

شماره
۵۱۲

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۲۹ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage

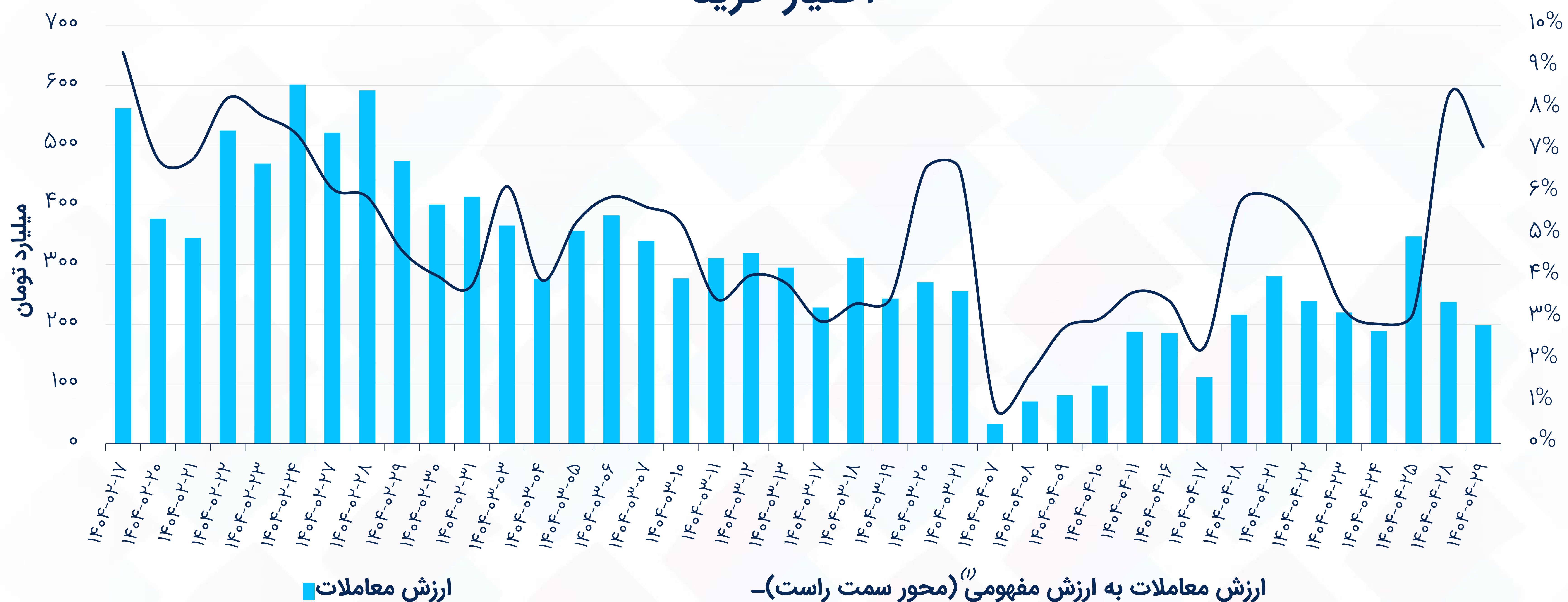




اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



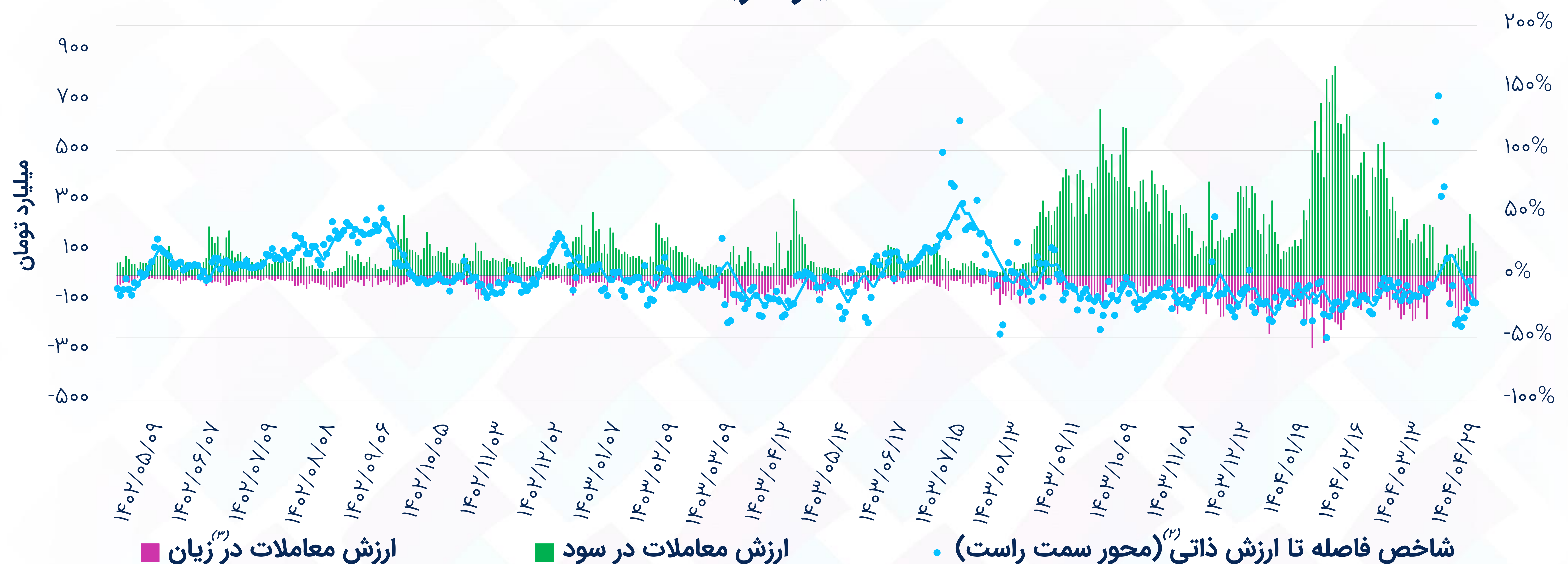
اختیار فروش



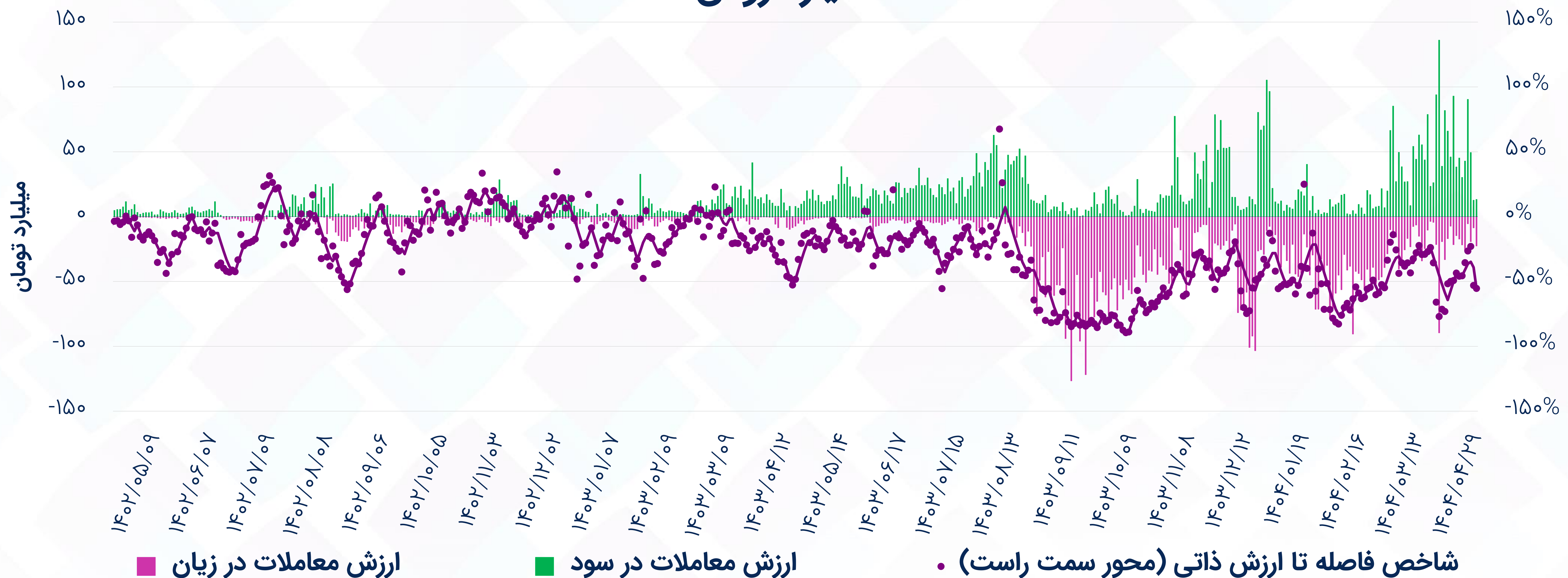
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

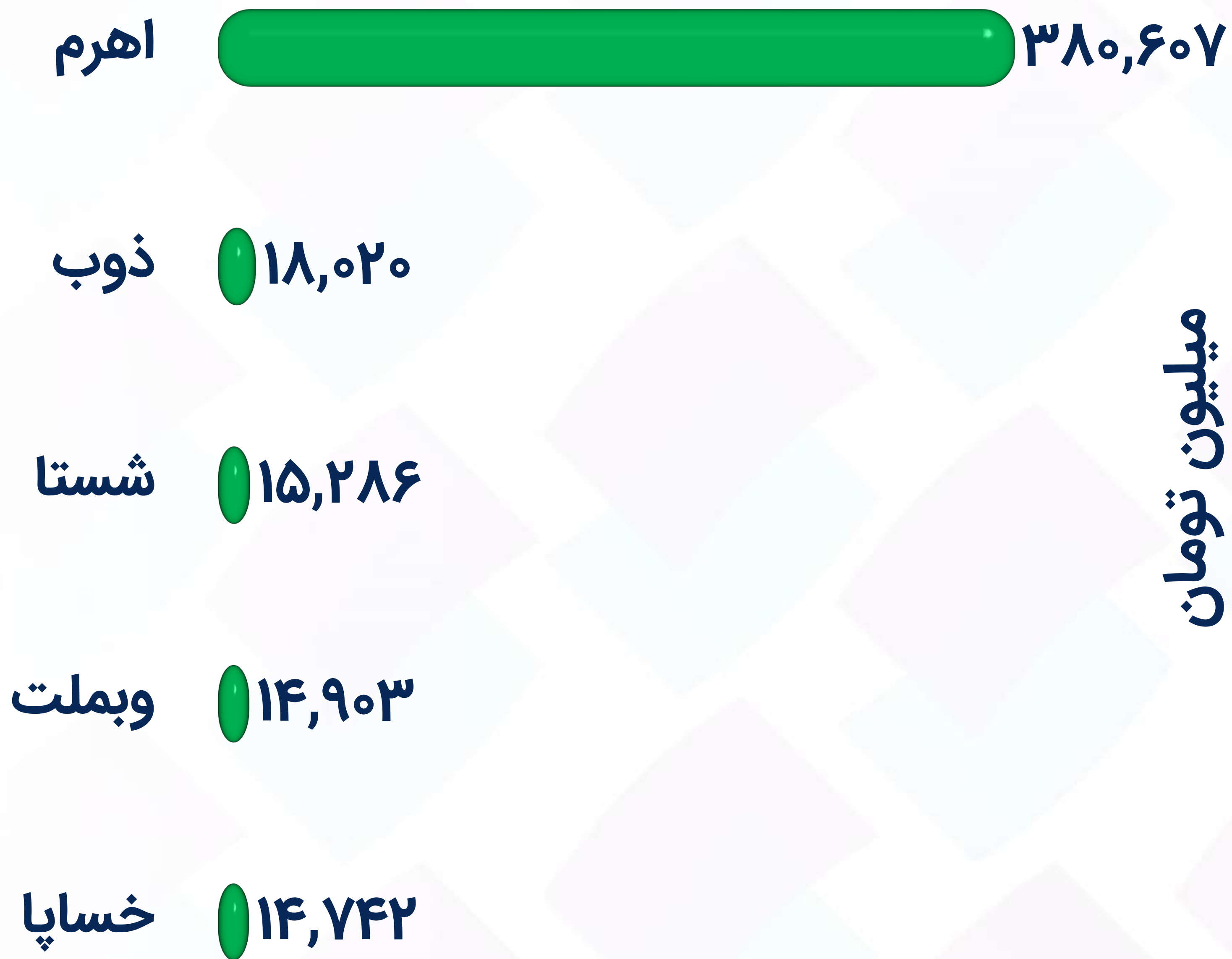
نماد	تعداد نمادهای با معامله	ارزش معاملات (میلیارد تومان)	ارزش مفهومی معاملات (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در سود (میلیارد تومان)	ارزش معاملات در زیان (میلیارد تومان)	میانگین فاصله با ارزش ذاتی
اهرم	۳۴	۱۷۳.۹	۲,۲۳۶.۶	۷۹.۳	۹۴.۶	(۲۹.۲%)
شستا	۲۹	۵.۴	۲۰۸.۲	۲.۶	۲.۸	۴۴.۶%
خسپا	۱۵	۵.۴	۵۳.۸	۵.۲	۰.۱	۵۱.۶%
وبملت	۱۹	۳.۸	۸۵.۶	۳.۴	۰.۴	۳۶.۷%
وبصادر	۱۱	۲.۲	۴۴.۲	۲.۲	۰.۱	۲۵.۵%
ذوب	۲۱	۲.۰	۶۰.۲	۰.۴	۱.۶	(۲۱.۳%)
موج	۳	۱.۵	۲۸.۵	۱.۵	۰.۰	۲.۲%

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	۲۲	۳۳,۵۷۳.۹	۵۵۳,۹۸۷.۱	۱۲,۱۸۲.۹	۲۱,۳۹۱.۰	(۵۷.۲%)
شستا	۱۰	۱,۴۰۶.۳	۹۰,۸۶۶.۸	۹۶۹.۷	۴۳۶.۶	(۴۴.۲%)
خسپا	۲	۴۵۵.۳	۹,۹۰۸.۶	۰.۰	۴۵۵.۳	۲۰.۴%
وتجارت	۲	۱۴۹.۸	۲,۰۴۳.۴	۱۳۹.۵	۱۰.۴	(۵۱.۰%)
وبملت	۴	۱۴۴.۸	۹,۲۲۲.۰	۰.۰	۱۴۴.۸	(۴۳.۸%)
اطلس	۳	۱۱۶.۰	۱۵,۳۳۶.۱	۰.۰	۱۱۶.۰	(۳۶.۴%)
وبصادر	۲	۶۳.۶	۱,۸۴۹.۶	۰.۰	۶۳.۶	(۳۳.۶%)

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

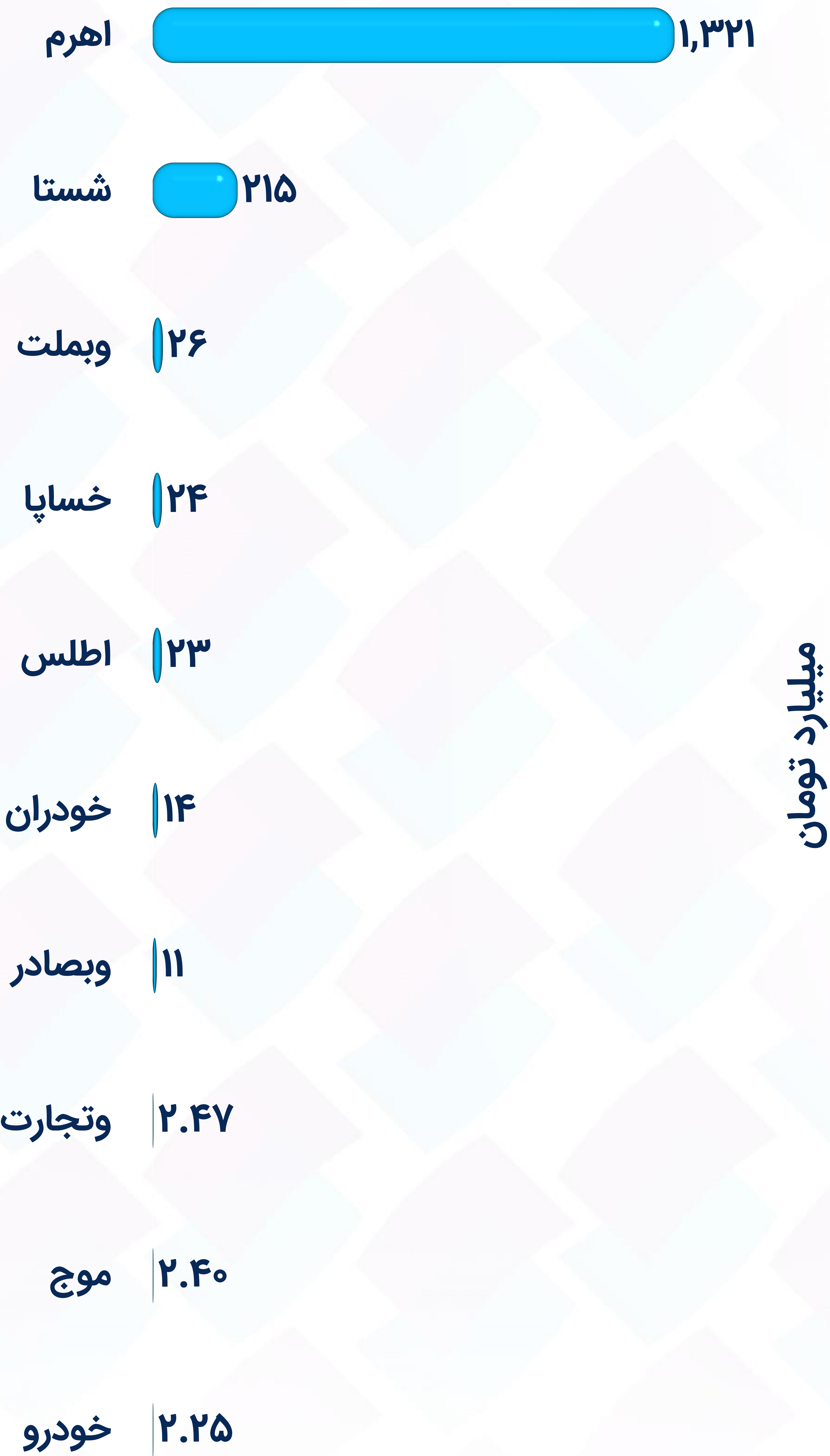


میلیارد تومان

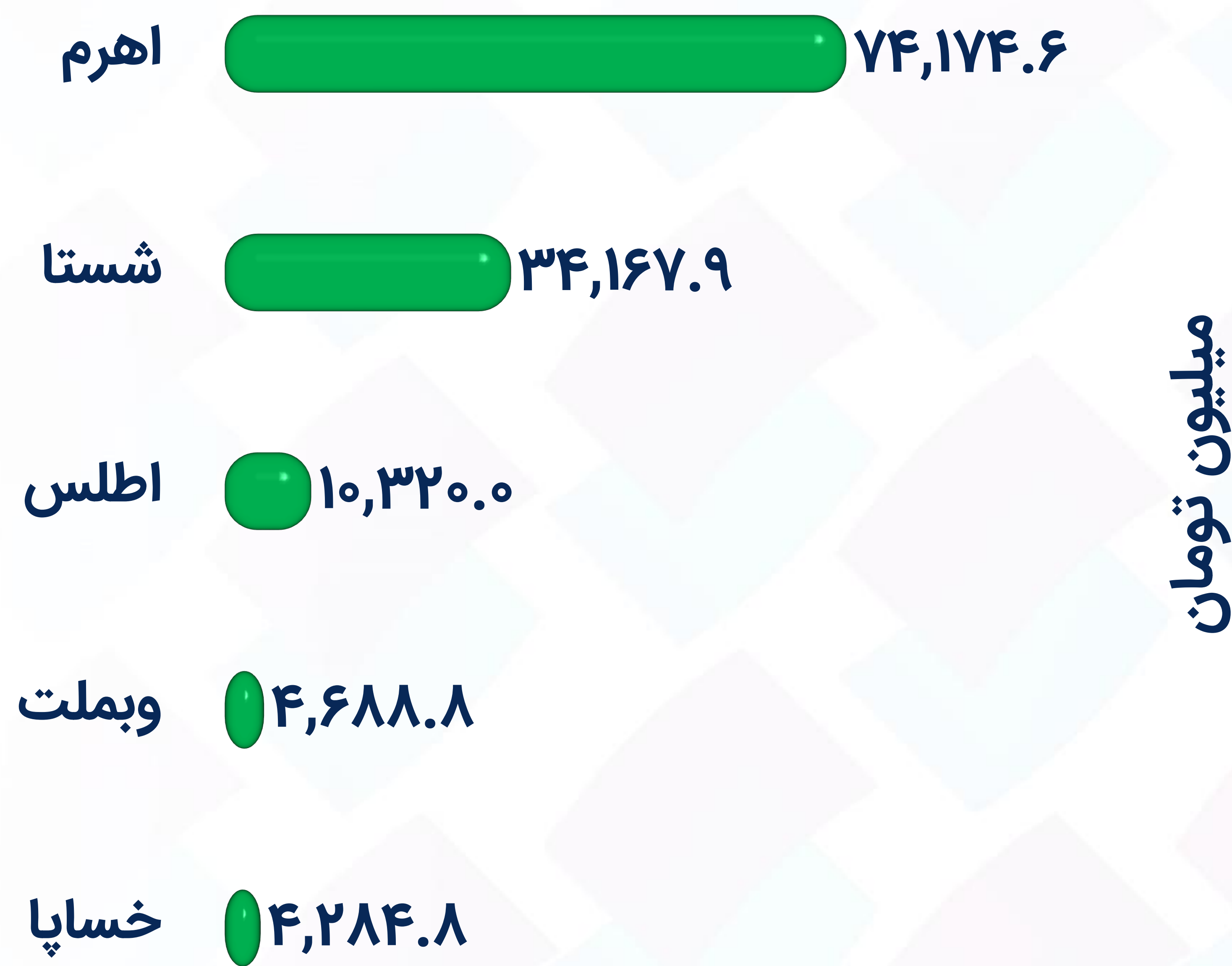
(۱) ارزش موقعیت باز: تعداد قرارداد باز * اندازه قرارداد * قیمت اعمال

موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



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	۳۱	۷۳.۶	۳	۴۱۳	۵۰۳	۲۱.۸%	۱۶۷.۷	۰.۲۹	۱۶	۴۳۸%
ضمخا ۵۰۰۳	اخابر	۵۶۰	۲۴	۲.۰	۱۳	۵۵۲	۵۷۳	۳.۸%	۴۴.۱	۰.۵۶	۲۹	۱۲۲%
ضملی ۵۰۱۸	فملي	۶,۶۸۶	۱۰	۲۱.۷	۱۰۶	۶,۷۵۰	۶,۷۹۲	۰.۶%	۶۴.۱	۰.۶۷	۲۲۹	۱۱۶%
ضسپا ۶۰۳۱	خسپا	۵۰۰	۵۹	۳۰.۲	۱۵	۴۱۳	۵۱۵	۲۴.۷%	۳۴.۳	۰.۳۹	۲۹	۹۵%
ضسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۱	۱,۶۵۹.۲	۲۷	۴۱۳	۴۲۷	۳.۴%	۱۵.۸	۰.۶۵	۵۲	۹۴%

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 ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۵۹	۱۸.۲	۵۹	۲۰,۵۰۰	۴۶,۰۵۹	۱۲۵%	۷۸۰.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضصاد ۵۰۲۰	وبصادر	۱,۰۰۰	۲۴	۵.۵	۱	۶۰۳	۱,۰۰۱	۶۶%	۱,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۵۰۱۴	ذوب	۶۰۰	۲۴	۲.۸	۱	۳۷۳	۶۰۱	۶۱%	۶۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۲	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۱	۴.۲	۷۲	۲۰,۵۰۰	۳۴,۰۷۲	۶۶%	۴۷۳.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۶۰۰۴	ذوب	۶۰۰	۵۱	۱.۷	۲	۳۷۳	۶۰۲	۶۱%	۳۰۱.۰	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
طموج ۵۱۱	موج	۲۰,۰۰۰	۲۱	۴.۹	۴۱	۲۰,۰۱۷	۱۹,۹۵۹	(۰.۳%)	۴۸۶.۸	-۰.۳۹	۵۵۷	۱۲۵۸.۷%
طسپا ۵۰۱۲	خسپا	۳۰۰	۳۱	۷.۳	۲	۴۱۳	۲۹۸	(۲۷.۸%)	۱۴۹.۰	-۰.۰۶	۳	۲۷.۵%
طسپا ۵۰۱۳	خسپا	۴۰۰	۳۱	۴۴۸.۰	۲۲	۴۱۳	۳۷۸	(۸.۵%)	۱۷.۲	-۰.۳۵	۲۶	۲۰.۳%
طهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۵۹	۳۹۶.۷	۲۳,۰۶۵	۲۰,۵۰۰	۲۲,۹۳۵	۱۱.۹%	۱.۰	-۱.۰۰	۲۳,۰۶۰	(۰.۰۲%)
طهرم ۵۰۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۱	۴۸۷.۲	۶,۹۱۱	۲۰,۵۰۰	۲۱,۰۸۹	۲.۹%	۳.۱	-۰.۹۹	۶,۶۰۳	(۴.۵%)

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
طاطلس ۵۰۱	اطلس	۵۰,۰۰۰	۷	۲.۵	۶۵	۶۰,۷۹۹	۴۹,۹۳۵	(۱۷.۹%)	۷۶۸.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۵۰۲۷	ثستا	۱,۰۰۰	۱۷	۰.۳	۲	۱,۲۹۸	۹۹۸	(۲۳.۱%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۱	۰.۳	۶۰	۲۰,۵۰۰	۱۴,۹۴۰	(۲۷.۱%)	۲۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۴%)
طملت ۵۰۱۳	وبملت	۱,۹۰۰	۲۴	۰.۲	۲۰	۲,۴۴۰	۱,۸۸۰	(۲۳.۰%)	۹۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۴%)
طذوب ۵۰۱۱	ذوب	۳۰۰	۲۴	۰.۰	۲	۳۷۳	۲۹۸	(۲۰.۱%)	۱۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۸.۴%)

(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

ارزش موقعیت‌های باز

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

ضهرم ۵۰۱۹
۳۱
۲۶۰۰۰ ۱,۶۴۸

ضهرم ۵۰۱۷
۳۱
۲۲۰۰۰ ۱,۱۰۴

ضهرم ۵۰۱۸
۳۱
۲۴۰۰۰ ۸۸۳

ضهرم ۵۰۲۰
۳۱
۲۸۰۰۰ ۶۳۲

ضهرم ۵۰۱۶
۳۱
۲۰۰۰۰ ۶۲۶

ضهرم ۵۰۲۱
۳۱
۳۰۰۰۰ ۴۴۰

ضهرم ۶۰۲۹
۵۹
۲۴۰۰۰ ۴۱۷

ضهرم ۶۰۲۸
۵۹
۲۲۰۰۰ ۳۸۲

ضستا ۵۰۳۱
۱۷
۱۴۰۰ ۲۸۹

ضستا ۵۰۳۰
۱۷
۱۳۰۰ ۲۸۴

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

ضهرم ۶۰۲۸
۵۹
۲۲۰۰۰ ۱۵۷,۳۶۸

ضهرم ۶۰۲۹
۵۹
۲۴۰۰۰ ۱۵۰,۴۲۵

ضهرم ۶۰۳۰
۵۹
۲۶۰۰۰ ۱۱۱,۵۲۷

ضهرم ۶۰۲۷
۵۹
۲۰۰۰۰ ۹۰,۳۵۰

ضهرم ۶۰۲۶
۵۹
۱۸۰۰۰ ۳۲,۱۹۷

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

ضهرم ۵۰۱۷
۳۱
۲۲۰۰۰ (۶۲,۲۹۹.۶)

ضهرم ۵۰۱۹
۳۱
۲۶۰۰۰ (۵۹,۵۹۲.۰)

ضهرم ۵۰۱۸
۳۱
۲۴۰۰۰ (۳۳,۹۸۸.۸)

ضهرم ۵۰۱۶
۳۱
۲۰۰۰۰ (۳۰,۱۶۰.۰)

ضهرم ۵۰۲۰
۳۱
۲۸۰۰۰ (۱۹,۳۲۰.۰)

میلیون تومان

موقعیت‌های باز به تفکیک نماد - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز

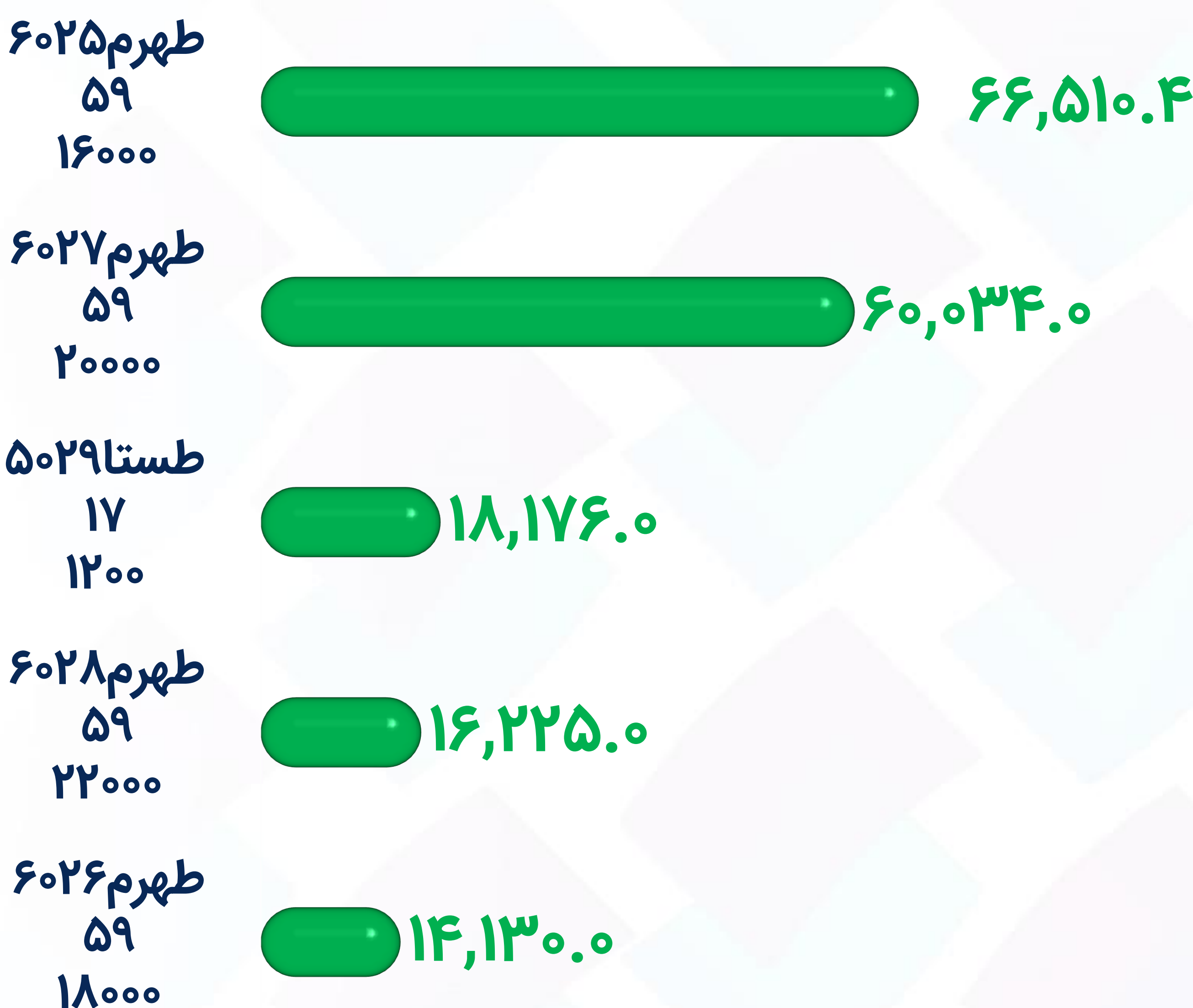
نماد
فاصله تا سررسید (روز)
قیمت اعمال (ریال)



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)

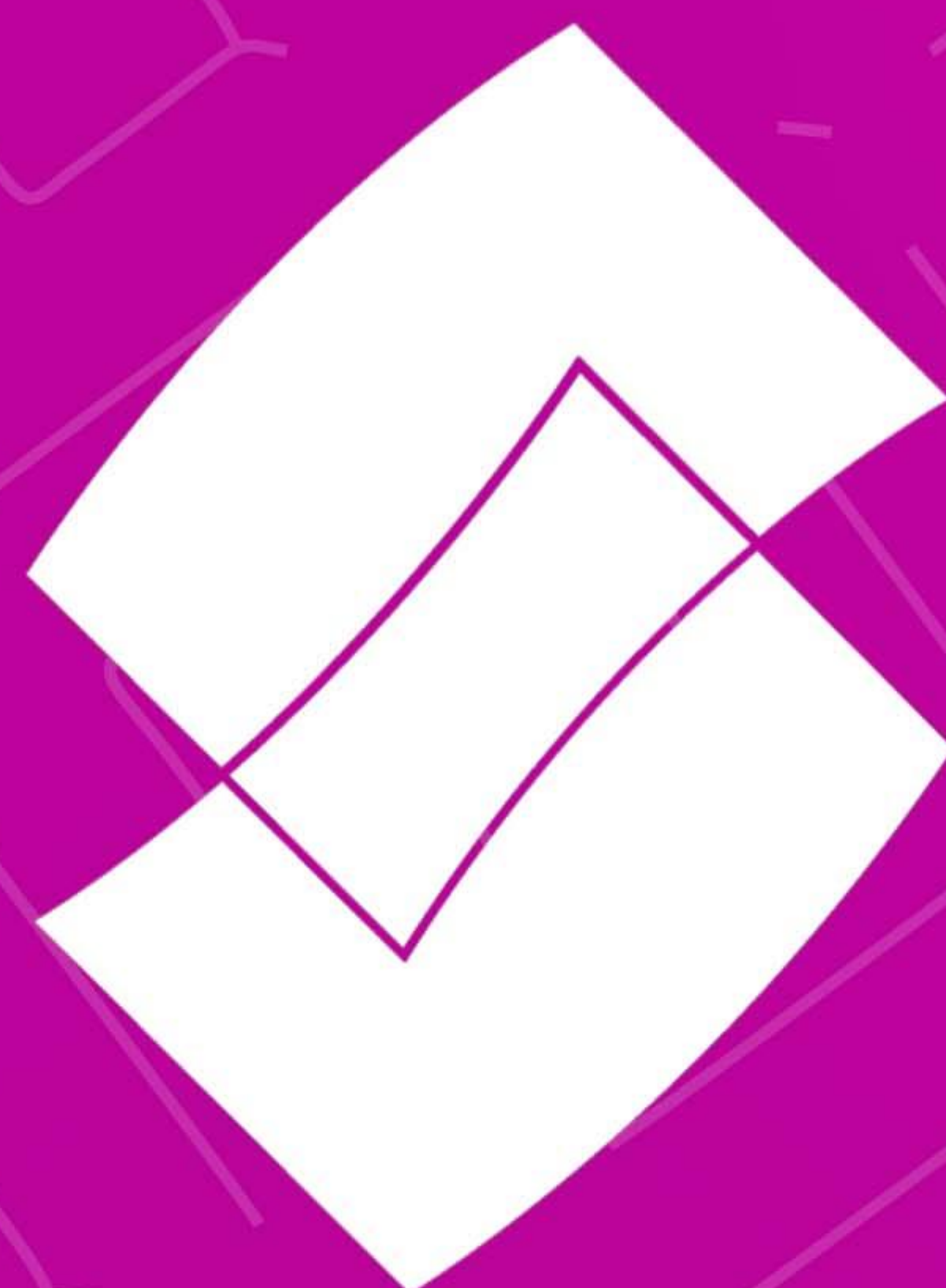
اختیار خرید



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.