

شماره
۴۷۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۴ 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



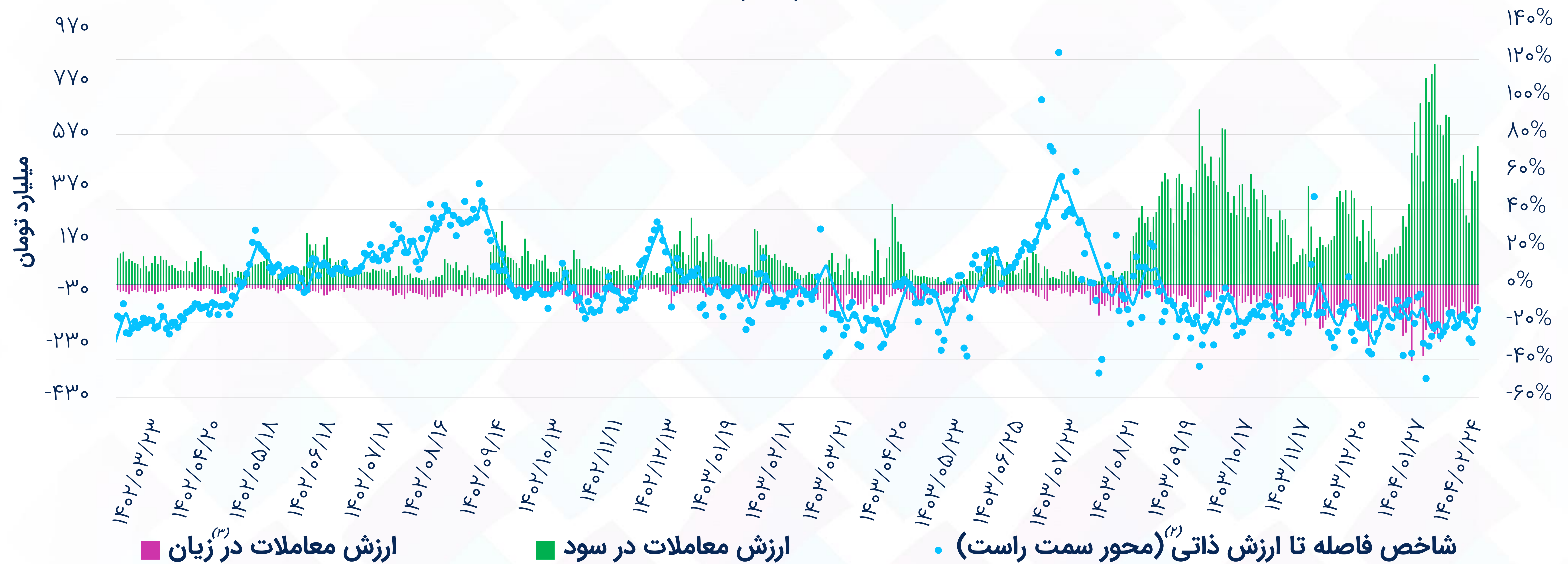
اختیار فروش



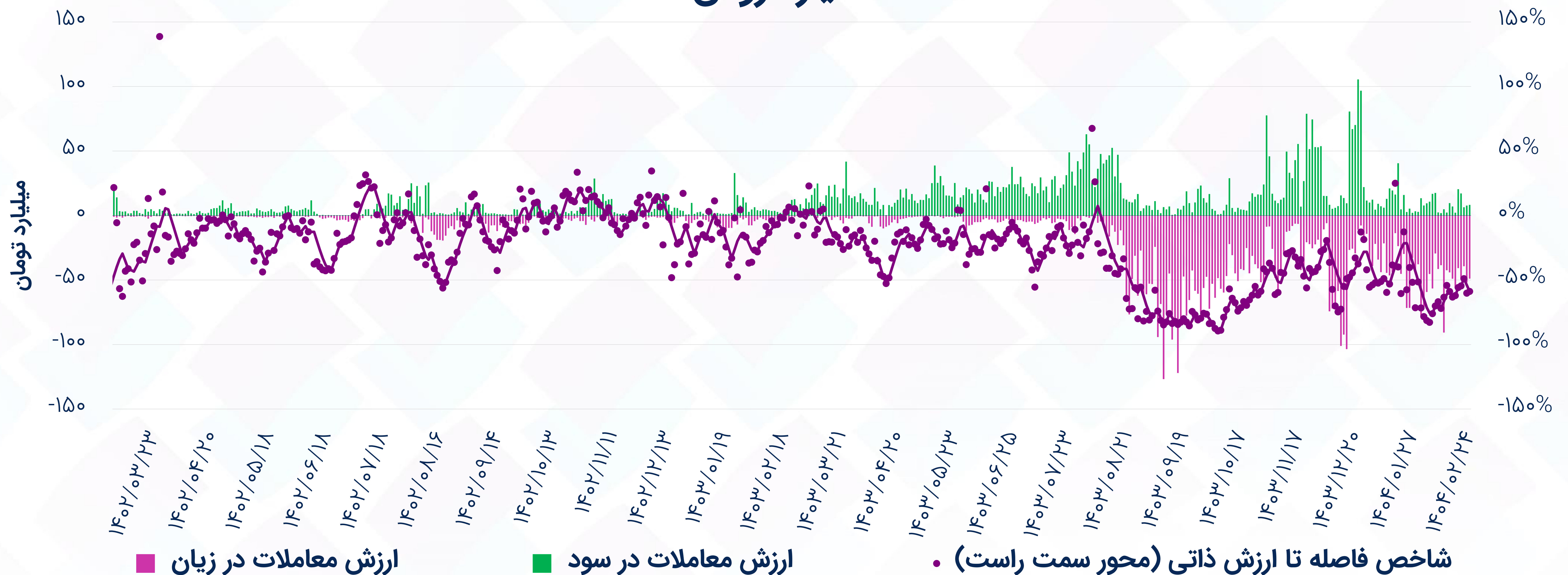
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۱۷.۳	۴,۹۵۰.۱	۲۷۰.۶	۴۶.۷	(۱۶.۸%)
خودرو	۱۳	۹۹.۷	۱,۲۰۵.۲	۹۱.۳	۸.۴	(۱۶.۲%)
شستا	۴۲	۷۰.۳	۹۲۲.۵	۵۶.۷	۱۳.۶	(۱۲.۰%)
ذوب	۲۸	۵۳.۲	۵۳۲.۳	۵۱.۱	۲.۱	۴.۰%
خسپا	۲۲	۱۴.۹	۱۴۷.۶	۱۴.۹	۰.۰	۱۴.۴%
وبملت	۲۳	۱۲.۴	۱۳۶.۴	۱۰.۹	۱.۵	(۱۱.۲%)
شتاب	۱۲	۶.۴	۲۶.۱	۶.۴	۰.۰	(۱.۷%)

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	۱۸	۴۱,۳۶۶.۷	۴,۰۳۱,۴۷۲.۴	۳,۴۵۵.۴	۳۷,۹۱۱.۲	(۷۱.۸%)
خودرو	۶	۱۲,۷۹۳.۷	۴۶۰,۵۴۲.۷	۴,۵۱۲.۰	۸,۲۸۱.۷	(۱۴.۲%)
شستا	۷	۲,۴۹۷.۳	۲۲۲,۹۴۲.۶	۱۰۲.۶	۲,۳۹۴.۷	(۷۶.۲%)
وبملت	۳	۷۳.۵	۳,۱۴۴.۵	۰.۰	۷۳.۵	(۶۵.۳%)
خسپا	۲	۴۱.۲	۱۱,۹۰۶.۲	۰.۰	۴۱.۲	۱۲۴.۰%
وبصادر	۲	۳۶.۸	۳,۱۸۳.۱	۰.۰	۳۶.۸	(۹۸.۹%)
فملی	۲	۱۷.۴	۹۹۱.۵	۶.۱	۱۱.۳	(۸۰.۹%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۵,۴۷۷

خودرو ۹۳۸

شستا ۳۰۵

ذوب ۴۵

وبملت ۲۸

وتعاون ۱۹

شتاب ۱۴

وبصادر ۹.۷۸

خسپا ۸.۶۸

خودران ۲.۶۵

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۲۹۳,۱۳۸.۸

شستا ۹۴,۰۱۷.۲

وبصادر ۱,۸۰۶.۶

وبملت ۱,۵۳۲.۳

خسپا ۱,۳۲۲.۹

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

خودرو (۵۸,۷۳۹.۶)

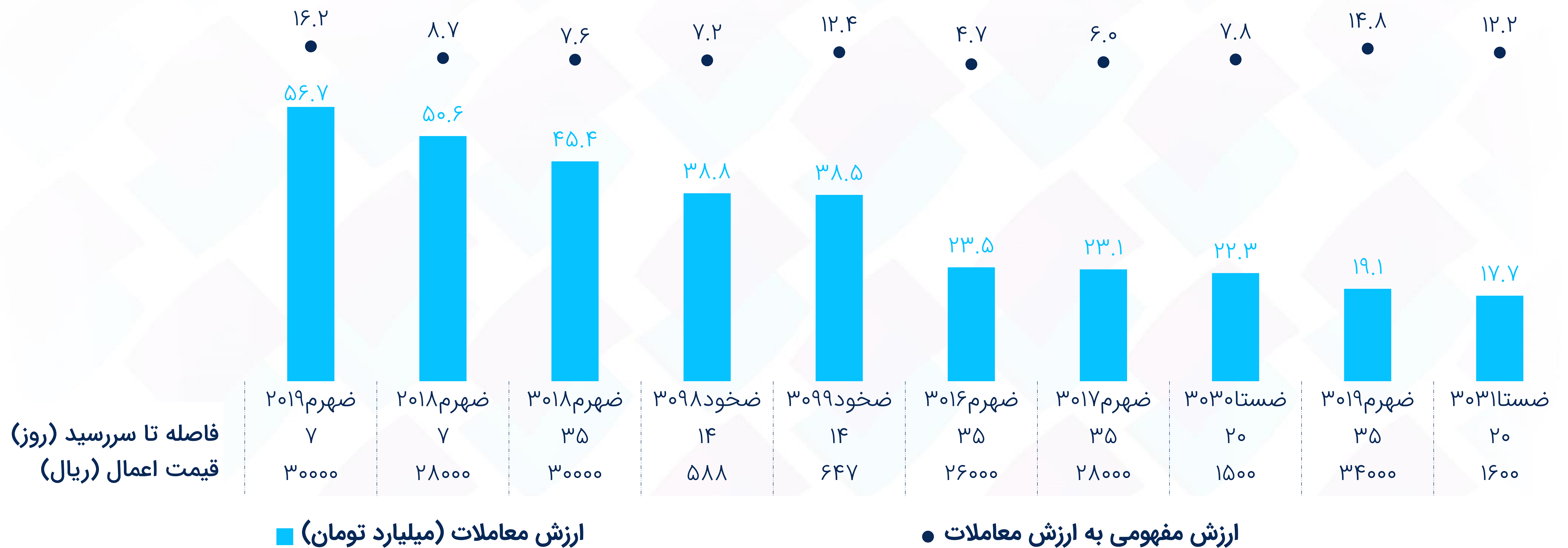
فملی (۷۱۱.۷)

شپنا (۴۷.۰)

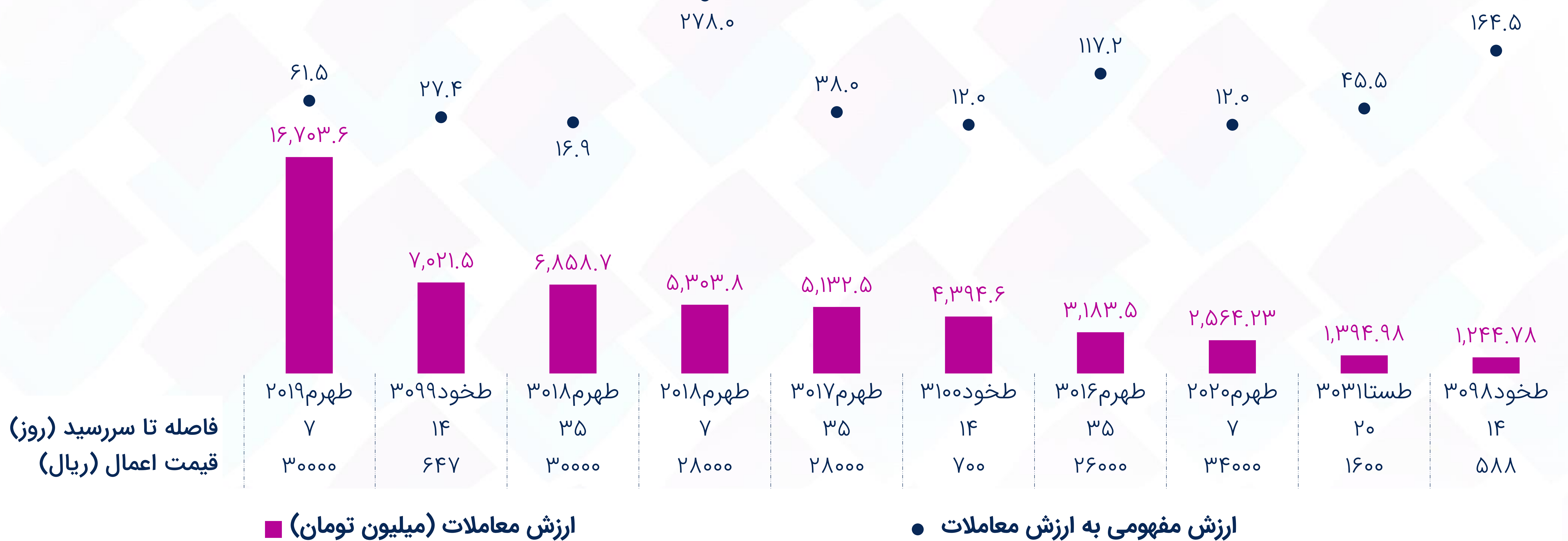
میلیون تومان

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
ضسامان ۵۰۳	سامان	۱,۶۰۰	۸۸	۴.۲	۸۳	۲,۳۸۳	۱,۶۸۳	(۲۹.۴%)	۲۰.۳	۱.۰۰	۹۰۴	۹۸۹%
ضسامان ۵۰۱	سامان	۱,۴۰۰	۸۸	۸.۱	۳۰۱	۲,۳۸۳	۱,۷۰۱	(۲۸.۶%)	۵.۷	۱.۰۰	۱,۰۸۹	۲۶۲%
ضپاد ۴۰۳۱	پادا	۱۸۰,۰۰۰	۴۶	۱۱.۳	۱۸,۷۱۷	۲۱۴,۱۲۳	۱۹۸,۷۱۷	(۷.۲%)	۱۰.۶	۱.۰۰	۴۱,۲۹۴	۱۲۱%
ضتیام ۲۰۶	تیام	۱۴,۰۰۰	۴	۴.۲	۱,۴۳۸	۱۵,۹۰۶	۱۵,۴۳۸	(۲.۹%)	۱۰.۷	۱.۰۰	۱,۹۶۳	۳۶%
ضسپا ۲۰۲۳	خسپا	۶۰۳	۷	۲,۸۷۹.۹	۲۵	۶۰۹	۶۲۸	۳.۱%	۲۵.۱	۰.۵۹	۳۳	۳۳%

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	۲۸	۲.۹	۴	۵۲۷	۱,۰۰۴	۹۱%	۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۳	فولاد	۶,۴۸۰	۲۰	۱.۳	۷	۴,۰۴۵	۶,۴۸۷	۶۰%	۹۲۶.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷	۵۸.۷	۱۲	۳۱,۴۱۰	۴۲,۰۱۲	۳۴%	۳,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۳۰۳۶	شستا	۲,۲۰۰	۲۰	۲۱۲.۷	۷	۱,۶۸۲	۲,۲۰۷	۳۱%	۳۱۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۸	۳۱.۷	۵	۷۲۶	۱,۰۰۵	۳۸%	۲۰۱.۰	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
طسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۷	۳۸.۹	۲	۶۰۹	۵۴۱	(۱۱.۲%)	۲۷۰.۵	-۰.۱۳	۵	۱۳۲.۲%
طتیام ۲۱	تیام	۱۸,۰۰۰	۴	۱.۵	۱,۵۰۰	۱۵,۹۰۶	۱۶,۵۰۰	۳.۷%	۱۱.۰	-۱.۰۰	۲,۰۲۱	۳۴.۷%
طخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۱۴	۱,۲۴۴.۸	۴	۶۵۸	۵۸۴	(۱۱.۲%)	۱۴۶.۰	-۰.۱۱	۴	۵.۸%
طوتعاون ۳۰۹	وتعاون	۱,۸۰۰	۳۳	۲.۵	۲۱	۱,۸۴۸	۱,۷۷۹	(۳.۷%)	۸۴.۷	-۰.۲۳	۲۱	(۰.۲%)
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۱۴	۱۱۷.۴	۱۳۸	۶۵۸	۶۶۲	۰.۶%	۴.۸	-۰.۹۴	۱۳۲	(۴.۴%)

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 ۲۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷	۱.۲	۳	۳۱,۴۱۰	۱۹,۹۹۷	(۳۶.۳%)	۶,۶۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۶۳	۰.۳	۳	۵۲۷	۱۹۷	(۶۲.۶%)	۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۷	۲۷.۲	۷	۳۱,۴۱۰	۲۱,۹۹۳	(۳۰.۰%)	۳,۱۴۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۶	اهرم	۲۴,۰۰۰	۷	۲۵۸.۰	۲۱	۳۱,۴۱۰	۲۳,۹۷۹	(۲۳.۷%)	۱,۱۴۱.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۳۰۵۱	وبصادر	۵۰۰	۲۸	۳.۷	۲	۷۲۶	۴۹۸	(۳۱.۴%)	۲۴۹.۰	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

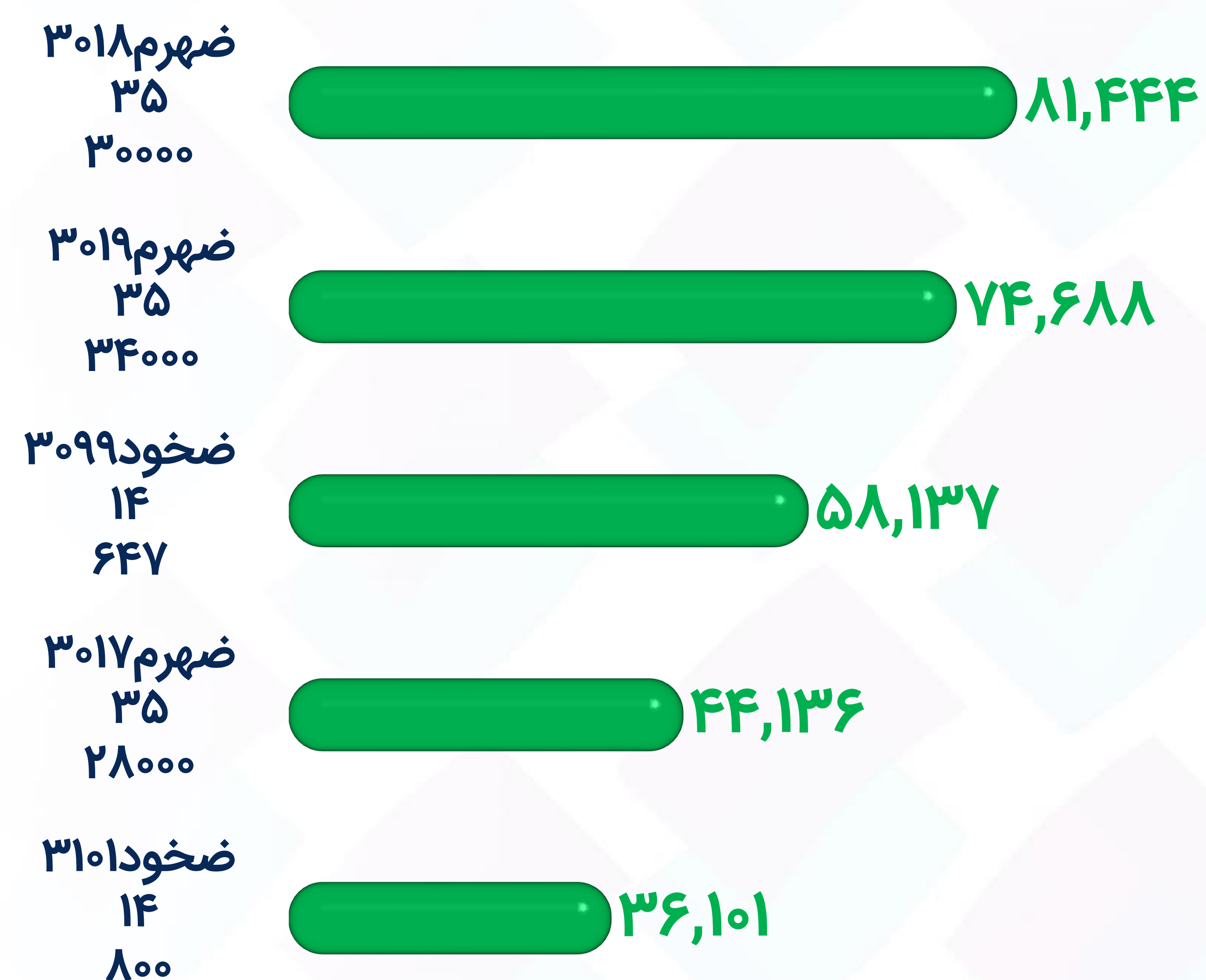
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

طهرم ۲۰۱۶
۷
۲۴۰۰۰ ۱,۰۱۷

طهرم ۳۰۱۶
۳۵
۲۶۰۰۰ ۹۷۴

طهرم ۲۰۱۸
۷
۲۸۰۰۰ ۸۹۲

طهرم ۳۰۱۷
۳۵
۲۸۰۰۰ ۶۳۱

طهرم ۲۰۱۷
۷
۲۶۰۰۰ ۶۰۵

طخود ۳۰۹۸
۱۴
۵۸۸ ۵۲۴

طهرم ۲۰۱۹
۷
۳۰۰۰۰ ۴۵۴

طهرم ۳۰۱۸
۳۵
۳۰۰۰۰ ۳۳۹

طخود ۳۰۹۹
۱۴
۶۴۷ ۳۲۴

طستا ۳۰۳۰
۲۰
۱۵۰۰ ۱۸۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

طهرم ۲۰۱۸
۷
۲۸۰۰۰ ۱۷۳,۸۰۷.۲

طهرم ۳۰۱۶
۳۵
۲۶۰۰۰ ۱۶۴,۰۷۰.۴

طهرم ۲۰۱۹
۷
۳۰۰۰۰ ۷۸,۹۵۱.۰

طستا ۳۰۳۰
۲۰
۱۵۰۰ ۶۷,۶۸۲.۷

طهرم ۳۰۱۷
۳۵
۲۸۰۰۰ ۴۳,۸۰۸.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

طهرم ۲۰۱۶
۷
۲۴۰۰۰ (۶۹,۹۷۹.۲)

طهرم ۲۰۱۵
۷
۲۲۰۰۰ (۶۹,۸۶۷.۶)

طخود ۳۰۹۹
۱۴
۶۴۷ (۵۱,۵۱۱.۶)

طهرم ۲۰۱۷
۷
۲۶۰۰۰ (۴۷,۰۵۷.۴)

طخود ۳۰۹۷
۱۴
۵۲۹ (۴,۴۷۸.۰)

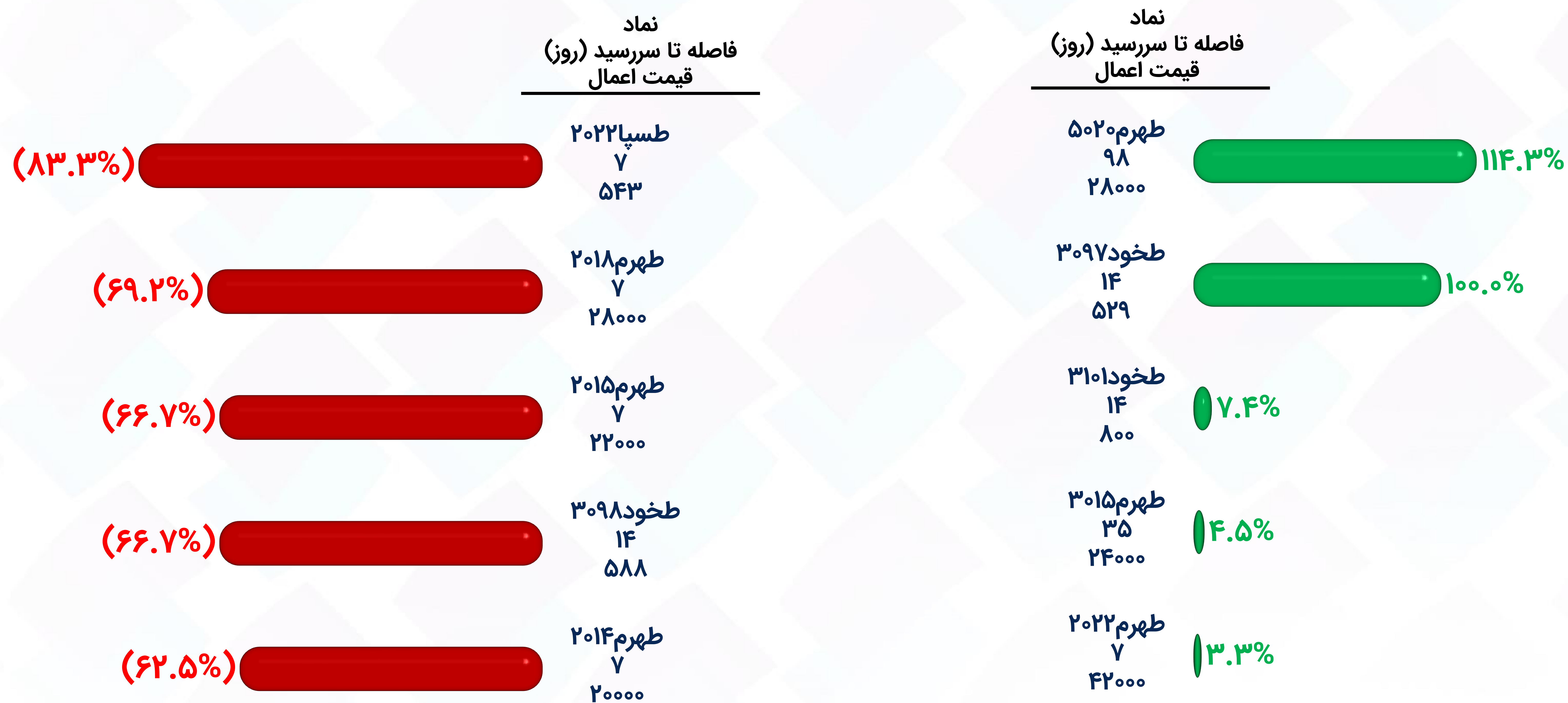
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

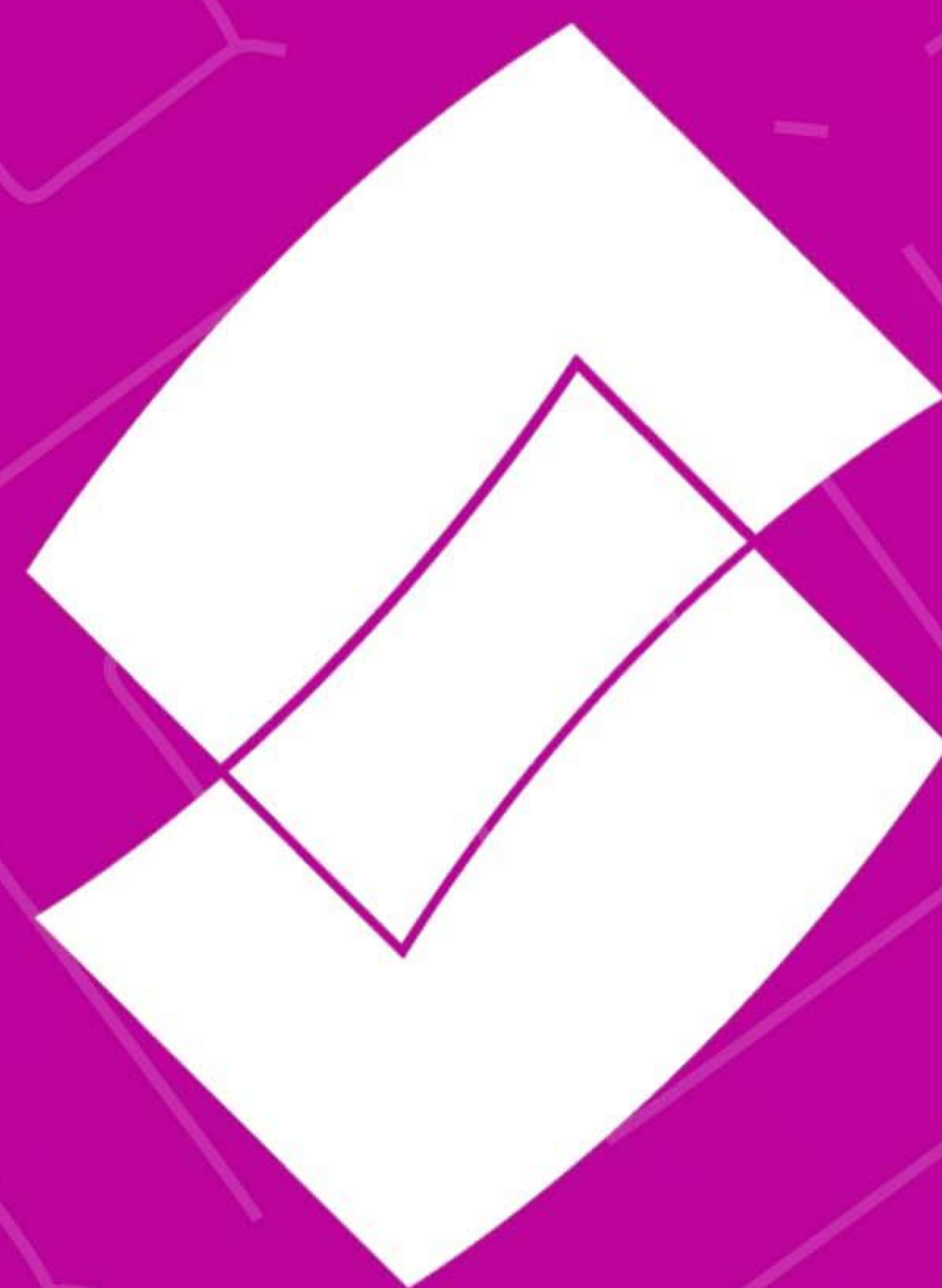
اختیار خرید



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.