

شماره

۵۰۸

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۳ 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



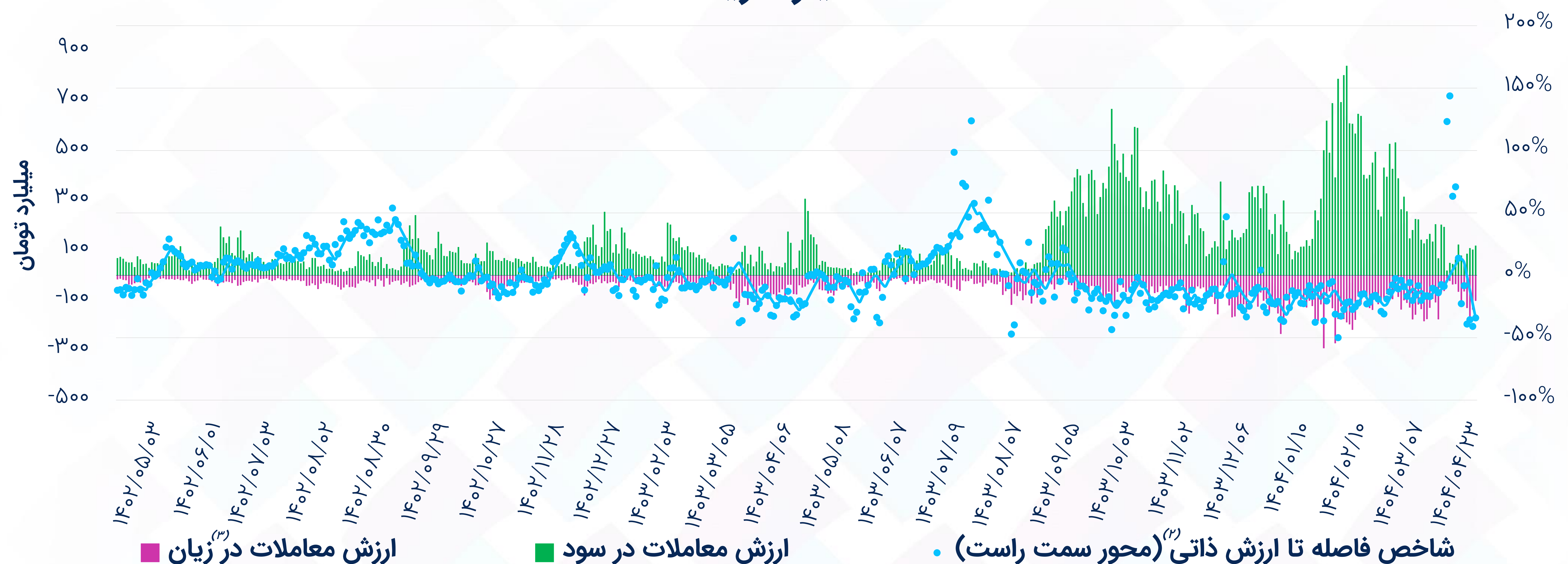
اختیار فروش



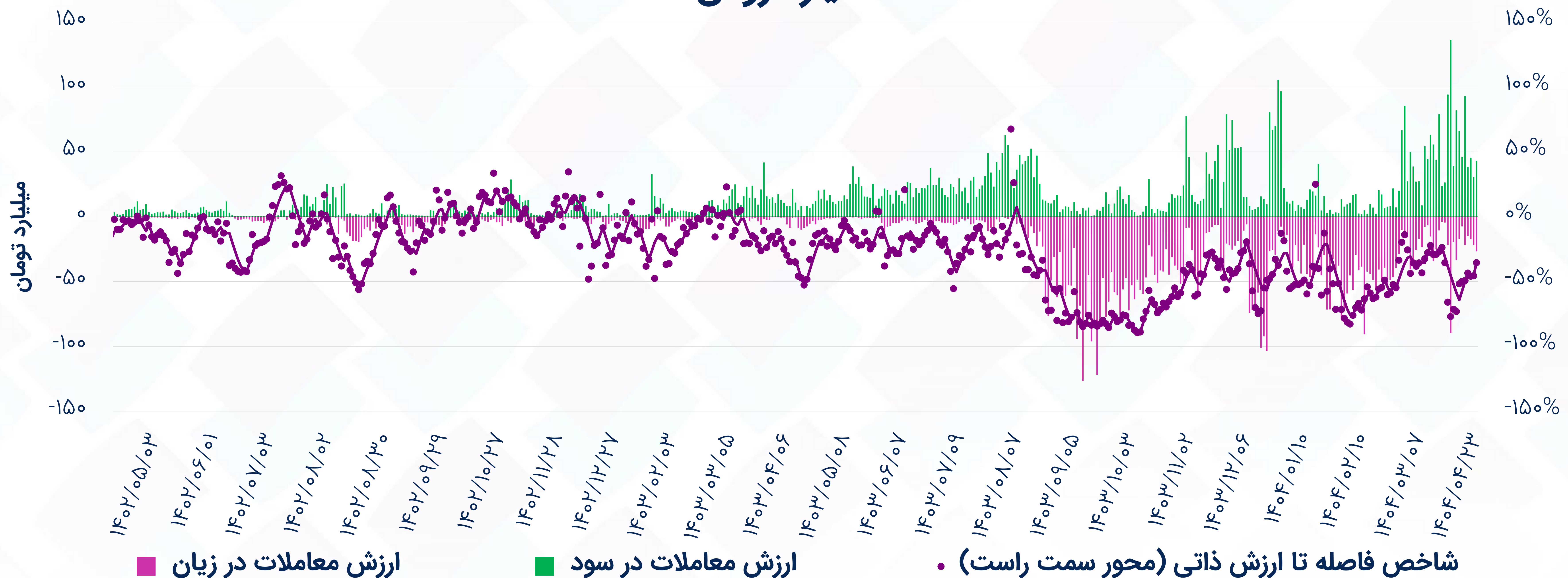
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۱۹۷.۹	۶,۴۰۱.۴	۱۰۲.۸	۹۵.۱	(۳۹.۷%)
خسپا	۱۵	۸.۳	۵۹.۶	۸.۲	۰.۱	۳۰.۴%
شستا	۳۰	۵.۹	۲۳۱.۳	۲.۶	۳.۳	۱۵.۴%
وبملت	۲۲	۲.۴	۴۹.۷	۱.۸	۰.۶	۲۶.۷%
دوب	۱۹	۱.۵	۲۷.۳	۰.۵	۱.۰	(۳۳.۱%)
وبصادر	۱۲	۱.۳	۱۷.۱	۰.۶	۰.۶	(۴.۷%)
وتجارت	۵	۰.۹	۱۶.۳	۰.۳	۰.۶	(۲۷.۴%)

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	۶۷,۹۲۲.۴	۱,۸۱۵,۶۶۱.۲	۴۲,۱۶۵.۷	۲۵,۷۵۶.۷	(۳۵.۲%)
شستا	۸	۱,۱۵۹.۳	۴۸,۹۱۷.۴	۶۰۵.۰	۵۵۴.۳	(۵۵.۹%)
خسپا	۲	۱۷۶.۵	۴,۹۴۴.۵	۰.۰	۱۷۶.۵	۱۸.۷%
وبصادر	۲	۱۲۳.۱	۲,۹۲۴.۴	۱۱۳.۷	۹.۵	(۴۹.۹%)
وبملت	۵	۱۲۲.۸	۴,۲۲۹.۰	۱.۰	۱۲۱.۸	(۸۳.۱%)
خودران	۳	۶.۲	۱۵۸.۲	۰.۱	۶.۱	(۳۸.۲%)
وتجارت	۲	۲.۳	۲۸۱.۰	۰.۶	۱.۸	(۶۳.۱%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



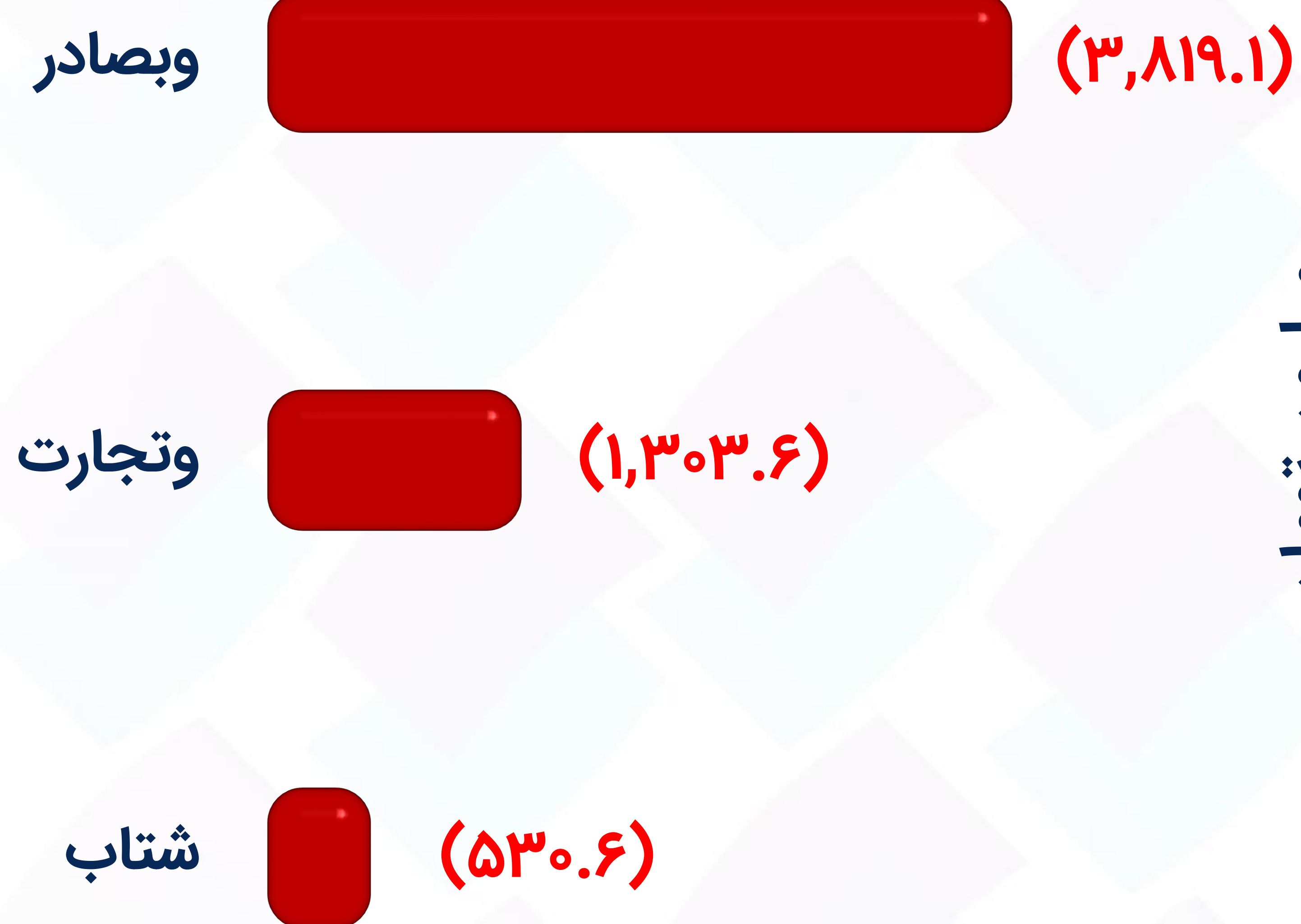
میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

اهرم ۲,۲۳۷

شستا ۷۹

خسپا ۷

وبملت ۶

وبصادر ۵

خودران ۲

خودرو ۲

ذوب ۱.۷۱

فولاد ۱.۶۹

شتاب ۰.۳۰

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

اهرم ۴۳۲,۱۹۵.۰

شستا ۱۰,۸۴۲.۵

وبملت ۳,۳۵۵.۷

خسپا ۱,۴۰۵.۰

وبصادر ۱,۰۰۵.۳

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

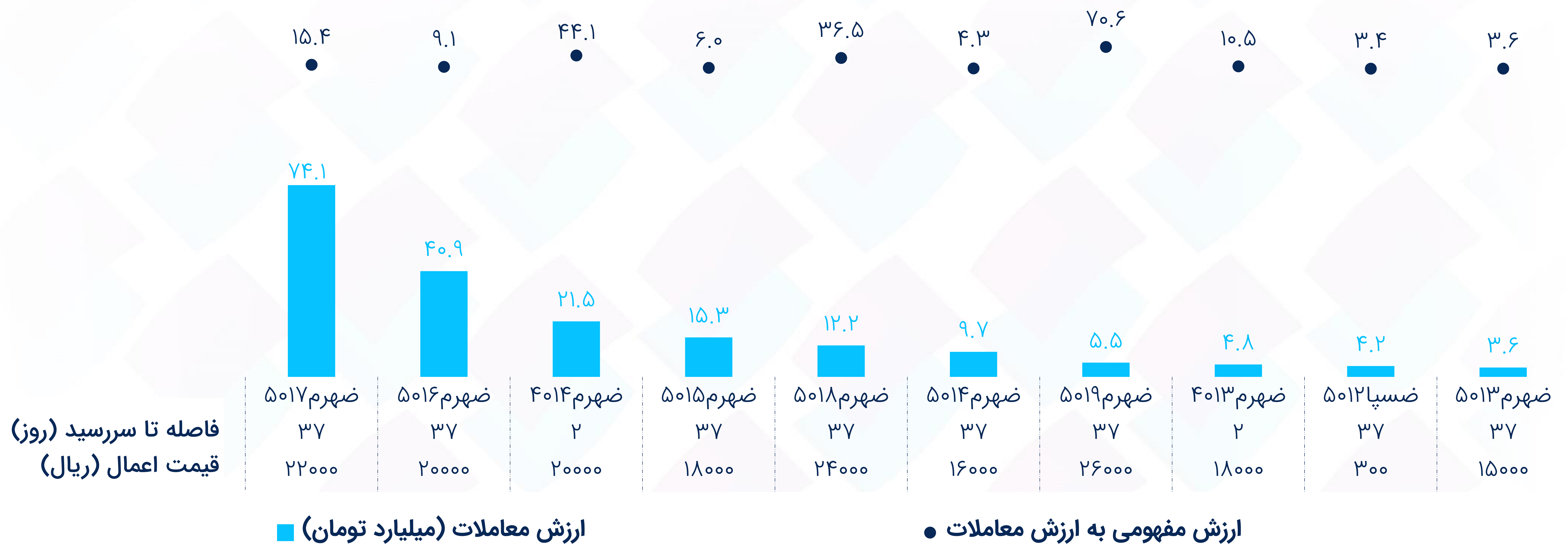
ذوب

(۶.۸)

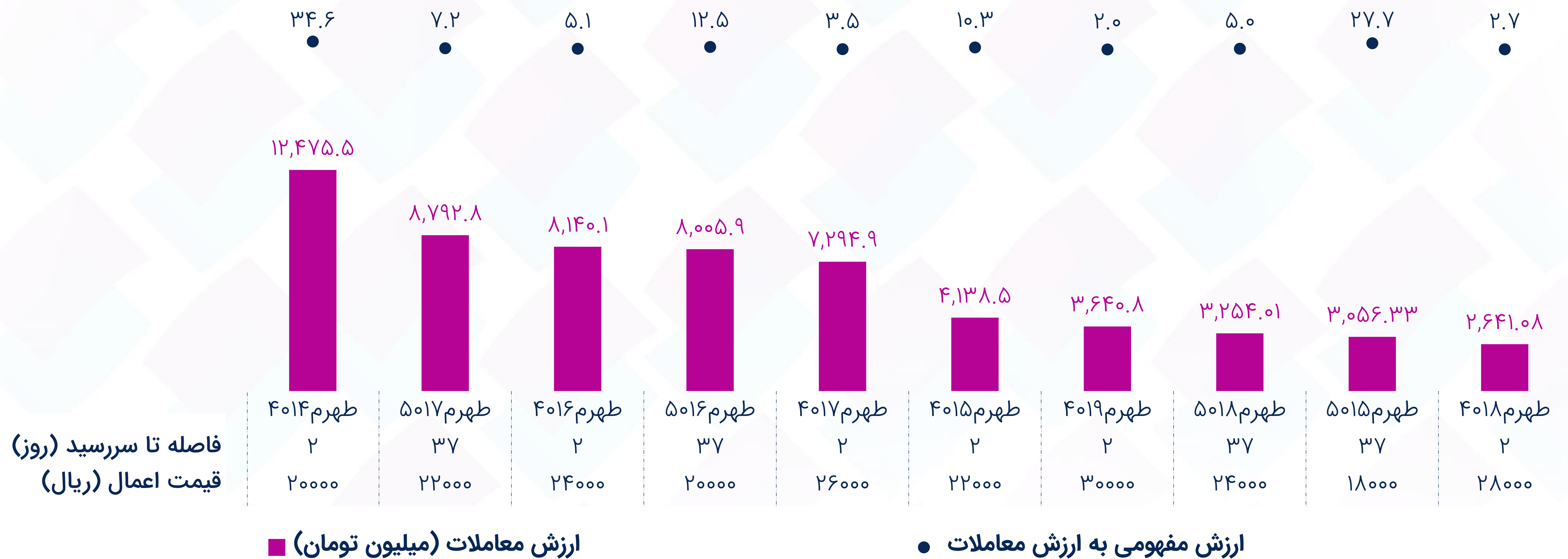
میلیون تومان

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
خسپا ۵۰۱۴	خسپا	۵۰۰	۳۷	۹۷.۶	۵	۴۱۳	۵۰۵	۲۲.۳%	۱۰۱.۰	۰.۳۲	۲۰	۲۹۴%
ضبید ۴۰۰۰	بیدار	۱۱,۰۰۰	۲	۱۰.۰	۱۵۳	۱۱,۳۱۰	۱۱,۱۵۳	(۱.۴%)	۷۲.۹	۰.۷۸	۴۱۵	۱۷۲%
ضملت ۴۰۰۴	وبملت	۲,۴۰۰	۲	۴۰.۲	۱۲	۲,۳۷۳	۲,۴۱۲	۱.۶%	۲۰۱.۰	۰.۴۳	۲۸	۱۳۷%
ضشنا ۶۰۳۰	شپنا	۴,۰۰۰	۵۷	۵.۷	۷۵	۳,۶۹۱	۴,۰۷۵	۱۰.۴%	۵۴.۳	۰.۴۵	۱۶۰	۱۱۴%
ضشنا ۶۰۲۹	شپنا	۳,۷۵۰	۵۷	۷.۲	۱۴۴	۳,۶۹۱	۳,۸۹۴	۵.۵%	۲۷.۰	۰.۶۳	۲۷۶	۹۱%

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	۲	۱۱.۲	۲	۲۰,۱۳۰	۳۴,۰۰۲	۶۹%	۱۷,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۹	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲	۲۰.۹	۲	۲۰,۱۳۰	۳۰,۰۰۲	۴۹%	۱۵,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۱	اهرم	۳۸,۰۰۰	۲	۲.۶	۲	۲۰,۱۳۰	۳۸,۰۰۲	۸۹%	۱۹,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۲	۴.۰	۲	۲۰,۱۳۰	۴۲,۰۰۲	۱۰۹%	۲۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۴۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲	۴۸.۶	۴	۲۰,۱۳۰	۲۸,۰۰۴	۳۹%	۷,۰۰۱.۰	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
طملت ۵۰۱۷	وبملت	۲,۶۰۰	۳۰	۱.۰	۵۱	۲,۳۷۳	۲,۵۴۹	۷.۴%	۵۰.۰	-۰.۷۰	۱۹۳	۲۷۸.۲%
طسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۷	۱۶۰.۷	۲۴	۴۱۳	۳۷۶	(۹.۰%)	۱۵.۷	-۰.۳۴	۲۹	۱۹.۲%
طسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۷	۱۵.۸	۳	۴۱۳	۲۹۷	(۲۸.۱%)	۹۹.۰	-۰.۰۷	۳	۱۳.۳%
طهرم ۴۰۱۸	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲	۲,۶۴۱.۱	۷,۵۴۴	۲۰,۱۳۰	۲۰,۴۵۶	۱.۶%	۲.۷	-۱.۰۰	۷,۷۵۵	۲.۸%
طهرم ۴۰۲۲	اهرم	۴۲,۰۰۰	۲	۷۵.۵	۲۱,۵۶۰	۲۰,۱۳۰	۲۰,۴۴۰	۱.۵%	۰.۹	-۱.۰۰	۲۱,۶۹۸	۰.۶%

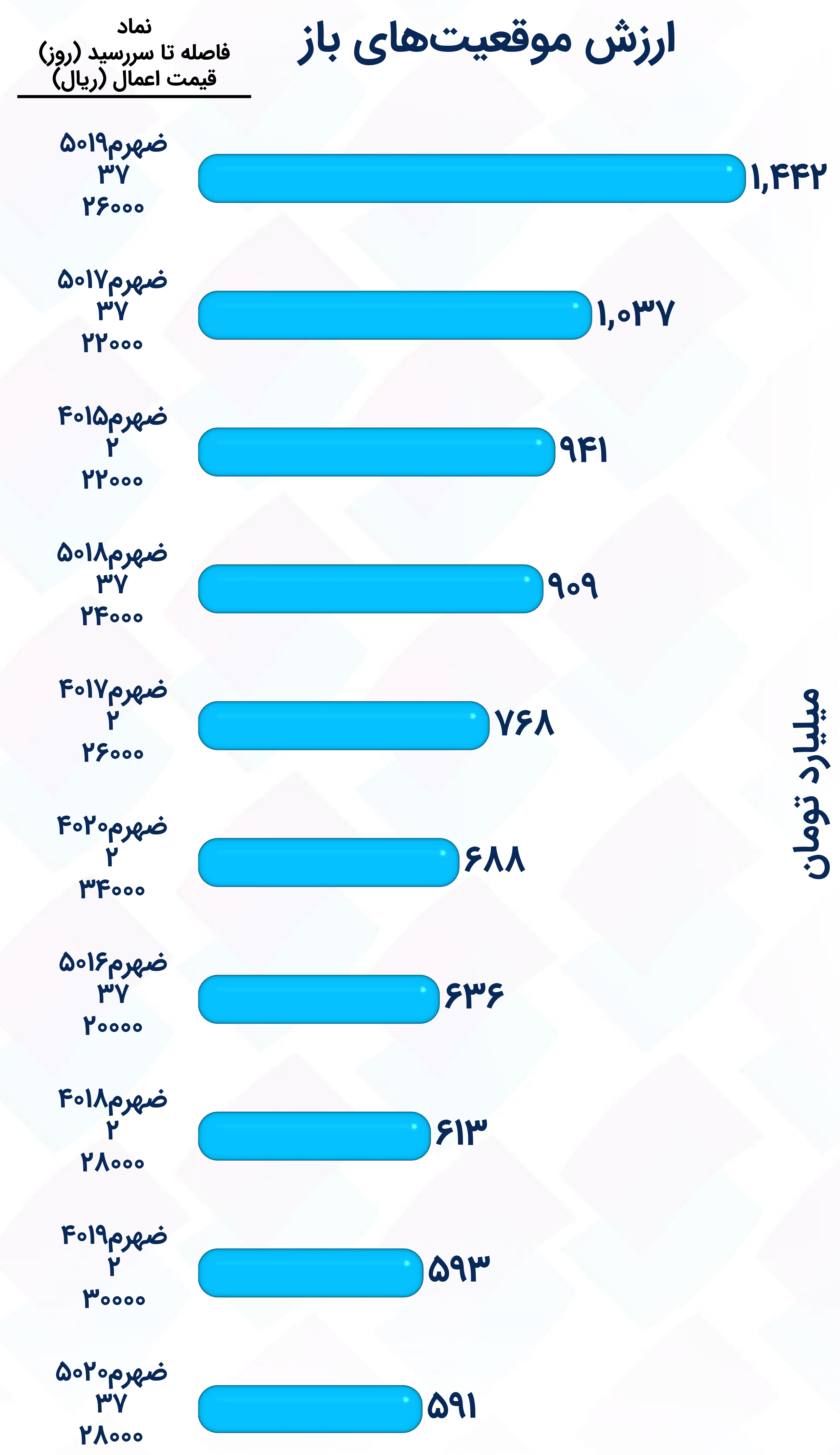
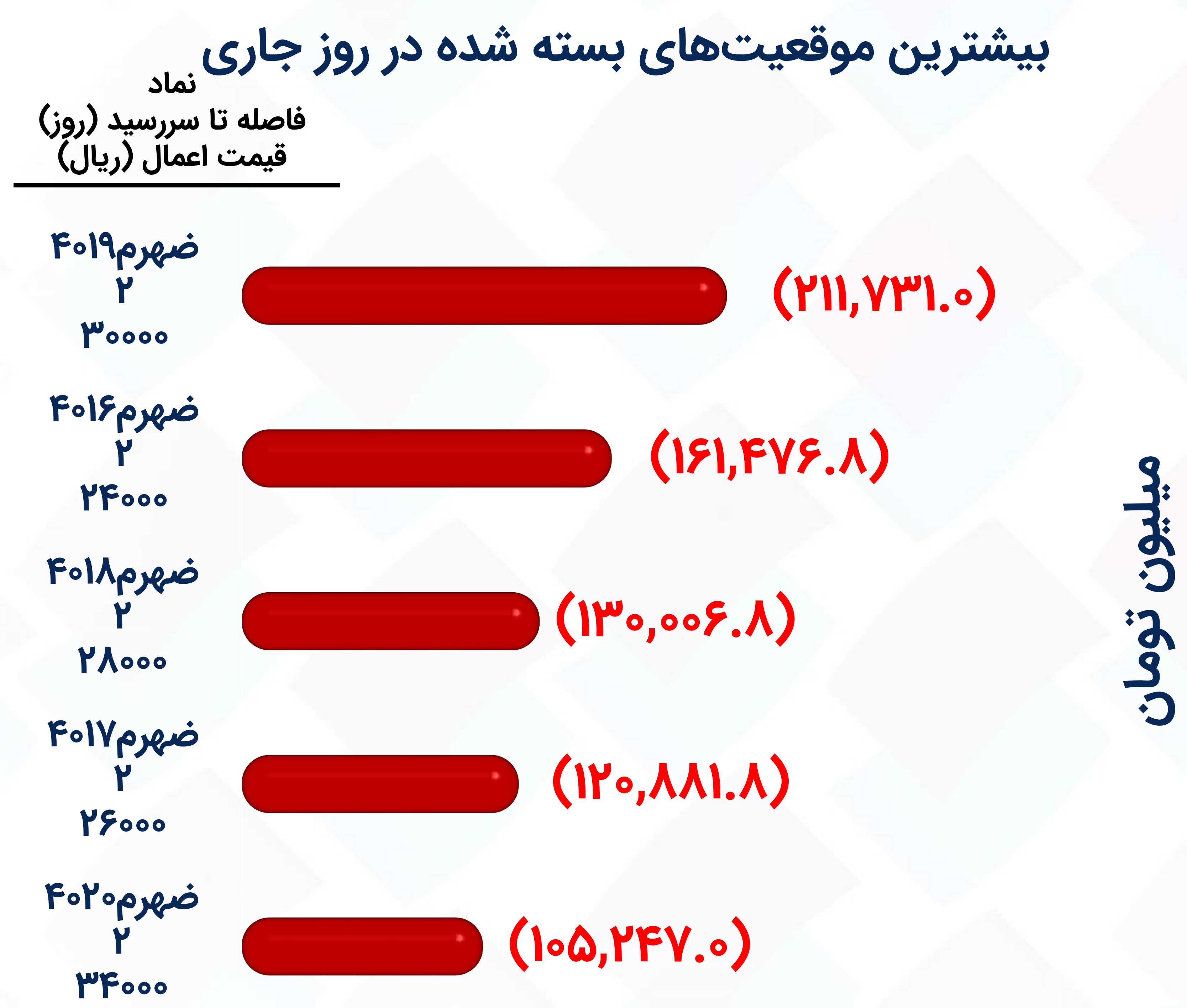
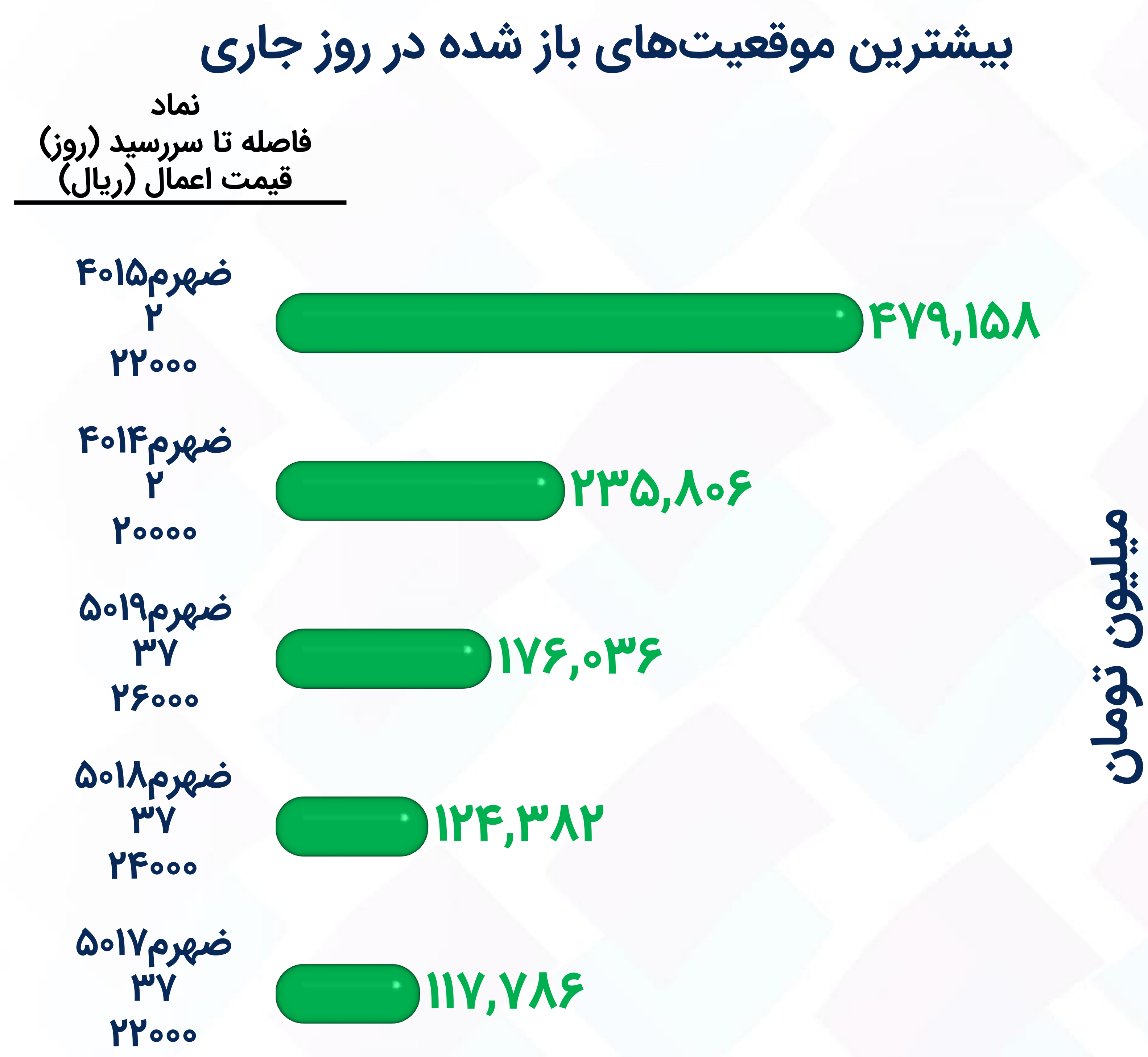
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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	۲	۰.۰	۱	۳۷۲	۱۹۹	(۴۶.۵%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۱	اهرم	۱۵,۰۰۰	۲	۰.۱	۱	۲۰,۱۳۰	۱۴,۹۹۹	(۲۵.۵%)	۱۴,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۲	اهرم	۱۶,۰۰۰	۲	۳.۴	۴	۲۰,۱۳۰	۱۵,۹۹۶	(۲۰.۵%)	۳,۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طهرم ۴۰۱۳	اهرم	۱۸,۰۰۰	۲	۷۶۲.۲	۱۹	۲۰,۱۳۰	۱۷,۹۸۱	(۱۰.۷%)	۹۴۶.۴	۰.۰۰	۰	(۹۸.۷%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۷	۵۴.۴	۹۸	۲۰,۱۳۰	۱۴,۹۰۲	(۲۶.۰%)	۱۵۲.۱	۰.۰۰	۱	(۹۸.۷%)

(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

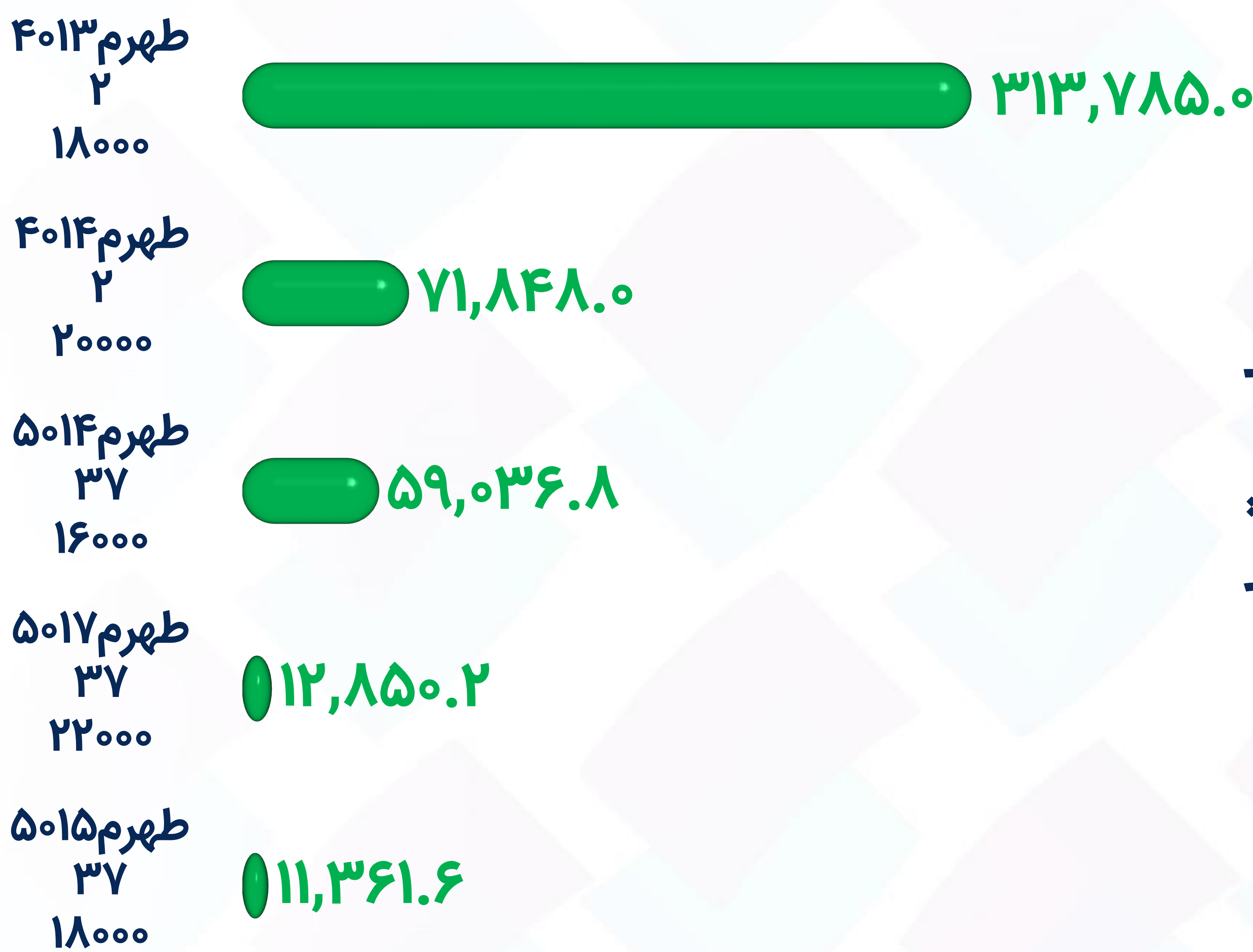
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

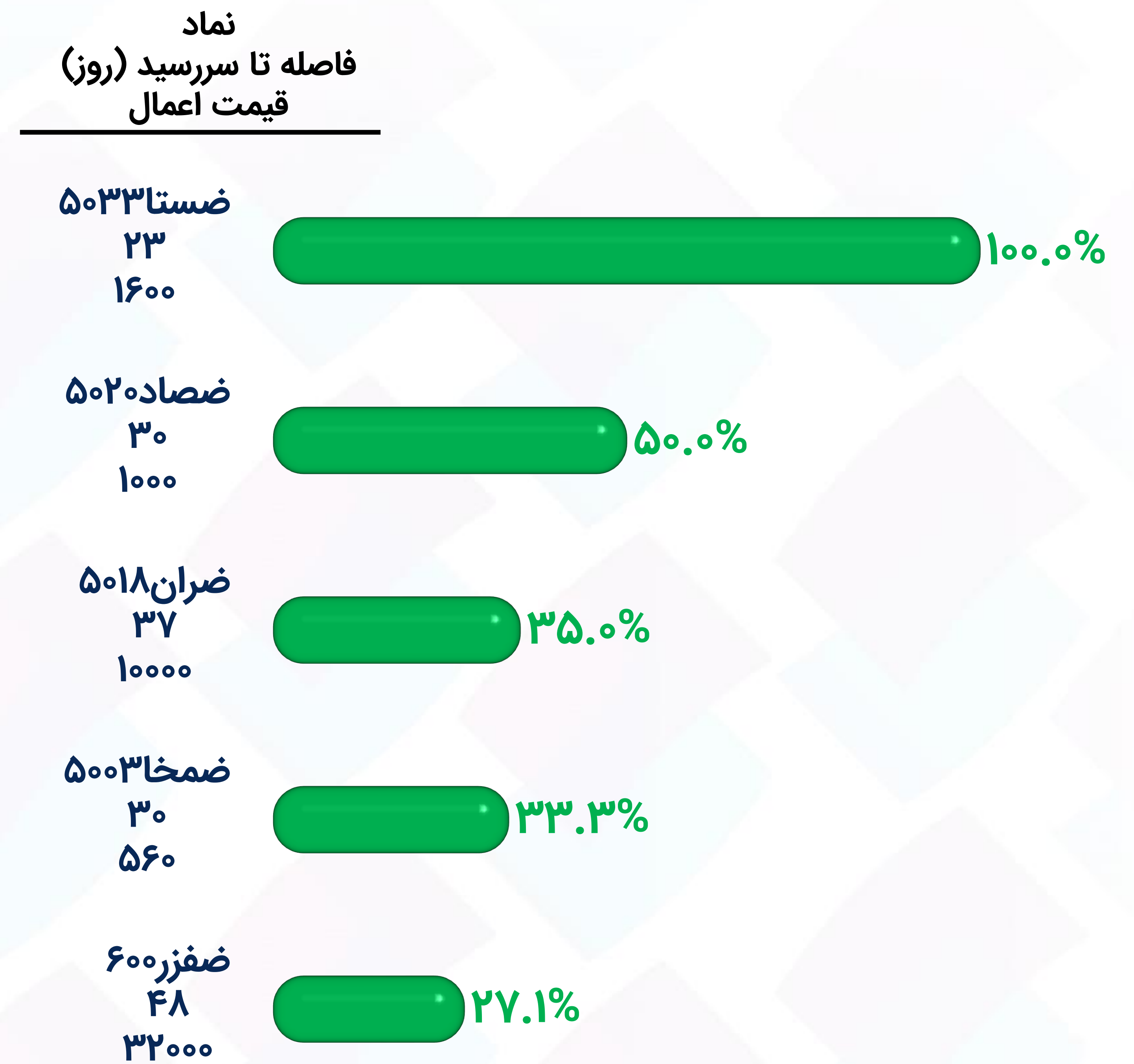
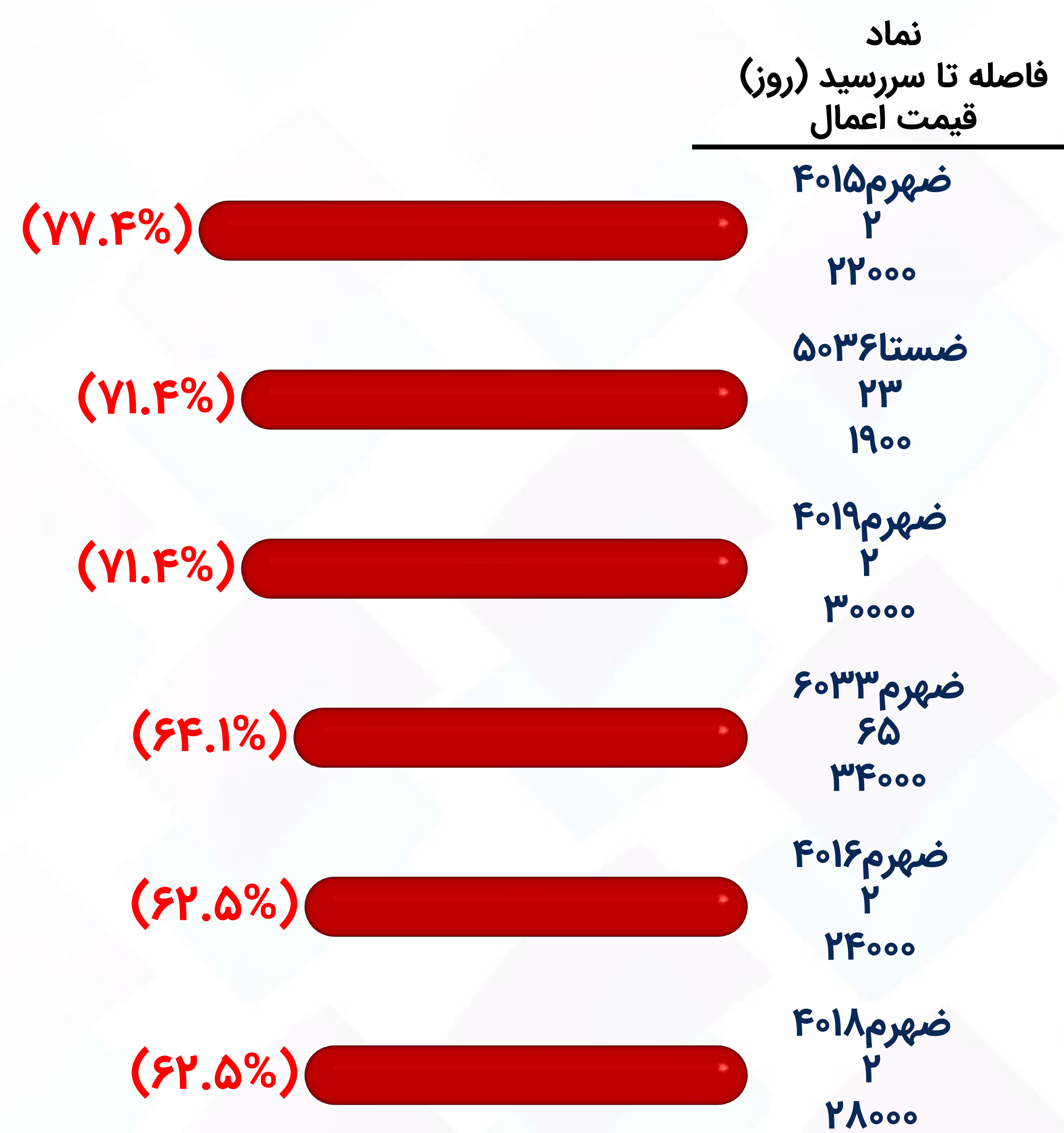
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



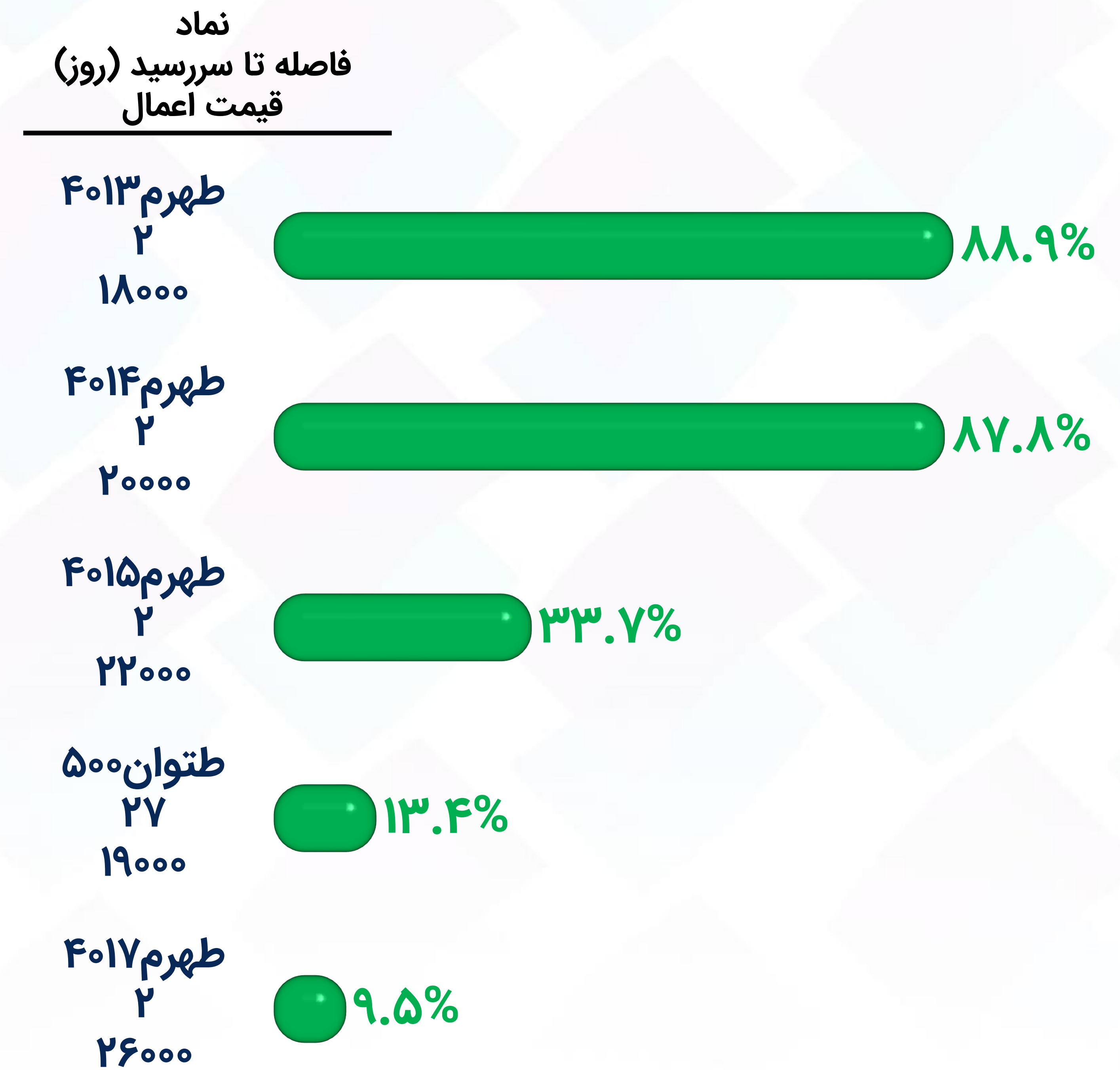
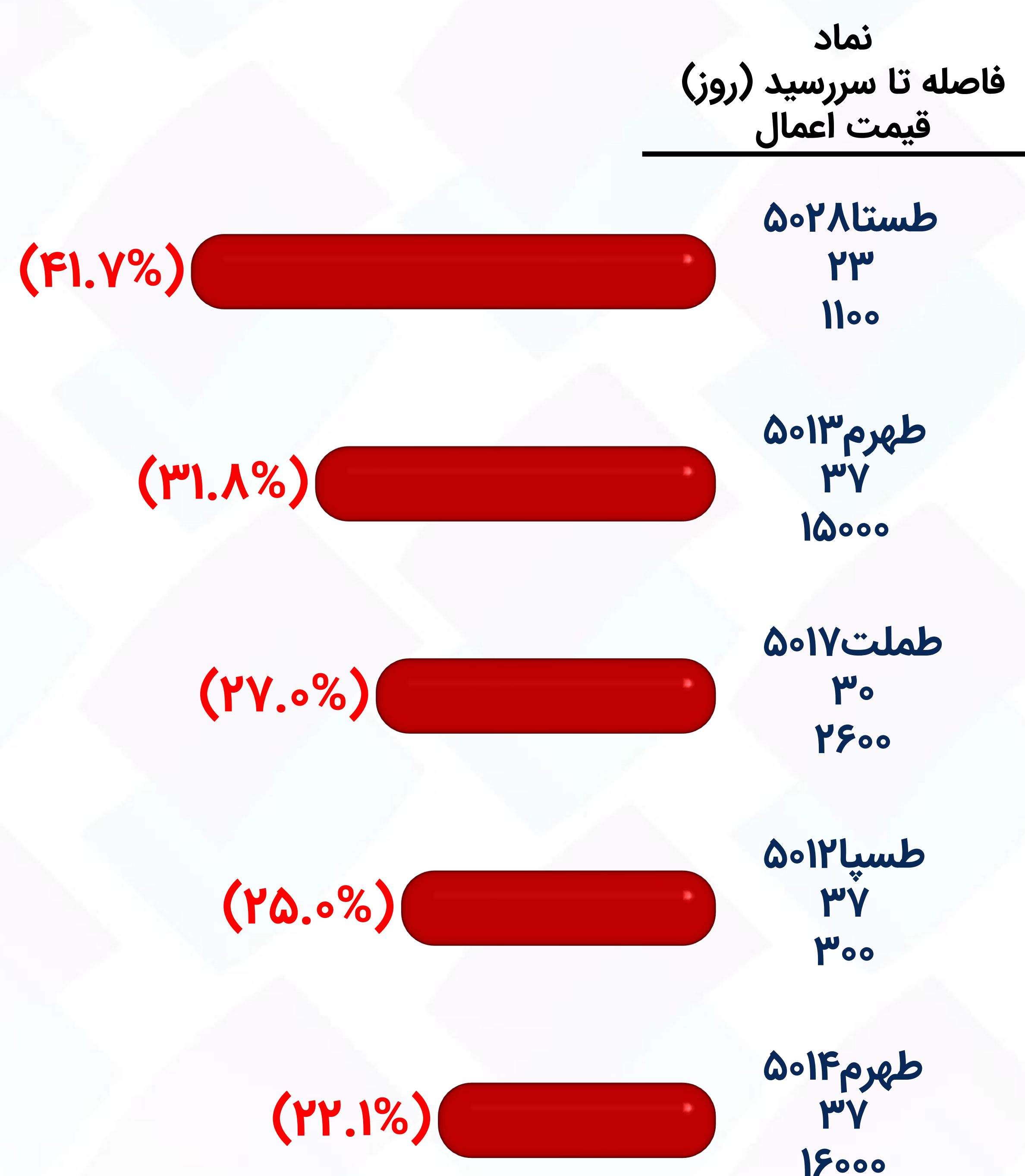
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

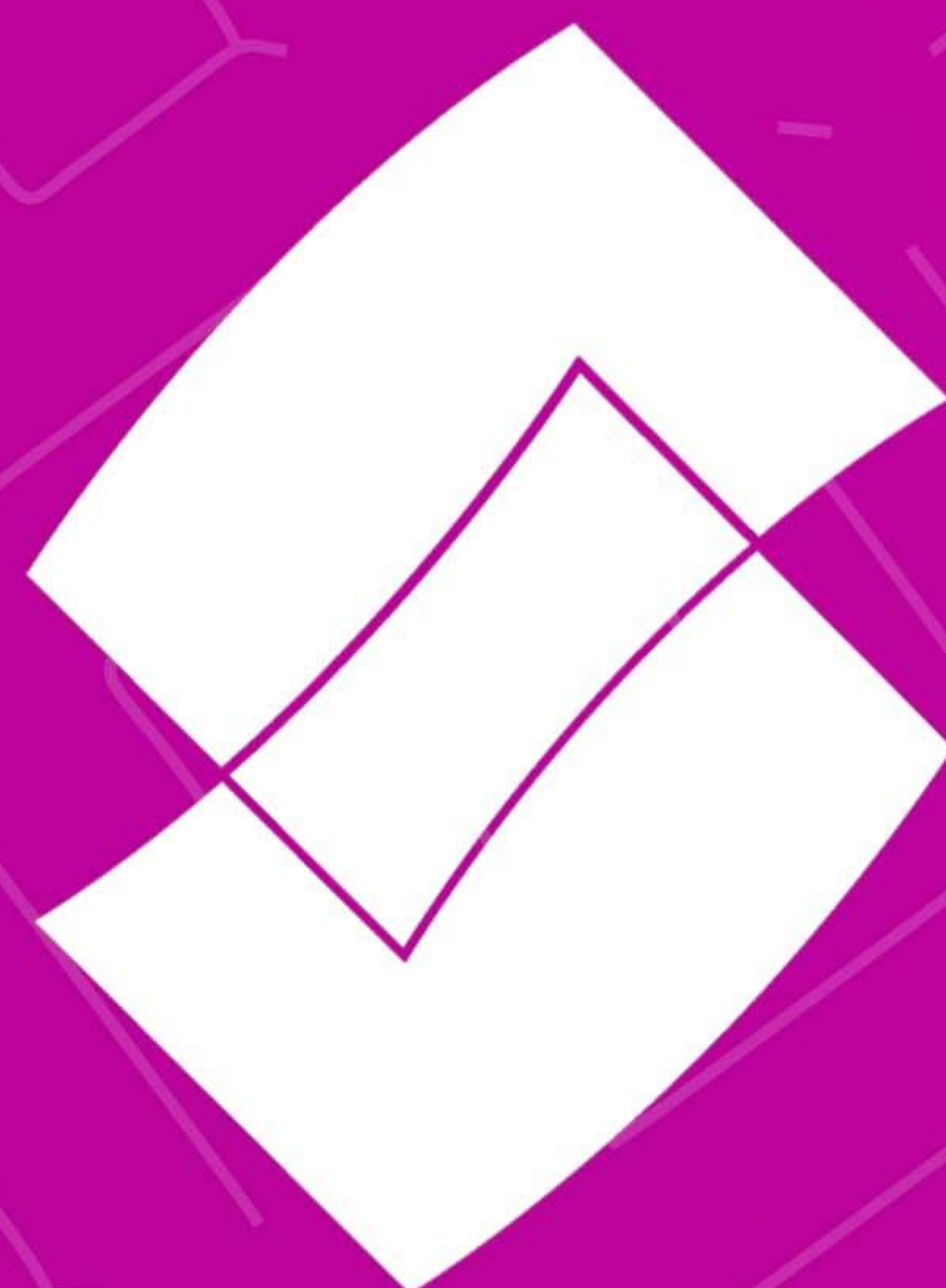
اختیار خرید



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.