

شماره
۵۰۷

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۲ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

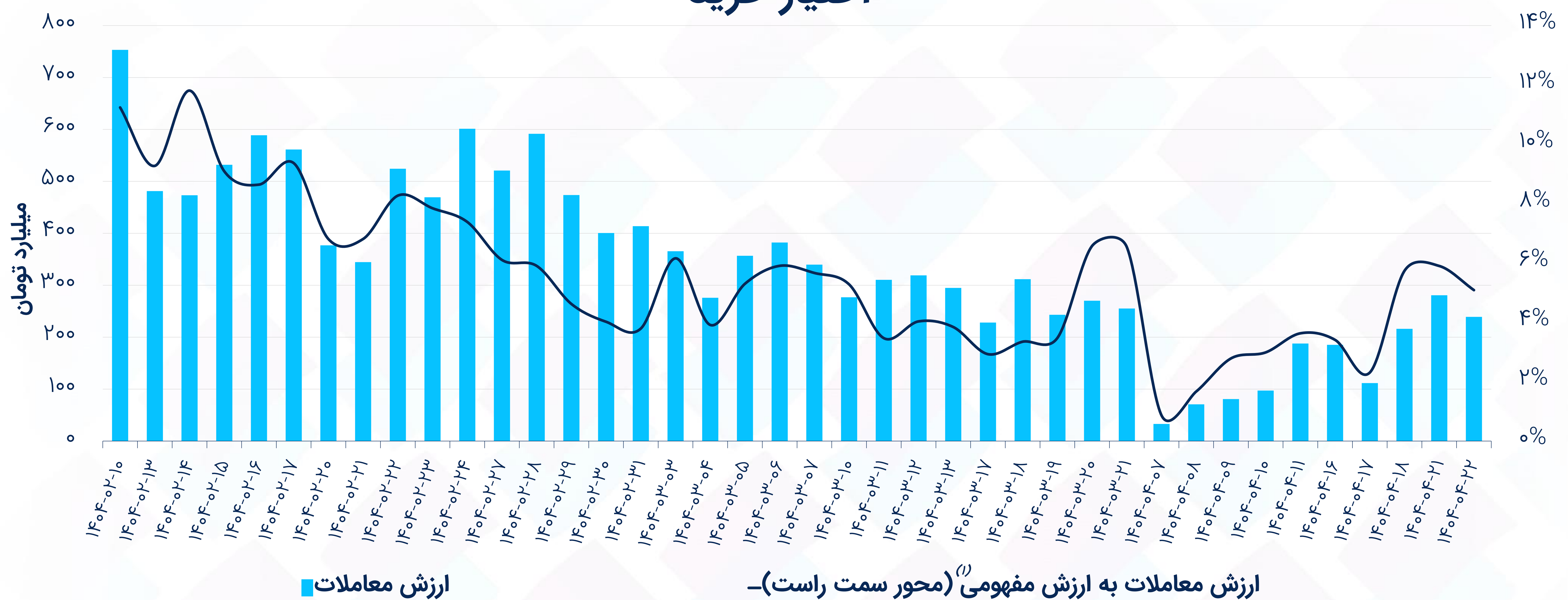




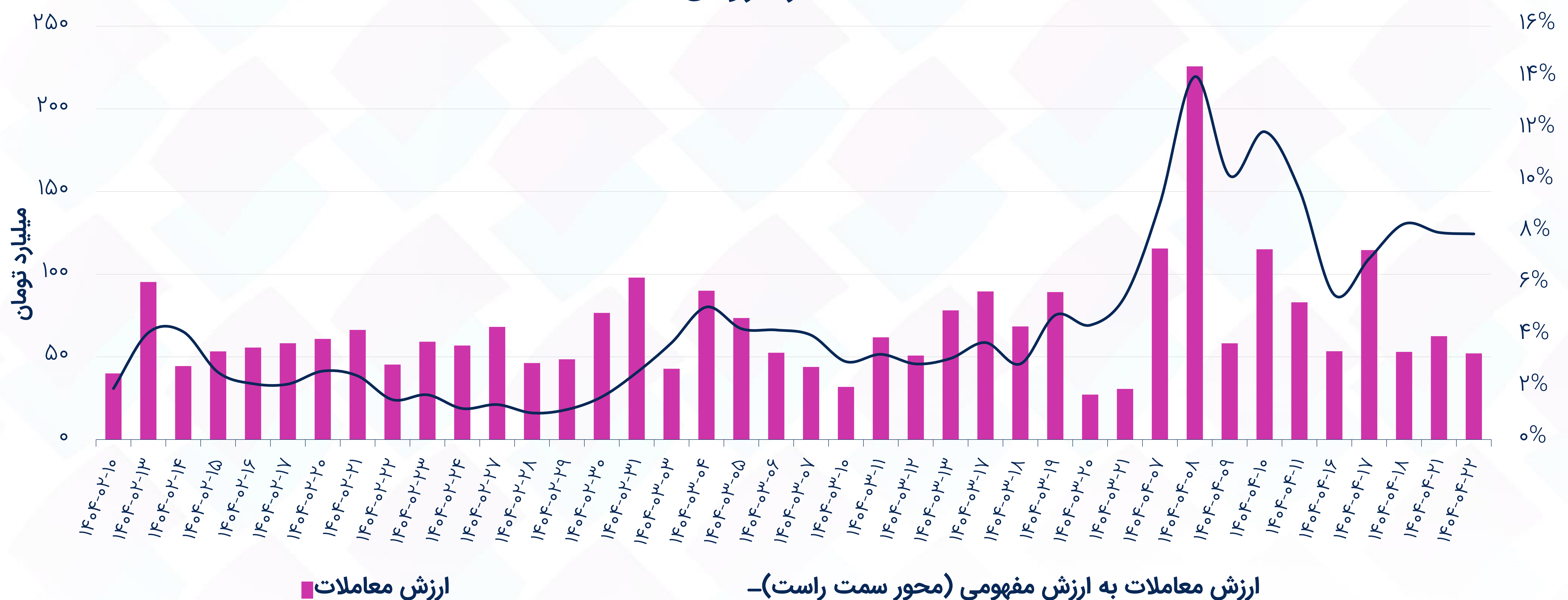
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



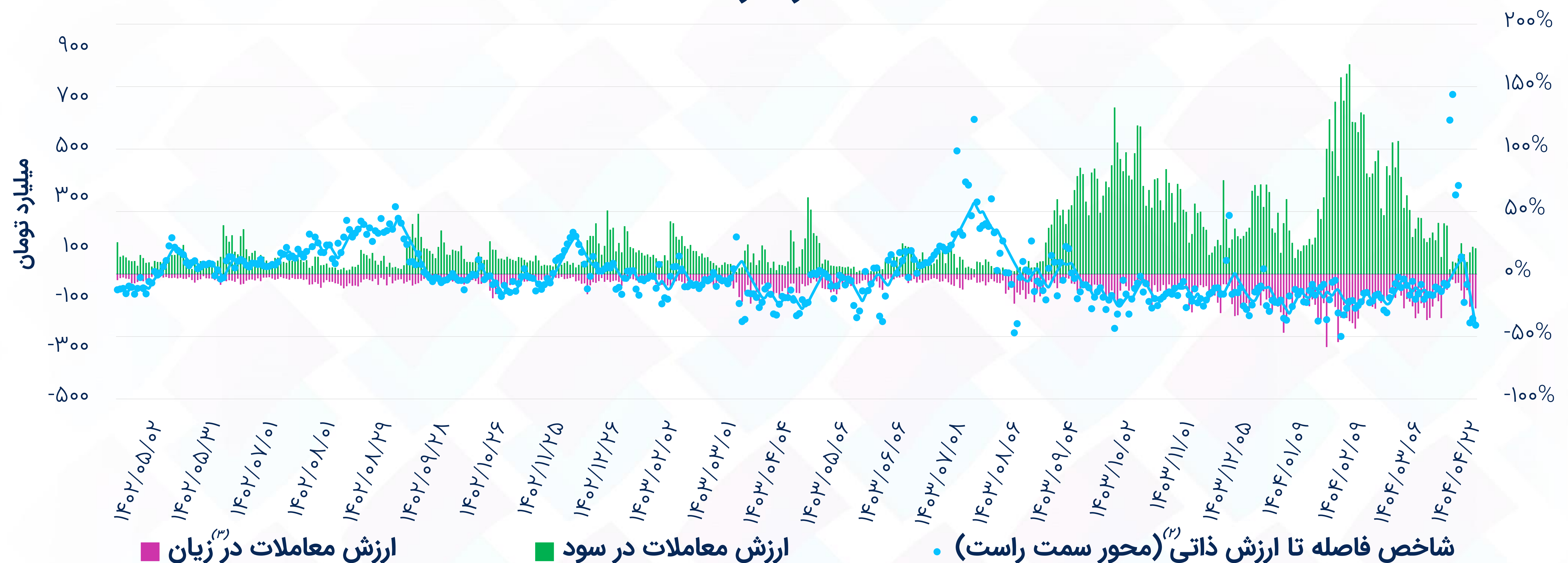
اختیار فروش



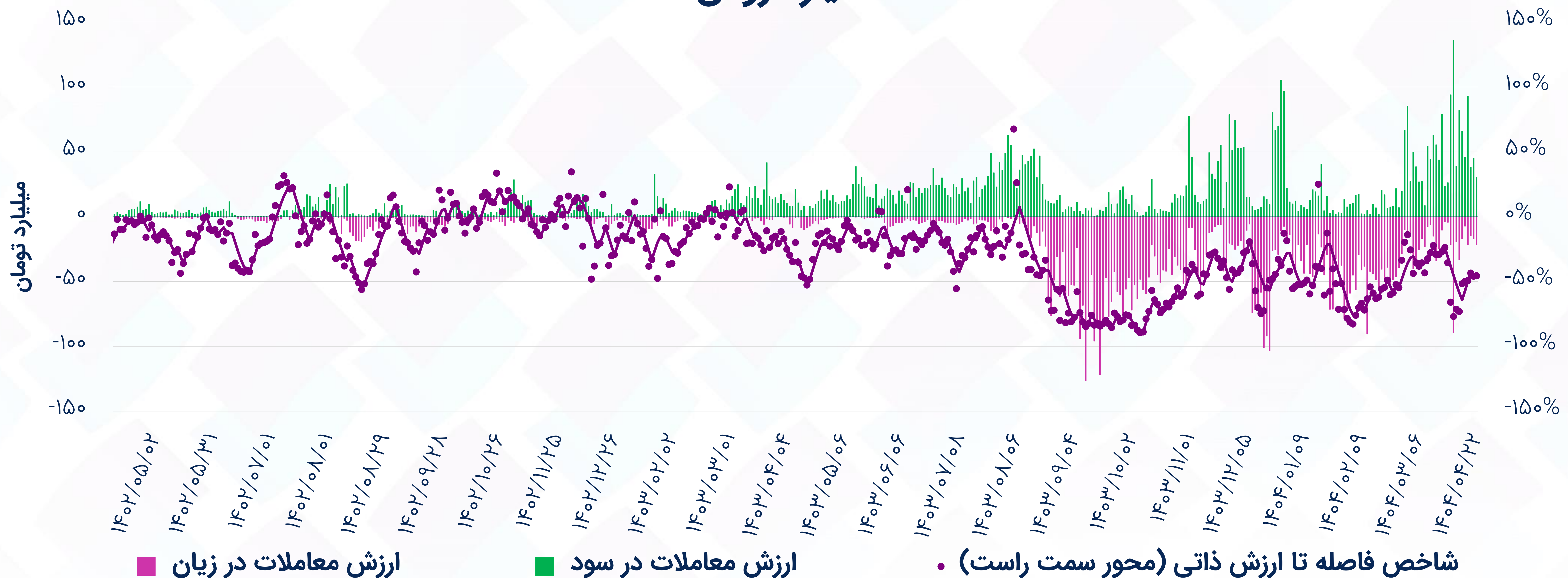
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

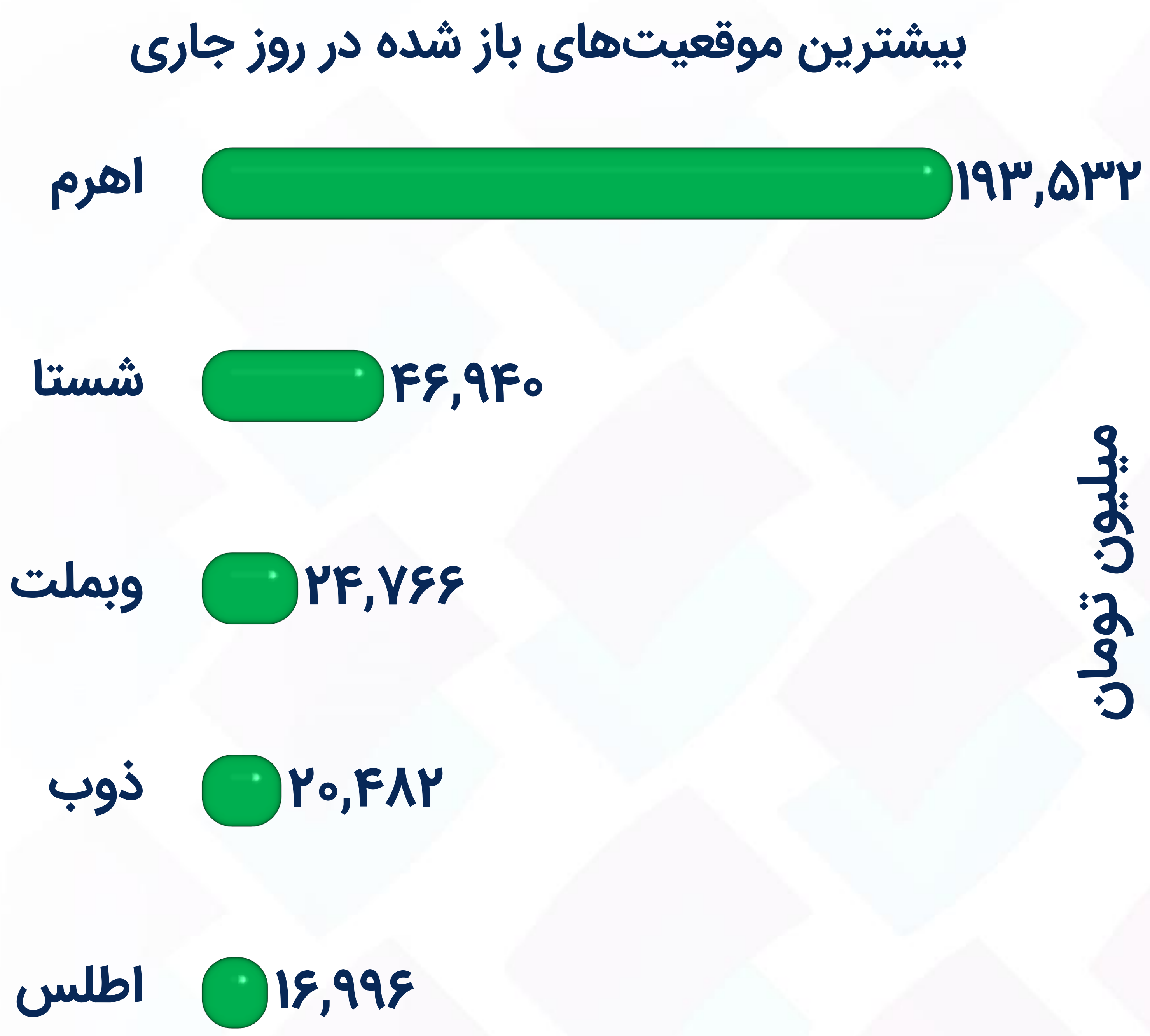
اختیار خرید

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	۲۱۴.۲	۴,۰۹۹.۷	۸۶.۵	۱۲۷.۷	(۴۶.۶%)
شستا	۲۶	۸.۱	۲۹۲.۷	۳.۸	۴.۴	۵.۲%
وبملت	۲۴	۵.۵	۱۰۷.۸	۴.۳	۱.۲	۱۴.۷%
خسپا	۱۱	۳.۸	۳۷.۴	۳.۷	۰.۱	۴۱.۶%
دوب	۲۲	۱.۸	۴۵.۸	۰.۶	۱.۲	(۳۵.۱%)
وتجارت	۷	۱.۵	۱۸.۸	۰.۹	۰.۶	(۱۷.۸%)
وبصادر	۱۰	۱.۱	۲۵.۹	۰.۴	۰.۷	(۲۲.۳%)

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	۵۰,۲۳۳.۸	۵۹۶,۳۲۸.۵	۲۹,۷۱۶.۲	۲۰,۵۱۷.۶	(۴۵.۳%)
شستا	۷	۱,۶۰۰.۹	۵۳,۸۹۷.۰	۳۹۷.۱	۱,۲۰۳.۸	(۶۰.۶%)
خسپا	۲	۱۰۰.۰	۲,۳۹۸.۶	۰.۰	۱۰۰.۰	۲۶.۷%
توان	۳	۸۷.۵	۴۳۱.۹	۸۷.۵	۰.۰	(۲.۶%)
خودران	۴	۳۶.۶	۳۱۱.۶	۳۶.۵	۰.۱	(۲۱.۵%)
وبملت	۸	۳۵.۱	۷۷۴.۹	۱۴.۴	۲۰.۶	(۶۰.۷%)
وبصادر	۱	۲۱.۷	۳۲۴.۴	۲۱.۷	۰.۰	(۴۲.۳%)

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



میلیون تومان



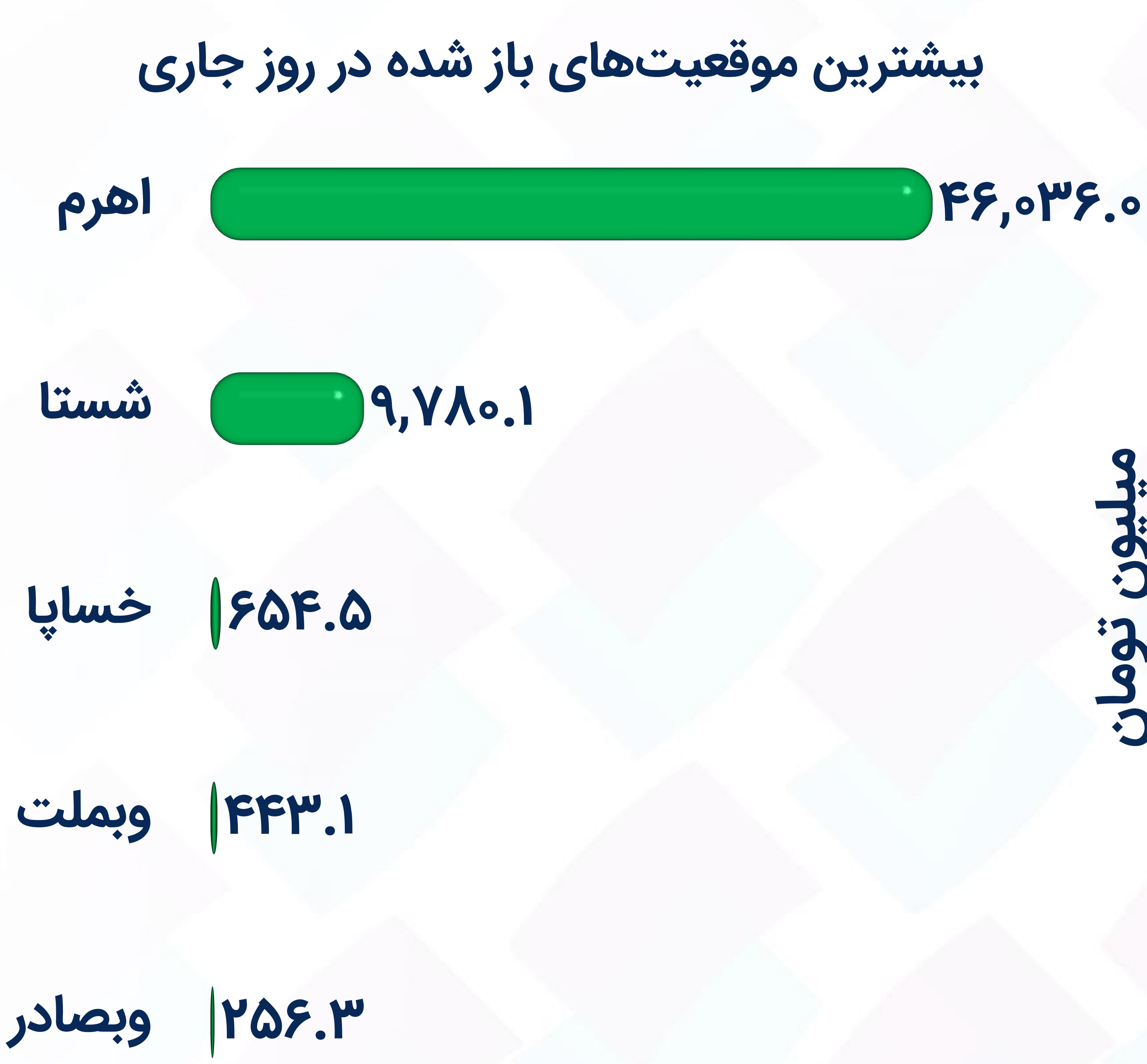
میلیون تومان



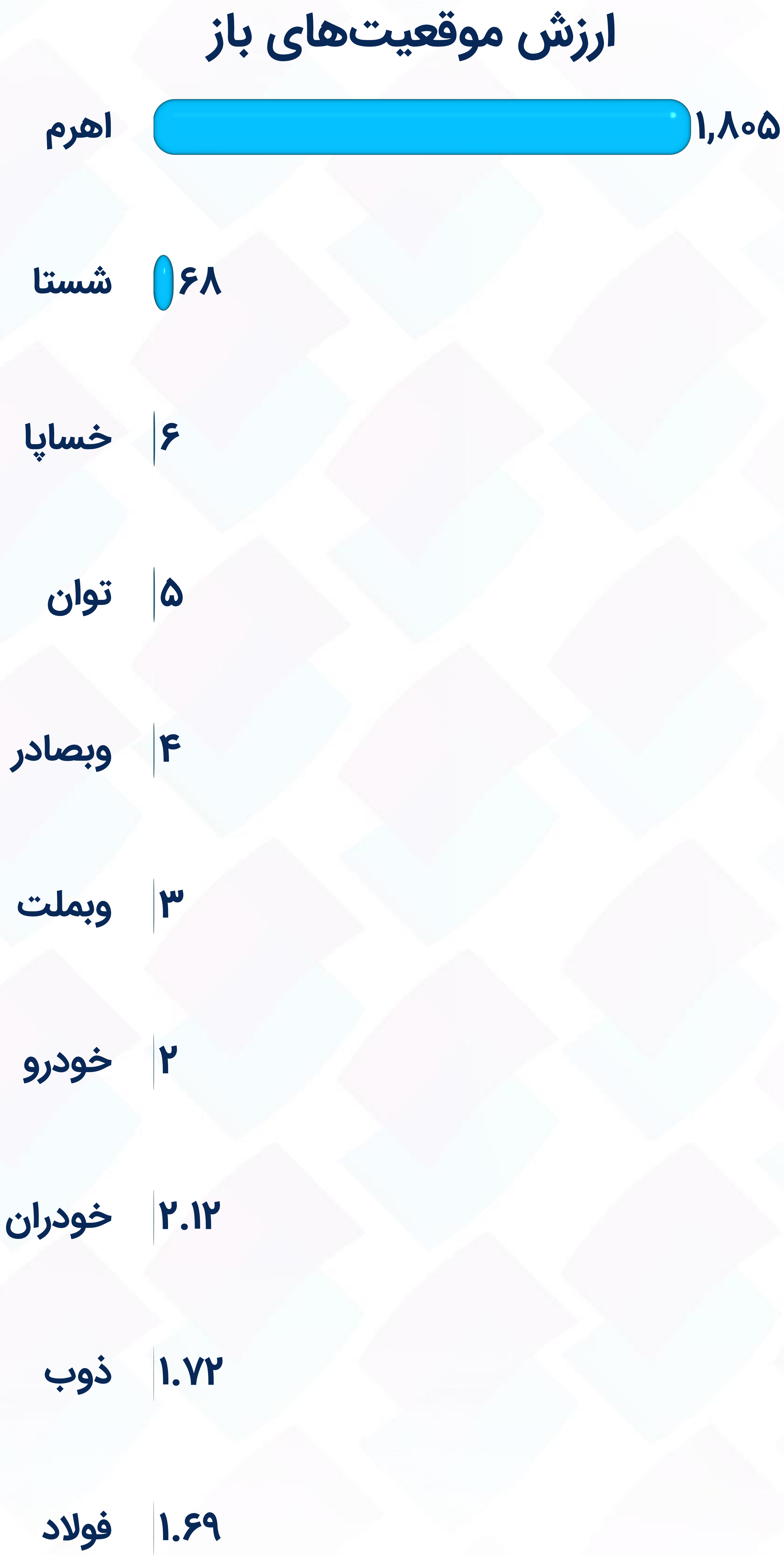
میلیارد تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



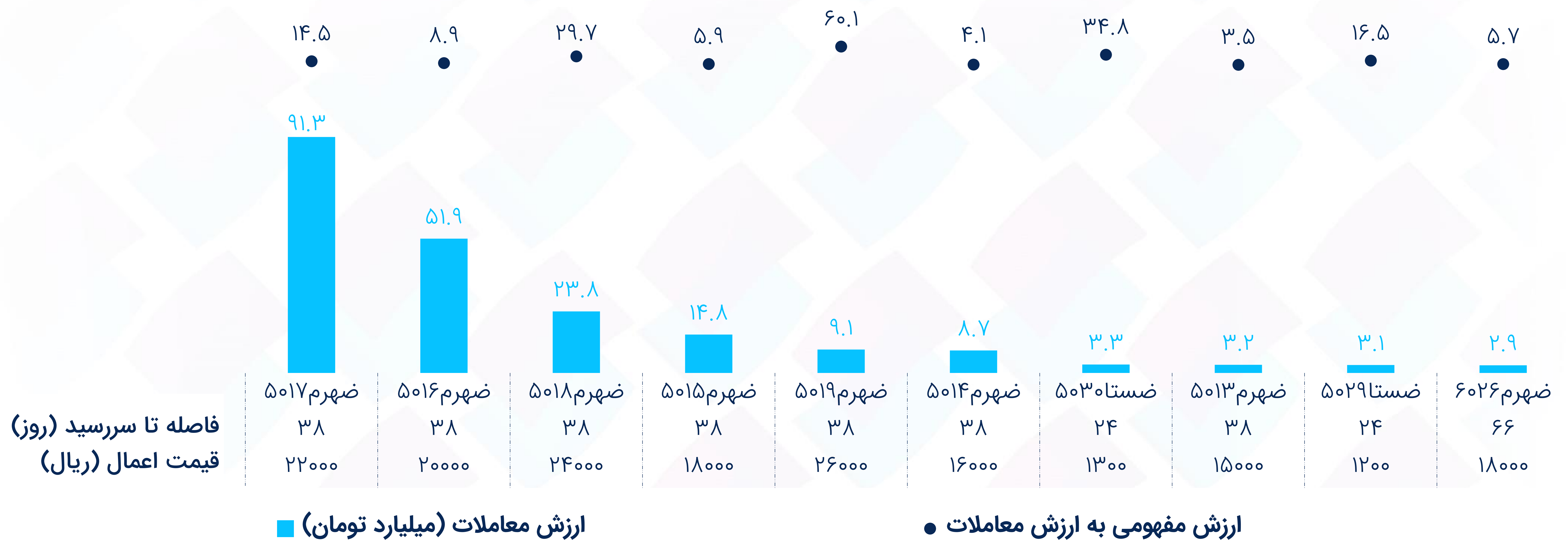
میلیون تومان



میلیارد 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	۳۸	۶۴.۴	۵	۴۰۱	۵۰۵	۲۵.۹%	۱۰۱.۰	۰.۲۹	۱۷	۲۳۸%
ضاساس ۵۰۳	آساس	۴۸,۰۰۰	۳۵	۳۹.۷	۱,۰۵۹	۴۸,۰۶۶	۴۹,۰۵۹	۲.۱%	۴۶.۳	۰.۶۹	۲,۵۵۱	۱۴۱%
ضمخا ۵۰۰۳	اخبر	۵۶۰	۳۱	۹.۶	۱۸	۵۵۸	۵۷۸	۳.۶%	۳۲.۱	۰.۶۱	۳۸	۱۱۰%
ضنارنج ۵۰۲	نارنج اهرم	۱۲,۰۰۰	۲۱	۵.۷	۵۶۹	۱۲,۶۶۵	۱۲,۵۶۹	(۰.۸%)	۲۲.۱	۰.۸۰	۱,۰۷۱	۸۸%
ضملت ۴۰۰۴	وبملت	۲,۴۰۰	۳	۷۹.۲	۱۲	۲,۳۳۷	۲,۴۱۲	۳.۲%	۲۰۱.۰	۰.۳۲	۲۱	۷۸%

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 ۴۰۲۰	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳	۱۱.۷	۳	۲۰,۲۵۰	۳۴,۰۰۳	۶۸%	۱۱,۳۳۴.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳	۱۸.۶	۷	۲۰,۲۵۰	۳۰,۰۰۷	۴۸%	۴,۲۸۶.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳	۱.۷	۲	۲۰,۲۵۰	۳۸,۰۰۲	۸۸%	۱۹,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳	۳.۱	۲	۲۰,۲۵۰	۴۲,۰۰۲	۱۰۷%	۲۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳	۱۴.۶	۸	۲۰,۲۵۰	۲۸,۰۰۸	۳۸%	۳,۵۰۱.۰	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	۳۸	۸۹.۹	۲۶	۴۰۱	۳۷۴	(۶.۷%)	۱۴.۴	-۰.۳۸	۳۳	۲۸.۳%
طسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۸	۱۰.۱	۴	۴۰۱	۲۹۶	(۲۶.۲%)	۷۴.۰	-۰.۰۸	۴	۱۲.۲%
طهرم ۴۰۱۵	اهرم	۲۲,۰۰۰	۳	۱۵۲.۶	۱,۶۲۷	۲۰,۲۵۰	۲۰,۳۷۳	۰.۶%	۱۲.۵	-۰.۹۶	۱,۶۴۳	۱.۰%
طهرم ۴۰۱۷	اهرم	۲۶,۰۰۰	۳	۳,۸۳۶.۳	۵,۵۸۲	۲۰,۲۵۰	۲۰,۴۱۸	۰.۸%	۳.۷	-۱.۰۰	۵,۶۰۷	۰.۴%
طذوب ۴۰۰۳	ذوب	۵۰۰	۳	۳.۲	۱۲۵	۳۷۲	۳۷۵	۰.۸%	۳.۰	-۱.۰۰	۱۲۵	۰.۲%

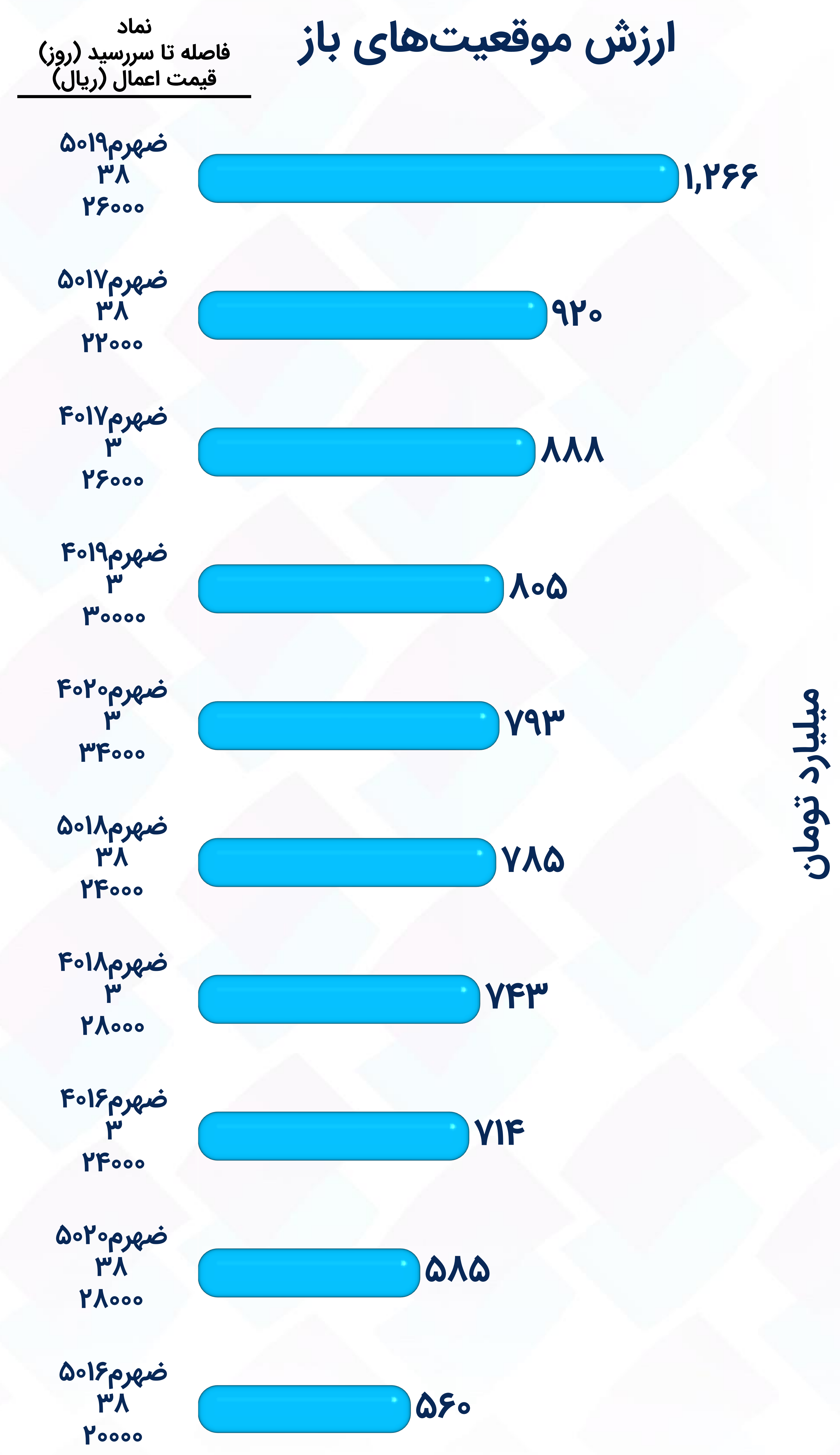
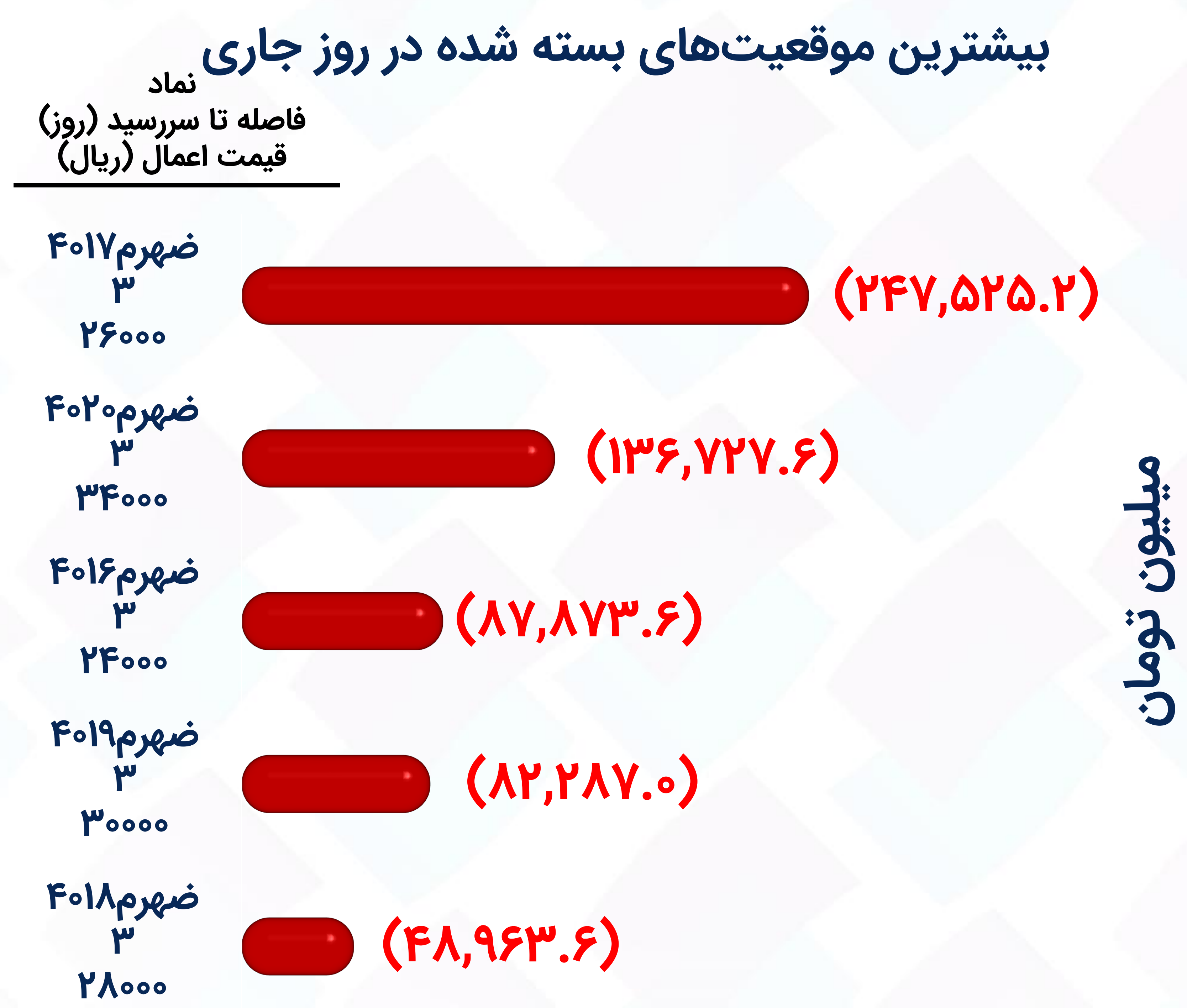
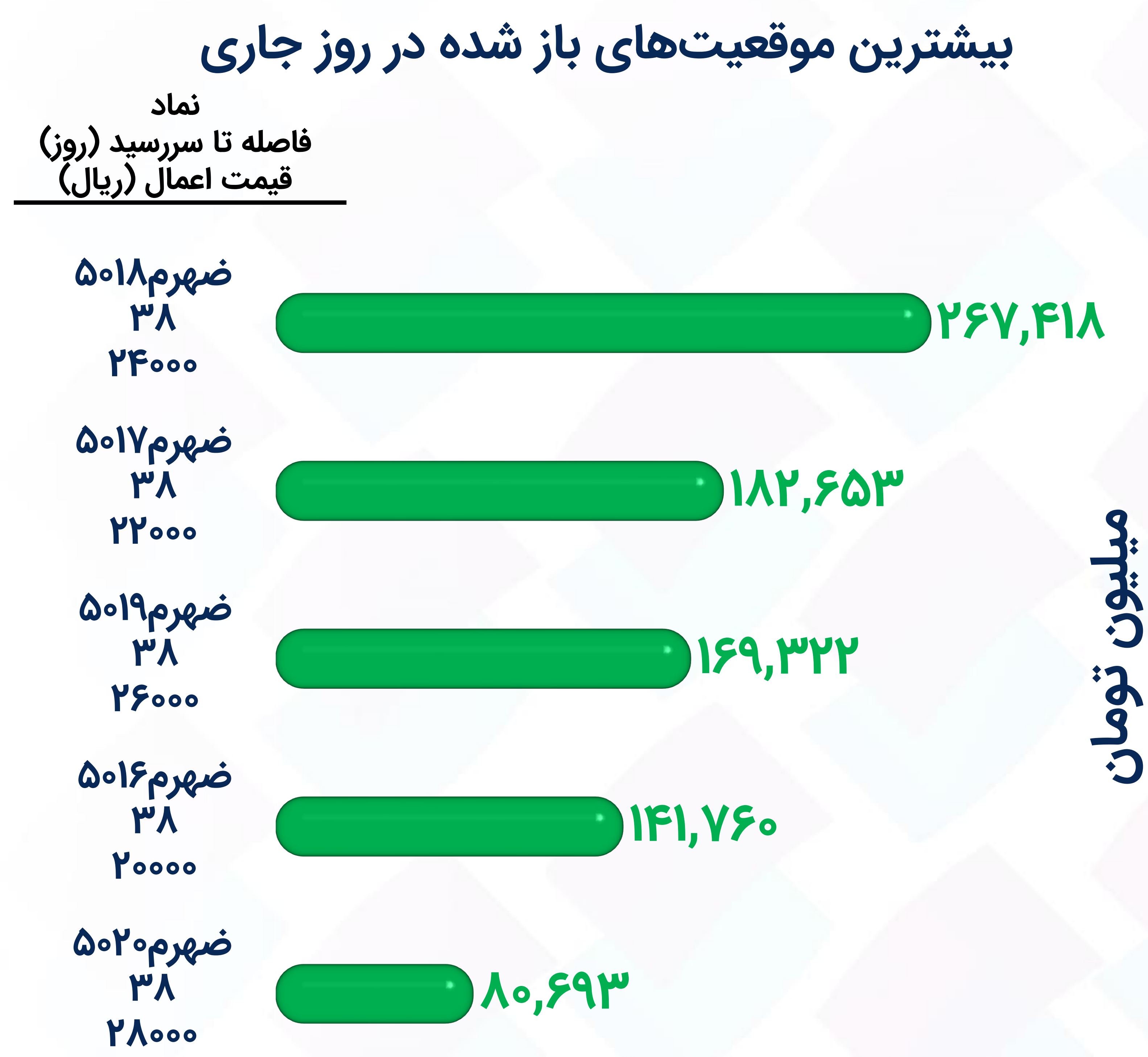
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طذوب ۴۰۰۰	ذوب	۲۰۰	۳	۱.۰	۱	۳۷۲	۱۹۹	(۴۶.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳	۰.۱	۱	۲۰,۲۵۰	۱۴,۹۹۹	(۲۵.۹%)	۱۴,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۳	۰.۵	۴	۲۰,۲۵۰	۱۵,۹۹۶	(۲۱.۰%)	۳,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طملت ۴۰۰۲	وبملت	۲,۰۰۰	۳	۰.۰	۱	۲,۳۳۷	۱,۹۹۹	(۱۴.۵%)	۱,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۷%)
طملت ۵۰۱۲	وبملت	۱,۸۰۰	۳۱	۰.۰	۳۰	۲,۳۳۷	۱,۷۷۰	(۲۴.۳%)	۵۹.۰	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

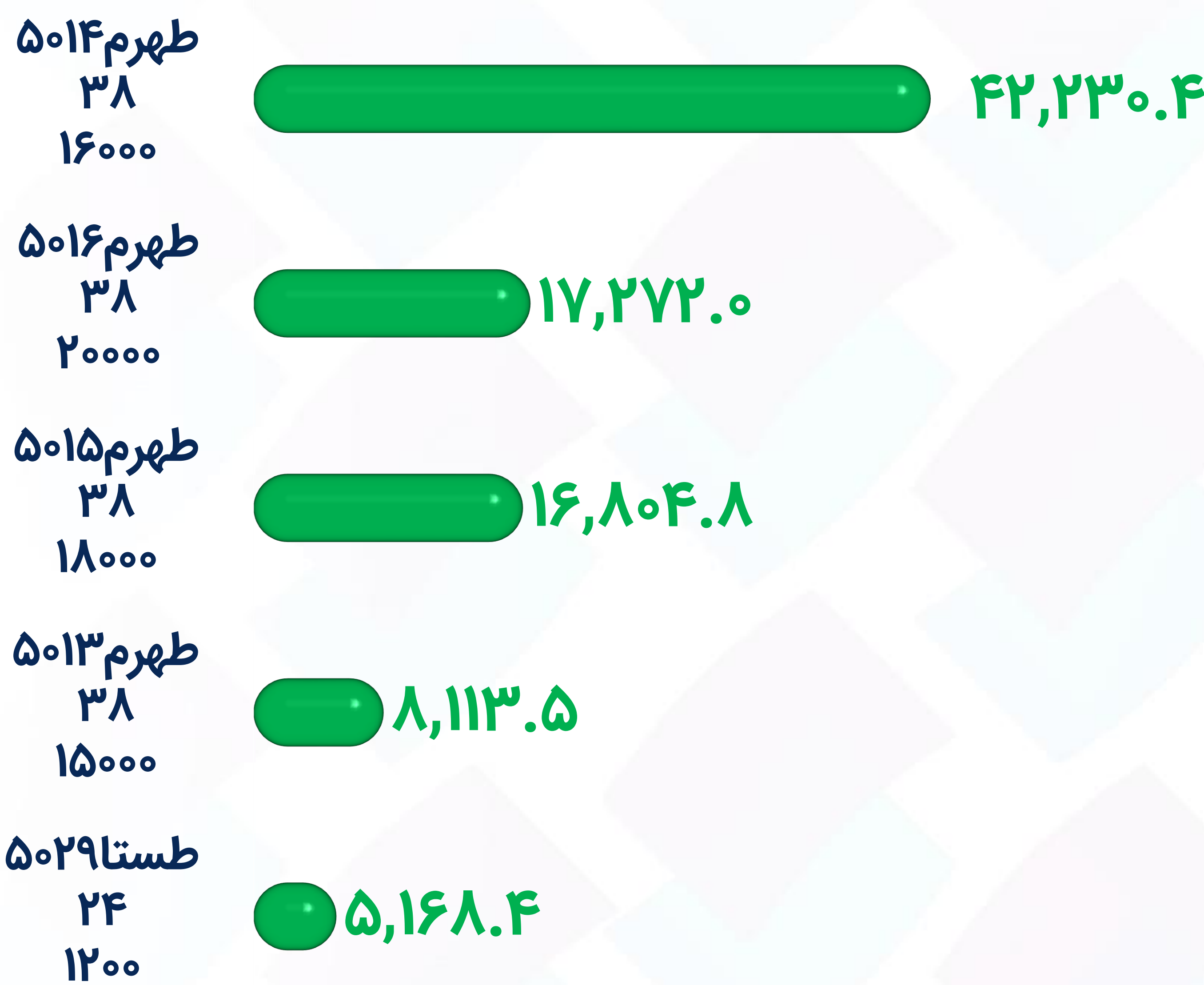
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

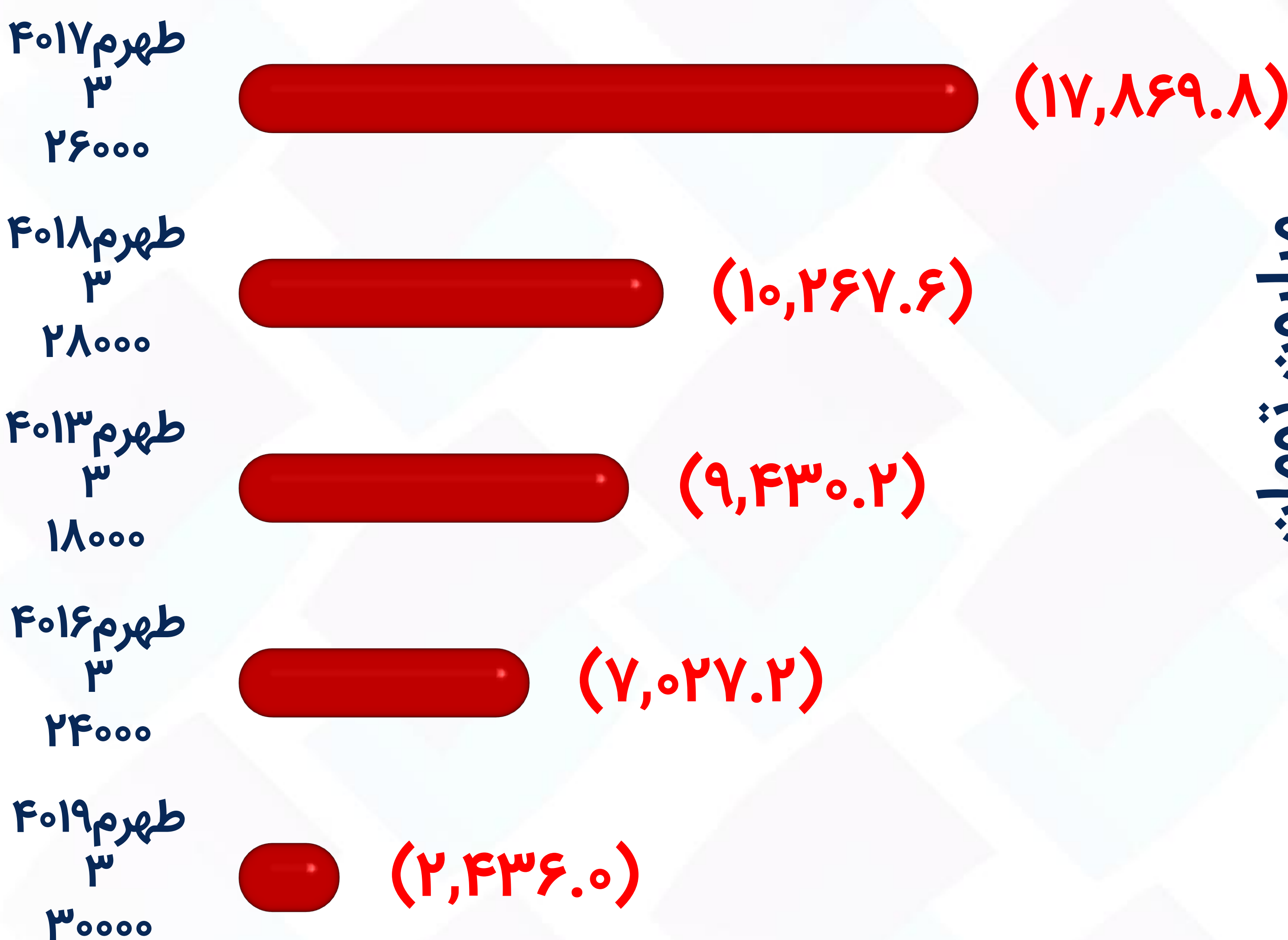
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

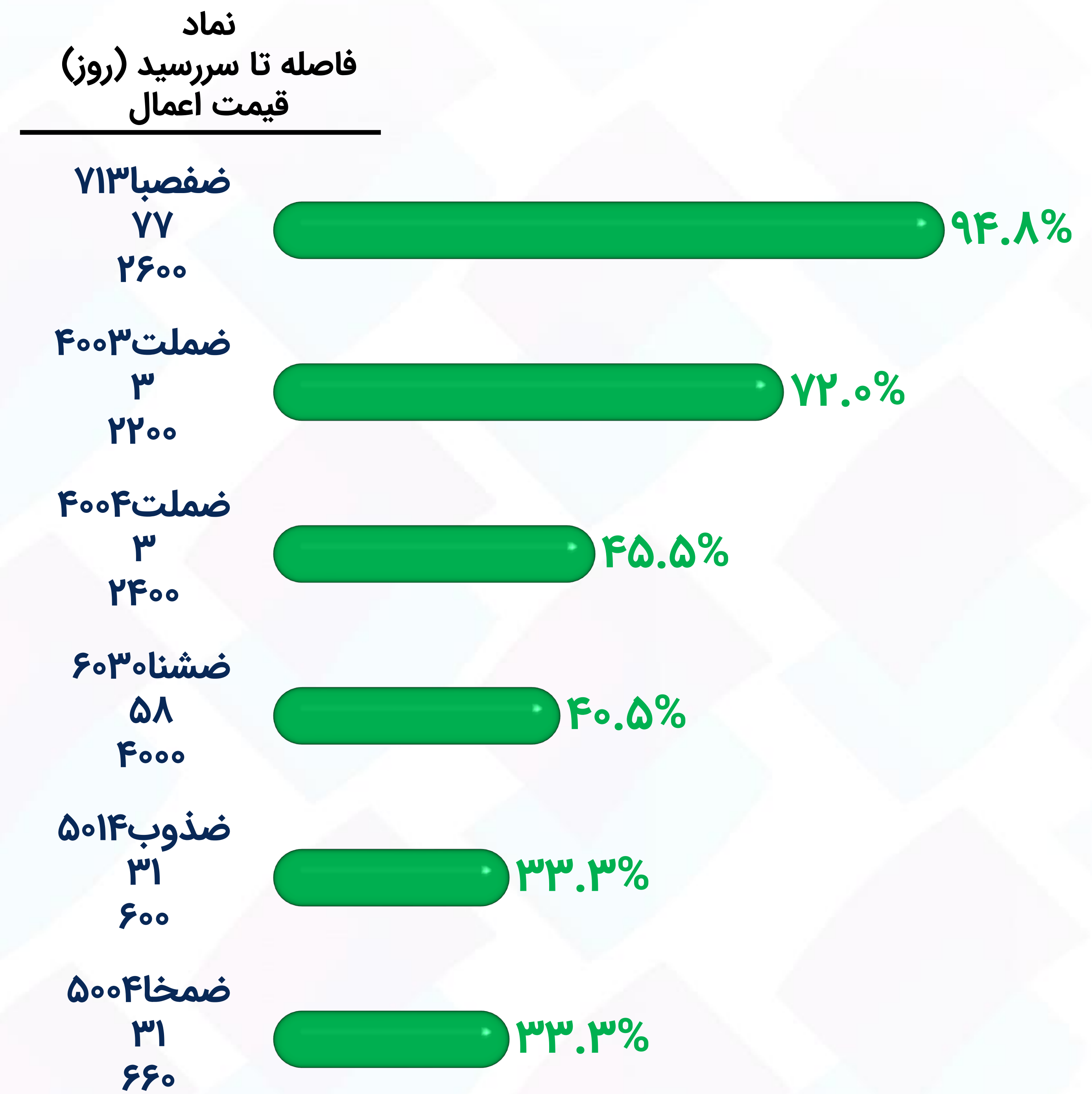
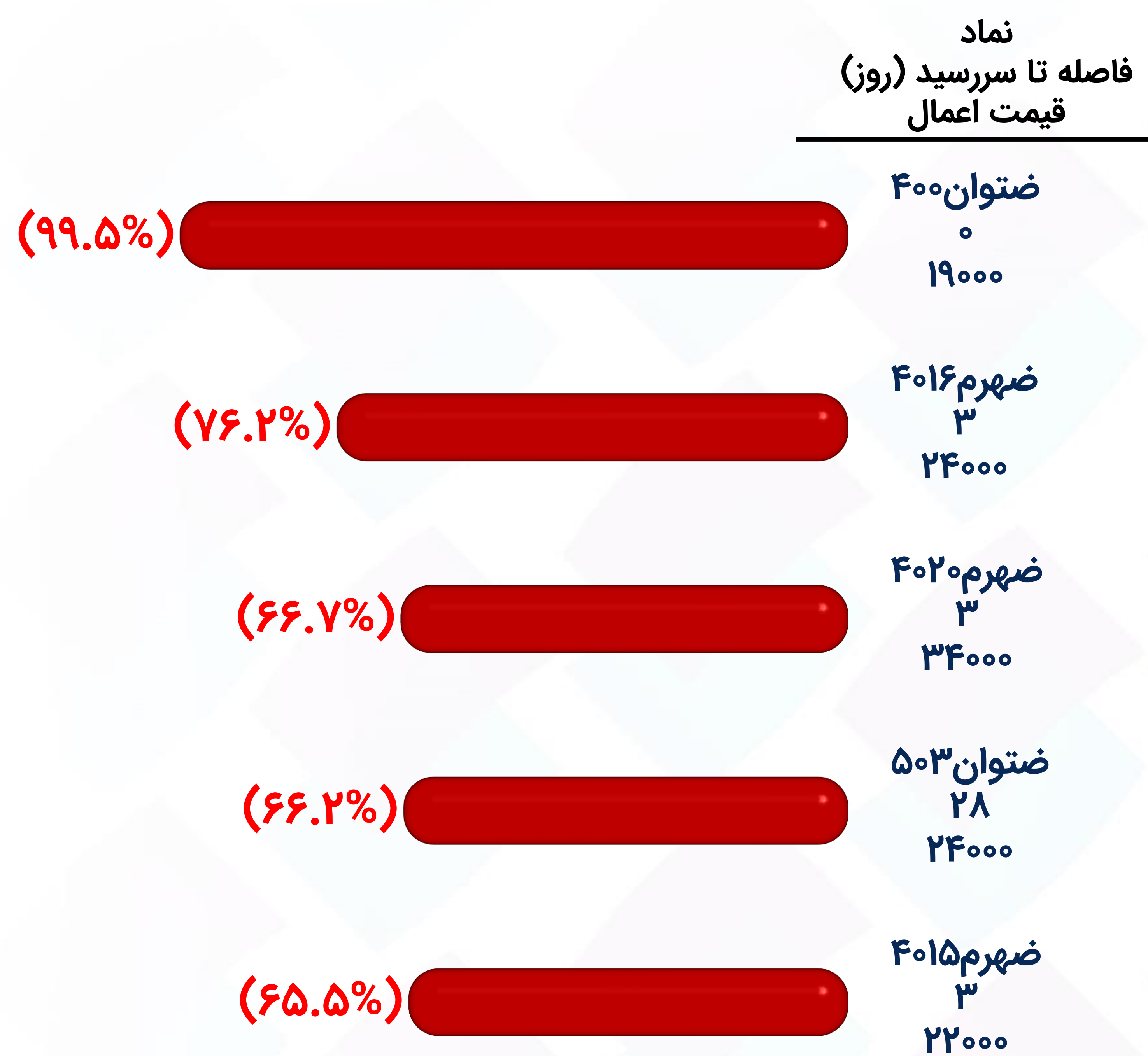
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



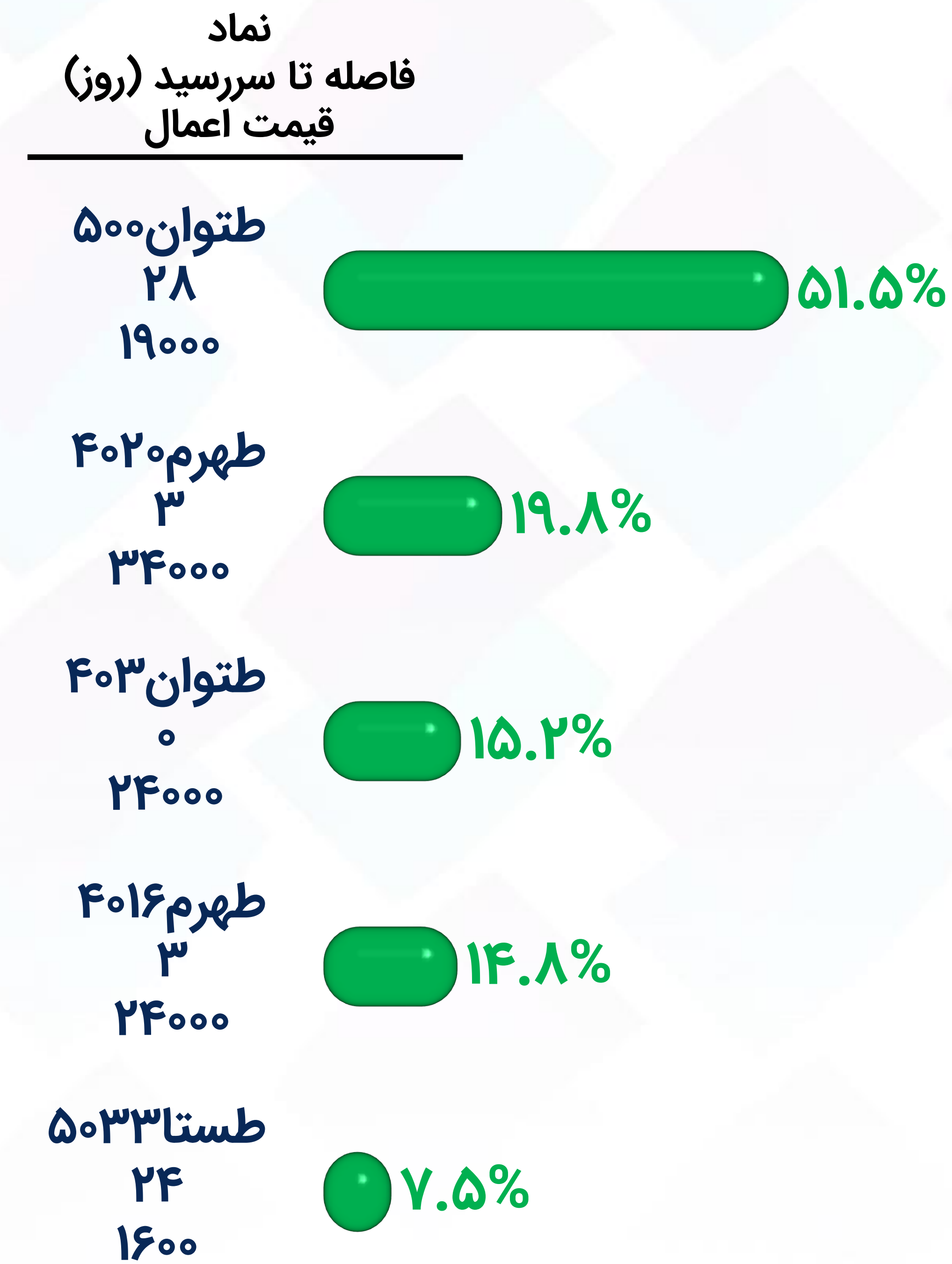
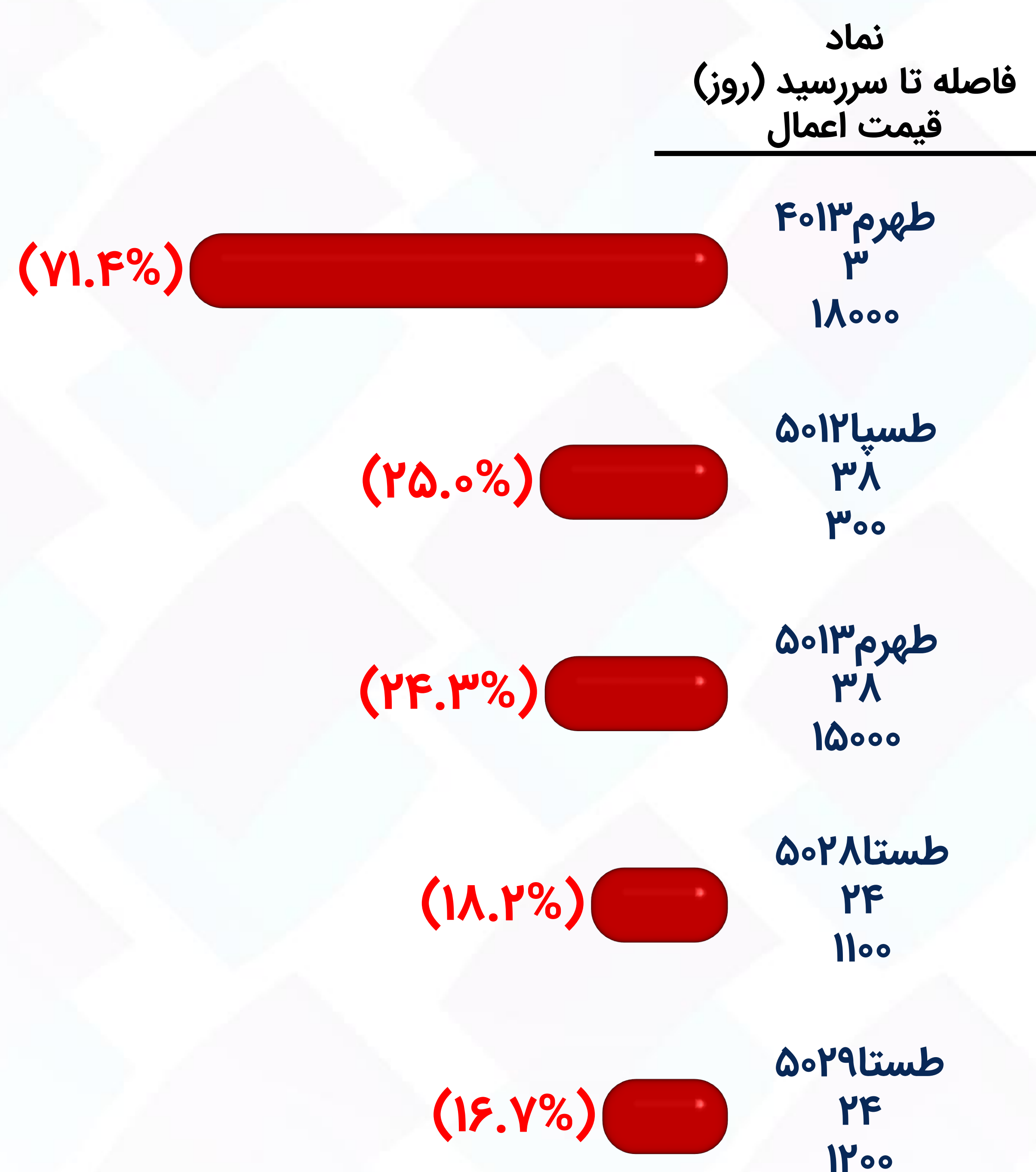
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

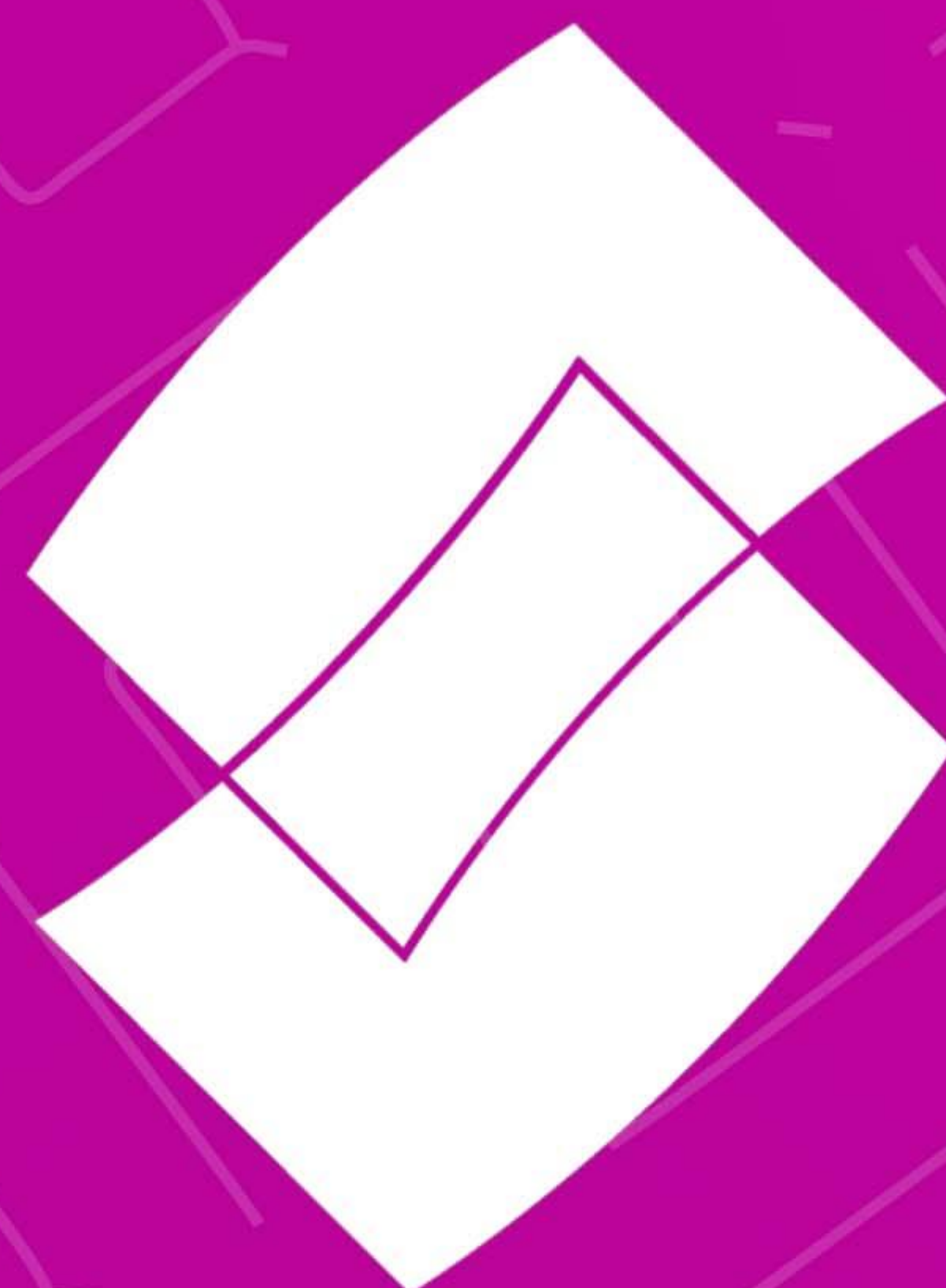
اختیار خرید



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.