

شماره
۵۱۰

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۵ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





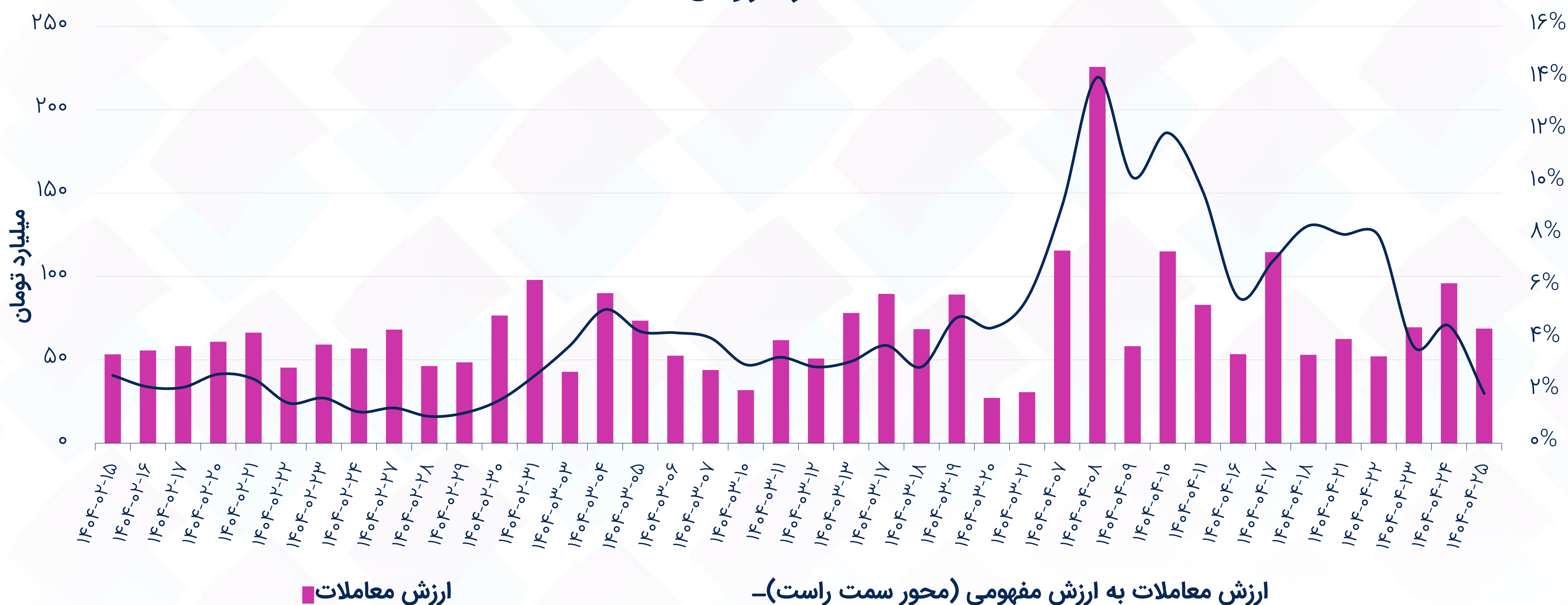
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



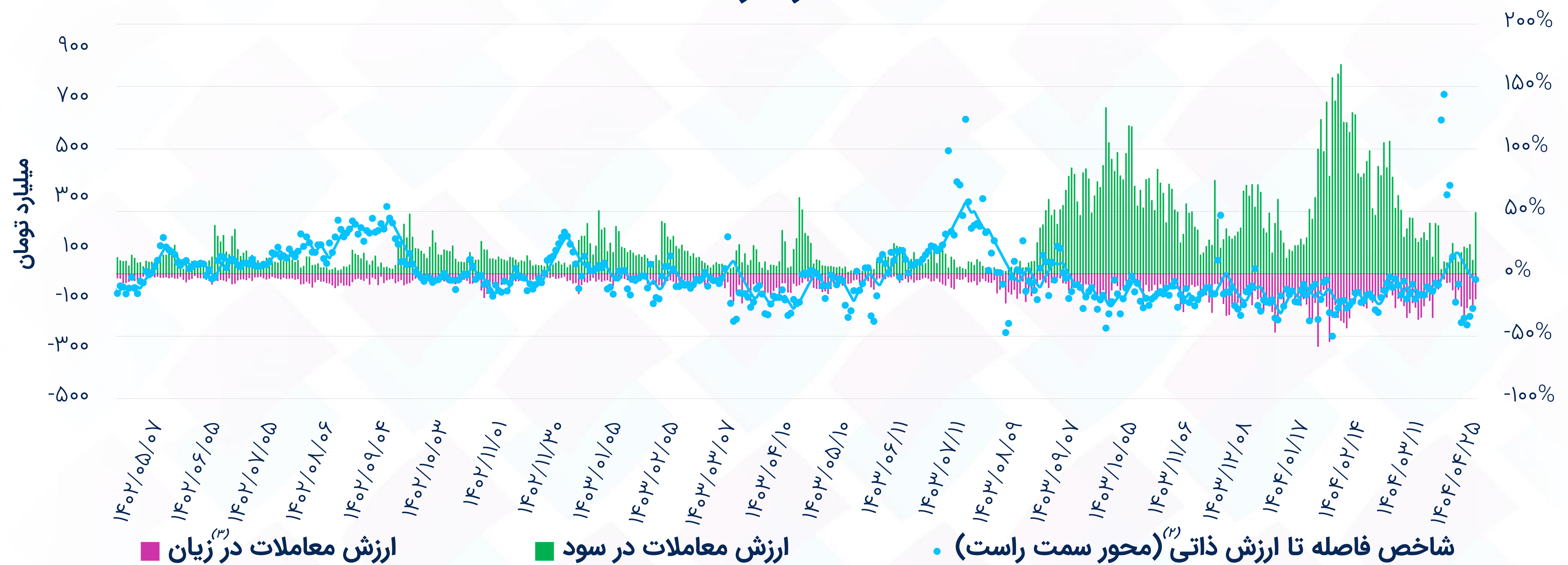
اختیار فروش



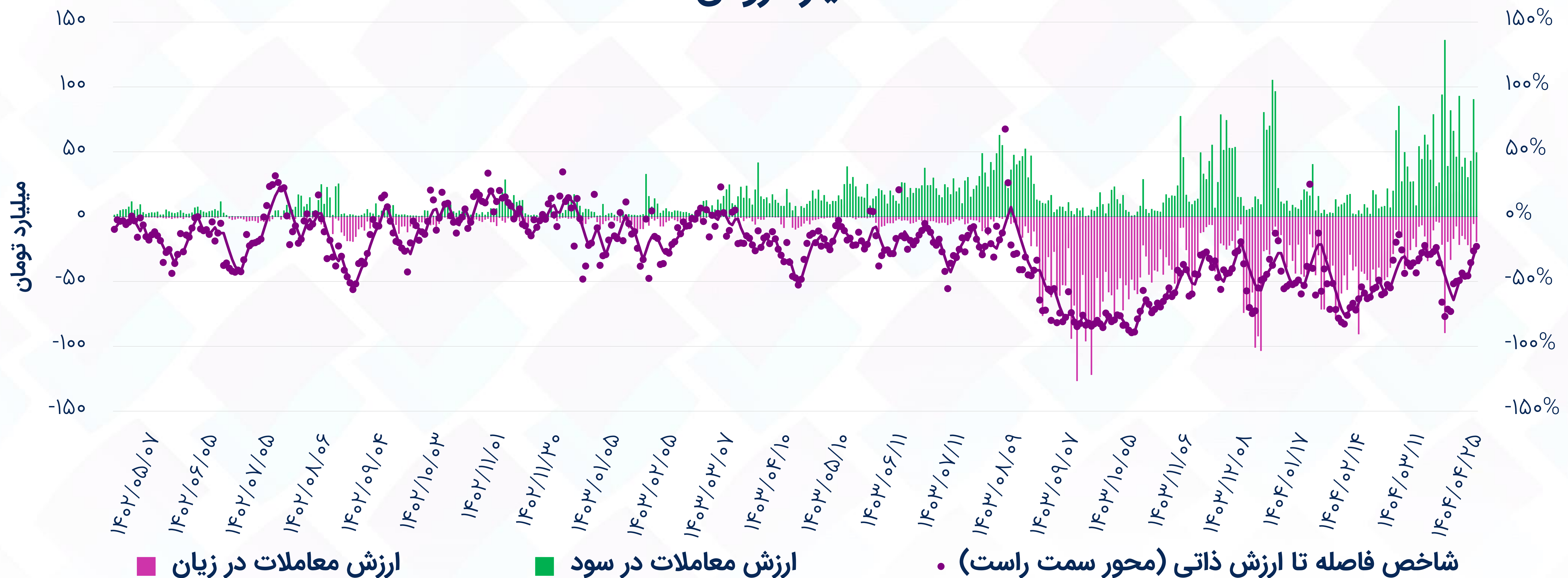
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۴۴	۳۲۵.۵	۱۰,۵۳۴.۲	۲۳۰.۷	۹۴.۸	(۵.۹%)
شستا	۲۷	۶.۰	۲۰۸.۷	۲.۹	۳.۱	۳۰.۲%
وبملت	۳۱	۴.۱	۹۹.۸	۳.۹	۰.۲	۲۵.۹%
خسپا	۱۳	۳.۹	۲۹.۵	۳.۹	۰.۱	۳۲.۲%
دوب	۲۲	۲.۷	۳۸.۵	۱.۴	۱.۳	(۲۶.۱%)
وبصادر	۱۲	۰.۸	۲۳.۵	۰.۷	۰.۱	(۲.۹%)
شتاب	۵	۰.۷	۲۴.۲	۰.۶	۰.۱	(۱.۲%)

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	۶۷,۶۱۶.۱	۳,۵۳۵,۰۳۷.۷	۴۸,۹۹۴.۴	۱۸,۶۲۱.۸	(۲۲.۵%)
شستا	۱۰	۸۵۳.۵	۵۲,۳۳۱.۴	۳۶۴.۳	۴۸۹.۳	(۶۶.۰%)
خسپا	۲	۱۵۳.۱	۴,۲۴۷.۱	۰.۰	۱۵۳.۱	۹.۵%
وبملت	۶	۴۴.۱	۲,۰۵۰.۰	۴.۹	۳۹.۳	(۵۸.۸%)
جهش	۲	۳۵.۸	۶۹۳.۴	۳۱.۵	۴.۲	(۱۳.۵%)
اطلس	۳	۲۷.۳	۲,۲۴۲.۸	۲۴.۴	۲.۸	(۱۴.۷%)
وبصادر	۲	۱۰.۵	۳۰۸.۲	۰.۰	۱۰.۵	(۳۳.۹%)

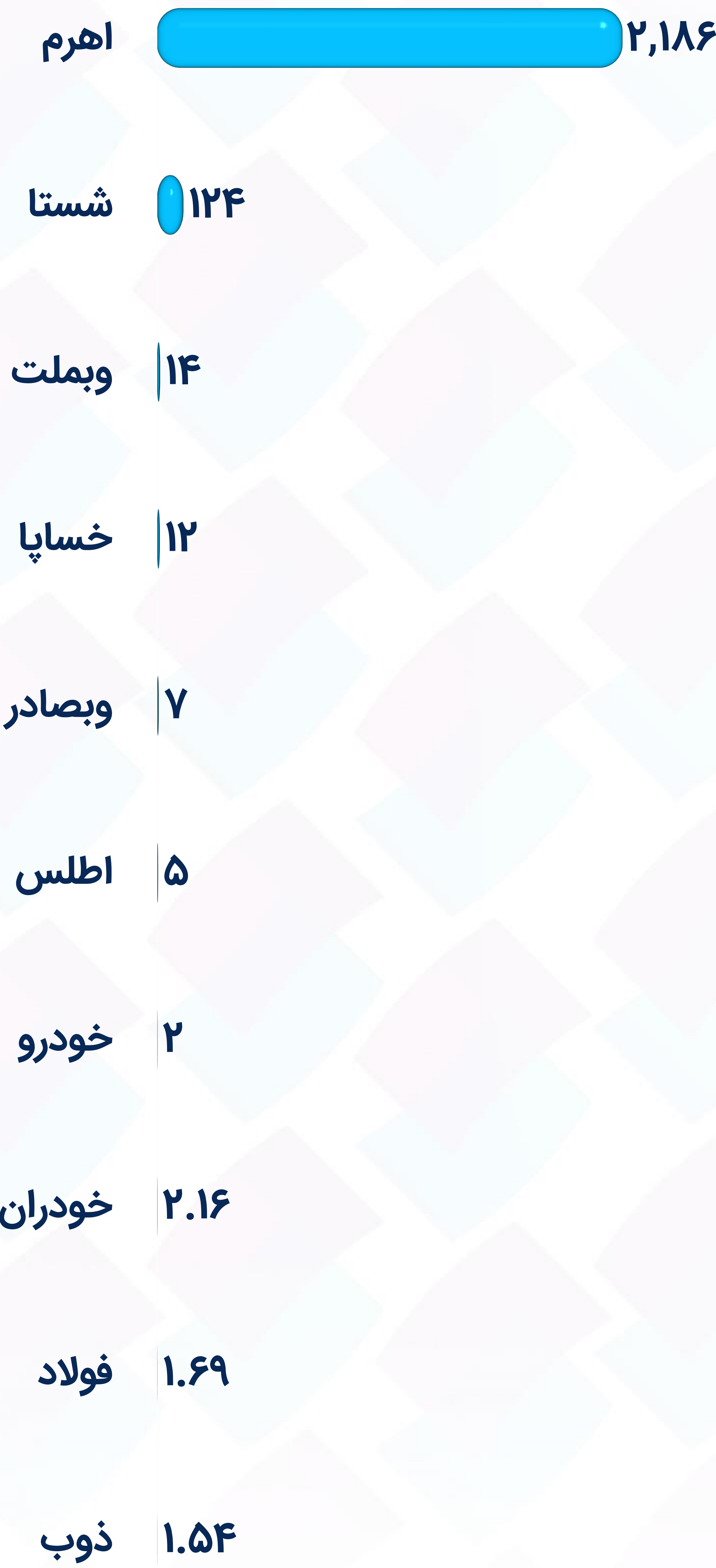
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

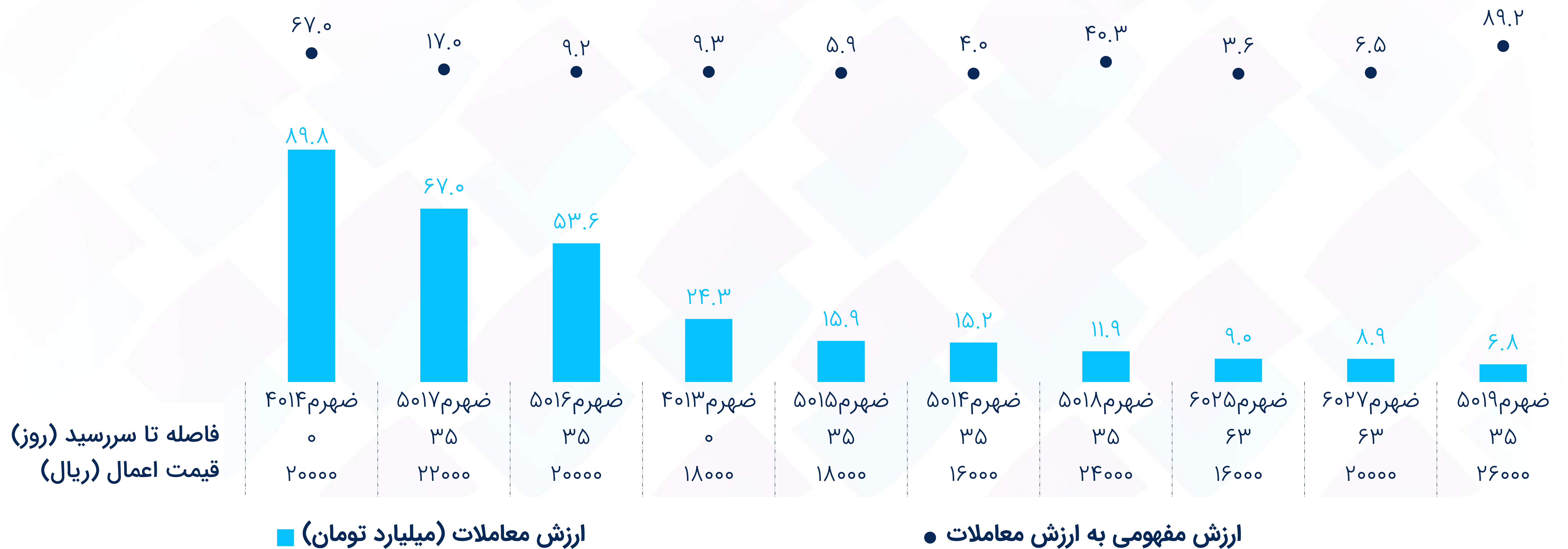
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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	۳۵	۴۴.۶	۵	۴۱۶	۵۰۵	۲۱.۴%	۱۰۱.۰	۰.۳۲	۱۹	۲۷۷%
ضسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۵	۹۷۷.۸	۳۴	۴۱۶	۴۳۴	۴.۳%	۱۲.۸	۰.۶۶	۵۶	۶۶%
ضسپا ۶۰۳۱	خسپا	۵۰۰	۶۳	۱۲.۶	۲۰	۴۱۶	۵۲۰	۲۵.۰%	۲۶.۰	۰.۴۰	۳۲	۶۰%
ضمخا ۵۰۰۳	اخبر	۵۶۰	۲۸	۲۰۰.۴	۲۳	۵۵۹	۵۸۳	۴.۳%	۲۵.۳	۰.۶۱	۳۵	۵۳%
ضستا ۵۰۳۰	شستا	۱,۳۰۰	۲۱	۲,۴۳۵.۰	۳۴	۱,۲۹۴	۱,۳۳۴	۳.۱%	۳۹.۲	۰.۶۰	۵۲	۵۲%

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
ضفلا ۵۰۲۳	فولاد	۶,۵۰۰	۲۱	۲۹.۶	۷	۳,۱۶۷	۶,۵۰۷	۱۰۵%	۹۲۹.۶	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۵۰۱۵	ذوب	۷۰۰	۲۸	۱.۹	۱	۳۷۲	۷۰۱	۸۸%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۴	اهرم	۴۲,۰۰۰	۳۵	۱۲.۱	۴۴	۲۰,۴۳۰	۴۲,۰۴۴	۱۰۶%	۹۵۵.۵	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۶۳	۲۱.۵	۲۱۳	۲۰,۴۳۰	۴۶,۲۱۳	۱۲۶%	۲۱۷.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۳	اهرم	۳۸,۰۰۰	۳۵	۶.۳	۵۹	۲۰,۴۳۰	۳۸,۰۵۹	۸۶%	۶۴۵.۱	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

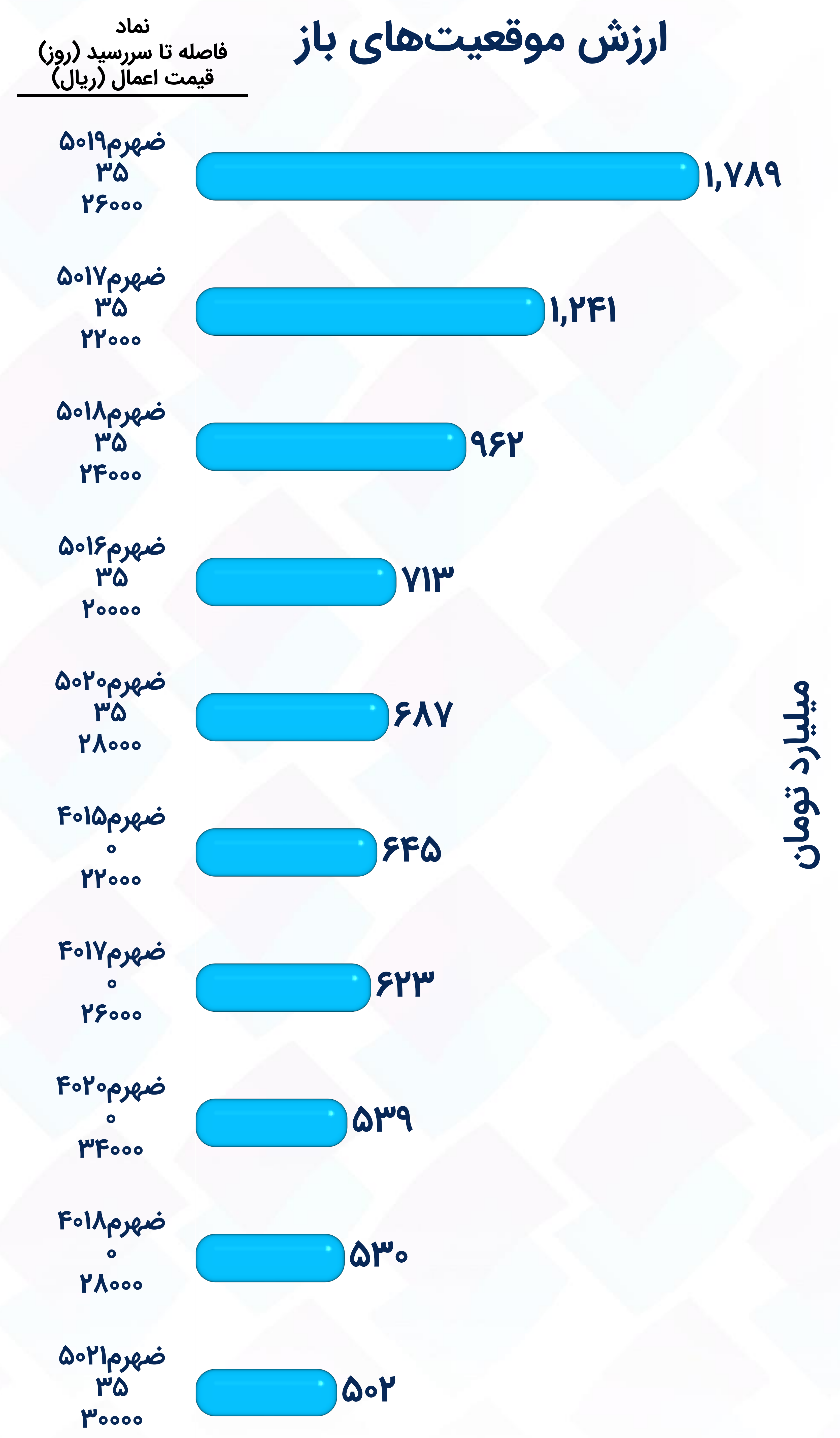
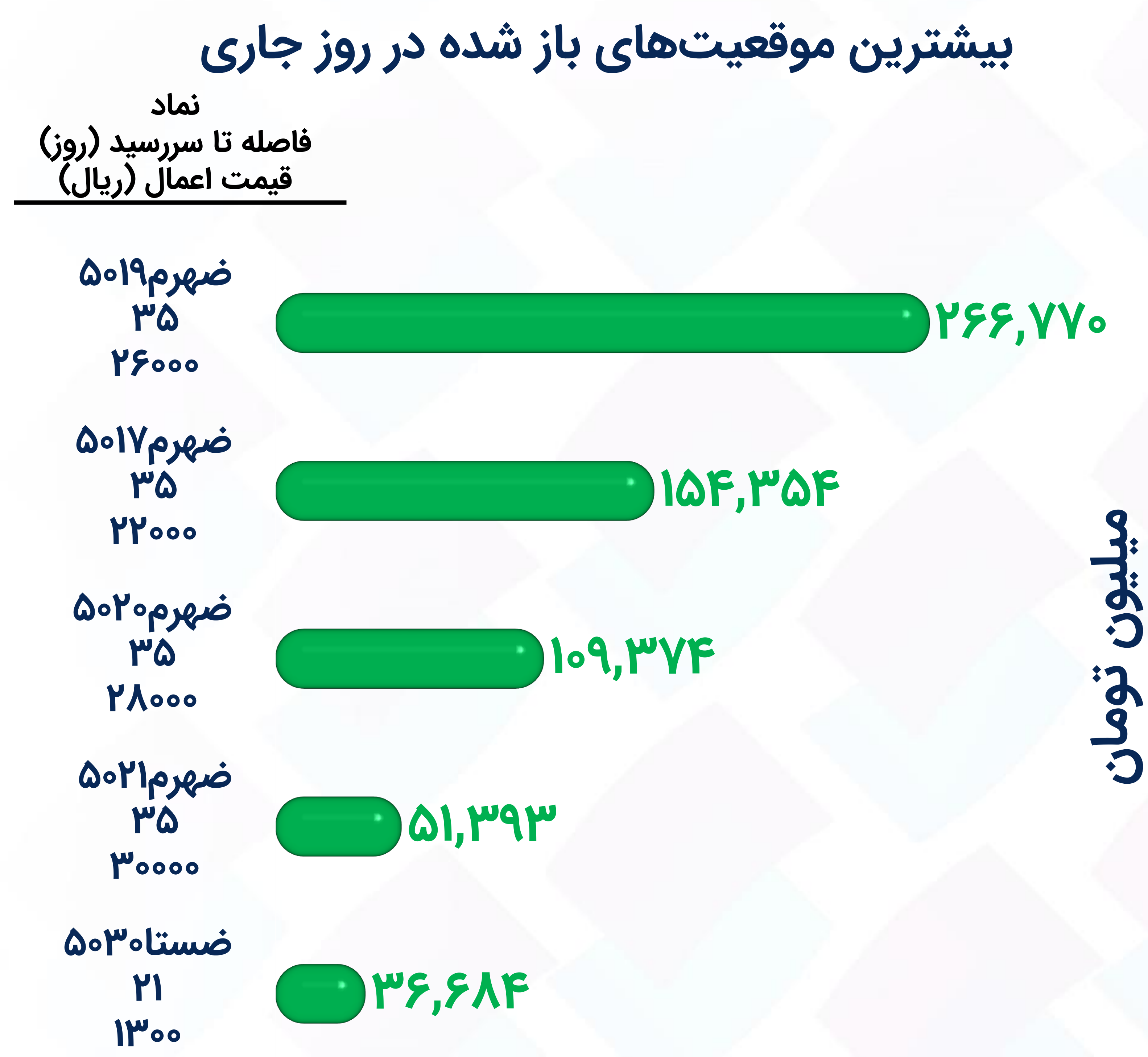
نماد	دارایی پایه	قیمت اعمال	فاصله تا سررسید (روز)	ارزش معاملات (میلیون تومان)	قیمت اختیار	قیمت دارایی پایه	سربه‌سر ^(۱)	فاصله تا سربه‌سر ^(۲)	اهرم ^(۳)	دلتا	ارزش ذاتی (بلک شولز)	فاصله تا ارزش ذاتی
طهرم ۶۰۳۱	اهرم	۲۸,۰۰۰	۶۳	۱.۵	۵,۰۰۲	۲۰,۴۳۰	۲۲,۹۹۸	۱۲.۶%	۴.۶	-۰.۹۶	۶,۰۷۵	۲۱.۵%
طسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۵	۱۳۹.۹	۲۴	۴۱۶	۳۷۶	(۹.۶%)	۱۵.۷	-۰.۳۴	۲۷	۱۱.۰%
طهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۵	۵۷۲.۵	۸,۸۰۸	۲۰,۴۳۰	۲۱,۱۹۲	۳.۷%	۲.۴	-۱.۰۰	۸,۵۳۸	(۳.۱%)
طهرم ۵۰۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۵	۱,۶۳۳.۳	۶,۸۶۸	۲۰,۴۳۰	۲۱,۱۳۲	۳.۴%	۳.۱	-۰.۹۹	۶,۶۱۱	(۳.۷%)
طاطلس ۵۰۳	اطلس	۶۰,۰۰۰	۱۱	۲۴.۴	۱,۵۱۷	۵۸,۷۰۶	۵۸,۴۸۳	(۰.۴%)	۳۸.۶	-۰.۵۹	۱,۴۳۸	(۵.۲%)

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	۲۸	۰.۰	۱	۶۰۵	۱۹۹	(۶۷.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طاطلس ۵۰۱	اطلس	۵۰,۰۰۰	۱۱	۲.۰	۱۰۰	۵۸,۷۰۶	۴۹,۹۰۰	(۱۵.۰%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طستا ۵۰۲۷	ثستا	۱,۰۰۰	۲۱	۱.۹	۲	۱,۲۹۴	۹۹۸	(۲۲.۹%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۸%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۵	۹۰.۱	۶۵	۲۰,۴۳۰	۱۴,۹۳۵	(۲۶.۹%)	۲۲۹.۸	۰.۰۰	۱	(۹۹.۱%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۳۵	۸۸۳.۲	۹۸	۲۰,۴۳۰	۱۵,۹۰۲	(۲۲.۲%)	۱۶۲.۳	-۰.۰۱	۴	(۹۵.۷%)

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

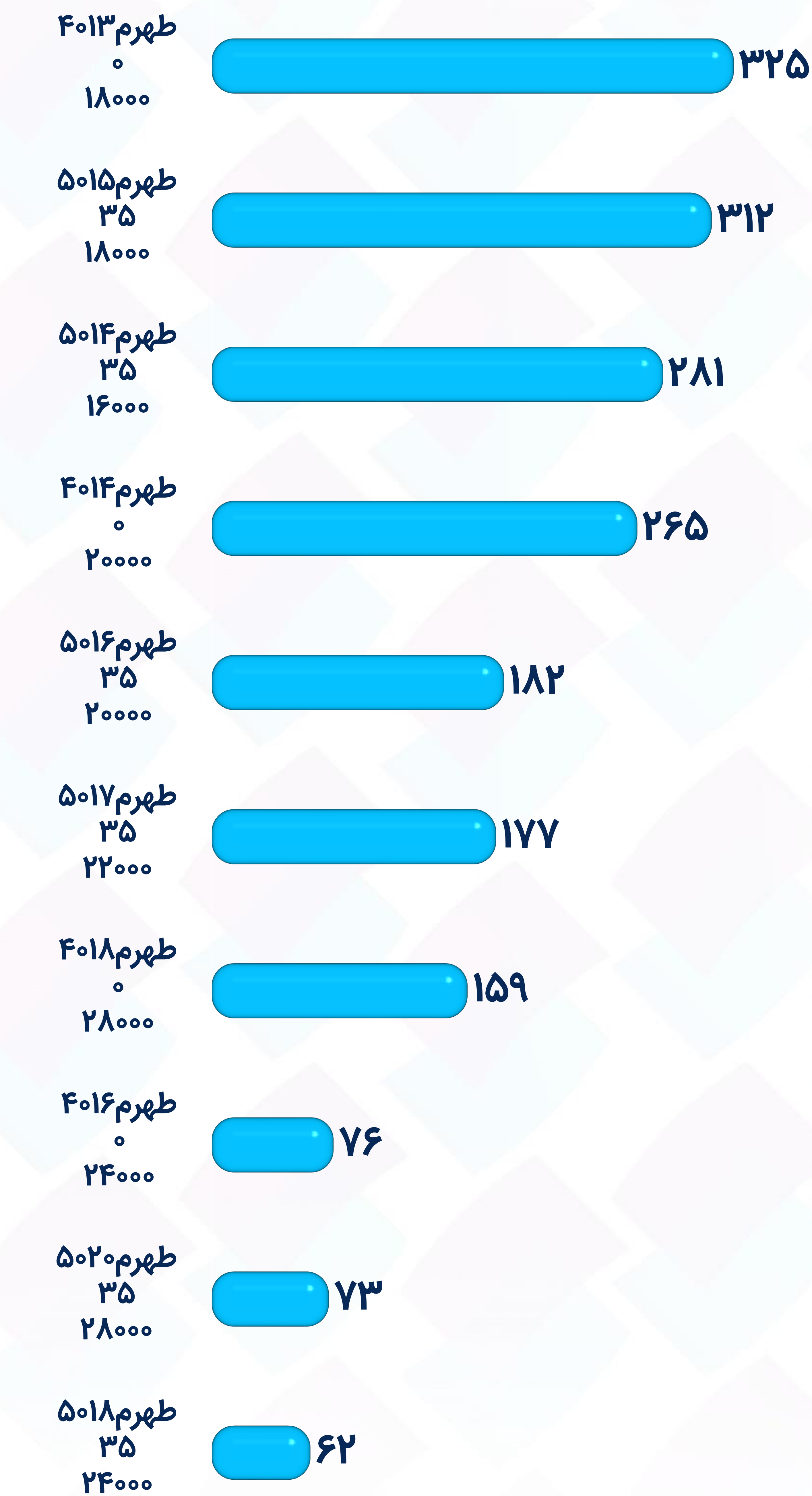
موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار خرید



موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

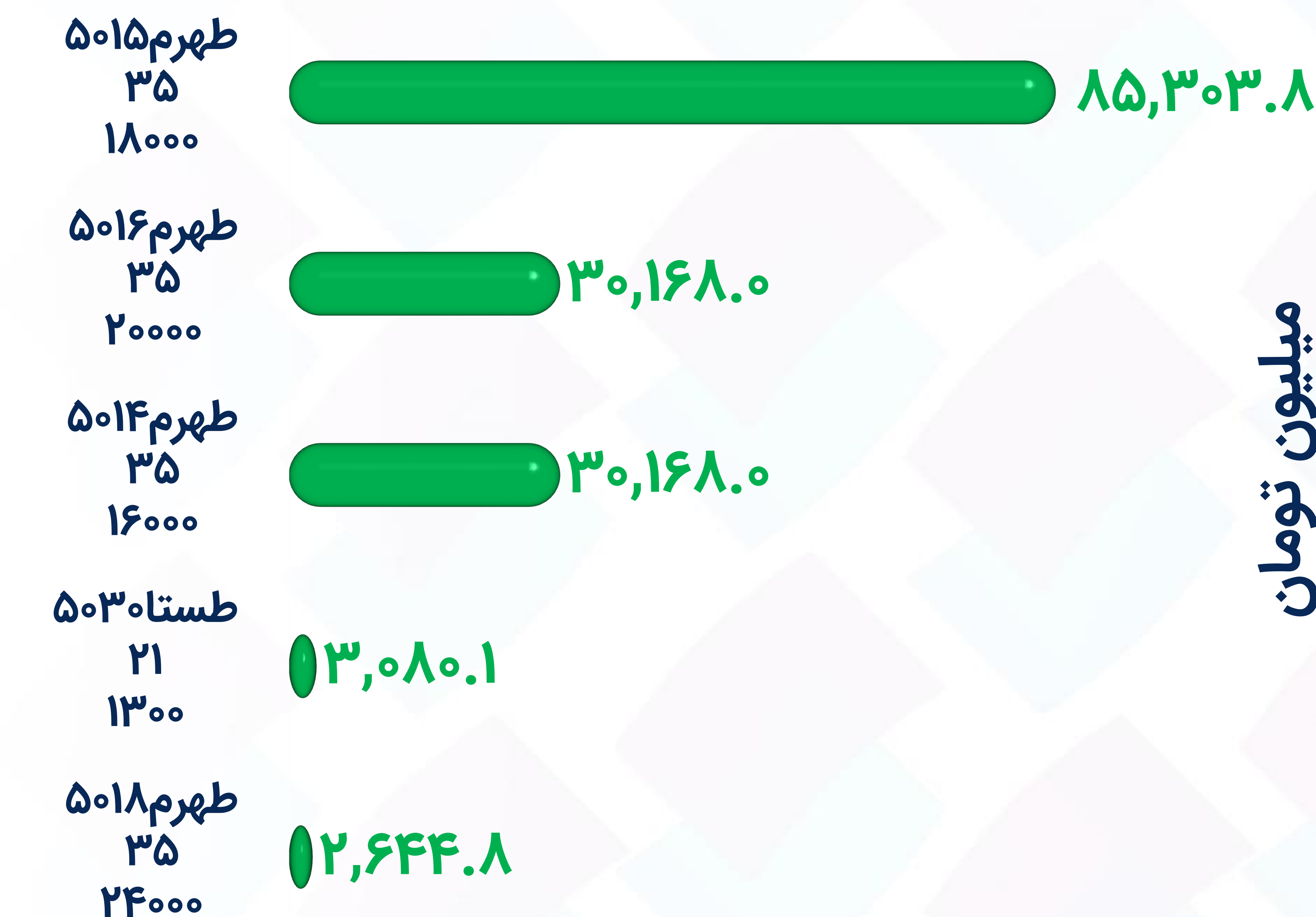
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

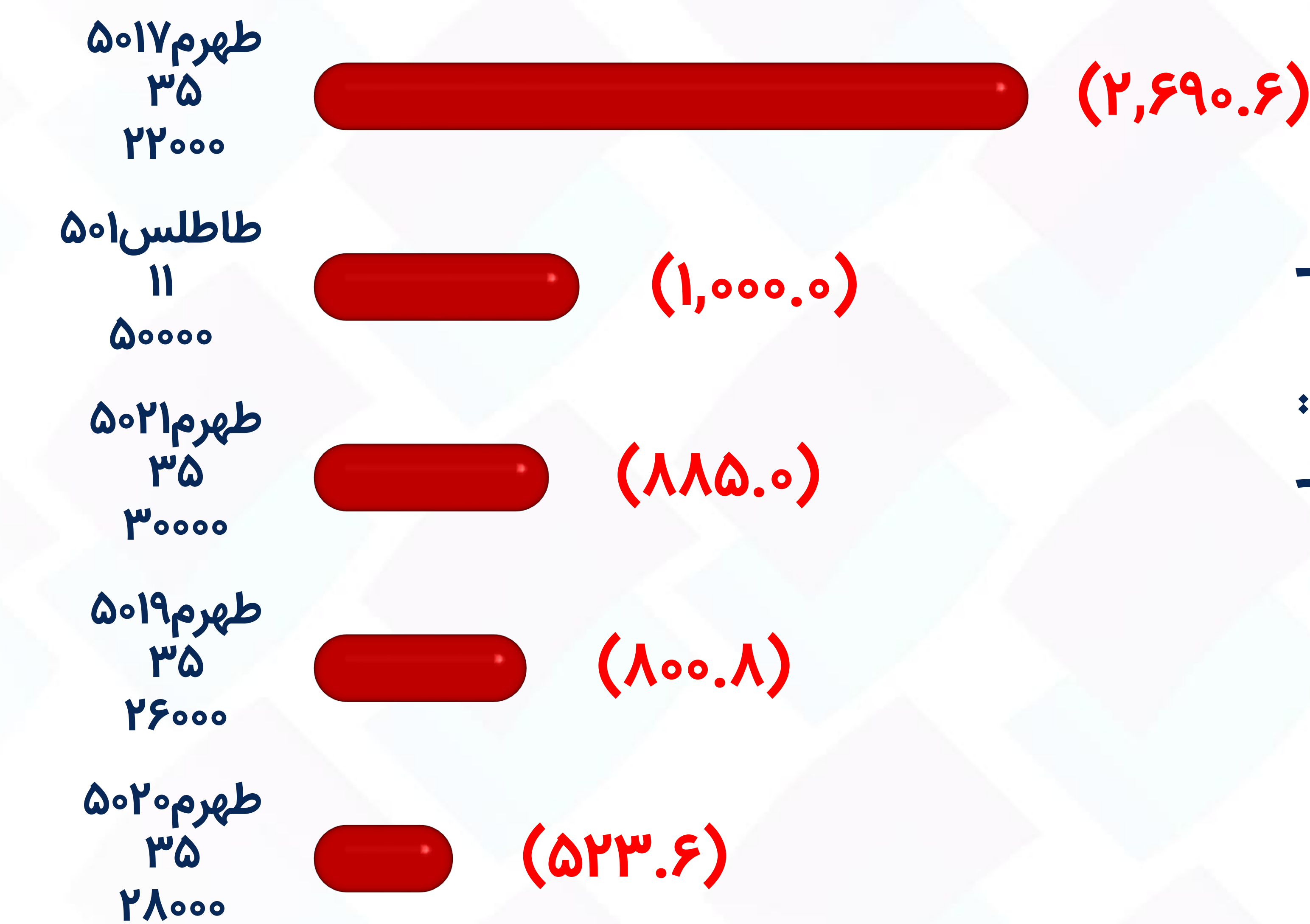
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

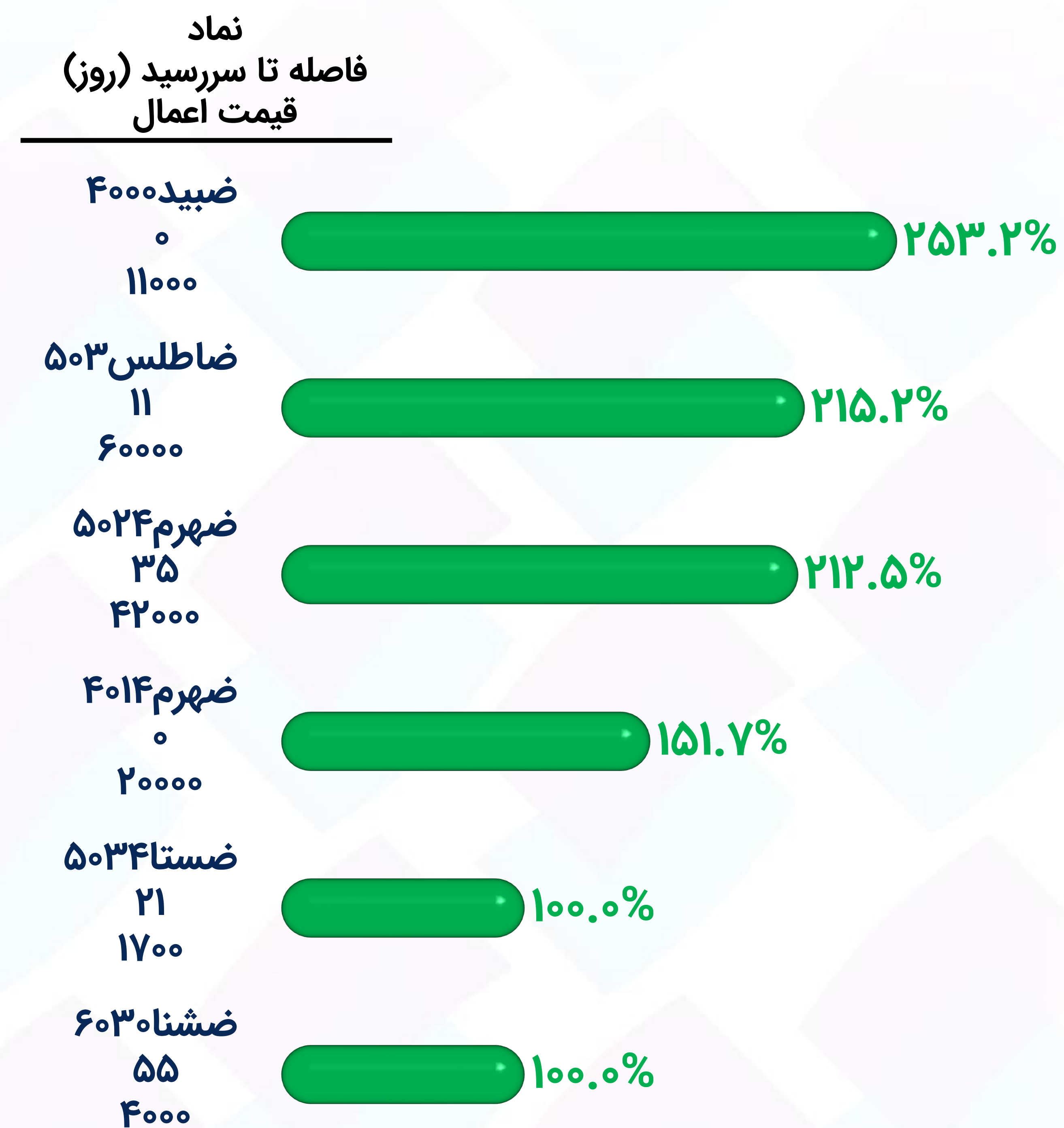
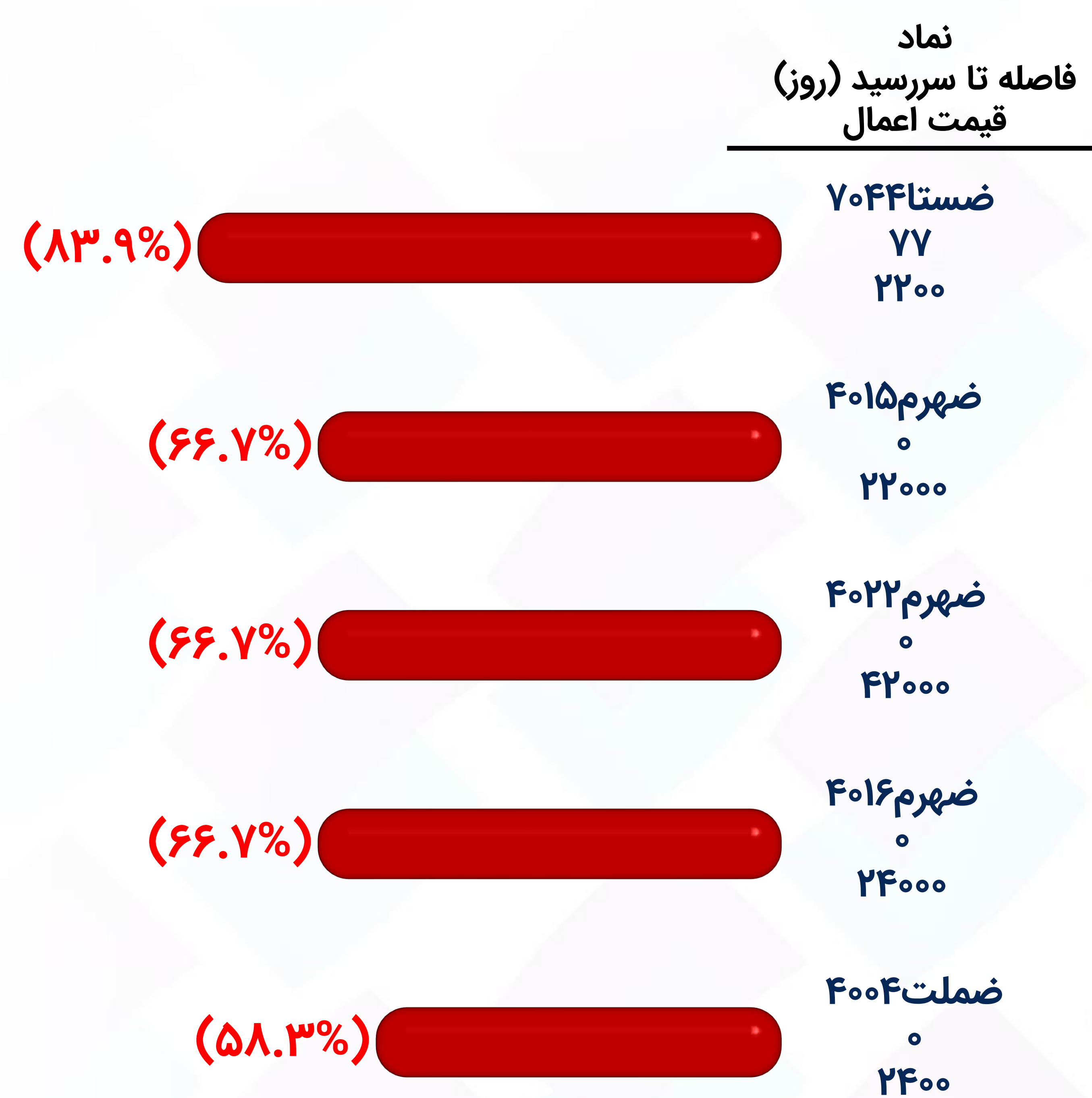
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



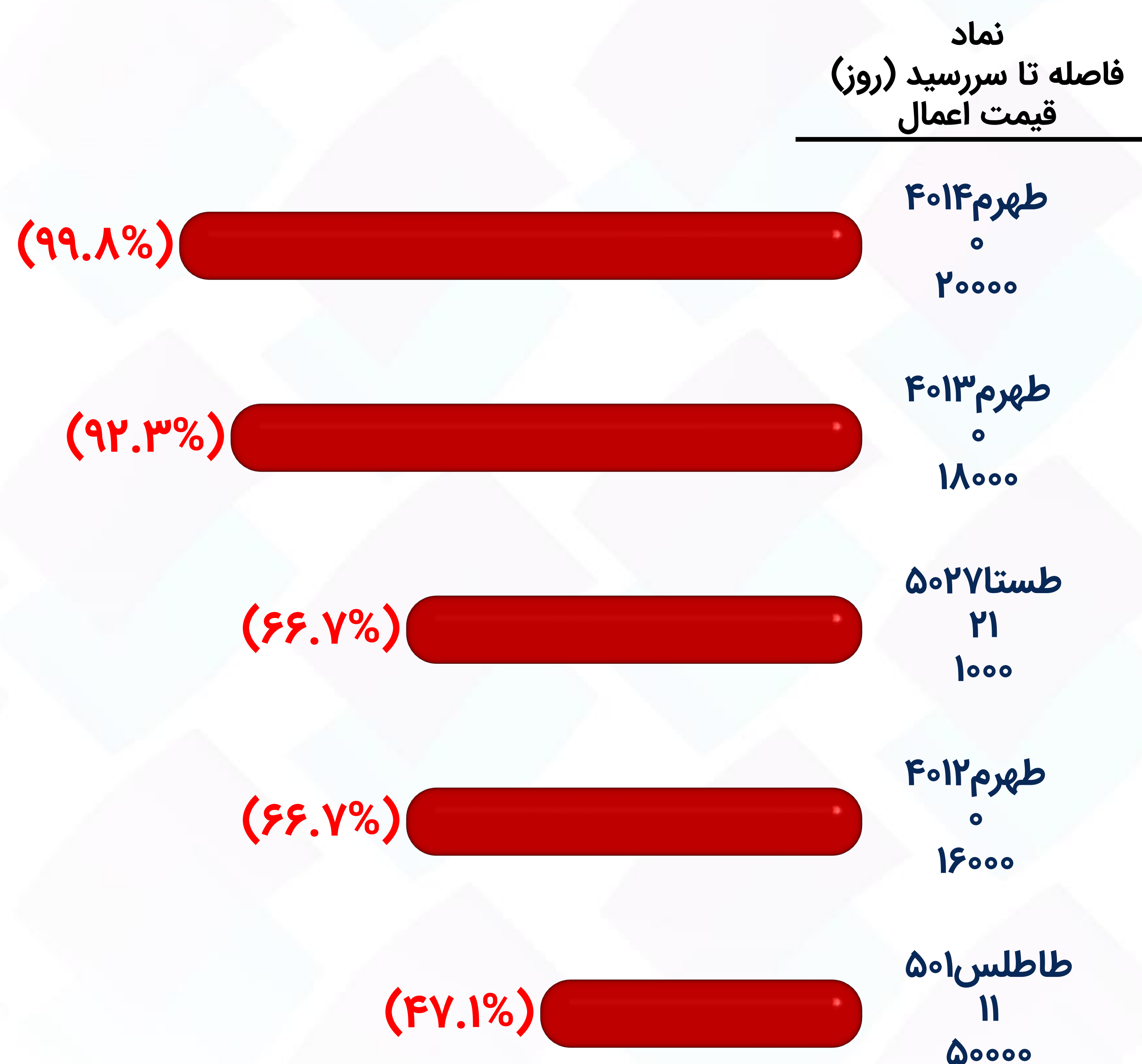
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

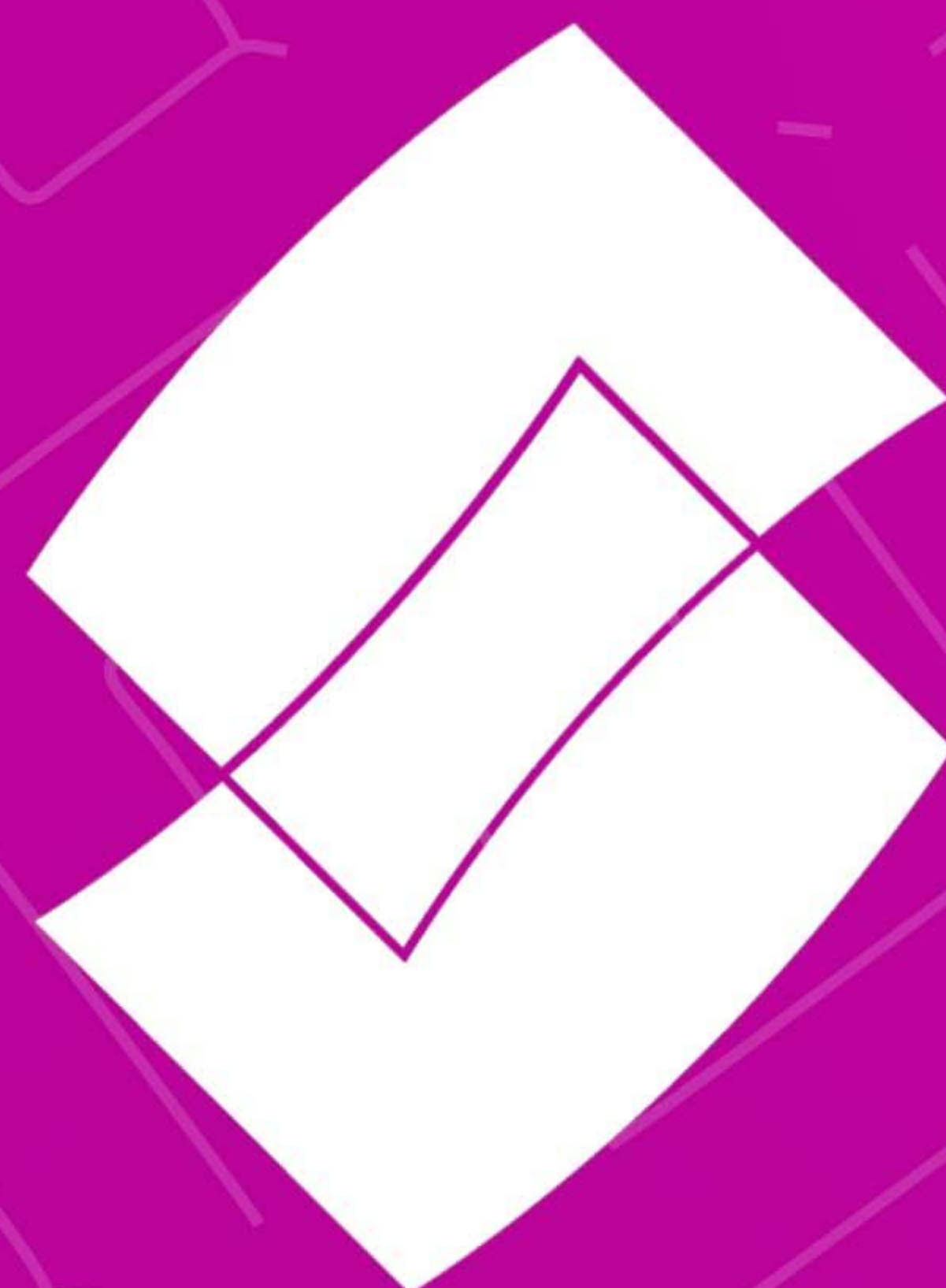
اختیار خرید



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.