

شماره
۴۹۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۷ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

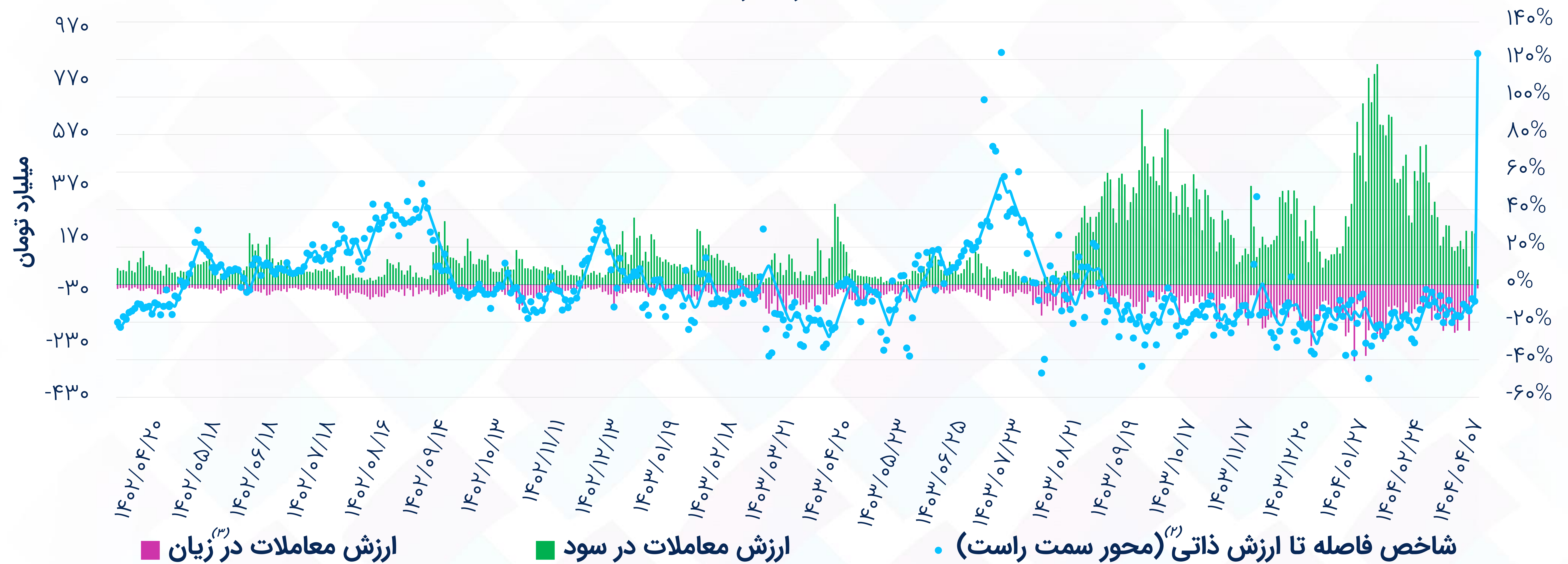




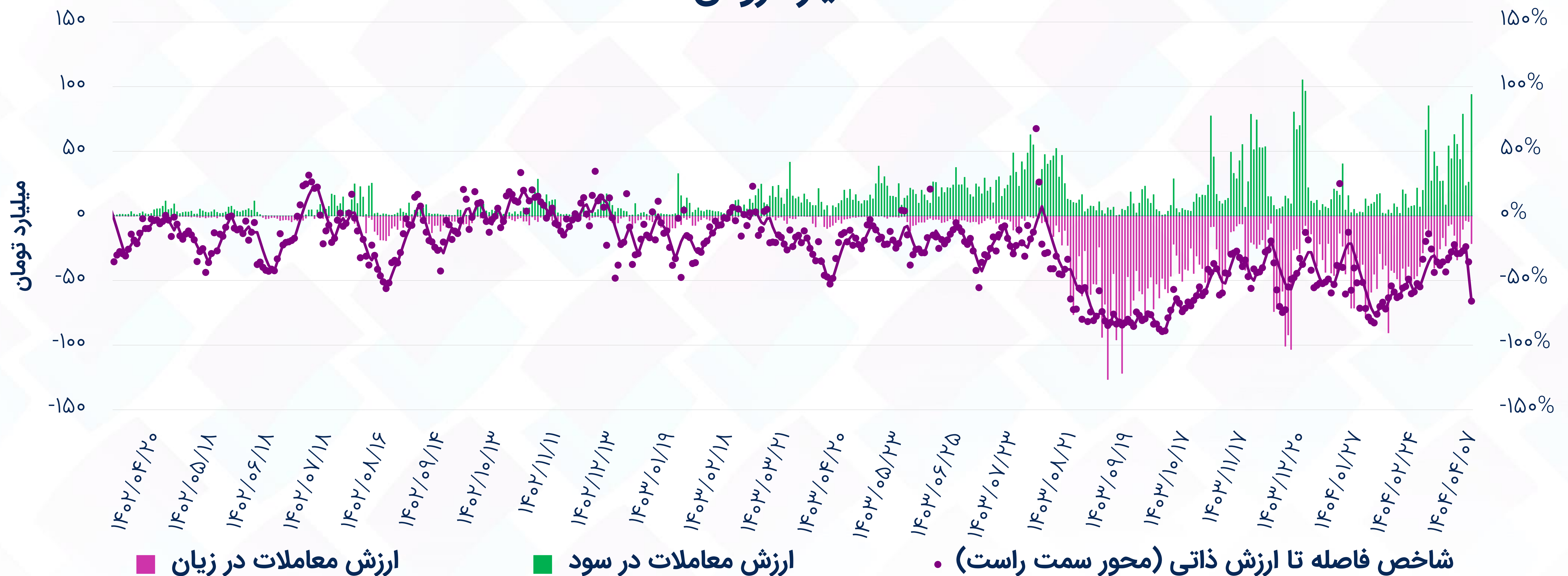
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

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

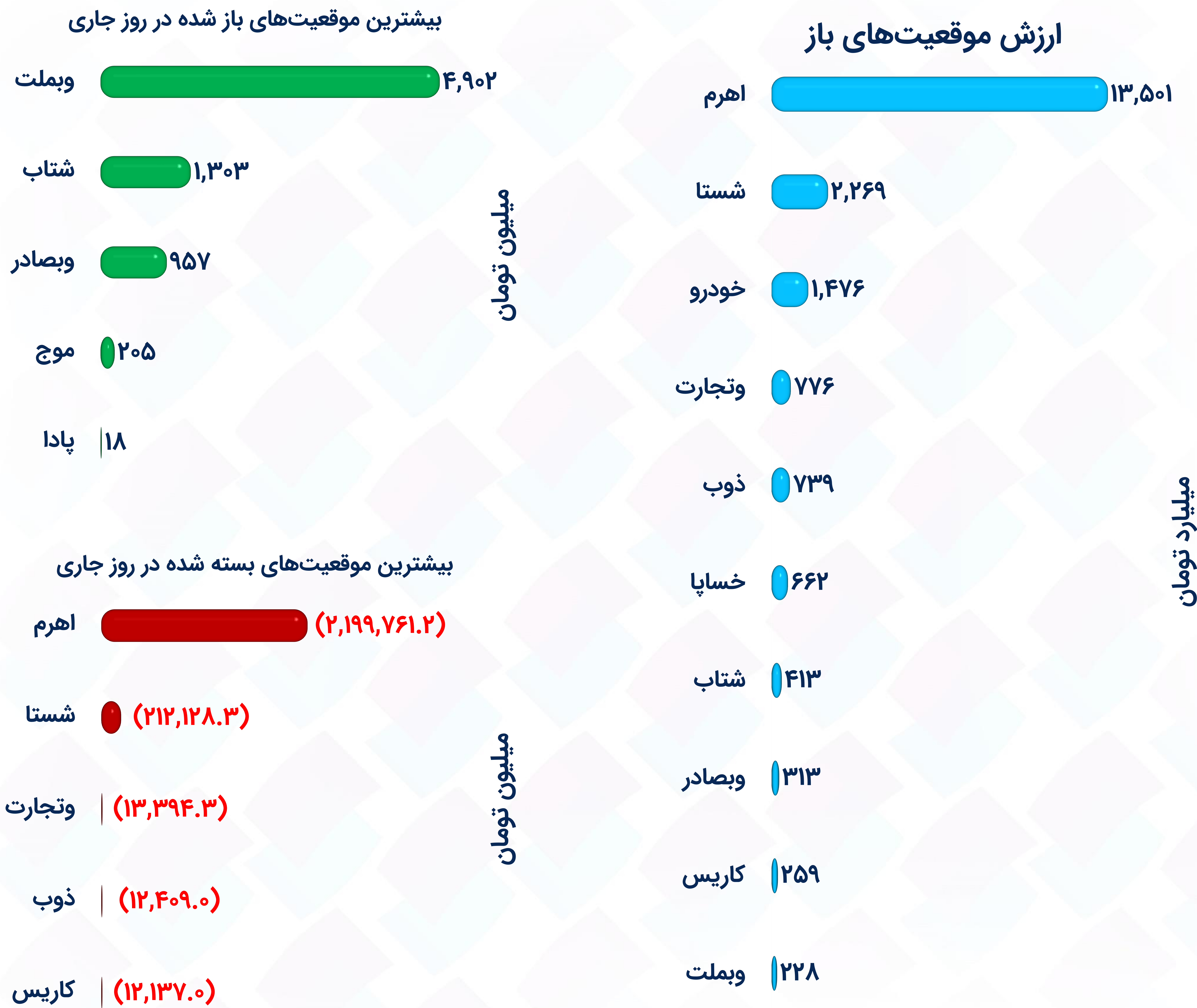
اختیار خرید

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	۴۵	۲۳.۰	۲,۴۷۹.۴	۱۰.۷	۱۲.۳	۱۲۰.۴%
شستا	۳۶	۴.۲	۹۶۲.۶	۳.۵	۰.۷	۱۹۶.۳%
ذوب	۲۰	۱.۹	۱۲۹.۱	۱.۴	۰.۵	۱۰۶.۸%
وبصادر	۹	۱.۲	۲۶.۵	۱.۱	۰.۱	۹۱.۷%
وتجارت	۱۲	۰.۸	۱۰۴.۶	۰.۴	۰.۳	۴۹.۳%
وتعاون	۴	۰.۵	۲.۶	۰.۵	۰.۰	(۲.۴%)
وبملت	۱۵	۰.۴	۱۷.۷	۰.۲	۰.۲	۷۳.۳%

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	۲۹	۹۵,۳۰۹.۱	۱,۰۰۵,۶۲۶.۳	۸۵,۱۴۱.۹	۱۰,۱۶۷.۳	(۶۴.۲%)
شستا	۱۱	۱۹,۳۵۹.۴	۲۳۶,۹۲۹.۵	۸,۵۲۸.۴	۱۰,۸۳۱.۰	(۷۴.۵%)
شتاب	۱	۵۰۵.۳	۱۵,۱۹۰.۶	۰.۰	۵۰۵.۳	(۹۶.۹%)
اطلس	۲	۱۳۲.۶	۱,۵۹۰.۷	۱۳۲.۶	۰.۰	(۲۲.۶%)
وتعاون	۳	۱۱۶.۹	۴,۴۷۵.۸	۱۱۵.۷	۱.۱	(۰.۱%)
خودران	۷	۶۰.۷	۷۵۶.۰	۶۰.۷	۰.۱	(۶۲.۹%)
توان	۳	۵۸.۸	۸۳۳.۶	۴.۲	۵۴.۶	(۷۳.۴%)

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

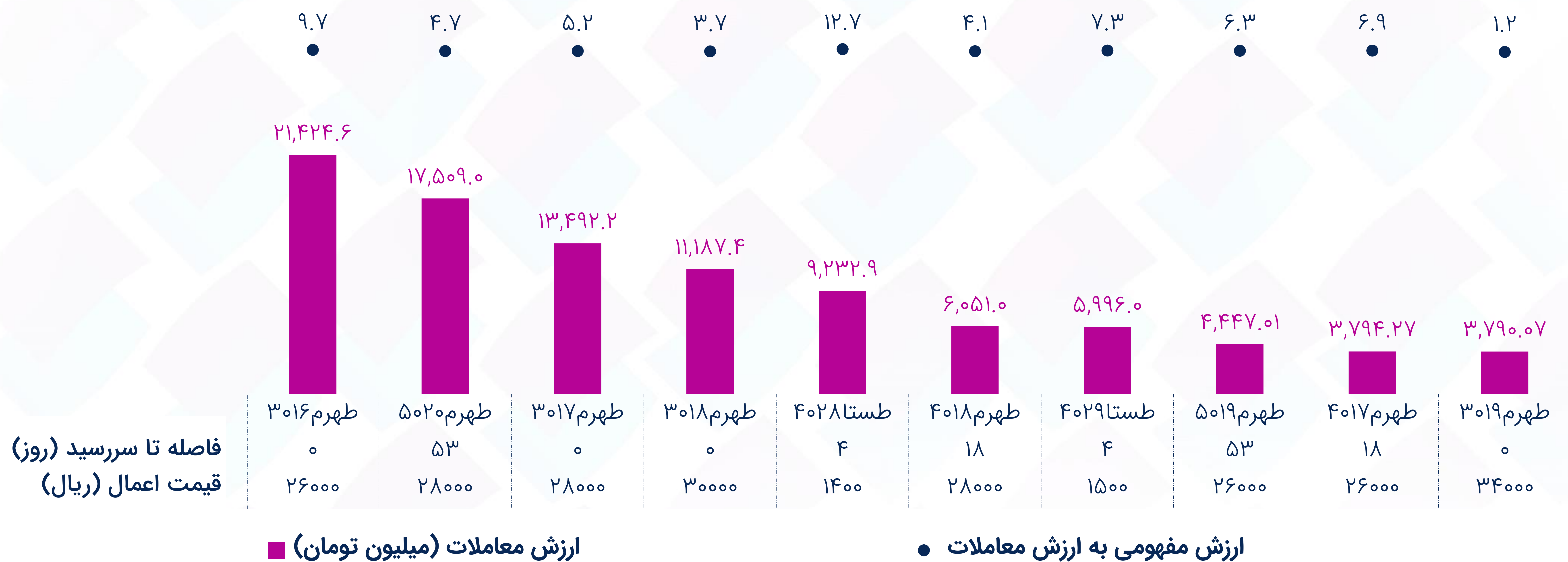


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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 ۴۰۱۸	شتاب	۱۵,۰۰۰	۴	۳.۵	۲۶	۱۵,۱۲۰	۱۵,۰۲۶	(۰.۶%)	۵۷۷.۹	۰.۶۳	۴۳۴	۱۵۶۸%
ضشنا ۴۰۱۸	شپنا	۳,۸۷۳	۱۱	۷.۱	۱۴	۳,۹۱۵	۳,۸۸۷	(۰.۷%)	۲۷۷.۶	۰.۶۵	۱۴۵	۹۳۶%
ضستا ۴۰۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۴	۴۹۹.۷	۵	۱,۴۱۵	۱,۴۰۵	(۰.۷%)	۲۸۱.۰	۰.۶۷	۳۹	۶۷۲%
ضتاب ۴۰۱۶	شتاب	۱۳,۰۰۰	۴	۸۵.۶	۳۸۷	۱۵,۱۲۰	۱۳,۳۸۷	(۱۱.۵%)	۳۴.۶	۱.۰۰	۲,۲۱۲	۴۷۲%
ضجهش ۴۰۰۴	جهش	۱۳,۰۰۰	۴	۱.۱	۲۸	۱۲,۶۱۰	۱۳,۰۲۸	۳.۳%	۴۶۵.۳	۰.۳۵	۱۵۵	۴۵۴%

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
ضستا ۴۰۳۵	شستا	۲,۲۰۰	۴	۲۸.۱	۱	۱,۴۱۵	۲,۲۰۱	۵۶%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۴۰۰۶	ذوب	۸۰۰	۱۸	۳.۲	۱	۴۱۷	۸۰۱	۹۲%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۸	وتجارت	۸۰۰	۱۱	۱۲.۰	۲	۵۰۱	۸۰۲	۶۰%	۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۳۴	شستا	۲,۰۰۰	۴	۱۶.۴	۱	۱,۴۱۵	۲,۰۰۱	۴۱%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۳۳	شستا	۱,۹۰۰	۴	۲۰.۴	۱	۱,۴۱۵	۱,۹۰۱	۳۴%	۱,۹۰۱.۰	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
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۸	۳۳.۳	۱۸,۵۰۰	۲۵,۴۵۰	۲۳,۵۰۰	(۷.۷%)	۱.۳	-۱.۰۰	۱۵,۷۸۰	(۱۴.۷%)
طهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۸	۶۶۹.۸	۱۰,۵۴۸	۲۵,۴۵۰	۲۳,۴۵۲	(۷.۹%)	۲.۲	-۱.۰۰	۷,۹۲۷	(۲۴.۸%)
طهرم ۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸۱	۴۷.۰	۱۸,۸۰۰	۲۵,۴۵۰	۲۳,۲۰۰	(۸.۸%)	۱.۲	-۰.۹۹	۱۳,۴۵۱	(۲۸.۵%)
طستا ۴۰۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۴	۲۵۵.۳	۴۰۱	۱,۴۱۵	۱,۲۹۹	(۸.۲%)	۳.۲	-۱.۰۰	۲۷۳	(۳۱.۹%)
طستا ۴۰۳۰	شستا	۱,۶۰۰	۴	۲,۰۵۳.۹	۳۱۳	۱,۴۱۵	۱,۲۸۷	(۹.۰%)	۴.۱	-۱.۰۰	۱۷۴	(۴۴.۵%)

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 ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۸	۲.۰	۲۰۰	۲۵,۴۵۰	۱۴,۸۰۰	(۴۱.۸%)	۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۸	۰.۱	۳۵۰	۲۵,۴۵۰	۱۵,۶۵۰	(۳۸.۵%)	۴۴.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۶۰۲۵	اهرم	۱۶,۰۰۰	۸۱	۰.۵	۵,۰۰۰	۲۵,۴۵۰	۱۱,۰۰۰	(۵۶.۸%)	۲.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۴۰۲۶	شستا	۱,۲۰۰	۴	۰.۱	۲	۱,۴۱۵	۱,۱۹۸	(۱۵.۳%)	۵۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۵۰۱۵	اهرم	۱۸,۰۰۰	۵۳	۱۲.۰	۴۲۶	۲۵,۴۵۰	۱۷,۵۷۴	(۳۰.۹%)	۴۱.۳	۰.۰۰	۲	(۹۹.۶%)

(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

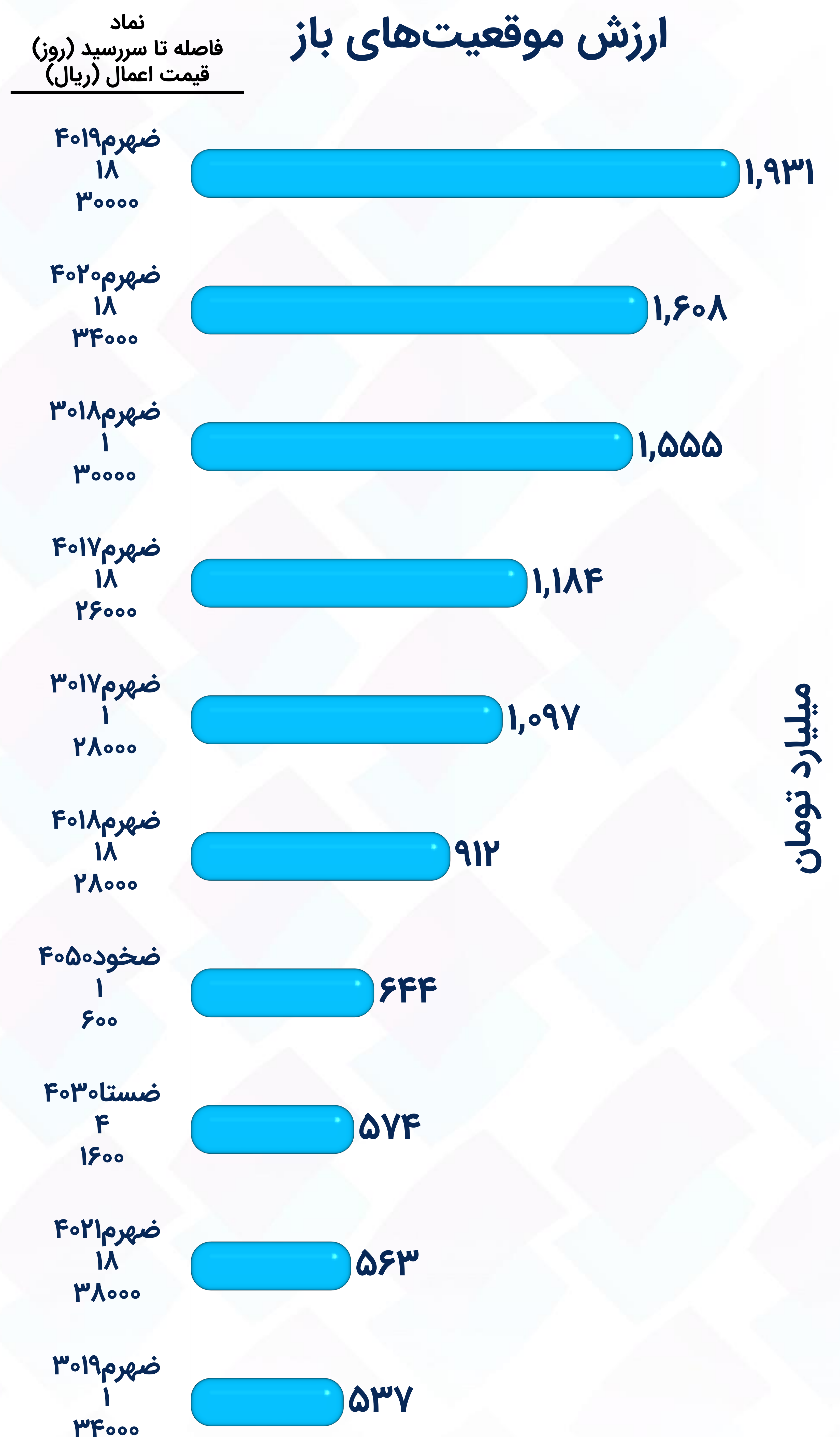
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



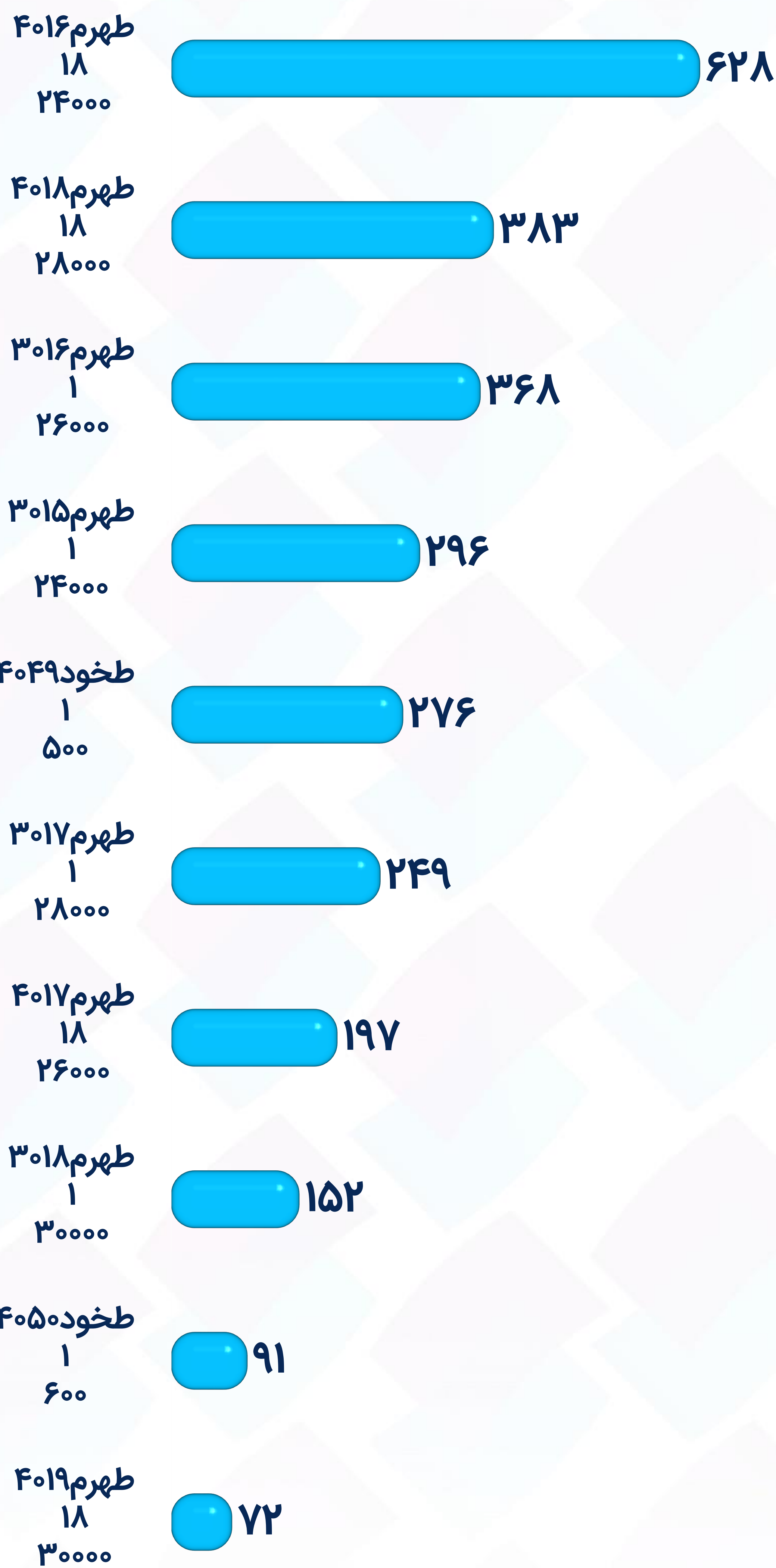
ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

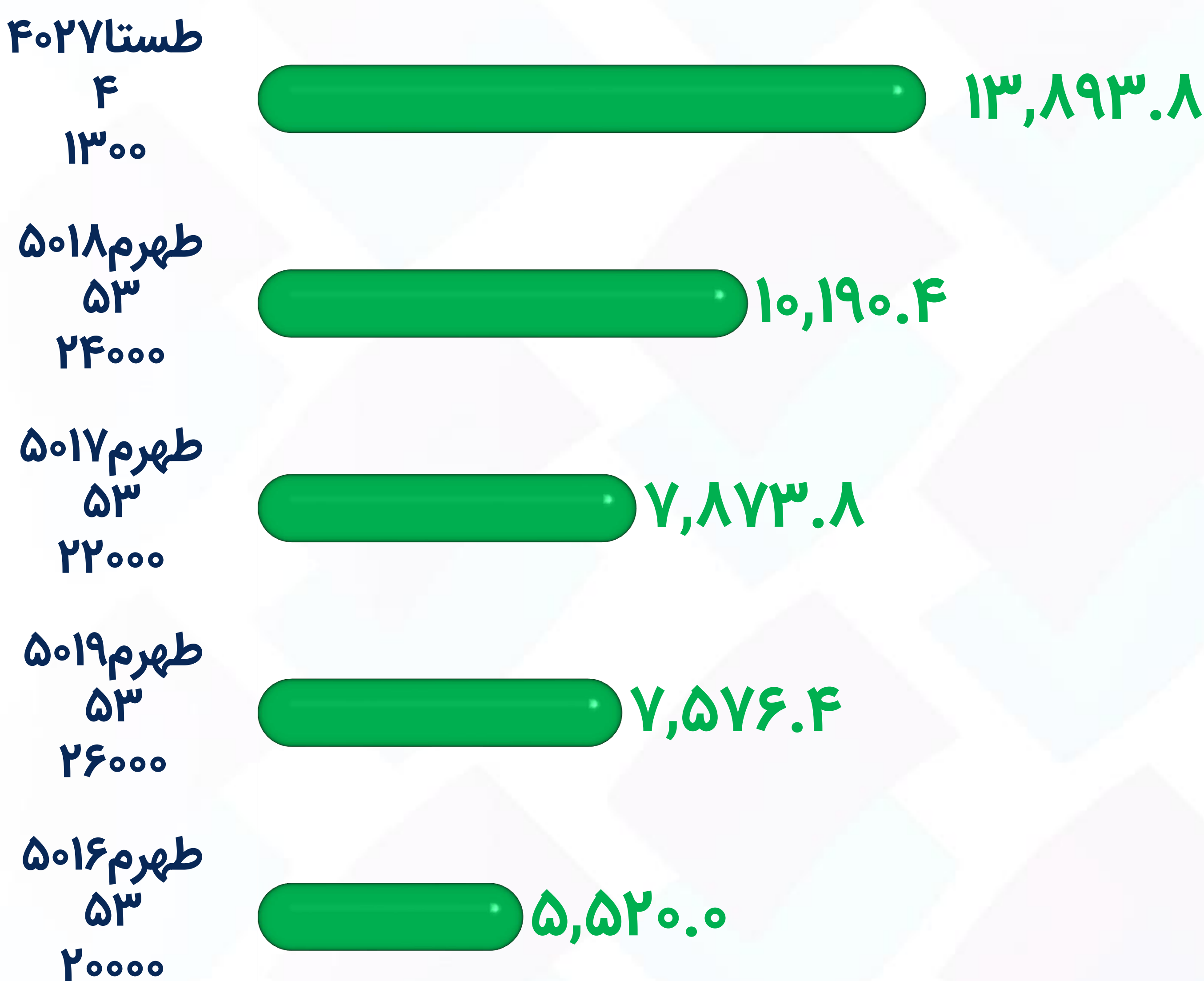
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

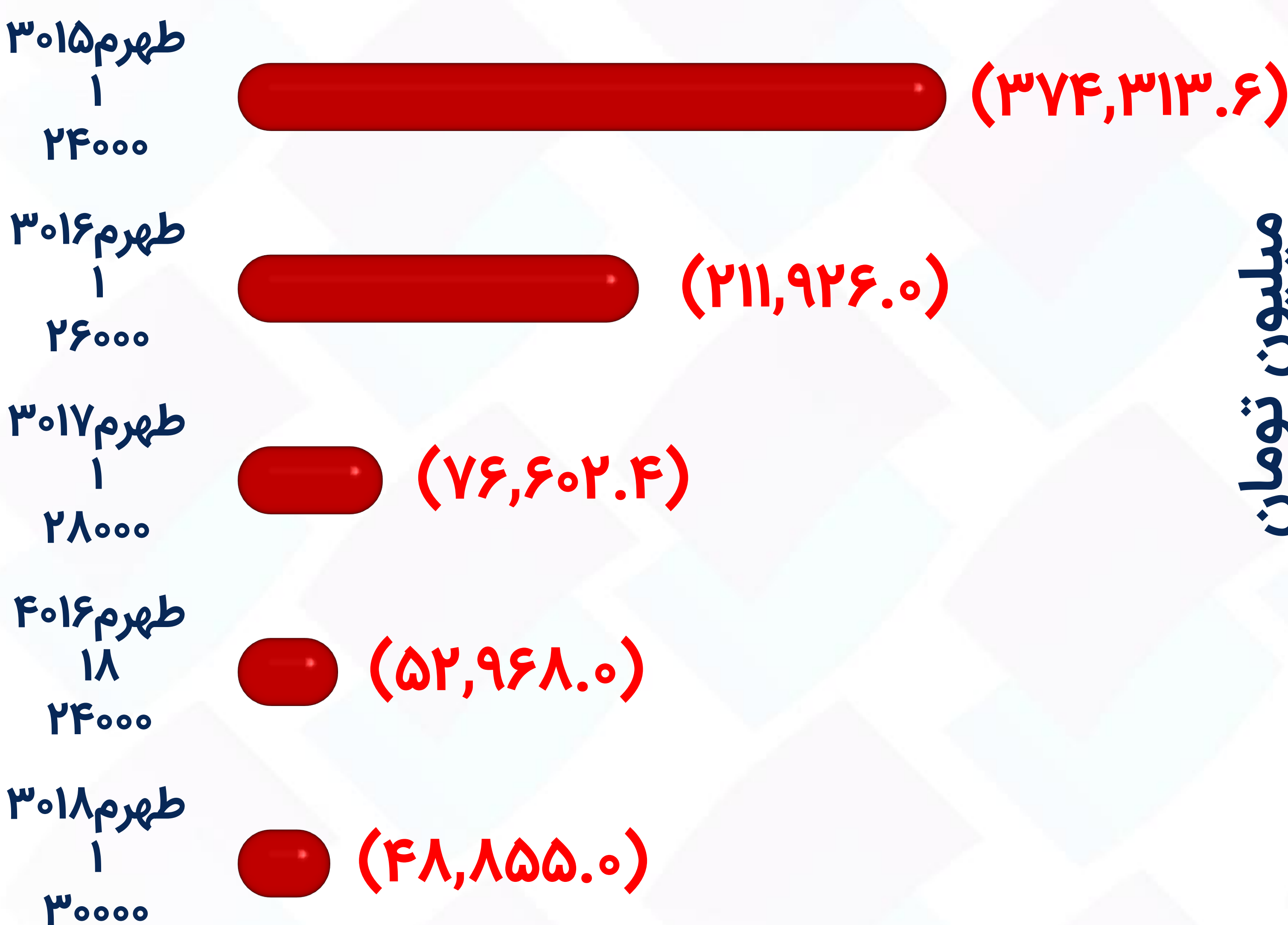
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

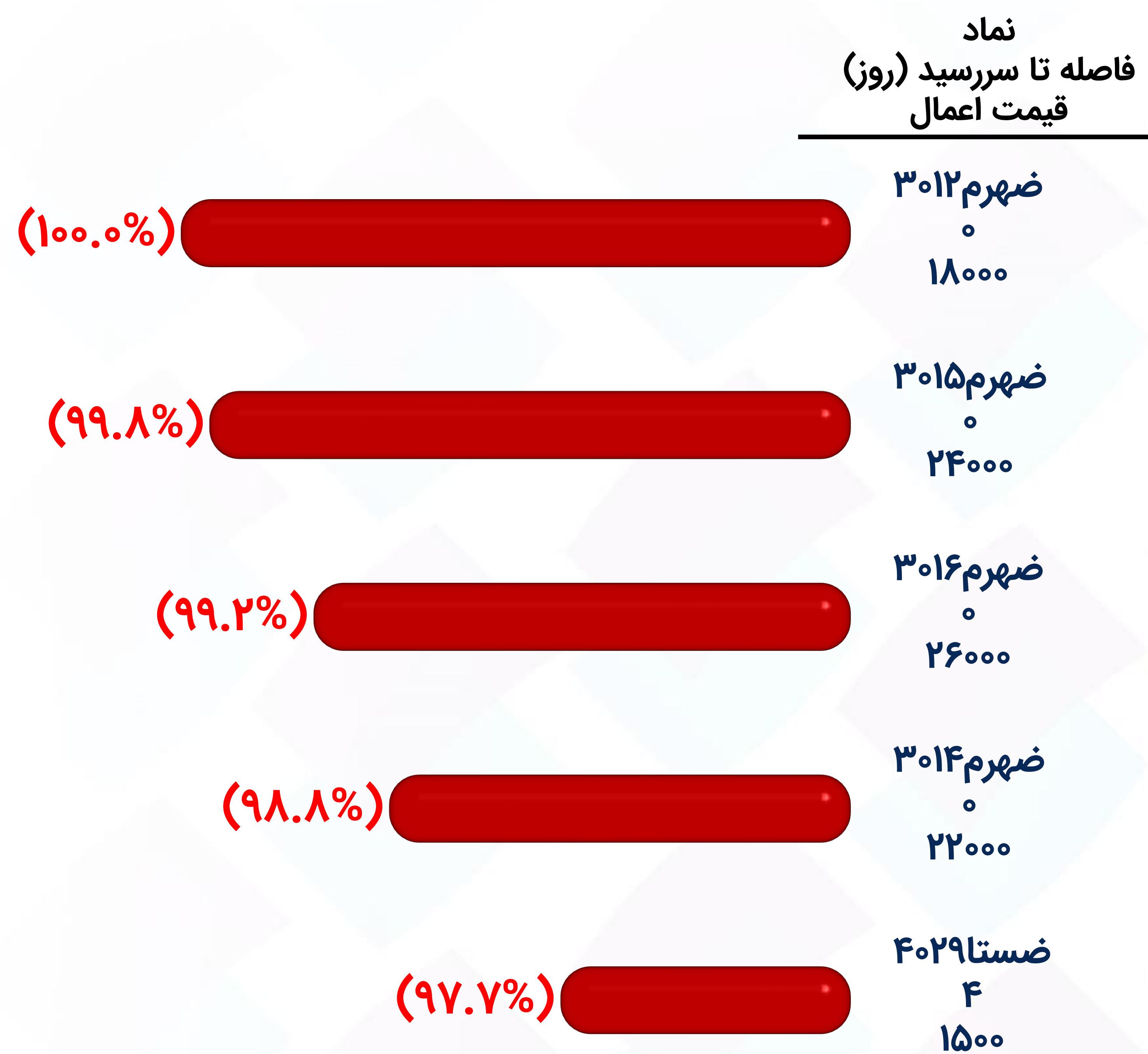
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



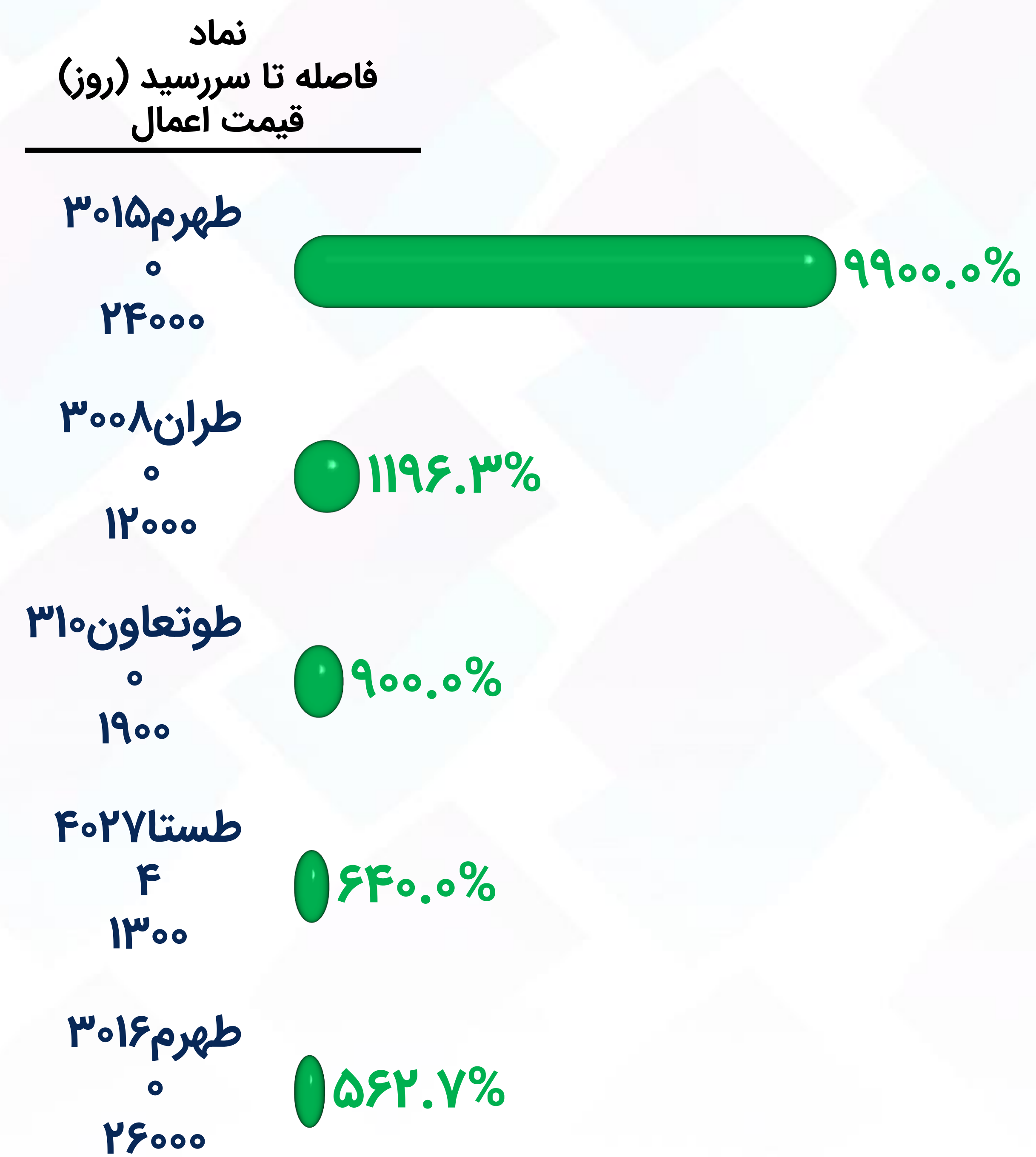
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

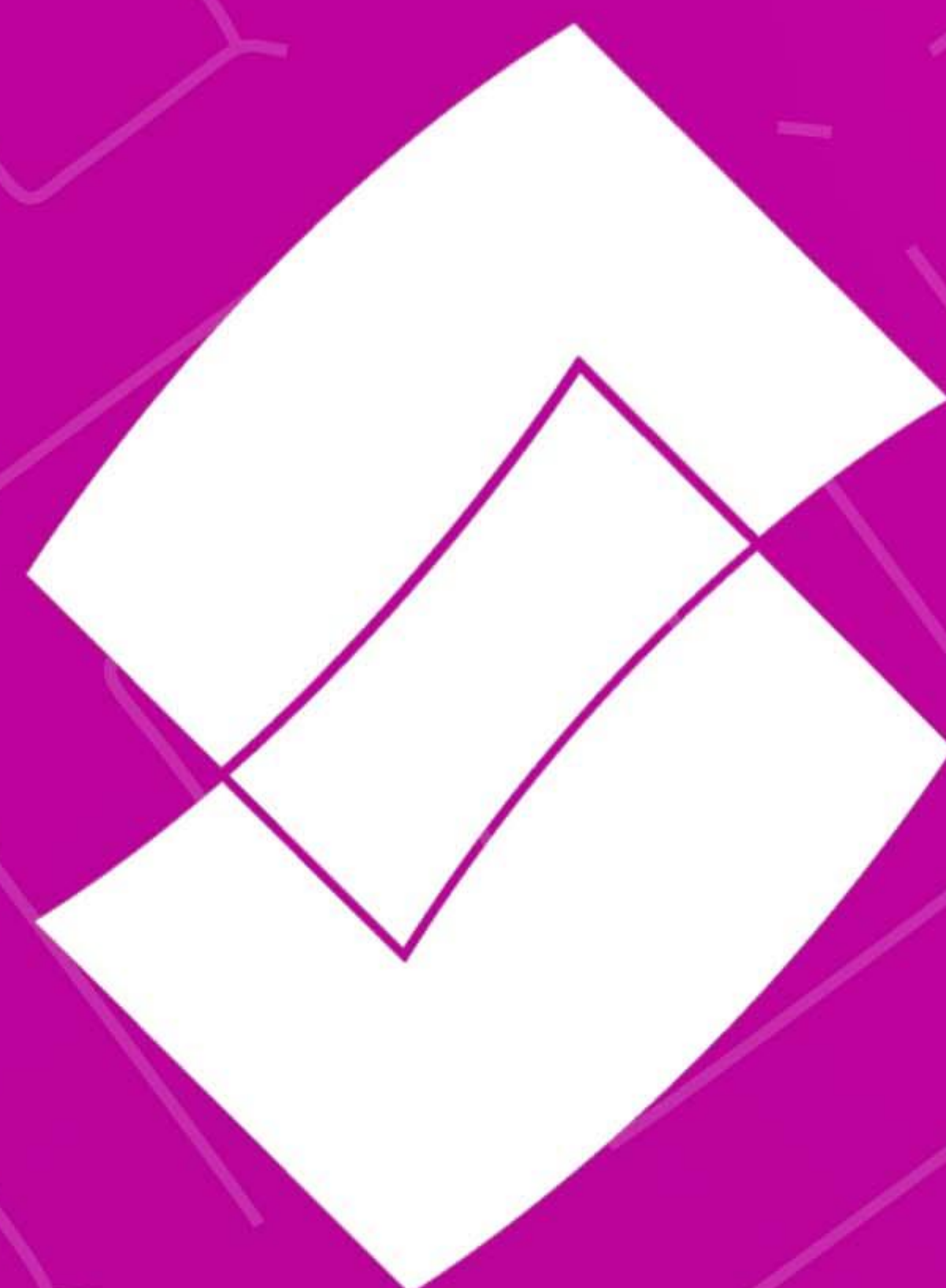
اختیار خرید



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

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.