

شماره
۵۰۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۱ 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



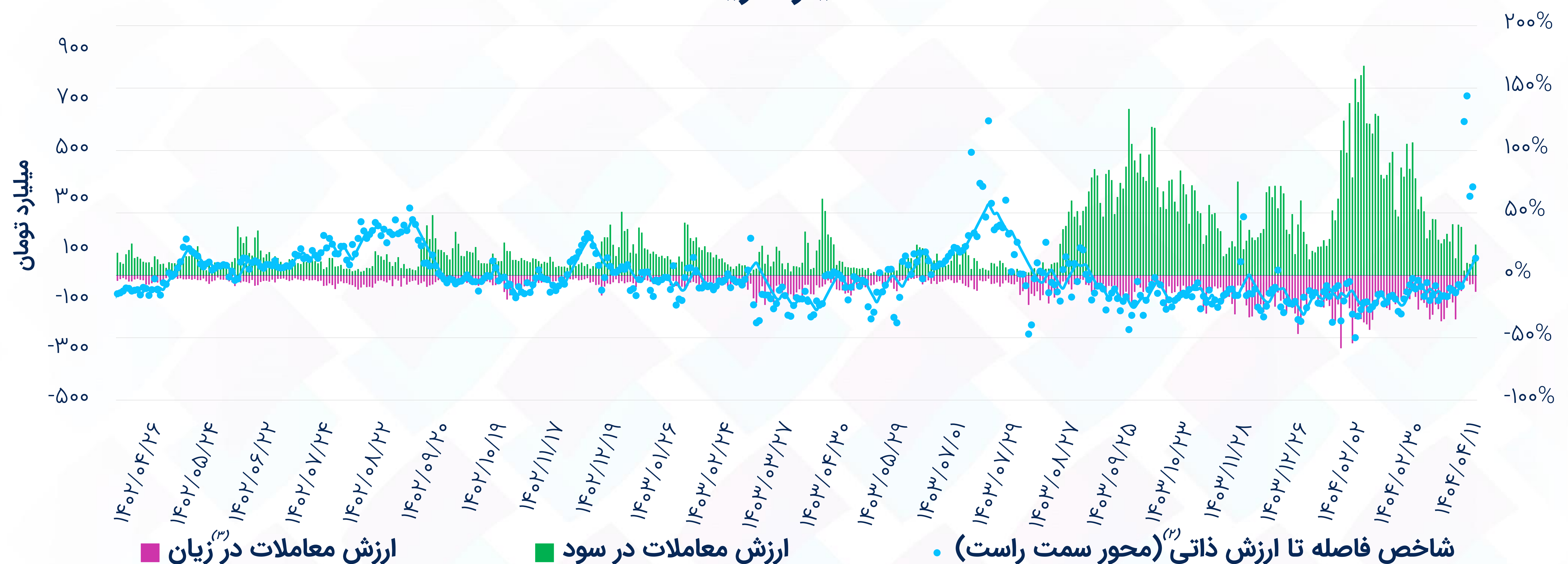
اختیار فروش



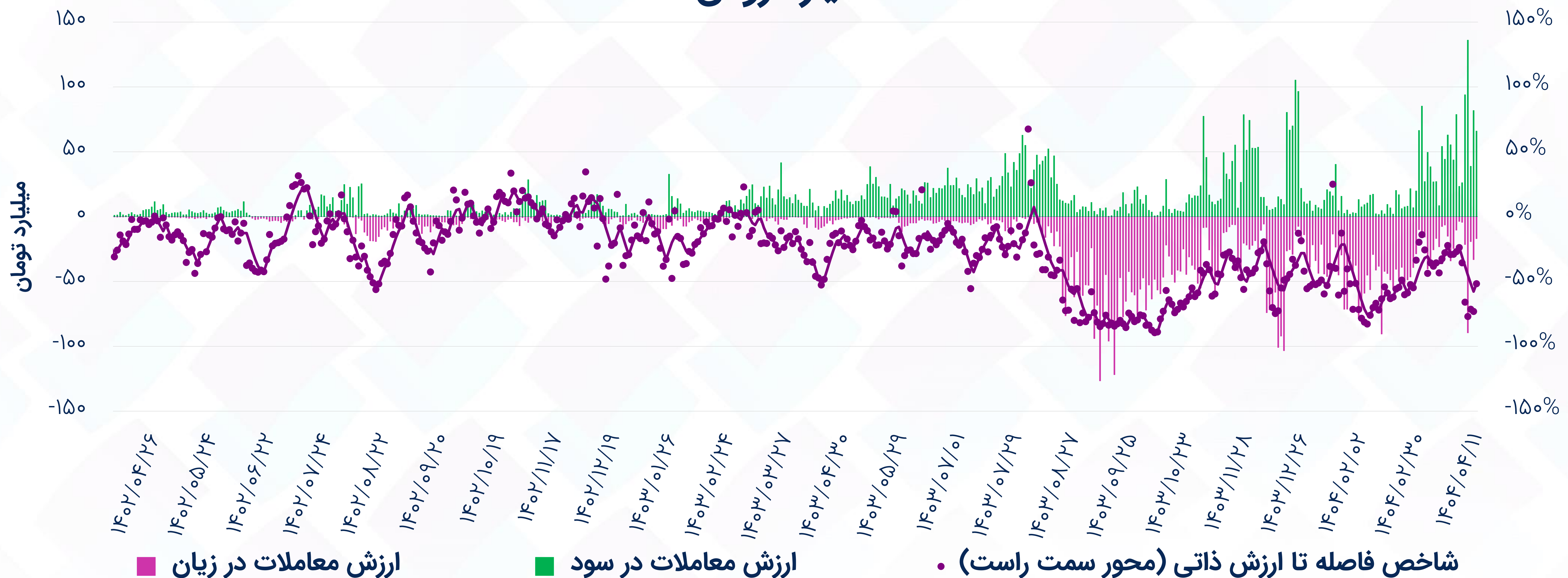
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

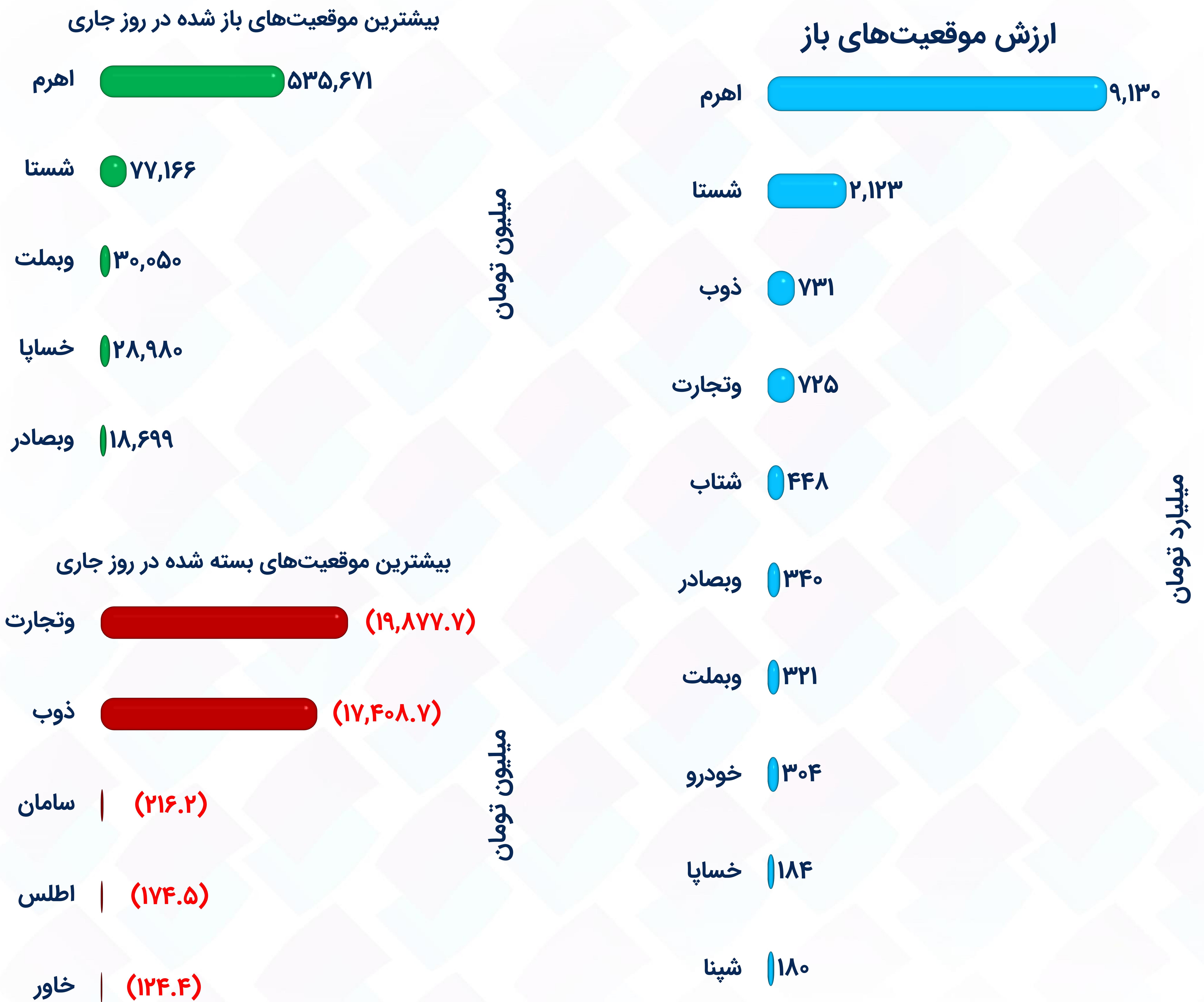
اختیار خرید

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	۴۱	۱۲۱.۷	۳,۹۱۴.۹	۷۹.۵	۴۲.۲	۱۳.۴%
شستا	۴۱	۲۱.۶	۵۲۸.۱	۱۶.۴	۵.۲	۱۲.۰%
خسپا	۱۵	۱۷.۳	۱۴۷.۷	۱۱.۴	۵.۸	۵.۷%
ذوب	۱۷	۹.۲	۱۹۶.۹	۱.۶	۷.۶	(۲۷.۵%)
وبملت	۲۵	۸.۷	۹۳.۴	۷.۵	۱.۲	(۲۷.۵%)
وبصادر	۹	۳.۱	۳۵.۷	۱.۱	۲.۰	(۴۴.۴%)
شتاب	۱۵	۲.۹	۹۳.۵	۲.۹	۰.۰	۴۵۲.۰%

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	۲۲	۷۰,۸۴۴.۶	۶۴۷,۴۳۶.۳	۵۳,۹۹۶.۰	۱۶,۸۴۸.۶	(۵۷.۶%)
شستا	۱۵	۱۱,۹۵۶.۶	۲۰۷,۷۸۷.۴	۱۱,۸۶۲.۹	۹۳.۸	(۱۷.۲%)
وبملت	۶	۳۹.۰	۴۷۰.۵	۳۰.۶	۸.۴	۲۳.۸%
وتجارت	۲	۳۵.۴	۹۴۸.۹	۳۴.۱	۱.۳	(۱۴.۱%)
خودران	۴	۲۴.۳	۳۸۴.۴	۱۲.۳	۱۲.۰	(۵۸.۹%)
ذوب	۳	۲۳.۵	۷۳۰.۹	۲۲.۵	۱.۰	(۵۷.۳%)
موج	۱	۱۷.۶	۴۶.۴	۱۷.۶	۰.۰	(۶۶.۳%)

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 ۱,۵۷۰

شستا ۱۱۶

و تجارت ۶

توان ۵

خودرو ۲

فولاد ۱

ذوب ۱

خودران ۰.۸۷

وبملت ۰.۶۹

شپنا ۰.۶۱

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۳۵,۶۴۶.۰

شستا ۱,۹۳۸.۴

ذوب ۵۱۹.۲

خودران ۳۲۳.۴

شتاب ۲۹۸.۰

میلیون تومان

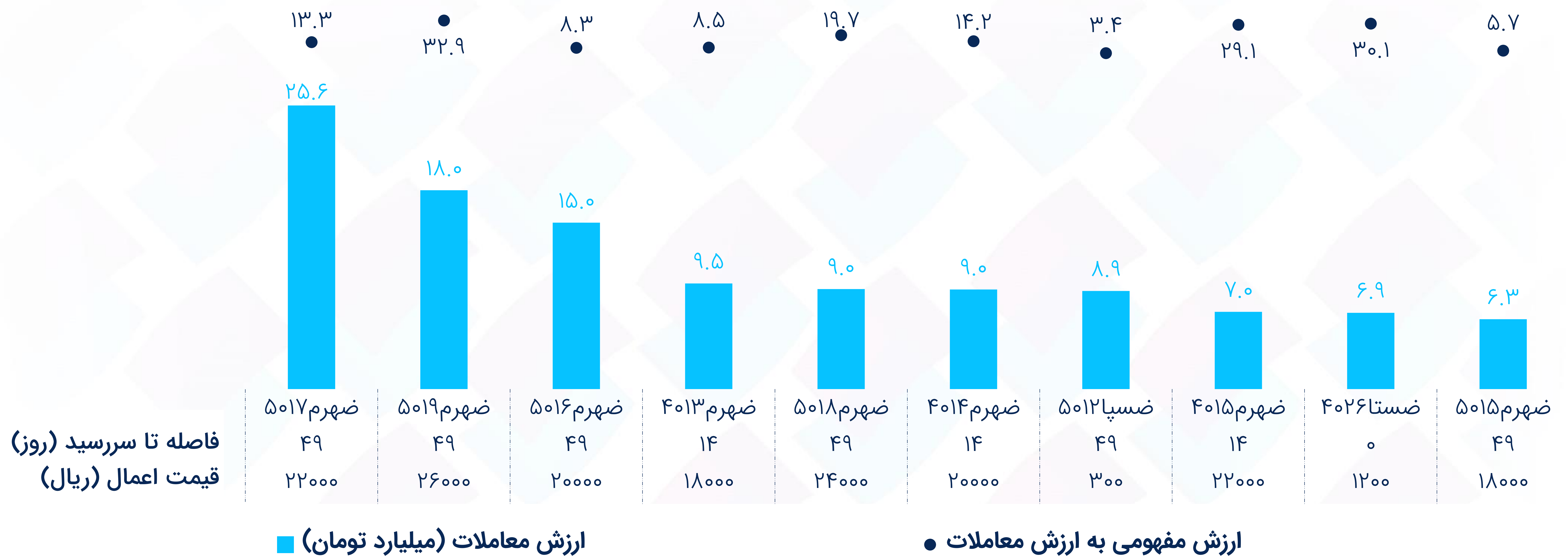
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

توان (۱۰.۴)

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
ضخاور ۶۱۳	خاور	۱,۱۰۰	۷۴	۱۰.۹	۷۹	۱,۴۰۲	۱,۱۷۹	(۱۵.۹%)	۱۴.۹	۰.۹۸	۳۷۵	۳۷۵%
ضتاب ۵۰۰۲	شتاب	۱۲,۰۰۰	۲۸	۱۲۰.۷	۵۰۱	۱۳,۴۰۰	۱۲,۵۰۱	(۶.۷%)	۲۵.۰	۰.۹۲	۱,۷۷۰	۲۵۳%
ضتاب ۵۰۰۱	شتاب	۱۱,۰۰۰	۲۸	۲۵۸.۱	۱,۲۲۰	۱۳,۴۰۰	۱۲,۲۲۰	(۸.۸%)	۱۰.۰	۰.۹۹	۲,۷۰۰	۱۲۱%
ضتاب ۵۰۰۰	شتاب	۱۰,۰۰۰	۲۸	۶۶.۶	۱,۷۲۶	۱۳,۴۰۰	۱۱,۷۲۶	(۱۲.۵%)	۶.۸	۱.۰۰	۳,۶۶۸	۱۱۳%
ضهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۴	۹,۵۴۰.۰	۲,۶۵۴	۲۲,۵۵۰	۲۰,۶۵۴	(۸.۴%)	۷.۸	۱.۰۰	۴,۷۸۰	۸۰%

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	۷	۳۷.۲	۱	۴۶۰	۷۰۱	۵۲%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۸	وتجارت	۸۰۰	۷	۹.۳	۱	۴۶۰	۸۰۱	۷۴%	۸۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۴	۳۵.۳	۲۲	۲۲,۵۵۰	۴۲,۰۲۲	۸۶%	۱,۹۱۰.۱	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۹	وتجارت	۹۰۰	۷	۱.۴	۱	۴۶۰	۹۰۱	۹۶%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۱۴	۷۱.۱	۴۰	۲۲,۵۵۰	۳۸,۰۴۰	۶۹%	۹۵۱.۰	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
طملت ۴۰۰۵	وبملت	۲,۶۰۰	۱۴	۲۵.۵	۱۹۵	۲,۲۳۷	۲,۴۰۵	۷.۵%	۱۲.۳	-۰.۹۸	۳۳۱	۶۹.۷%
طسپا ۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۷	۱۴.۳	۹۸	۳۹۵	۴۰۲	۱.۸%	۴.۱	-۰.۹۹	۱۰۲	۴.۴%
طستا ۵۰۳۴	شستا	۱,۷۰۰	۳۵	۲۴.۲	۳۹۲	۱,۲۶۳	۱,۳۰۸	۳.۶%	۳.۳	-۱.۰۰	۳۸۰	(۳.۱%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۱۴	۶۰.۵	۲۰,۱۶۷	۲۲,۵۵۰	۲۱,۸۳۳	(۳.۲%)	۱.۱	-۱.۰۰	۱۸,۹۱۳	(۶.۲%)
طستا ۵۰۳۳	شستا	۱,۶۰۰	۳۵	۳.۴	۳۰۵	۱,۲۶۳	۱,۲۹۵	۲.۵%	۴.۲	-۰.۹۸	۲۸۴	(۶.۹%)

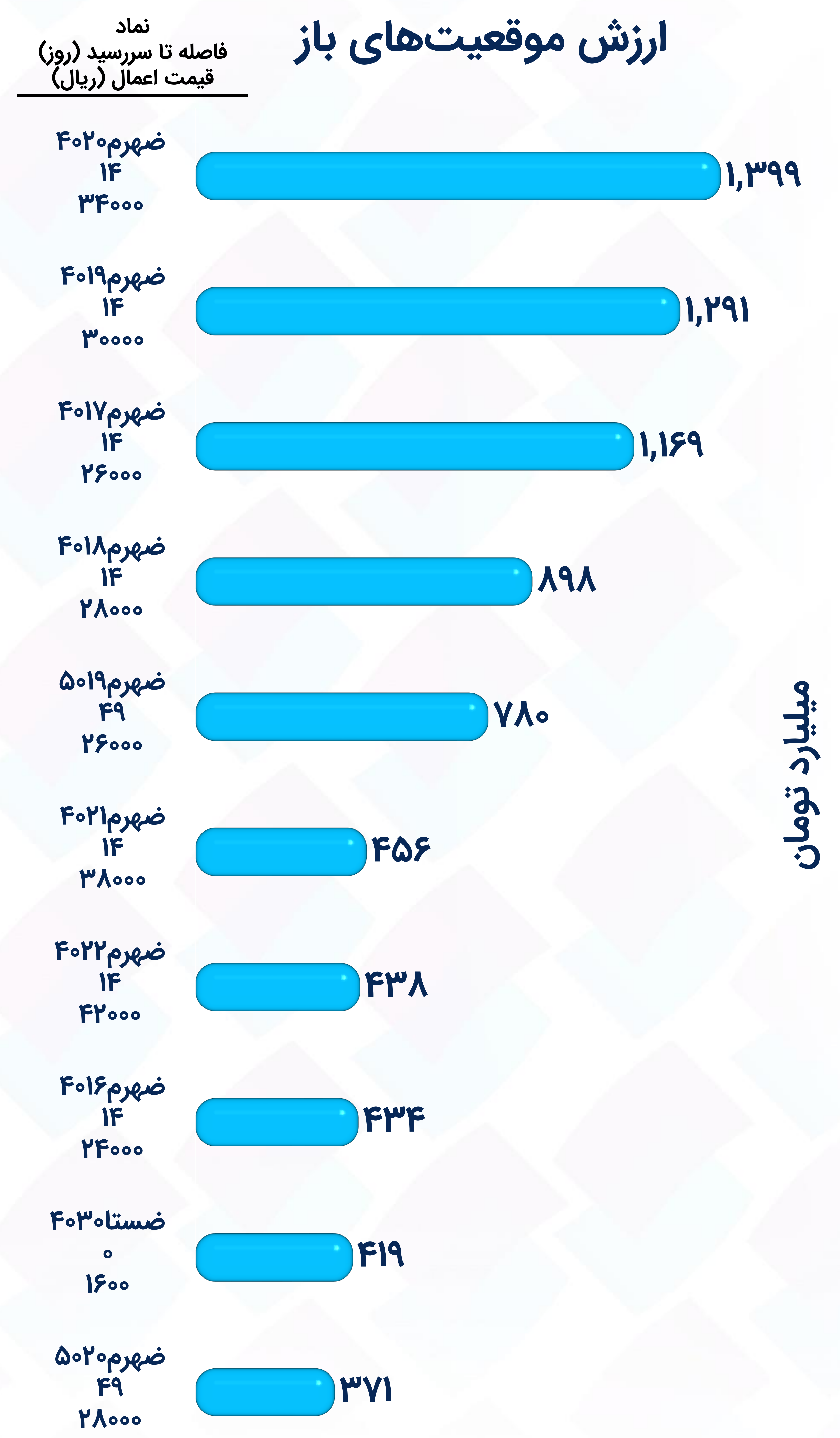
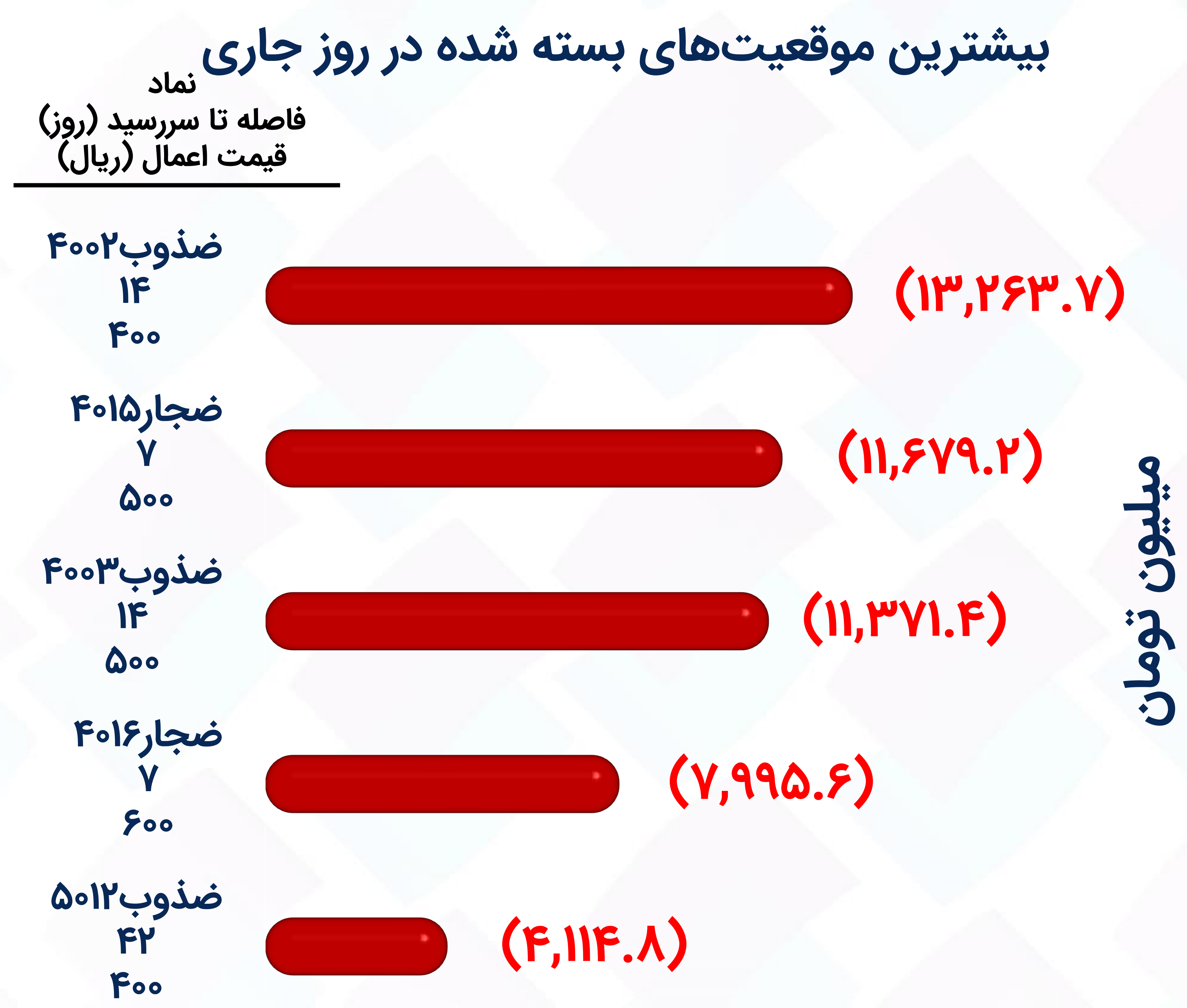
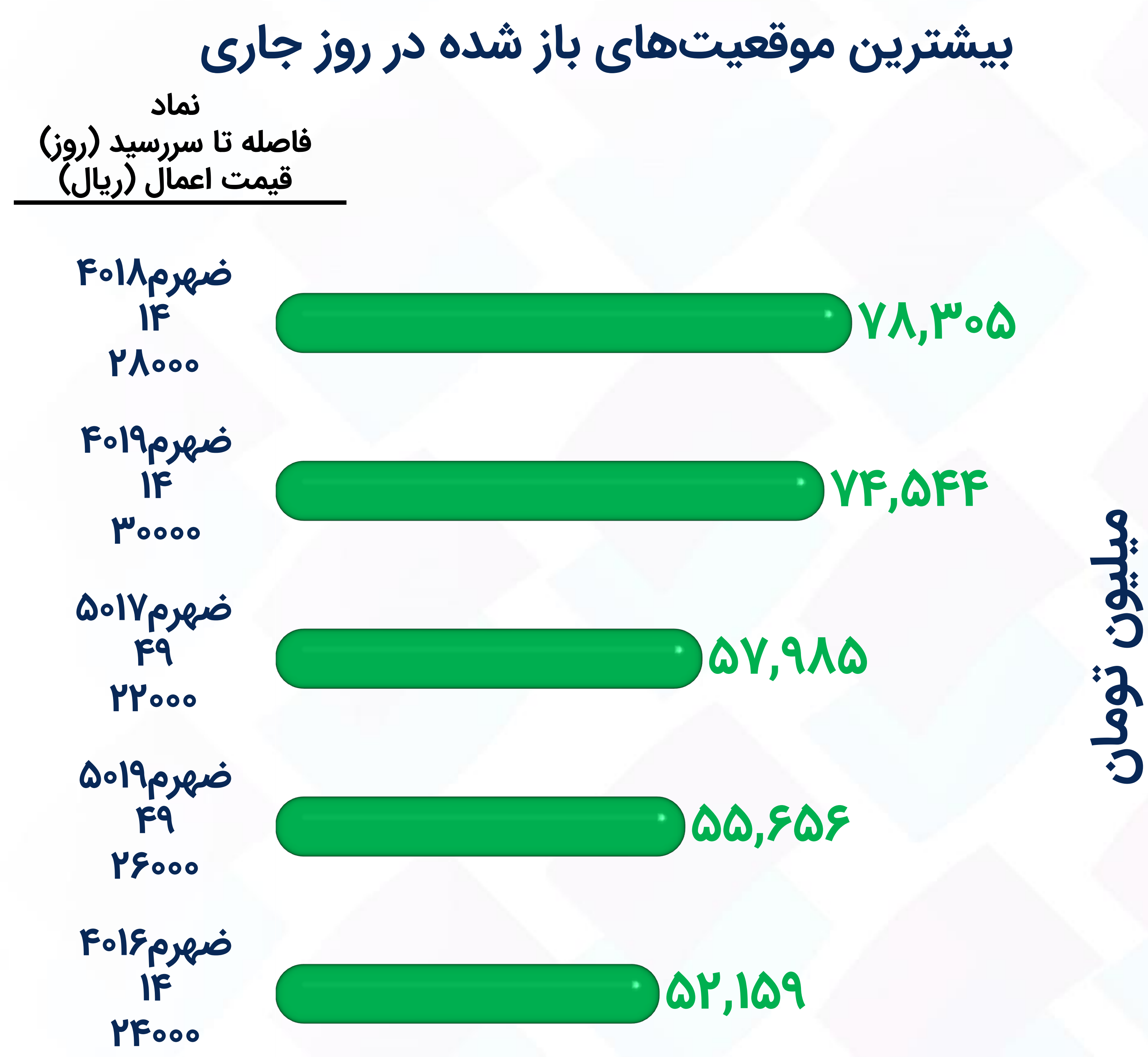
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۴۲	۰.۱	۱	۵۶۴	۱۹۹	(۶۴.۷%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۱۴	۰.۰	۸۵	۲۲,۵۵۰	۱۴,۹۱۵	(۳۳.۹%)	۱۷۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۱۴	۳۳.۱	۴۲	۲۲,۵۵۰	۱۵,۹۵۸	(۲۹.۲%)	۳۸۰.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۴۰۰۱	ذوب	۳۰۰	۱۴	۱.۰	۱	۳۹۲	۲۹۹	(۲۳.۷%)	۲۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۱۴	۱,۷۶۰.۵	۱۷۳	۲۲,۵۵۰	۱۷,۸۲۷	(۲۰.۹%)	۱۰۳.۰	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



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

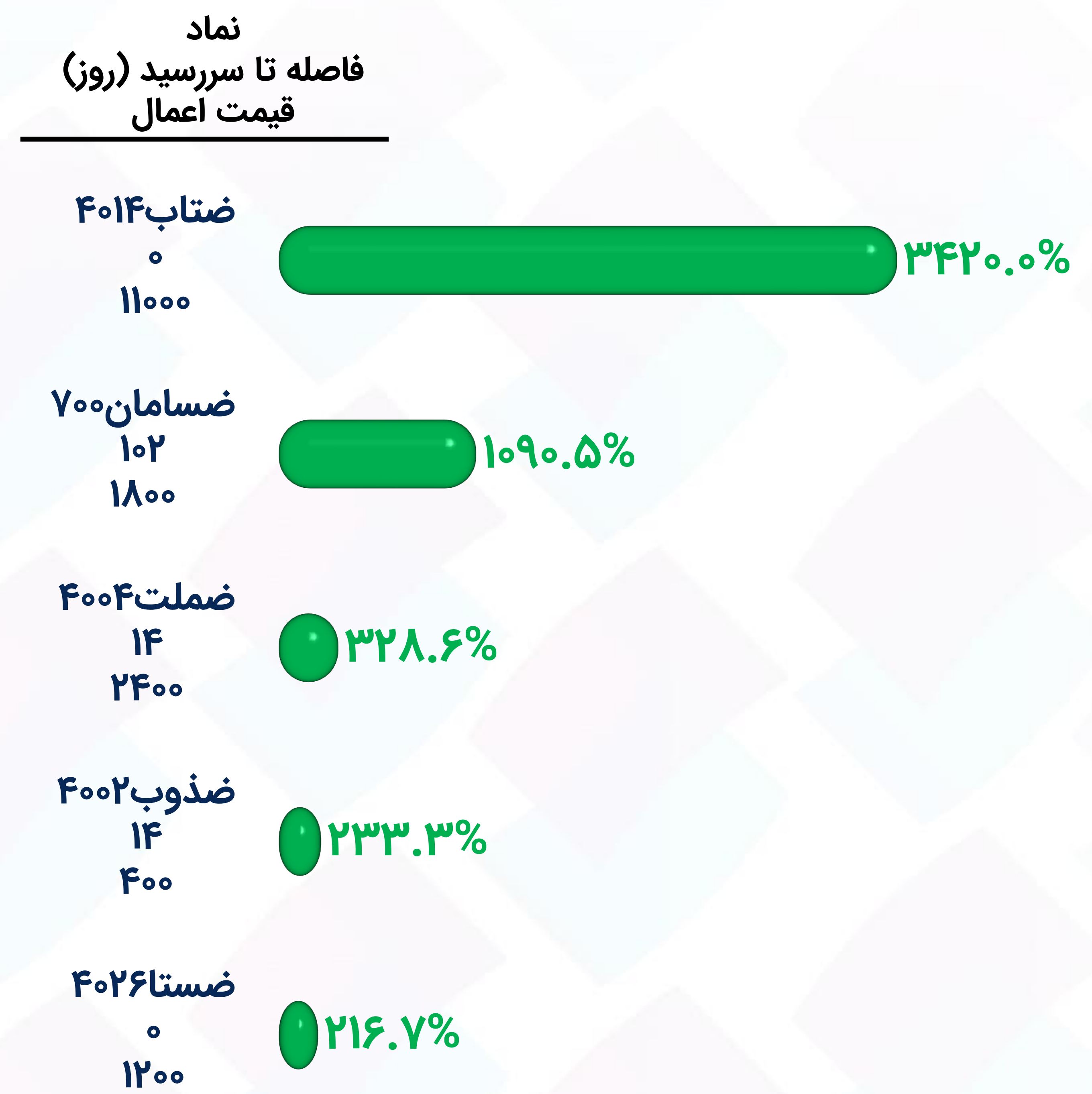
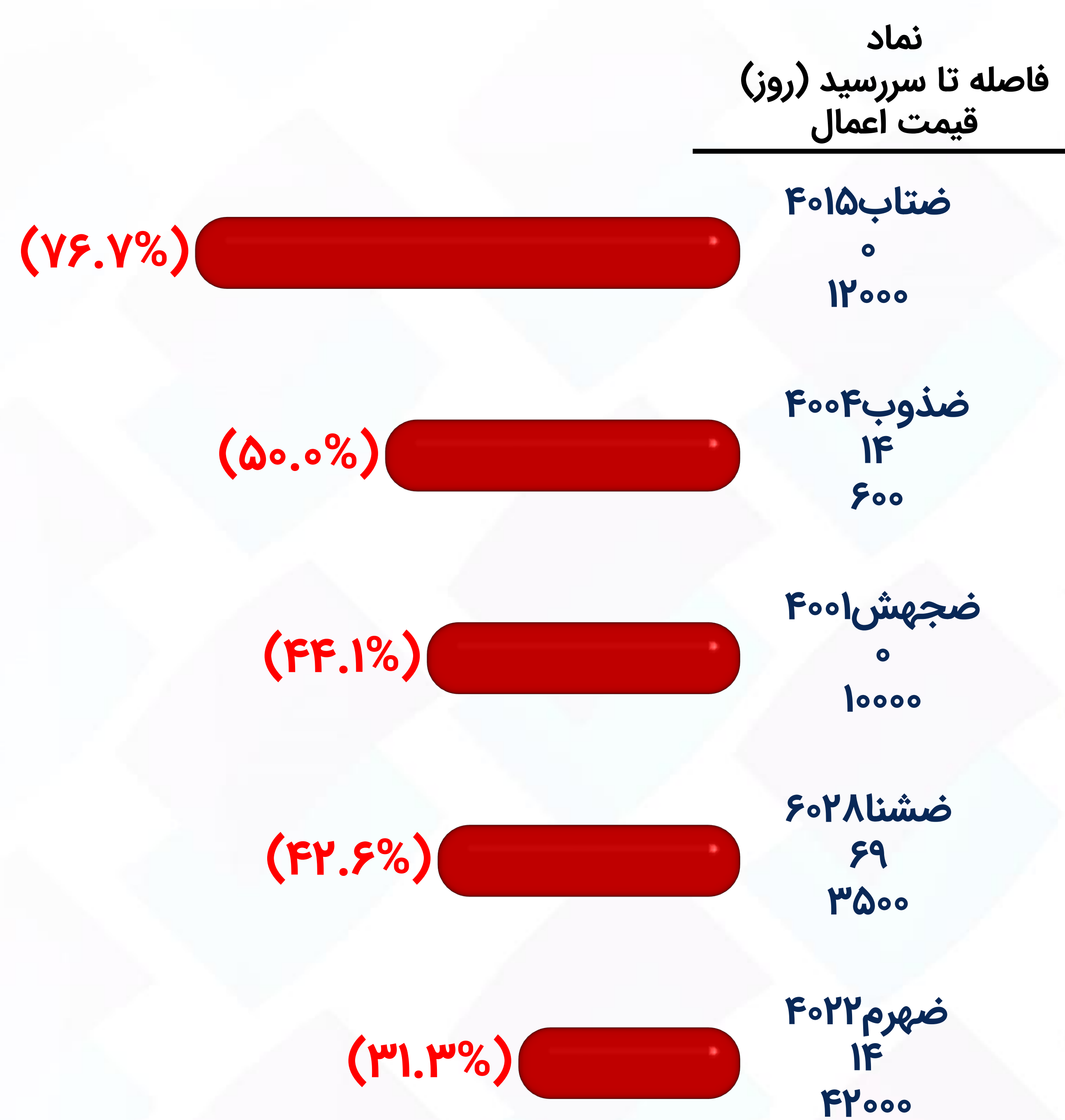
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



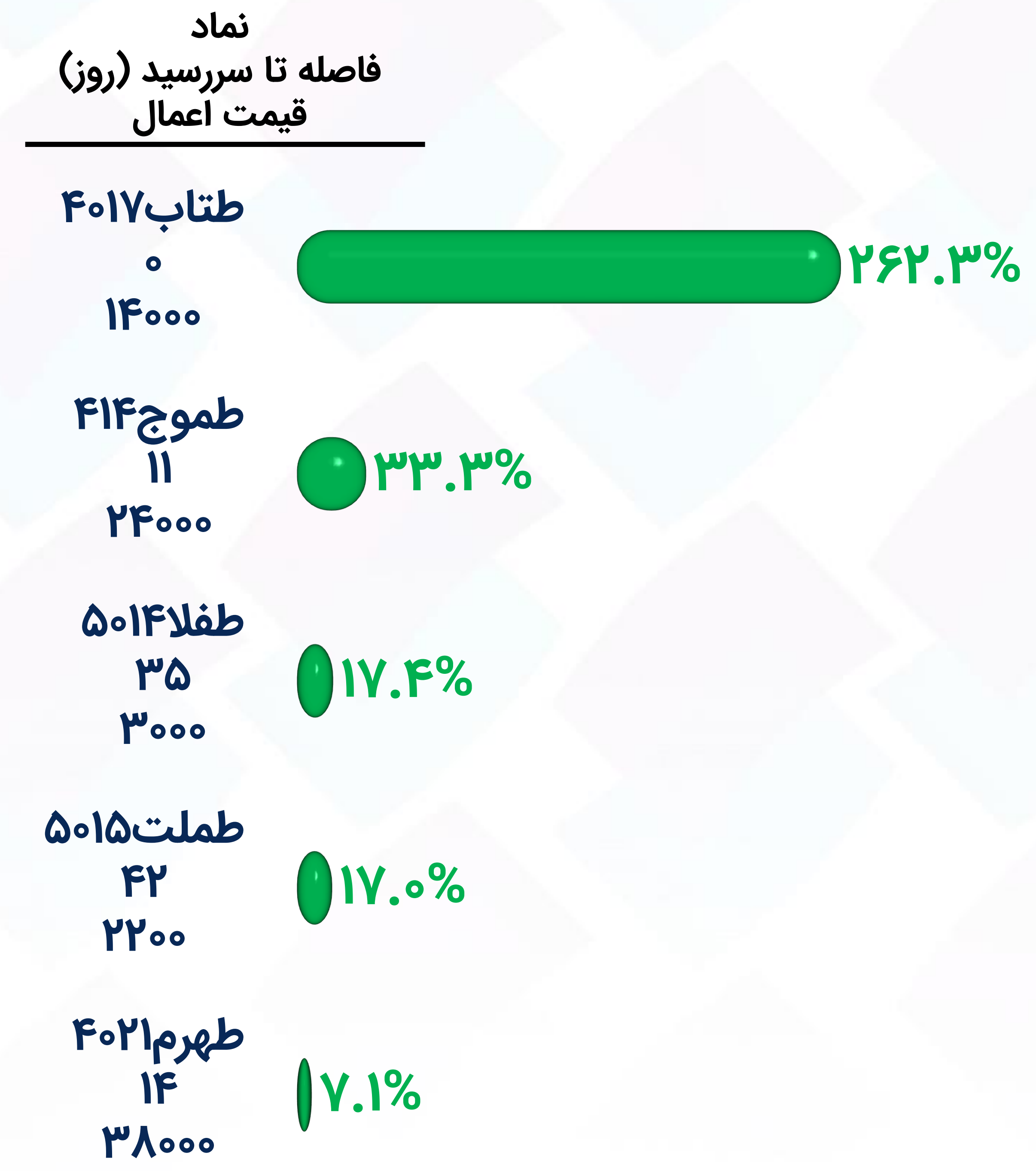
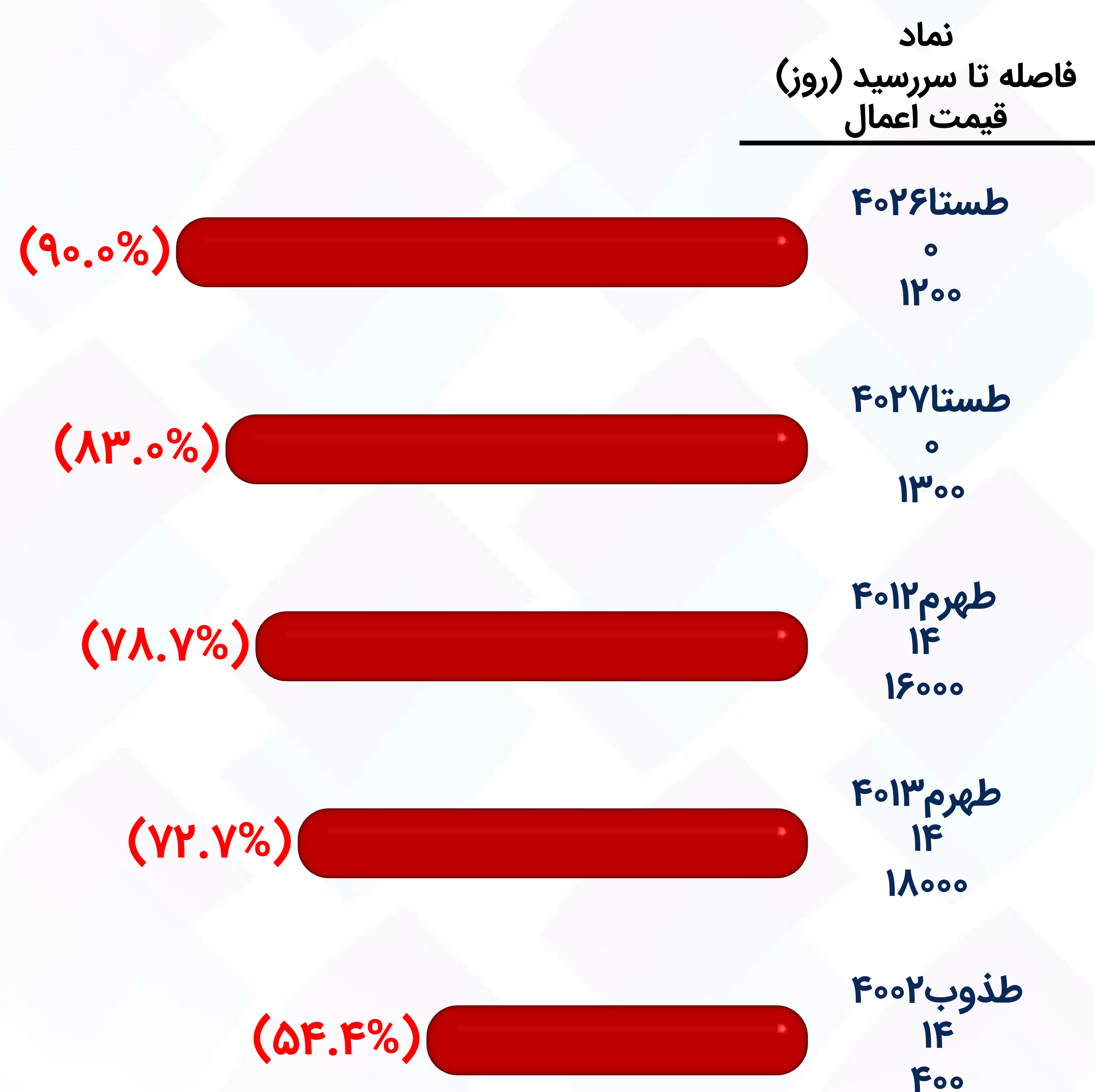
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

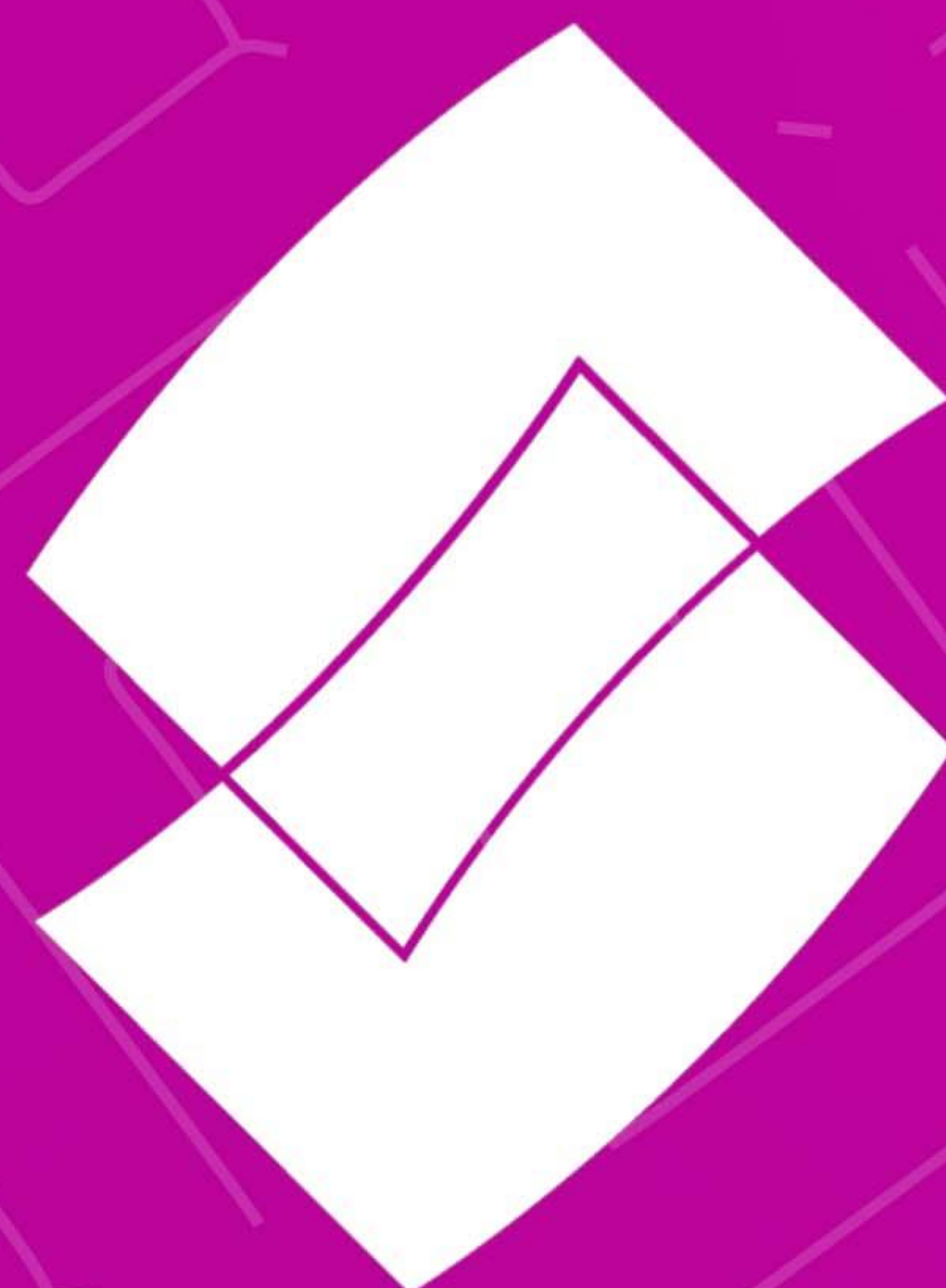
اختیار خرید



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.