

شماره

۵۰۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۹ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





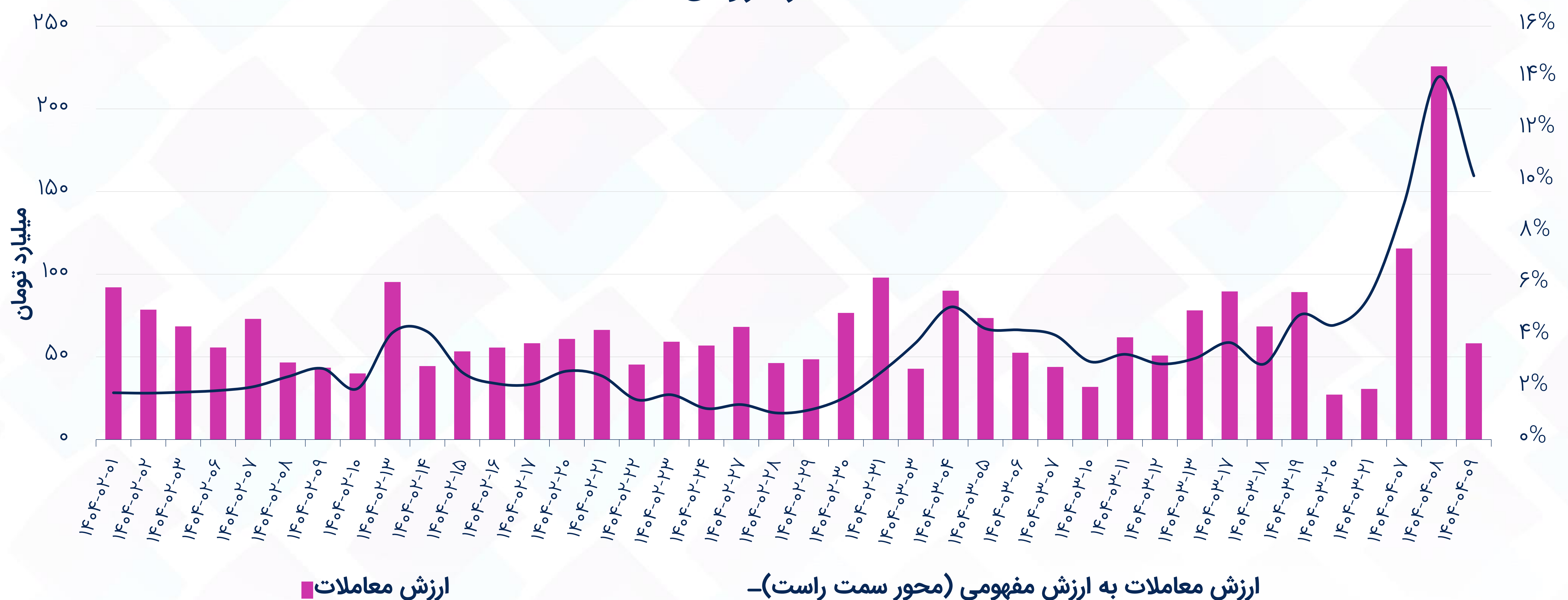
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



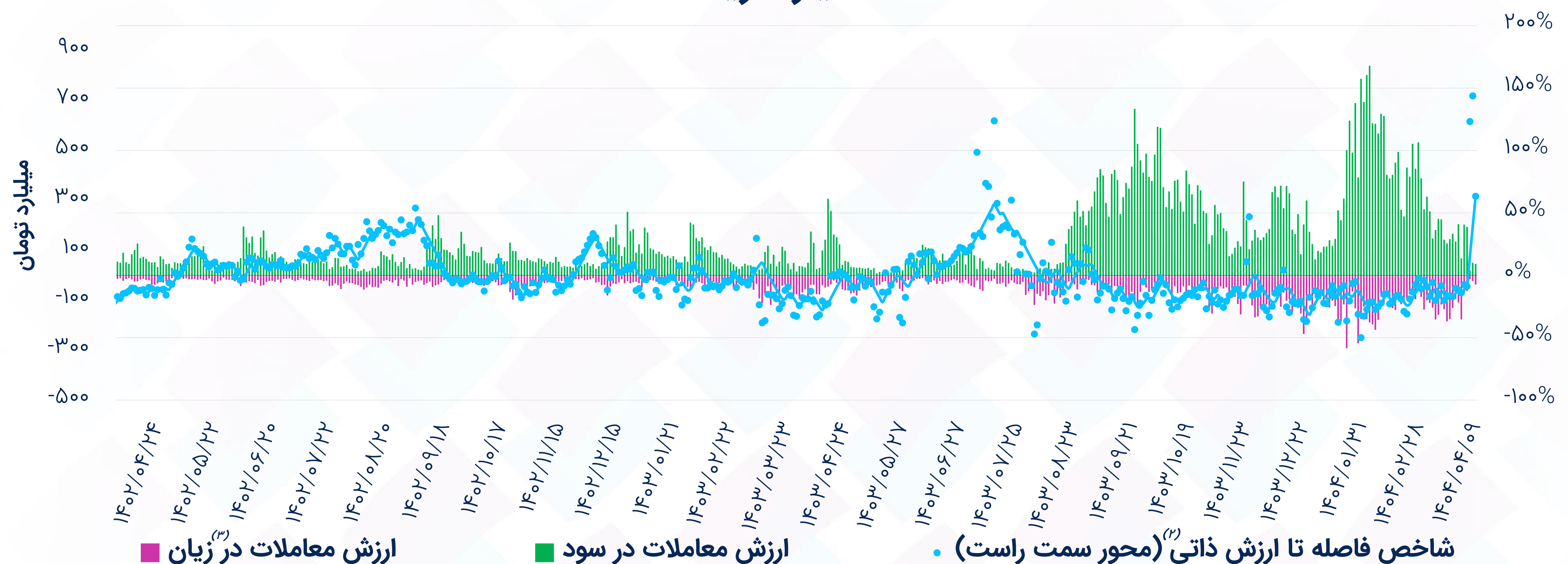
اختیار فروش



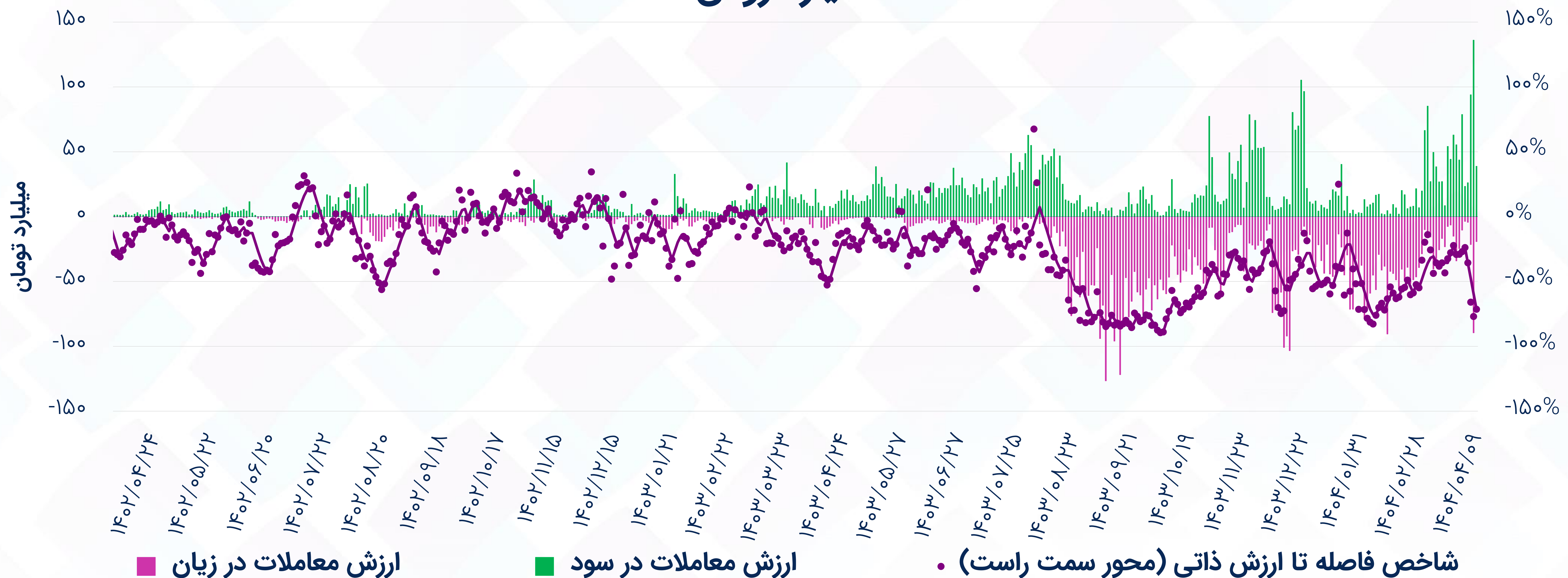
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

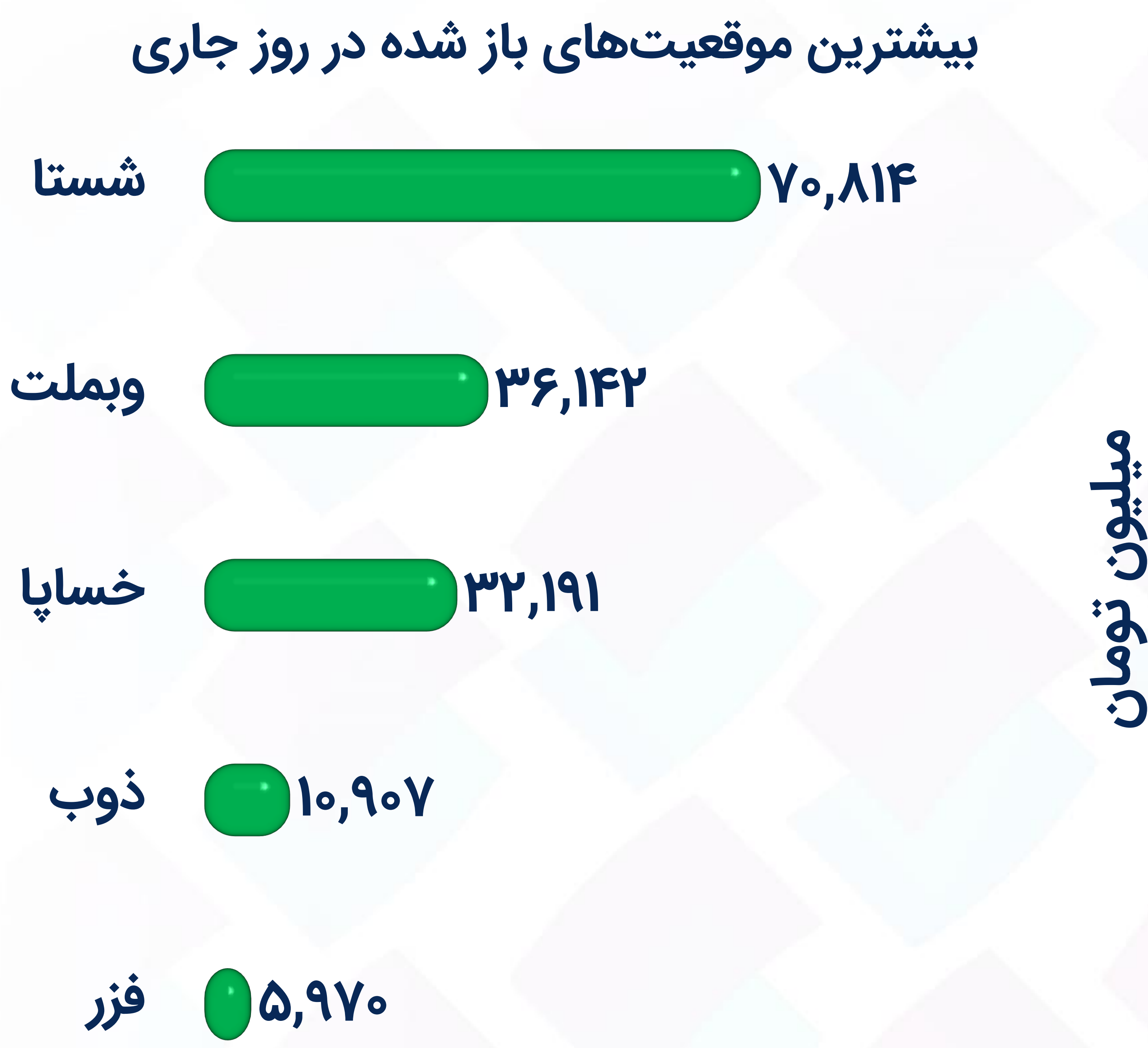
اختیار خرید

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	۳۷	۵۶.۰	۱,۸۹۶.۲	۲۷.۹	۲۸.۱	۶۹.۷%
خسپا	۱۴	۷.۲	۶۲.۸	۵.۲	۲.۱	۷.۷%
شستا	۳۴	۶.۳	۵۰۷.۱	۴.۵	۱.۸	۱۸۲.۸%
وبملت	۲۲	۳.۳	۶۳.۴	۲.۲	۱.۰	(۱۴.۳%)
وتجارت	۱۴	۲.۶	۲۰۸.۳	۱.۱	۱.۵	(۲۹.۹%)
وبصادر	۸	۲.۲	۲۸.۹	۱.۰	۱.۱	(۱.۴%)
دوب	۱۸	۱.۵	۹۵.۸	۱.۲	۰.۳	۵۶.۰%

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	۳۹,۲۹۶.۷	۳۳۲,۳۱۱.۲	۲۷,۰۹۶.۷	۱۲,۱۹۹.۹	(۷۱.۹%)
شستا	۱۳	۱۷,۴۶۲.۷	۲۳۲,۲۸۳.۸	۱۰,۳۹۰.۱	۷,۰۷۲.۷	(۶۹.۸%)
موج	۱	۱,۰۵۶.۸	۲,۳۸۹.۴	۱,۰۵۶.۸	۰.۰	(۸۵.۱%)
وتجارت	۲	۲۵۱.۴	۲,۱۸۷.۳	۲۵۰.۳	۱.۱	(۵۷.۷%)
توان	۳	۵۲.۷	۲۶۱.۴	۵۱.۹	۰.۹	(۴۹.۵%)
خسپا	۲	۲۹.۳	۱۰۱.۲	۲۸.۷	۰.۶	(۳۱.۰%)
فولاد	۳	۱۵.۰	۱۶۰.۵	۱۳.۶	۱.۴	(۵۸.۳%)

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

اهرم ۱,۲۵۹

شستا ۱۹۸

توان ۵

موج ۳

خودرو ۲

وتجارت ۲

شپنا ۱

ذوب ۰.۵۵

خودران ۰.۴۸

فولاد ۰.۴۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۵۳,۲۸۰.۶

شستا ۴۰,۵۲۹.۰

وتجارت ۱,۵۶۰.۹

وبملت ۱۵۰.۳

فولاد ۹۳.۵

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

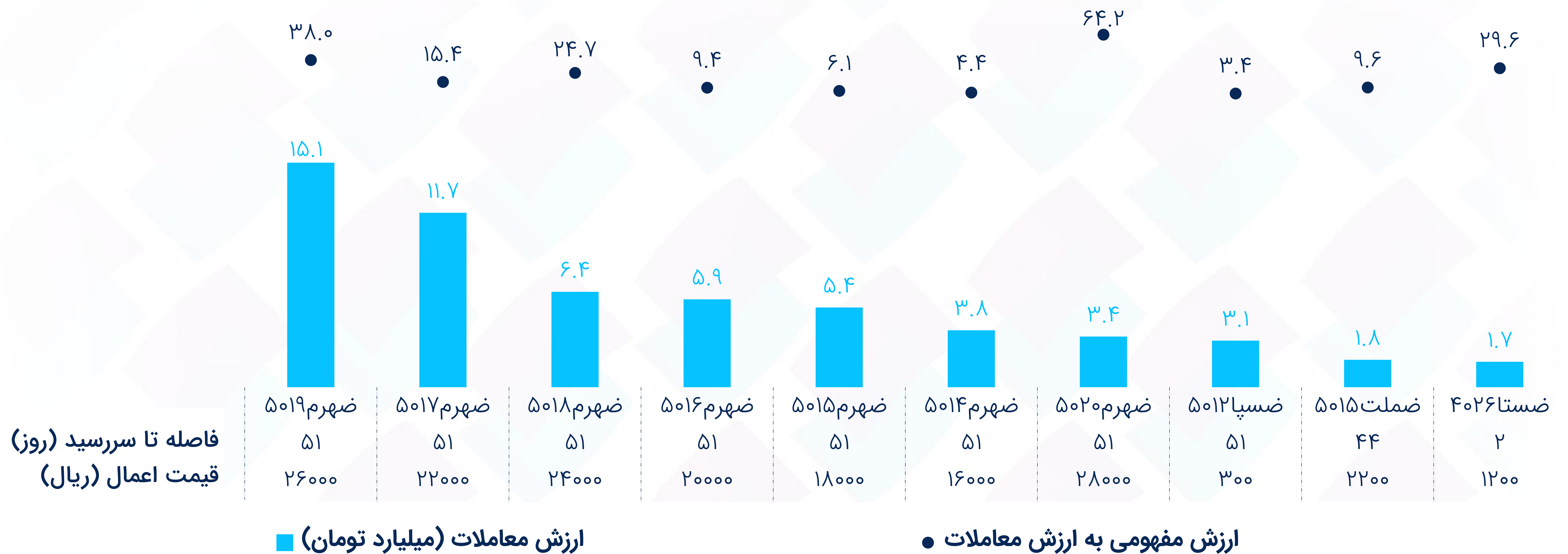
موج (۲,۳۲۸.۰)

توان (۵۷.۲)

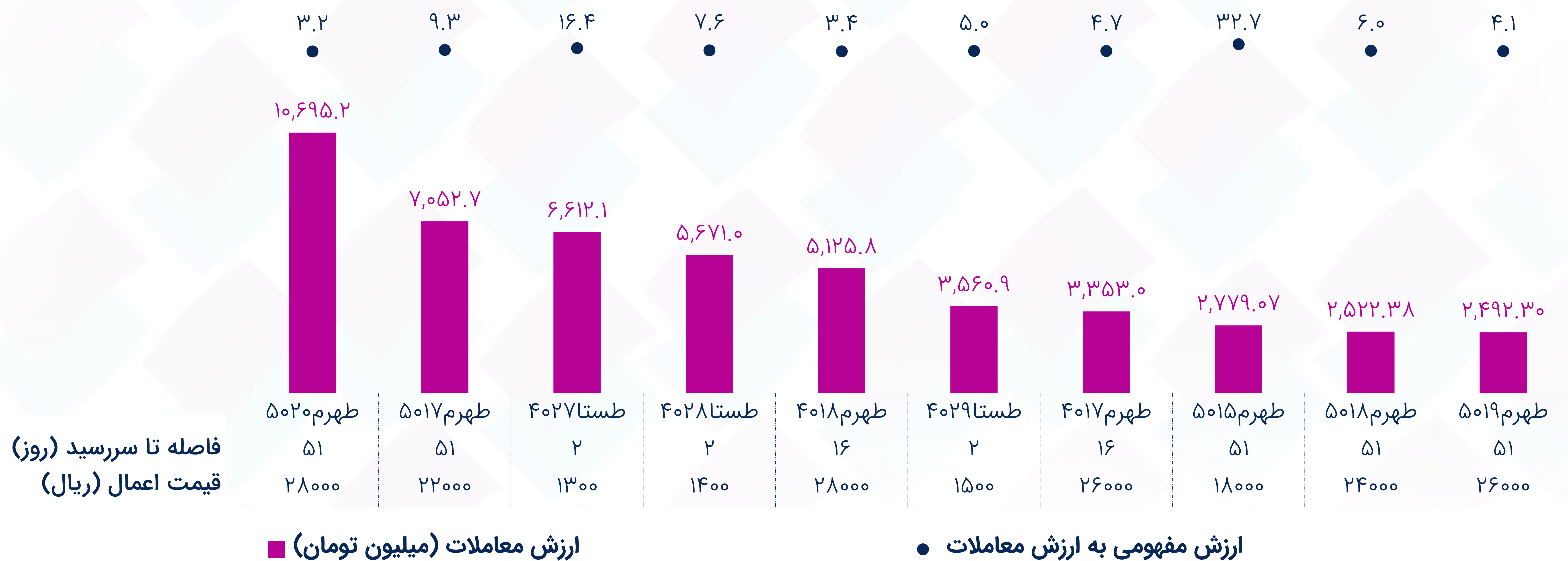
میلیون تومان

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 ۴۰۱۶	شتاب	۱۳,۰۰۰	۲	۶.۳	۱۵۲	۱۴,۲۳۰	۱۳,۱۵۲	(۷.۶%)	۸۶.۵	۰.۹۹	۱,۲۸۷	۷۴۶%
ضستا ۴۰۲۷	شستا	۱,۳۰۰	۲	۱,۳۷۳.۰	۷	۱,۳۳۲	۱,۳۰۷	(۱.۹%)	۱۸۶.۷	۰.۸۱	۴۲	۵۰۵%
ضهرم ۴۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۶	۵۴.۳	۴۲۲	۲۳,۹۵۰	۲۲,۴۲۲	(۶.۴%)	۵۳.۱	۰.۹۲	۲,۳۶۰	۴۵۹%
ضشنا ۴۰۱۵	شپنا	۲,۸۱۷	۹	۲۰.۷	۱۷۹	۳,۶۸۵	۲,۹۹۶	(۱۸.۷%)	۱۶.۷	۱.۰۰	۸۹۲	۳۹۸%
ضهرم ۴۰۱۶	اهرم	۲۴,۰۰۰	۱۶	۵۴.۸	۲۱۳	۲۳,۹۵۰	۲۴,۲۱۳	۱.۱%	۱۱۳.۷	۰.۵۹	۸۸۰	۳۱۳%

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 ۴۰۳۳	شستا	۱,۹۰۰	۲	۴.۵	۱	۱,۳۳۲	۱,۹۰۱	۴۳%	۱,۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۳۴	شستا	۲,۰۰۰	۲	۱.۵	۱	۱,۳۳۲	۲,۰۰۱	۵۰%	۲,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۴۰۳۵	شستا	۲,۲۰۰	۲	۹.۰	۱	۱,۳۳۲	۲,۲۰۱	۶۵%	۲,۲۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۸	وتجارت	۸۰۰	۹	۲.۹	۱	۴۷۲	۸۰۱	۷۰%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۹	وتجارت	۹۰۰	۹	۲.۱	۳	۴۷۲	۹۰۳	۹۱%	۳۰۱.۰	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	۱۶	۴۰.۰	۲۰,۰۰۰	۲۳,۹۵۰	۲۲,۰۰۰	(۸.۱%)	۱.۱	-۱.۰۰	۱۷,۴۰۲	(۱۳.۰%)
طستا ۴۰۳۱	شستا	۱,۷۰۰	۲	۱۷۷.۳	۴۷۳	۱,۳۳۲	۱,۲۲۷	(۷.۹%)	۲.۶	-۱.۰۰	۳۶۱	(۲۳.۷%)
طهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۱۶	۲.۶	۱۲,۹۲۰	۲۳,۹۵۰	۲۱,۰۸۰	(۱۲.۰%)	۱.۶	-۱.۰۰	۹,۵۲۵	(۲۶.۳%)
طسپا ۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۹	۲۸.۷	۱۴۵	۳۹۶	۳۵۵	(۱۰.۴%)	۲.۴	-۰.۹۷	۱۰۰	(۳۰.۸%)
طستا ۴۰۳۰	شستا	۱,۶۰۰	۲	۴۹۶.۱	۳۸۲	۱,۳۳۲	۱,۲۱۸	(۸.۶%)	۳.۲	-۱.۰۰	۲۶۱	(۳۱.۶%)

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
طستا ۴۰۲۵	شستا	۱,۱۰۰	۲	۸.۱	۱	۱,۳۳۲	۱,۰۹۹	(۱۷.۵%)	۱,۰۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۶	۰.۳	۷۵	۲۳,۹۵۰	۱۷,۹۲۵	(۲۵.۲%)	۲۳۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۴۰۲۶	شستا	۱,۲۰۰	۲	۴۲۵.۷	۱۲	۱,۳۳۲	۱,۱۸۸	(۱۰.۸%)	۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طجار ۴۰۱۴	وتجارت	۴۰۰	۹	۱.۱	۲	۴۷۲	۳۹۸	(۱۵.۷%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۱	۳۰۵.۹	۲۲۳	۲۳,۹۵۰	۱۵,۷۷۷	(۳۴.۱%)	۷۰.۷	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)

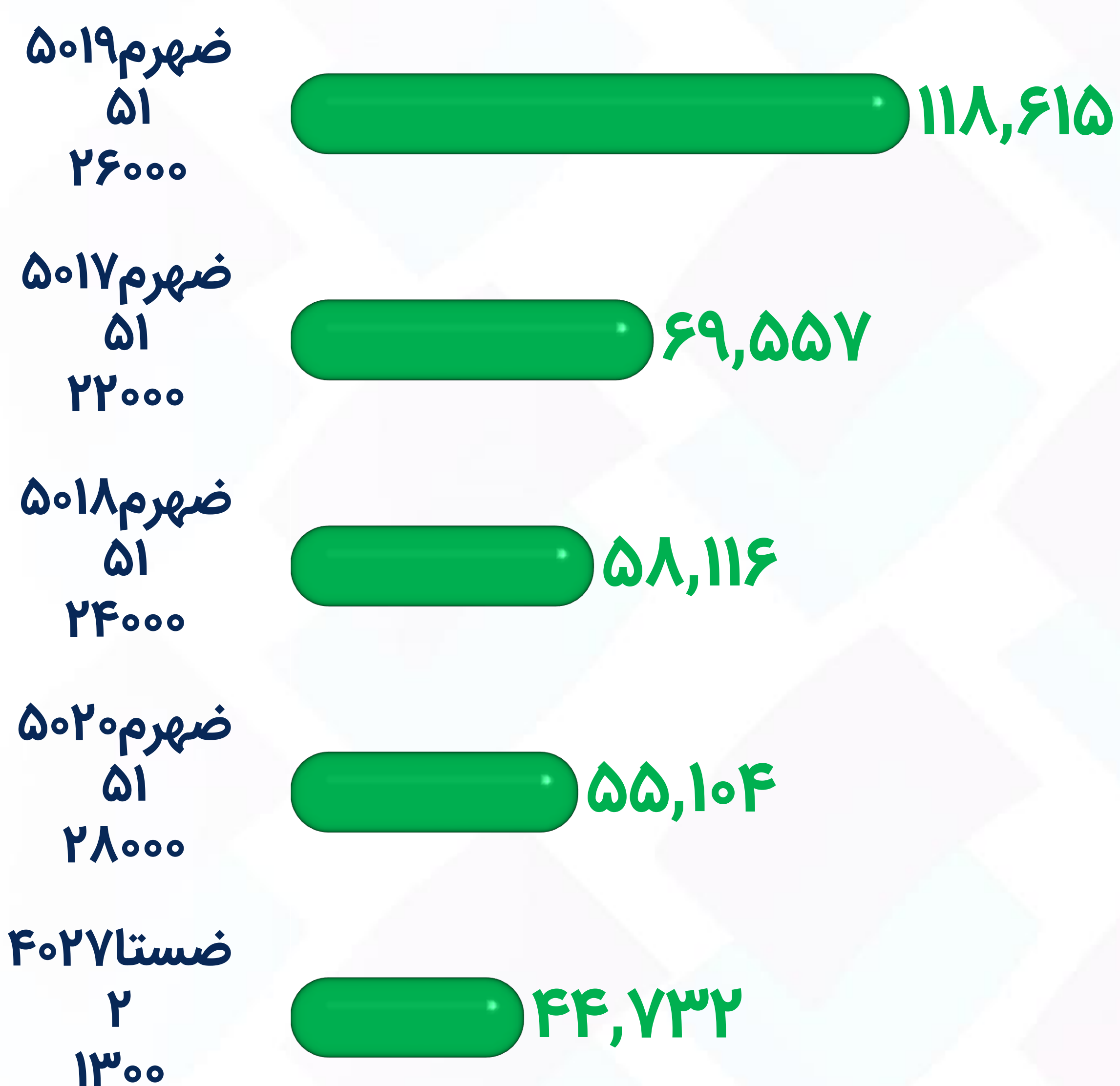
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ارزش موقعیت‌های باز

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



میلیارد 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

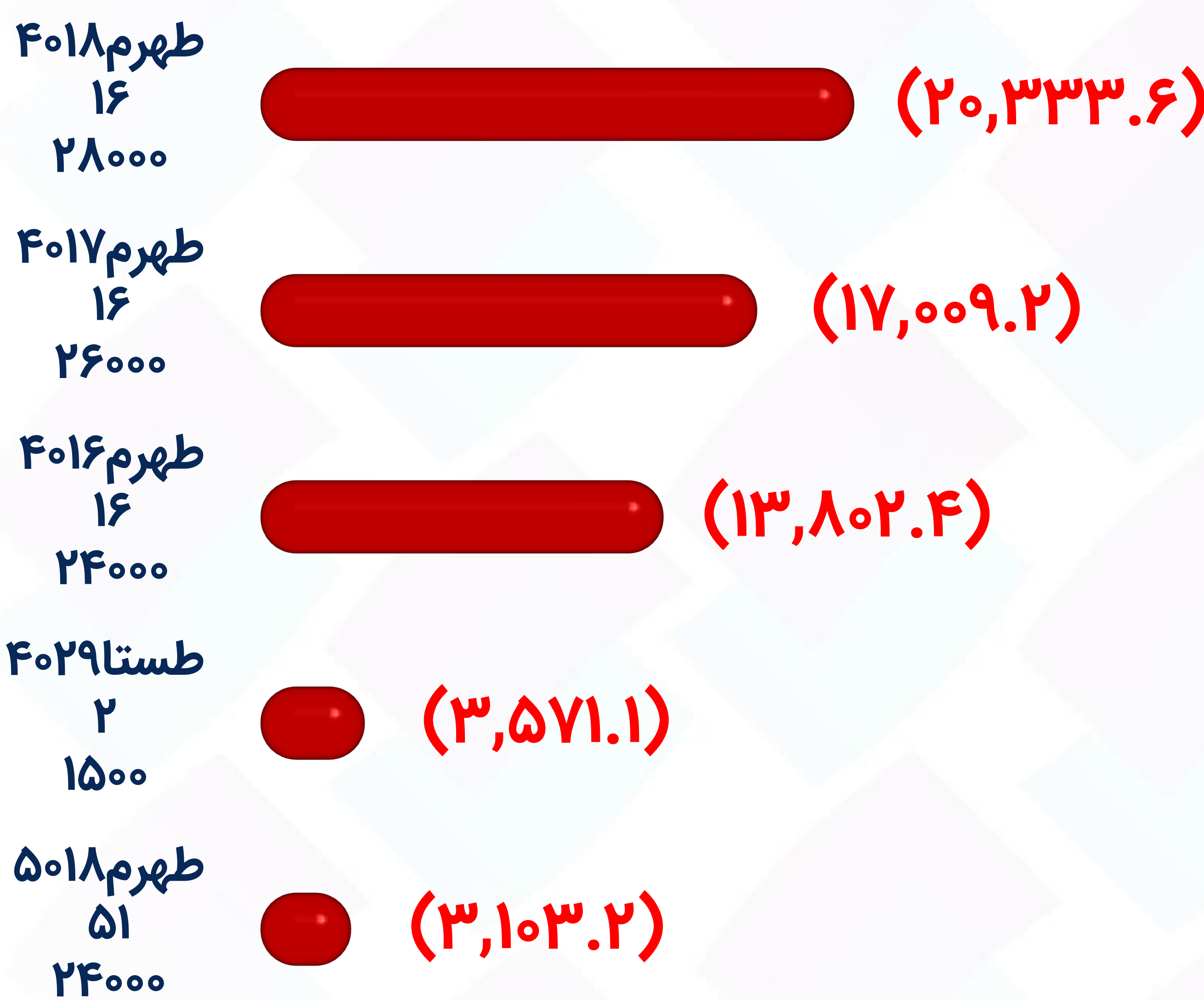
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

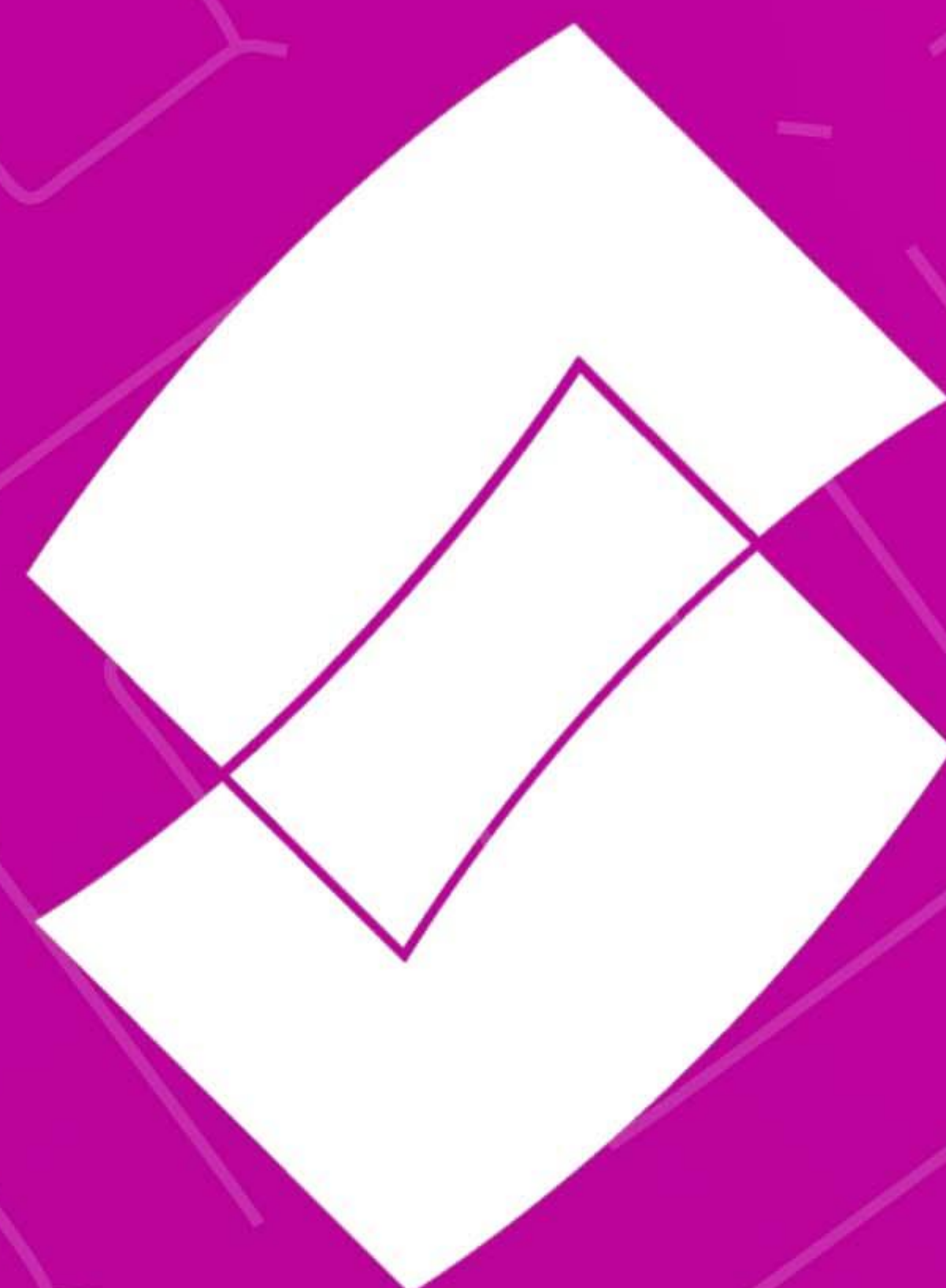
اختیار خرید



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

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.