

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۰ 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



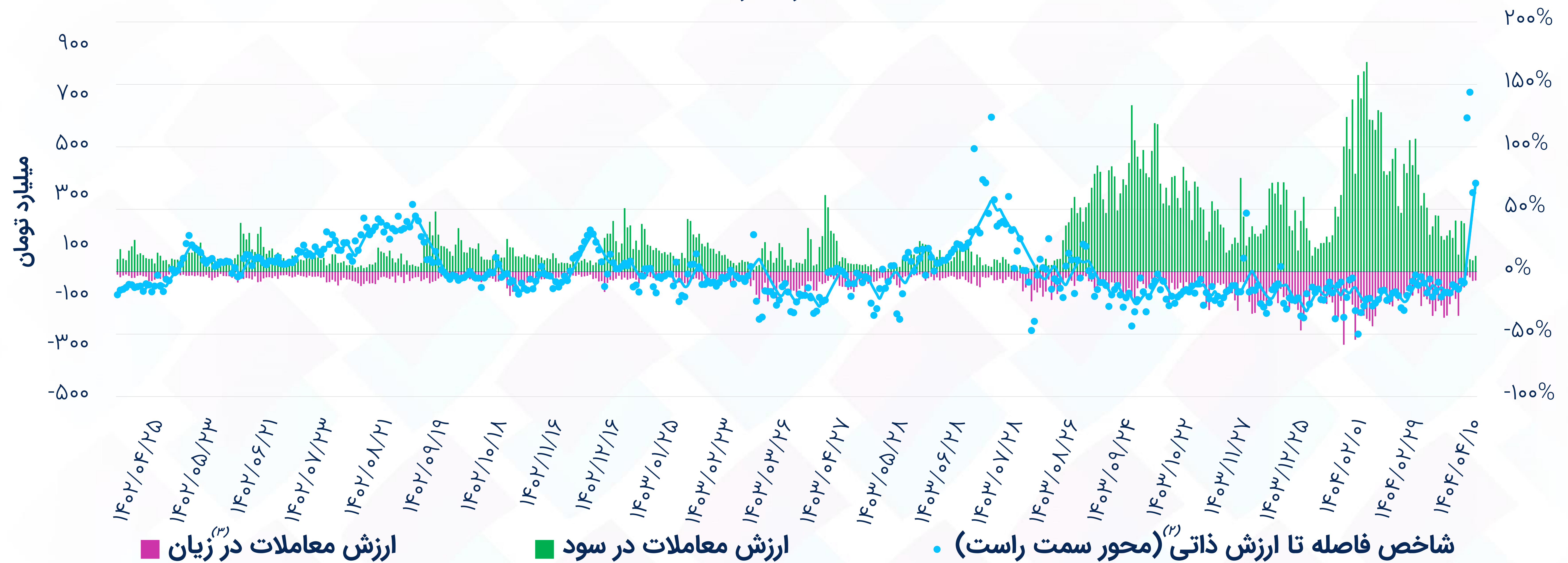
اختیار فروش



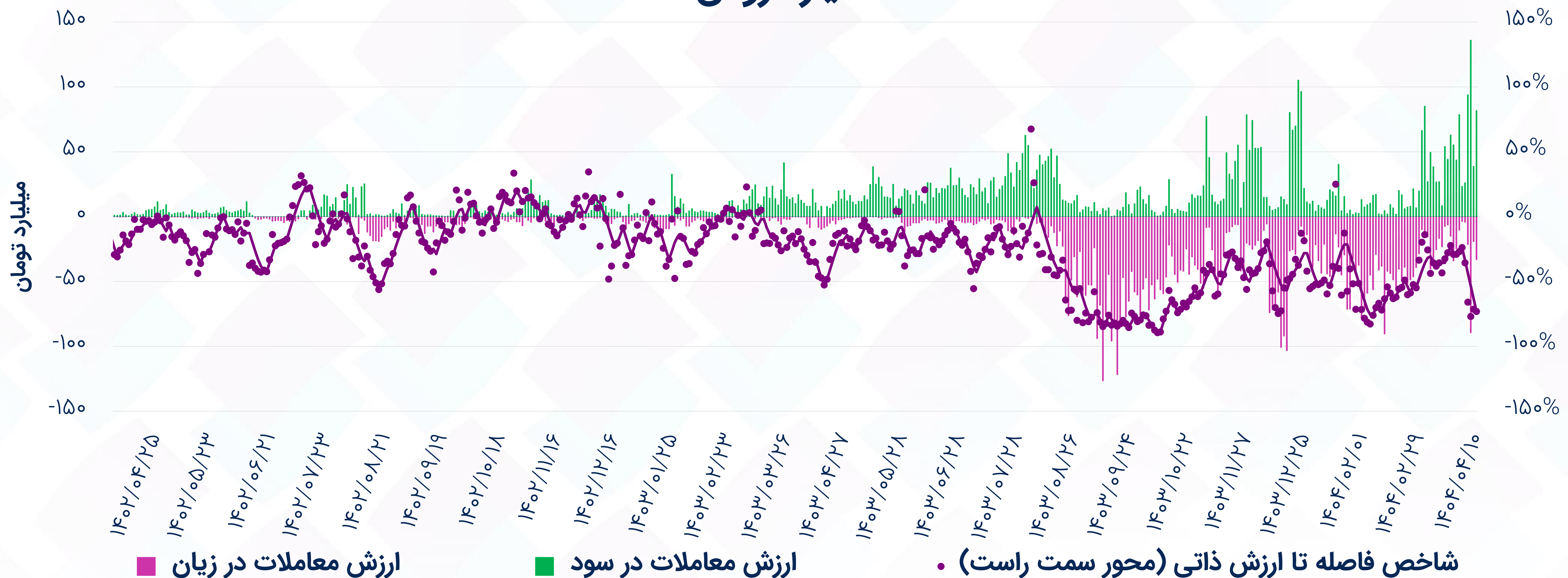
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

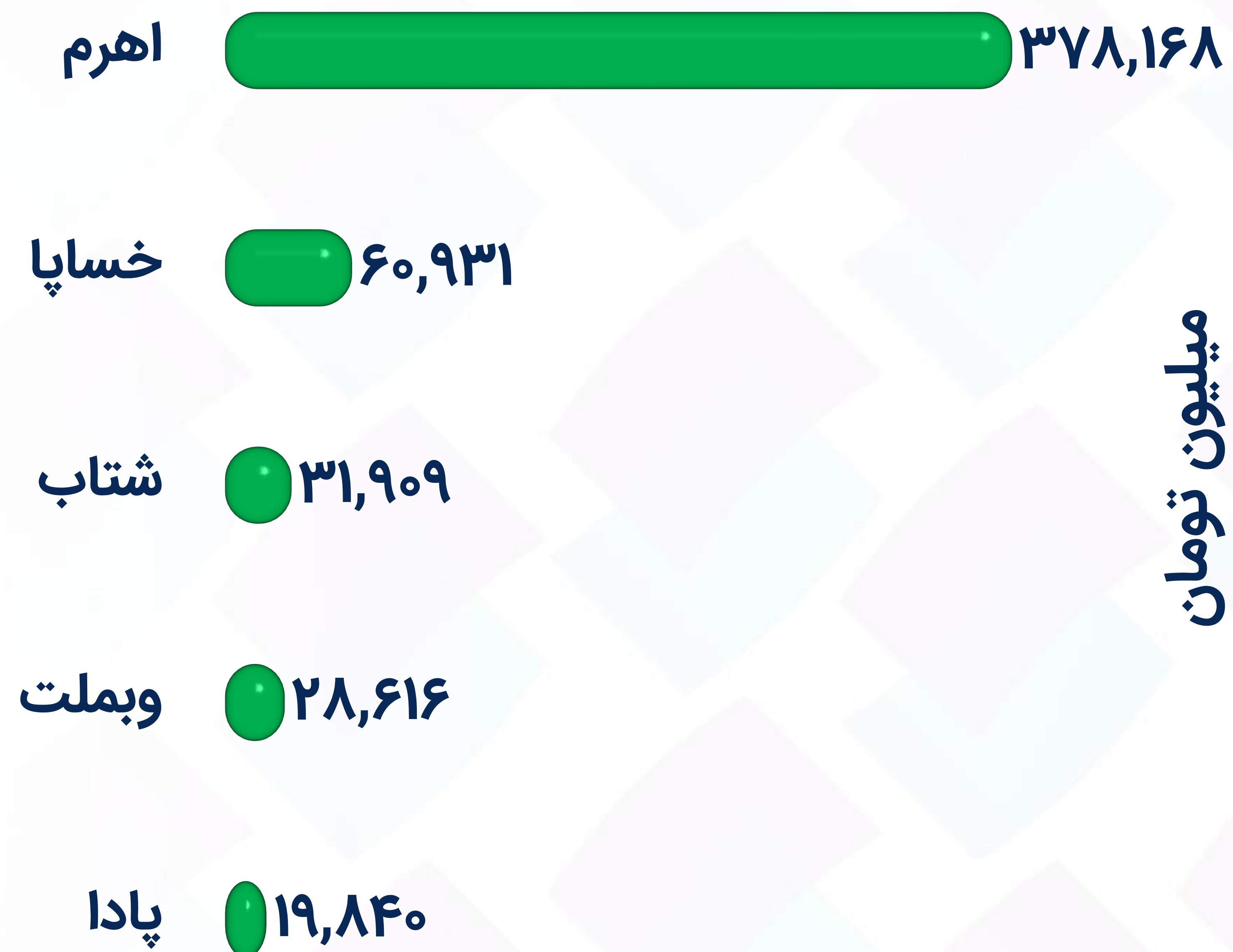
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۴۰	۵۷.۰	۲,۳۵۶.۴	۳۵.۵	۲۱.۵	۹۲.۵%
خسپا	۱۳	۱۴.۷	۱۱۲.۹	۱۱.۸	۲.۹	۸.۴%
ویملت	۲۰	۶.۲	۸۶.۵	۱.۵	۴.۷	(۳۰.۶%)
شستا	۳۰	۵.۶	۳۱۵.۹	۳.۷	۱.۹	۱۲۵.۹%
پادا	۱	۴.۱	۲۲.۰	۴.۱	۰.۰	(۲۰.۵%)
وبصادر	۹	۳.۱	۴۹.۵	۰.۸	۲.۴	(۳۵.۶%)
وتجارت	۱۵	۲.۶	۱۱۴.۳	۱.۷	۰.۸	(۲۶.۵%)

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	۲۲	۱۰۴,۱۸۳.۷	۸۳۷,۲۶۱.۸	۷۱,۲۱۲.۹	۳۲,۹۷۰.۷	(۷۴.۵%)
شستا	۱۳	۹,۸۸۶.۳	۱۱۹,۱۸۴.۰	۹,۷۰۹.۴	۱۷۶.۹	(۶۰.۲%)
موج	۱	۵۷۷.۸	۲,۰۹۵.۹	۵۷۷.۸	۰.۰	(۶۵.۷%)
وتجارت	۲	۲۲۰.۱	۵,۵۴۴.۶	۲۰۲.۹	۱۷.۲	(۳۸.۳%)
توان	۳	۷۲.۴	۳۰۸.۷	۷۰.۱	۲.۳	(۵۸.۰%)
خسپا	۳	۳۸.۸	۲۳۴.۰	۳۷.۸	۱.۰	(۲۳.۰%)
فولاد	۴	۳۴.۲	۶۱۹.۶	۱۵.۸	۱۸.۴	(۵۶.۳%)

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 ۱,۴۳۵

شستا ۱۸۳

و تجارت ۶

توان ۵

خودرو ۲

فولاد ۱

شپنا ۱

ذوب ۰.۵۵

خودران ۰.۵۴

وبملت ۰.۵۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۷۶,۳۰۰.۴

و تجارت ۴,۰۴۳.۶

فولاد ۴۸۷.۲

خسپا ۱۸۲.۵

وبملت ۸۰.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شستا (۱۵,۳۳۰.۹)

موج (۲,۳۱۱.۲)

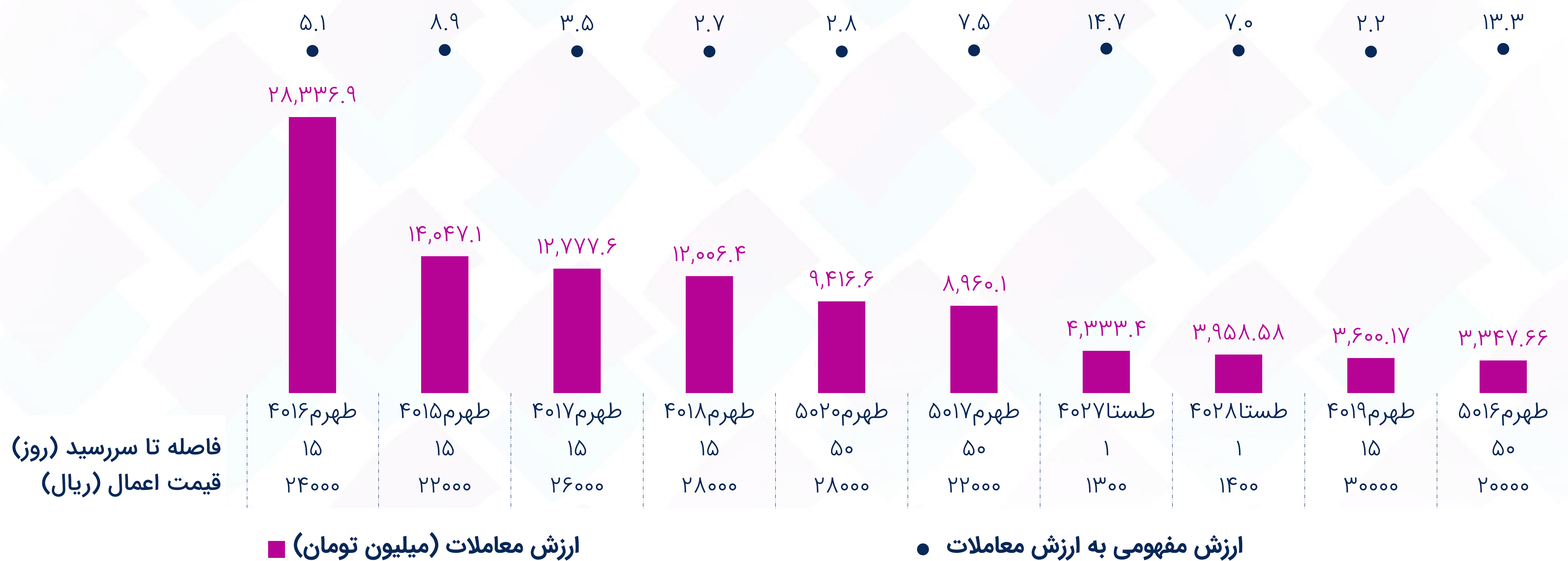
میلیون تومان

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
ضسامان ۷۰۰	سامان	۱,۸۰۰	۱۰۳	۵.۲	۴۲	۲,۴۲۸	۱,۸۴۲	(۲۴.۱%)	۴۳.۹	۰.۹۹	۷۹۶	۱۷۹۵%
ضهرم ۴۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۱۵	۲,۶۲۰.۸	۴۱۹	۲۳,۲۴۰	۲۲,۴۱۹	(۳.۵%)	۵۳.۵	۰.۸۴	۱,۶۹۵	۳۰۵%
ضتاب ۵۰۰۱	شتاب	۱۱,۰۰۰	۲۹	۱۹.۰	۸۳۰	۱۳,۸۱۰	۱۱,۸۳۰	(۱۴.۳%)	۱۴.۳	۰.۹۹	۳,۱۲۴	۲۷۶%
ضهرم ۴۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۱۵	۲,۹۷۴.۷	۱,۱۱۰	۲۳,۲۴۰	۲۱,۱۱۰	(۹.۲%)	۱۹.۰	۰.۹۹	۳,۵۳۱	۲۱۸%
ضخاور ۶۱۳	خاور	۱,۱۰۰	۷۵	۲۳.۶	۱۳۴	۱,۴۴۲	۱,۲۳۴	(۱۴.۴%)	۹.۲	۰.۹۹	۴۱۶	۲۱۱%

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
ضجار ۴۰۱۷	وتجارت	۷۰۰	۸	۲۲.۵	۱	۴۵۸	۷۰۱	۵۳%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۸	وتجارت	۸۰۰	۸	۸.۷	۱	۴۵۸	۸۰۱	۷۵%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۵	۱۴.۰	۳۲	۲۳,۲۴۰	۴۲,۰۳۲	۸۱%	۱,۳۱۳.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۵	۳۶.۸	۴۸	۲۳,۲۴۰	۳۸,۰۴۸	۶۴%	۷۹۲.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۵۰۱۷	دوب	۹۰۰	۴۳	۱.۳	۵	۴۰۳	۹۰۵	۱۲۵%	۱۸۱.۰	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 ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۵	۸.۴	۱۶,۷۶۰	۲۳,۲۴۰	۲۱,۲۴۰	(۸.۶%)	۱.۳	-۱.۰۰	۱۴,۲۱۸	(۱۵.۲%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۵	۱۴۲.۰	۲۱,۸۴۰	۲۳,۲۴۰	۲۰,۱۶۰	(۱۳.۳%)	۰.۹	-۱.۰۰	۱۸,۱۶۱	(۱۶.۸%)
طستا ۵۰۳۴	شستا	۱,۷۰۰	۳۶	۳۵.۵	۴۲۶	۱,۲۹۳	۱,۲۷۴	(۱.۵%)	۳.۰	-۰.۹۹	۳۴۷	(۱۸.۴%)
طسپا ۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۸	۳۷.۸	۱۴۳	۳۸۵	۳۵۷	(۷.۳%)	۲.۵	-۰.۹۹	۱۱۲	(۲۲.۰%)
طملت ۵۰۱۸	وبملت	۲,۸۰۰	۴۳	۳.۶	۶۶۲	۲,۱۹۹	۲,۱۳۸	(۲.۸%)	۳.۲	-۰.۹۴	۴۸۹	(۲۶.۱%)

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	۱۵	۰.۶	۱۰۰	۲۳,۲۴۰	۱۴,۹۰۰	(۳۵.۹%)	۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۵	۲۱۹.۰	۱۲۲	۲۳,۲۴۰	۱۵,۸۷۸	(۳۱.۷%)	۱۳۰.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۵	۲,۴۳۹.۴	۳۲۲	۲۳,۲۴۰	۱۷,۶۷۸	(۲۳.۹%)	۵۴.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۰	۲۳۹.۰	۲۵۴	۲۳,۲۴۰	۱۵,۷۴۶	(۳۲.۲%)	۶۲.۰	۰.۰۰	۱	(۹۹.۸%)
طجار ۴۰۱۴	وتجارت	۴۰۰	۸	۱۷.۲	۲	۴۵۸	۳۹۸	(۱۳.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)

(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

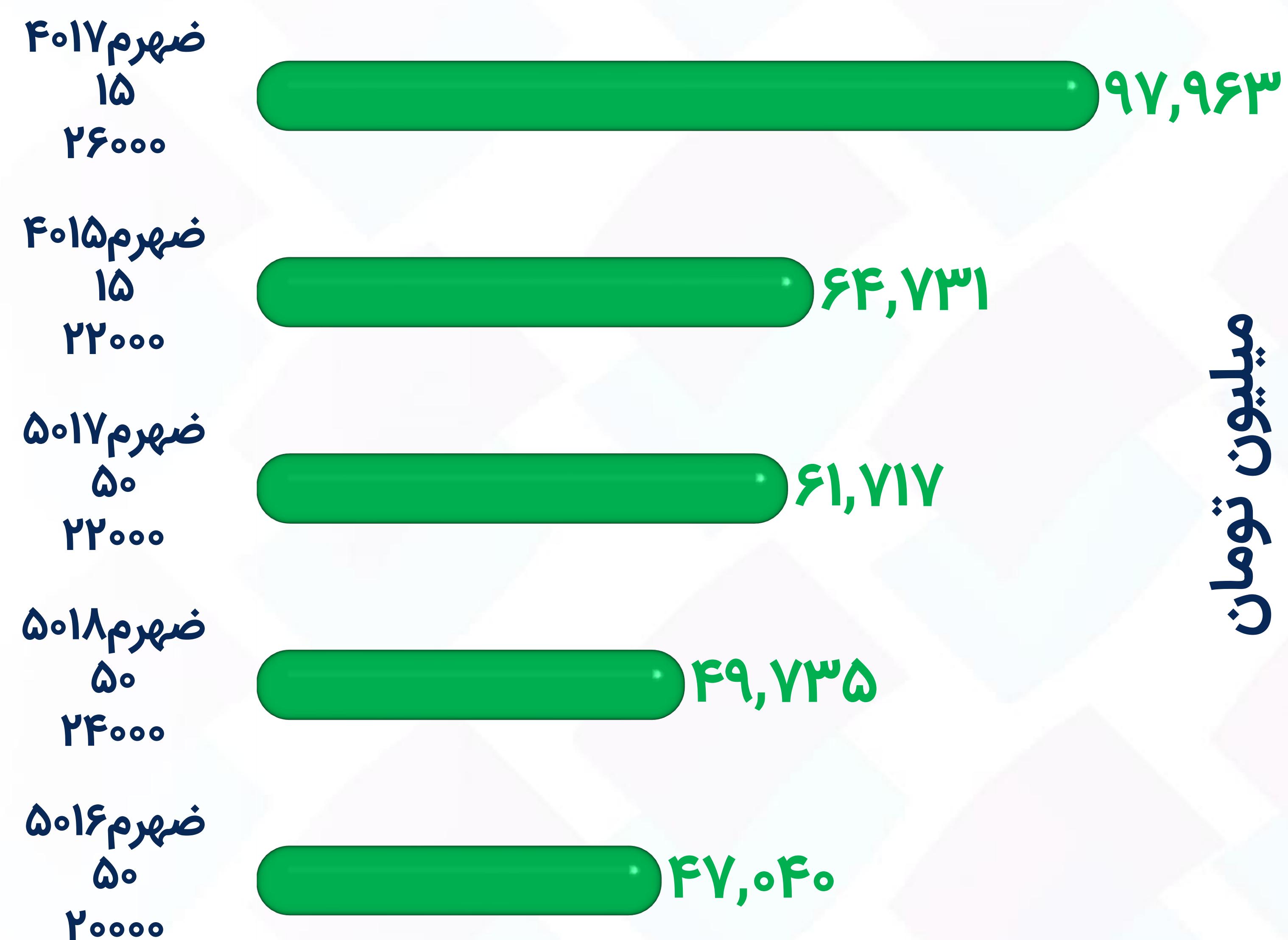
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

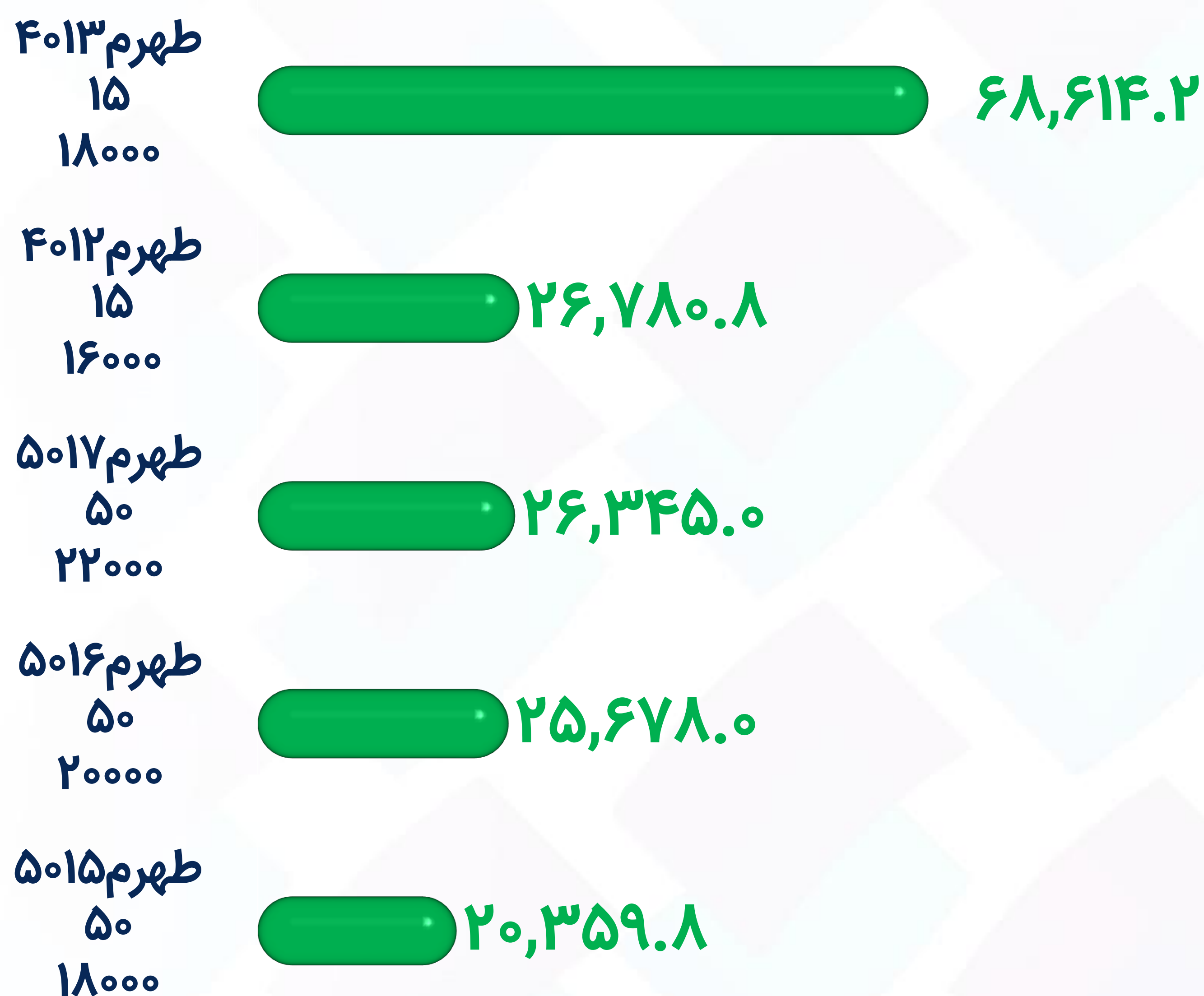
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

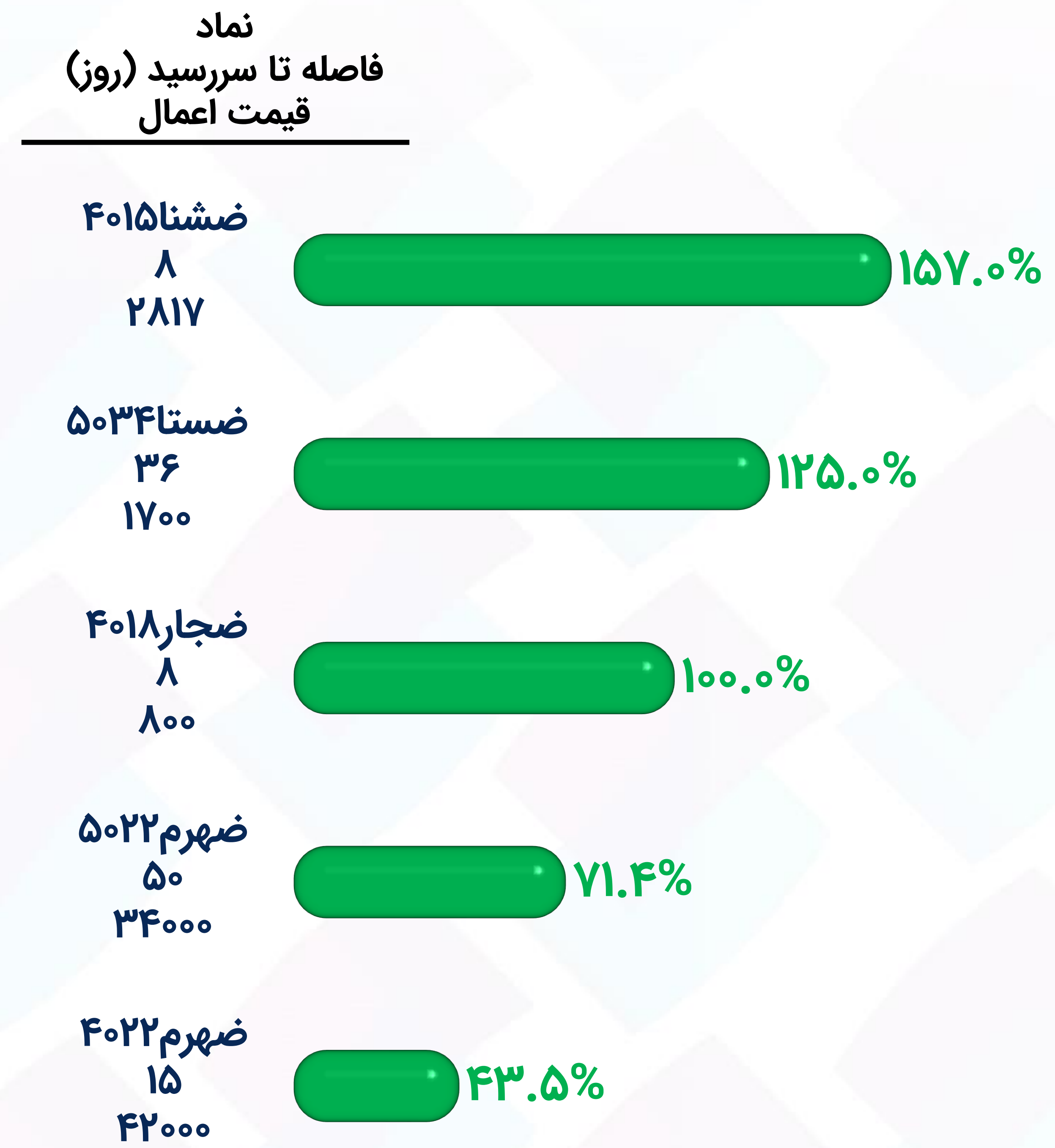
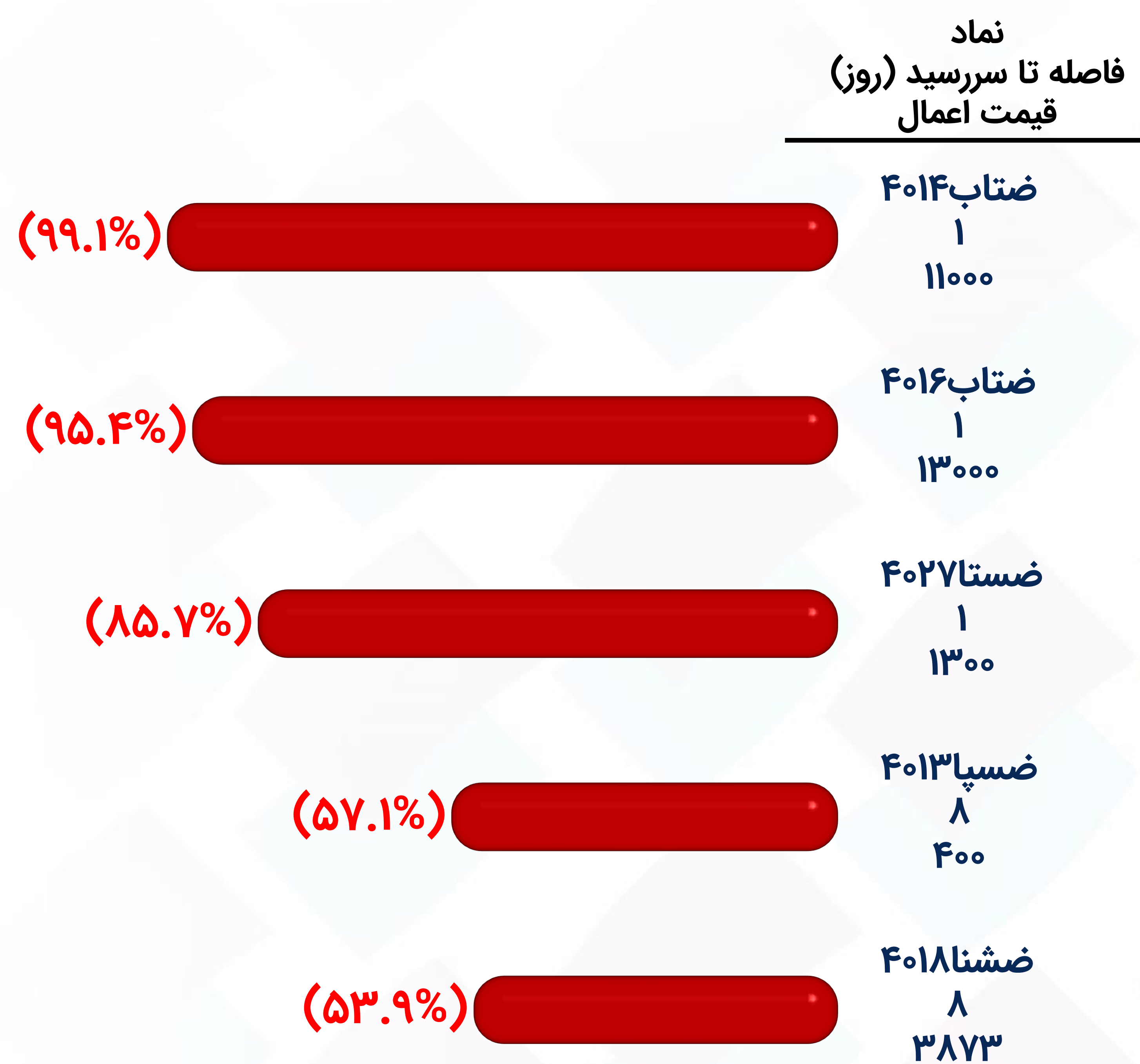
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



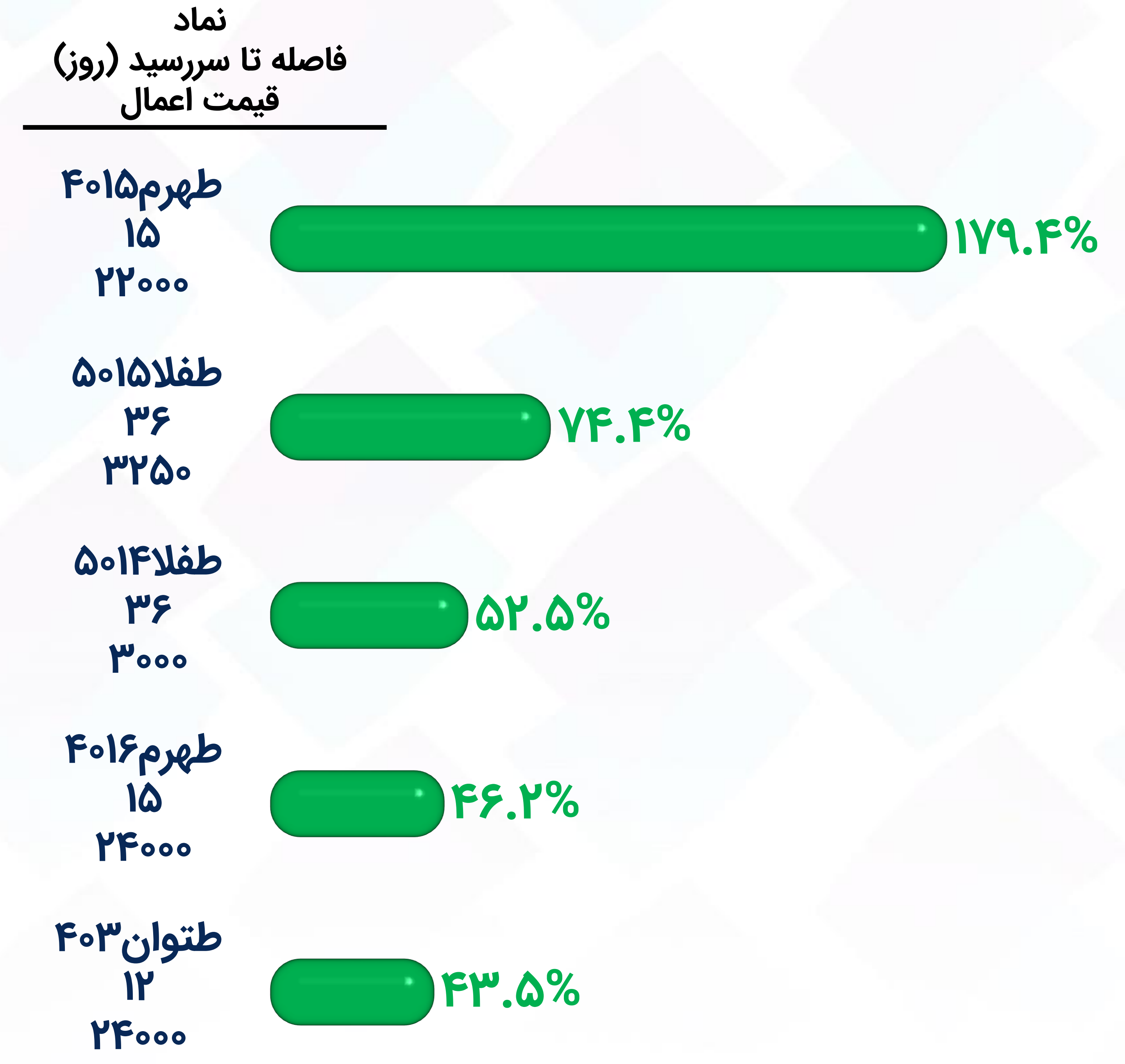
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

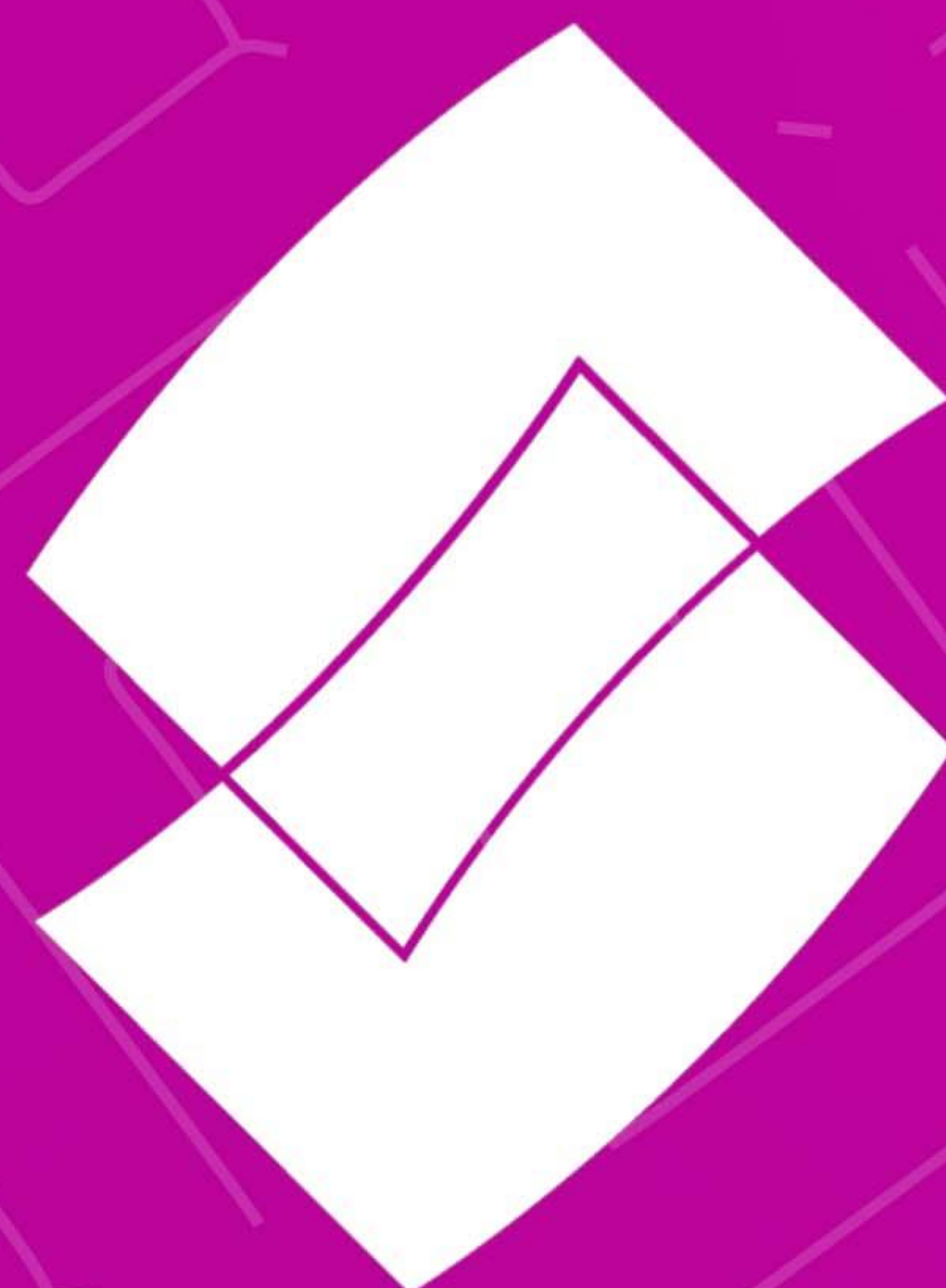
اختیار خرید



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.