شماره
۴۹۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۸ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص
کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار
NOVIN Investment Bank Brokerage

اختیار باشماست!

استفاده از اهرم یا پوشش ریسک

تنها با ثبت نام در نئوکارگزاری نوین
معاملات خودرا در سامانه صحرا شروع کنید.

My.Nibb.ir

ره پویان پردازش گستر صحرا

کارگزاری تأمین سرمایه نوین
شرکت سهامی خاص

www.nibb.ir

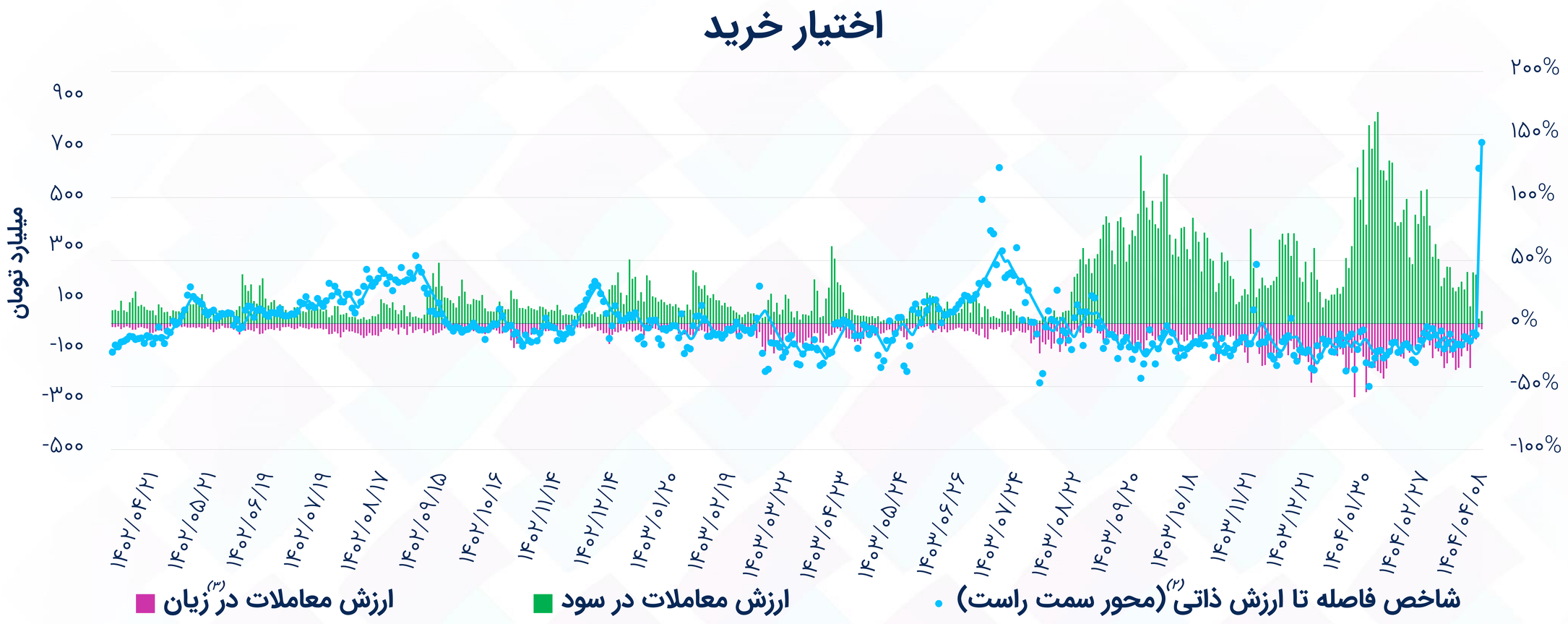
ارزش معاملات

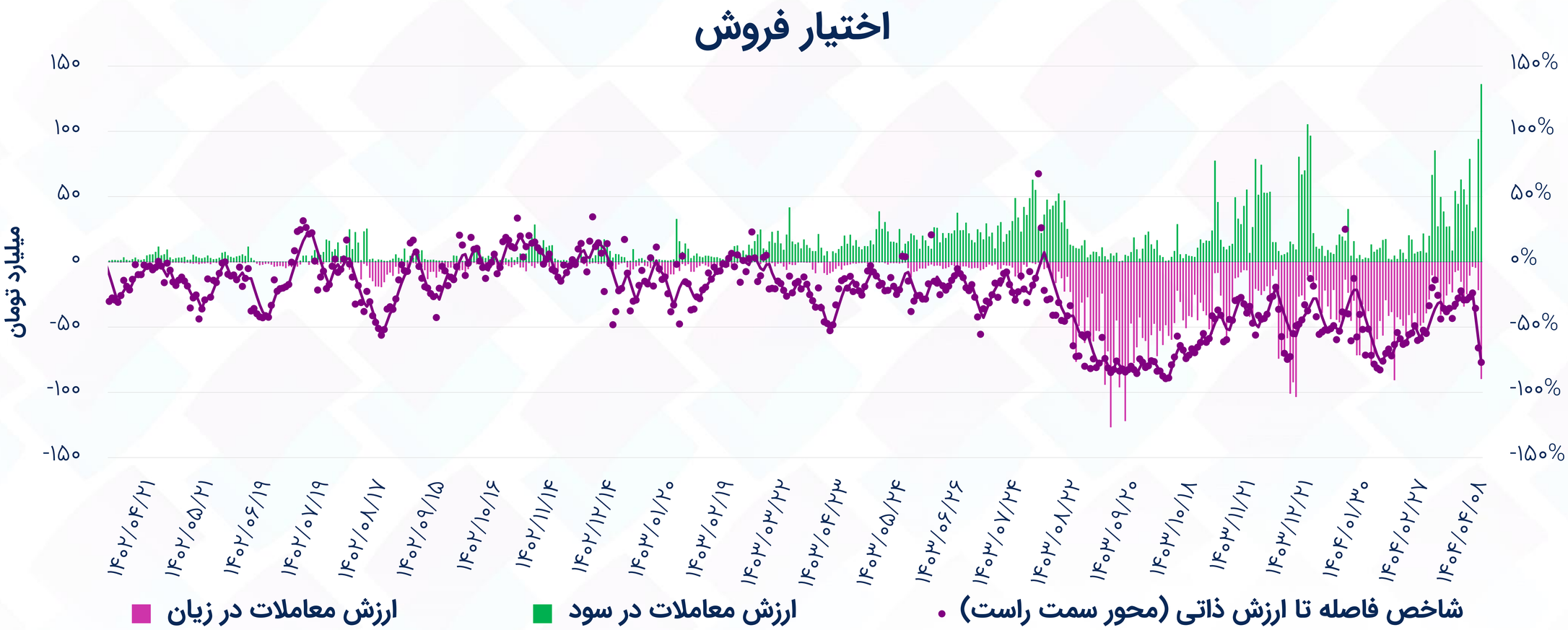
اختیار خرید

اختیار فروش

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

شاخص فاصله تا ارزش ذاتی[۱]





(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

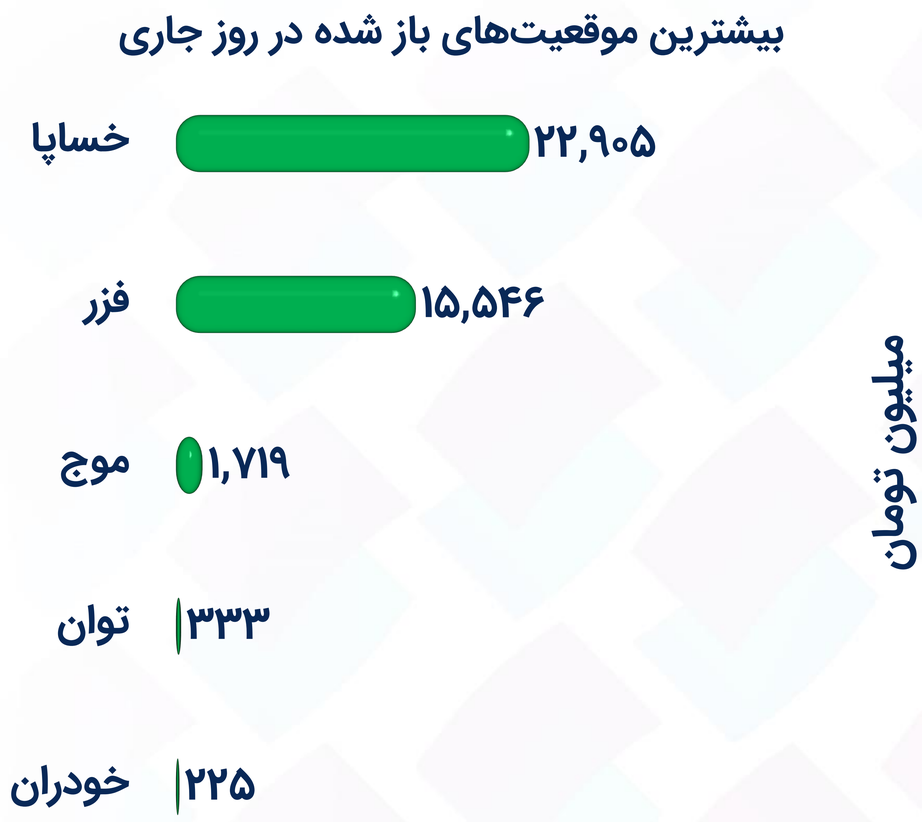
اختیار خرید

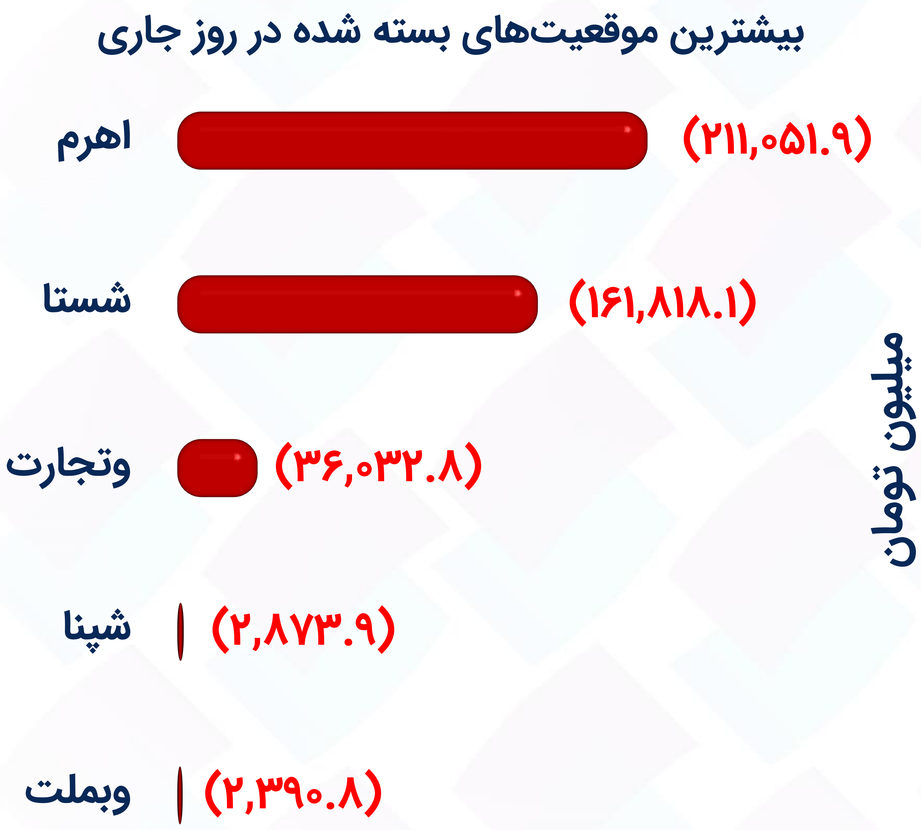
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۶	۵۳.۰	۳,۲۶۹.۳	۳۴.۲	۱۸.۸	۱۶۲.۴%
شستا	۳۸	۶.۱	۶۱۴.۵	۴.۲	۱.۹	۱۴۵.۵%
خساپا	۲۴	۳.۴	۷۹.۲	۳.۳	۰.۲	۳۱.۵%
پادا	۲	۲.۰	۴۶.۳	۲.۰	۰.۰	۲۵.۷%
ذوب	۱۷	۱.۳	۴۱.۴	۱.۲	۰.۱	۷۸.۲%
فزر	۱۵	۱.۲	۱۹.۵	۱.۲	۰.۰	۱۵۴.۲%
وبصادر	۹	۱.۰	۱۸.۹	۰.۹	۰.۰	۶۲.۴%

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	۲۸	۲۰۸,۵۶۸.۳	۱,۴۰۵,۵۶۳.۰	۱۲۲,۰۶۵.۶	۸۶,۵۰۲.۷	(۷۷.۵%)
شستا	۱۲	۱۶,۵۰۸.۶	۱۹۲,۸۸۱.۶	۱۳,۴۴۵.۱	۳,۰۶۳.۴	(۷۲.۵%)
خودران	۶	۲۰۸.۹	۱,۵۹۵.۵	۲۰۴.۲	۴.۷	(۴۶.۲%)
وتعاون	۳	۱۱۱.۱	۴,۸۱۲.۲	۹۲.۸	۱۸.۳	(۲۹.۱%)
وتجارت	۱	۹۶.۱	۵۱۹.۱	۹۶.۱	۰.۰	(۸۲.۵%)
توان	۲	۷۳.۴	۵۳۶.۶	۷۳.۴	۰.۰	(۶۷.۰%)
اطلس	۲	۴۹.۲	۵۵۸.۲	۴۹.۲	۰.۰	(۳۱.۰%)

موقعیت‌های باز[1] به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید





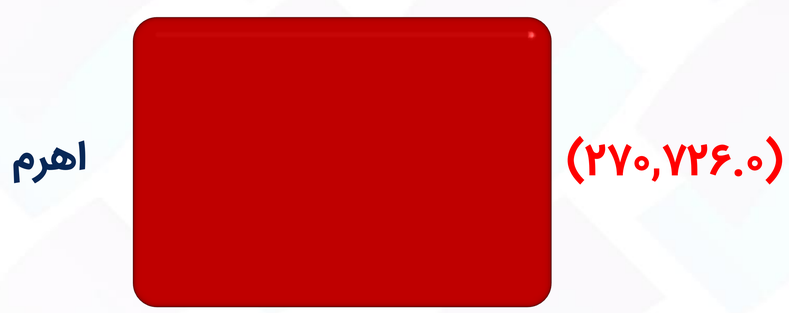
*(۱) **ارزش موقعیت باز:** تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال*

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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
ضستا۴۰۲۸	شستا	۱,۴۰۰	۳	۱۲۲.۰	۲	۱,۳۷۳	۱,۴۰۲	۲.۱%	۷۰۱.۰	۰.۳۷	۱۳	۵۵۹%
ضتاب۴۰۱۶	شتاب	۱۳,۰۰۰	۳	۴۷.۳	۳۰۶	۱۴,۶۷۰	۱۳,۳۰۶	(۹.۳%)	۴۳.۵	۱.۰۰	۱,۷۴۵	۴۷۰%
ضشنا۴۰۱۸	شپنا	۳,۸۷۳	۱۰	۷.۷	۱۴	۳,۷۹۸	۳,۸۸۷	۲.۳%	۲۷۷.۶	۰.۴۵	۷۲	۴۱۲%
ضستا۴۰۲۷	شستا	۱,۳۰۰	۳	۱,۳۹۷.۹	۱۹	۱,۳۷۳	۱,۳۱۹	(۳.۹%)	۶۹.۴	۰.۹۴	۸۲	۳۳۰%
ضهرم۴۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۷	۹۷.۱	۷۷۰	۲۴,۶۹۰	۲۲,۷۷۰	(۷.۸%)	۲۹.۶	۰.۹۶	۳,۰۹۸	۳۰۲%

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
ضجار۴۰۱۸	وتجارت	۸۰۰	۱۰	۳.۱	۱	۴۸۶	۸۰۱	۶۵%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا۴۰۳۵	شستا	۲,۲۰۰	۳	۱۰.۲	۱	۱,۳۷۳	۲,۲۰۱	۶۰%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا۴۰۳۳	شستا	۱,۹۰۰	۳	۳.۱	۱	۱,۳۷۳	۱,۹۰۱	۳۸%	۱,۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا۴۰۳۲	شستا	۱,۸۰۰	۳	۵.۲	۱	۱,۳۷۳	۱,۸۰۱	۳۱%	۱,۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضفلا۵۰۲۳	فولاد	۶,۵۰۰	۳۸	۱.۱	۱۷	۳,۲۹۳	۶,۵۱۷	۹۸%	۳۸۳.۴	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
طهرم۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۷	۹.۷	۱۶,۰۸۳	۲۴,۶۹۰	۲۱,۹۱۷	(۱۱.۲%)	۱.۴	-۱.۰۰	۱۲,۶۶۳	(۲۱.۳%)
طستا۴۰۳۲	شستا	۱,۸۰۰	۳	۸۲.۳	۵۷۹	۱,۳۷۳	۱,۲۲۱	(۱۱.۱%)	۲.۱	-۱.۰۰	۴۱۷	(۲۸.۰%)
طستا۴۰۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۳	۱۸۲.۶	۴۵۲	۱,۳۷۳	۱,۲۴۸	(۹.۱%)	۲.۸	-۱.۰۰	۳۱۷	(۲۹.۸%)
طهرم۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۷	۴۸۶.۱	۱۲,۴۶۵	۲۴,۶۹۰	۲۱,۵۳۵	(۱۲.۸%)	۱.۷	-۱.۰۰	۸,۷۳۱	(۳۰.۰%)
طهرم۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸۰	۲.۲	۲۲,۰۰۰	۲۴,۶۹۰	۲۰,۰۰۰	(۱۹.۰%)	۰.۹	-۱.۰۰	۱۴,۲۴۷	(۳۵.۲%)

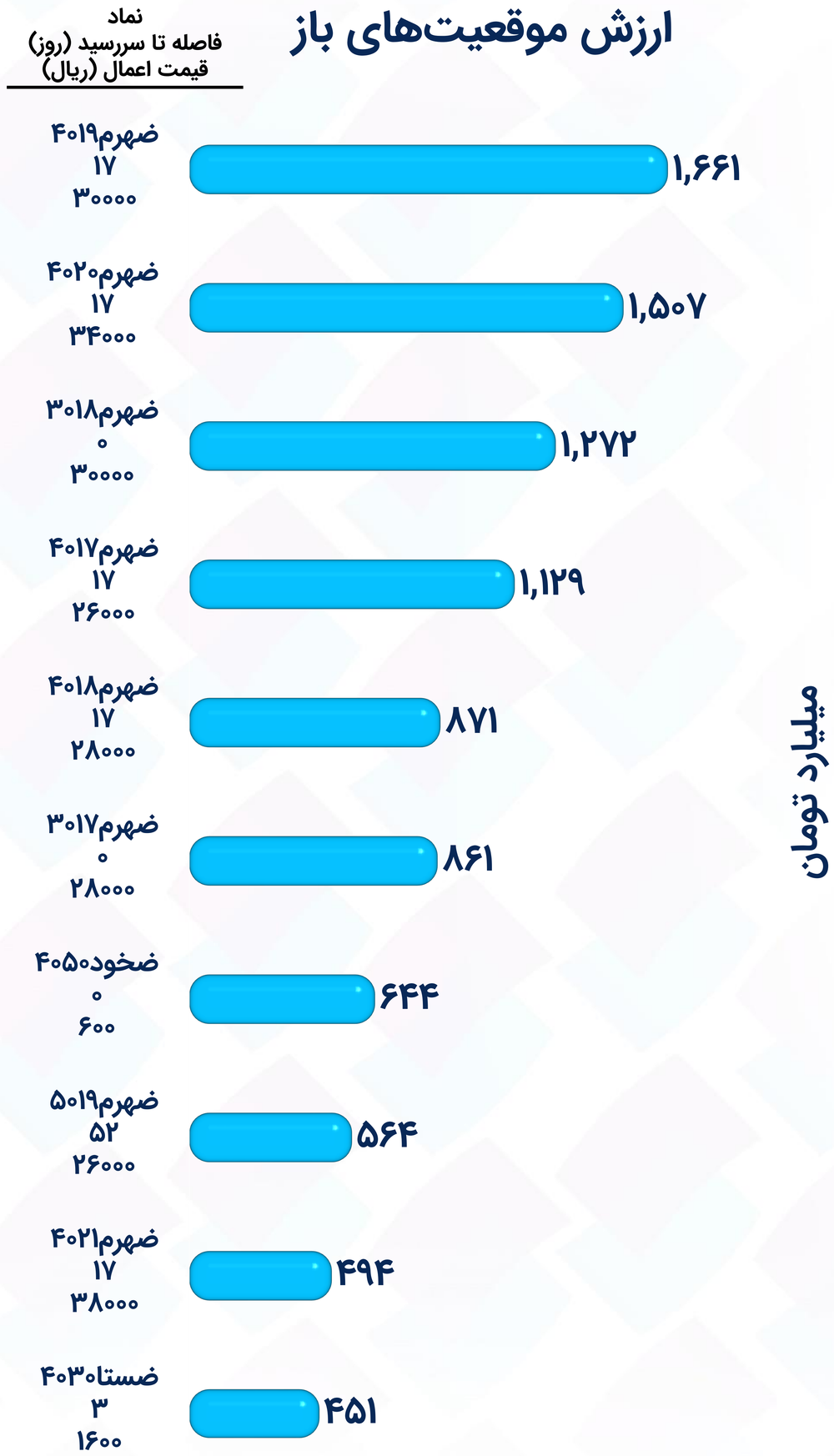
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طستا۴۰۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۳	۱.۷	۴	۱,۳۷۳	۱,۰۹۶	(۲۰.۲%)	۲۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۷	۰.۰	۲۰۰	۲۴,۶۹۰	۱۵,۸۰۰	(۳۶.۰%)	۷۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا۴۰۲۶	شستا	۱,۲۰۰	۳	۱۹۸.۵	۱۳	۱,۳۷۳	۱,۱۸۷	(۱۳.۵%)	۹۱.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۲	۴۷.۴	۲۹۷	۲۴,۶۹۰	۱۵,۷۰۳	(۳۶.۴%)	۵۲.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم۵۰۱۵	اهرم	۱۸,۰۰۰	۵۲	۶۸۹.۷	۵۶۳	۲۴,۶۹۰	۱۷,۴۳۷	(۲۹.۴%)	۳۱.۰	۰.۰۰	۳	(۹۹.۴%)

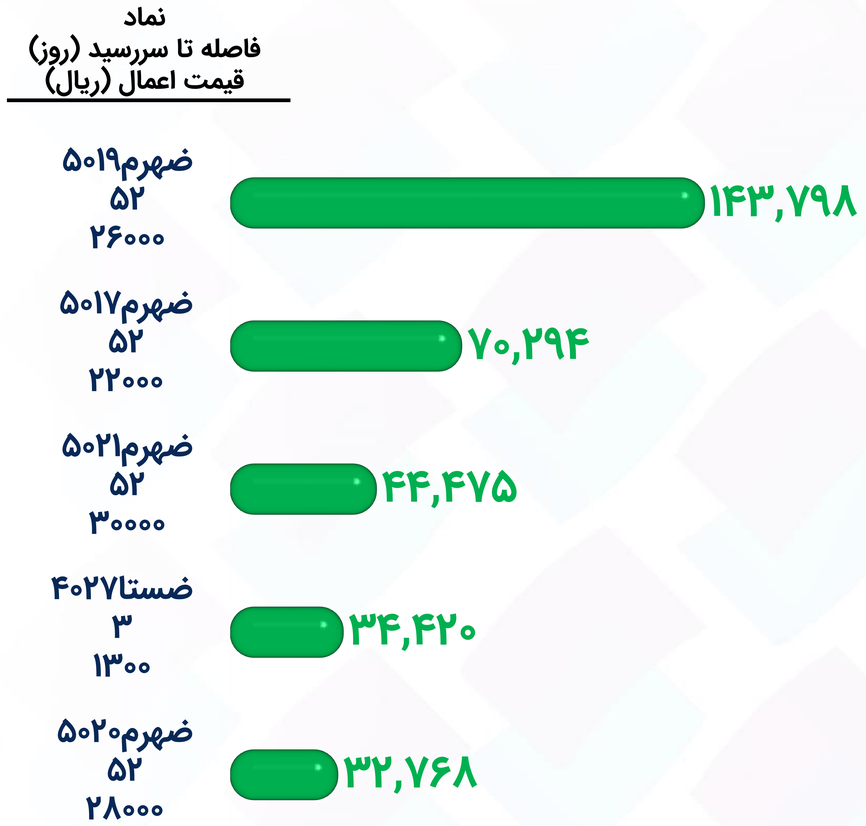
*(۱) **سربه‌سر :** قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است.)*
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

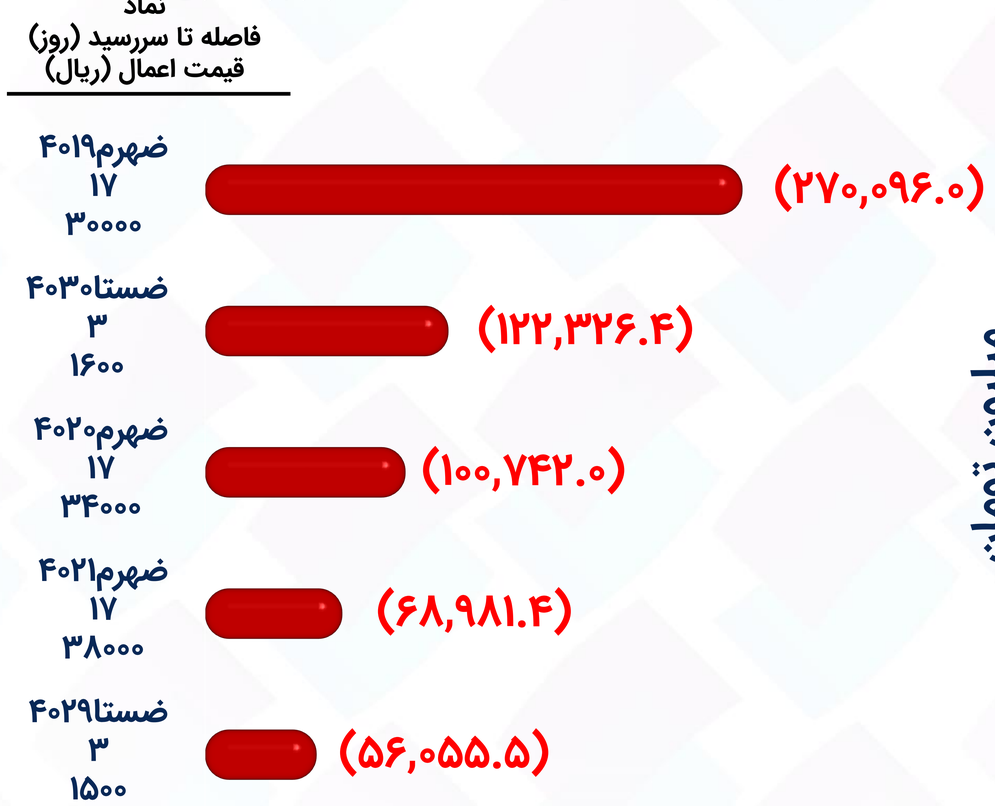
ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

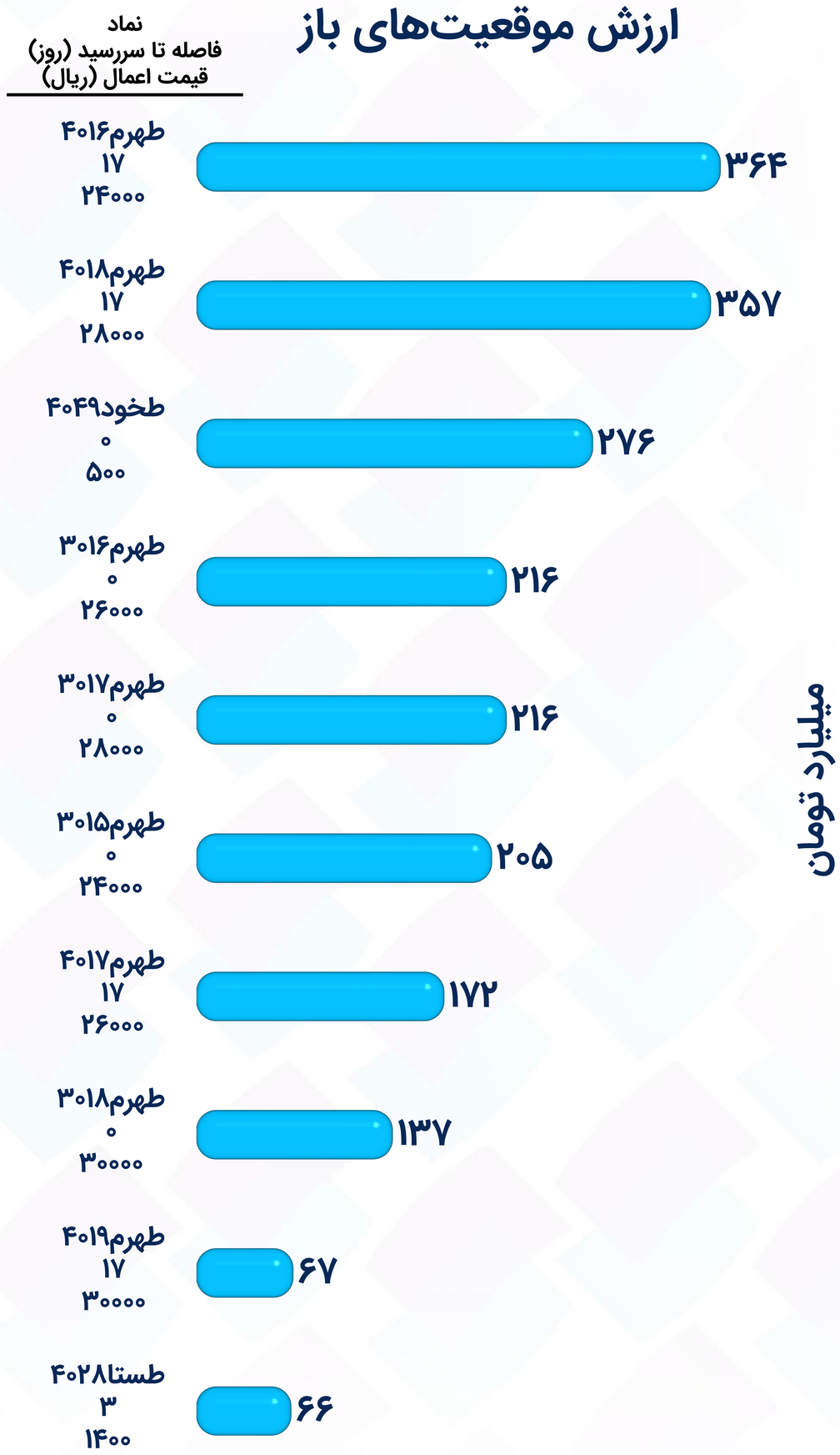


بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

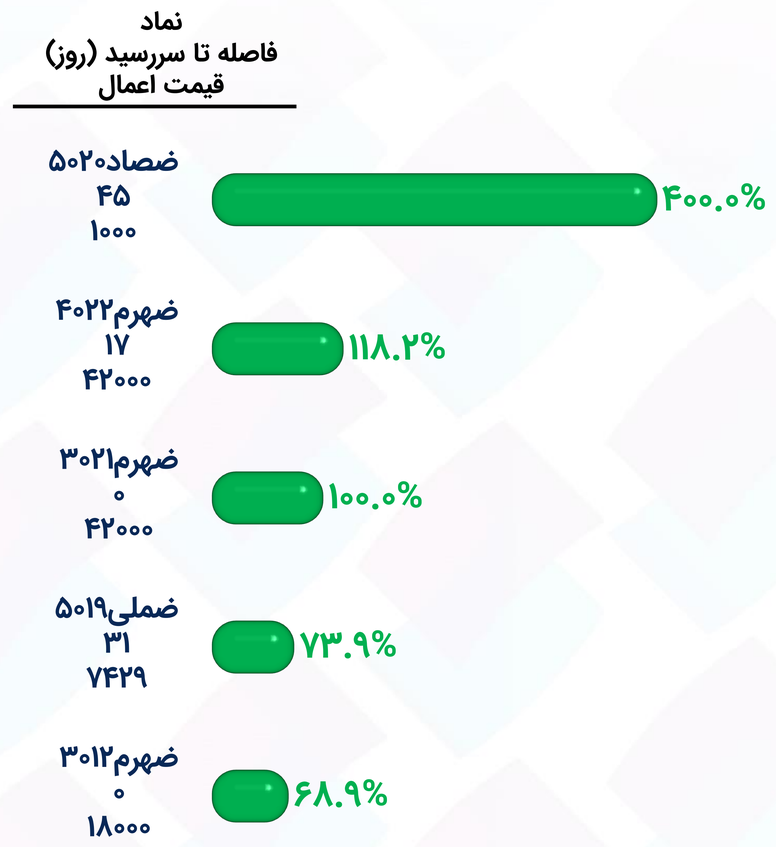


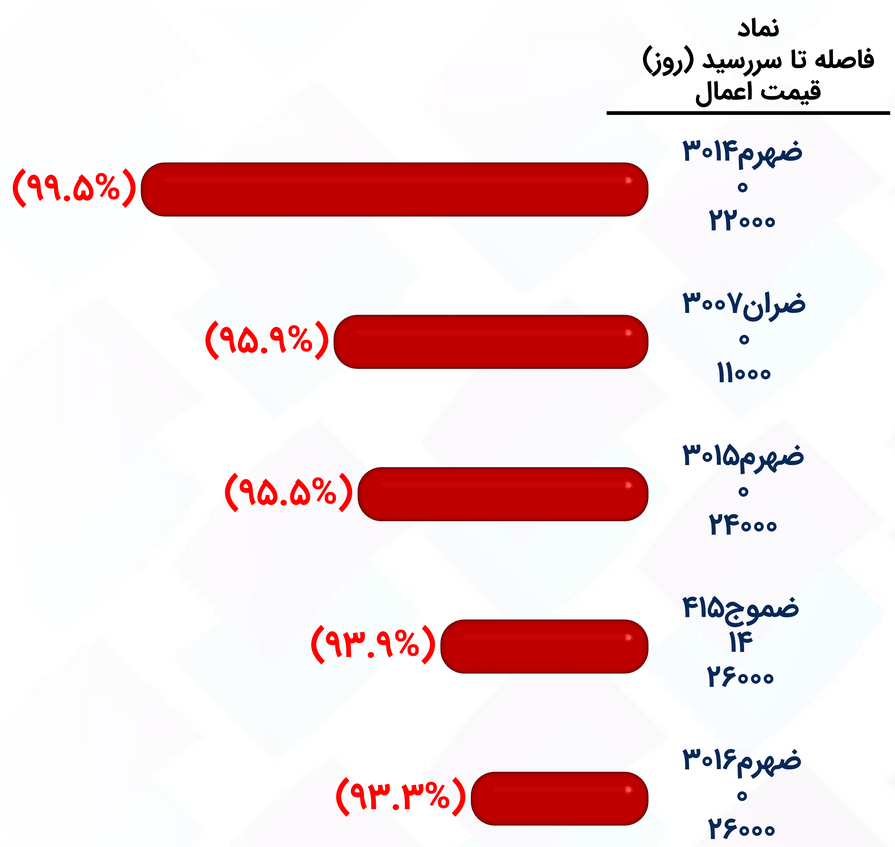
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

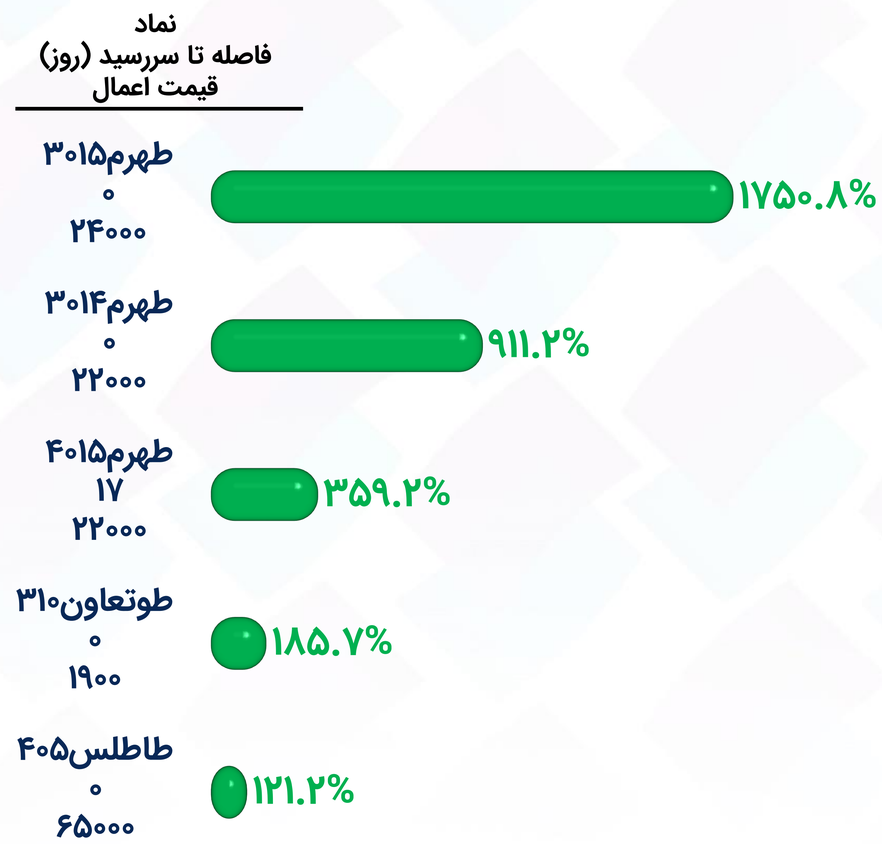
بیشترین تغییرات قیمت (۱)

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

آدرس

خیابان ولیعصر، خیابان همایون
شهنواز (گلستان)، پلاک ۱۱۰

تلفن

۰۲۱ ۸۶۷۹ ۱۰۰۰

وبسایت

nibb.ir
my.nibb.ir

تهیه و تنظیم: واحد تحلیل کارگزاری تأمین سرمایه نوین

کارشناس واحد تحلیل: زهره عباسی

این گزارش صرفا جهت اطلاع از شرایط بازارها تهیه شده است،
محتوای آن نباید به تنهایی جهت اخذ تصمیمات مالی و
سرمایه گذاری و خرید و فروش اوراق بهادار مورد استفاده قرار گیرد.