

شماره
۵۱۱

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۸ 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



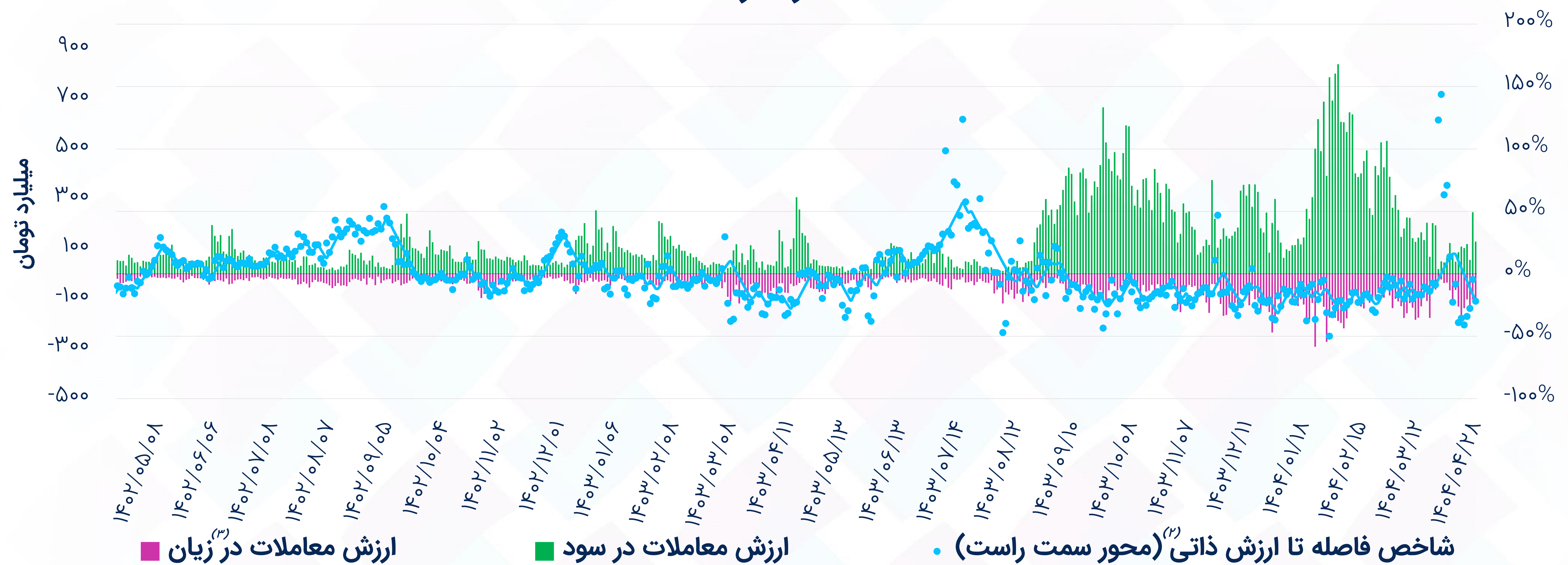
اختیار فروش



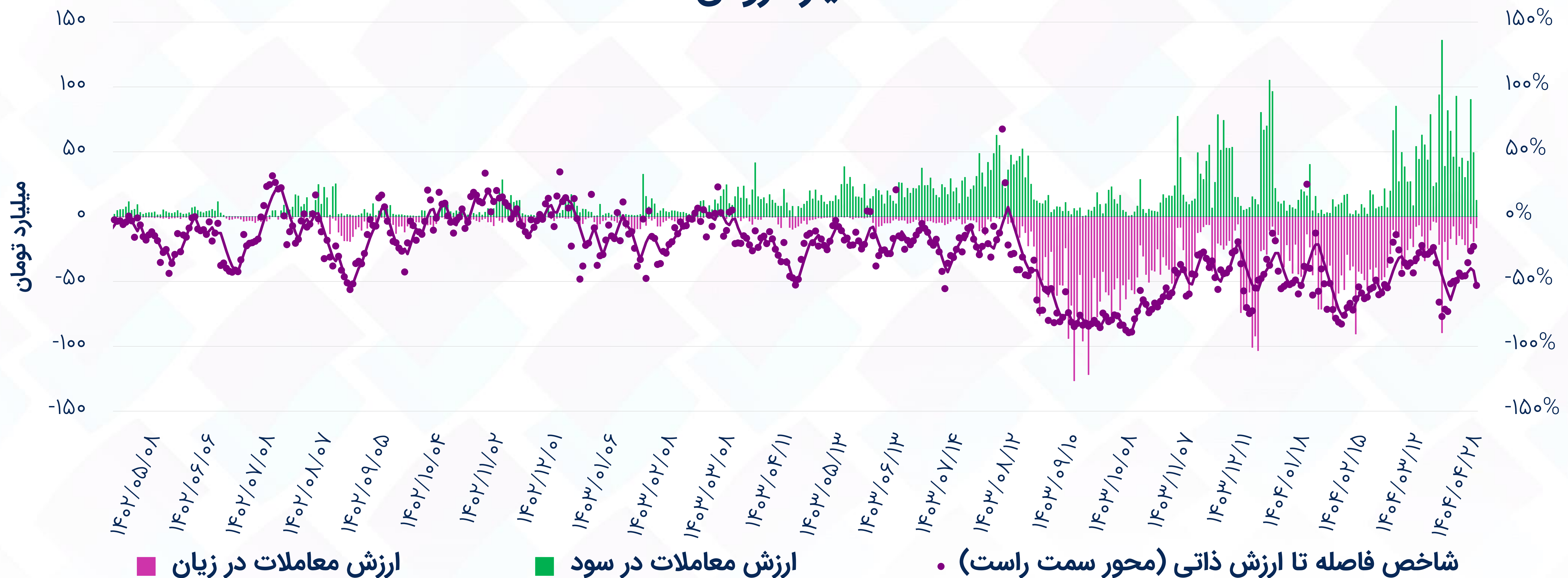
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۱	۱۹۹.۷	۲,۱۰۳.۲	۱۰۱.۱	۹۸.۶	(۲۸.۳%)
تیام	۹	۹.۸	۴۷.۳	۹.۷	۰.۰	(۳.۰%)
شستا	۲۴	۹.۷	۳۳۴.۳	۳.۹	۵.۷	۲۳.۹%
خسپا	۱۵	۴.۷	۴۵.۹	۴.۵	۰.۱	۴۶.۷%
وبملت	۱۶	۳.۸	۷۹.۲	۳.۴	۰.۴	۲۹.۶%
ذوب	۲۰	۳.۵	۹۳.۷	۰.۹	۲.۶	(۳۰.۷%)
شتاب	۴	۱.۲	۴۱.۹	۱.۱	۰.۲	۱۶.۰%

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	۱۹	۱۸,۵۶۴.۸	۱۹۴,۸۹۵.۴	۱۱,۴۹۸.۴	۷,۰۶۶.۴	(۵۵.۰%)
شستا	۱۲	۱,۸۱۲.۶	۱۱۶,۱۴۳.۹	۱,۰۱۳.۹	۷۹۸.۷	(۵۱.۸%)
خسپا	۲	۴۲۵.۵	۱۱,۷۷۷.۹	۰.۰	۴۲۵.۵	۳۰.۳%
وبملت	۳	۲۱۳.۱	۱۵,۷۸۱.۳	۰.۰	۲۱۳.۱	(۵۴.۳%)
اطلس	۳	۱۵۱.۰	۱۱,۰۶۸.۸	۱۳۲.۴	۱۸.۶	(۴۰.۸%)
خودران	۳	۱۴۵.۶	۱۵,۶۷۵.۵	۴.۵	۱۴۱.۱	(۷۴.۶%)
وبصادر	۳	۴۰.۲	۱,۶۶۳.۹	۰.۰	۴۰.۲	(۳۷.۷%)

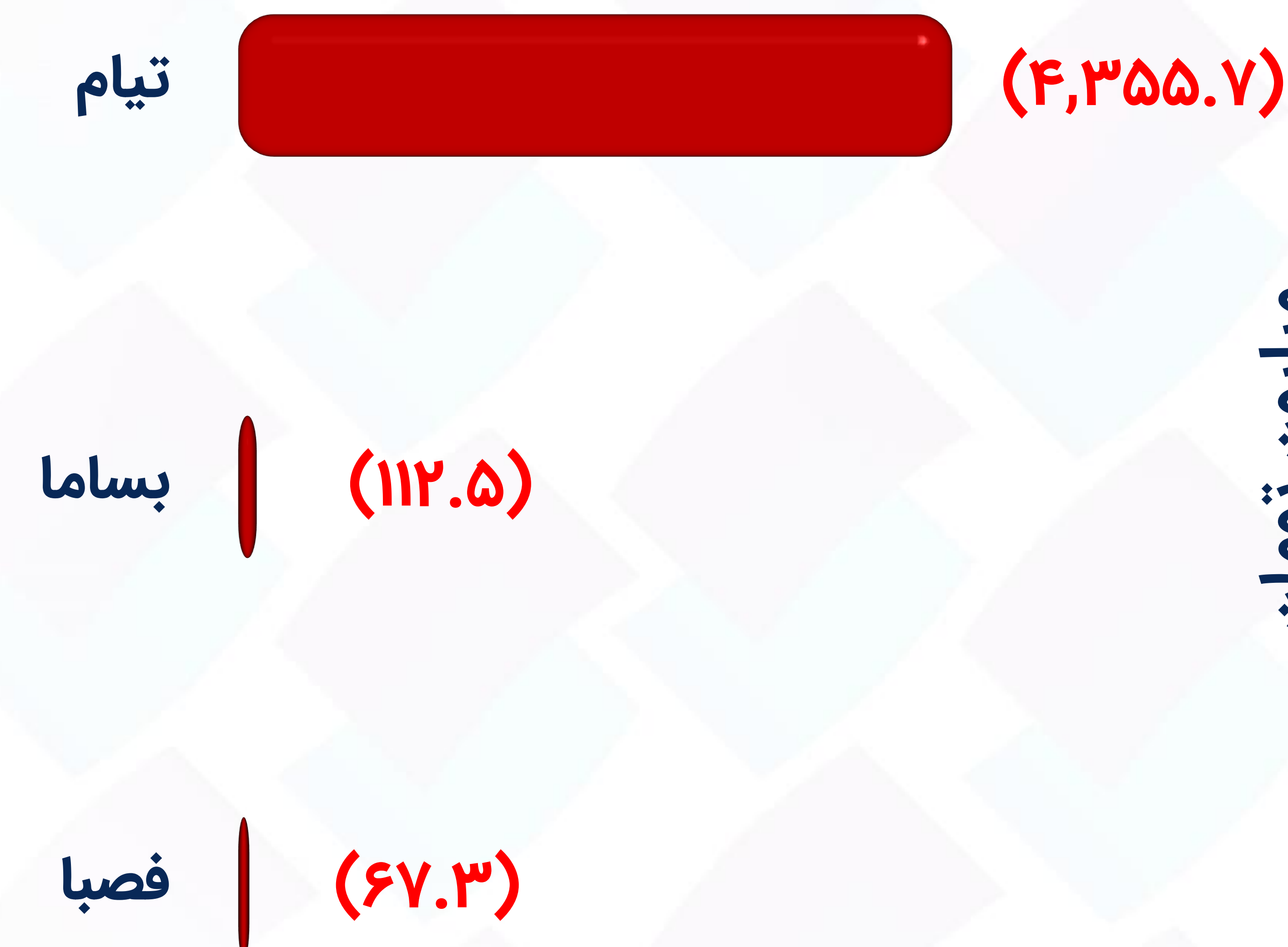
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



میلیون تومان

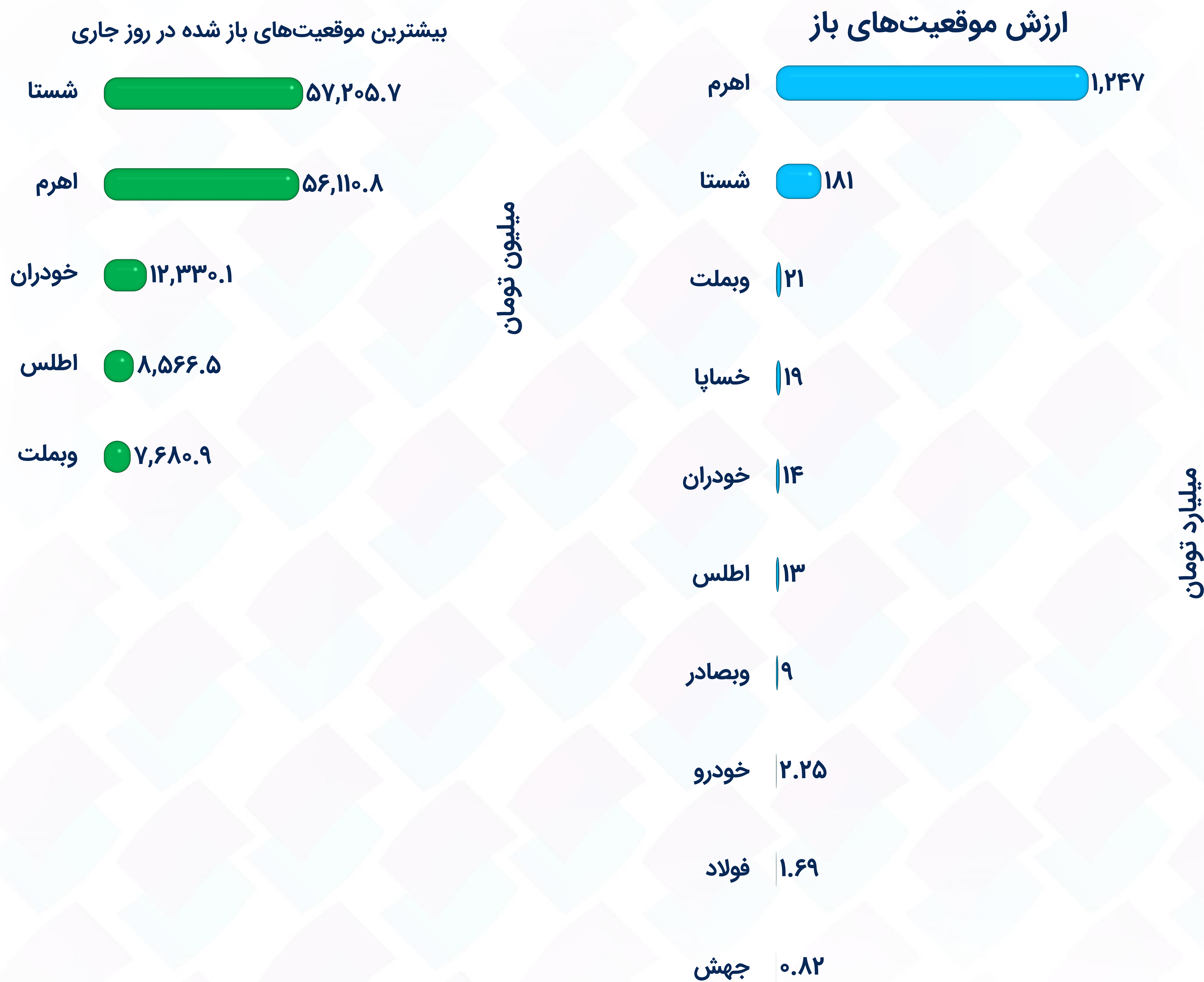
ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

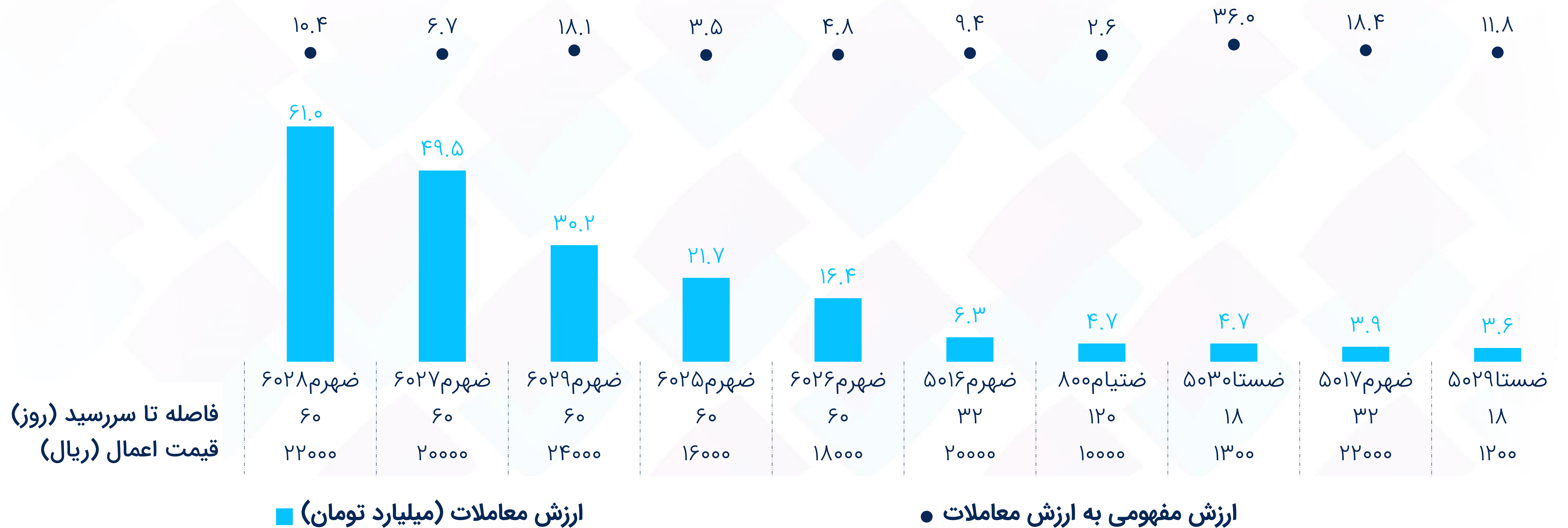
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

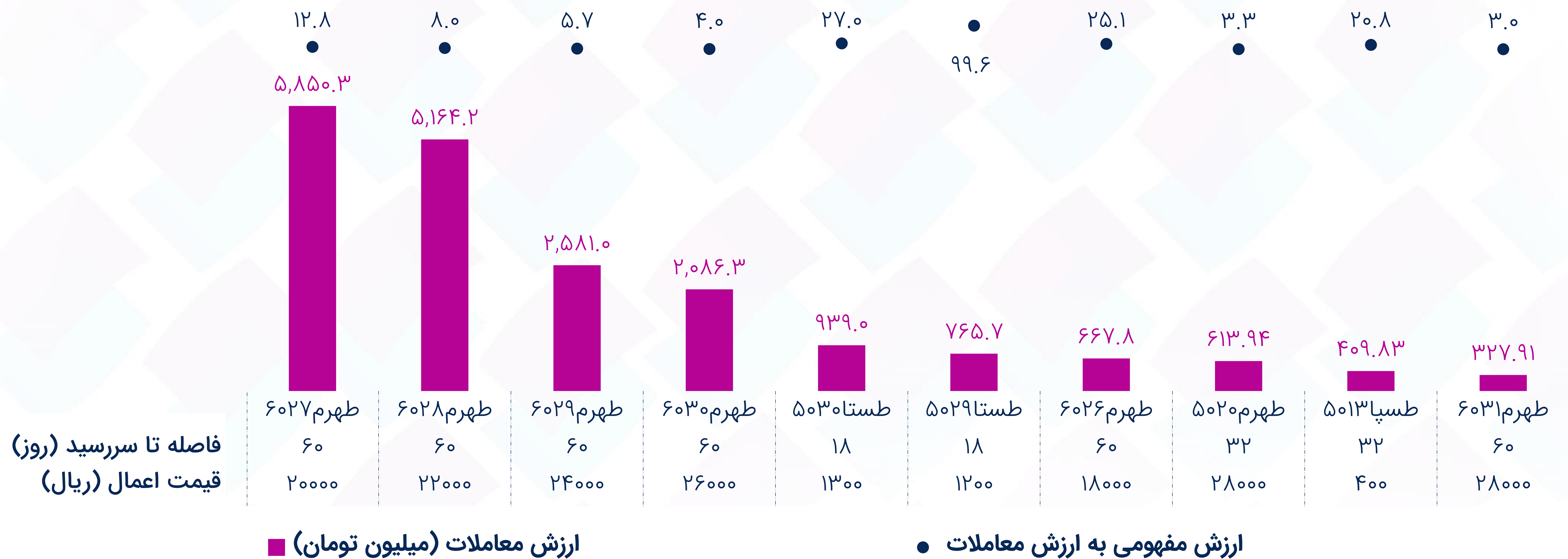


بیشترین ارزش معاملات به تفکیک نماد

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	۳۲	۸۲.۵	۴	۴۱۶	۵۰۴	۲۱.۲%	۱۲۶.۰	۰.۳۱	۱۸	۳۵۰%
ضسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۲	۱,۷۵۶.۸	۳۳	۴۱۶	۴۳۳	۴.۱%	۱۳.۱	۰.۶۶	۵۵	۶۸%
ضسپا ۸۰۷۵	خسپا	۵۰۰	۱۲۳	۱۱.۵	۳۸	۴۱۶	۵۳۸	۲۹.۳%	۱۴.۲	۰.۵۳	۶۴	۶۷%
ضسپا ۶۰۳۱	خسپا	۵۰۰	۶۰	۳۲.۲	۱۹	۴۱۶	۵۱۹	۲۴.۸%	۲۷.۳	۰.۴۰	۳۱	۶۵%
ضملت ۵۰۱۸	وبملت	۲,۸۰۰	۲۵	۴۲.۵	۱۰	۲,۴۳۰	۲,۸۱۰	۱۵.۶%	۲۸۱.۰	۰.۱۳	۱۶	۵۵%

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	۱۸	۲.۵	۲	۳,۱۷۳	۶,۵۰۲	۱۰۵%	۳,۲۵۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۵۰۱۷	ذوب	۹۰۰	۲۵	۱.۸	۱	۳۷۷	۹۰۱	۱۳۹%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضذوب ۵۰۱۵	ذوب	۷۰۰	۲۵	۱.۲	۱	۳۷۷	۷۰۱	۸۶%	۷۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضتاب ۵۰۰۷	شتاب	۱۸,۰۰۰	۱۱	۳۹.۷	۲۰	۱۱,۹۴۰	۱۸,۰۲۰	۵۱%	۹۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۶۰	۱۴.۰	۱۳۸	۲۰,۹۴۰	۴۶,۱۳۸	۱۲۰%	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
تسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۲	۱۵.۶	۲	۴۱۶	۲۹۸	(۲۸.۴%)	۱۴۹.۰	-۰.۰۵	۳	۳۰.۳%
تسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۲	۴۰۹.۸	۲۰	۴۱۶	۳۸۰	(۸.۷%)	۱۹.۰	-۰.۳۴	۲۶	۳۰.۳%
طهرم ۵۰۱۸	اهرم	۲۴,۰۰۰	۳۲	۱۵۱.۰	۲,۱۷۹	۲۰,۹۴۰	۲۱,۸۲۱	۴.۲%	۱۰.۰	-۰.۸۱	۲,۴۸۸	۱۴.۲%
طهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۶۰	۱۱۴.۹	۲۲,۹۷۵	۲۰,۹۴۰	۲۳,۰۲۵	۱۰.۰%	۱.۰	-۱.۰۰	۲۲,۵۵۹	(۱.۸%)
طهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۲	۱.۷	۸,۳۵۰	۲۰,۹۴۰	۲۱,۶۵۰	۳.۴%	۲.۶	-۱.۰۰	۸,۰۵۶	(۳.۵%)

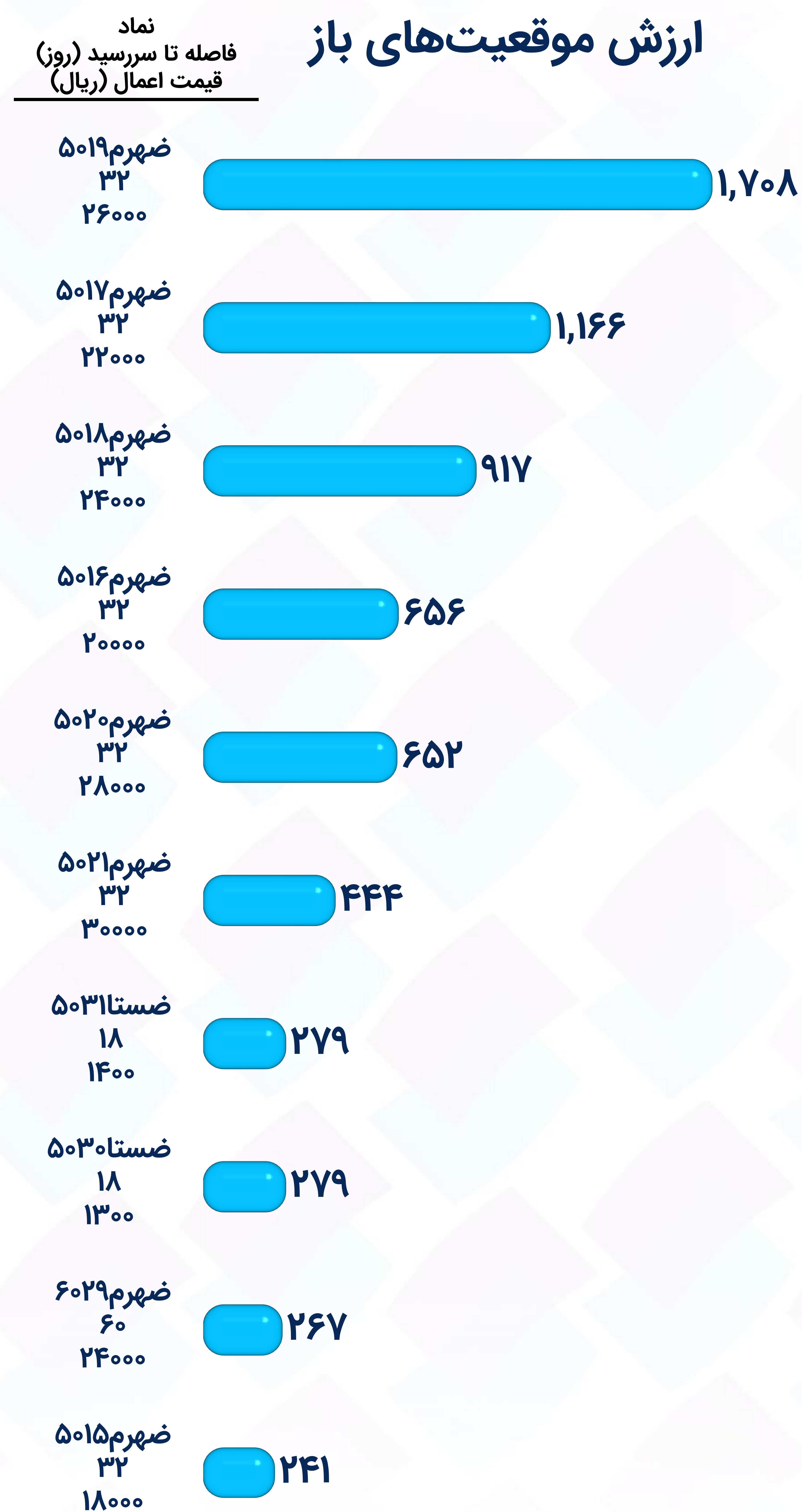
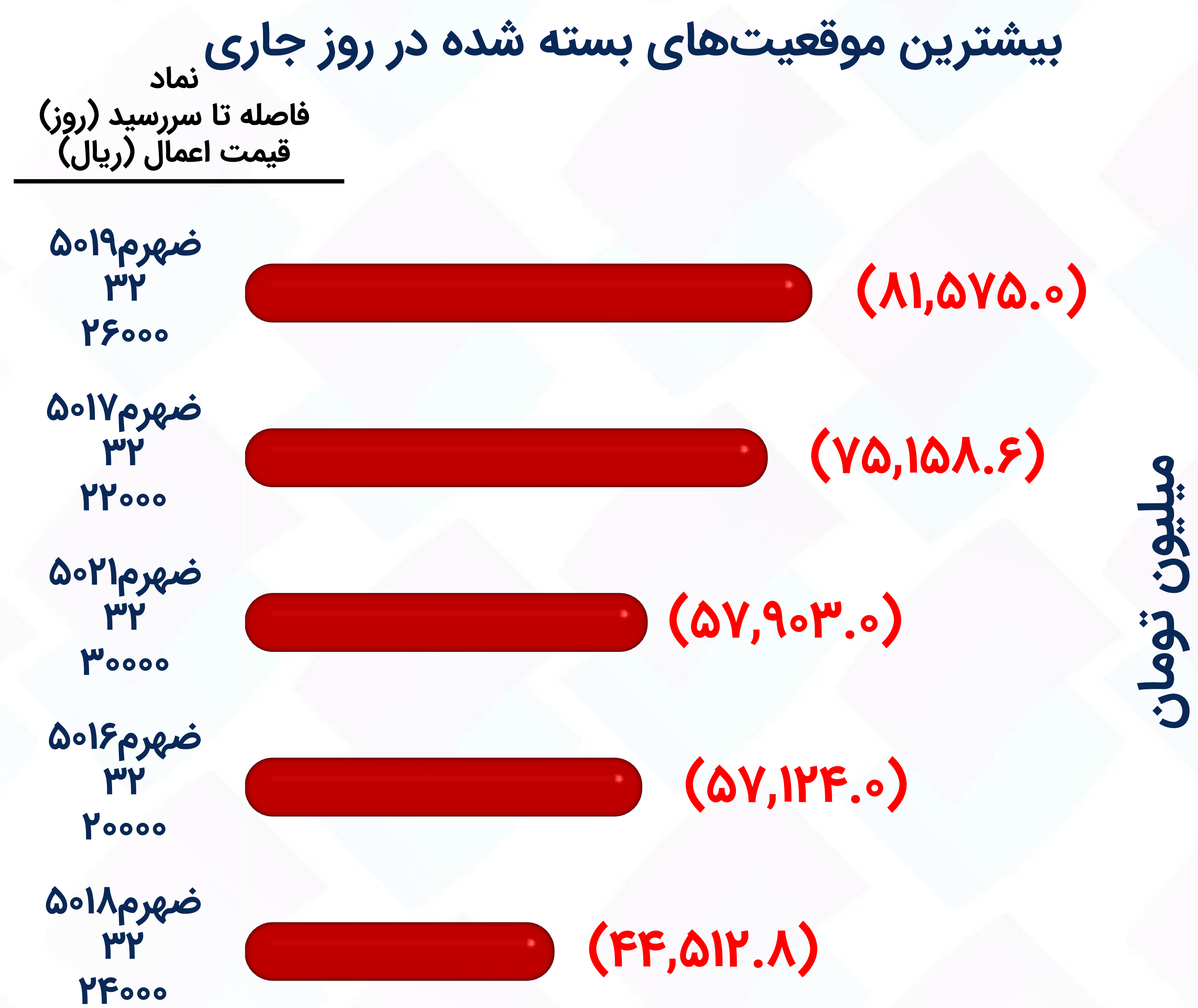
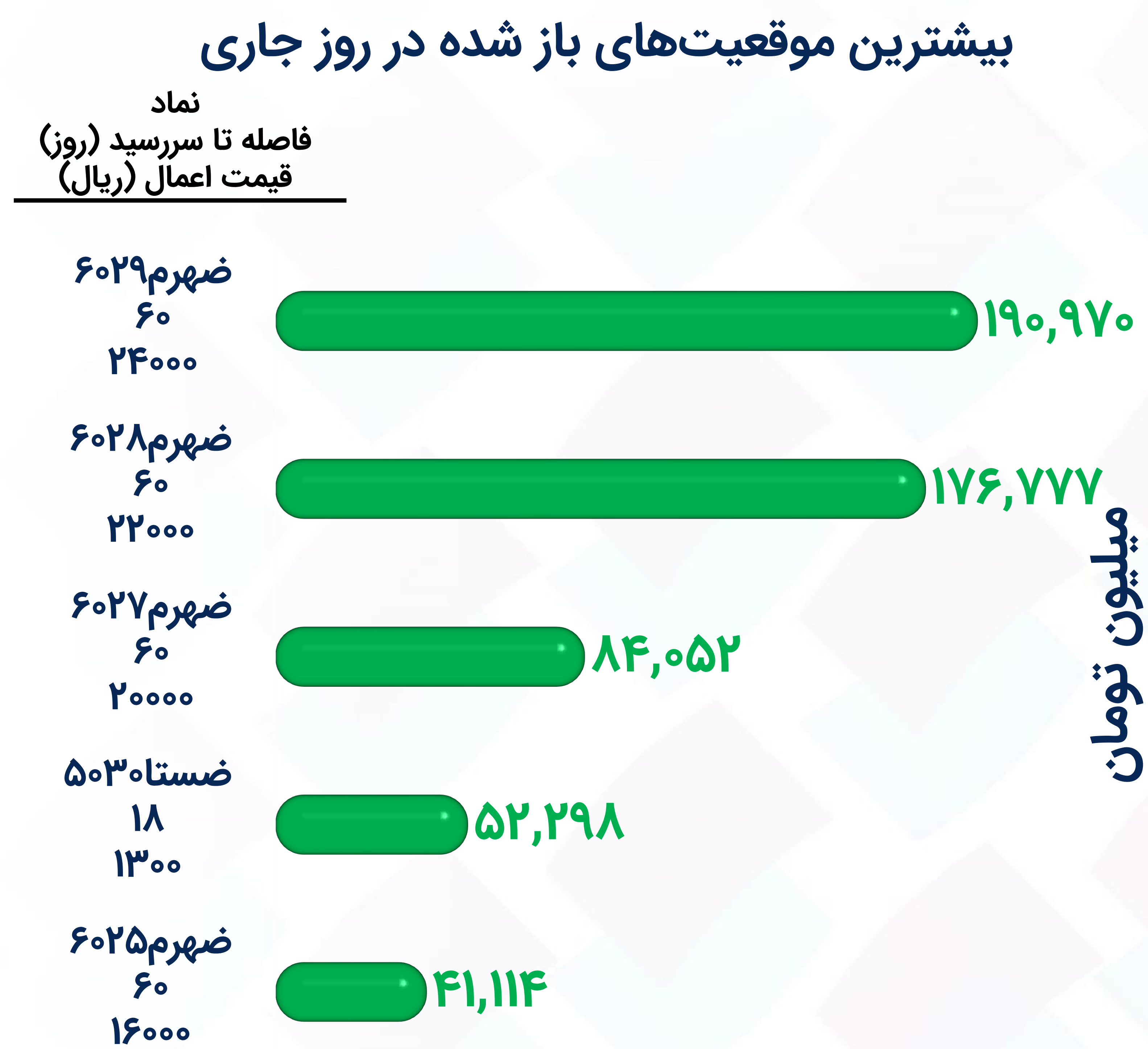
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
تصاد ۵۰۱۲	وبصادر	۲۰۰	۲۵	۰.۱	۱	۶۰۴	۱۹۹	(۶۷.۱%)	۱۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
تستا ۵۰۲۶	شستا	۹۰۰	۱۸	۰.۱	۱	۱,۲۹۵	۸۹۹	(۳۰.۶%)	۸۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طاطلس ۵۰۱	اطلس	۵۰,۰۰۰	۸	۲.۱	۹۵	۵۹,۷۷۱	۴۹,۹۰۵	(۱۶.۵%)	۵۲۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
تستا ۵۰۲۷	شستا	۱,۰۰۰	۱۸	۱.۱	۲	۱,۲۹۵	۹۹۸	(۲۲.۹%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۲	۰.۹	۵۴	۲۰,۹۴۰	۱۴,۹۴۶	(۲۸.۶%)	۲۷۶.۸	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)

(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

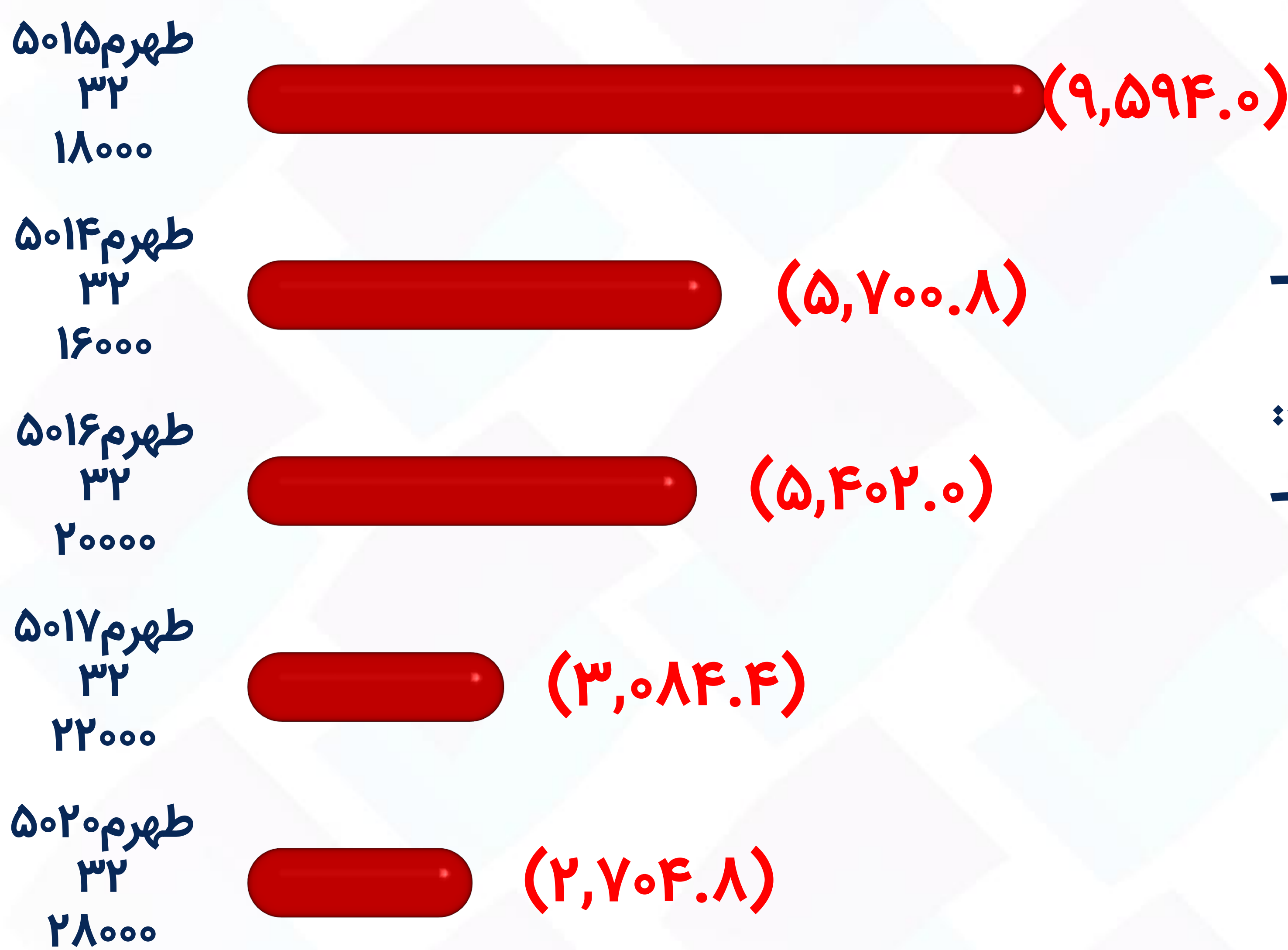
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

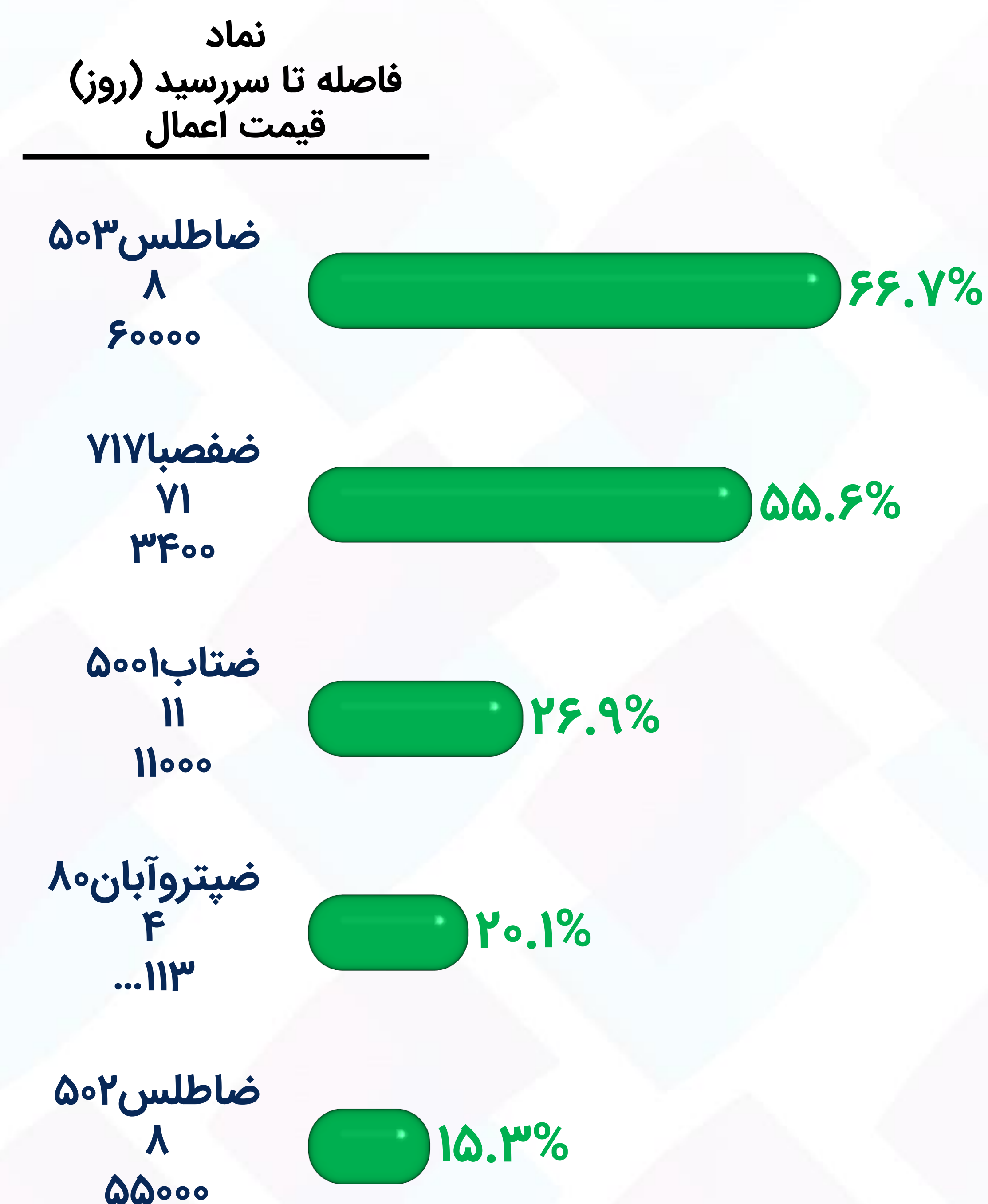
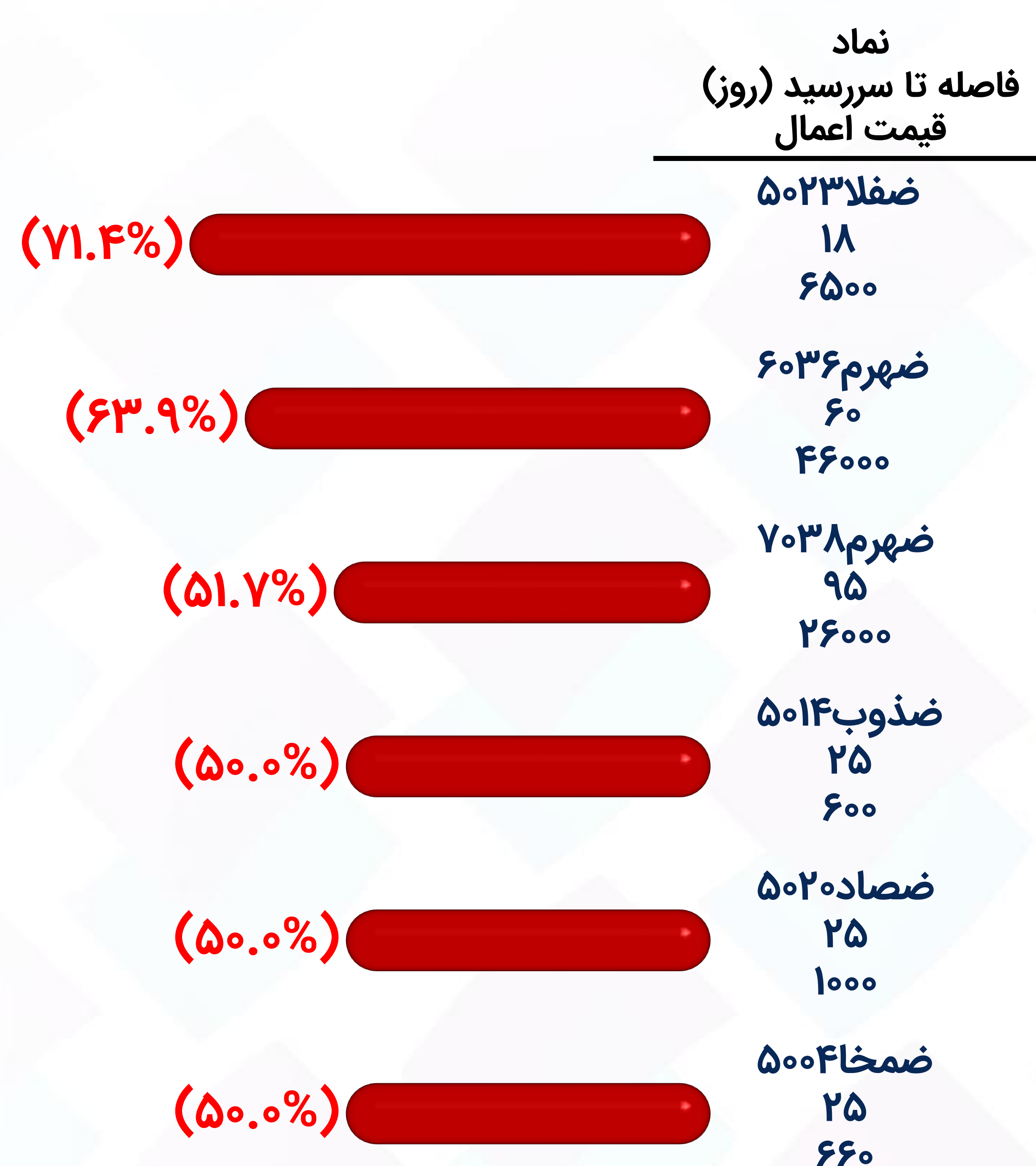
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



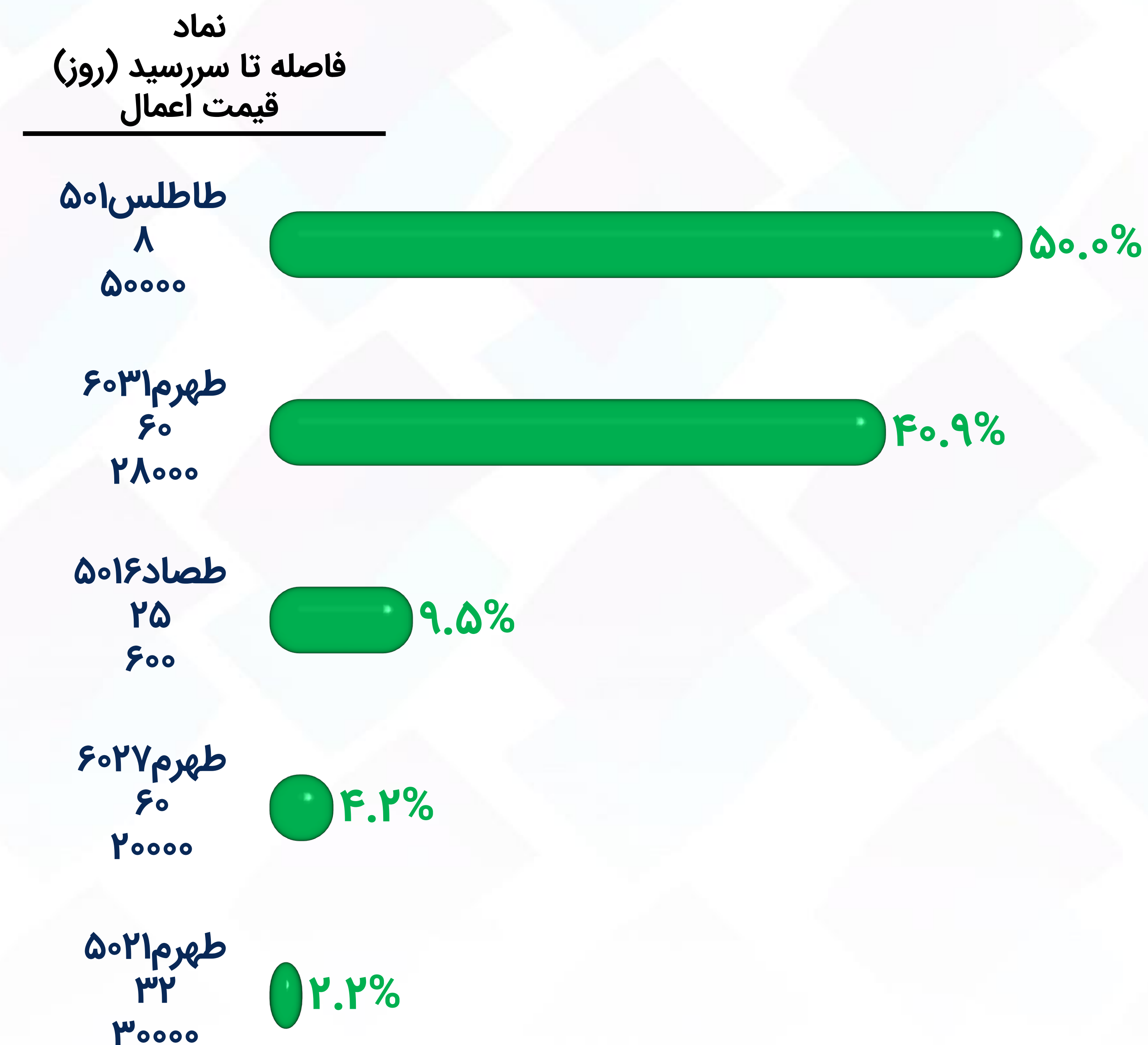
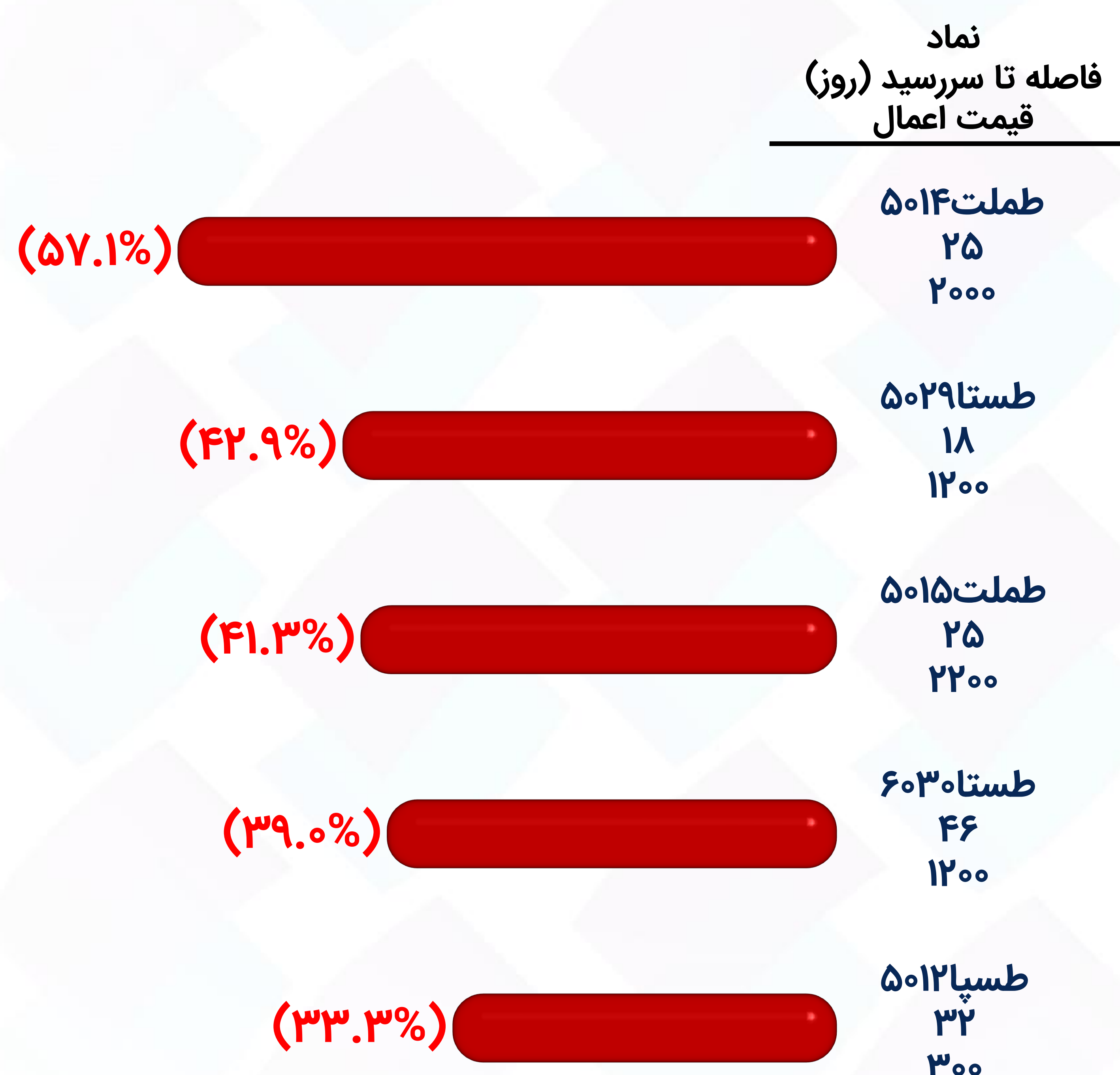
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

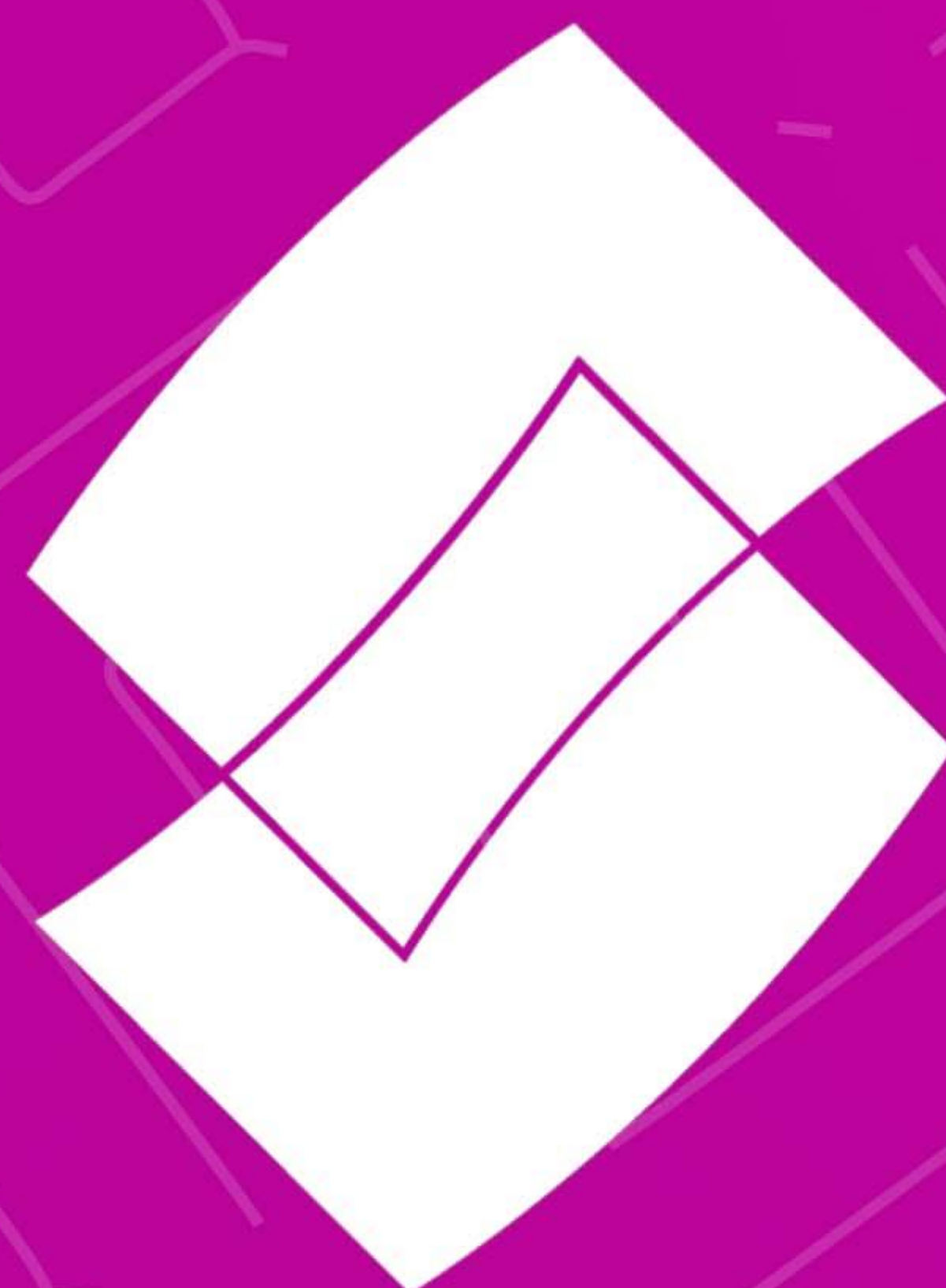
اختیار خرید



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.