

شماره
۵۰۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۷ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





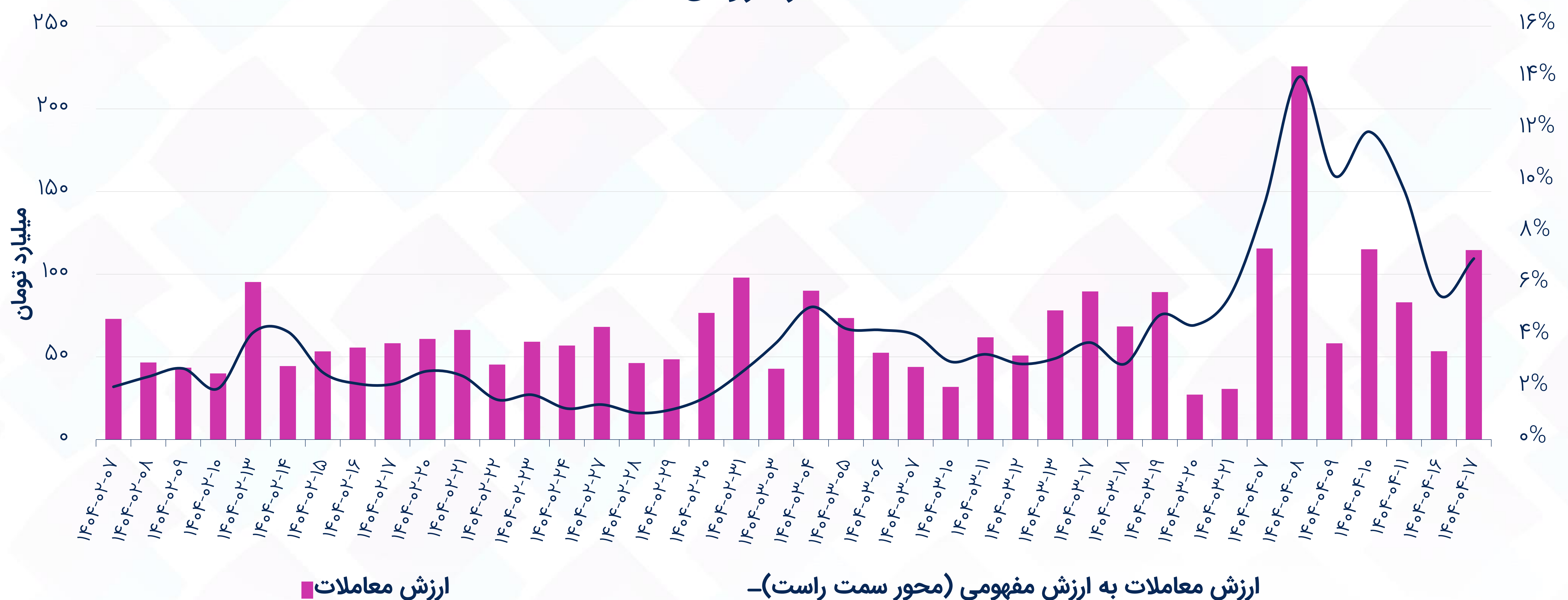
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



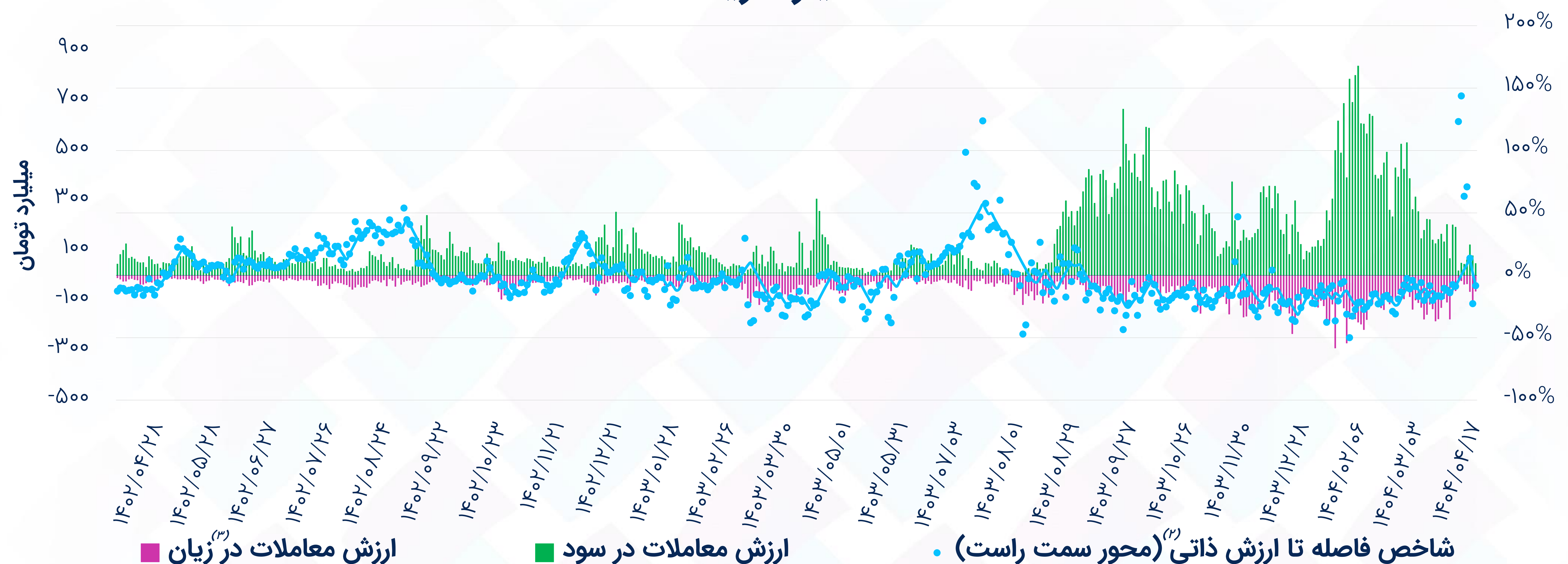
اختیار فروش



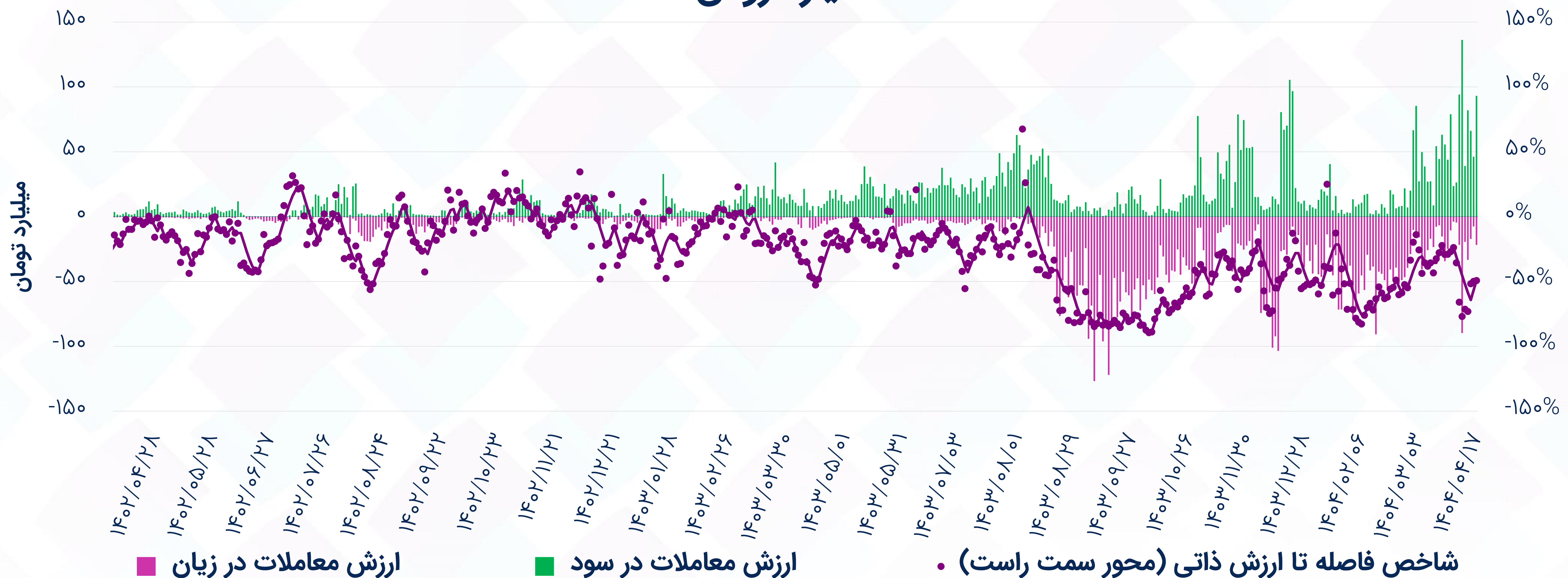
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۹	۹۵.۶	۴,۳۲۸.۹	۴۰.۹	۵۴.۸	(۷.۹%)
شستا	۲۳	۳.۷	۱۵۲.۷	۰.۶	۳.۱	(۳۶.۲%)
وبملت	۲۴	۳.۱	۷۷.۴	۱.۹	۱.۲	(۲۰.۱%)
خسپا	۱۲	۲.۹	۶۳.۸	۱.۶	۱.۳	۵۰.۹%
ذوب	۲۰	۲.۵	۱۱۴.۳	۰.۴	۲.۱	(۴۱.۷%)
وتجارت	۱۵	۱.۶	۲۱.۷	۱.۰	۰.۶	(۱۴.۶%)
وبصادر	۹	۱.۱	۲۴.۳	۰.۵	۰.۶	(۳۶.۰%)

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	۲۱	۱۱۲,۷۰۰.۸	۱,۶۰۳,۶۵۴.۸	۹۱,۶۷۶.۹	۲۱,۰۲۳.۹	(۴۹.۴%)
شستا	۸	۱,۶۹۳.۹	۲۸,۷۳۷.۱	۱,۱۳۳.۰	۵۶۱.۰	(۴۲.۹%)
خودران	۳	۳۶.۹	۳۷۶.۵	۲۶.۸	۱۰.۱	(۳۶.۴%)
وبملت	۵	۲۴.۸	۴۱۳.۴	۳.۰	۲۱.۸	(۵۶.۲%)
شپنا	۳	۲۳.۵	۲۸۵.۵	۲۳.۵	۰.۱	(۱۴.۳%)
خسپا	۴	۲۰.۷	۷۰۴.۸	۷.۶	۱۳.۲	(۲۶.۶%)
توان	۲	۱۸.۹	۷۵.۸	۱۸.۹	۰.۰	(۵.۳%)

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 ۱,۸۵۸

شستا ۳۴

و تجارت ۶

توان ۵

خودرو ۲

وبصادر ۲

فولاد ۲

ذوب ۱.۴۰

خودران ۱.۳۵

وبملت ۰.۹۲

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۱۷۷,۱۲۱.۷

شستا ۱۲,۳۲۹.۹

فولاد ۴۳۸.۲

خسپا ۳۸۵.۸

خودران ۳۱۳.۰

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

شپنا (۱۷۲.۱)

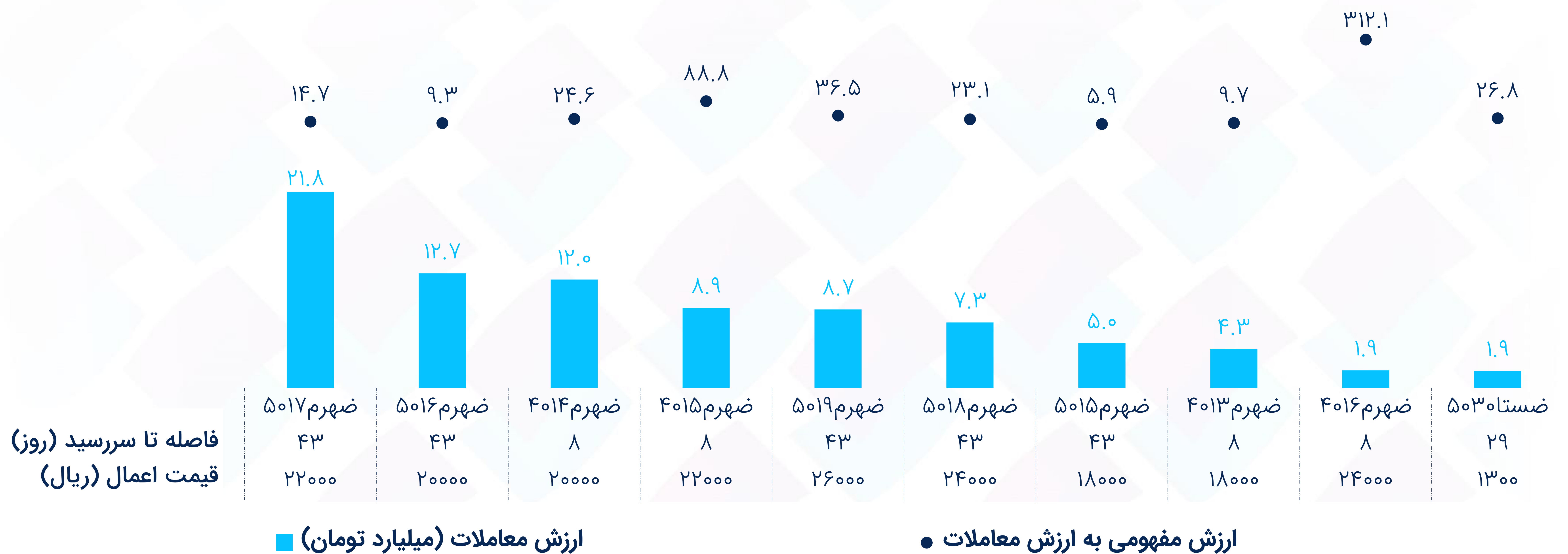
و تجارت (۱۳۸.۷)

توان (۲۶.۰)

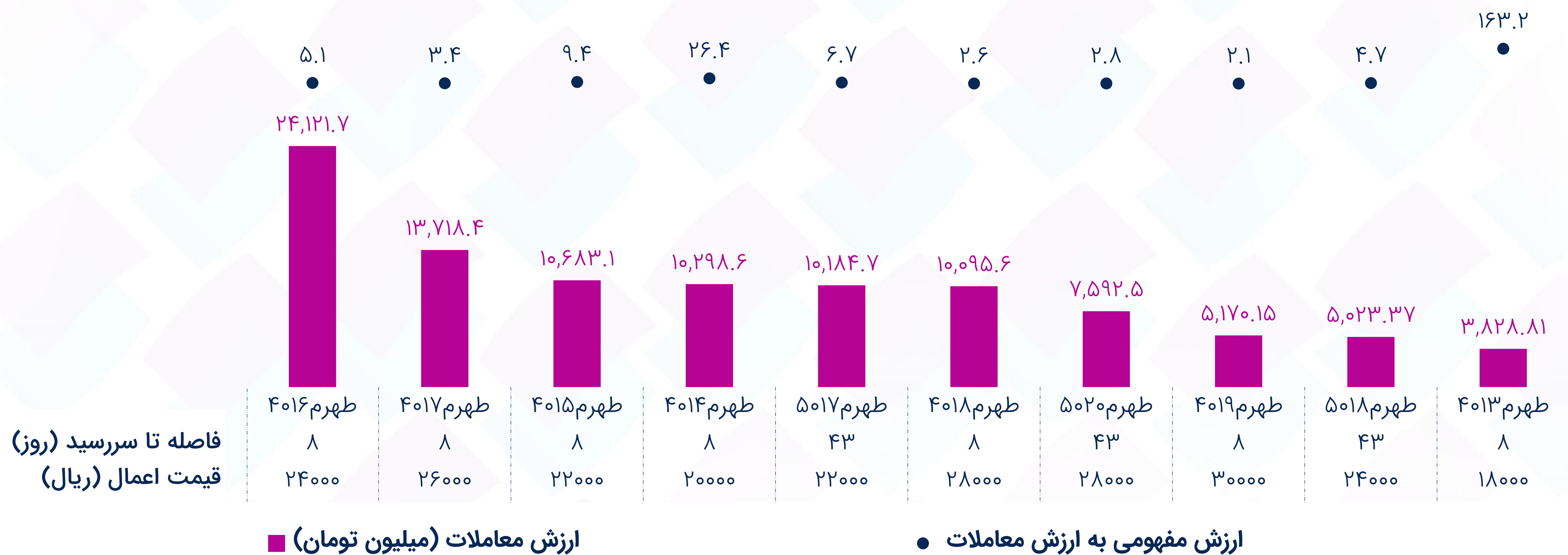
میلیون تومان

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
ضبیدا ۴۰۰۱	بیدار	۱۲,۰۰۰	۸	۲۷.۵	۵۰	۱۲,۱۰۰	۱۲,۰۵۰	(۰.۴%)	۲۴۱.۰	۰.۶۲	۴۲۶	۷۵۱%
ضاساس ۵۰۳	آساس	۴۸,۰۰۰	۴۰	۱.۳	۲۶۱	۴۶,۳۶۵	۴۸,۲۶۱	۴.۱%	۱۸۴.۹	۰.۵۵	۱,۷۰۶	۵۵۴%
ضفصبا ۷۱۴	فصبا	۲,۸۰۰	۸۲	۲۴.۰	۲۴	۲,۵۶۲	۲,۸۲۴	۱۰.۲%	۱۱۷.۷	۰.۴۹	۱۰۹	۳۵۴%
ضفصبا ۷۱۵	فصبا	۳,۰۰۰	۸۲	۴.۰	۲۰	۲,۵۶۲	۳,۰۲۰	۱۷.۹%	۱۵۱.۰	۰.۲۷	۴۸	۱۴۰%
ضفصبا ۷۱۳	فصبا	۲,۶۰۰	۸۲	۱۰.۰	۱۰۰	۲,۵۶۲	۲,۷۰۰	۵.۴%	۲۷.۰	۰.۷۲	۲۱۲	۱۱۲%

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 ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸	۱۱.۰	۸	۲۱,۲۲۰	۴۲,۰۰۸	۹۸%	۵,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۸	۳۴.۹	۱۲	۲۱,۲۲۰	۳۸,۰۱۲	۷۹%	۳,۱۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۴۰۰۴	ذوب	۶۰۰	۸	۸.۶	۱	۳۷۶	۶۰۱	۶۰%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۸	۳۴۹.۴	۲۰	۲۱,۲۲۰	۳۴,۰۲۰	۶۰%	۱,۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضتوان ۴۰۴	توان	۲۶,۰۰۰	۵	۱.۲	۹	۱۹,۹۴۸	۲۶,۰۰۹	۳۰%	۲,۸۸۹.۹	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 ۵۰۲۳	اهرم	۳۸,۰۰۰	۴۳	۴۰.۰	۱۰,۰۰۰	۲۱,۲۲۰	۲۸,۰۰۰	۳۲.۰%	۲.۸	-۱.۰۰	۱۵,۱۱۲	۵۱.۱%
طملت ۴۰۰۵	وبملت	۲,۶۰۰	۸	۳.۰	۳۰۰	۲,۲۴۵	۲,۳۰۰	۲.۴%	۷.۷	-۰.۹۹	۳۳۰	۱۰.۰%
طتوان ۴۰۴	توان	۲۶,۰۰۰	۵	۹.۰	۶,۰۰۰	۱۹,۹۴۸	۲۰,۰۰۰	۰.۳%	۳.۳	-۱.۰۰	۵,۹۰۷	(۱.۶%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۸	۲۳.۱	۲۱,۰۰۰	۲۱,۲۲۰	۲۱,۰۰۰	(۱.۰%)	۱.۰	-۱.۰۰	۲۰,۳۷۰	(۳.۰%)
طستا ۵۰۳۳	شستا	۱,۶۰۰	۲۹	۱۵.۷	۳۲۹	۱,۲۳۴	۱,۲۷۱	۳.۰%	۳.۹	-۰.۹۹	۳۱۸	(۳.۵%)

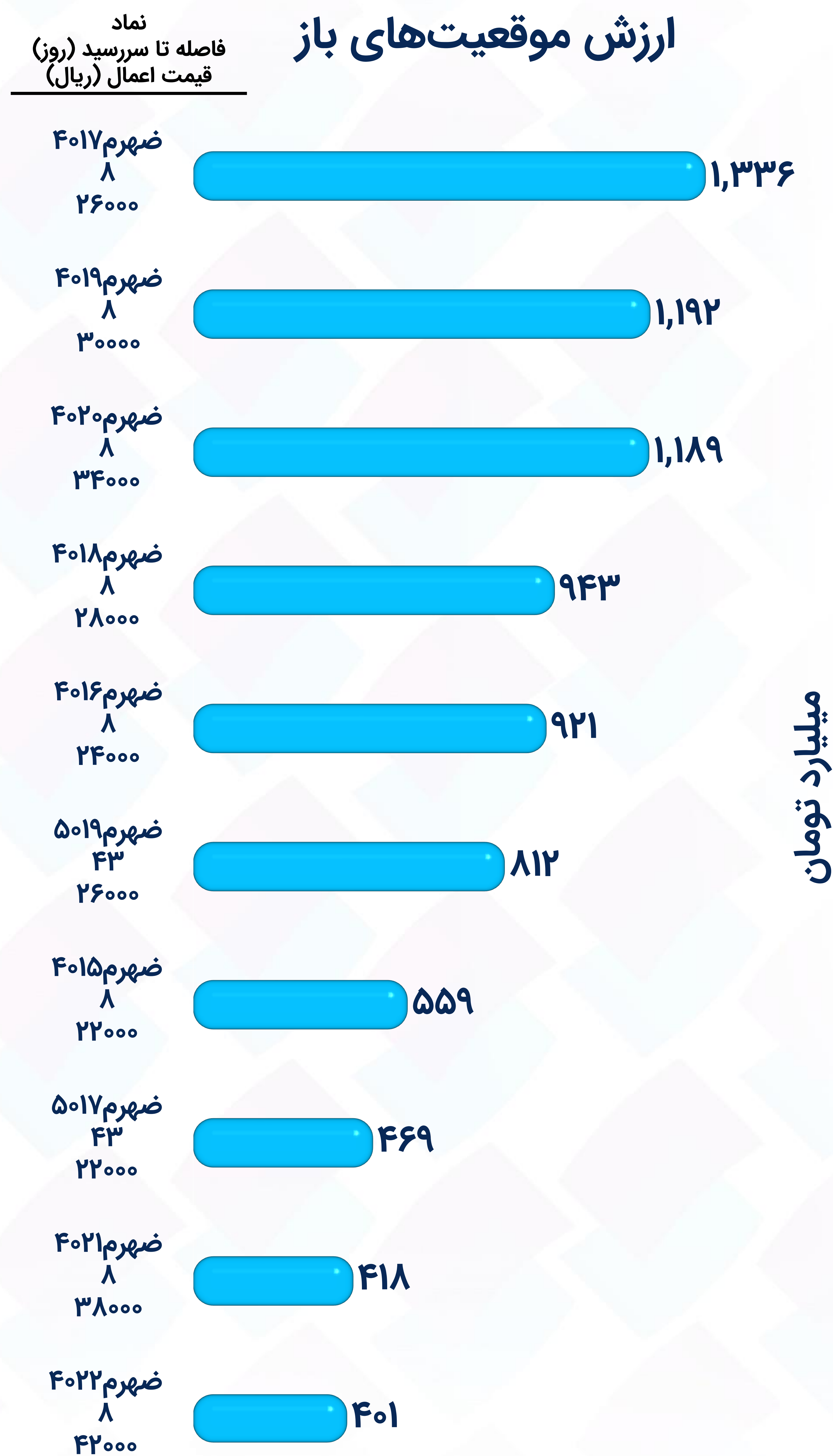
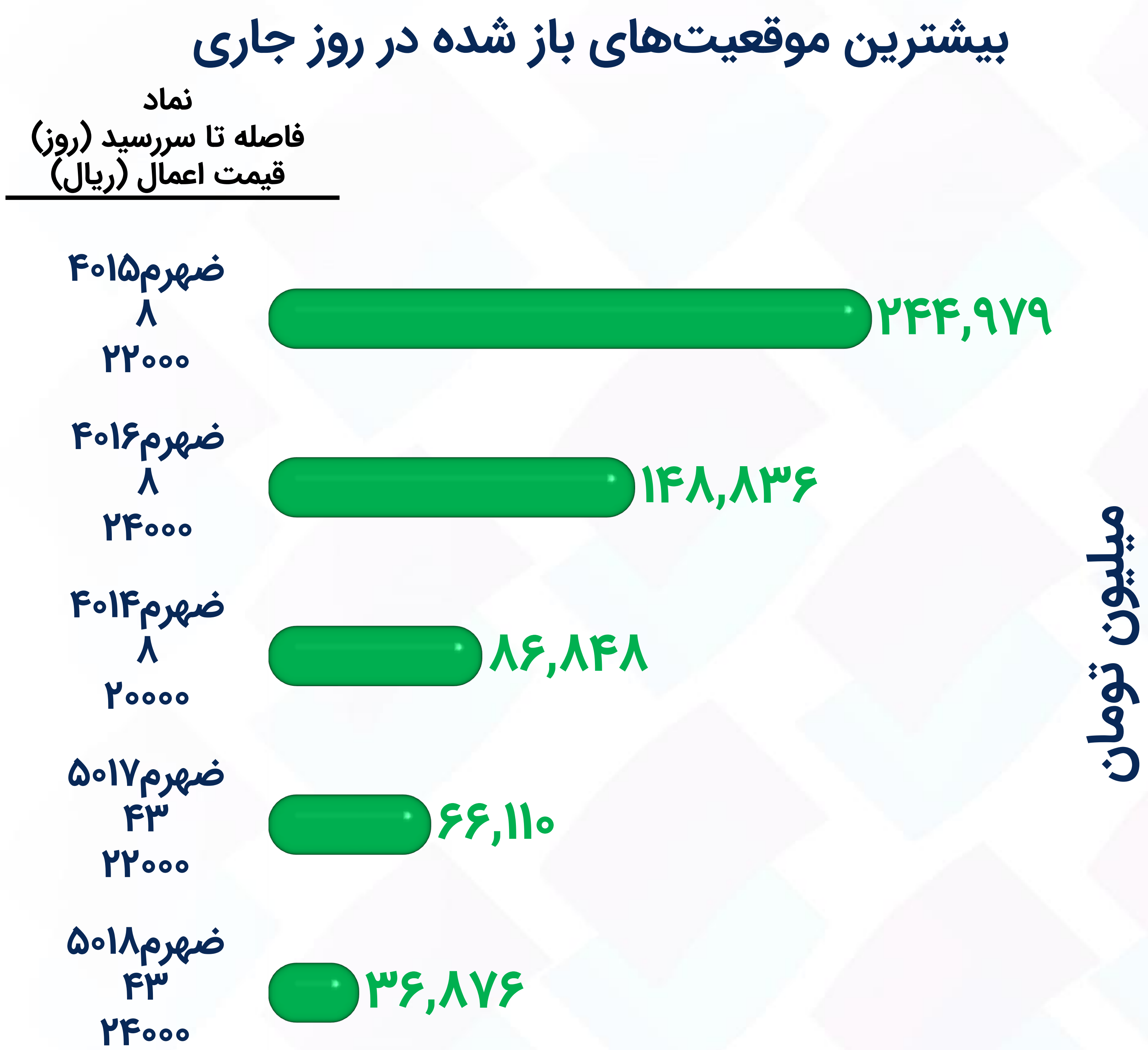
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۳۶	۱.۲	۱	۵۶۰	۱۹۹	(۶۴.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۸	۲۵.۸	۳۰	۲۱,۲۲۰	۱۴,۹۷۰	(۲۹.۵%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طذوب ۵۰۱۰	ذوب	۲۰۰	۳۶	۰.۲	۱	۳۷۶	۱۹۹	(۴۷.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۸	۱۴۵.۶	۲۸	۲۱,۲۲۰	۱۵,۹۷۲	(۲۴.۷%)	۵۷۰.۴	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۸	۳,۸۲۸.۸	۱۳۰	۲۱,۲۲۰	۱۷,۸۷۰	(۱۵.۸%)	۱۳۷.۵	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



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

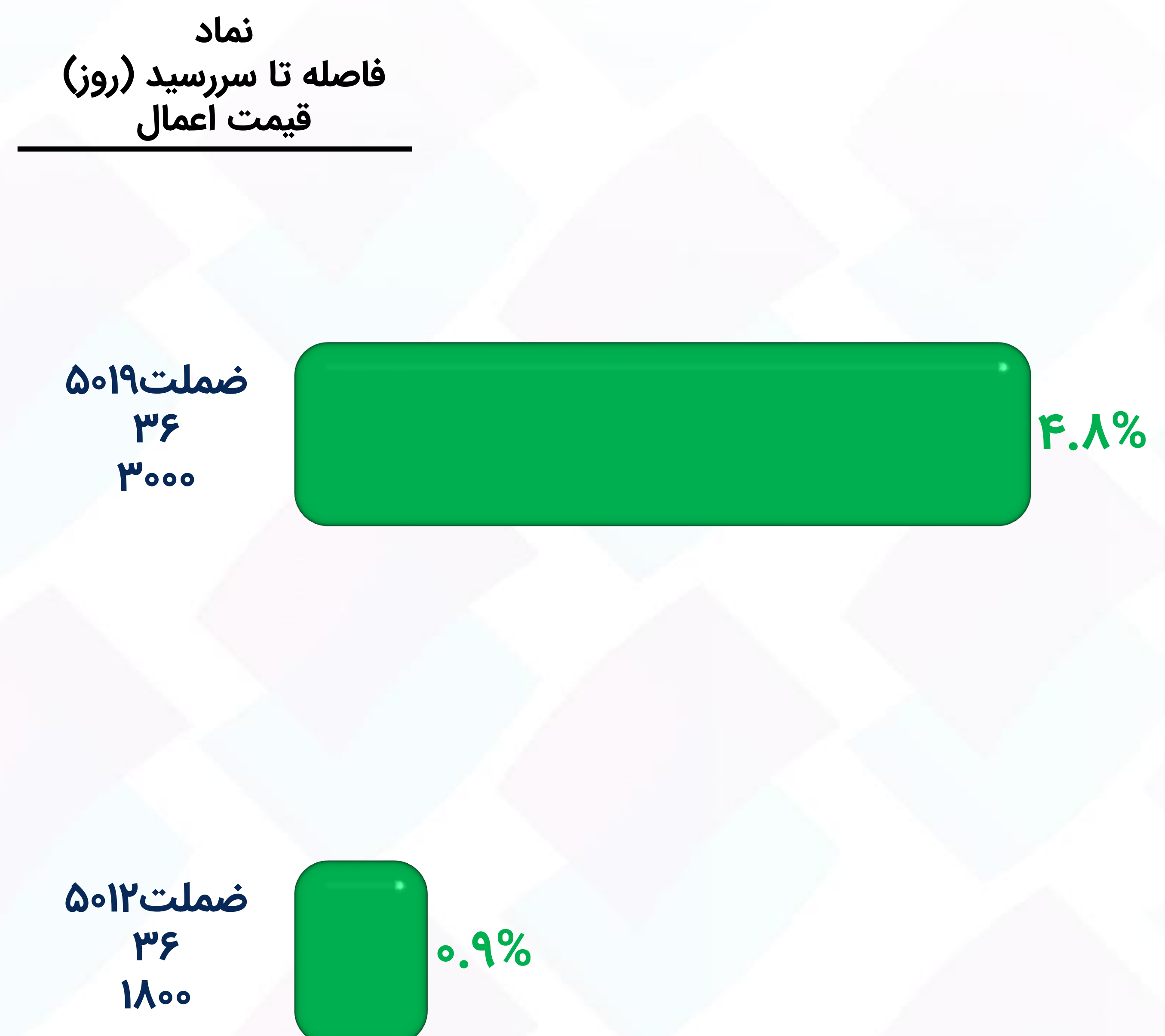
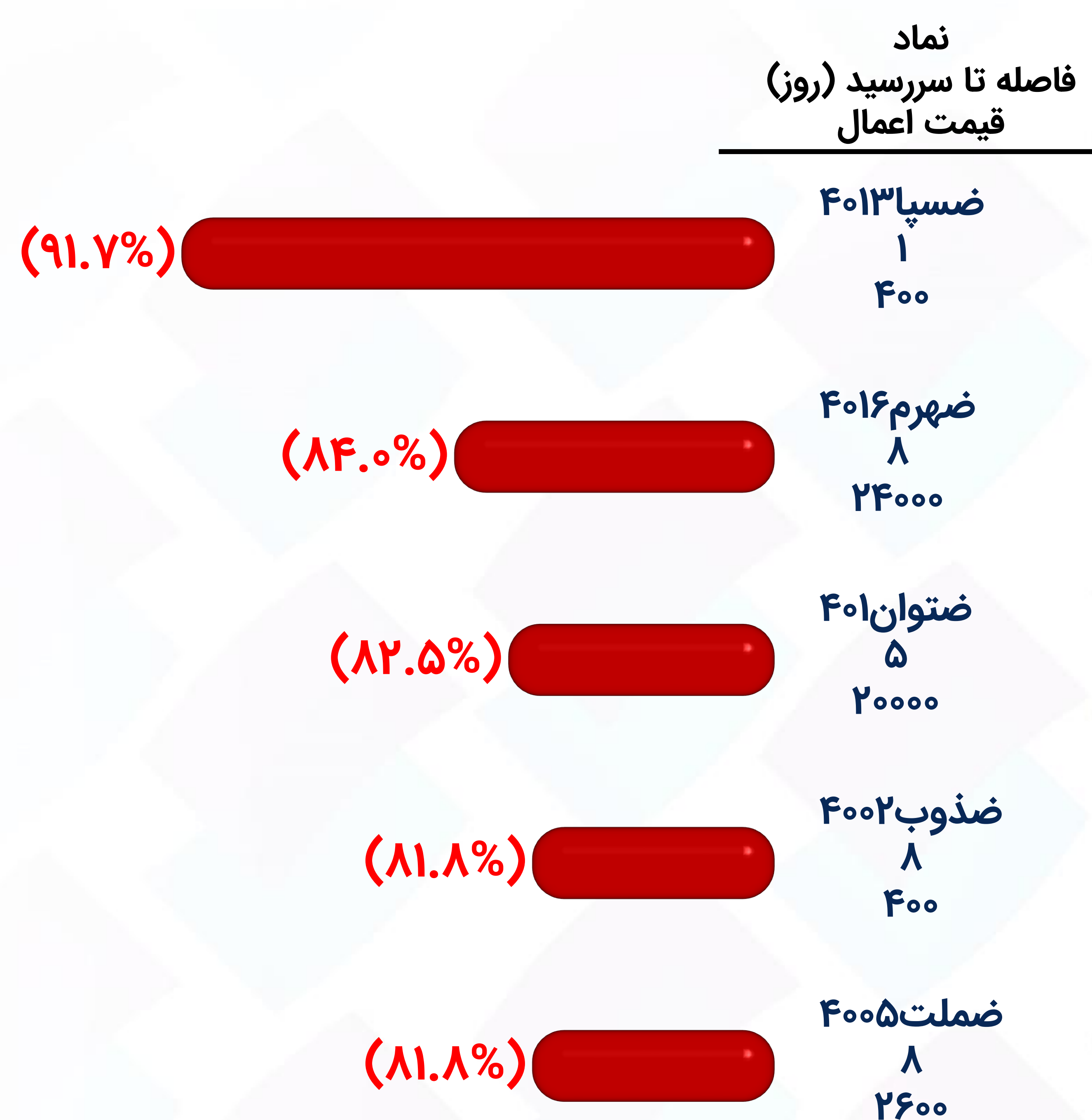
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



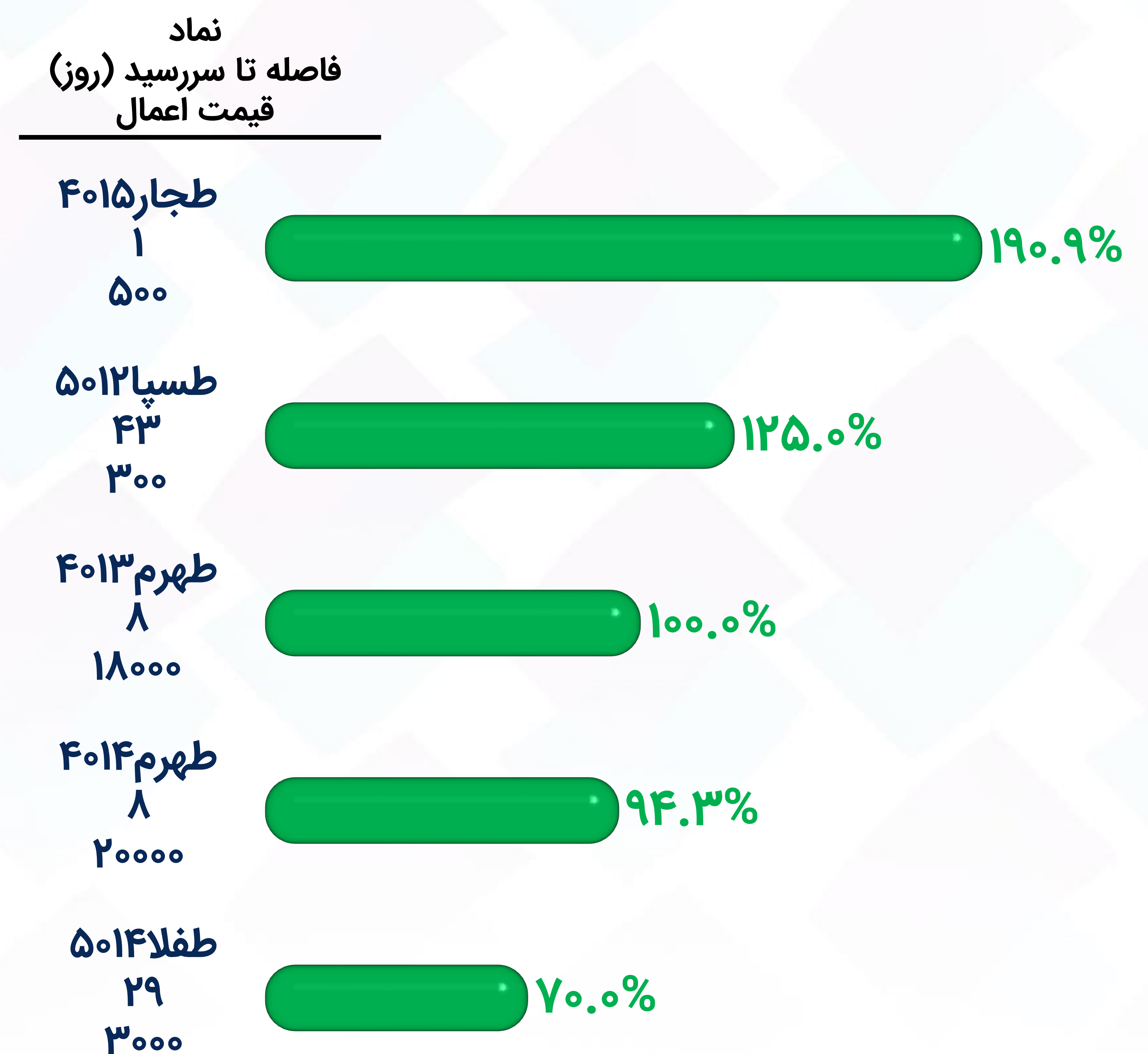
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

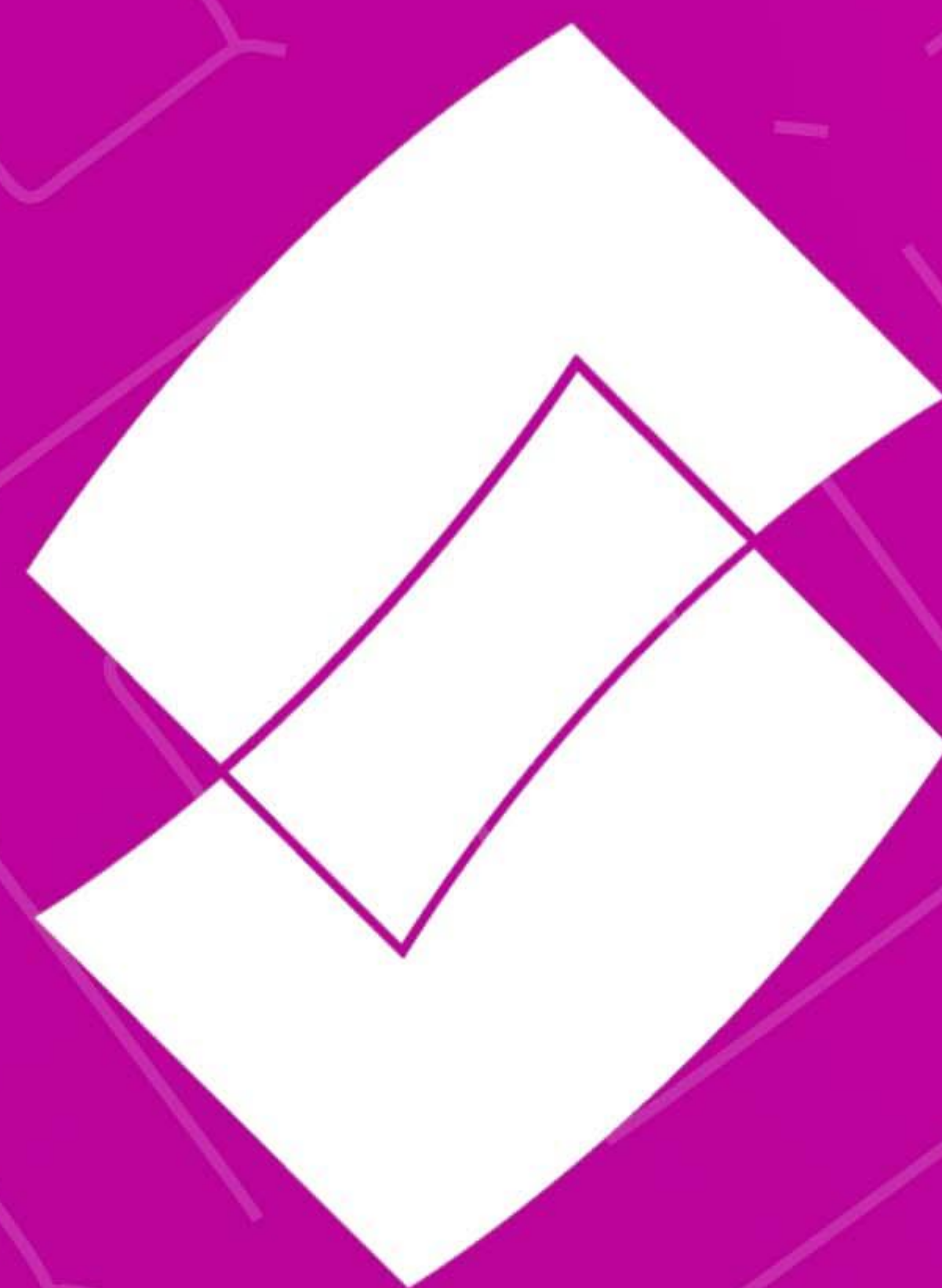
اختیار خرید



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.