

شماره
۵۰۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۶ 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



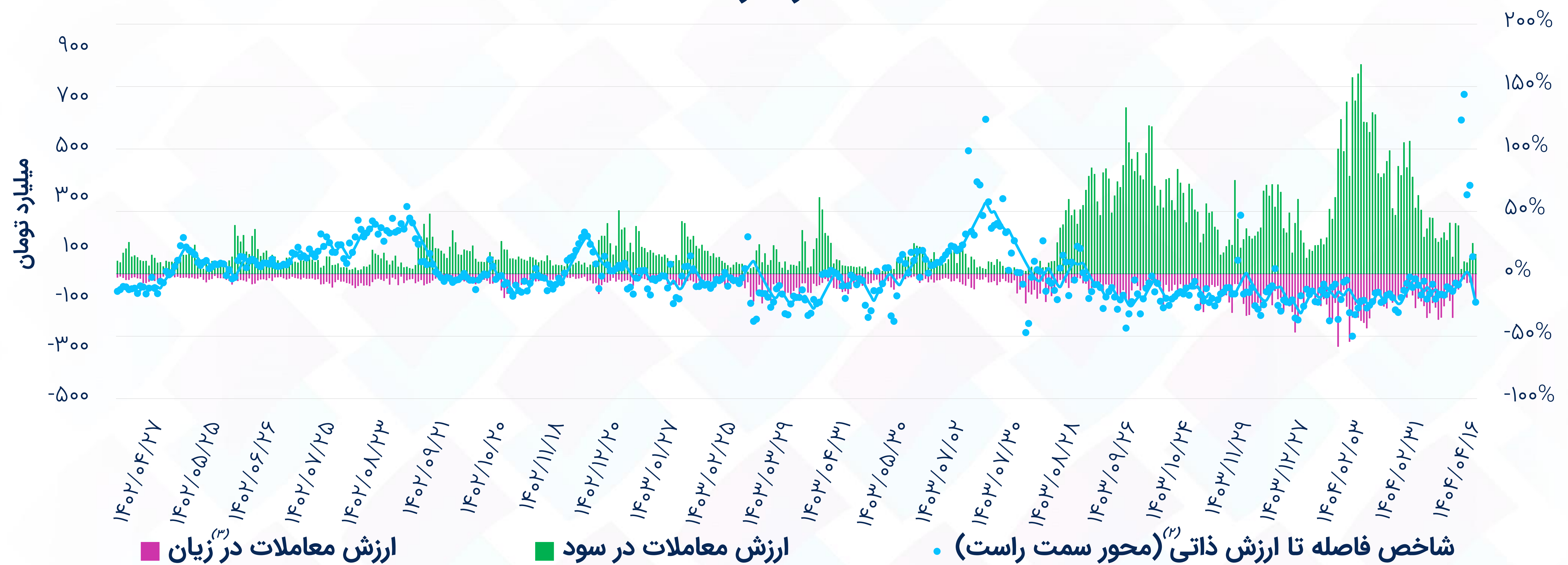
اختیار فروش



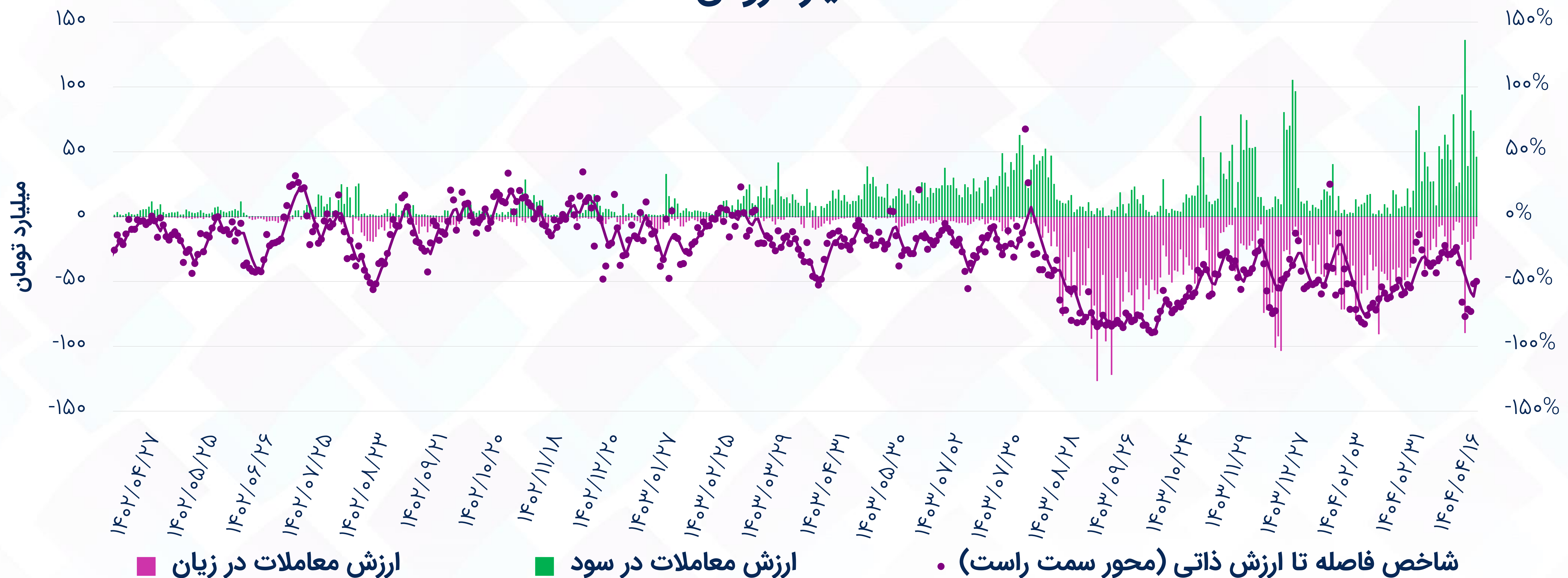
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۵۰.۶	۴,۷۶۳.۶	۵۷.۵	۹۳.۰	(۲۴.۳%)
خسایا	۱۴	۹.۶	۸۶.۹	۹.۴	۰.۱	۱۲.۳%
ویملت	۲۶	۸.۵	۱۱۶.۸	۷.۳	۱.۲	(۱۲.۶%)
شستا	۲۷	۶.۸	۱۷۳.۴	۱.۱	۵.۷	(۳۱.۴%)
ذوب	۲۰	۵.۱	۱۶۰.۱	۰.۷	۴.۴	(۴۸.۲%)
وبصادر	۸	۱.۷	۲۷.۴	۰.۴	۱.۳	(۴۱.۰%)
وتجارت	۱۵	۱.۵	۵۱.۳	۱.۰	۰.۵	(۲۳.۰%)

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	۵۱,۴۰۴.۰	۹۲۲,۱۵۶.۳	۴۴,۳۵۵.۶	۷,۰۴۸.۴	(۵۰.۳%)
شستا	۸	۱,۸۰۵.۱	۲۷,۸۰۳.۳	۱,۴۹۲.۴	۳۱۲.۷	(۴۲.۱%)
وبصادر	۲	۱۰۹.۰	۲,۰۴۰.۸	۱۰۷.۸	۱.۲	(۴۳.۸%)
خسایا	۳	۴۲.۶	۳۶۹.۹	۴۱.۰	۱.۷	۱۳.۲%
فولاد	۳	۲۴.۱	۴۹۷.۵	۱۴.۶	۹.۵	(۵۸.۵%)
وتجارت	۲	۱۴.۵	۳۷۴.۷	۱۴.۳	۰.۱	۲۲.۹%
خودران	۲	۱۴.۱	۲۵۹.۳	۶.۸	۷.۴	(۵۰.۴%)

موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

میلیارد تومان

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۱۰,۰۸۳

ذوب ۷۸۷

وتجارت ۷۲۰

شستا ۵۲۷

وبملت ۳۸۳

وبصادر ۳۴۸

خودرو ۳۰۴

شتاب ۲۰۲

خسپا ۱۹۹

شپنا ۱۷۶

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۹۵۲,۹۰۱

شستا ۷۸,۳۷۱

وبملت ۶۱,۷۴۸

ذوب ۵۵,۵۰۴

خسپا ۱۵,۰۰۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

توان (۵,۵۱۹.۱)

وتجارت (۵,۴۲۷.۵)

شپنا (۳,۲۷۹.۱)

فولاد (۳۵۴.۹)

خودران (۲۷۳.۳)

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۱,۶۸۱

شستا ۲۱

وتجارت ۶

توان ۵

خودرو ۲

وبصادر ۲

ذوب ۱

فولاد ۱.۳۴

خودران ۱.۰۳

وبملت ۰.۷۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۱۰,۱۱۵.۳

شستا ۱۳,۲۸۶.۱

وبصادر ۱,۵۲۶.۹

ذوب ۲۹۴.۶

فولاد ۲۱۳.۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

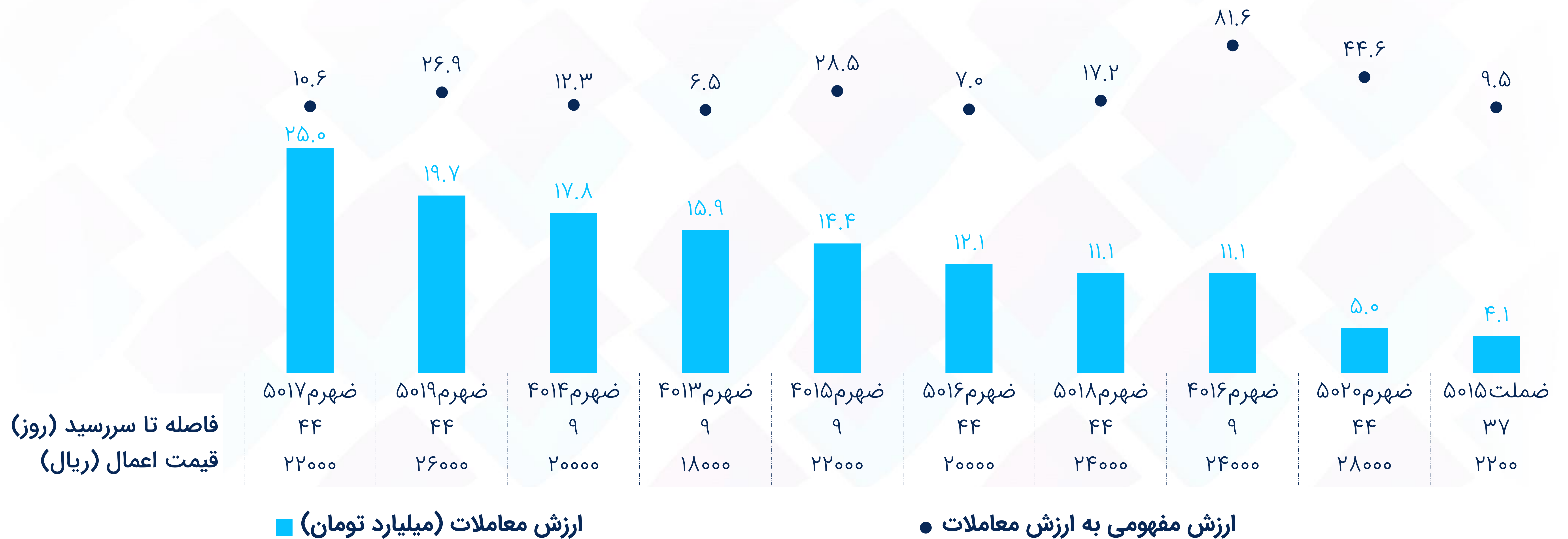
وتجارت (۱۳۵.۱)

توان (۴۵.۸)

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 ۵۰۰۲	شتاب	۱۲,۰۰۰	۲۳	۶۹.۷	۸۹۶	۱۳,۰۰۰	۱۲,۸۹۶	(۰.۸%)	۱۴.۴	۰.۸۸	۱,۳۷۹	۵۴%
ضسپا ۴۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۲	۱,۲۶۵.۲	۱۲	۴۰۵	۴۱۲	۱.۷%	۳۴.۳	۰.۵۹	۱۷	۴۳%
ضسامان ۵۰۶	سامان	۱,۹۰۰	۳۴	۱.۳	۴۲۱	۲,۴۳۶	۲,۳۲۱	(۴.۷%)	۵.۵	۱.۰۰	۶۰۲	۴۳%
ضسپا ۵۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۴۴	۱۴۳.۶	۱۵	۴۰۵	۵۱۵	۲۷.۲%	۳۴.۳	۰.۳۳	۲۱	۴۲%
ضران ۵۰۱۶	خودران	۸,۰۰۰	۴۴	۳.۰	۲,۰۰۰	۱۰,۴۵۰	۱۰,۰۰۰	(۴.۳%)	۵.۰	۱.۰۰	۲,۸۱۷	۴۱%

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
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۹	۶۴.۲	۲۵	۲۱,۹۶۰	۳۸,۰۲۵	۷۳%	۱,۵۲۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۹	وتجارت	۹۰۰	۲	۱.۷	۱	۴۷۱	۹۰۱	۹۱%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضجار ۴۰۱۷	وتجارت	۷۰۰	۲	۳.۹	۱	۴۷۱	۷۰۱	۴۹%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۹	۳۸.۹	۱۸	۲۱,۹۶۰	۴۲,۰۱۸	۹۱%	۲,۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۴۰۰۴	ذوب	۶۰۰	۹	۶.۸	۱	۳۸۶	۶۰۱	۵۶%	۶۰۱.۰	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
تسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۴۴	۱.۵	۴	۴۰۵	۲۹۶	(۲۶.۹%)	۷۴.۰	-۰.۰۸	۵	۲۴.۹%
تجار ۴۰۱۵	وتجارت	۵۰۰	۲	۱۴.۳	۲۲	۴۷۱	۴۷۸	۱.۵%	۲۱.۷	-۰.۹۴	۲۷	۲۴.۱%
تسپا ۴۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۲	۴۱.۰	۸۳	۴۰۵	۴۱۷	۳.۰%	۵.۰	-۰.۹۹	۹۳	۱۲.۰%
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۹	۳.۹	۱۹,۷۰۰	۲۱,۹۶۰	۲۲,۳۰۰	۱.۵%	۱.۱	-۱.۰۰	۱۹,۵۶۶	(۰.۷%)
طهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۹	۴.۹	۱۶,۲۳۳	۲۱,۹۶۰	۲۱,۷۶۷	(۰.۹%)	۱.۳	-۱.۰۰	۱۵,۶۱۱	(۳.۸%)

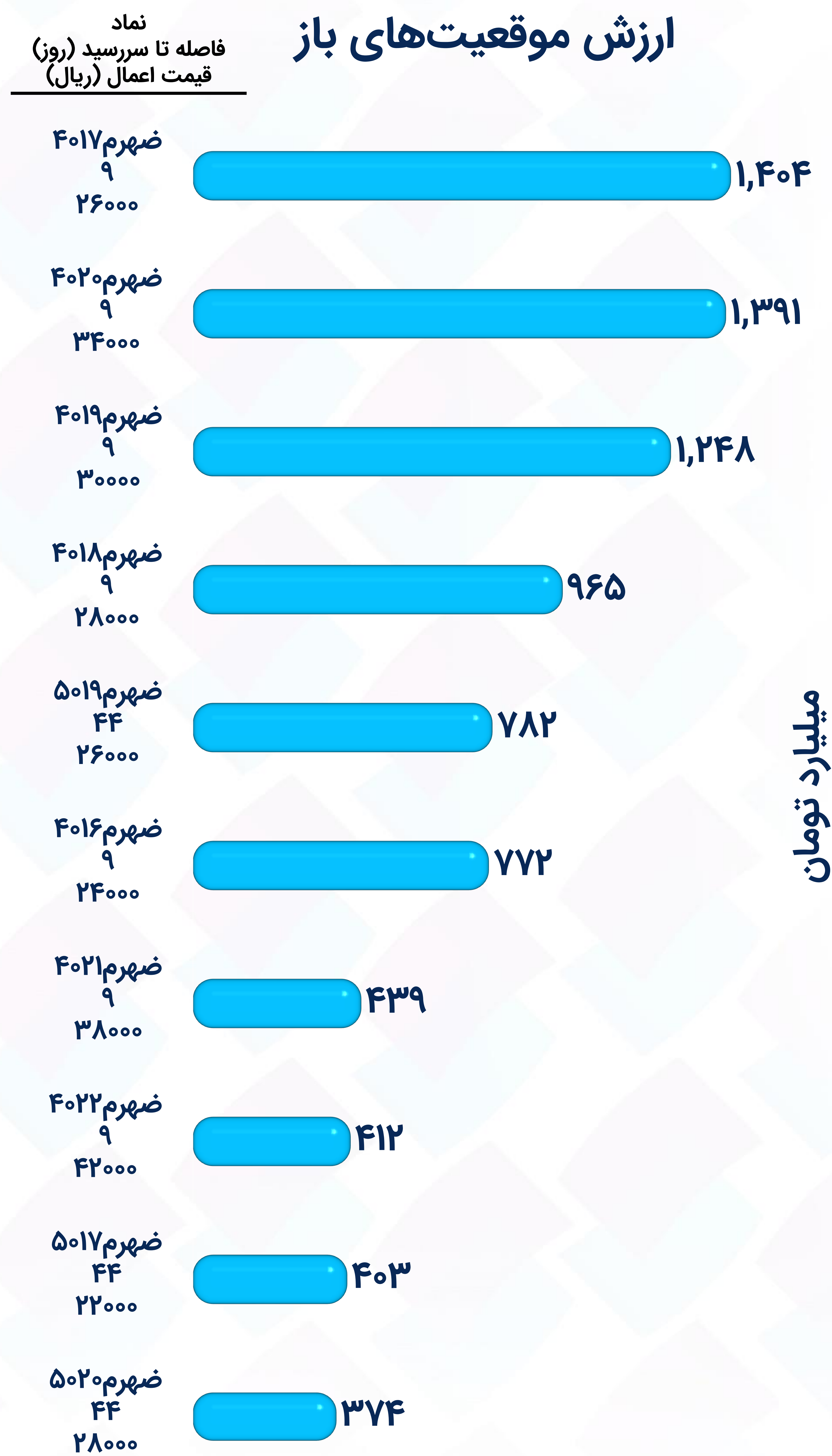
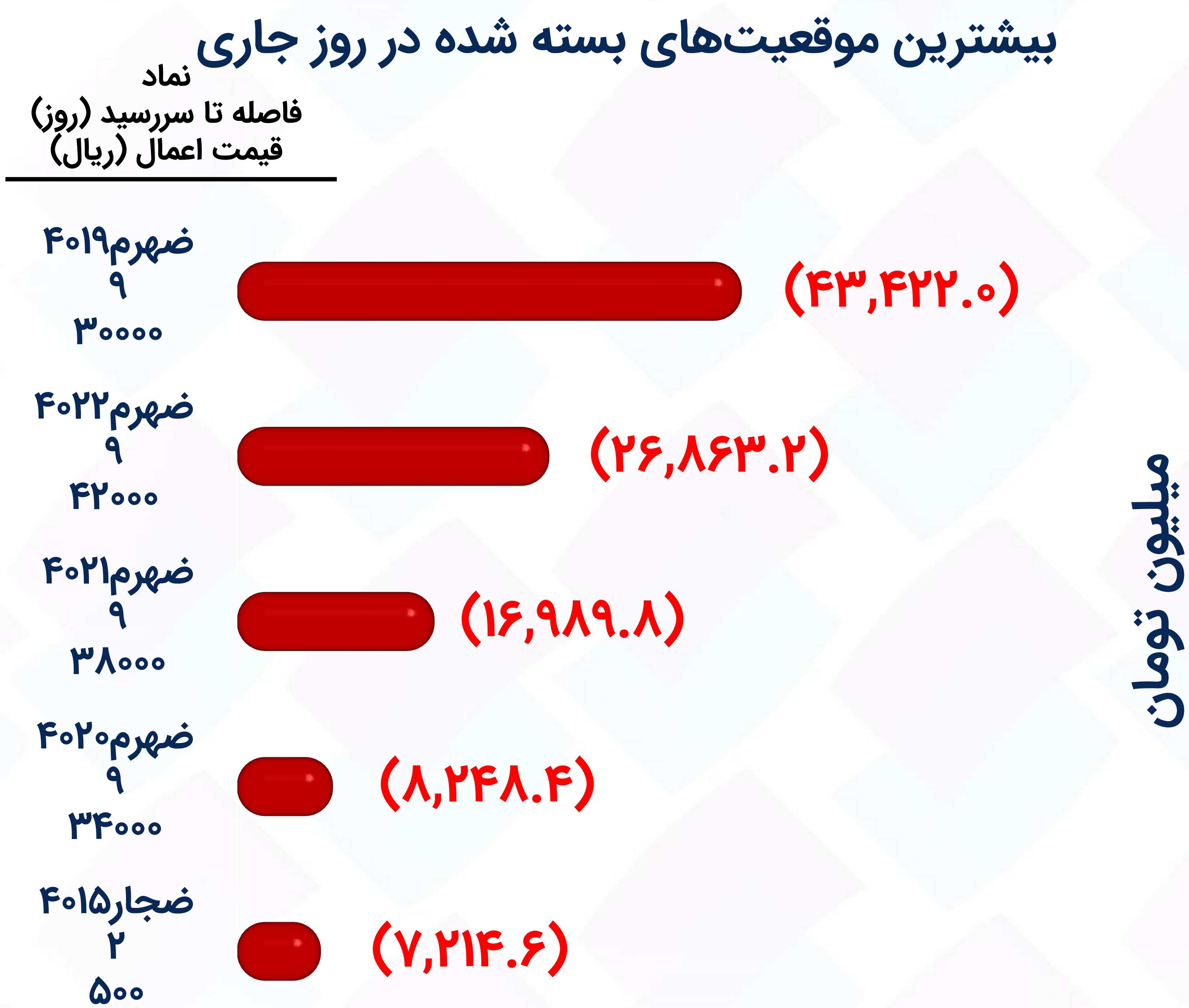
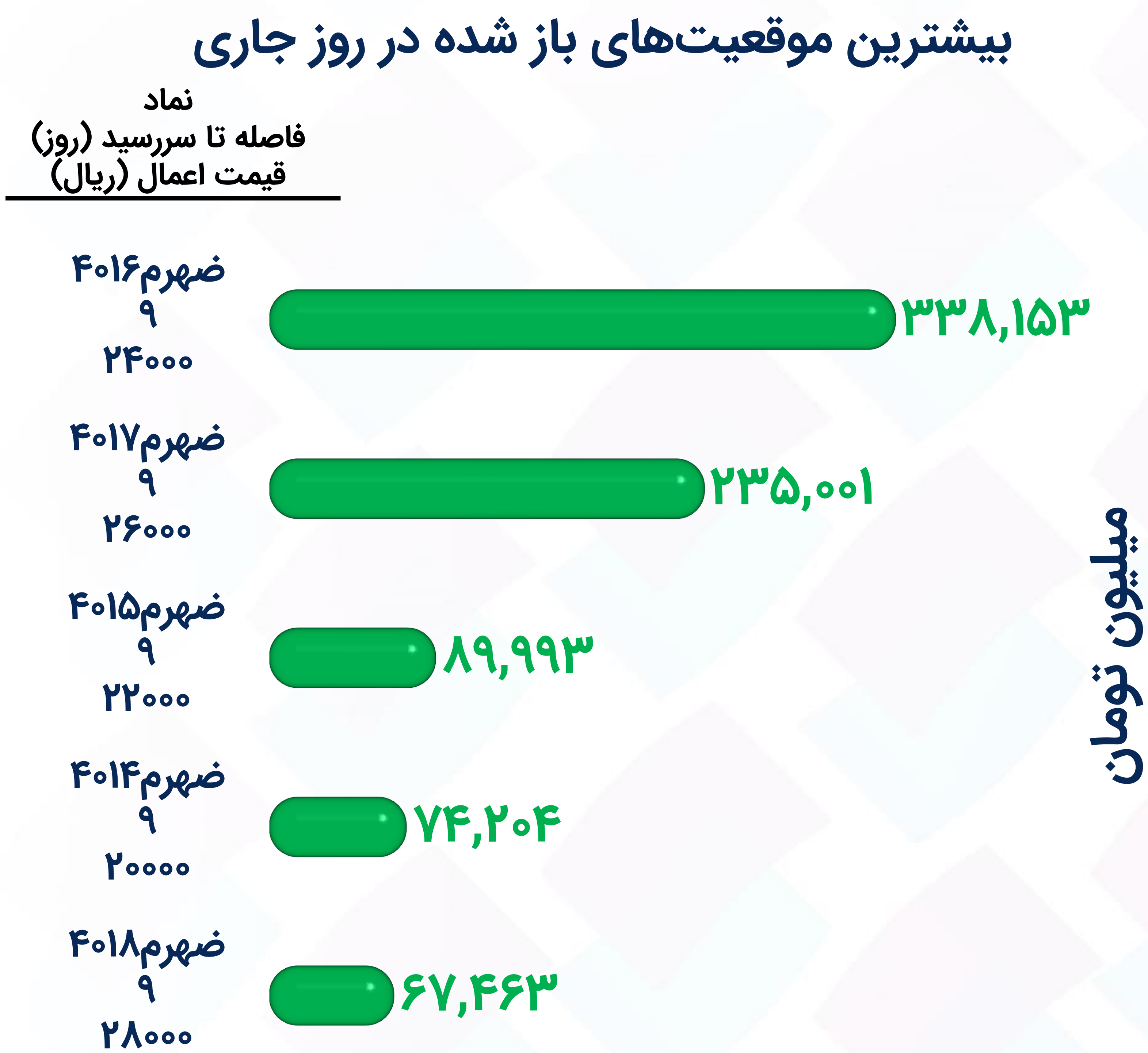
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
تصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۳۷	۱.۲	۱	۵۷۶	۱۹۹	(۶۵.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۹	۰.۱	۶۹	۲۱,۹۶۰	۱۴,۹۳۱	(۳۲.۰%)	۲۱۶.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
تذوب ۵۰۱۰	ذوب	۲۰۰	۳۷	۰.۱	۱	۳۸۶	۱۹۹	(۴۸.۴%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۹	۱۴.۳	۱۶	۲۱,۹۶۰	۱۵,۹۸۴	(۲۷.۲%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
تجار ۴۰۱۴	وتجارت	۴۰۰	۲	۰.۱	۱	۴۷۱	۳۹۹	(۱۵.۳%)	۳۹۹.۰	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

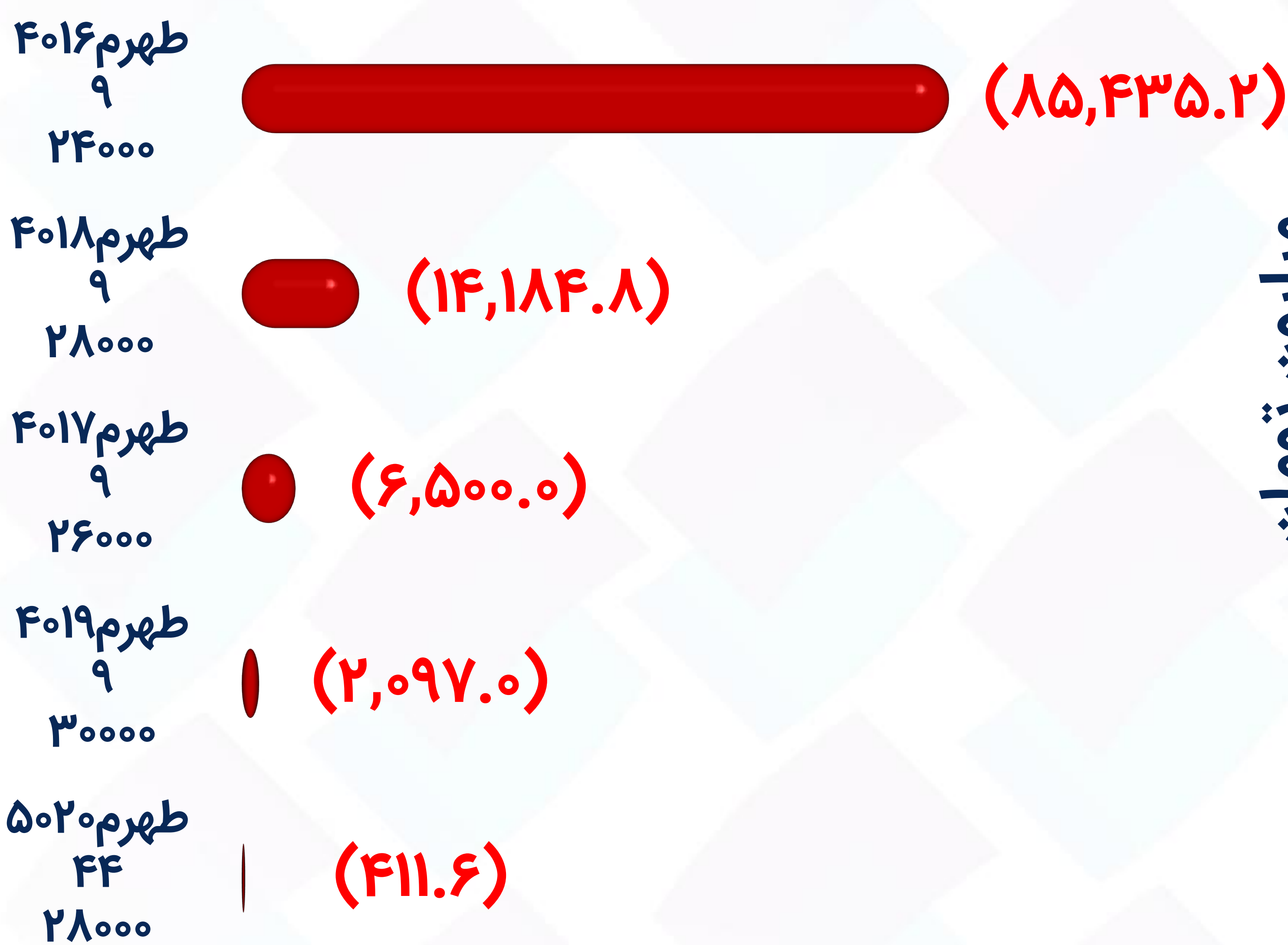
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

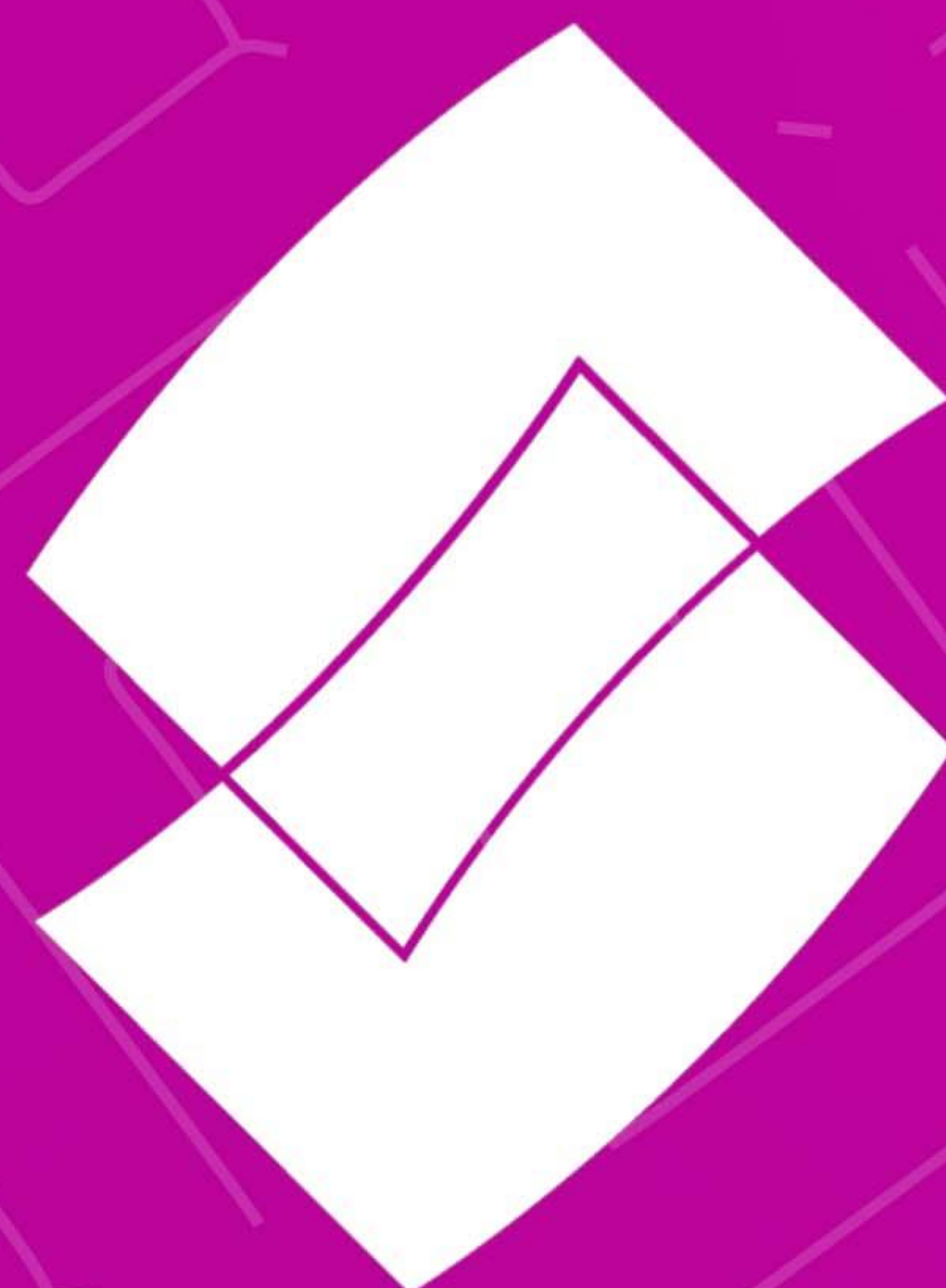
اختیار خرید



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.