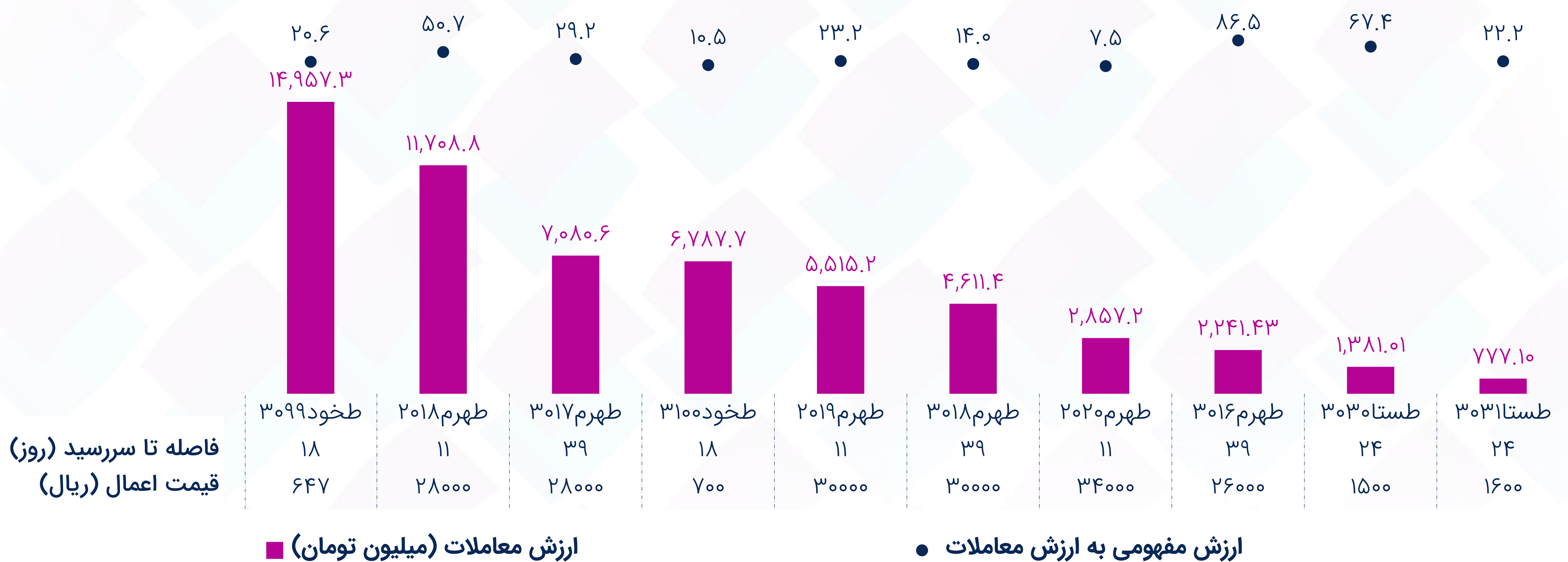
میلیون تومان

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
ضتاب ۳۰۰۶	شتاب	۱۵,۰۰۰	۲۴	۳۴.۱	۲,۲۵۵	۱۷,۲۸۰	۱۷,۲۵۵	(۰.۱%)	۷.۷	۰.۹۵	۲,۶۹۱	۱۹%
ضشنا ۴۰۱۳	شپنا	۲,۴۶۵	۶۰	۱۹.۹	۱,۵۲۱	۴,۰۲۲	۳,۹۸۶	(۰.۹%)	۲.۶	۱.۰۰	۱,۶۸۵	۱۱%
ضدوب ۲۰۰۱	ذوب	۳۰۰	۴	۴۱.۶	۲۰۶	۵۲۴	۵۰۶	(۳.۴%)	۲.۵	۱.۰۰	۲۲۶	۱۰%
ضستا ۴۰۲۴	شستا	۱,۰۰۰	۵۳	۴.۹	۶۱۱	۱,۶۱۷	۱,۶۱۱	(۰.۴%)	۲.۶	۱.۰۰	۶۶۵	۹%
ضدوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۴	۴,۷۵۱.۵	۱۱۷	۵۲۴	۵۱۷	(۱.۳%)	۴.۴	۱.۰۰	۱۲۷	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
ضدوب ۲۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۴	۸.۸	۱	۵۲۴	۸۰۱	۵۳%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۳۲	۱۲.۴	۵	۵۲۴	۱,۰۰۵	۹۲%	۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۴	۲.۰	۸	۳,۹۶۰	۶,۴۸۸	۶۴%	۸۱۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۲۰۰۵	ذوب	۷۰۰	۴	۲.۱	۱	۵۲۴	۷۰۱	۳۴%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۱	۱۵۱.۴	۴۳	۲۹,۹۲۰	۴۲,۰۴۳	۴۱%	۹۷۷.۷	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
تسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۱۱	۸۰.۸	۱۹	۵۶۳	۵۲۴	(۶.۹%)	۲۷.۶	-۰.۳۴	۲۰	۷.۷%
طهرم ۳۰۲۱	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۹	۱۴.۱	۱۰,۸۴۵	۲۹,۹۲۰	۳۱,۱۵۵	۴.۱%	۲.۹	-۰.۹۹	۱۰,۶۰۲	(۲.۲%)
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۱	۲,۸۵۷.۲	۳,۹۸۲	۲۹,۹۲۰	۳۰,۰۱۸	۰.۳%	۷.۵	-۰.۹۴	۳,۶۸۸	(۷.۴%)
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۱۸	۴۲.۶	۱۳۳	۶۸۰	۶۶۷	(۱.۹%)	۵.۰	-۰.۸۵	۱۱۱	(۱۶.۹%)
طهرم ۳۰۱۹	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۹	۳۱۰.۲	۴,۳۸۷	۲۹,۹۲۰	۲۹,۶۱۳	(۱.۰%)	۶.۸	-۰.۷۶	۳,۳۵۸	(۲۳.۵%)

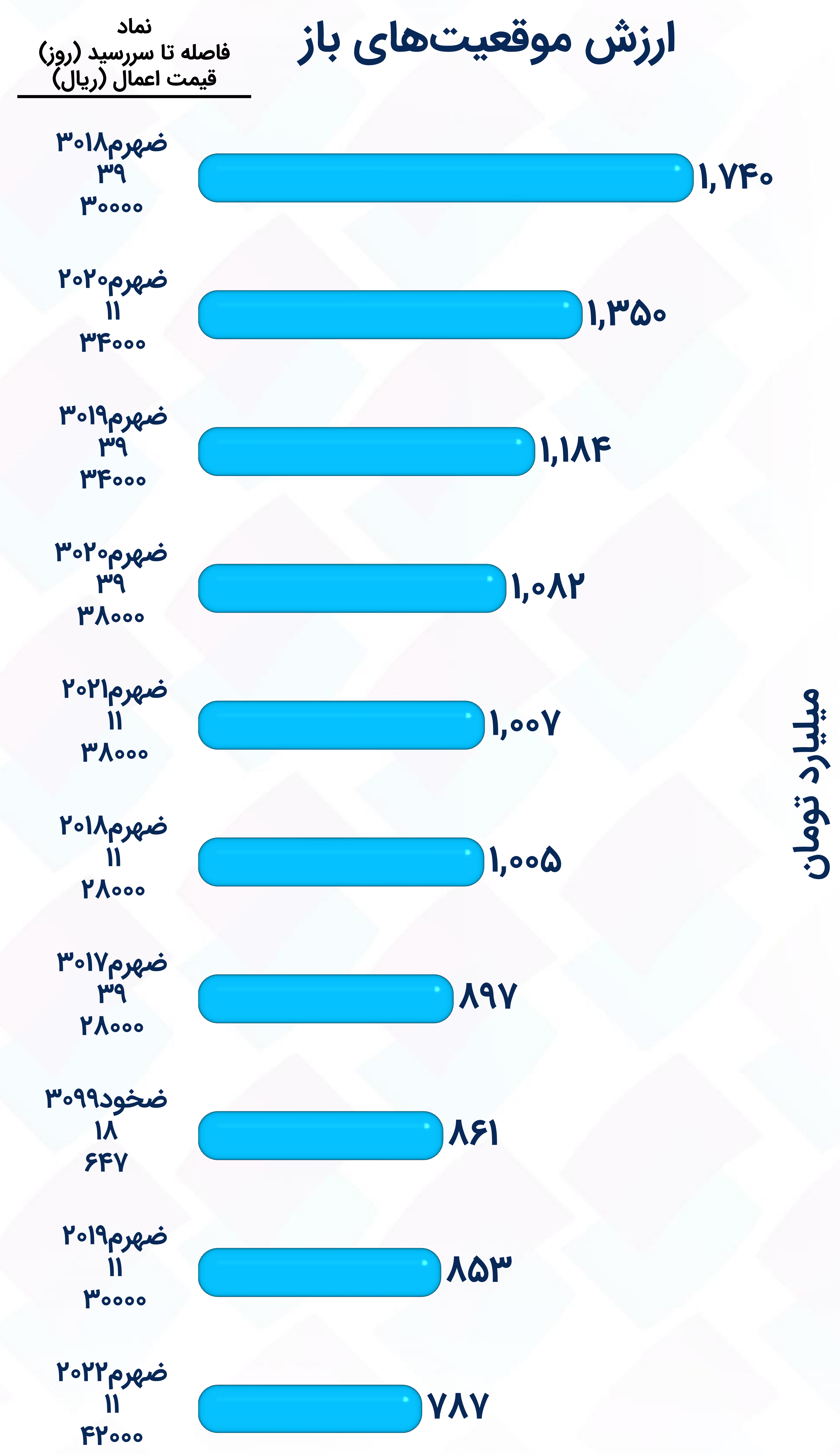
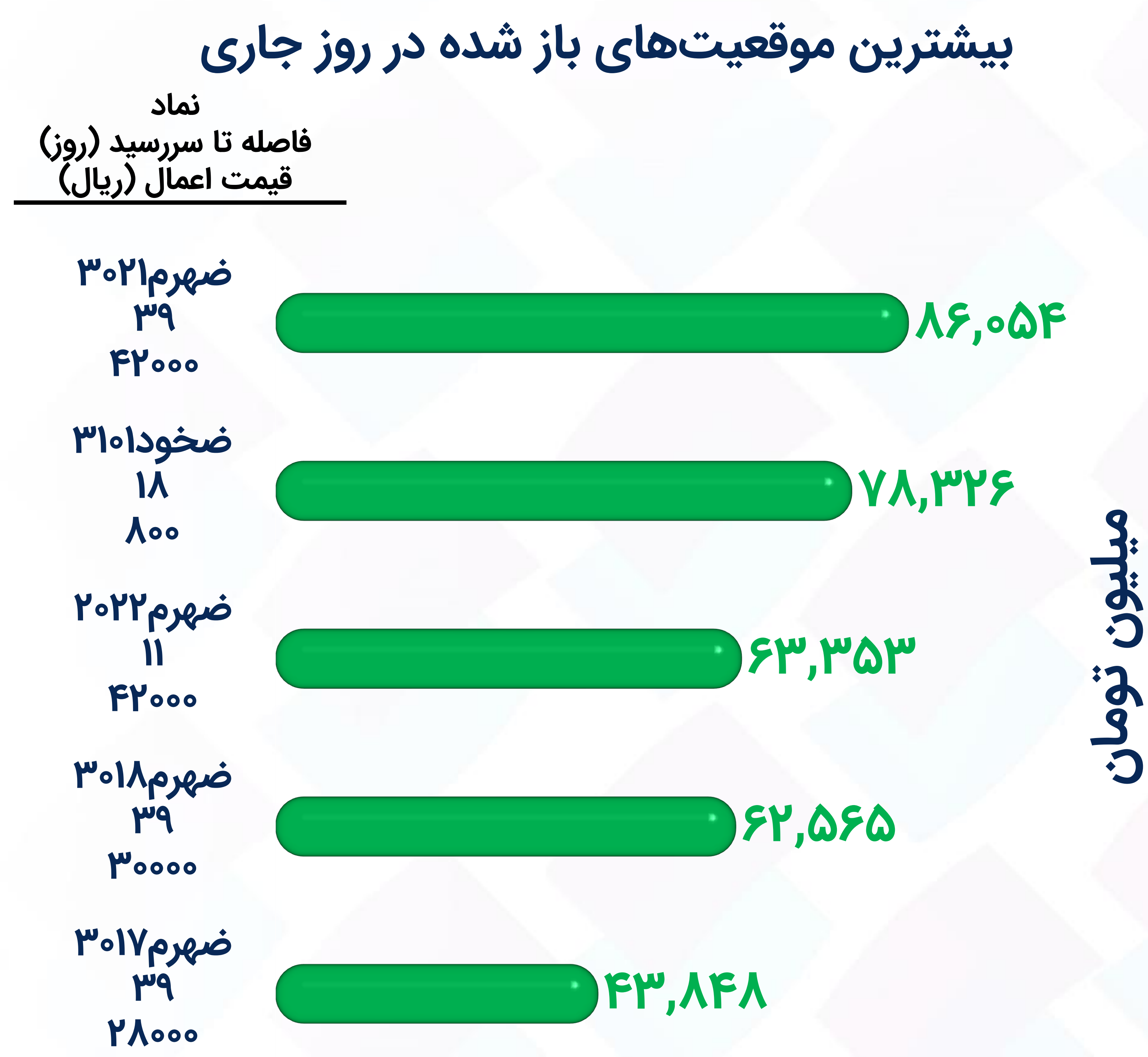
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طهرم ۲۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۱	۰.۰	۱	۲۹,۹۲۰	۱۵,۹۹۹	(۴۶.۵%)	۱۵,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۱۸	۶.۴	۱	۶۸۰	۲۸۱	(۵۸.۷%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۱	۰.۰	۵	۲۹,۹۲۰	۱۷,۹۹۵	(۳۹.۹%)	۳,۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۲۰۰۲	ذوب	۴۰۰	۴	۰.۲	۱	۵۲۴	۳۹۹	(۲۳.۹%)	۳۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۱	۶.۰	۱۱	۲۹,۹۲۰	۱۹,۹۸۹	(۳۳.۲%)	۱,۸۱۷.۲	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.



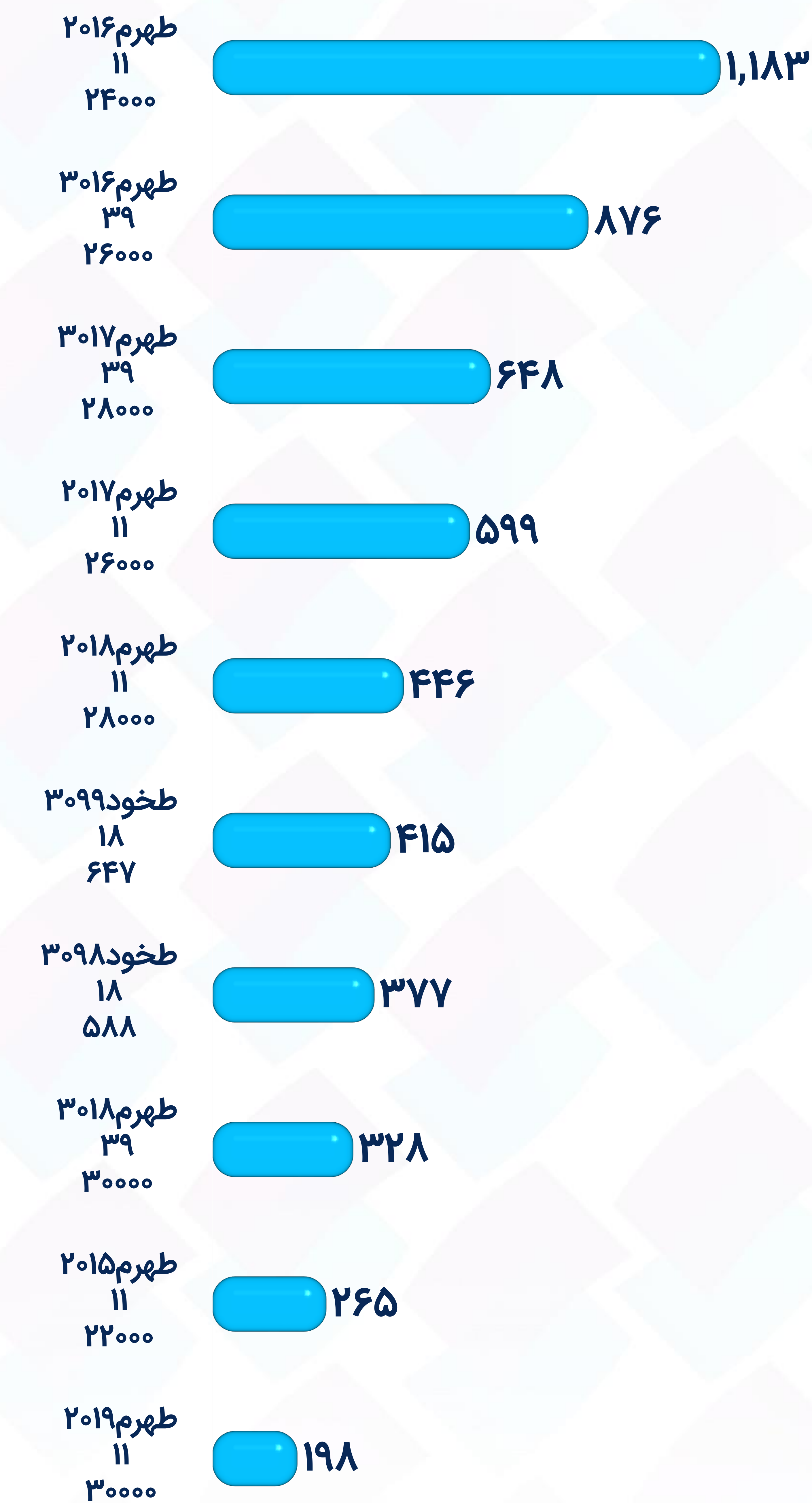
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



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

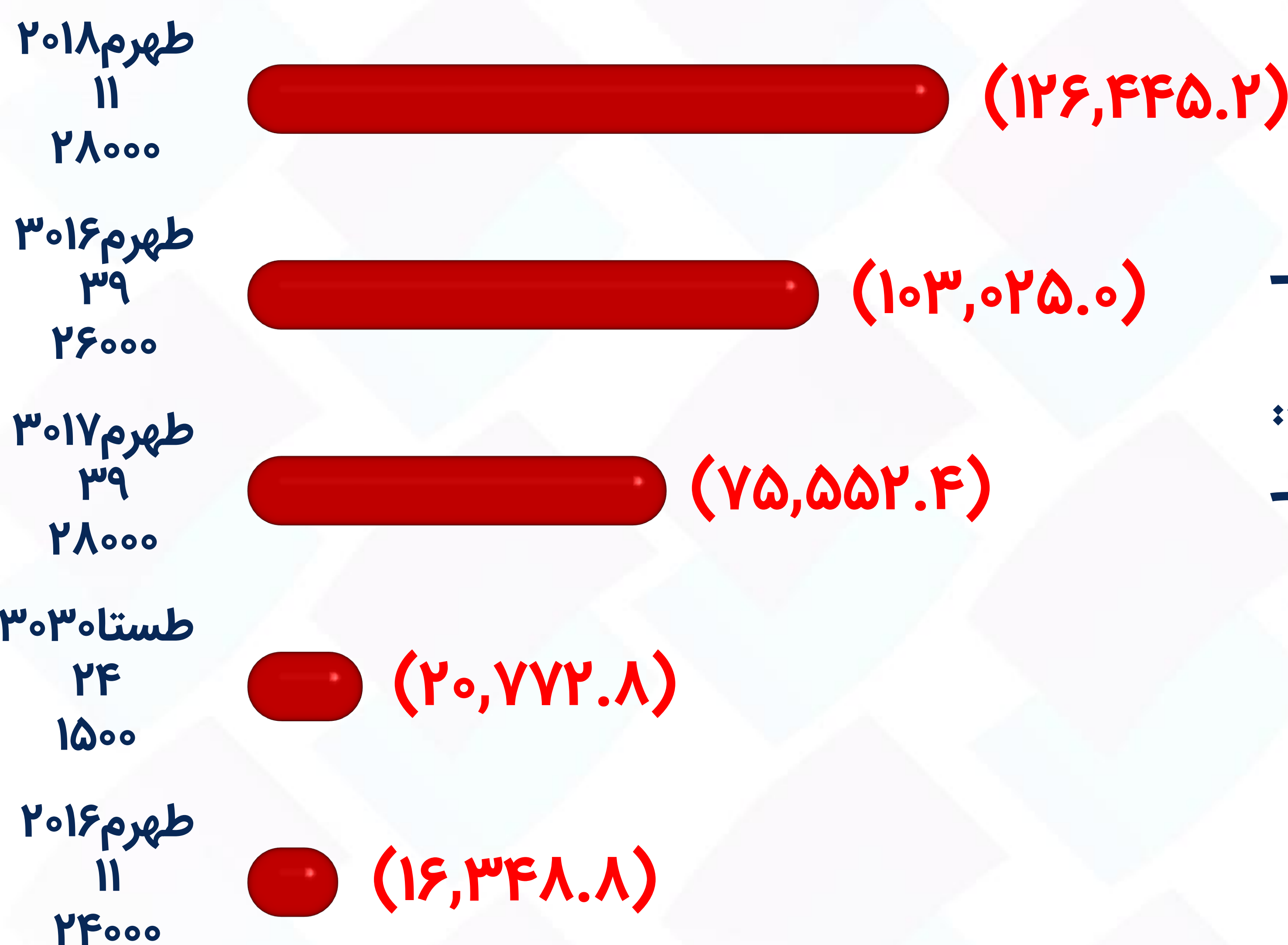
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

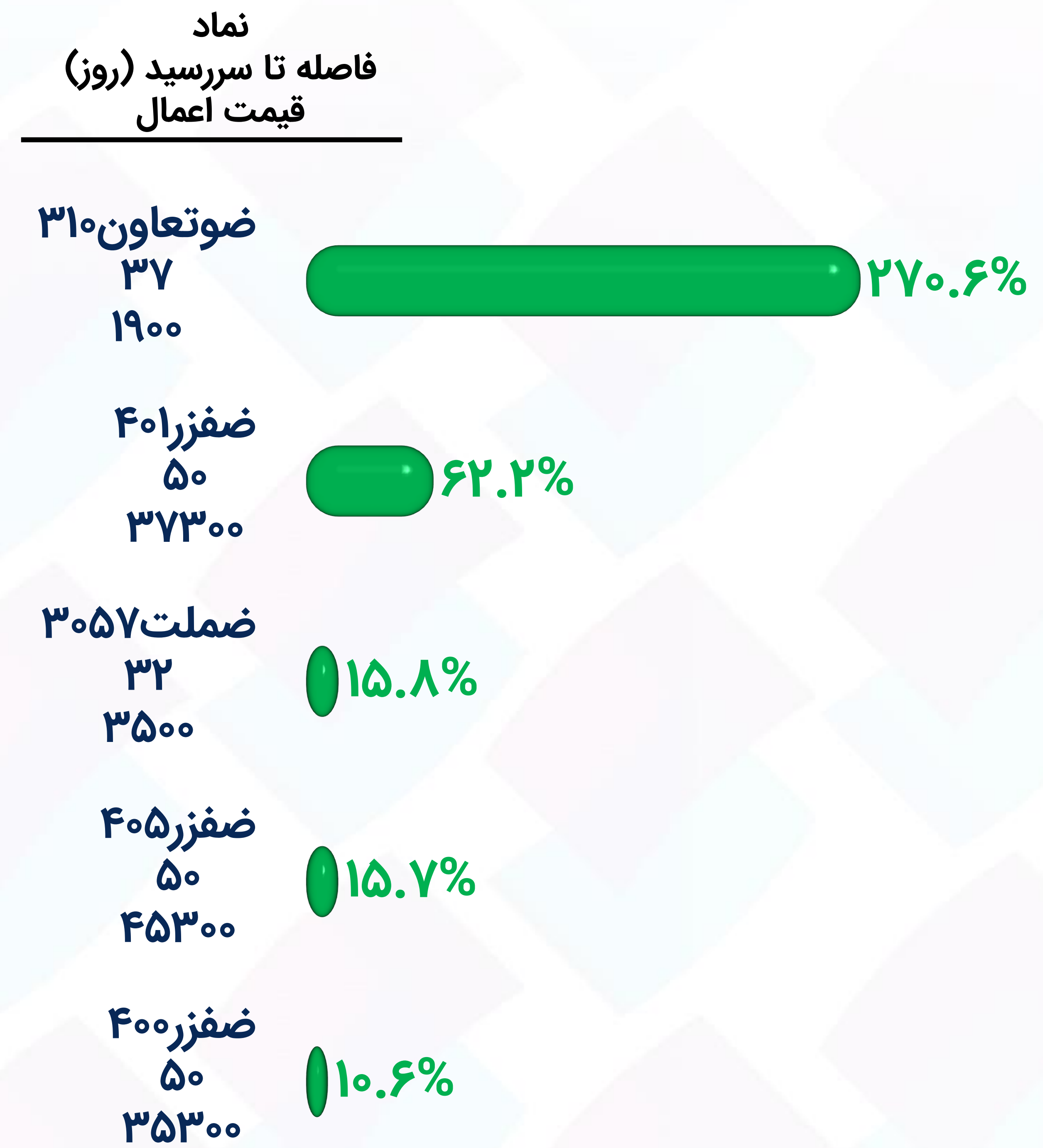
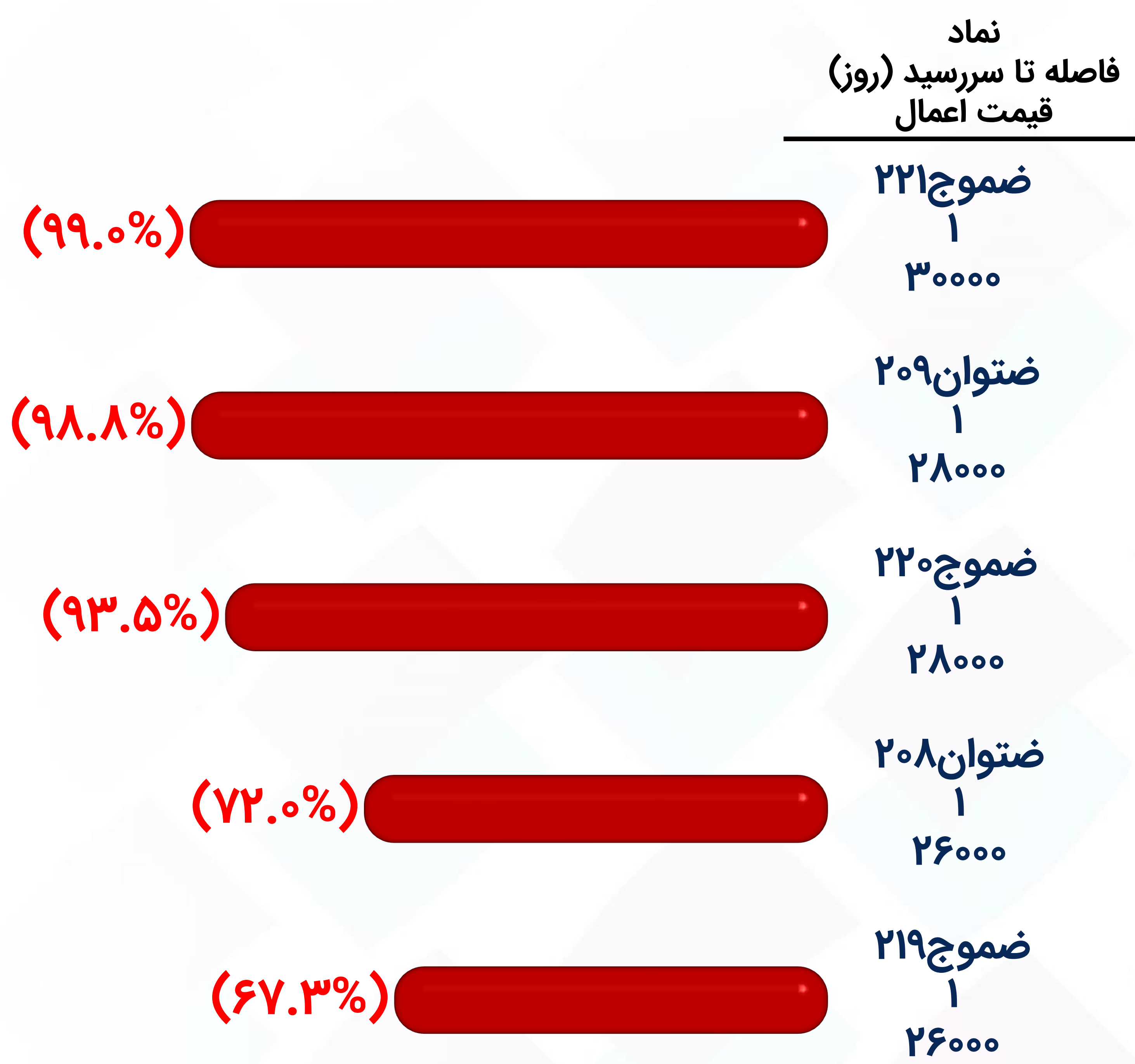
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



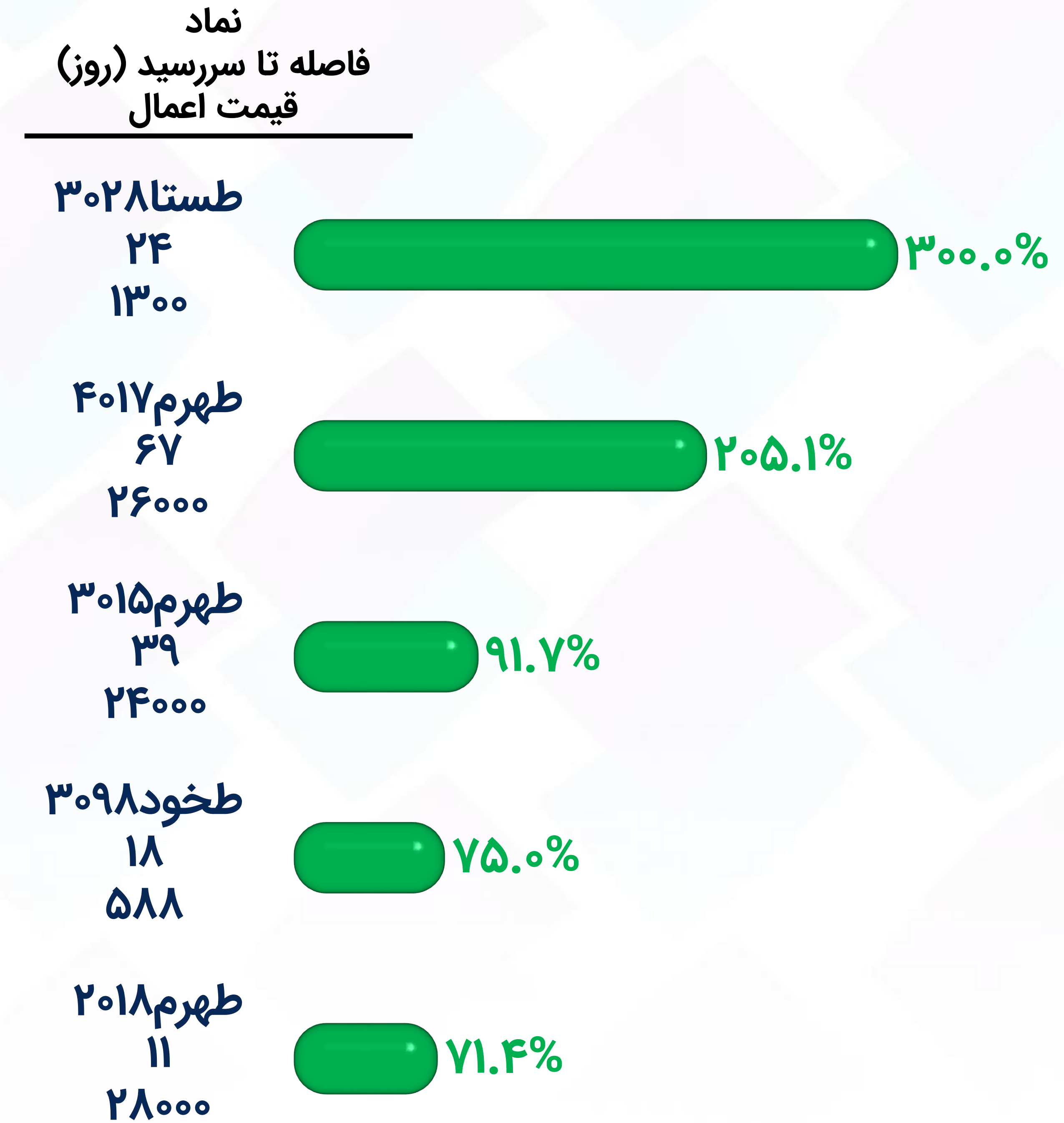
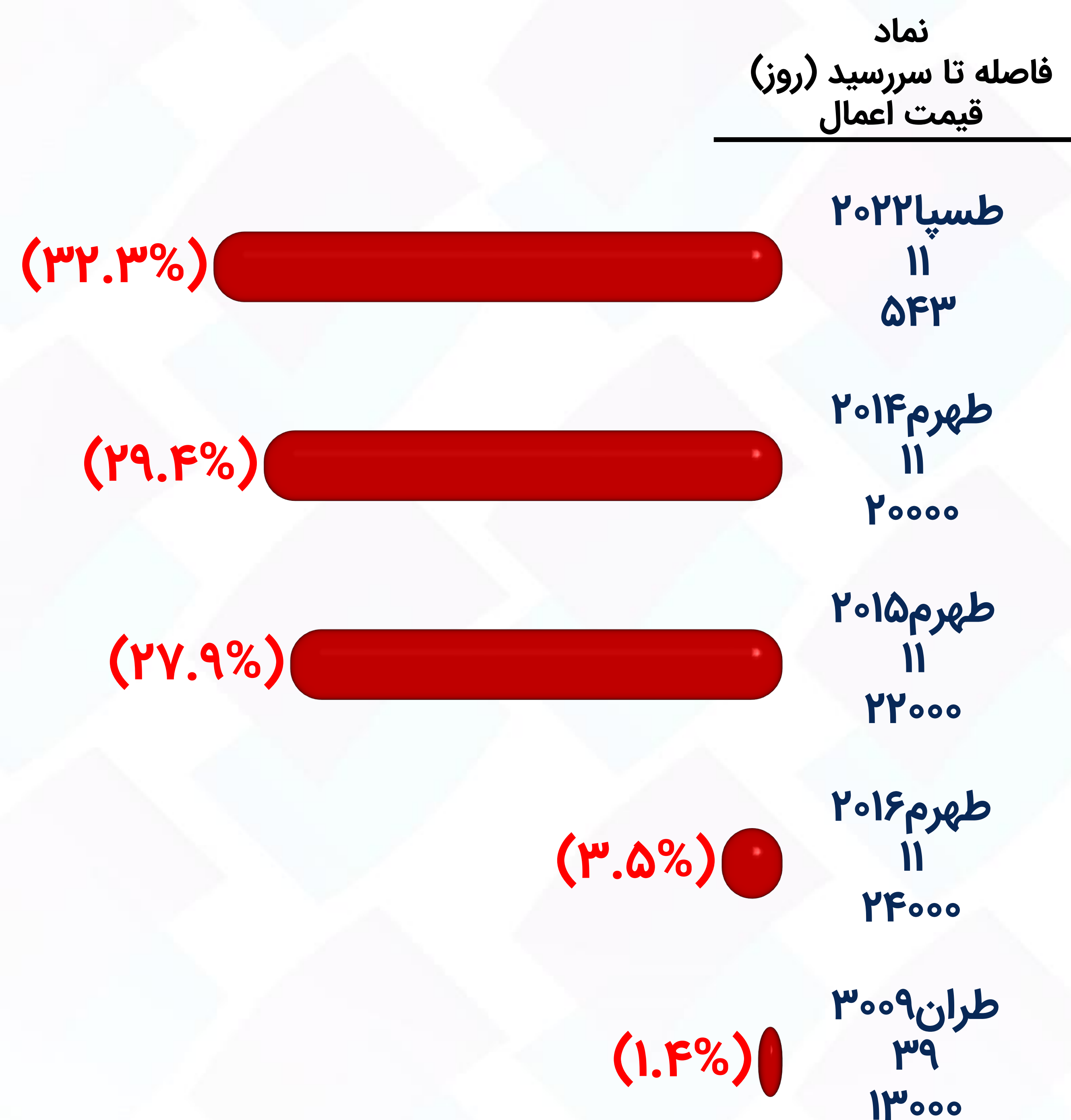
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

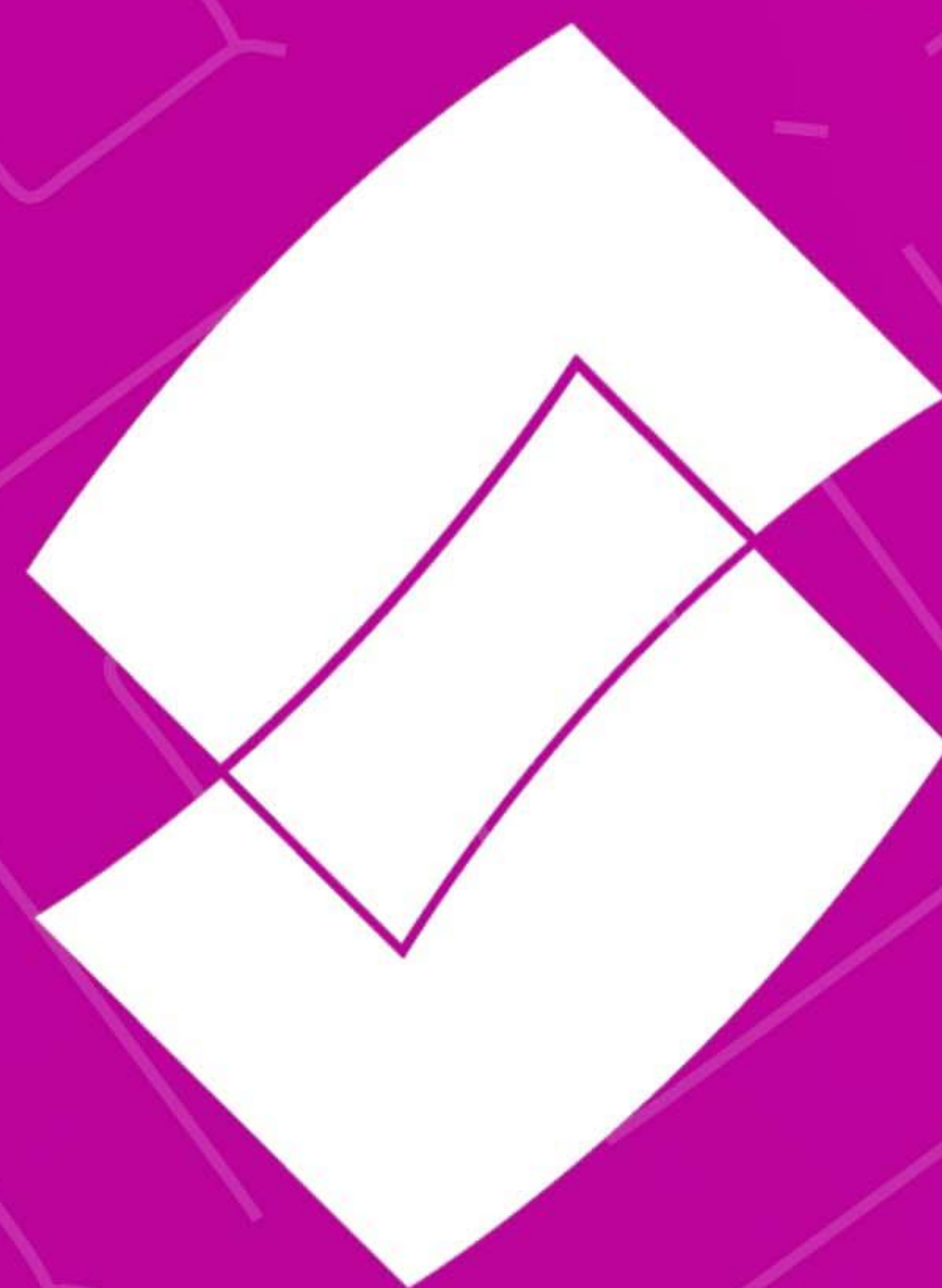
اختیار خرید



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.