

شماره
۵۰۶

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۱ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

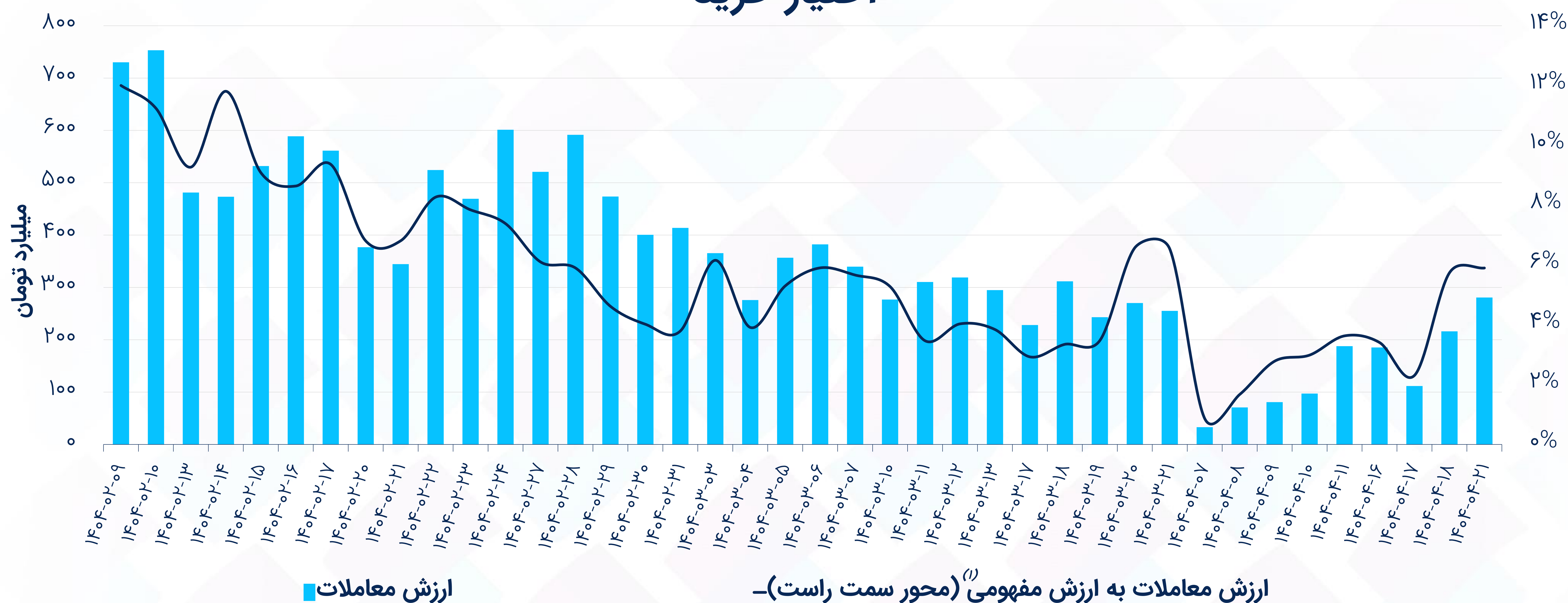




اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



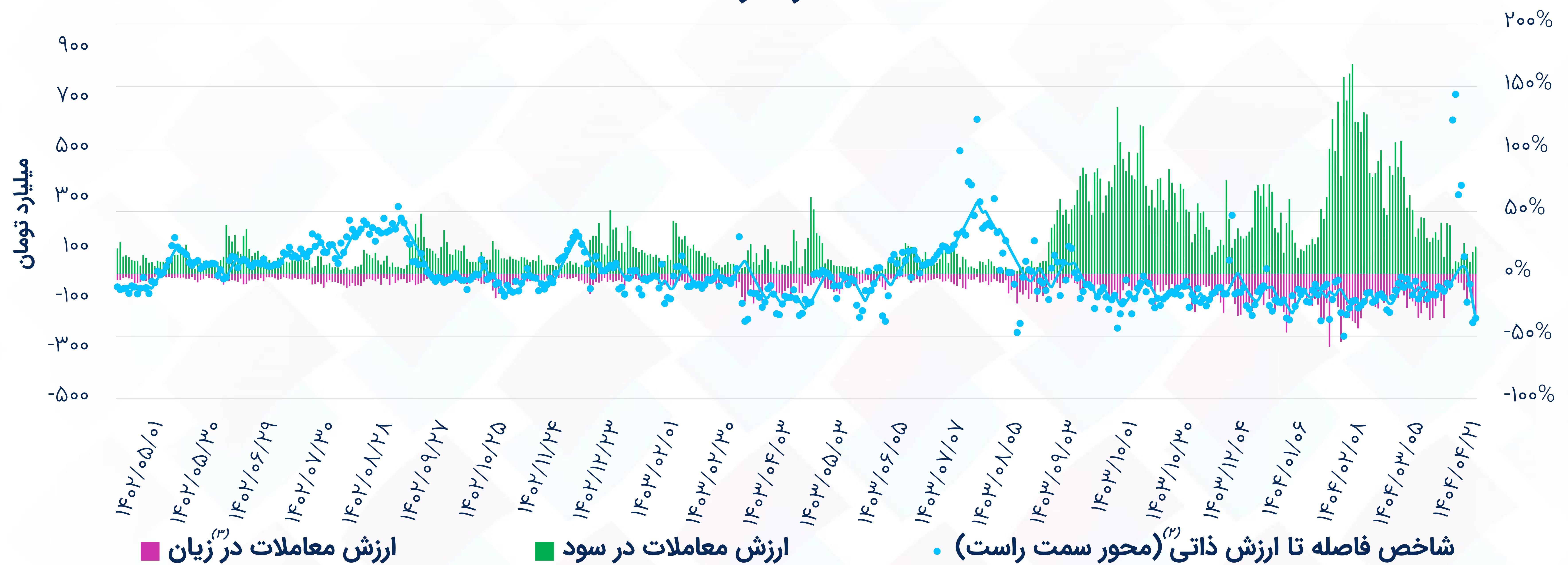
اختیار فروش



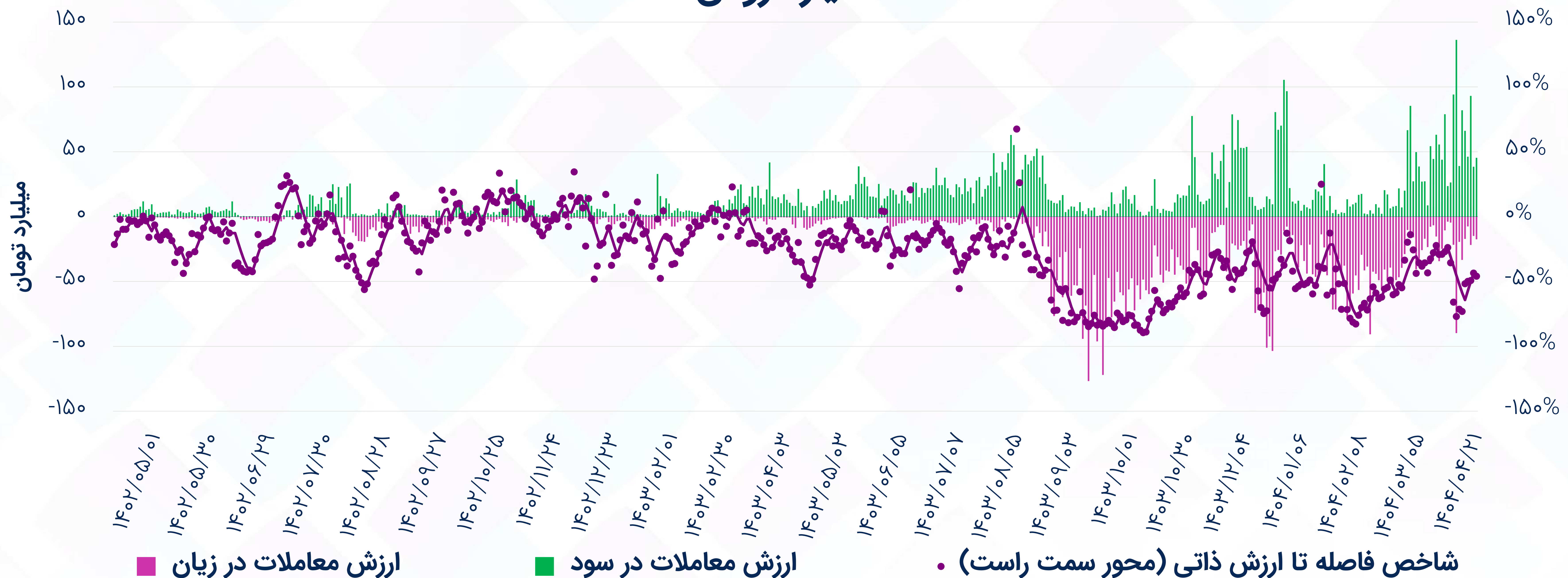
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

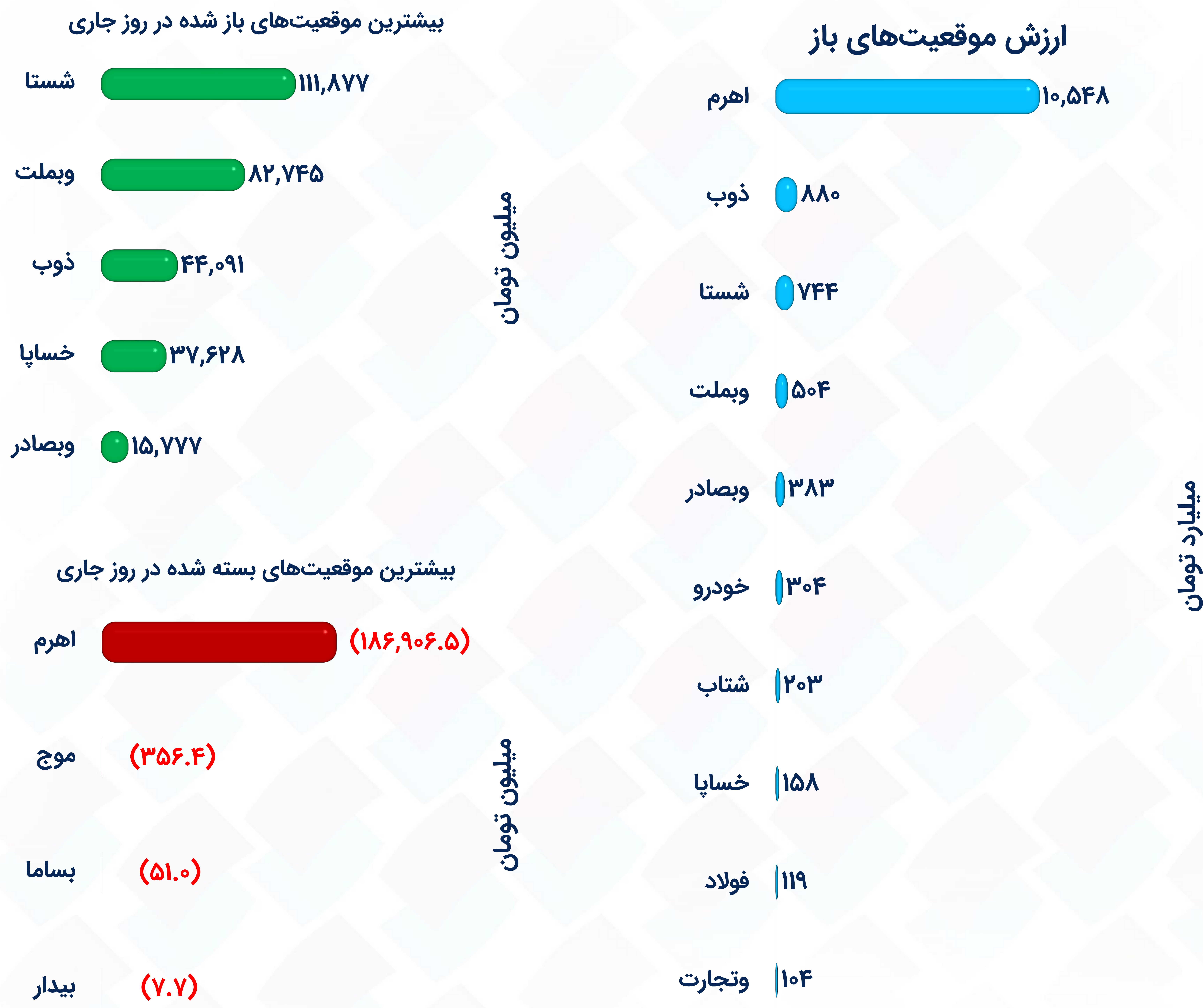
اختیار خرید

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	۲۴۳.۴	۴,۰۰۸.۱	۸۷.۹	۱۵۵.۵	(۳۹.۵%)
شستا	۲۵	۱۰.۷	۲۸۵.۳	۴.۹	۵.۸	(۲۵.۱%)
خسپا	۱۴	۹.۷	۷۳.۳	۵.۹	۳.۸	۱۷.۱%
وبملت	۲۹	۷.۸	۱۵۶.۵	۵.۸	۲.۰	(۷.۷%)
دوب	۲۴	۳.۶	۱۲۲.۵	۱.۱	۲.۵	(۳۵.۲%)
وتجارت	۷	۲.۳	۲۷.۰	۰.۹	۱.۴	(۳۷.۰%)
وبصادر	۱۲	۱.۳	۲۹.۳	۰.۶	۰.۸	(۳۴.۶%)

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	۲۵	۶۰,۷۳۵.۸	۷۲۷,۸۹۰.۹	۴۴,۲۳۰.۸	۱۶,۵۰۵.۰	(۴۶.۲%)
شستا	۸	۱,۳۴۴.۶	۴۵,۴۰۴.۳	۶۰۹.۳	۷۳۵.۳	(۴۸.۲%)
خسپا	۲	۱۷۵.۶	۳,۱۴۳.۲	۱۶۹.۱	۶.۵	۲۷.۷%
خودران	۴	۹۴.۵	۶۰۲.۶	۹۴.۵	۰.۰	(۲۱.۰%)
وبصادر	۲	۵۷.۹	۸۸۶.۳	۵۷.۸	۰.۱	(۳۲.۰%)
وبملت	۳	۵۲.۴	۱,۴۱۷.۸	۰.۰	۵۲.۴	(۷۴.۸%)
توان	۳	۴۶.۹	۳۷۵.۶	۳۸.۹	۸.۰	(۷.۹%)

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 ۱,۷۵۹

شستا ۵۸

توان ۵

خسپا ۵

وبصادر ۳

وبملت ۲

خودرو ۲

خودران ۱.۹۵

فولاد ۱.۶۹

ذوب ۱.۵۳

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

شستا ۱۳,۵۷۰.۸

خسپا ۱,۸۷۰.۸

وبملت ۱,۲۳۲.۷

وبصادر ۸۸۴.۳

خودران ۴۷۰.۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

اهرم (۵,۷۲۰.۷)

فولاد (۱۱۹.۷)

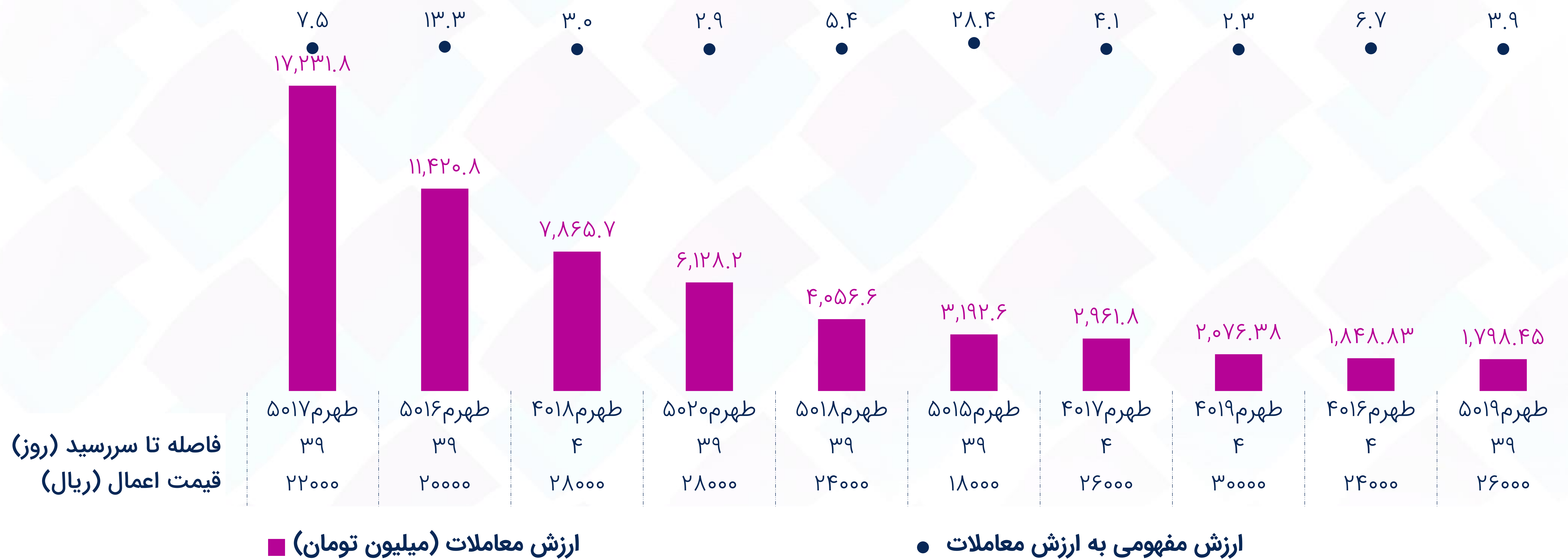
میلیون تومان

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
ضسپا ۵۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۳۹	۲۹۱.۳	۷	۳۹۹	۵۰۷	۲۷.۱%	۷۲.۴	۰.۲۹	۱۷	۱۴۶%
ضفصبا ۷۱۳	فصبا	۲,۶۰۰	۷۸	۲۰.۷	۷۷	۲,۵۱۶	۲,۶۷۷	۶.۴%	۳۴.۸	۰.۶۶	۱۷۵	۱۲۷%
ضمخا ۵۰۰۴	اخابر	۶۶۰	۳۲	۱۵.۰	۶	۵۷۲	۶۶۶	۱۶.۴%	۱۱۱.۰	۰.۲۳	۱۰	۶۳%
ضشنا ۶۰۲۸	شنا	۳,۵۰۰	۵۹	۴۸۸.۳	۲۲۱	۳,۵۴۶	۳,۷۲۱	۴.۹%	۱۶.۸	۰.۷۲	۳۳۸	۵۳%
ضمخا ۵۰۰۳	اخابر	۵۶۰	۳۲	۲.۸	۳۴	۵۷۲	۵۹۴	۳.۸%	۱۷.۵	۰.۶۹	۴۸	۴۲%

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	۴	۲.۸	۴	۲۰,۹۵۰	۴۲,۰۰۴	۱۰۰%	۱۰,۵۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۴	۱.۹	۲	۲۰,۹۵۰	۳۸,۰۰۲	۸۱%	۱۹,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۳۸.۸	۶	۲۰,۹۵۰	۳۴,۰۰۶	۶۲%	۵,۶۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۵۰۱۷	ذوب	۹۰۰	۳۲	۲.۵	۴	۳۷۴	۹۰۴	۱۴۲%	۲۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۴	۷۵.۳	۹	۲۰,۹۵۰	۳۰,۰۰۹	۴۳%	۳,۳۳۴.۳	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	۳۹	۱۶۹.۱	۲۷	۳۹۹	۳۷۳	(۶.۵%)	۱۳.۸	-۰.۳۹	۳۵	۲۷.۹%
طسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۹	۶.۵	۴	۳۹۹	۲۹۶	(۲۵.۸%)	۷۴.۰	-۰.۰۹	۵	۲۲.۴%
طهرم ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۴	۳۴.۰	۱۱,۳۳۷	۲۰,۹۵۰	۲۲,۶۶۳	۸.۲%	۲.۰	-۱.۰۰	۱۲,۸۱۳	۱۳.۰%
طهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۴	۶۴.۹	۱۵,۰۹۳	۲۰,۹۵۰	۲۲,۹۰۷	۹.۳%	۱.۵	-۱.۰۰	۱۶,۷۸۵	۱۱.۲%
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۴	۱۳.۳	۱۹,۰۰۰	۲۰,۹۵۰	۲۳,۰۰۰	۹.۸%	۱.۲	-۱.۰۰	۲۰,۷۵۷	۹.۲%

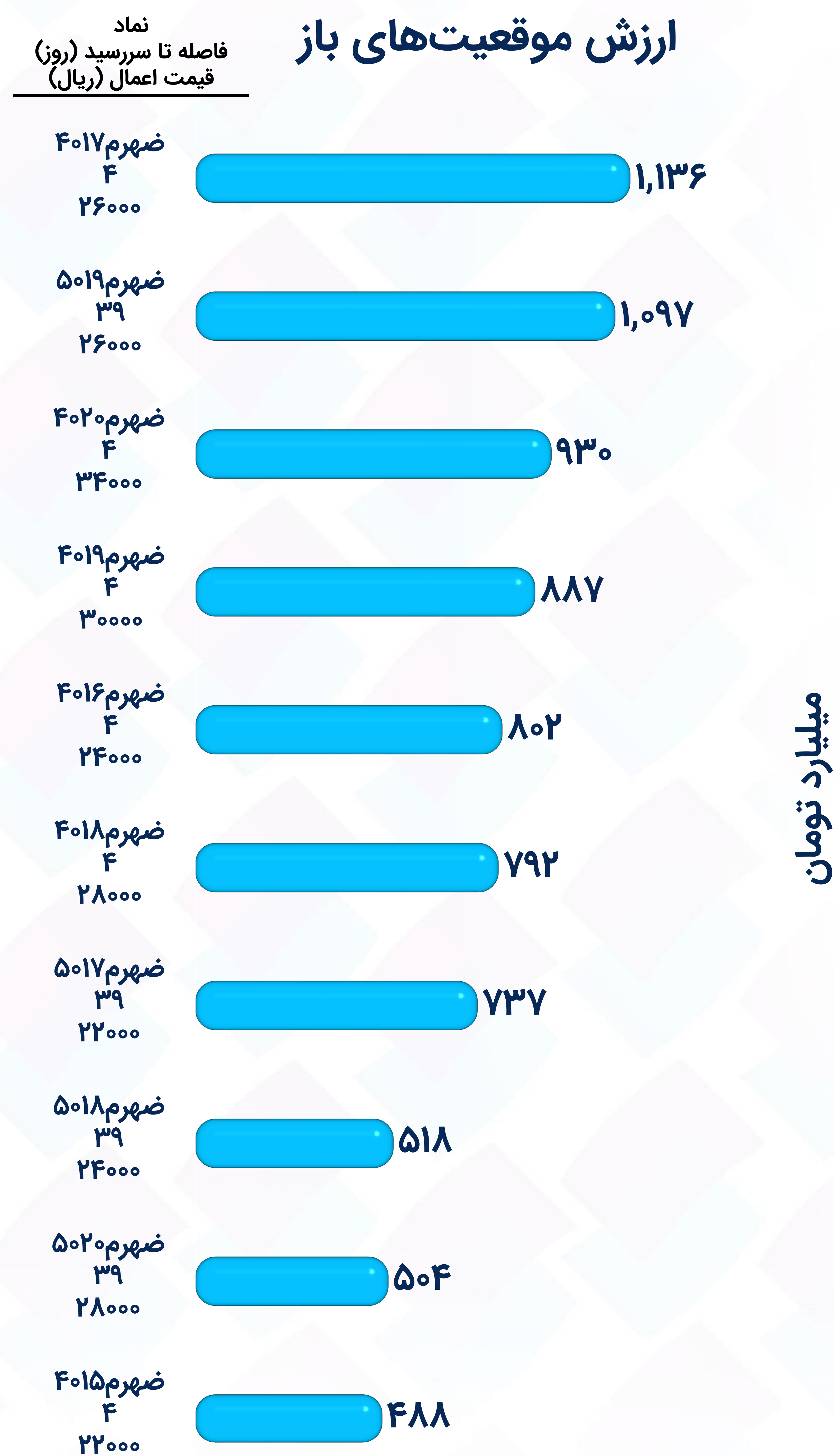
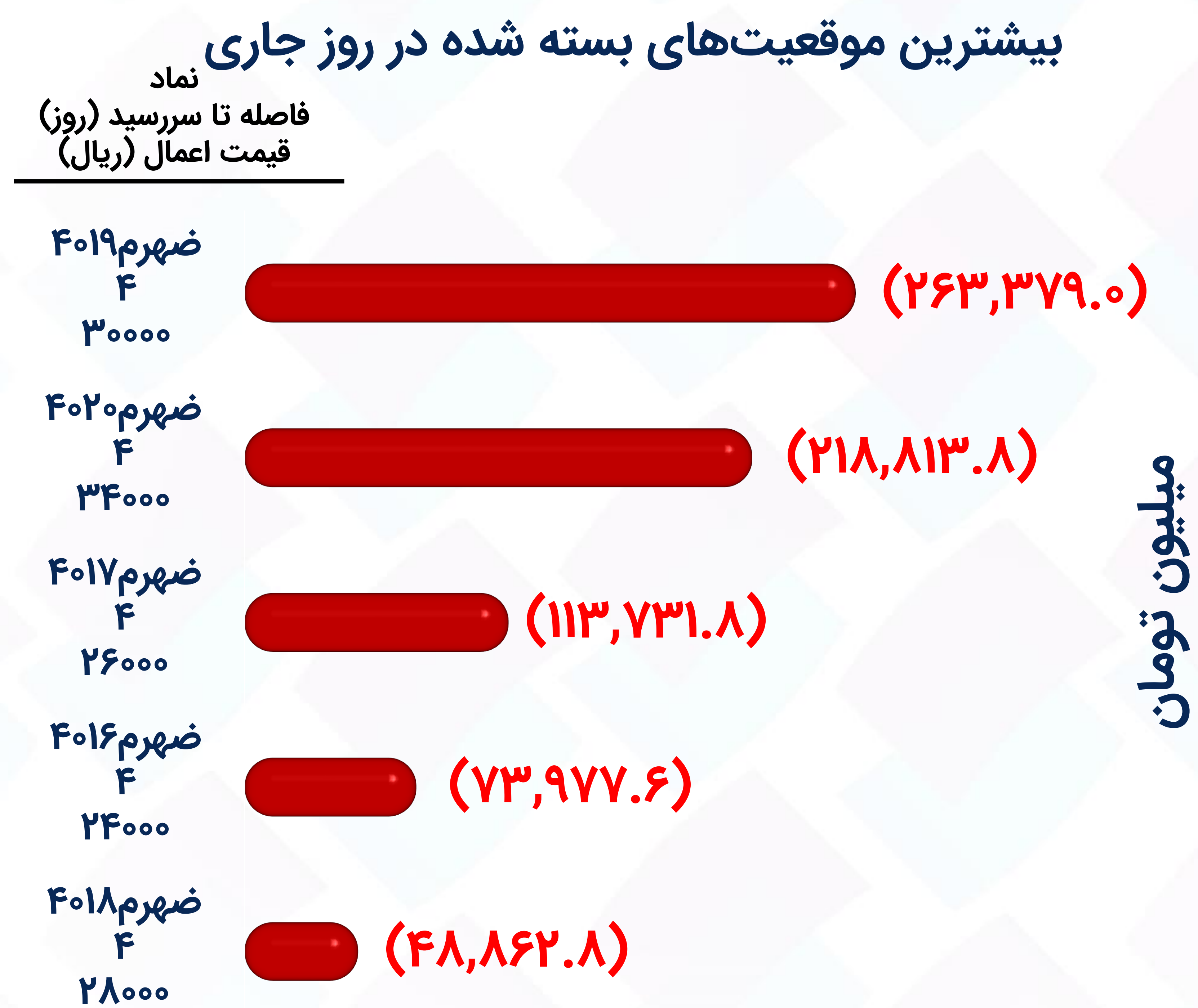
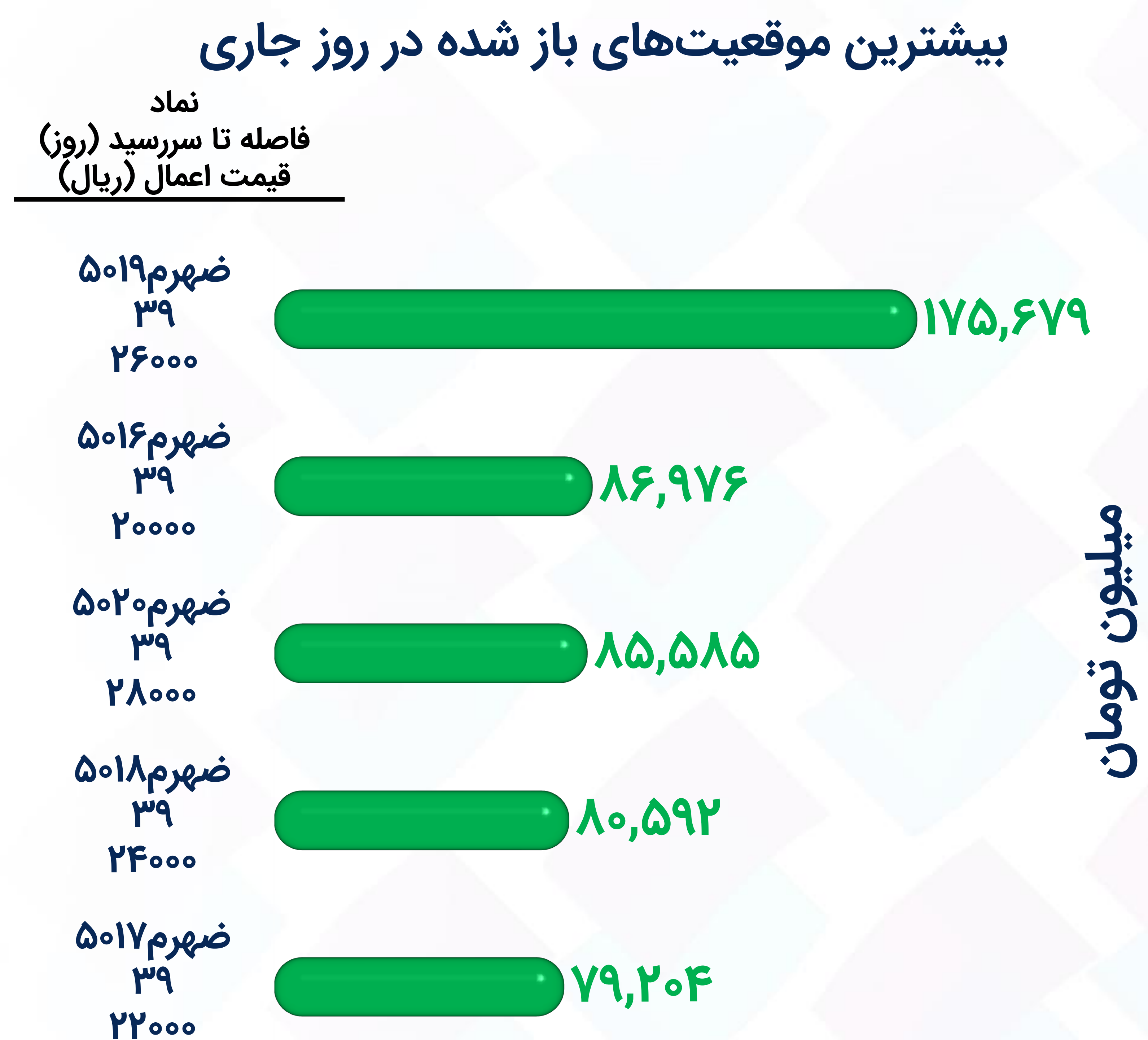
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۳۲	۰.۱	۱	۵۷۴	۱۹۹	(۶۵.۳%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۴	۰.۰	۱	۲۰,۹۵۰	۱۴,۹۹۹	(۲۸.۴%)	۱۴,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۴	۰.۲	۵	۲۰,۹۵۰	۱۵,۹۹۵	(۲۳.۷%)	۳,۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۹	۱۰۳.۱	۱۵۲	۲۰,۹۵۰	۱۴,۸۴۸	(۲۹.۱%)	۹۷.۷	۰.۰۰	۱	(۹۹.۷%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۴	۸۶.۲	۲۱	۲۰,۹۵۰	۱۷,۹۷۹	(۱۴.۲%)	۸۵۶.۱	۰.۰۰	۰	(۹۹.۳%)

(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

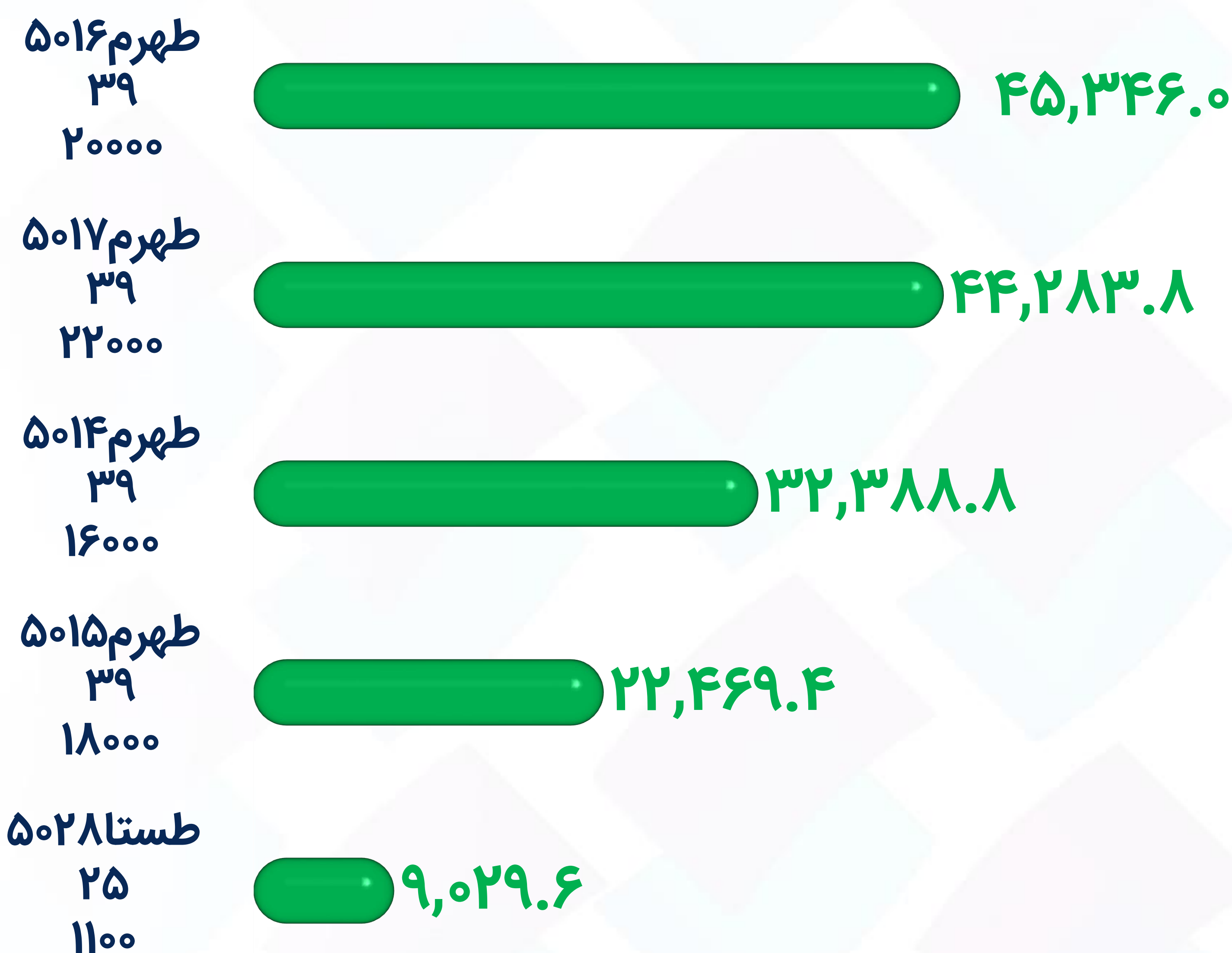
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

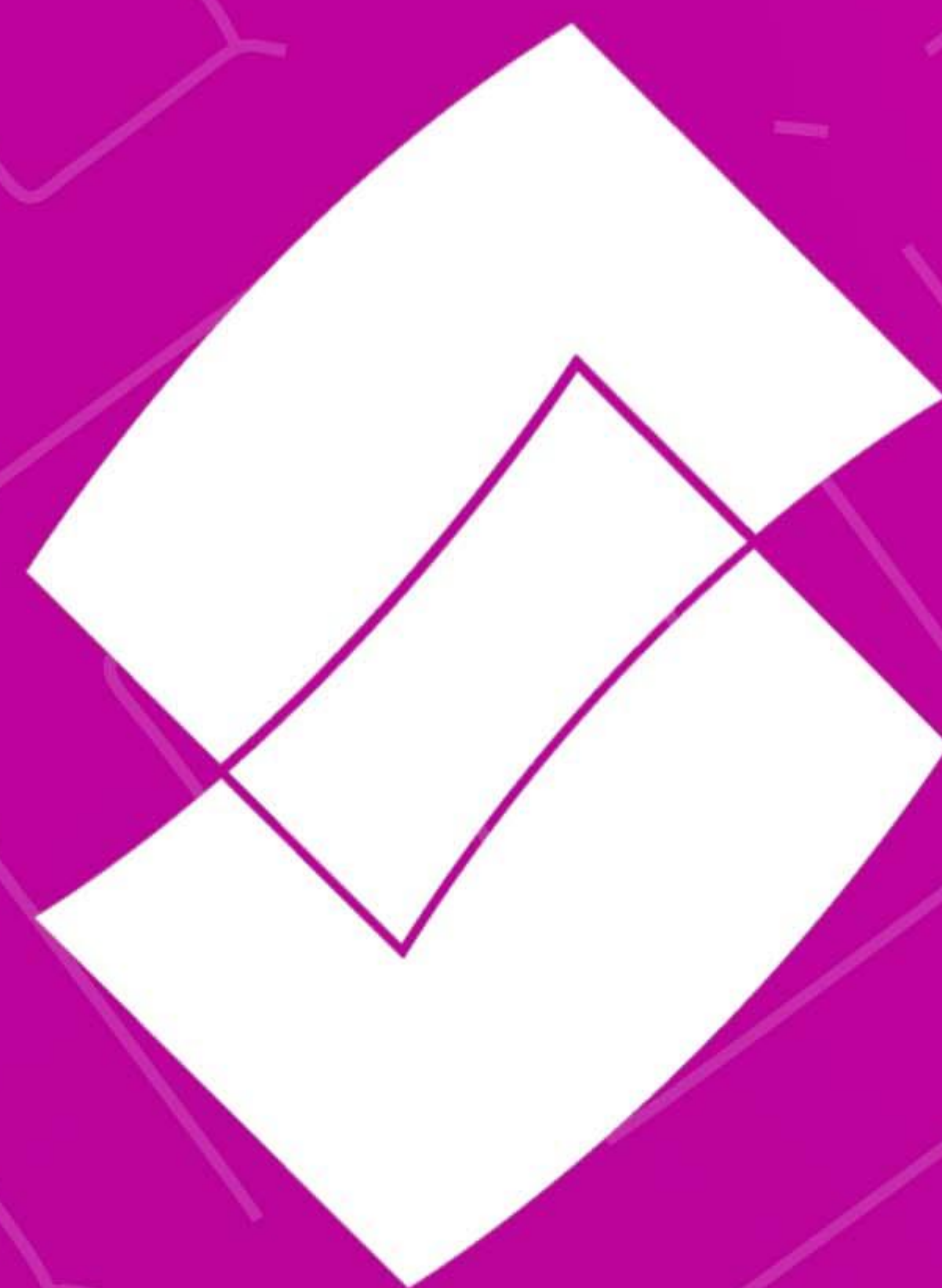
اختیار خرید



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.