

شماره
۵۱۳

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۰ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





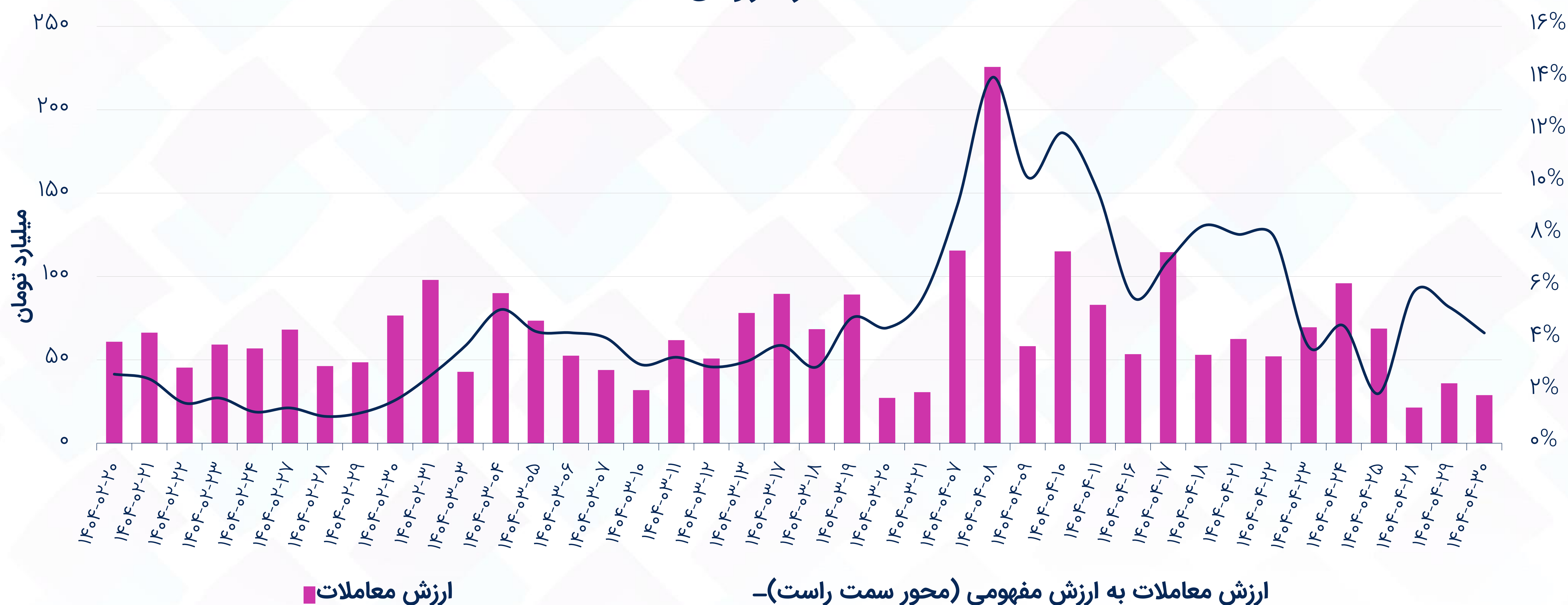
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



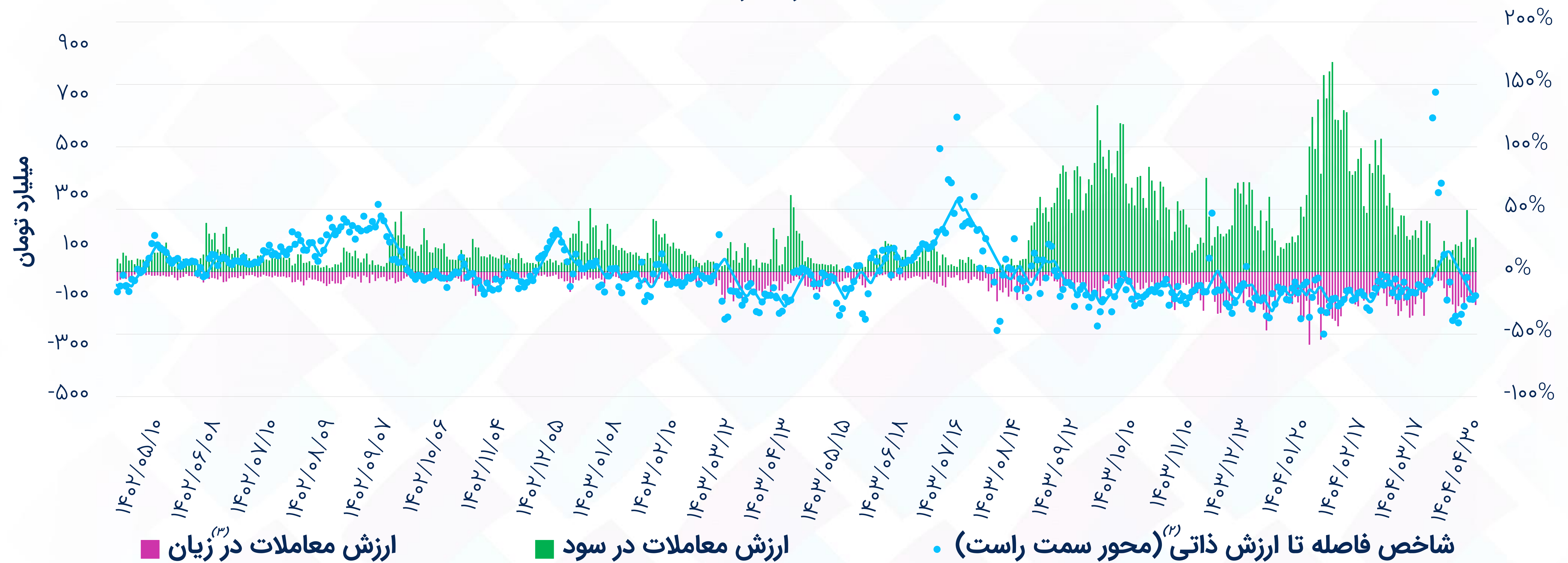
اختیار فروش



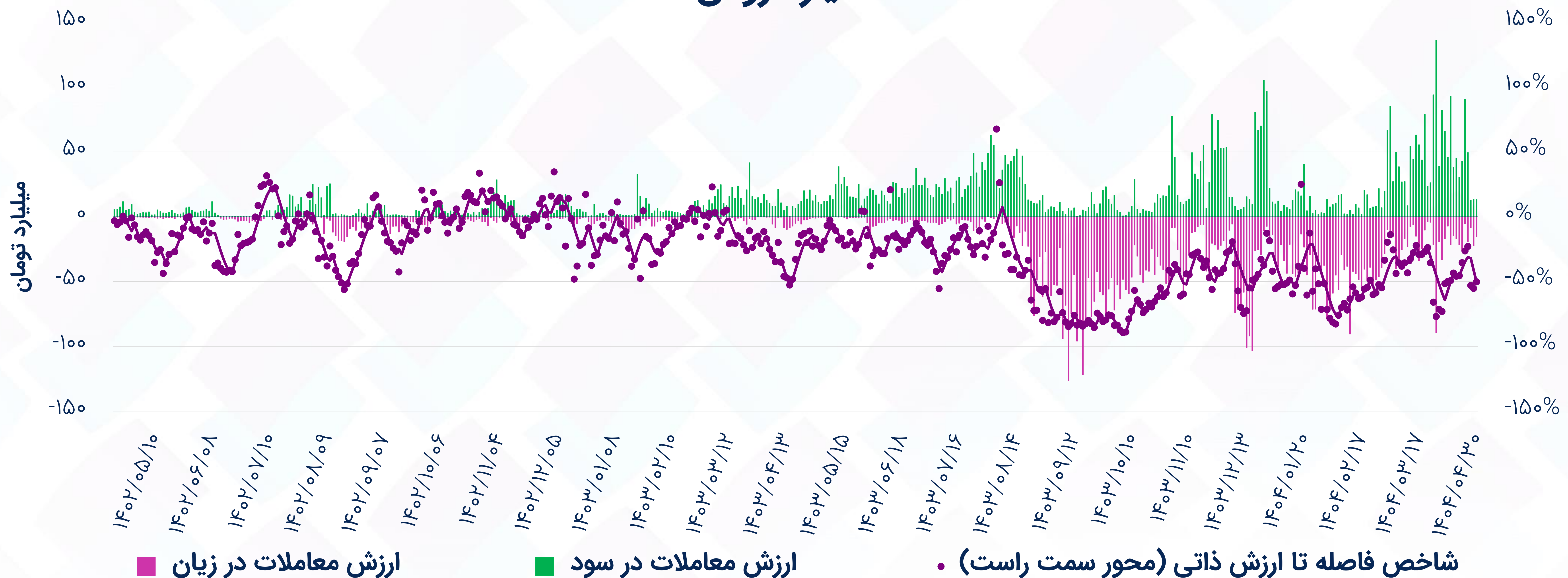
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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

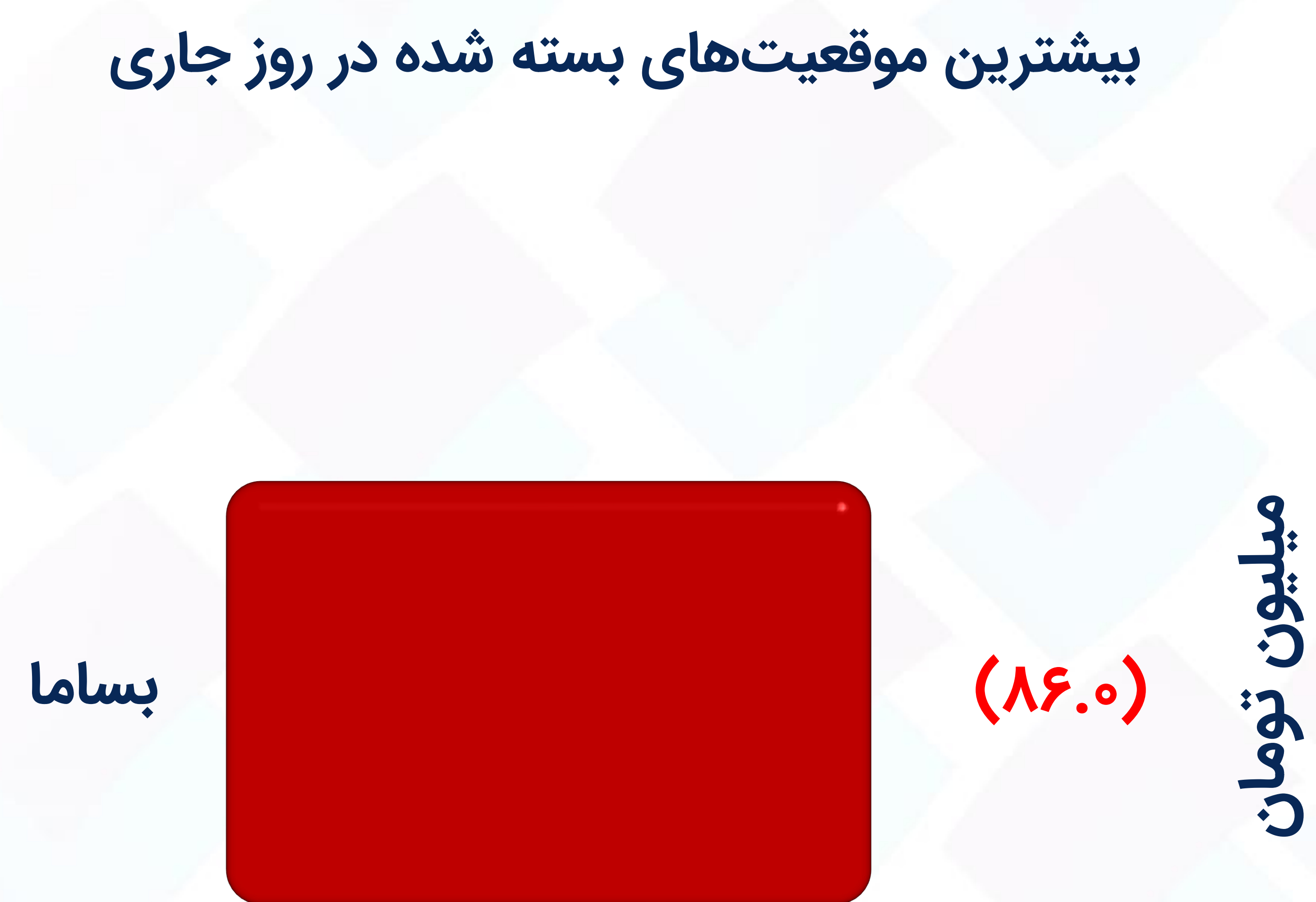
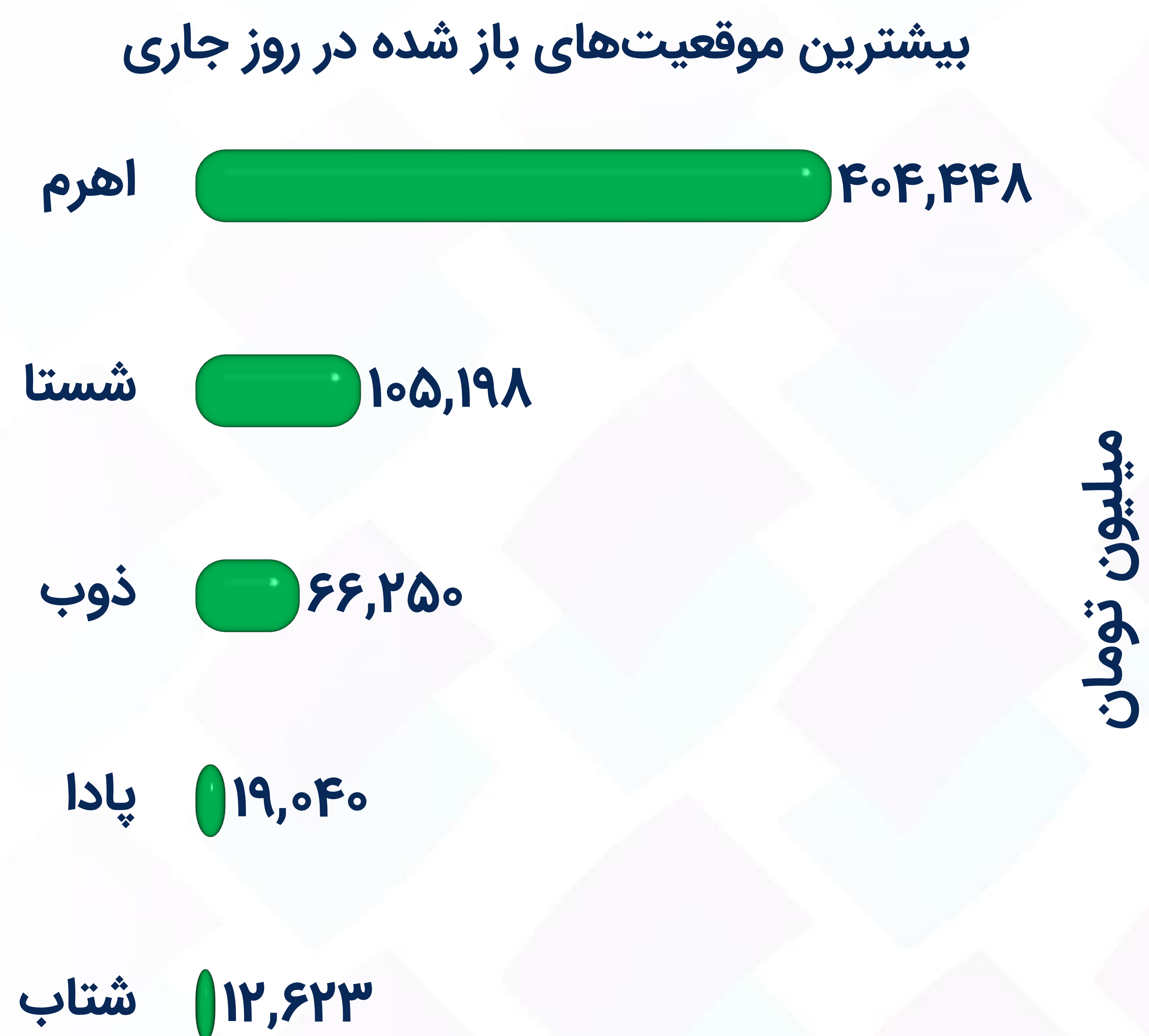
اختیار خرید

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	۲۴۰.۳	۲,۸۴۱.۲	۱۱۹.۳	۱۲۱.۱	(۲۲.۹%)
شستا	۲۹	۱۳.۷	۴۹۵.۳	۷.۳	۶.۵	۲۸.۳%
ذوب	۲۱	۵.۵	۱۱۳.۴	۱.۰	۴.۵	(۱۶.۱%)
پادا	۱	۴.۰	۲۲.۷	۴.۰	۰.۰	۸.۳%
شتاب	۸	۱.۴	۳۹.۶	۱.۳	۰.۱	۷.۴%
موج	۷	۱.۳	۱۴.۷	۱.۲	۰.۱	(۷.۷%)
اطلس	۹	۰.۴	۱۳.۵	۰.۴	۰.۰	۱۰.۷%

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	۲۶,۱۸۰.۰	۴۹۹,۶۰۸.۵	۱۱,۰۲۲.۴	۱۵,۱۵۷.۶	(۵۲.۶%)
شستا	۶	۲,۵۷۰.۹	۱۶۷,۰۰۵.۸	۲,۱۹۸.۴	۳۷۲.۵	(۲۷.۴%)
اطلس	۳	۴۹.۲	۱۱,۹۸۰.۱	۲۵.۰	۲۴.۱	(۲۹.۶%)
موج	۲	۱۵.۷	۱,۳۰۲.۳	۰.۰	۱۵.۷	۳۳.۵%
خودران	۲	۷.۰	۷۶۷.۸	۰.۰	۷.۰	(۶۷.۲%)
ذوب	۲	۱.۷	۱۲.۳	۱.۷	۰.۰	(۹.۱%)
شتاب	۱	۰.۸	۳۴۲.۶	۰.۰	۰.۸	(۶۰.۶%)

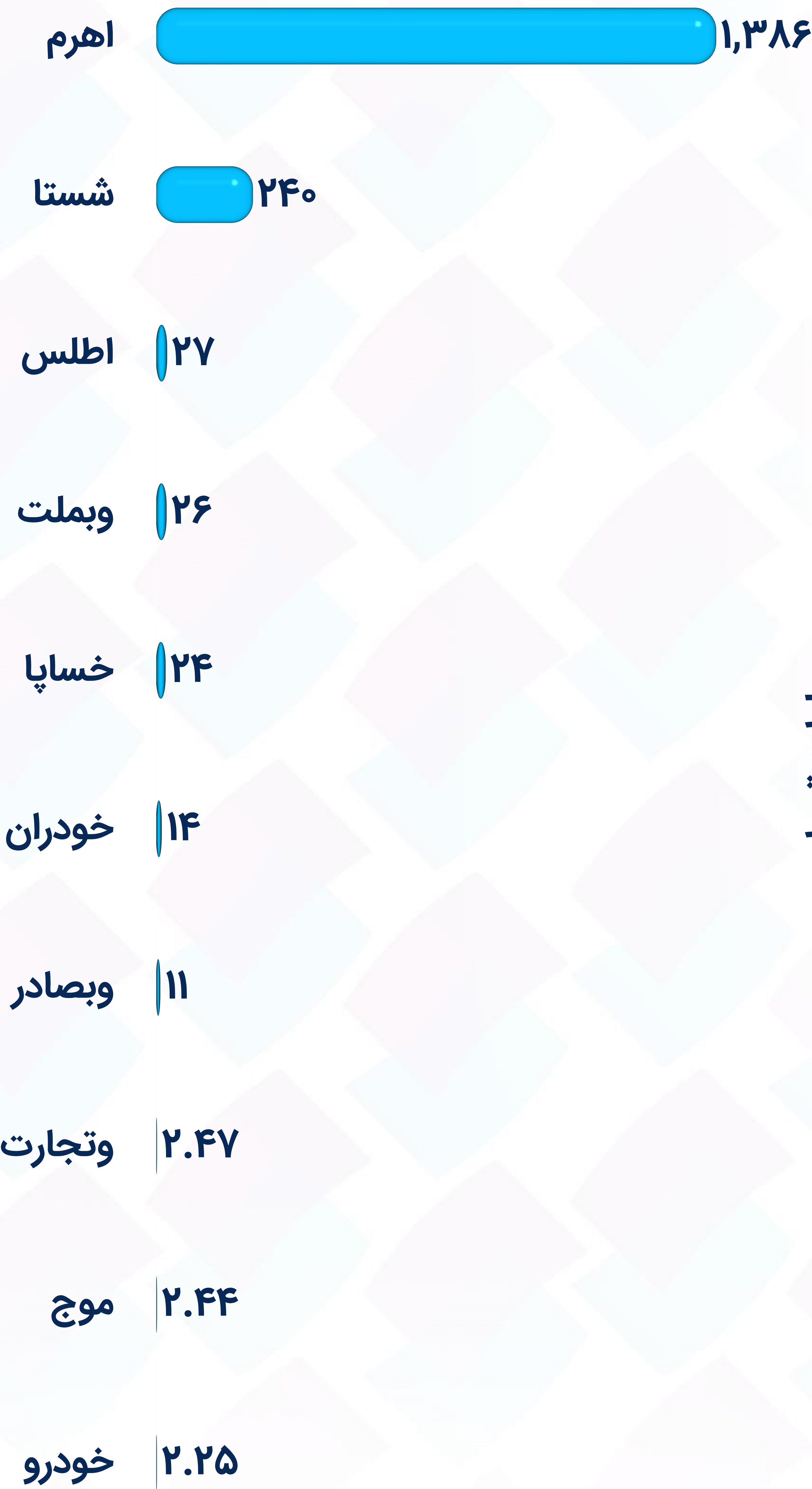
موقعیت‌های باز^(۱) به تفکیک دارایی پایه - اختیار خرید



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

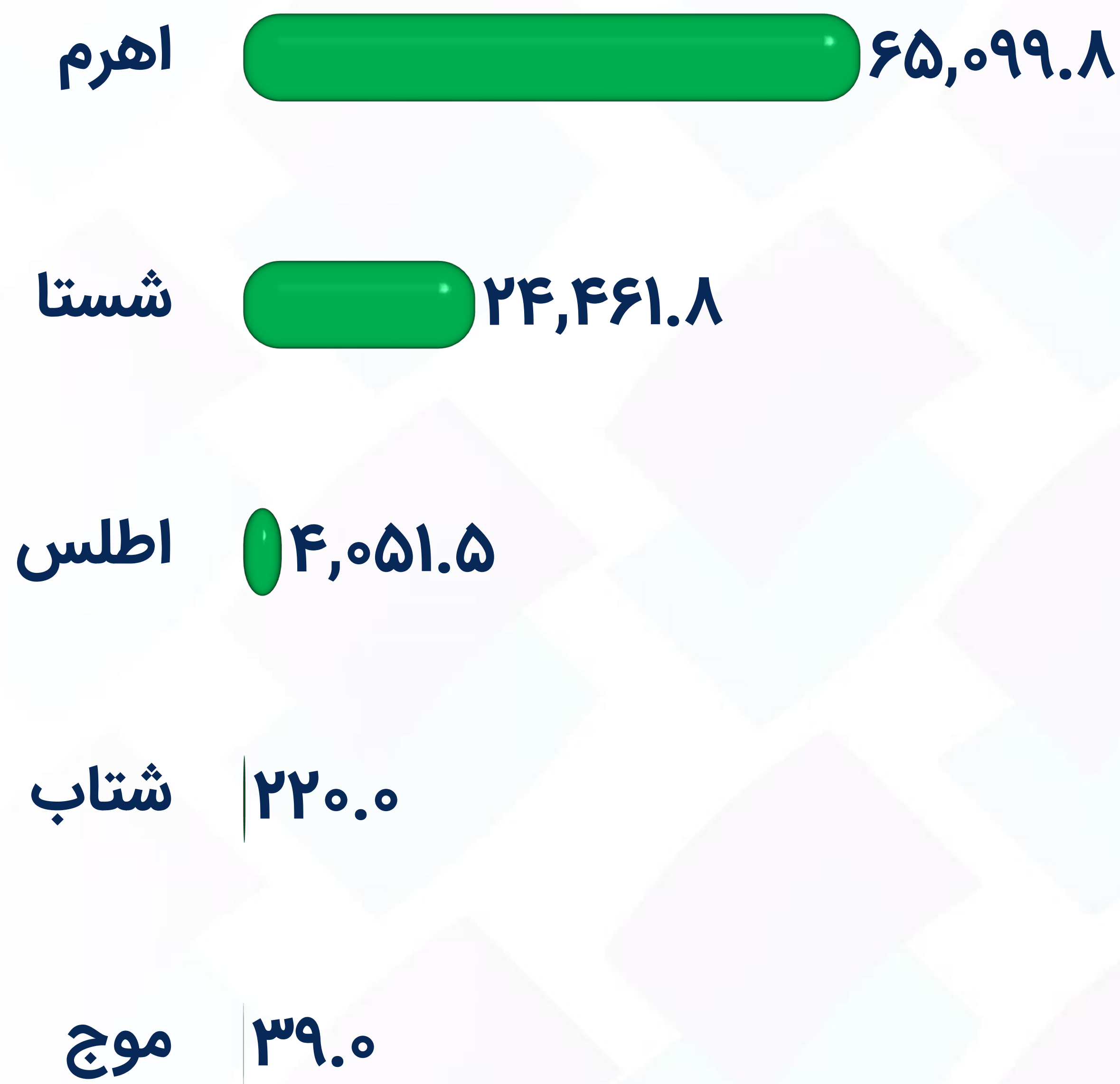
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



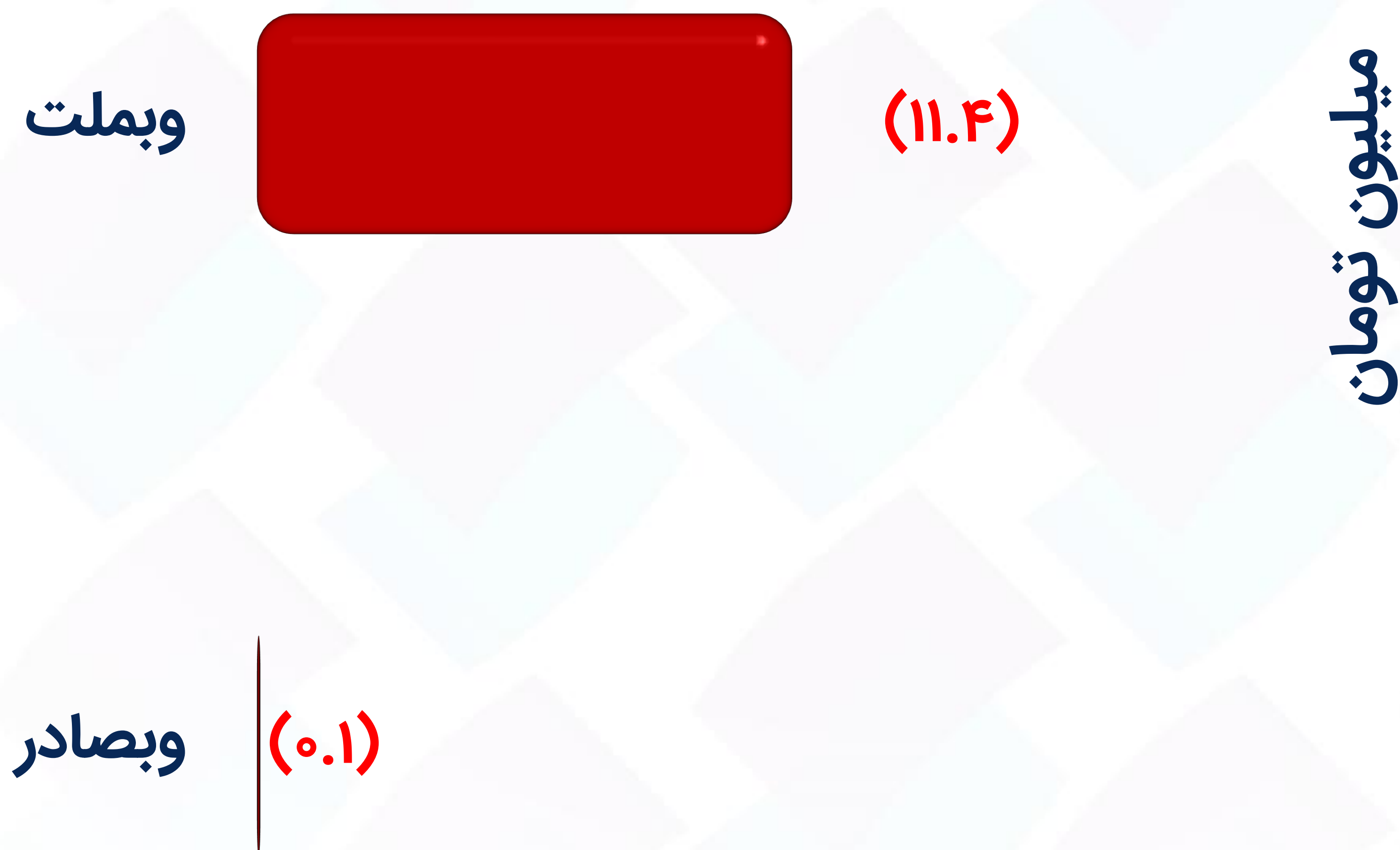
میلیارد تومان

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
ضفصبا ۷۱۴	فصبا	۲,۸۰۰	۶۹	۳۵.۰	۴۰	۲,۵۶۹	۲,۸۴۰	۱۰.۵%	۷۱.۰	۰.۴۴	۸۸	۱۱۹%
ضستا ۵۰۳۱	شستا	۱,۴۰۰	۱۶	۶۳۴.۱	۶	۱,۲۹۷	۱,۴۰۶	۸.۴%	۲۳۴.۳	۰.۲۱	۱۰	۷۱%
ضفصبا ۷۱۳	فصبا	۲,۶۰۰	۶۹	۱۴۴.۱	۱۱۸	۲,۵۶۹	۲,۷۱۸	۵.۸%	۲۳.۰	۰.۷۰	۱۸۷	۵۸%
ضستا ۵۰۳۰	شستا	۱,۳۰۰	۱۶	۵,۵۵۴.۲	۳۲	۱,۲۹۷	۱,۳۳۲	۲.۷%	۴۱.۶	۰.۶۰	۴۷	۴۶%
ضفلا ۵۰۱۵	فولاد	۳,۲۵۰	۱۶	۴۴.۰	۶۵	۳,۲۰۳	۳,۳۱۵	۳.۵%	۵۱.۰	۰.۵۳	۹۱	۴۱%

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
ضتاب ۵۰۰۸	شتاب	۲۰,۰۰۰	۹	۲.۲	۵	۱۲,۱۸۰	۲۰,۰۰۵	۶۴%	۴,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضتاب ۵۰۰۷	شتاب	۱۸,۰۰۰	۹	۲.۶	۶	۱۲,۱۸۰	۱۸,۰۰۶	۴۸%	۳,۰۰۱.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۵۸	۵.۰	۷۱	۲۱,۰۵۰	۴۶,۰۷۱	۱۱۹%	۶۴۸.۹	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۸	۵.۹	۹۰	۲۱,۰۵۰	۴۲,۰۹۰	۱۰۰%	۴۶۷.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۲	اهرم	۳۴,۰۰۰	۳۰	۱.۵	۵۲	۲۱,۰۵۰	۳۴,۰۵۲	۶۲%	۶۵۴.۸	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	۲۰	۱۵.۵	۲۵۰	۲۰,۶۳۳	۱۹,۷۵۰	(۴.۳%)	۷۹.۰	-۰.۲۷	۳۳۵	۳۳.۹%
طهرم ۵۰۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۳۰	۱,۶۷۴.۶	۶,۲۵۱	۲۱,۰۵۰	۲۱,۷۴۹	۳.۳%	۳.۵	-۰.۹۹	۶,۰۷۶	(۲.۸%)
طهرم ۶۰۳۶	اهرم	۴۶,۰۰۰	۵۸	۸۵.۸	۲۳,۸۲۸	۲۱,۰۵۰	۲۲,۱۷۲	۵.۳%	۰.۹	-۱.۰۰	۲۲,۵۲۳	(۵.۵%)
طهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۳۰	۱۲۳.۱	۸,۵۴۶	۲۱,۰۵۰	۲۱,۴۵۴	۱.۹%	۲.۵	-۱.۰۰	۸,۰۰۷	(۶.۳۱%)
طاطلس ۵۰۴	اطلس	۶۵,۰۰۰	۶	۲۵.۰	۲,۹۷۹	۶۱,۹۳۳	۶۲,۰۲۱	۰.۱%	۲۰.۸	-۰.۸۷	۲,۷۶۵	(۷.۲%)

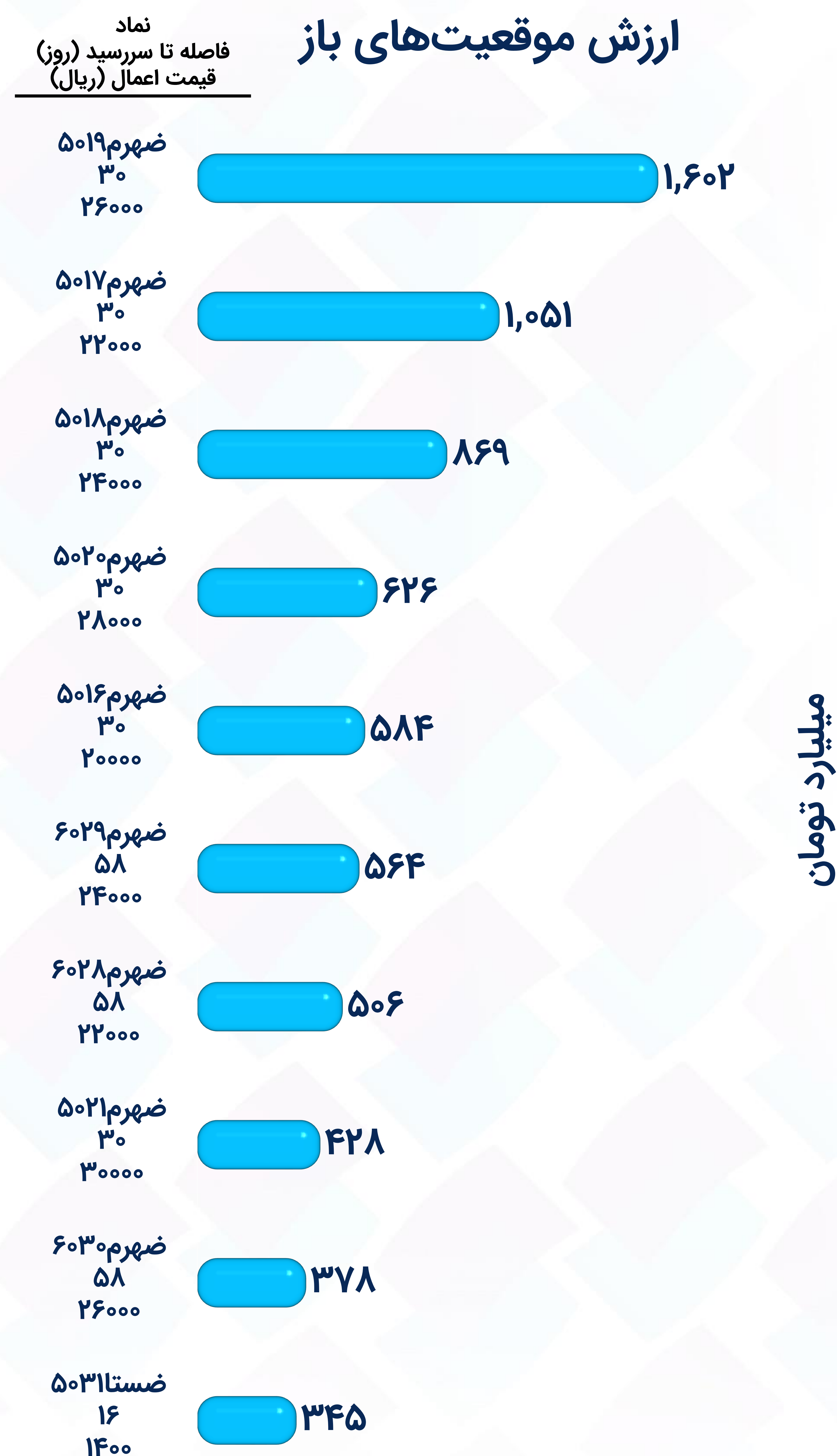
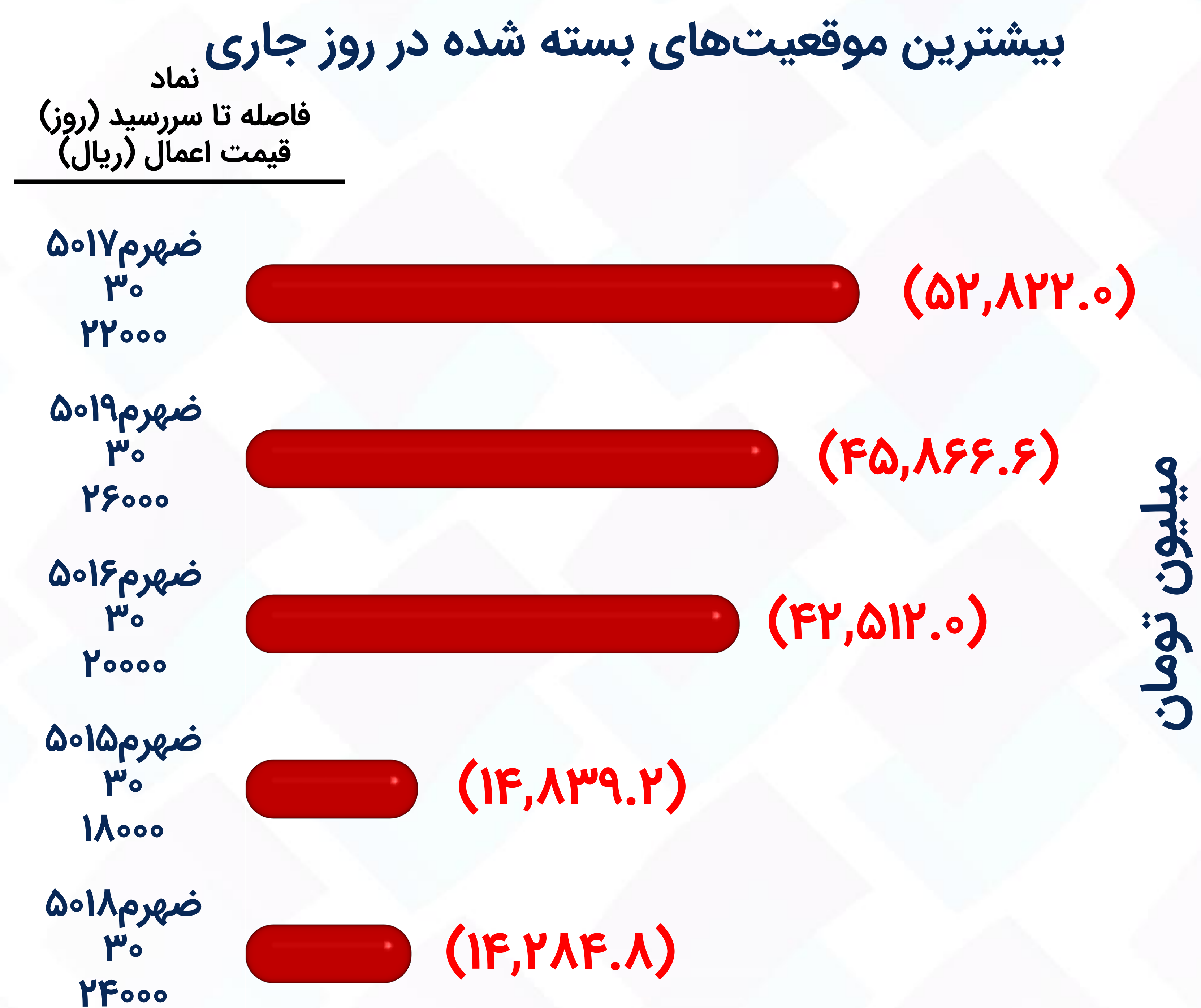
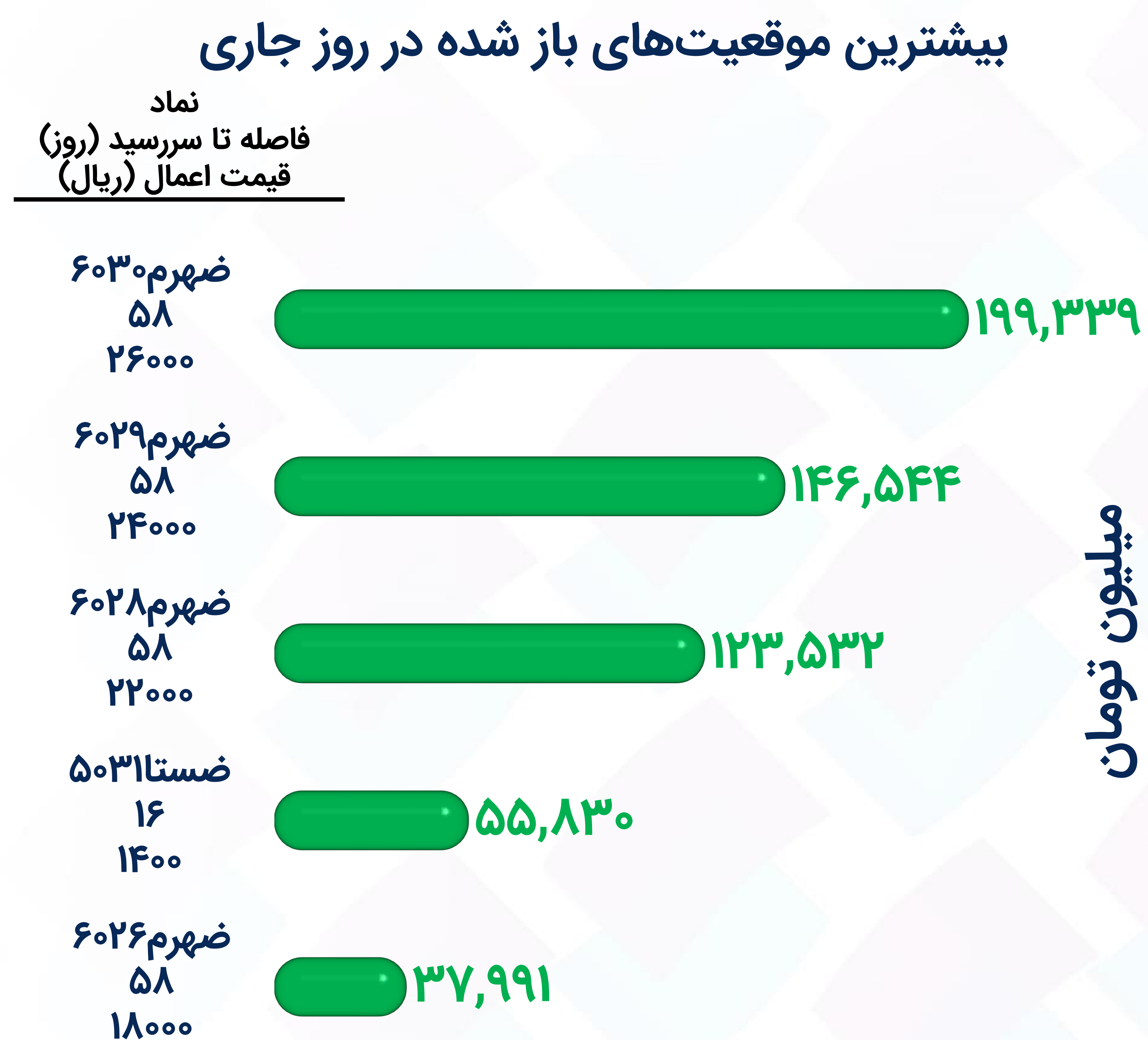
گرانترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طاطلس ۵۰۱	اطلس	۵۰,۰۰۰	۶	۱.۵	۱۳	۶۱,۹۳۳	۴۹,۹۸۷	(۱۹.۳%)	۳,۸۴۵.۲	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۵۰۲۷	شستا	۱,۰۰۰	۱۶	۰.۰	۱	۱,۲۹۷	۹۹۹	(۲۳.۰%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۳۰	۵.۸	۲۶	۲۱,۰۵۰	۱۴,۹۷۴	(۲۸.۹%)	۵۷۵.۹	۰.۰۰	۰	(۹۹.۶%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۳۰	۲۷.۶	۳۹	۲۱,۰۵۰	۱۵,۹۶۱	(۲۴.۲%)	۴۰۹.۳	۰.۰۰	۱	(۹۷.۳%)
طهرم ۶۰۲۵	اهرم	۱۶,۰۰۰	۵۸	۸۴۵.۹	۲۲۶	۲۱,۰۵۰	۱۵,۷۷۴	(۲۵.۱%)	۶۹.۸	-۰.۰۱	۷	(۹۶.۹%)

(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)

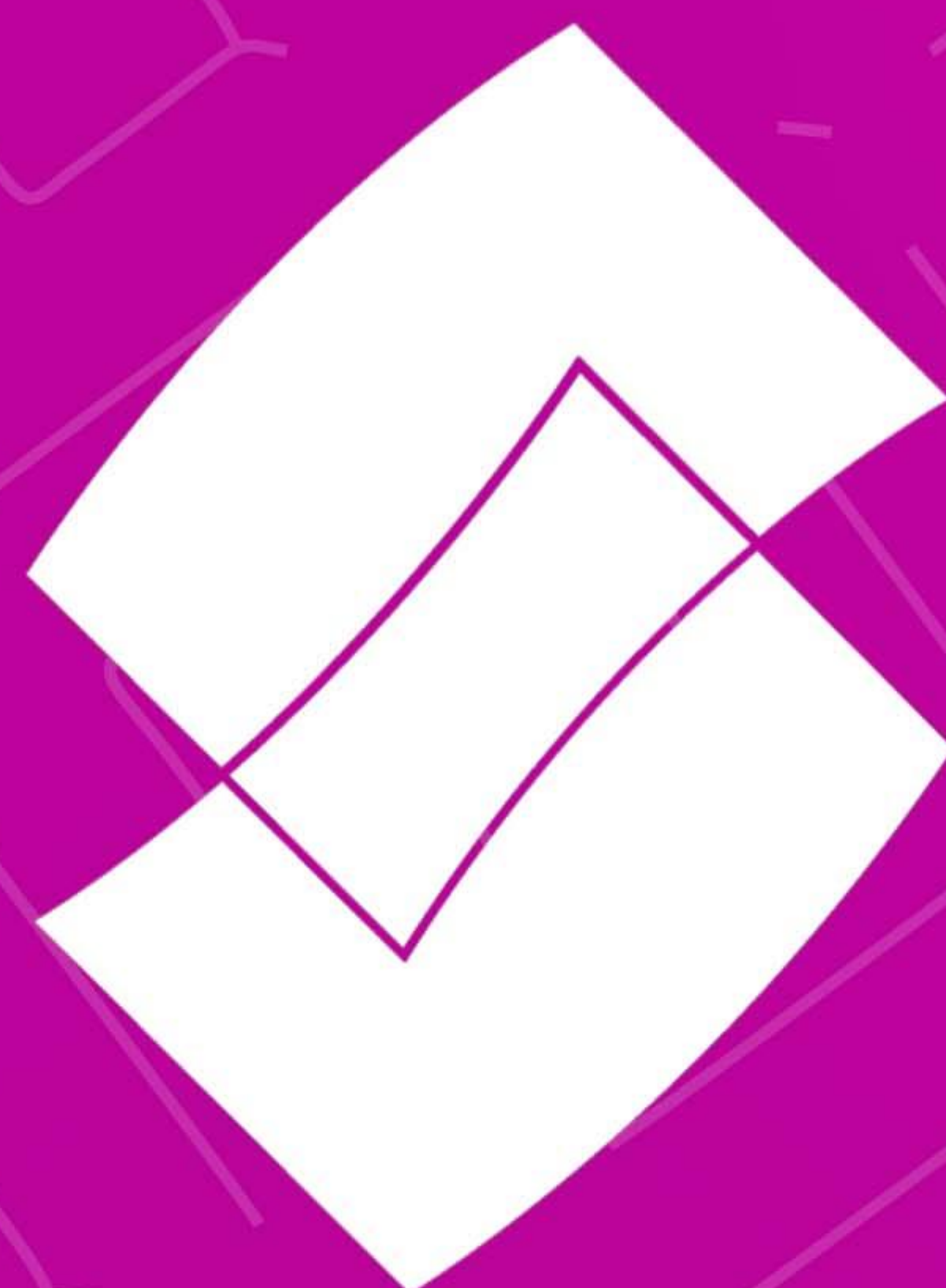
اختیار خرید



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.