

شماره
۵۰۹

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۴ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





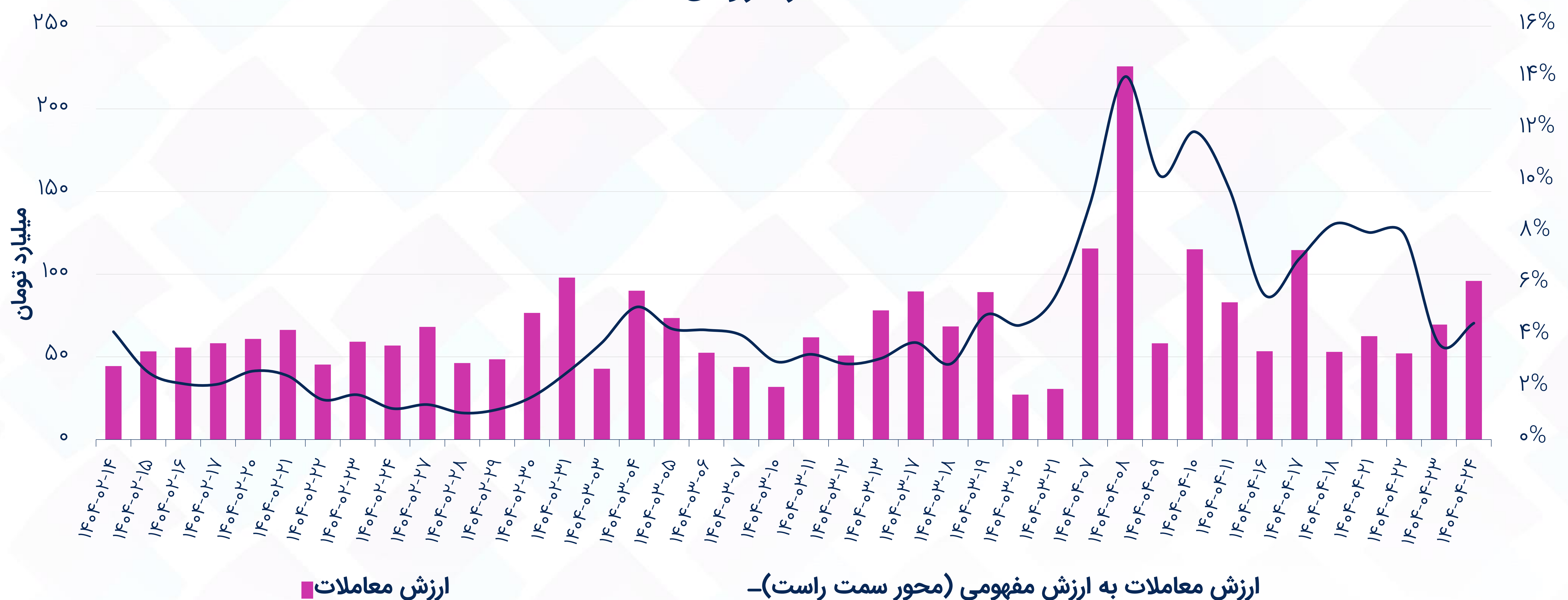
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



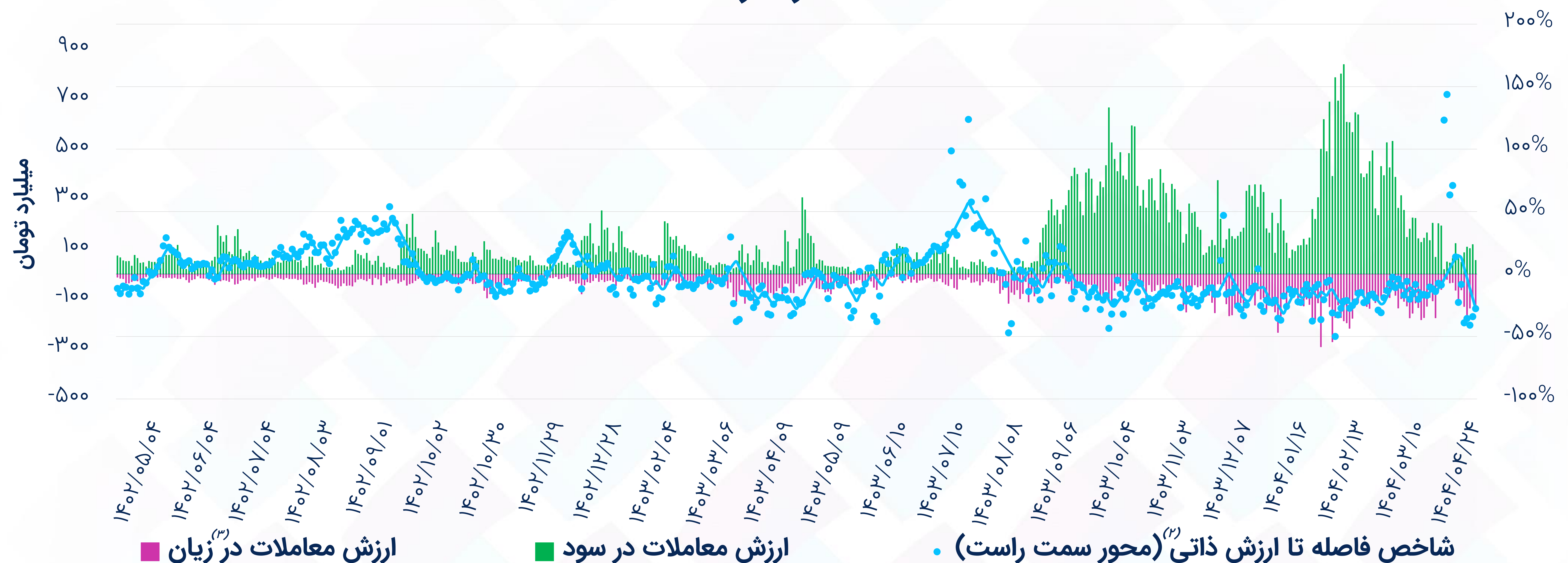
اختیار فروش



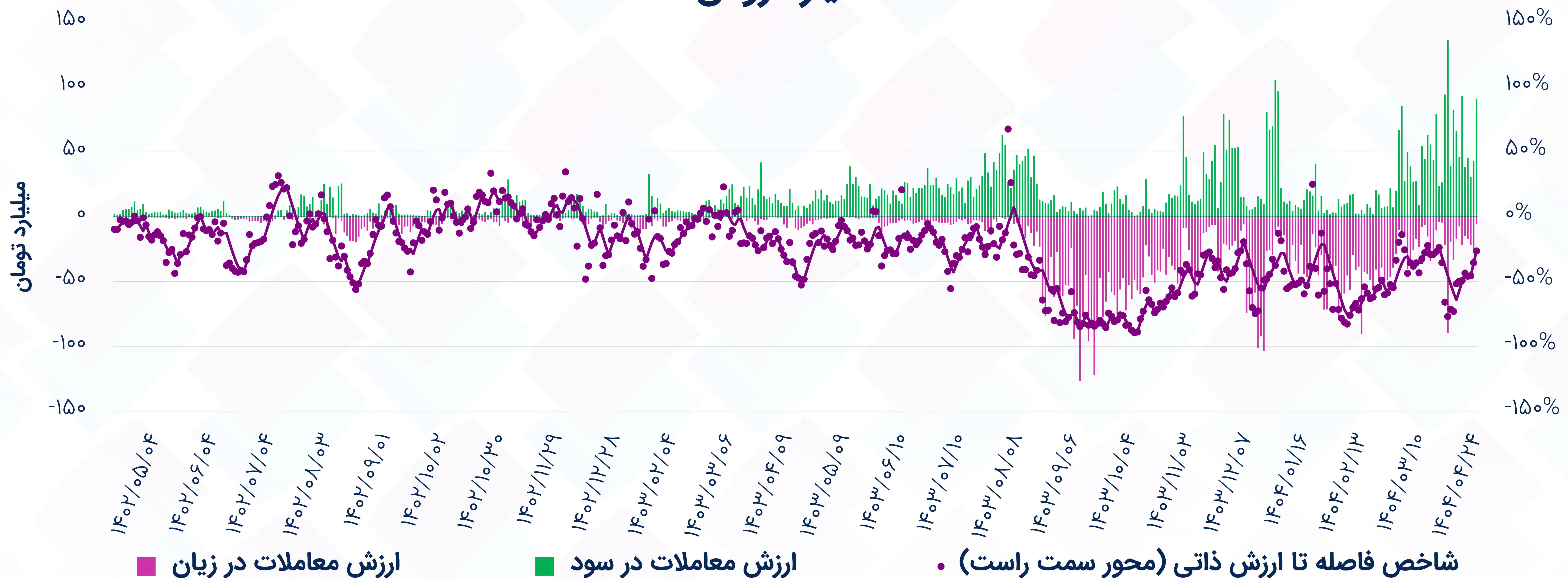
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

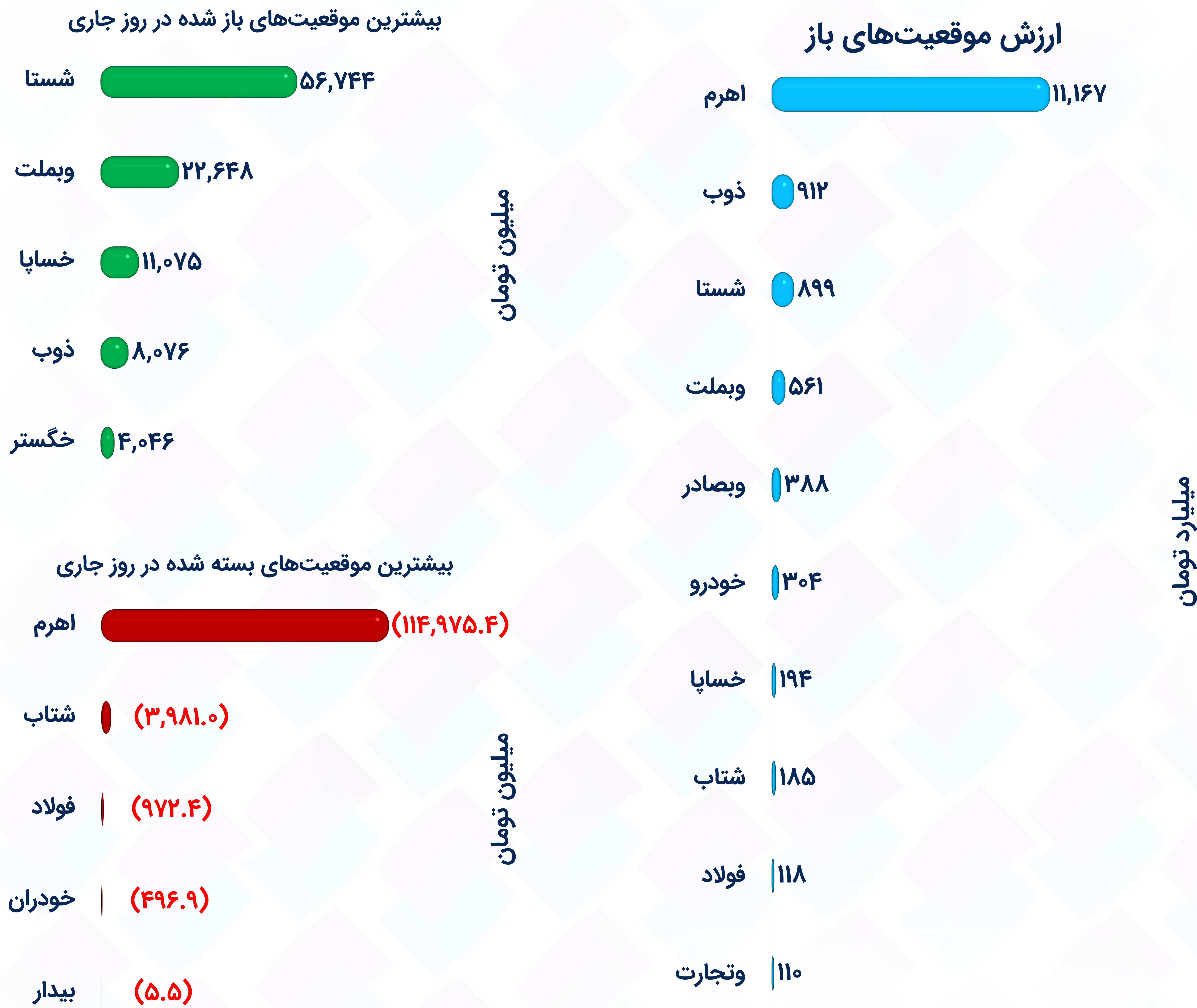
اختیار خرید

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	۴۲	۱۶۶.۹	۶,۱۳۴.۷	۳۷.۶	۱۲۹.۳	(۳۴.۱%)
شستا	۲۶	۷.۴	۲۰۷.۳	۵.۱	۲.۳	۲۸.۸%
خسپا	۱۱	۵.۸	۴۱.۱	۵.۷	۰.۱	۳۰.۳%
وبملت	۲۵	۳.۰	۱۰۷.۵	۲.۶	۰.۴	۳۸.۳%
وبصادر	۱۴	۱.۳	۱۹.۲	۱.۳	۰.۰	۱.۴%
ذوب	۲۱	۱.۰	۲۳.۱	۰.۳	۰.۷	(۳۳.۹%)
فزر	۵	۰.۶	۲.۱	۰.۶	۰.۰	(۴.۹%)

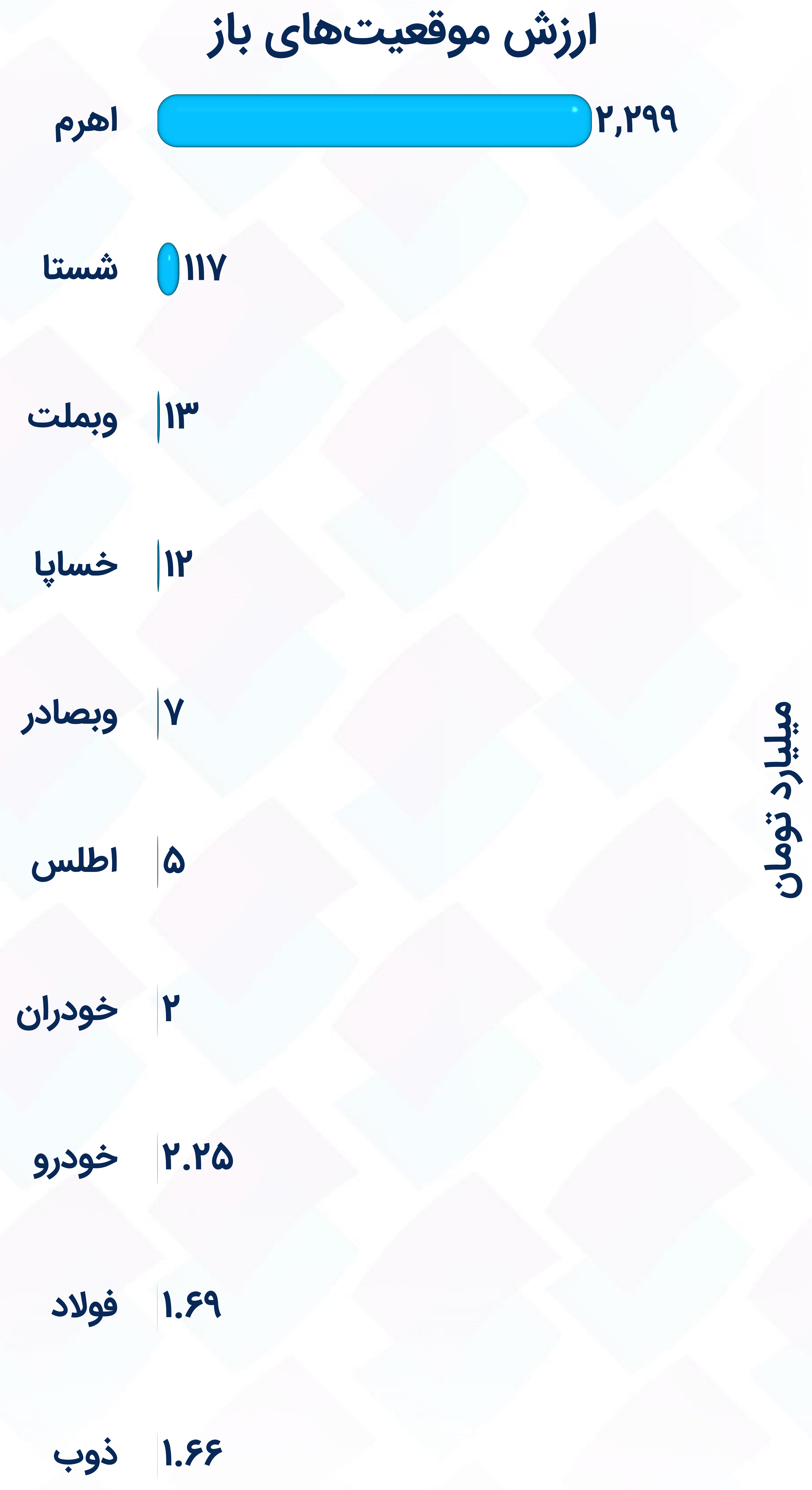
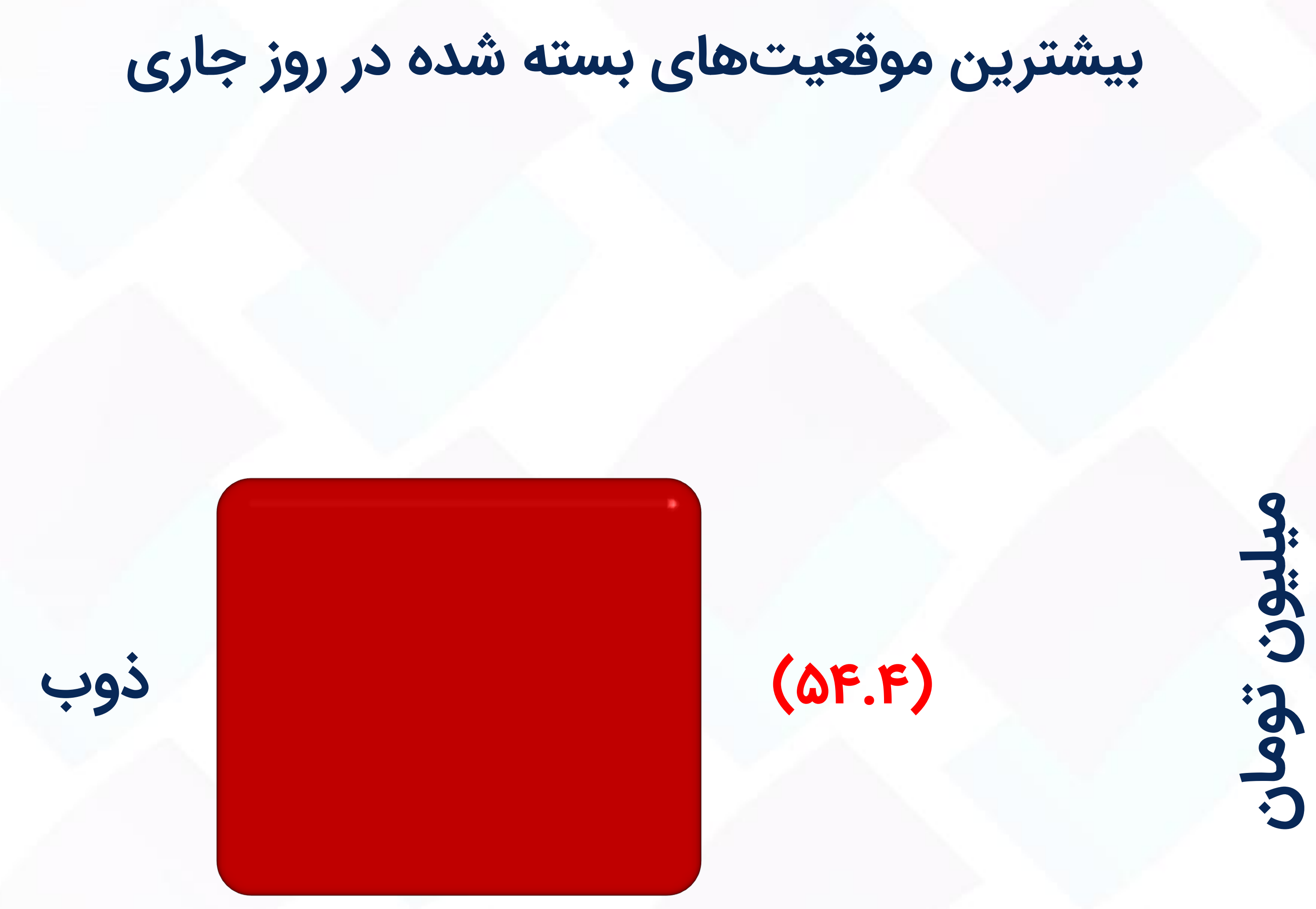
اختیار فروش

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	۹۳,۸۵۲.۵	۲,۰۳۶,۶۵۰.۰	۸۹,۸۷۴.۲	۳,۹۷۸.۳	(۲۵.۸%)
شستا	۸	۱,۳۴۰.۳	۶۵,۰۱۹.۵	۴۸۷.۳	۸۵۲.۹	(۶۹.۹%)
خسپا	۲	۳۰۳.۱	۸,۳۵۹.۶	۰.۰	۳۰۳.۱	۵.۸%
وبملت	۶	۲۴۶.۹	۱۰,۷۲۱.۸	۵.۴	۲۴۱.۵	(۷۱.۹%)
وبصادر	۳	۱۳۲.۰	۳,۲۲۵.۱	۰.۰	۱۳۲.۰	(۴۵.۷%)
جهش	۲	۳۱.۱	۴۱۶.۴	۳۰.۰	۱.۲	(۸.۹%)
ذوب	۲	۲۲.۴	۱۶۶.۱	۲۲.۴	۰.۰	(۱.۶%)

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

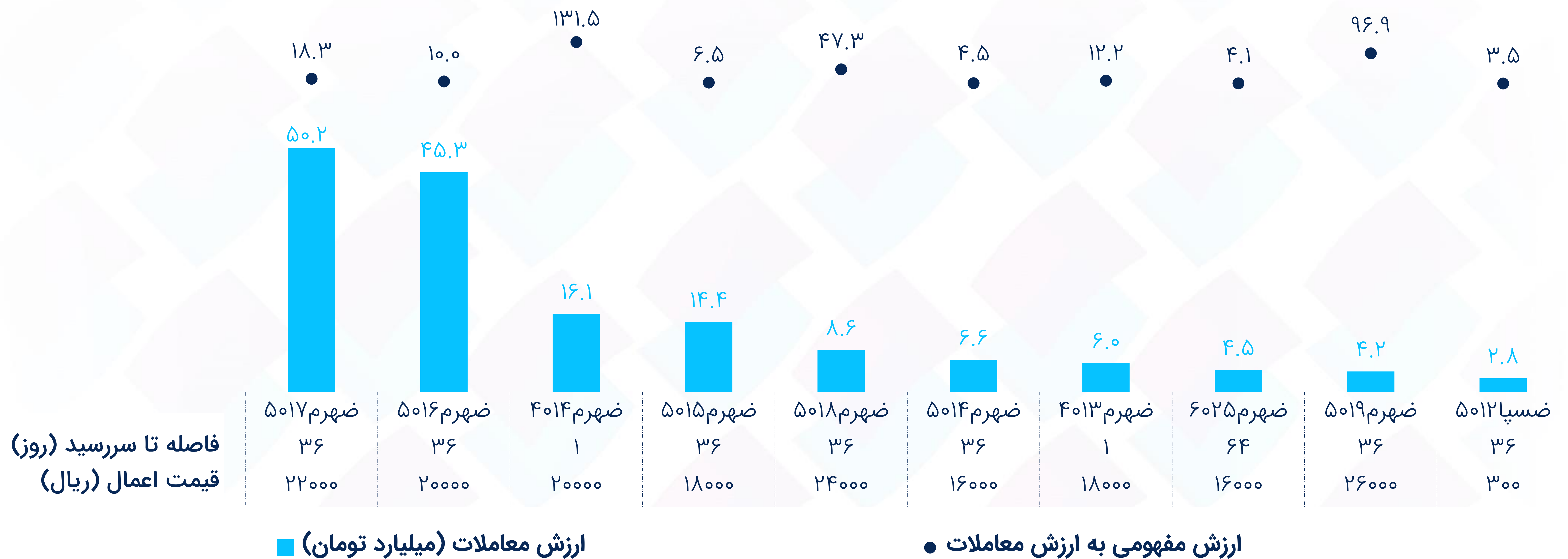


موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش



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	۳۶	۶۰.۹	۵	۴۱۵	۵۰۵	۲۱.۷%	۱۰۱.۰	۰.۳۲	۱۹	۲۹۰%
ضشنا ۶۰۳۰	شنا	۴,۰۰۰	۵۶	۵.۳	۱۰۰	۳,۷۵۲	۴,۱۰۰	۹.۳%	۴۱.۰	۰.۴۹	۱۷۶	۷۶%
ضملت ۵۰۱۶	وبملت	۲,۴۰۰	۲۹	۵۱۵.۴	۸۰	۲,۴۰۲	۲,۴۸۰	۳.۲%	۳۱.۰	۰.۶۳	۱۳۸	۷۳%
ضسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۶	۱,۶۱۹.۲	۳۳	۴۱۵	۴۳۳	۴.۳%	۱۳.۱	۰.۶۶	۵۷	۷۲%
ضملت ۵۰۱۸	وبملت	۲,۸۰۰	۲۹	۱۰۷.۲	۹	۲,۴۰۲	۲,۸۰۹	۱۶.۹%	۳۱۲.۱	۰.۱۳	۱۵	۶۸%

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
ضذوب ۵۰۱۷	ذوب	۹۰۰	۲۹	۱.۸	۱	۳۷۲	۹۰۱	۱۴۲%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضستا ۵۰۳۸	شستا	۲,۲۰۰	۲۲	۱.۲	۲	۱,۲۸۸	۲,۲۰۲	۷۱%	۱,۱۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۴	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۶	۶.۷	۱۶	۱۹,۸۶۰	۴۲,۰۱۶	۱۱۲%	۲,۶۲۶.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۶۴	۵۱.۶	۳۵۵	۱۹,۸۶۰	۴۶,۳۵۵	۱۳۳%	۱۳۰.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۳	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳۶	۲.۷	۳۹	۱۹,۸۶۰	۳۸,۰۳۹	۹۲%	۹۷۵.۴	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
تسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۶	۲۷۴.۳	۲۶	۴۱۵	۳۷۴	(۹.۹%)	۱۴.۴	-۰.۳۴	۲۸	۶.۱%
تسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۶	۲۸.۸	۳	۴۱۵	۲۹۷	(۲۸.۴%)	۹۹.۰	-۰.۰۶	۳	۳.۳%
طهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۶	۱,۲۷۰.۹	۹,۱۵۰	۱۹,۸۶۰	۲۰,۸۵۰	۵.۰%	۲.۳	-۱.۰۰	۹,۰۷۰	(۰.۹%)
طجهش ۶۰۲۱	جهش	۱۰,۰۰۰	۵۰	۳۰.۰	۷۱۷	۹,۳۰۰	۹,۲۸۳	(۰.۲%)	۱۲.۹	-۰.۵۵	۶۶۳	(۷.۶%)
طهرم ۵۰۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۶	۱,۹۴۵.۷	۷,۸۰۸	۱۹,۸۶۰	۲۰,۱۹۲	۱.۷%	۲.۶	-۱.۰۰	۷,۱۴۴	(۸.۵%)

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	۲۹	۰.۱	۱	۶۰۳	۱۹۹	(۶۷.۰%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۵۰۲۷	شتتا	۱,۰۰۰	۲۲	۲.۷	۳	۱,۲۸۸	۹۹۷	(۲۲.۶%)	۳۳۲.۳	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طاطلس ۵۰۱	اطلس	۵۰,۰۰۰	۱۲	۱۷.۰	۱۸۹	۵۷,۲۵۹	۴۹,۸۱۱	(۱۳.۰%)	۲۶۳.۶	۰.۰۰	۱	(۹۹.۵%)
طملت ۵۰۱۳	وبملت	۱,۹۰۰	۲۹	۰.۰	۲۵	۲,۴۰۲	۱,۸۷۵	(۲۱.۹%)	۷۵.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۵%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۶	۹۷.۱	۸۸	۱۹,۸۶۰	۱۴,۹۱۲	(۲۴.۹%)	۱۶۹.۵	۰.۰۰	۲	(۹۸.۱%)

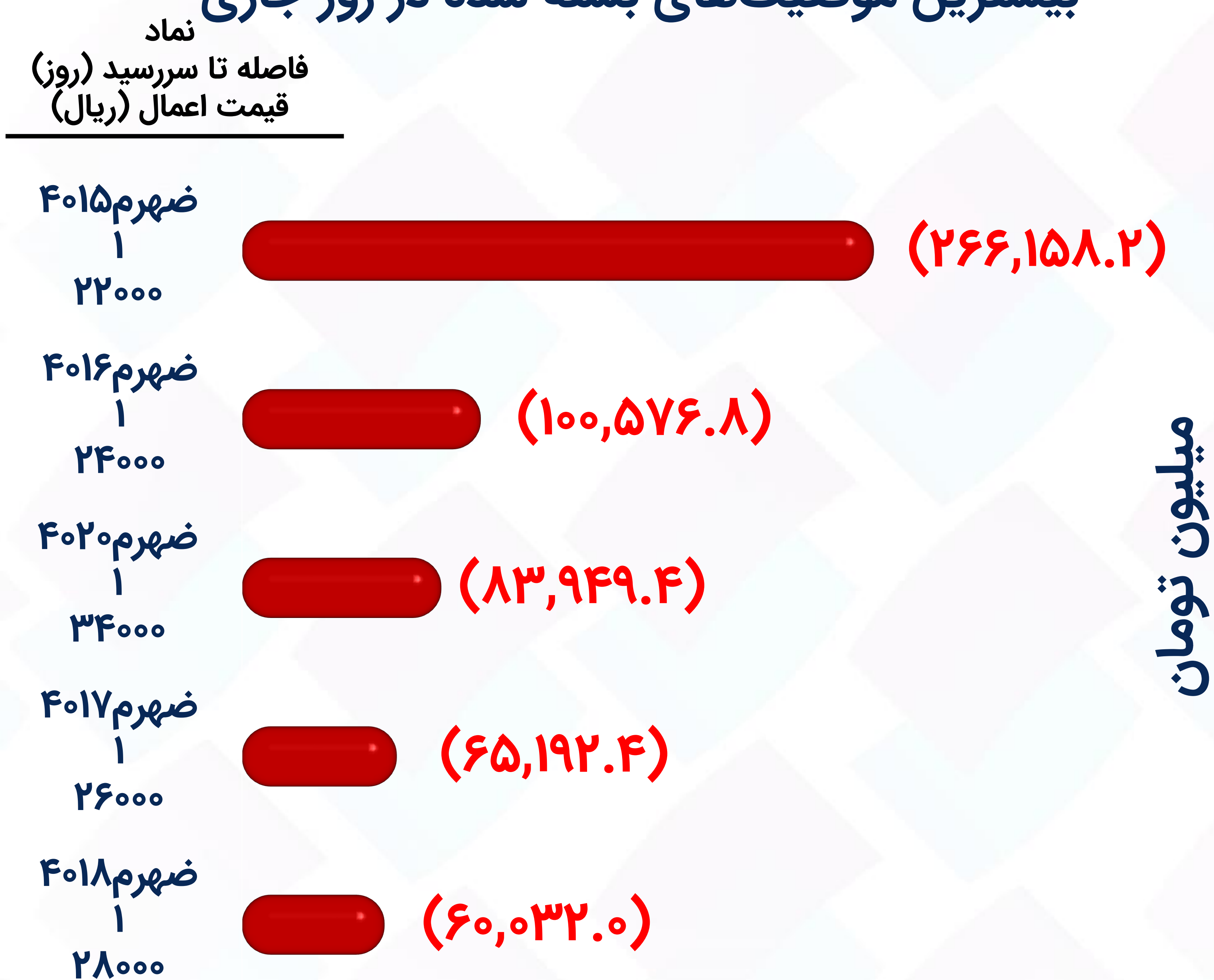
(۱) سربه‌سر: قیمت اختیار - قیمت اعمال (کارمزد معاملات لحاظ نشده است).
تنها نمادهایی با ارزش معاملات بیشتر از یک میلیون تومان لحاظ شده‌اند.

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید

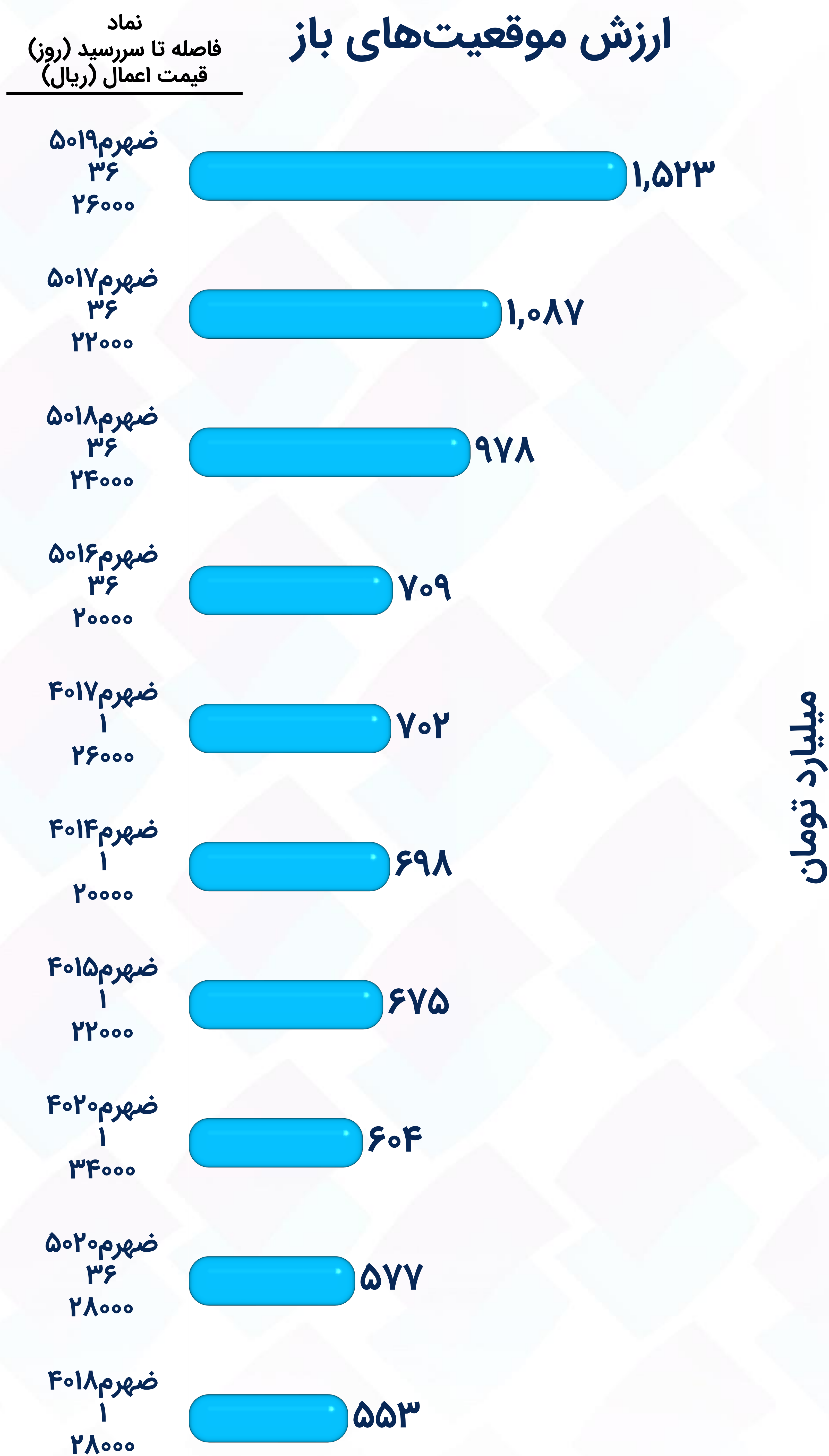
بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



ارزش موقعیت‌های باز



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

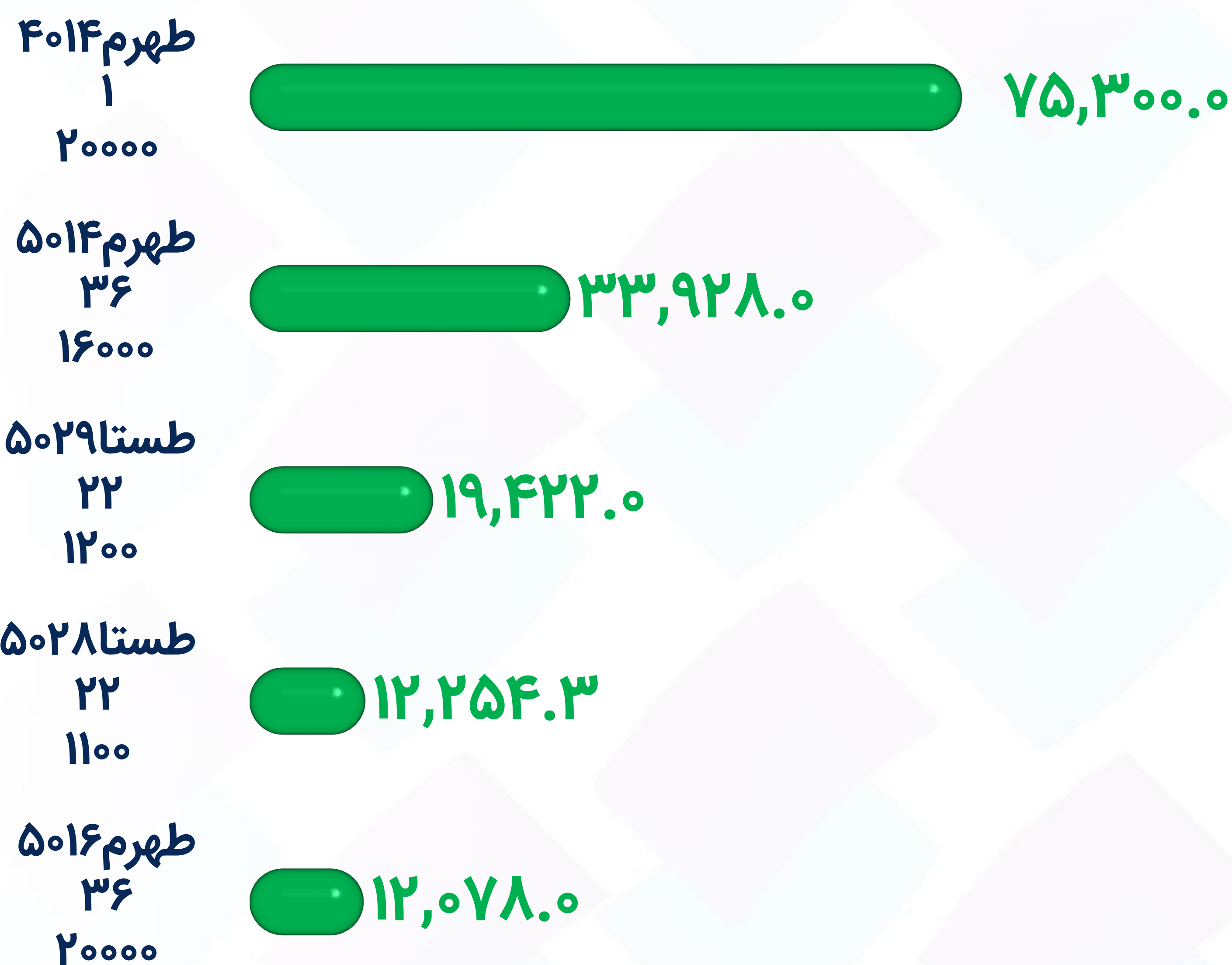
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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

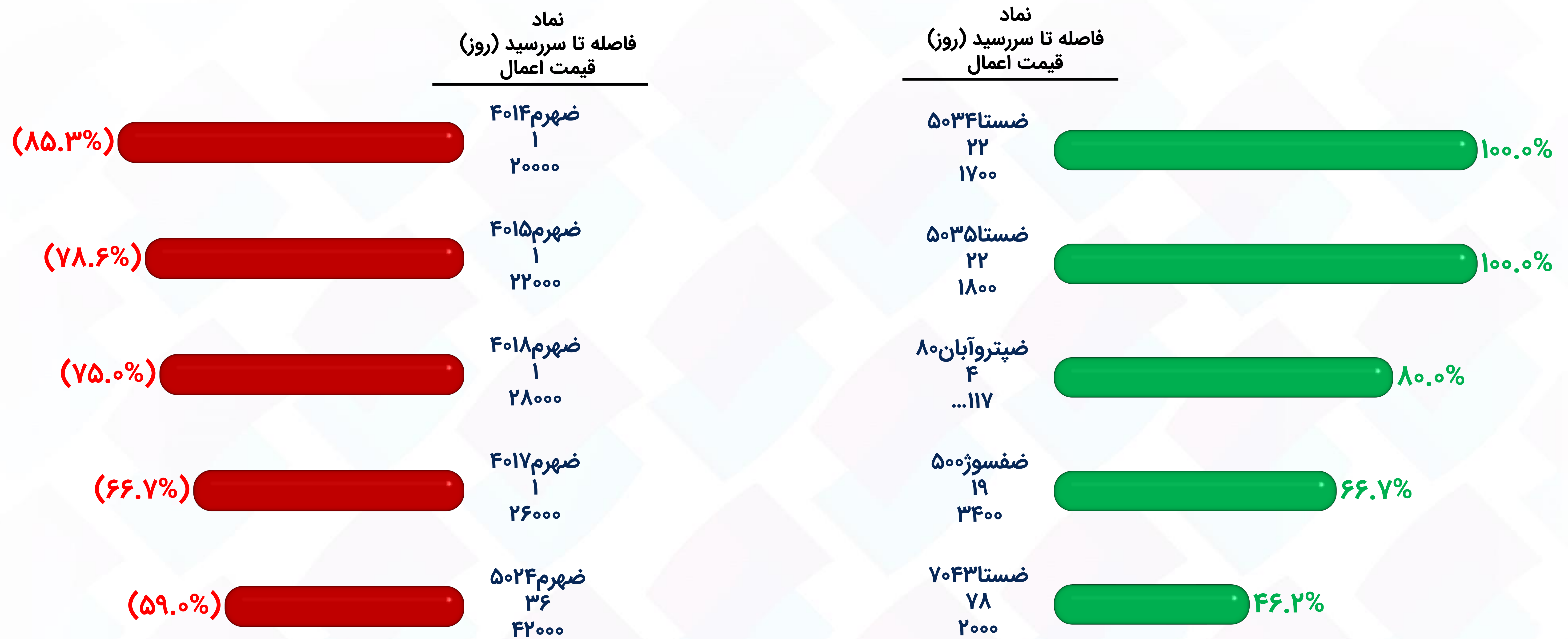
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

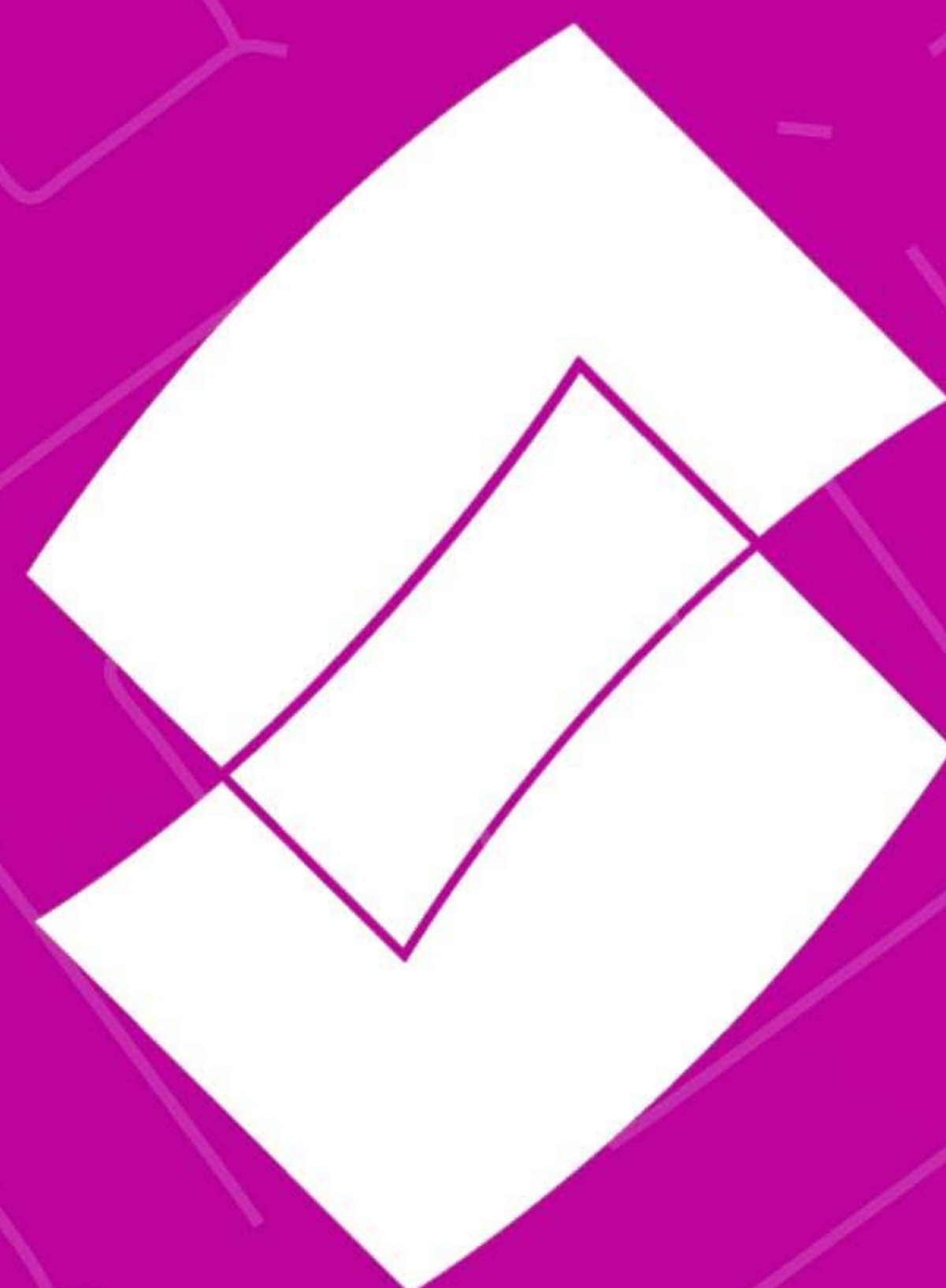
اختیار خرید



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.