

شماره

۵۰۵

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۱۸ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

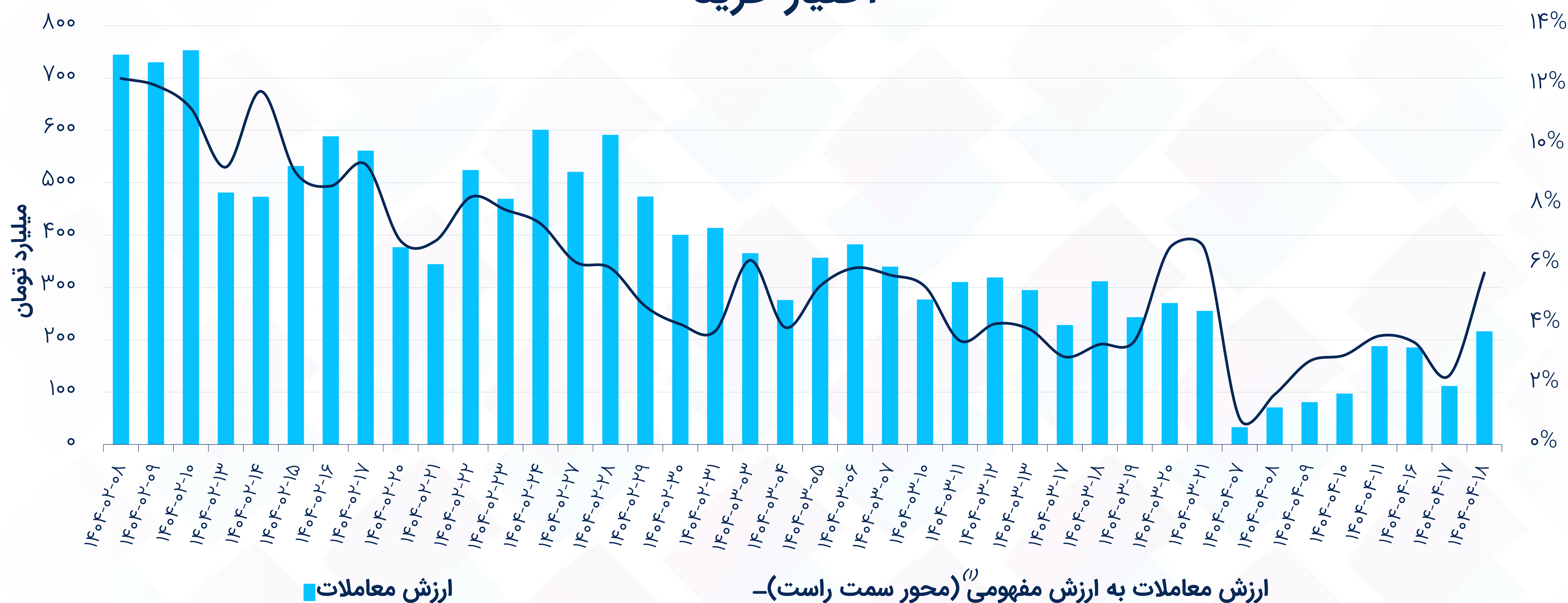




اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



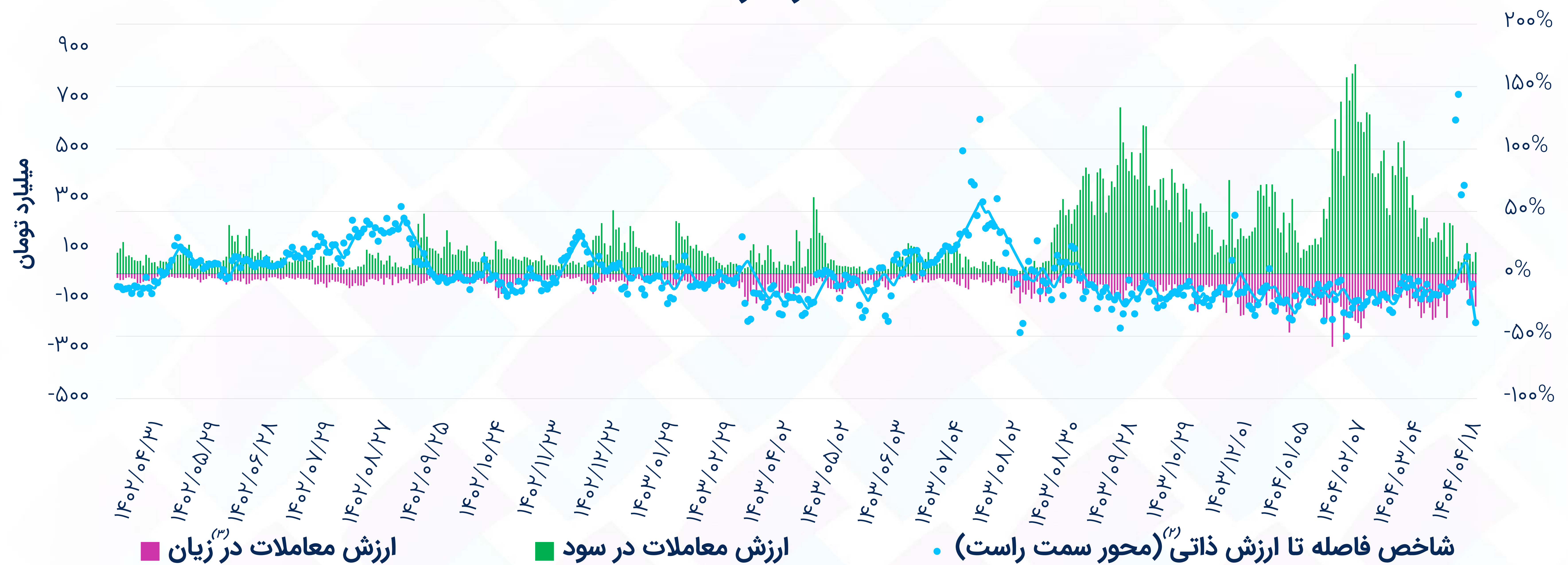
اختیار فروش



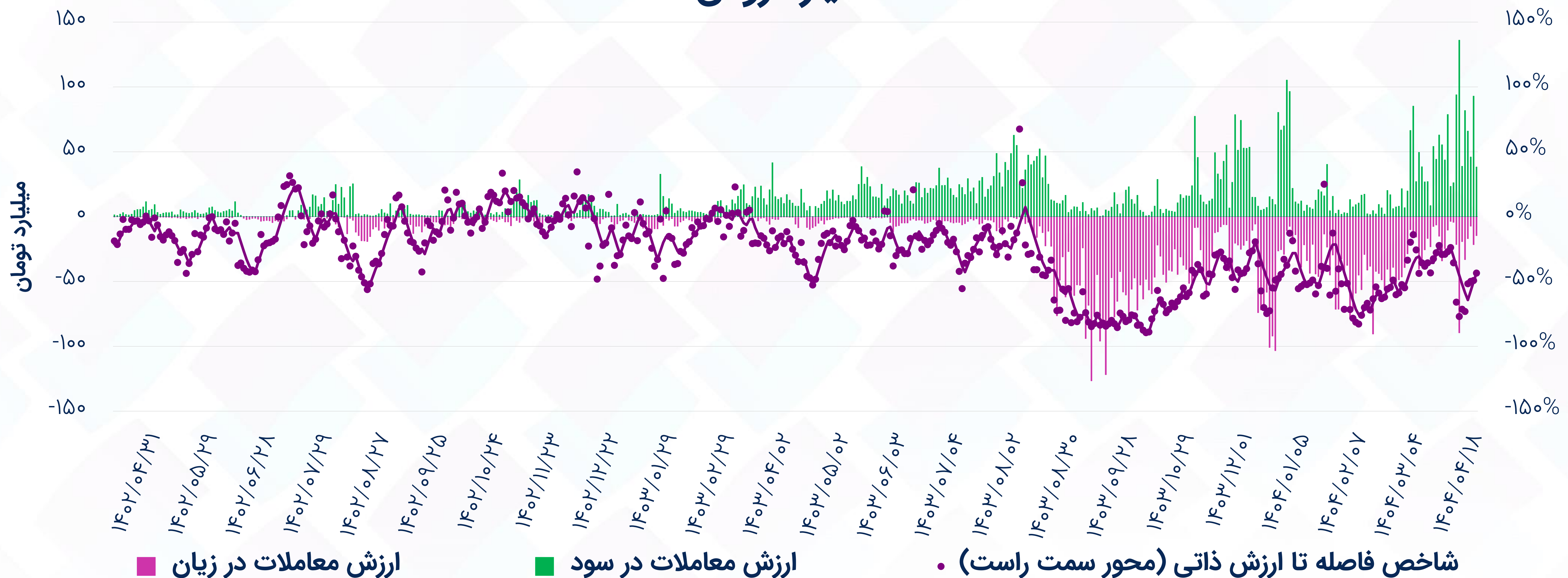
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۸	۱۸۵.۰	۳,۱۰۲.۱	۶۸.۸	۱۱۶.۳	(۴۳.۴%)
شستا	۲۸	۷.۹	۲۲۹.۷	۲.۰	۵.۹	(۴۴.۷%)
خسپا	۱۵	۷.۸	۴۹.۹	۵.۴	۲.۴	۱۲.۰%
وبملت	۲۶	۴.۴	۱۰۱.۴	۲.۹	۱.۴	(۲۲.۴%)
وتجارت	۱۲	۴.۰	۲۲.۲	۳.۸	۰.۲	۱.۴%
ذوب	۲۱	۲.۴	۱۱۱.۸	۰.۸	۱.۶	(۴۴.۸%)
شپنا	۱۷	۲.۱	۵۲.۳	۰.۷	۱.۴	۵۴.۱%

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	۲۳	۵۰,۱۹۴.۰	۵۸۳,۱۸۱.۶	۳۶,۷۰۲.۱	۱۳,۴۹۱.۹	(۴۴.۱%)
شستا	۸	۲,۴۰۳.۹	۴۵,۰۶۵.۶	۱,۲۲۷.۵	۱,۱۷۶.۳	(۴۰.۴%)
خسپا	۴	۲۱۶.۸	۳,۹۶۵.۶	۱۹۳.۲	۲۳.۷	۲۵.۴%
وتجارت	۳	۷۷.۰	۶۴۹.۴	۷۷.۰	۰.۰	(۱.۳%)
توان	۴	۷۱.۷	۲۳۵.۶	۷۱.۶	۰.۱	(۳.۸%)
شپنا	۲	۱۷.۷	۳۷۹.۸	۱۷.۷	۰.۰	(۳۸.۳%)
ذوب	۴	۱۵.۷	۳۲۸.۴	۱۵.۲	۰.۵	(۲۶.۴%)

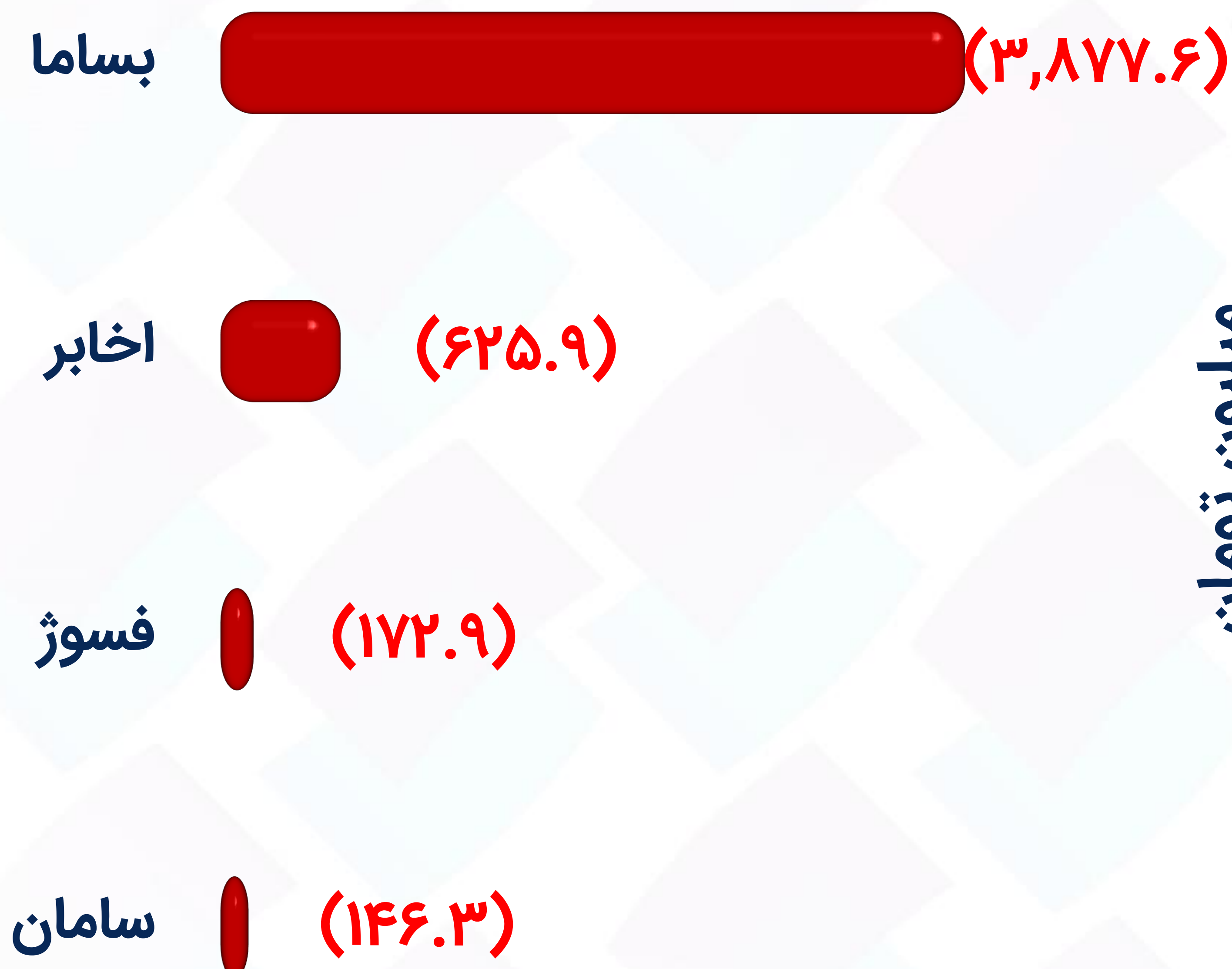
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

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 ۱,۷۶۵

شستا ۴۵

و تجارت ۶

توان ۵

خسپا ۳

وبصادر ۲

خودرو ۲

فولاد ۱.۸۱

ذوب ۱.۵۳

خودران ۱.۴۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۰,۸۵۴.۹

خسپا ۲,۷۰۷.۱

وبصادر ۴۰۷.۸

وبملت ۲۲۳.۳

خودران ۱۳۰.۴

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۹۲,۹۲۳.۲)

توان (۲۸۲.۴)

اخابر (۱.۰)

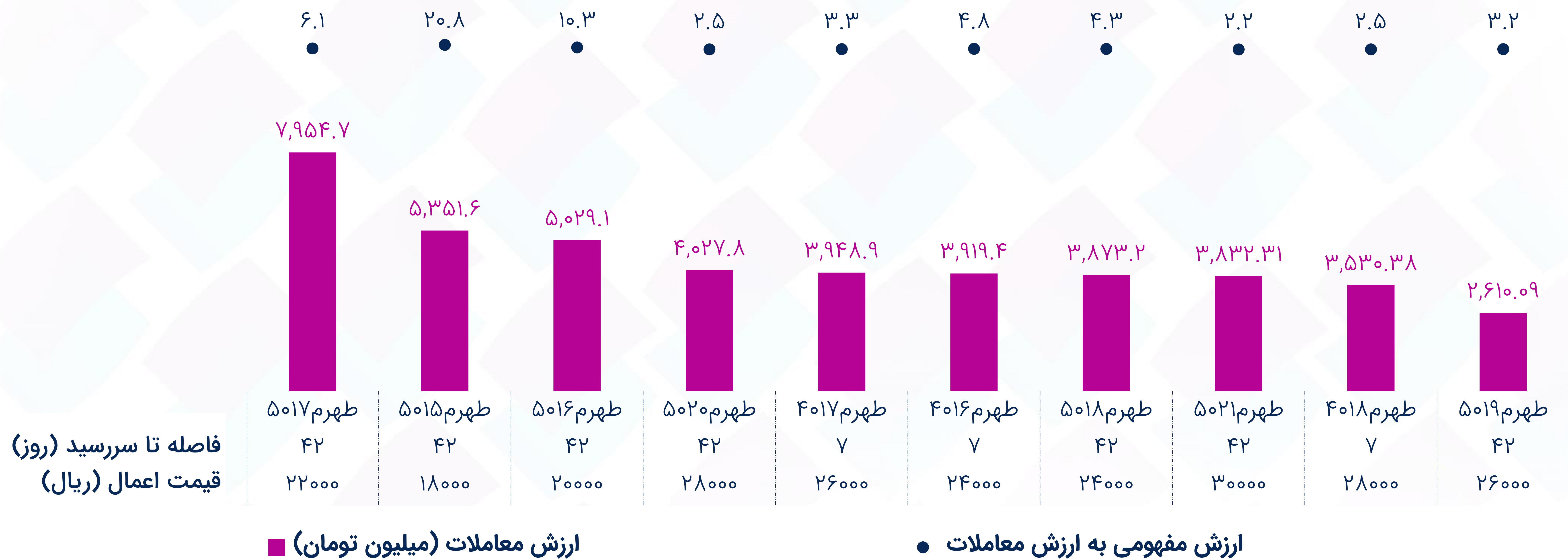
میلیون تومان

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
ضتوان ۴۰۰	توان	۱۹,۰۰۰	۴	۵.۰	۱۹۹	۱۹,۱۵۱	۱۹,۱۹۹	۰.۳%	۹۶.۵	۰.۶۳	۴۲۰	۱۱۱%
ضهرم ۴۰۱۴	اهرم	۲۰,۰۰۰	۷	۲۸۱.۴	۴۱۷	۲۰,۳۸۰	۲۰,۴۱۷	۰.۲%	۴۹.۰	۰.۷۰	۷۵۸	۸۲%
ضشنا ۶۰۲۸	شپنا	۳,۵۰۰	۶۲	۱,۳۳۹.۱	۱۵۳	۳,۴۴۷	۳,۶۵۳	۶.۰%	۲۳.۹	۰.۶۵	۲۷۵	۸۰%
ضفصبا ۷۱۳	فصبا	۲,۶۰۰	۸۱	۲.۷	۹۰	۲,۴۸۷	۲,۶۹۰	۸.۲%	۲۹.۹	۰.۶۳	۱۵۹	۷۶%
ضبساما ۵۰۳	بساما	۸,۰۰۰	۱۸	۳۰.۰	۳۰۰	۸,۳۲۰	۸,۳۰۰	(۰.۲%)	۲۷.۷	۰.۹۵	۴۷۰	۵۷%

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	۷	۱.۱	۵	۲۰,۳۸۰	۳۸,۰۰۵	۸۶%	۷,۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۴۰۰۴	ذوب	۶۰۰	۷	۴.۵	۱	۳۶۵	۶۰۱	۶۵%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۱۱.۴	۱۰	۲۰,۳۸۰	۳۴,۰۱۰	۶۷%	۳,۴۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۷	۱۸.۳	۱۳	۲۰,۳۸۰	۳۰,۰۱۳	۴۷%	۲,۳۰۸.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۵۰۳۸	شستا	۲,۲۰۰	۲۸	۲.۸	۲	۱,۲۱۰	۲,۲۰۲	۸۲%	۱,۱۰۱.۰	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
طسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۴۲	۱۲۹.۰	۲۹	۳۸۸	۳۷۱	(۴.۴%)	۱۲.۸	-۰.۴۳	۳۹	۳۵.۷%
طسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۴۲	۲۳.۷	۵	۳۸۸	۲۹۵	(۲۴.۰%)	۵۹.۰	-۰.۱۱	۶	۲۳.۸%
طستا ۵۰۳۳	شستا	۱,۶۰۰	۲۸	۳.۱	۳۴۱	۱,۲۱۰	۱,۲۵۹	۴.۰%	۳.۷	-۱.۰۰	۳۴۴	۰.۸%
طهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۷	۱.۴	۱۳,۵۰۰	۲۰,۳۸۰	۲۰,۵۰۰	۰.۶%	۱.۵	-۱.۰۰	۱۳,۳۳۵	(۱.۲%)
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۷	۸۹.۲	۲۱,۷۶۵	۲۰,۳۸۰	۲۰,۲۳۵	(۰.۷%)	۰.۹	-۱.۰۰	۲۱,۲۶۷	(۲.۳%)

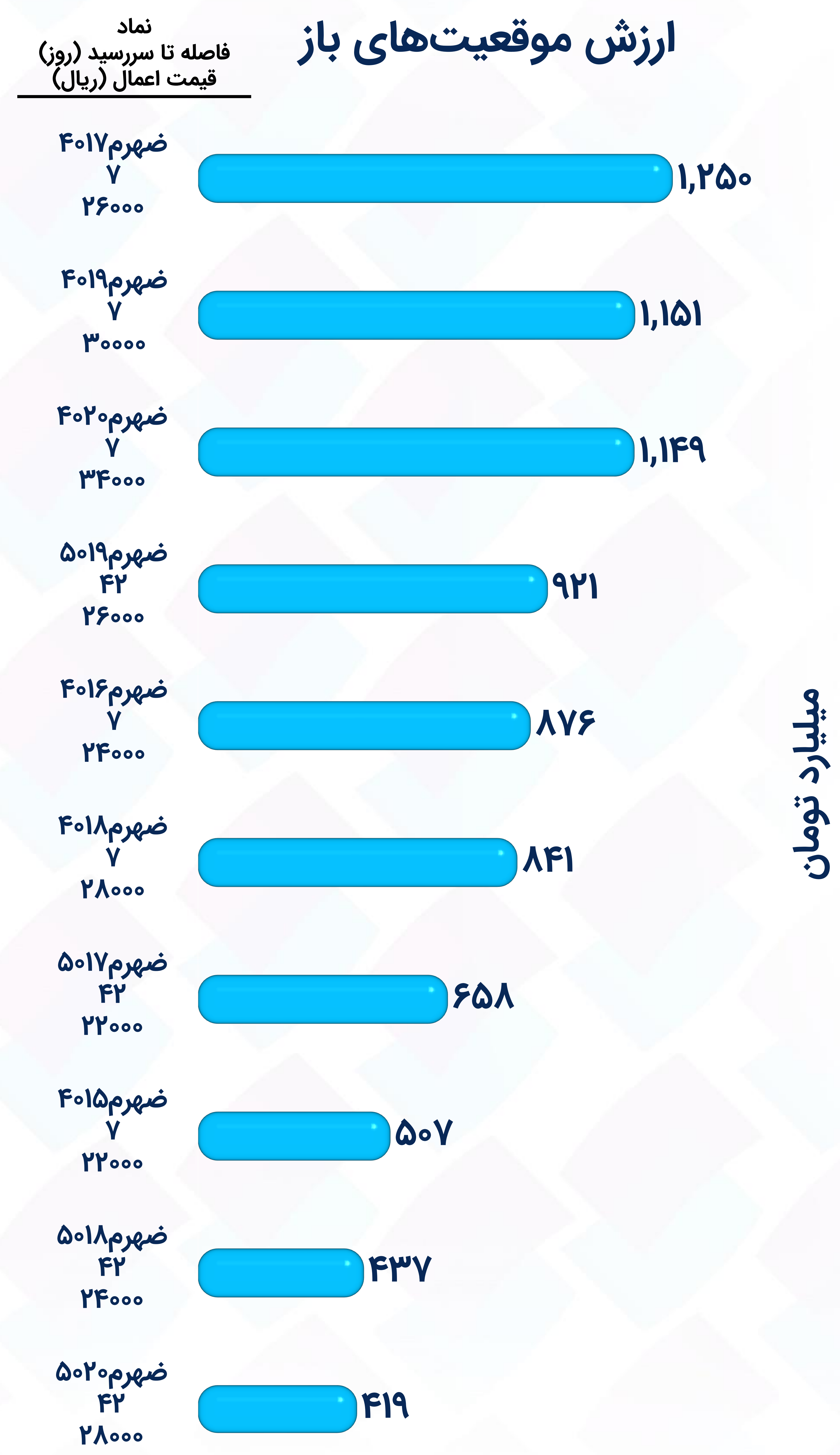
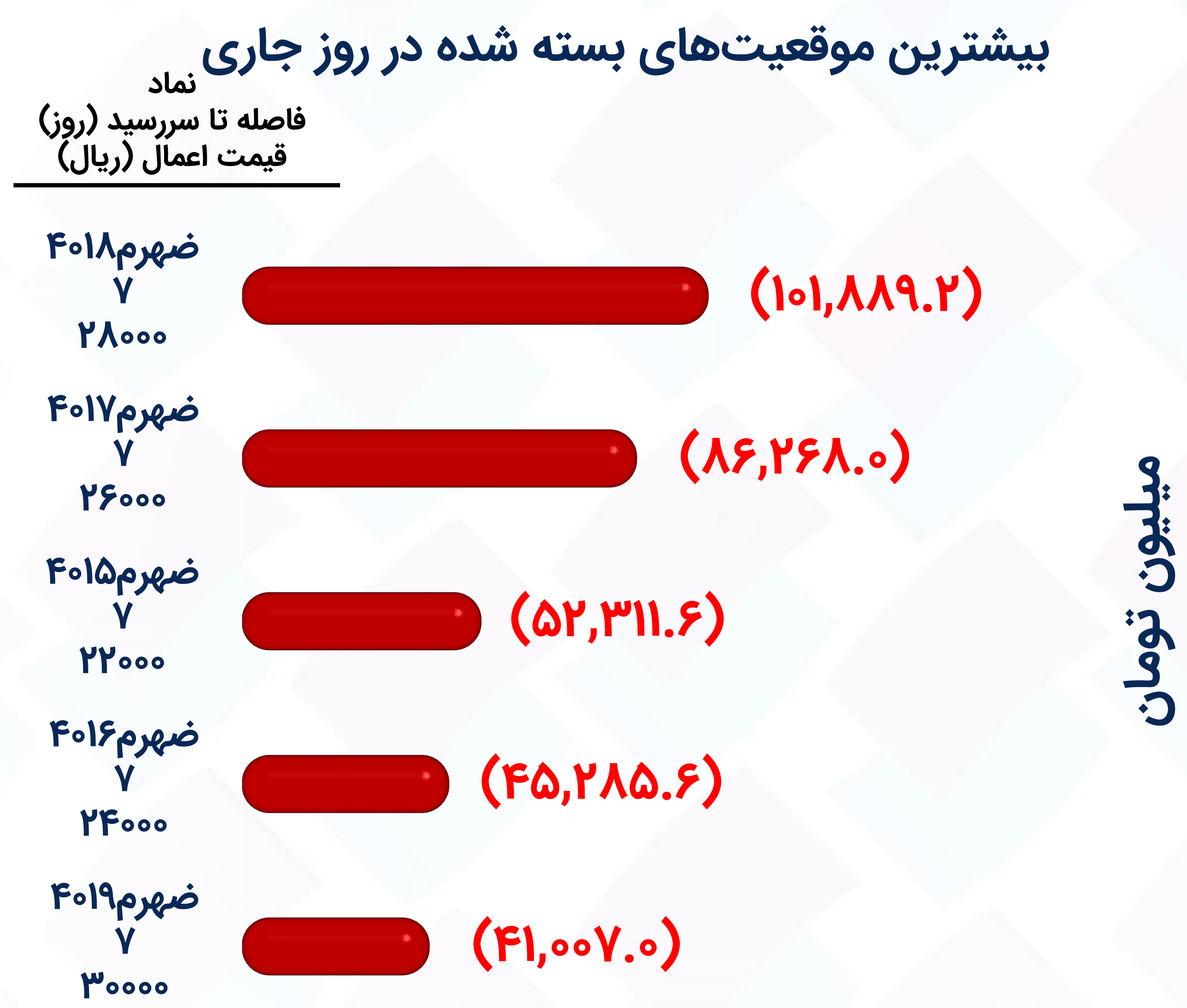
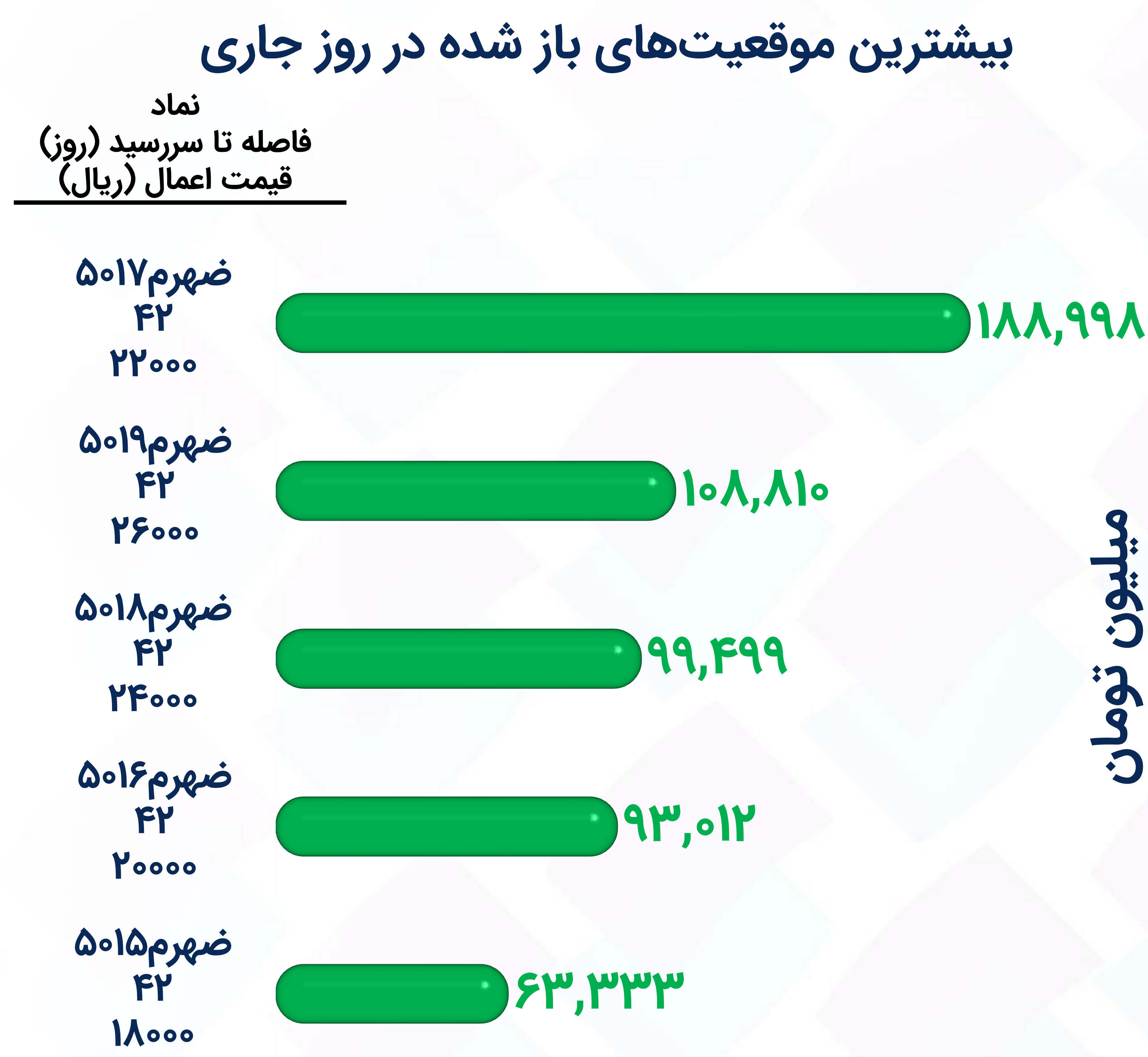
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۷	۰.۵	۱	۳۶۵	۱۹۹	(۴۵.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۳۵	۴.۹	۳	۵۵۸	۱۹۷	(۶۴.۷%)	۶۵.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۷	۱۲.۷	۵	۲۰,۳۸۰	۱۵,۹۹۵	(۲۱.۵%)	۳,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۴۲	۴۸.۶	۱۶۸	۲۰,۳۸۰	۱۴,۸۳۲	(۲۷.۲%)	۸۸.۳	۰.۰۰	۱	(۹۹.۳%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۴۲	۱,۷۳۷.۹	۳۶۵	۲۰,۳۸۰	۱۵,۶۳۵	(۲۳.۳%)	۴۲.۸	-۰.۰۱	۷	(۹۸.۱%)

(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

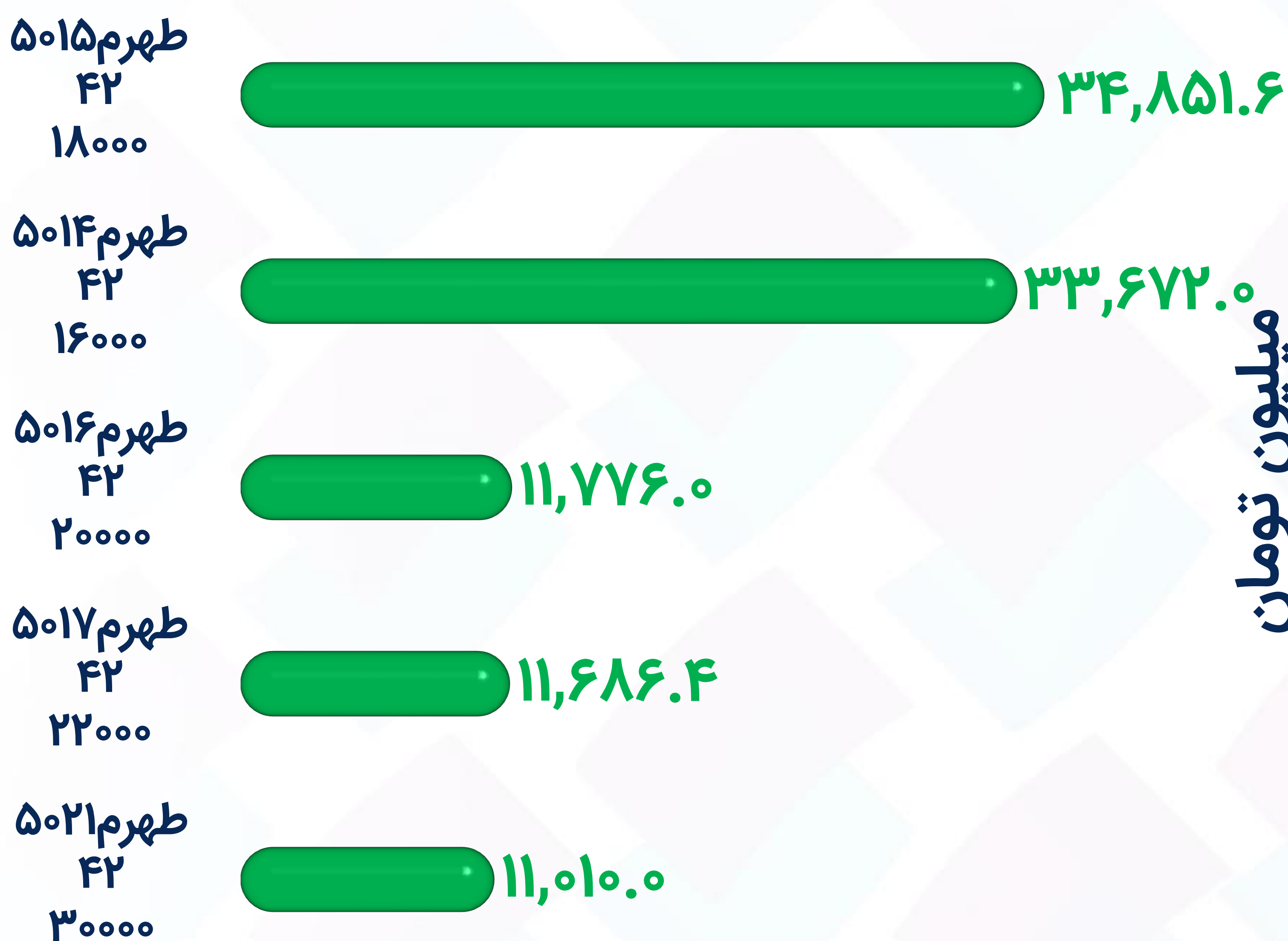
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

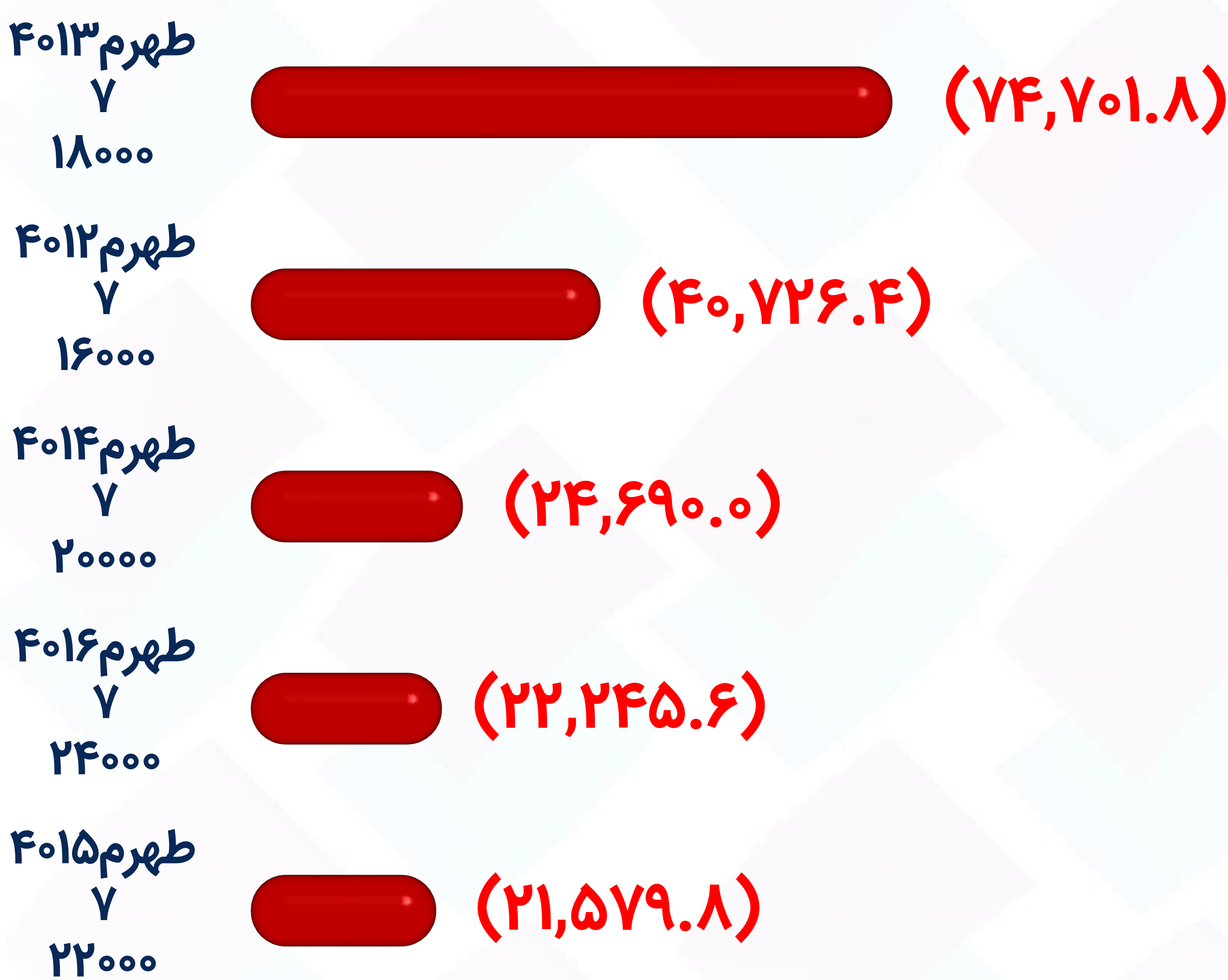
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

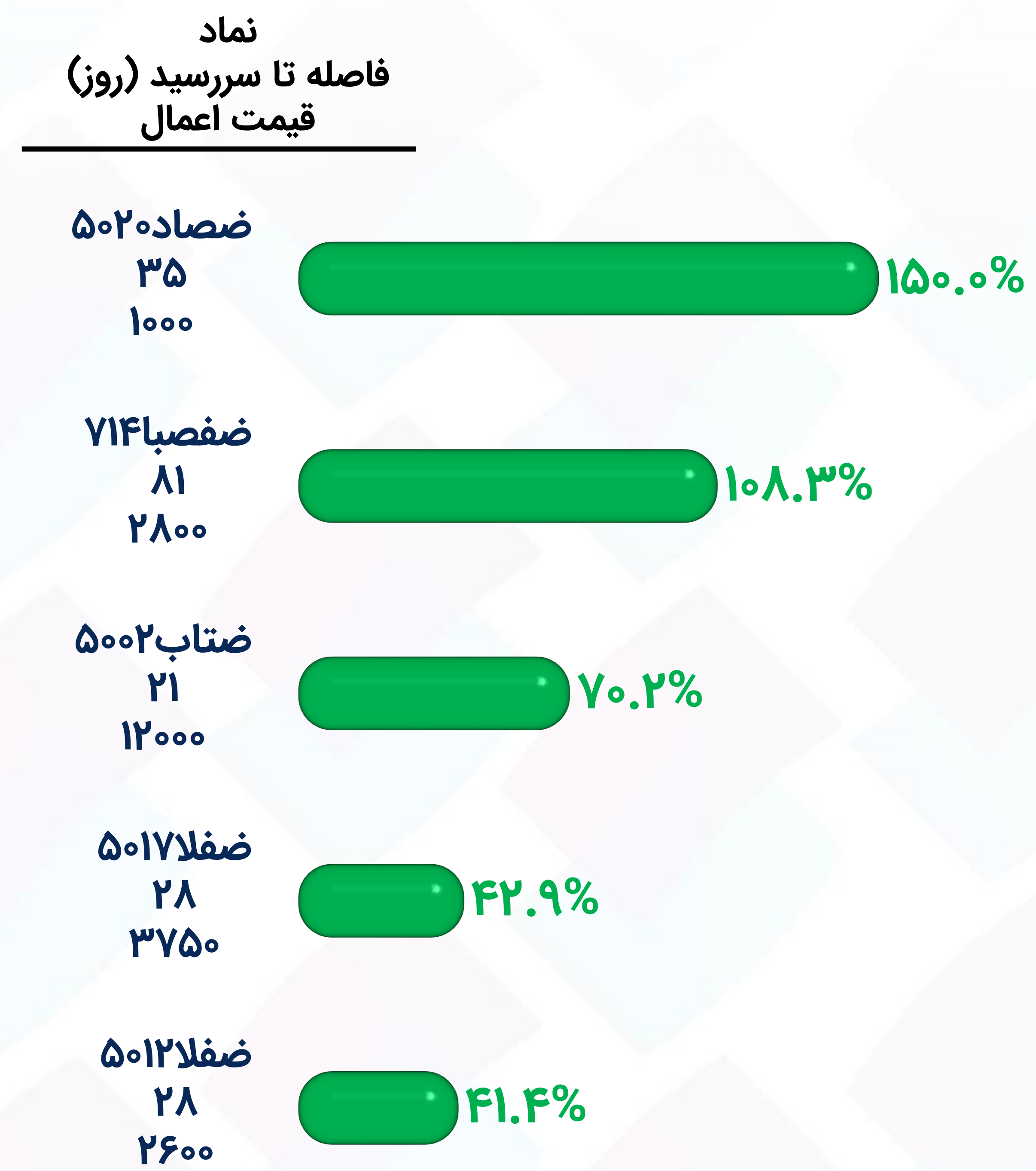
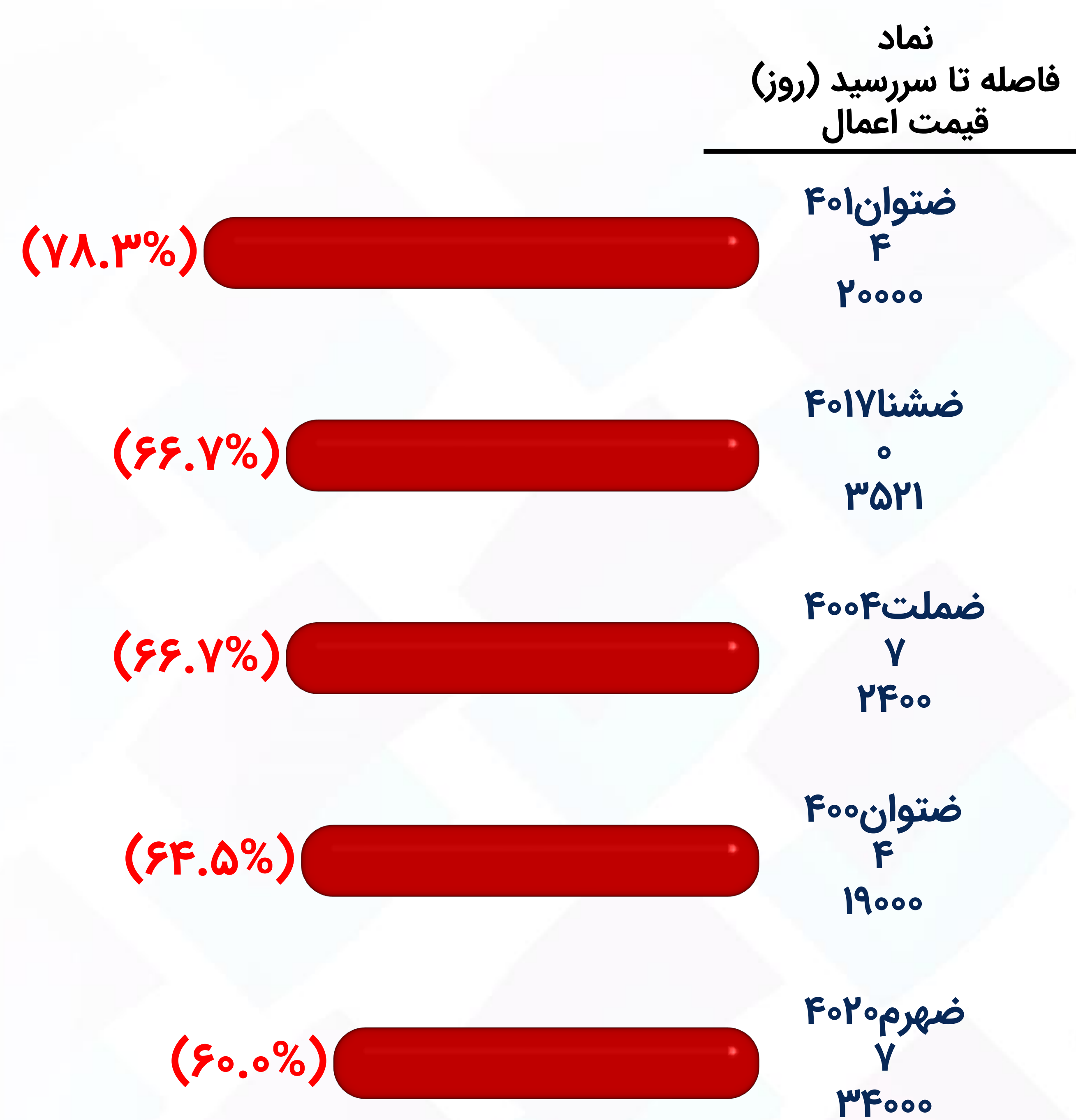
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



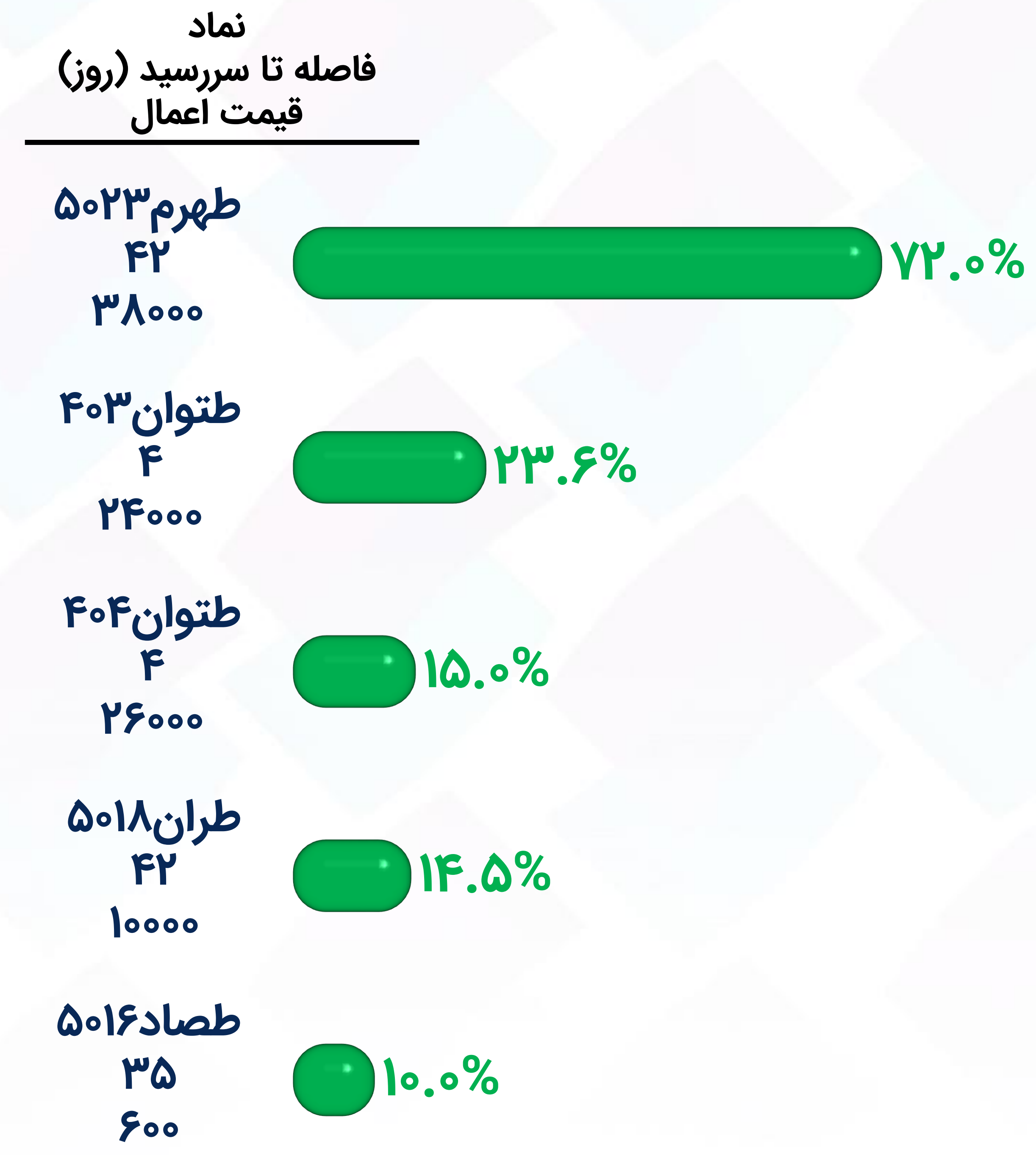
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

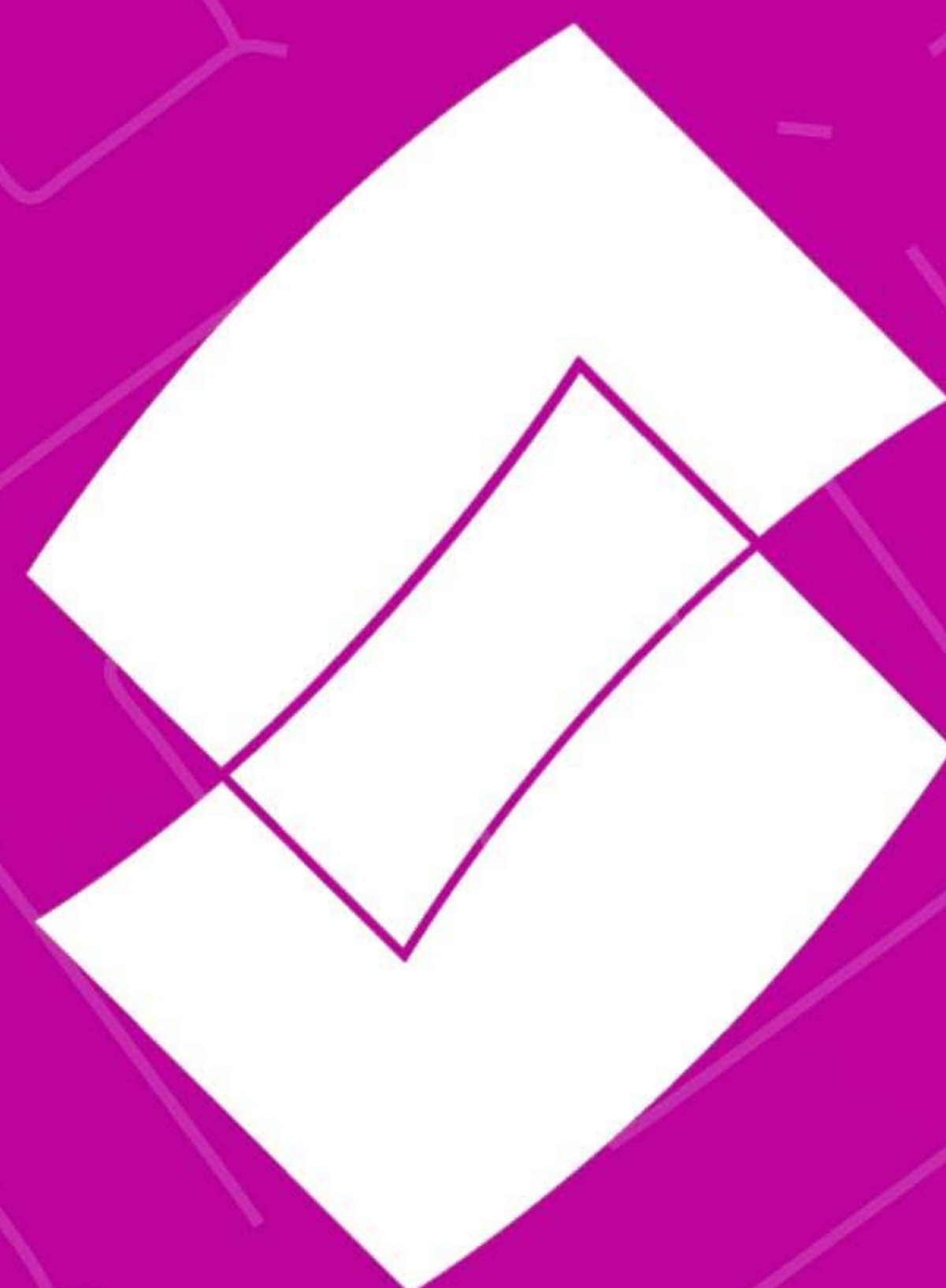
اختیار خرید



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.