

شماره
۴۸۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۹ اردیبهشت ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





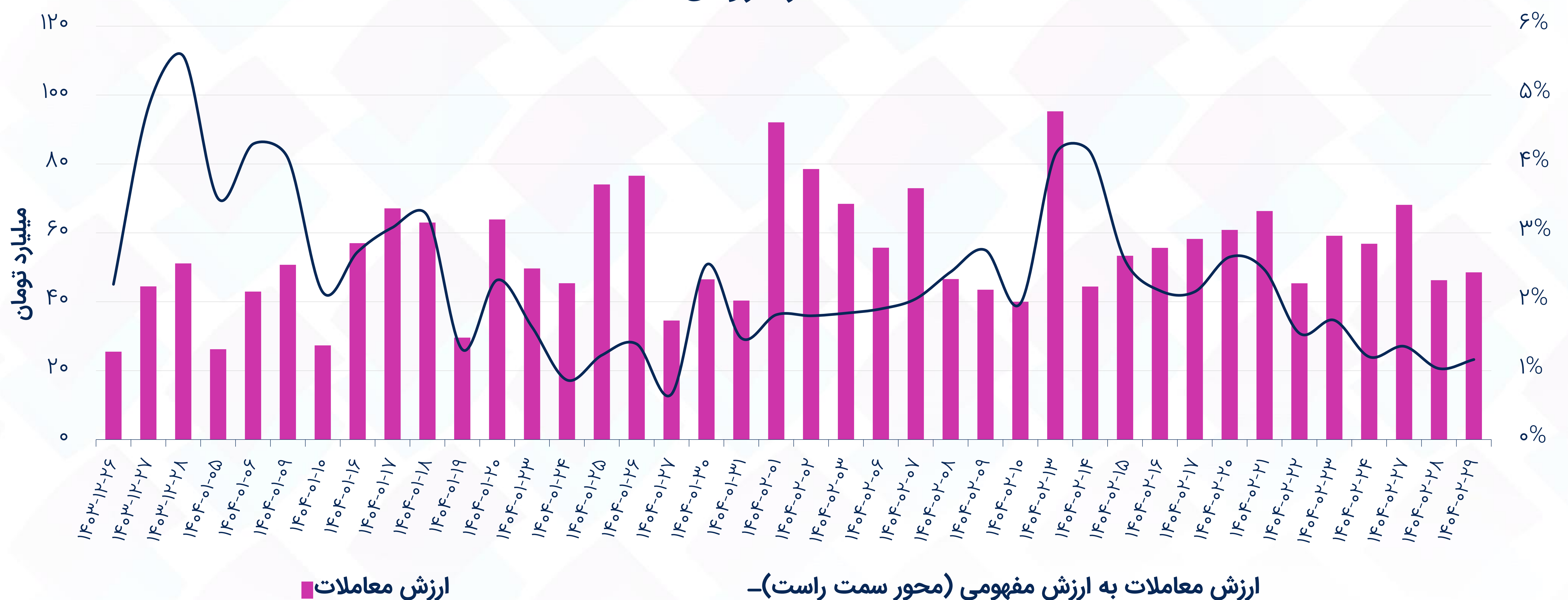
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



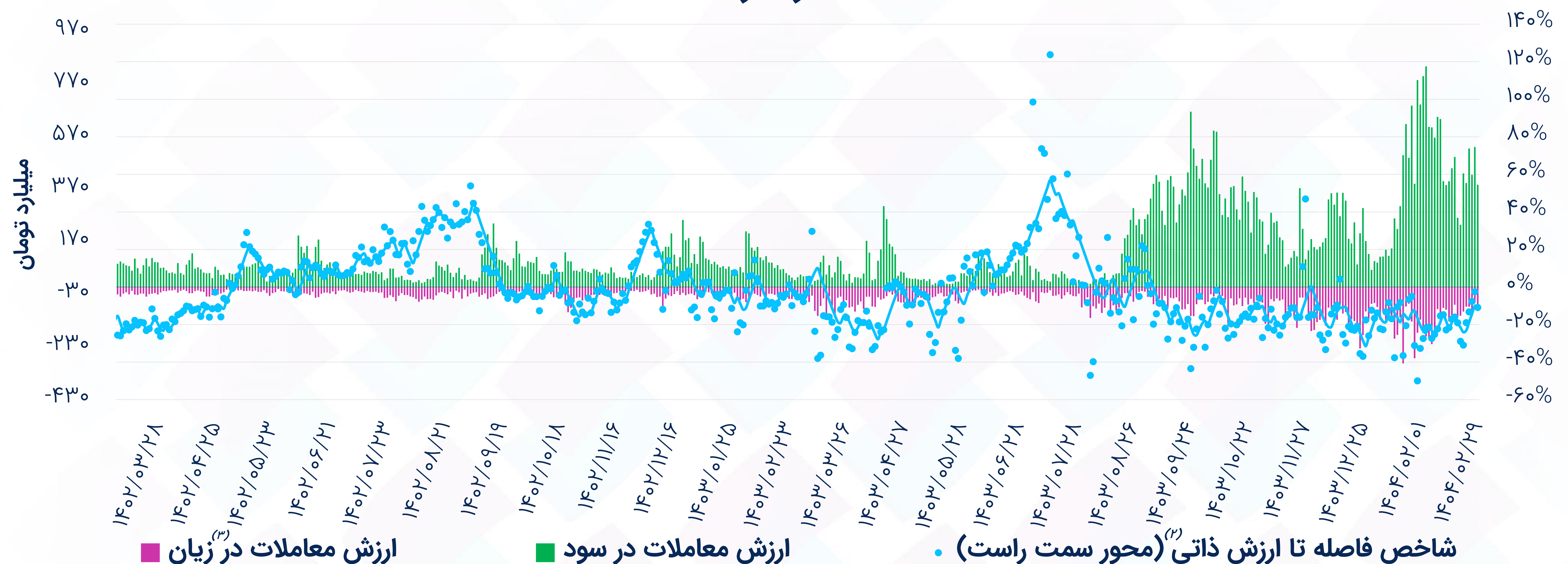
اختیار فروش



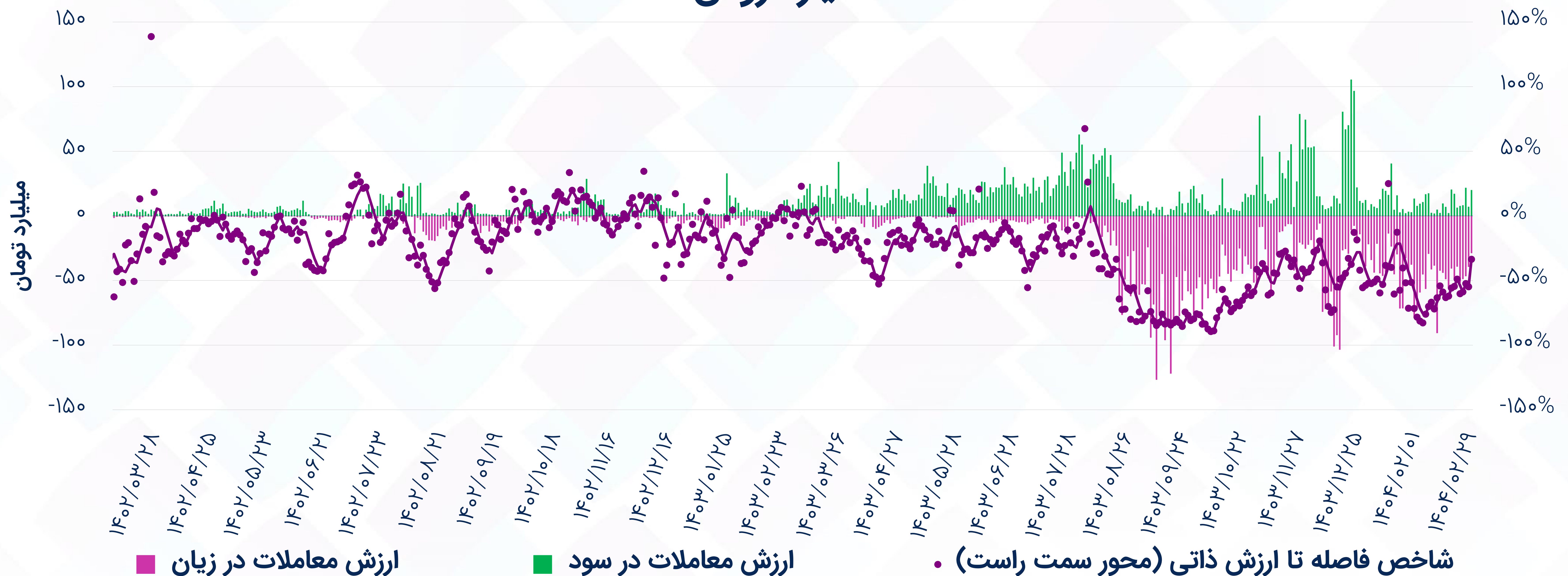
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

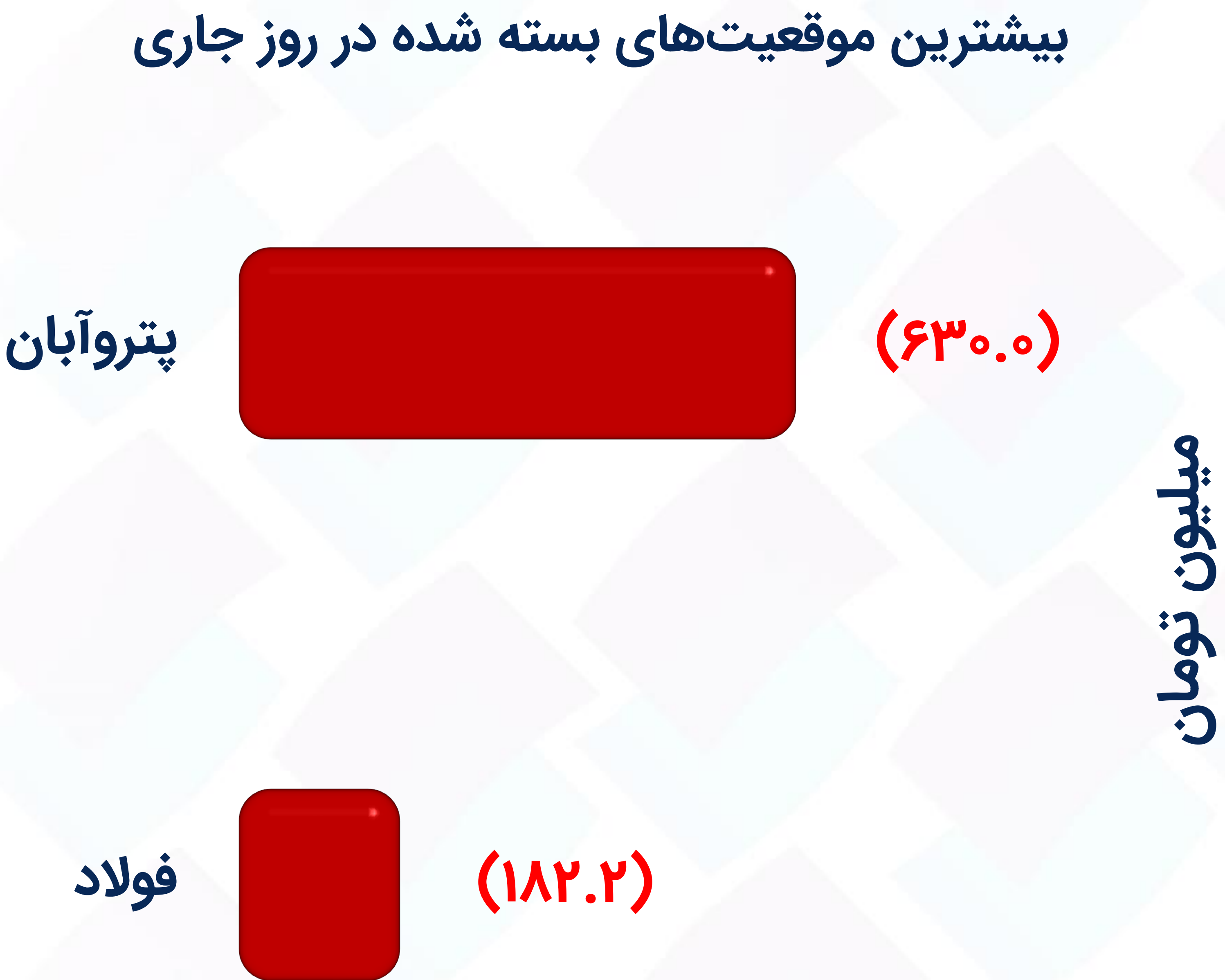
اختیار خرید

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	۲۸۸.۹	۷,۱۰۶.۵	۲۴۷.۰	۴۱.۹	(۱۳.۰%)
شستا	۵۰	۷۰.۵	۹۰۸.۲	۶۵.۶	۴.۹	(۴.۶%)
خودرو	۱۲	۶۲.۳	۱,۵۳۰.۹	۳۰.۷	۳۱.۶	(۷.۳%)
ذوب	۲۷	۱۷.۰	۱۶۱.۲	۱۵.۰	۲.۱	(۲۱.۰%)
وبصادر	۱۵	۷.۸	۵۶.۷	۷.۳	۰.۴	(۱۸.۲%)
خسپا	۲۴	۶.۵	۲۱۰.۷	۴.۹	۱.۶	۳۷.۴%
وبملت	۲۰	۵.۹	۱۲۰.۲	۴.۲	۱.۷	(۱۹.۴%)

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	۲۰	۳۱,۲۳۳.۵	۳,۶۲۶,۹۹۹.۷	۵,۵۵۴.۵	۲۵,۶۷۹.۰	(۴۵.۰%)
خودرو	۷	۱۵,۰۵۹.۰	۳۶۸,۵۶۱.۵	۱۴,۱۴۳.۴	۹۱۵.۶	(۶.۷%)
شستا	۶	۲,۰۵۲.۱	۱۷۶,۲۳۷.۷	۰.۰	۲,۰۵۲.۱	(۵۹.۷%)
خسپا	۲	۹۱.۹	۴,۱۴۴.۷	۸۱.۶	۱۰.۳	۱۵.۶%
خودران	۴	۶۱.۲	۹۱۷.۲	۶۰.۵	۰.۷	(۳۱.۳%)
وبملت	۴	۲۸.۲	۱,۶۳۱.۹	۰.۰	۲۸.۲	(۵۶.۶%)
توان	۱	۴.۶	۱۱۳.۹	۰.۰	۴.۶	(۵۳.۳%)

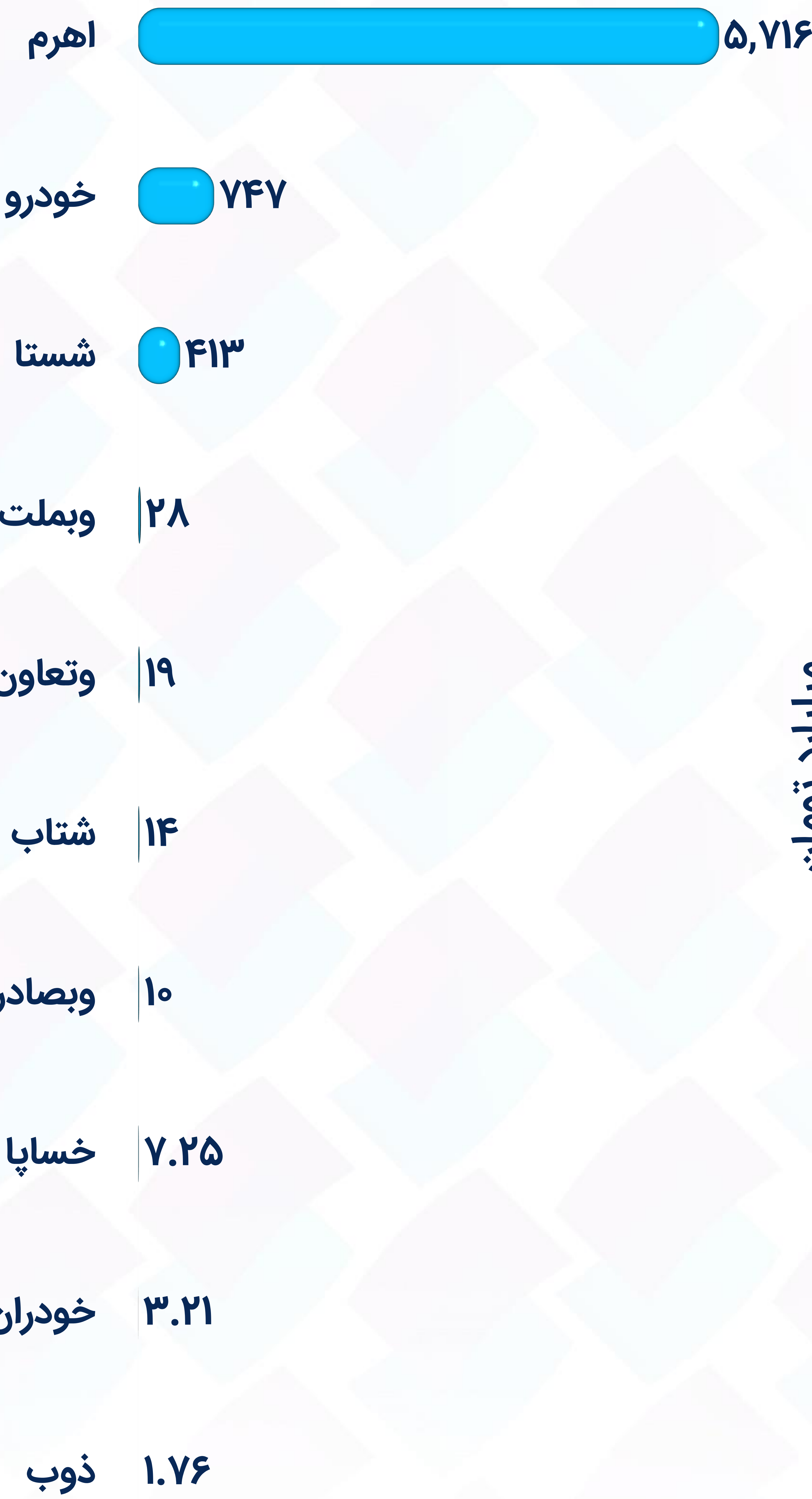
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

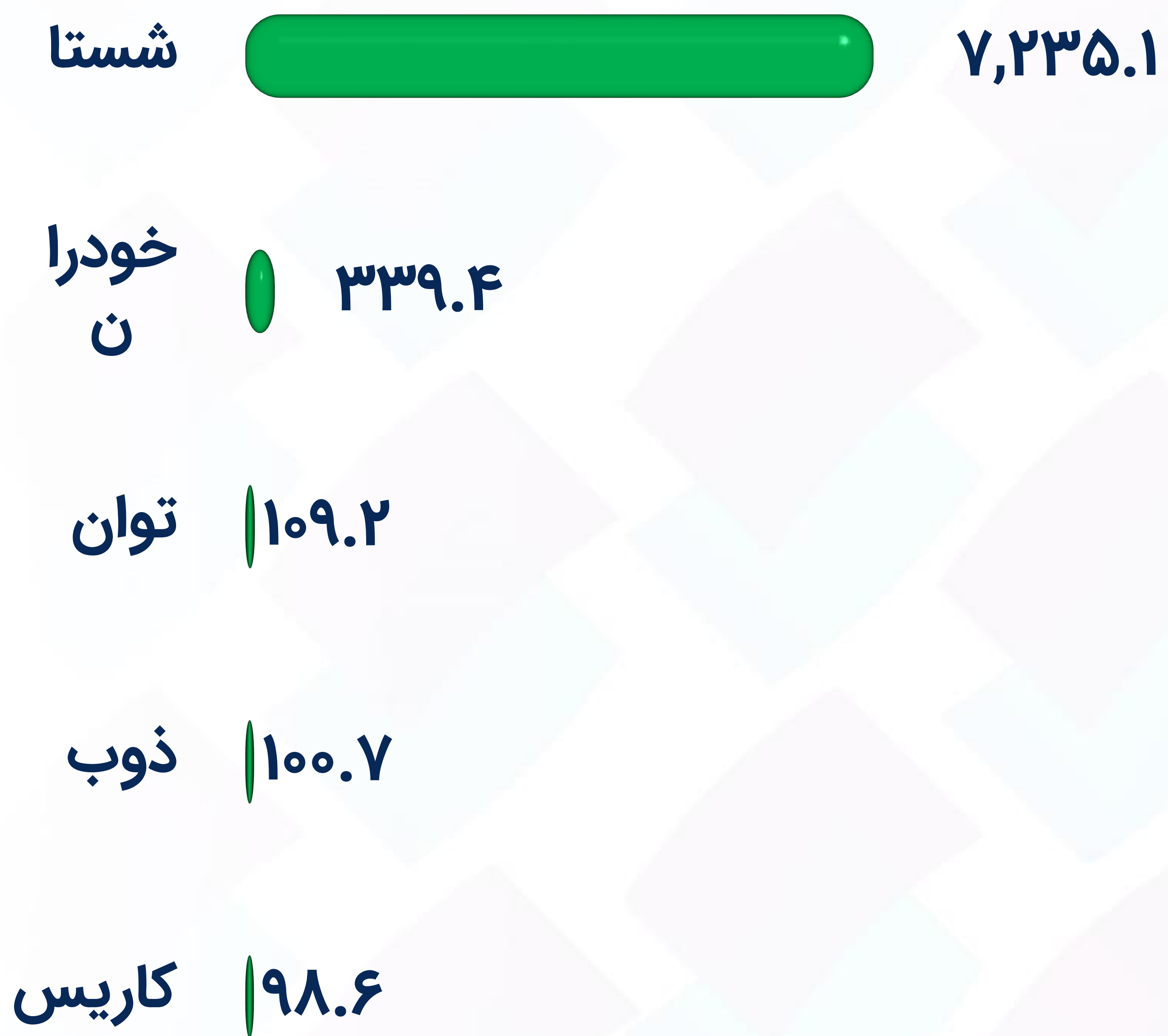
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



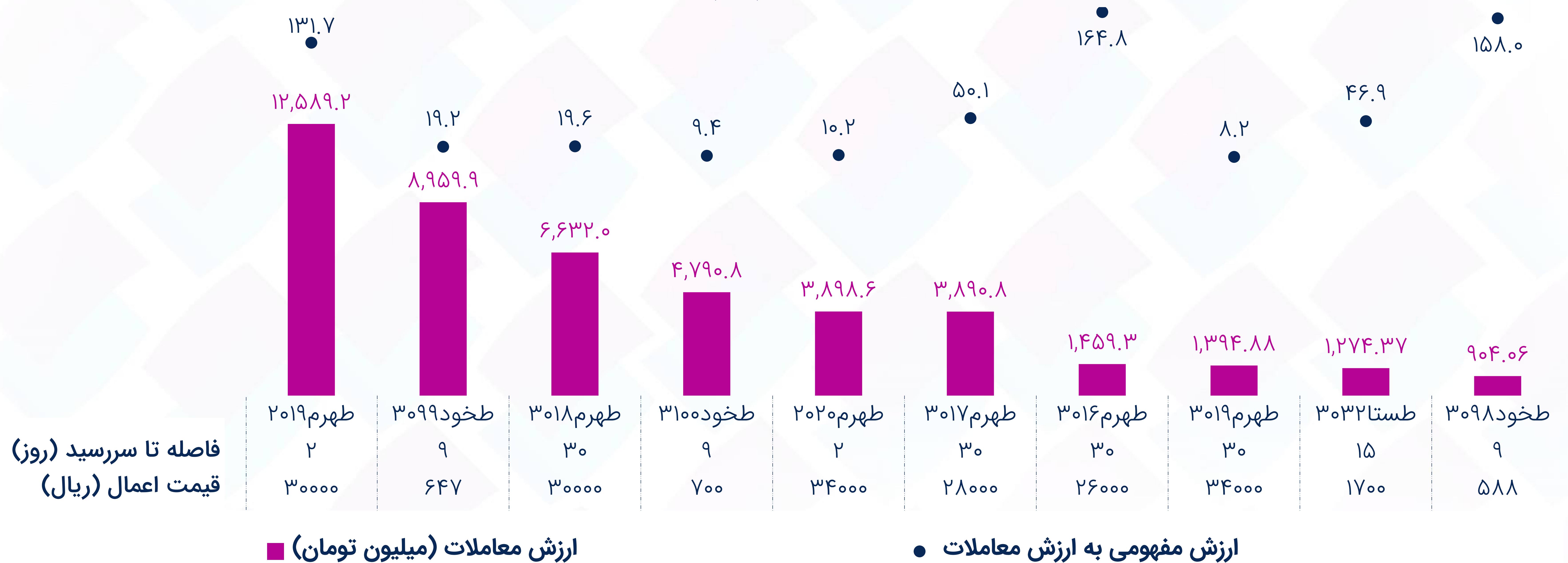
میلیون تومان

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
خسپا ۲۰۲۳	خسپا	۶۰۳	۲	۵۴۹.۱	۲	۵۷۳	۶۰۵	۵.۶%	۳۰۲.۵	۰.۲۹	۸	۳۰۸%
خسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۲	۵۷۴.۴	۲۷	۵۷۳	۵۷۰	(۰.۵%)	۲۱.۱	۰.۷۸	۳۸	۴۲%
ضیید ۲۰۰۴	بیدار	۱۳,۰۰۰	۲	۱۷۰.۵	۳,۹۵۶	۱۷,۹۳۰	۱۶,۹۵۶	(۵.۴%)	۴.۳	۱.۰۰	۴,۹۸۴	۲۶%
ضیید ۲۰۰۶	بیدار	۱۵,۰۰۰	۲	۶۷.۳	۲,۴۴۸	۱۷,۹۳۰	۱۷,۴۴۸	(۲.۷%)	۷.۱	۱.۰۰	۲,۹۹۲	۲۲%
ضیید ۲۰۰۷	بیدار	۱۶,۰۰۰	۲	۷۰.۷	۱,۶۳۷	۱۷,۹۳۰	۱۷,۶۳۷	(۱.۶%)	۱۰.۸	۱.۰۰	۱,۹۹۷	۲۲%

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
ضهرم ۲۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۲	۱۶.۶	۵	۳۰,۸۲۰	۴۲,۰۰۵	۳۶%	۸,۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۳۰۴۴	ذوب	۱,۰۰۰	۲۳	۲.۰	۳	۵۲۳	۱,۰۰۳	۹۲%	۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲	۱۴.۱	۷	۳۰,۸۲۰	۳۸,۰۰۷	۲۳%	۵,۴۲۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا ۳۰۵۱	فولاد	۵,۴۰۰	۱۵	۱.۱	۱	۳,۹۰۶	۵,۴۰۱	۳۸%	۵,۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۳۰۵۶	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۳	۱۵.۰	۴	۷۰۱	۱,۰۰۴	۴۳%	۲۵۱.۰	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
تسپا ۲۰۲۲	خسپا	۵۴۳	۲	۱۰.۳	۲	۵۷۳	۵۴۱	(۵.۶%)	۲۷۰.۵	-۰.۲۲	۶	۲۰۷.۷%
طخود ۳۰۹۸	خودرو	۵۸۸	۹	۹۰۴.۱	۴	۶۳۲	۵۸۴	(۷.۶%)	۱۴۶.۰	-۰.۱۸	۶	۴۷.۱%
طخود ۳۱۰۱	خودرو	۸۰۰	۹	۳۹۲.۷	۱۵۰	۶۳۲	۶۵۰	۲.۸%	۴.۳	-۰.۹۹	۱۵۹	۶.۲%
طهرم ۲۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲	۳,۸۹۸.۶	۳,۰۲۳	۳۰,۸۲۰	۳۰,۹۷۷	۰.۵%	۱۰.۲	-۰.۹۹	۳,۰۴۳	۰.۷%
طهرم ۲۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲	۳۹.۹	۷,۰۰۰	۳۰,۸۲۰	۳۱,۰۰۰	۰.۶%	۴.۴	-۱.۰۰	۷,۰۲۲	۰.۳%

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	۲	۰.۰	۱	۳۰,۸۲۰	۱۹,۹۹۹	(۳۵.۱%)	۱۹,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طخود ۳۰۸۹	خودرو	۲۸۲	۹	۰.۰	۱	۶۳۲	۲۸۱	(۵۵.۵%)	۲۸۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۲	۴.۶	۲	۳۰,۸۲۰	۲۱,۹۹۸	(۲۸.۶%)	۱۰,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۳۰۱۱	اهرم	۱۶,۰۰۰	۳۰	۰.۰	۱۵	۳۰,۸۲۰	۱۵,۹۸۵	(۴۸.۱%)	۱,۰۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۲۰۱۶	اهرم	۲۴,۰۰۰	۲	۴۰.۵	۳	۳۰,۸۲۰	۲۳,۹۹۷	(۲۲.۱%)	۷,۹۹۹.۰	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)

ضرم ۳۰۱۸
۳۰
۳۰۰۰۰ ۲,۱۶۷

ضرم ۳۰۱۹
۳۰
۳۴۰۰۰ ۱,۸۱۲

ضرم ۲۰۲۰
۲
۳۴۰۰۰ ۱,۴۳۶

ضرم ۳۰۲۰
۳۰
۳۸۰۰۰ ۱,۲۴۸

ضخود ۳۰۹۹
۹
۶۴۷ ۱,۱۹۳

ضرم ۳۰۲۱
۳۰
۴۲۰۰۰ ۱,۰۲۹

ضرم ۳۰۱۷
۳۰
۲۸۰۰۰ ۱,۰۲۵

ضرم ۲۰۱۹
۲
۳۰۰۰۰ ۹۶۵

ضرم ۲۰۱۸
۲
۲۸۰۰۰ ۷۹۲

ضخود ۳۱۰۰
۹
۷۰۰ ۷۳۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضرم ۳۰۱۹
۳۰
۳۴۰۰۰ ۱۹۶,۵۷۱

ضرم ۳۰۱۸
۳۰
۳۰۰۰۰ ۱۳۶,۱۰۱

ضخود ۳۱۰۰
۹
۷۰۰ ۱۲۵,۵۵۸

ضخود ۳۰۹۹
۹
۶۴۷ ۸۲,۷۷۹

ضرم ۳۰۲۱
۳۰
۴۲۰۰۰ ۸۱,۹۴۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضرم ۲۰۲۰
۲
۳۴۰۰۰ (۲۵۷,۸۸۳.۲)

ضرم ۲۰۲۲
۲
۴۲۰۰۰ (۱۱۴,۱۸۵.۴)

ضرم ۲۰۱۸
۲
۲۸۰۰۰ (۸۴,۵۸۲.۴)

ضخود ۳۱۰۱
۹
۸۰۰ (۴۰,۶۵۳.۸)

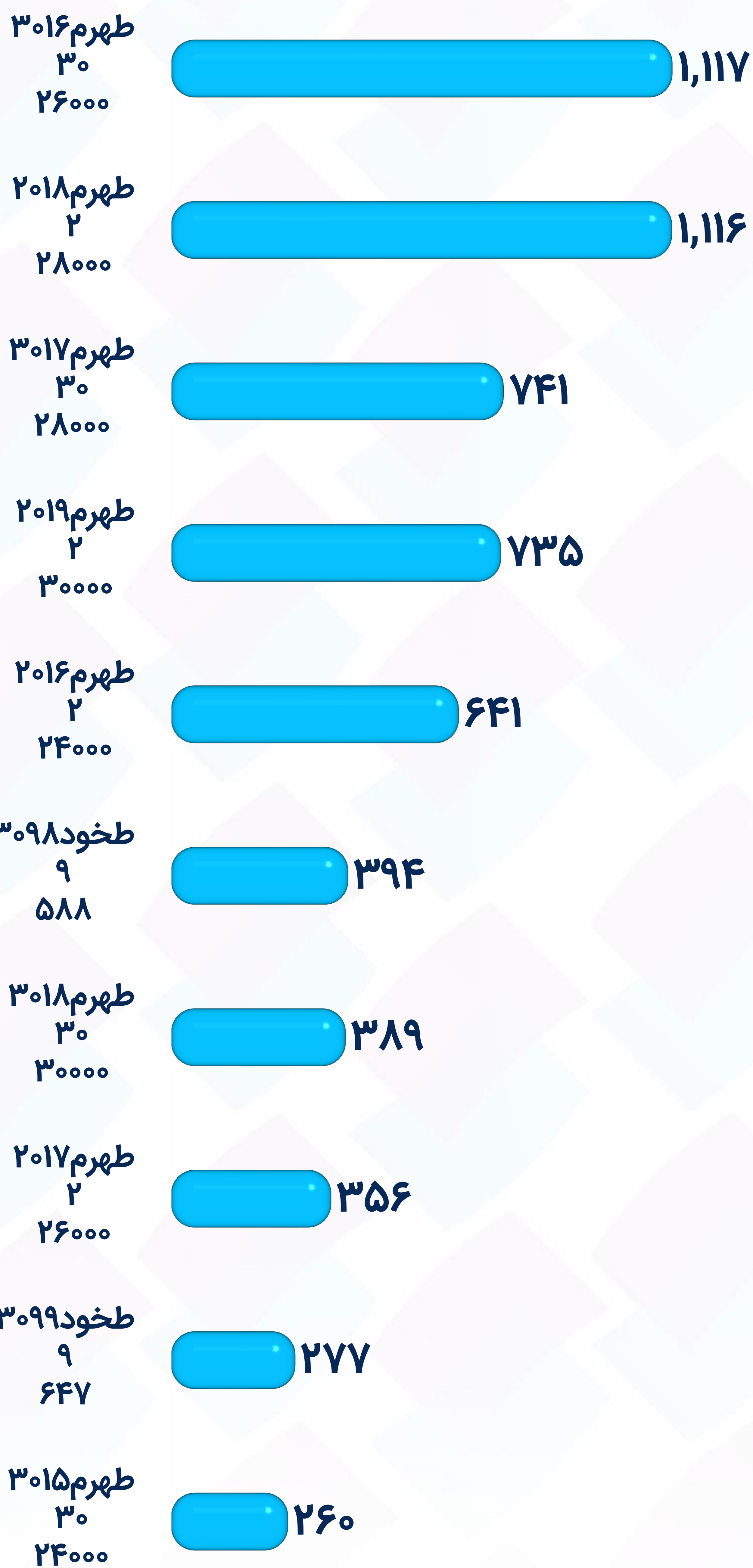
ضرم ۲۰۲۱
۲
۳۸۰۰۰ (۳۶,۷۶۵.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

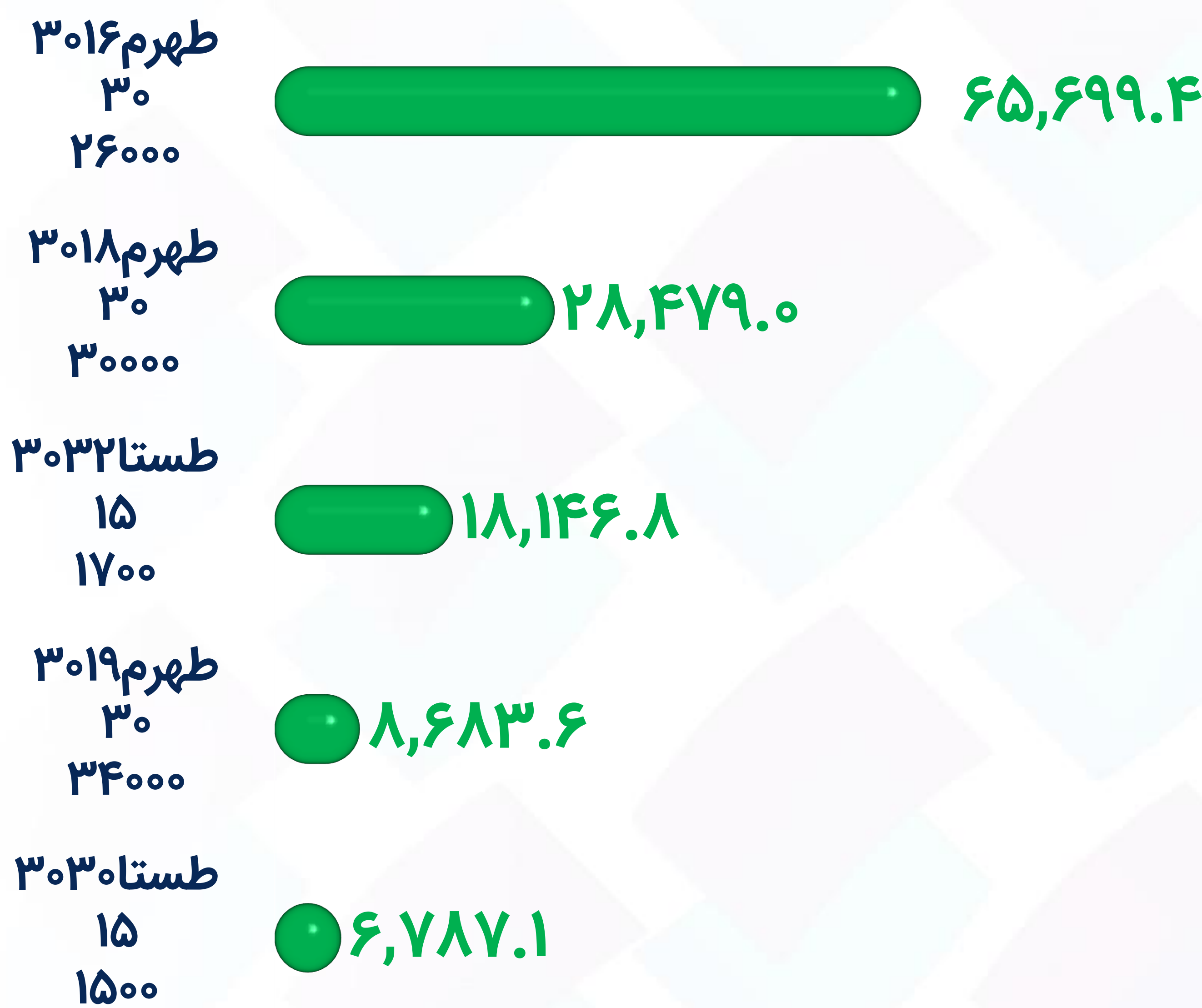
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

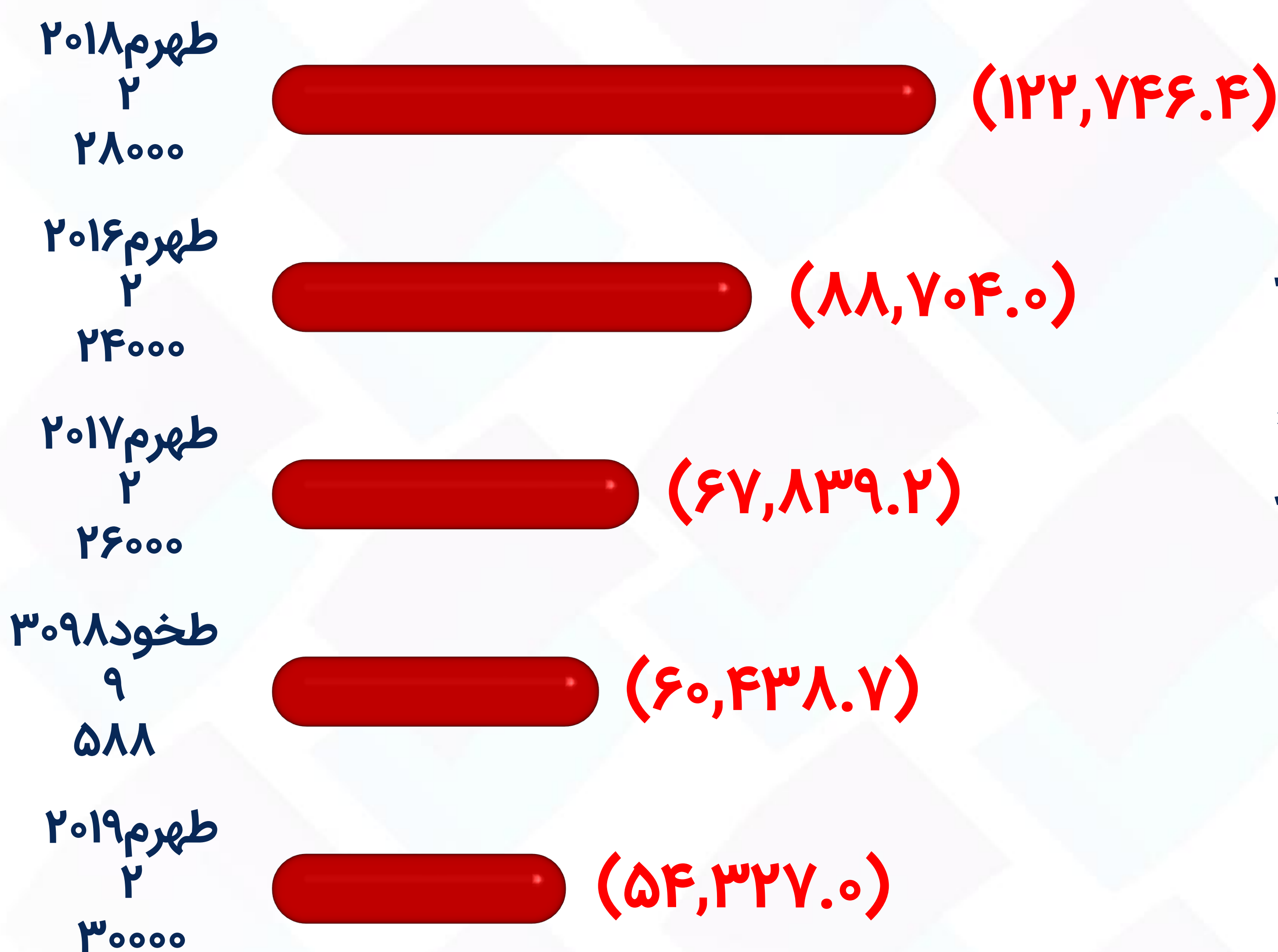
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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.