

شماره
۵۱۴

اولین گزارش تخصصی روزانه

بازار اختیار معامله

۳۱ تیر ۱۴۰۴

کارگزاری تأمین سرمایه نوین

شرکت سهامی خاص

کارگزار رسمی سازمان بورس و اوراق بهادار

NOVIN Investment Bank Brokerage





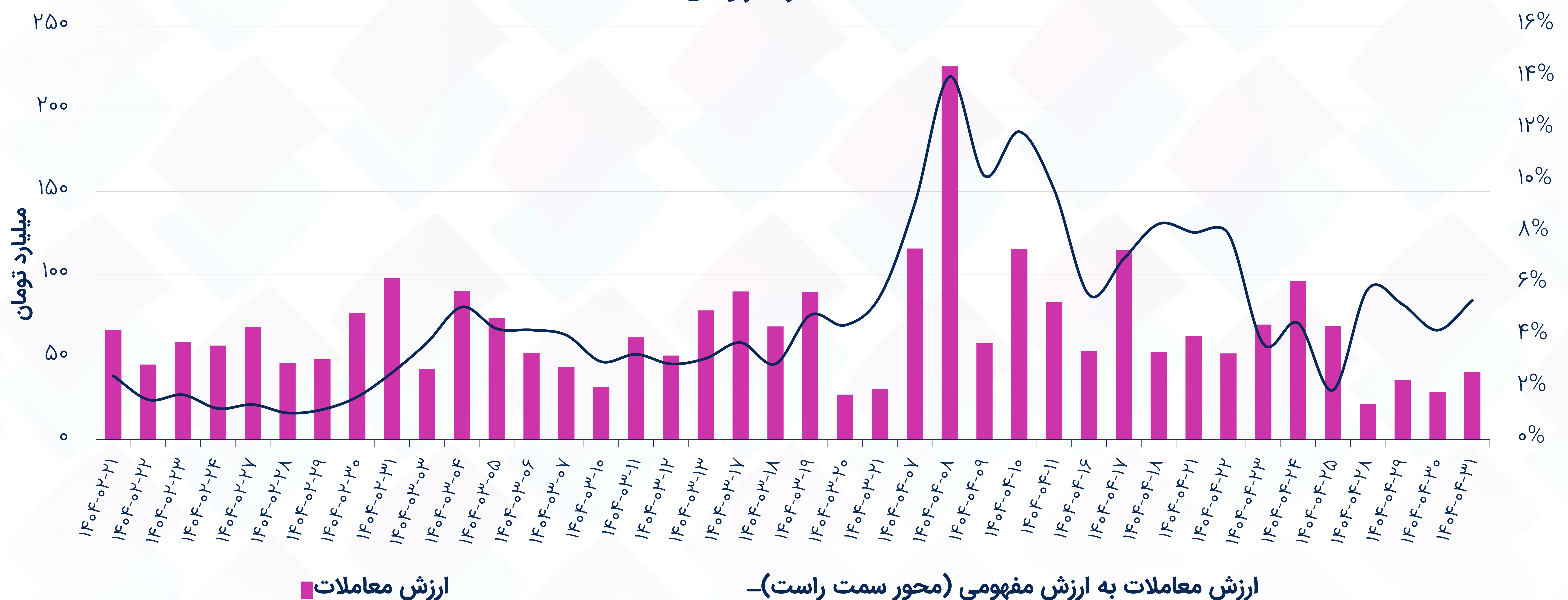
اختیار استفاده از اهرم یا پوشش ریسک باشماست!

ارزش معاملات

اختیار خرید



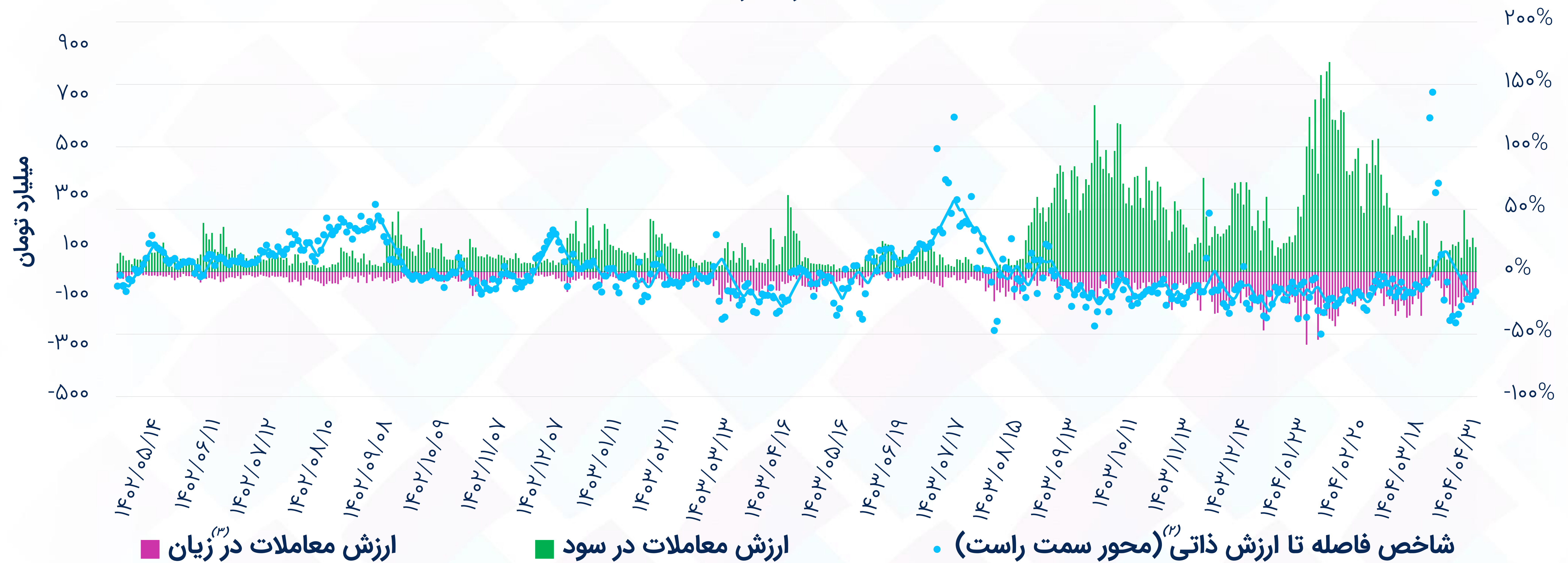
اختیار فروش



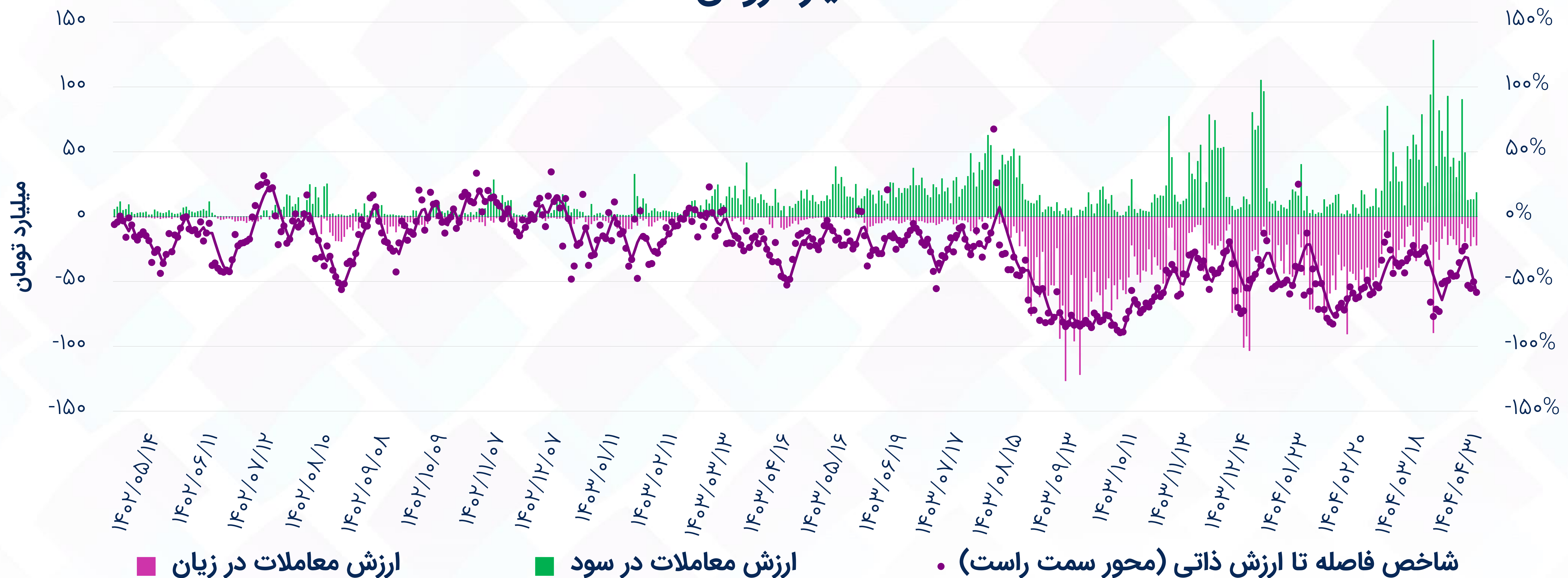
(۱) ارزش مفهومی معاملات: حجم معامله * اندازه قرارداد * قیمت دارایی پایه

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	۳۷	۱۸۸.۲	۲,۳۳۰.۹	۸۵.۳	۱۰۲.۹	(۱۸.۷%)
شستا	۲۴	۸.۳	۲۸۸.۴	۷.۷	۰.۶	۳۱.۲%
ذوب	۲۰	۴.۲	۱۰۶.۶	۰.۸	۳.۴	(۱۰.۶%)
شتاب	۵	۱.۲	۲۷.۶	۱.۲	۰.۰	۲۰.۱%
موج	۶	۰.۸	۱۴.۸	۰.۶	۰.۲	۰.۲%
اطلس	۷	۰.۶	۱۶.۰	۰.۶	۰.۰	۸.۹%
فزر	۵	۰.۴	۱.۳	۰.۴	۰.۰	۲.۷%

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	۲۰	۳۸,۷۷۱.۳	۶۴۹,۱۰۱.۱	۱۶,۹۵۰.۷	۲۱,۸۲۰.۷	(۵۹.۸%)
شستا	۸	۱,۷۳۴.۷	۹۹,۹۱۸.۵	۱,۵۱۱.۳	۲۲۳.۴	(۳۰.۲%)
موج	۳	۱۳۳.۹	۲,۳۸۵.۰	۱۰۳.۵	۳۰.۴	(۳۰.۰%)
توان	۲	۶۳.۱	۱,۰۰۱.۵	۶۲.۴	۰.۶	(۴۵.۷%)
خودران	۳	۲۱.۲	۴۳۵.۹	۱۸.۶	۲.۶	(۳۲.۸%)
اطلس	۳	۱۸.۸	۳,۸۱۰.۳	۳.۸	۱۵.۰	(۵۲.۹%)
فولاد	۵	۱۰.۷	۲۰۹.۸	۹.۴	۱.۳	(۲۷.۴%)

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

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

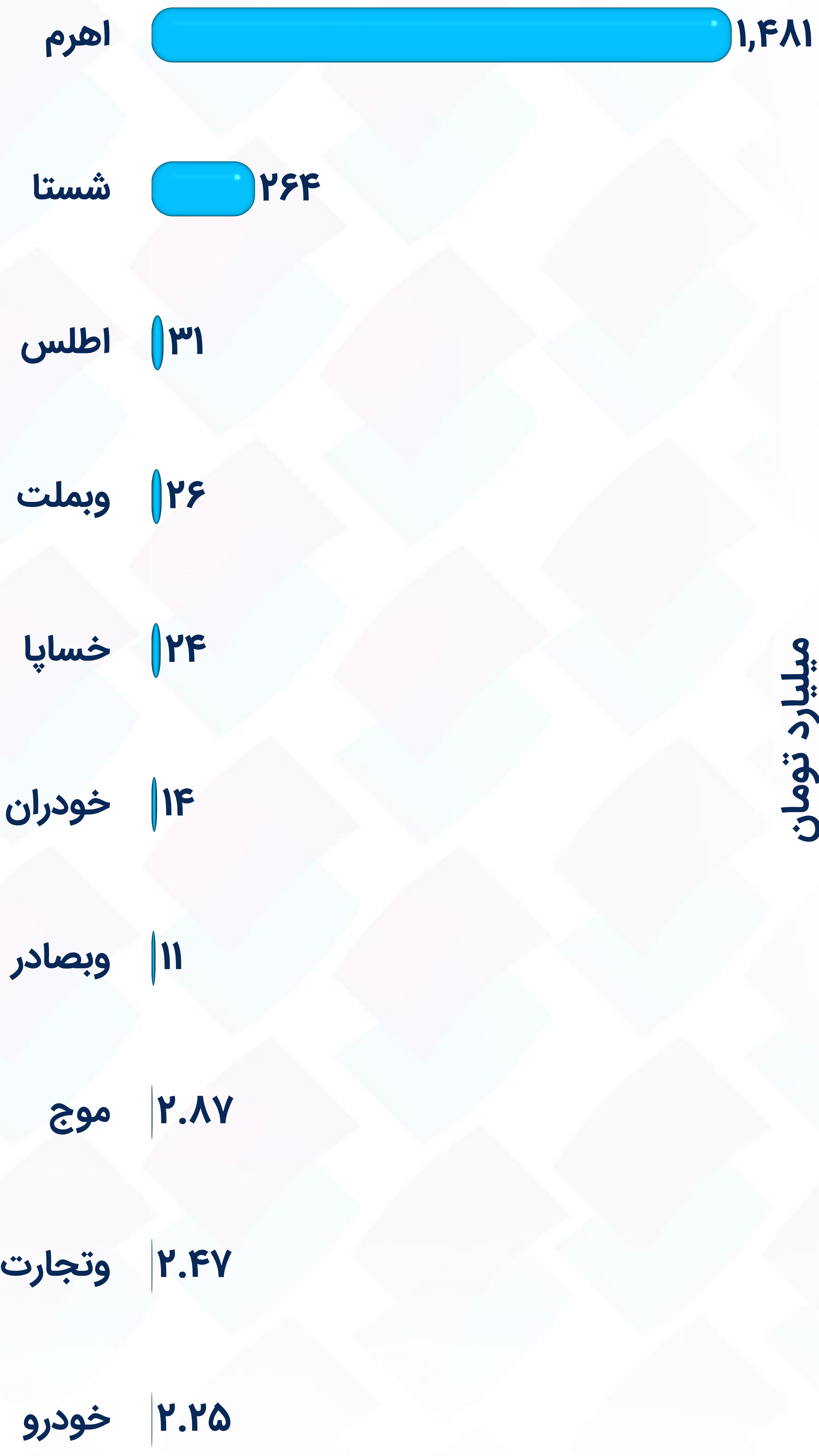


میلیون تومان

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

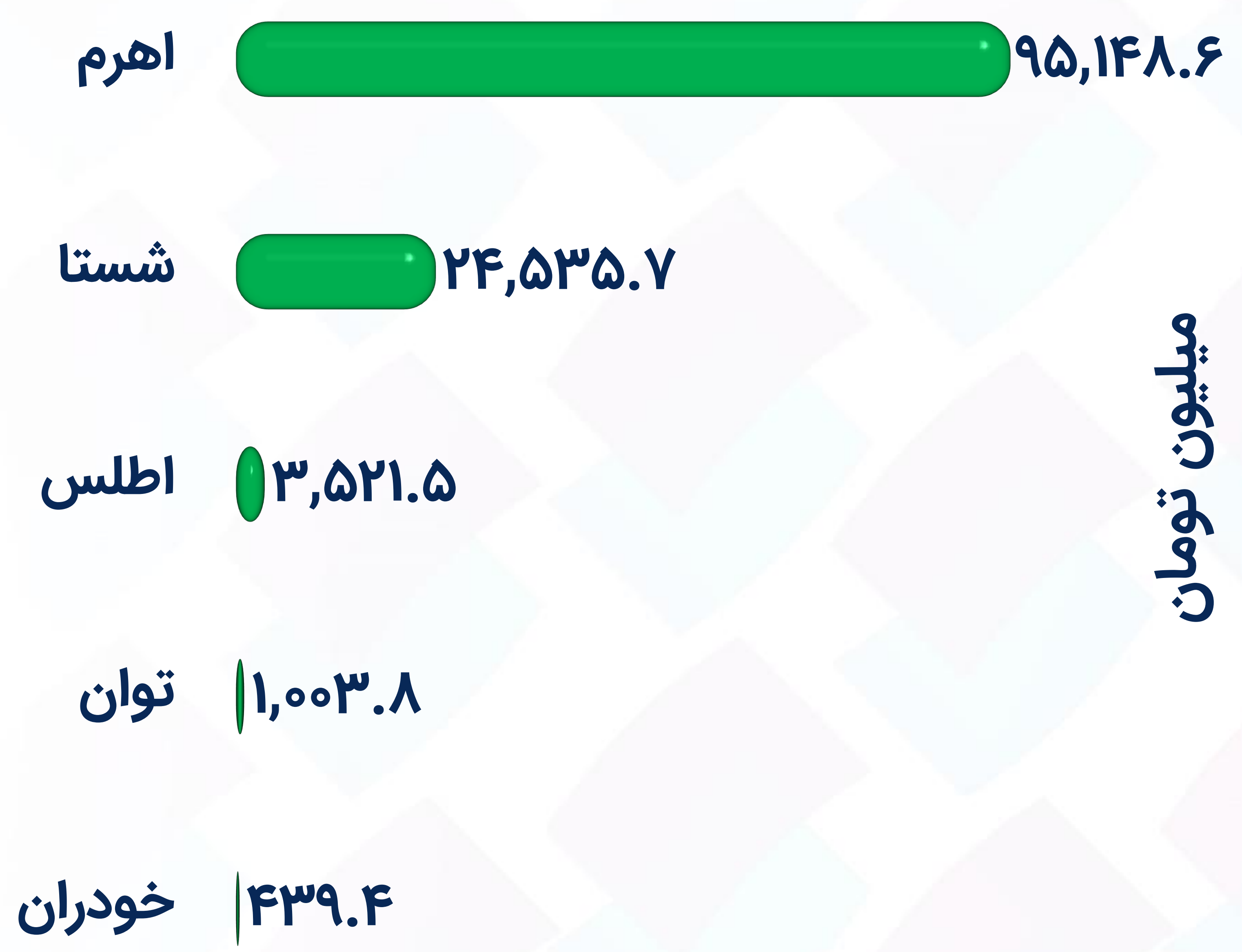
موقعیت‌های باز به تفکیک دارایی پایه - اختیار فروش

ارزش موقعیت‌های باز



میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری



میلیون تومان

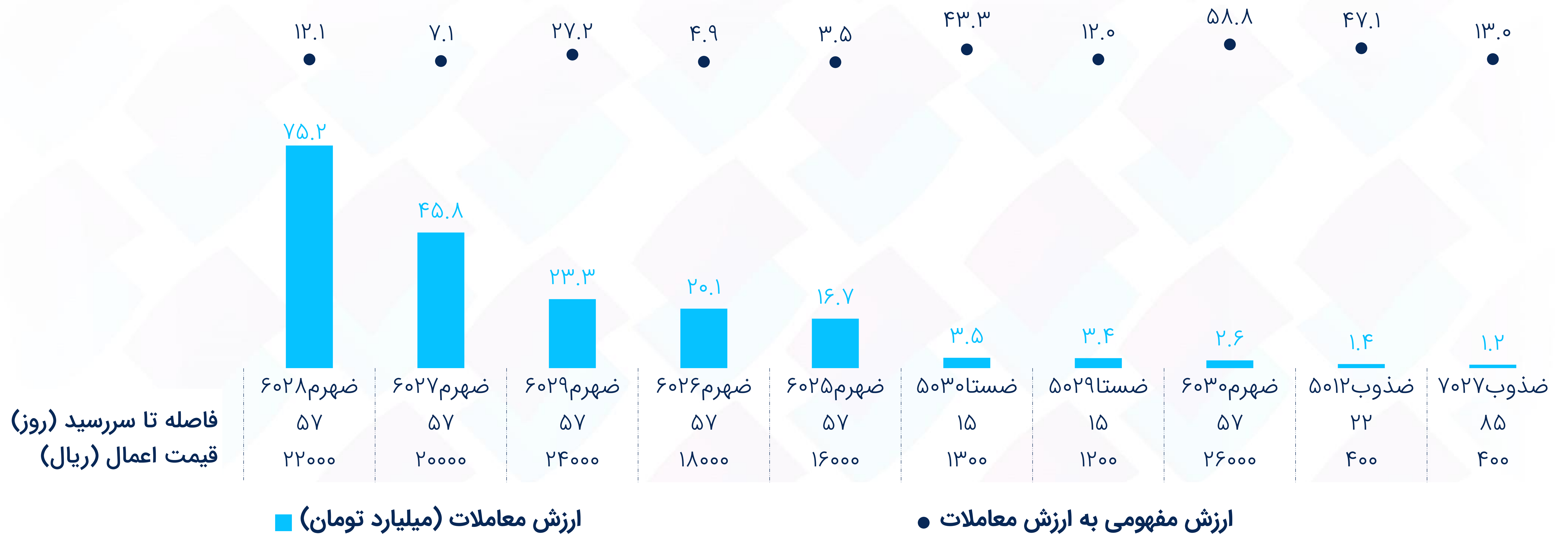
بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری



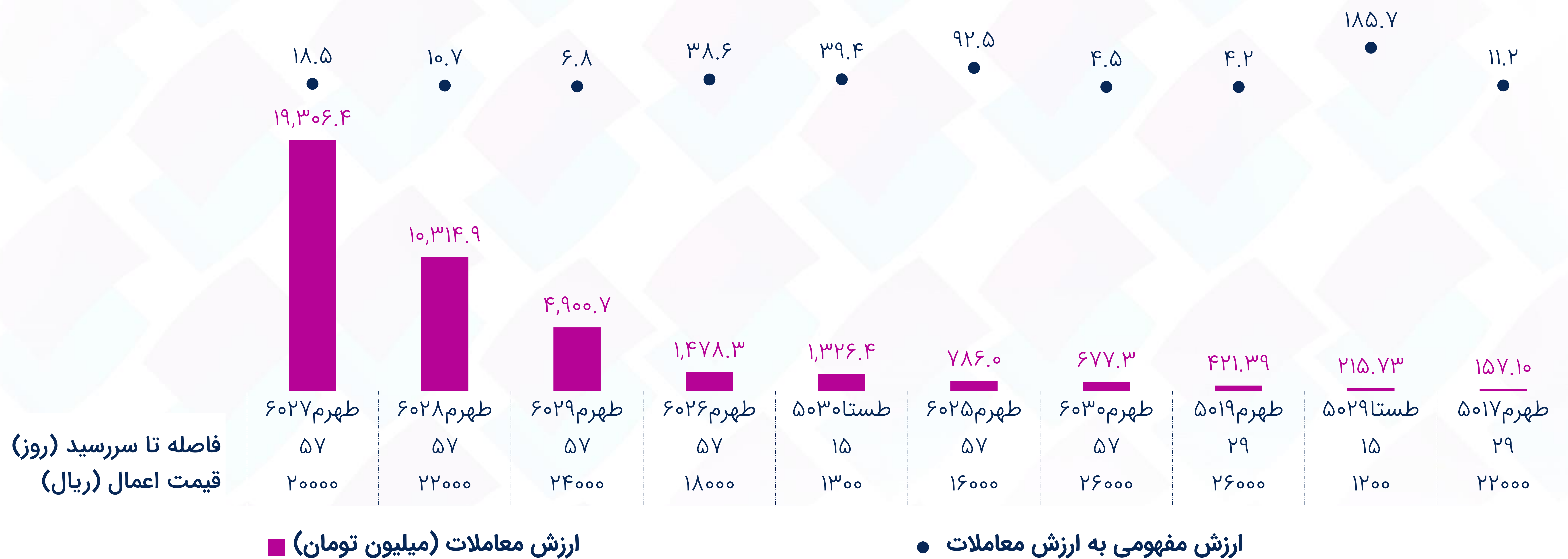
میلیون تومان

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
ضفلا ۷۰۵۴	فولاد	۳,۵۰۰	۷۱	۵۰.۸	۵۱	۳,۱۵۳	۳,۵۵۱	۱۲.۶%	۶۹.۶	۰.۴۱	۱۱۱	۱۱۸%
ضفلا ۵۰۱۶	فولاد	۳,۵۰۰	۱۵	۴.۴	۴	۳,۱۵۳	۳,۵۰۴	۱۱.۱%	۸۷۶.۰	۰.۰۹	۸	۱۱۰%
ضفلا ۵۰۱۵	فولاد	۳,۲۵۰	۱۵	۱۴۰.۵	۳۲	۳,۱۵۳	۳,۲۸۲	۴.۱%	۱۰۲.۶	۰.۴۳	۶۲	۹۳%
ضستا ۵۰۳۱	شستا	۱,۴۰۰	۱۵	۲۵۶.۷	۵	۱,۳۰۰	۱,۴۰۵	۸.۱%	۲۸۱.۰	۰.۲۰	۱۰	۹۱%
ضفصبا ۷۱۴	فصبا	۲,۸۰۰	۶۸	۱.۶	۴۰	۲,۵۳۲	۲,۸۴۰	۱۲.۲%	۷۱.۰	۰.۳۸	۷۰	۷۴%

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	۵۷	۵.۲	۵۷	۲۱,۱۸۰	۴۶,۰۵۷	۱۱۷%	۸۰۸.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۵	اهرم	۴۲,۰۰۰	۵۷	۴.۴	۶۹	۲۱,۱۸۰	۴۲,۰۶۹	۹۹%	۶۰۹.۷	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۵۰۲۲	اهرم	۳۴,۰۰۰	۲۹	۲.۱	۲۸	۲۱,۱۸۰	۳۴,۰۲۸	۶۱%	۱,۲۱۵.۳	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضهرم ۶۰۳۴	اهرم	۳۸,۰۰۰	۵۷	۱۸.۶	۸۸	۲۱,۱۸۰	۳۸,۰۸۸	۸۰%	۴۳۲.۸	۰.۰۰	۰	(۱۰۰%)
ضدوب ۶۰۰۴	ذوب	۶۰۰	۴۹	۳.۲	۳	۳۷۷	۶۰۳	۶۰%	۲۰۱.۰	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
طهرم ۵۰۲۰	اهرم	۲۸,۰۰۰	۲۹	۱۲۹.۰	۶,۰۸۴	۲۱,۱۸۰	۲۱,۹۱۶	۳.۵%	۳.۶	-۰.۹۹	۵,۹۸۵	(۱.۶%)
طفلا ۷۰۵۴	فولاد	۳,۵۰۰	۷۱	۶.۵	۲۵۴	۳,۱۵۳	۳,۲۴۶	۲.۹%	۱۲.۸	-۰.۵۹	۲۳۳	(۸.۴%)
طهرم ۵۰۲۱	اهرم	۳۰,۰۰۰	۲۹	۸۴.۲	۸,۸۶۸	۲۱,۱۸۰	۲۱,۱۳۲	(۰.۲%)	۲.۴	-۱.۰۰	۷,۹۱۹	(۱۰.۷%)
طستا ۵۰۳۲	شستا	۱,۵۰۰	۱۵	۱۶.۳	۲۰۰	۱,۳۰۰	۱,۳۰۰	۰.۰%	۶.۵	-۰.۹۷	۱۷۶	(۱۱.۸۷%)
طهرم ۶۰۳۳	اهرم	۳۴,۰۰۰	۵۷	۷.۵	۱۲,۵۷۵	۲۱,۱۸۰	۲۱,۴۲۵	۱.۲%	۱.۷	-۱.۰۰	۱۱,۰۷۶	(۱۱.۹%)

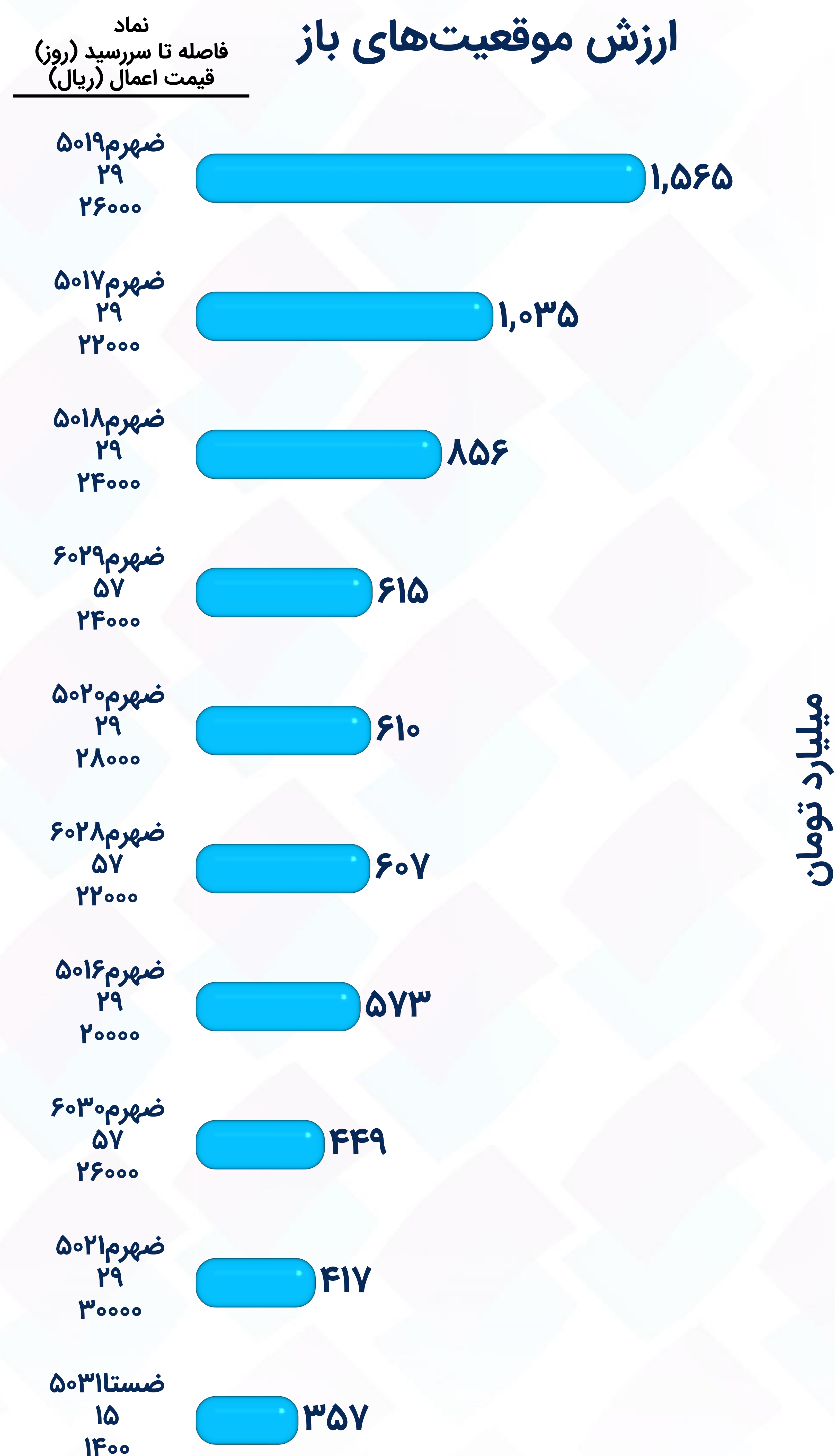
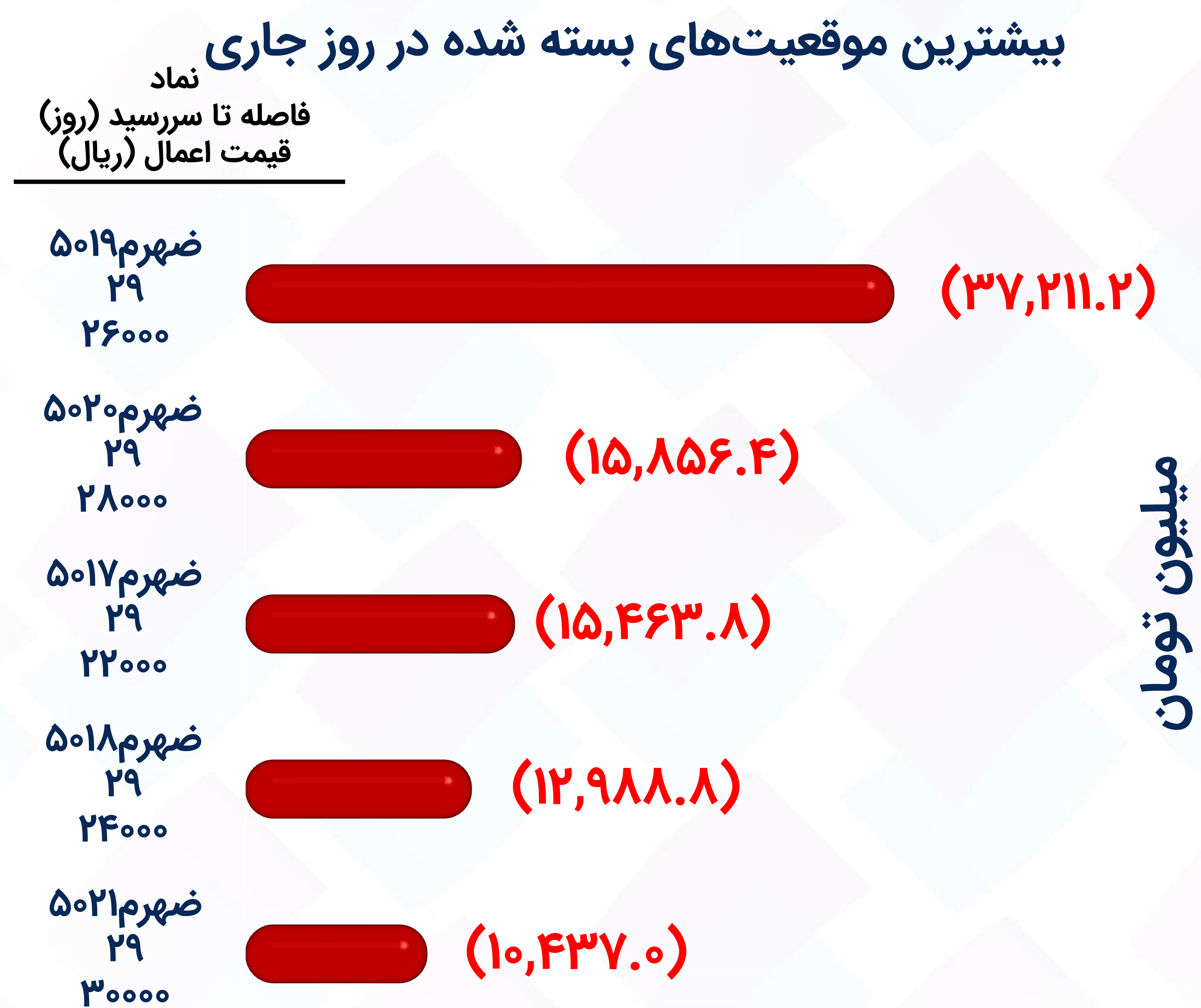
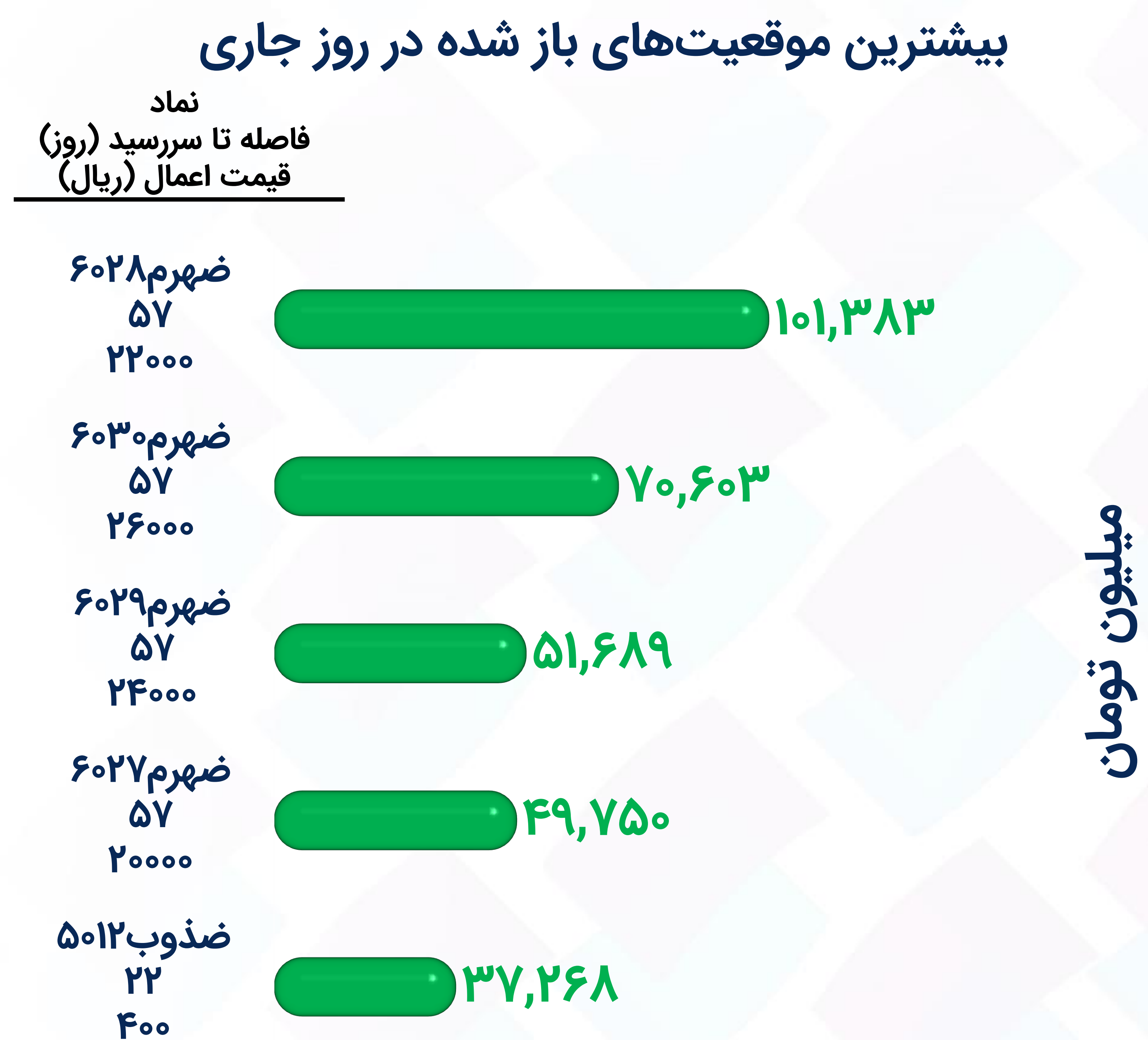
گران‌ترین نسبت به ارزش بلک شولز

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
طفلا ۵۰۱۱	فولاد	۲,۴۰۰	۱۵	۰.۰	۲۰	۳,۱۵۳	۲,۳۸۰	(۲۴.۵%)	۱۱۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طستا ۵۰۲۷	شستا	۱,۰۰۰	۱۵	۰.۰	۱	۱,۳۰۰	۹۹۹	(۲۳.۲%)	۹۹۹.۰	۰.۰۰	۰	(۱۰۰.۰%)
طاطلس ۵۰۲	اطلس	۵۵,۰۰۰	۵	۰.۰	۲۰	۶۲,۲۴۰	۵۴,۹۸۰	(۱۱.۷%)	۲,۷۴۹.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۹%)
طهرم ۵۰۱۳	اهرم	۱۵,۰۰۰	۲۹	۰.۲	۸	۲۱,۱۸۰	۱۴,۹۹۲	(۲۹.۲%)	۱,۸۷۴.۰	۰.۰۰	۰	(۹۹.۲%)
طهرم ۵۰۱۴	اهرم	۱۶,۰۰۰	۲۹	۰.۱	۳۲	۲۱,۱۸۰	۱۵,۹۶۸	(۲۴.۶%)	۴۹۹.۰	۰.۰۰	۱	(۹۷.۸%)

(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)

طهرم ۵۰۱۴
۲۹
۱۶۰۰۰ ۲۶۱

طهرم ۵۰۱۵
۲۹
۱۸۰۰۰ ۲۵۰

طهرم ۶۰۲۷
۵۷
۲۰۰۰۰ ۱۶۲

طهرم ۵۰۱۷
۲۹
۲۲۰۰۰ ۱۵۳

طهرم ۵۰۱۶
۲۹
۲۰۰۰۰ ۱۴۳

طستا ۵۰۲۹
۱۵
۱۲۰۰ ۱۲۶

طهرم ۶۰۲۵
۵۷
۱۶۰۰۰ ۱۱۷

طستا ۵۰۳۰
۱۵
۱۳۰۰ ۷۲

طهرم ۶۰۲۶
۵۷
۱۸۰۰۰ ۷۰

طهرم ۶۰۲۸
۵۷
۲۲۰۰۰ ۶۸

میلیارد تومان

بیشترین موقعیت‌های باز شده در روز جاری

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

طهرم ۶۰۲۶
۵۷
۱۸۰۰۰ ۲۸,۸۴۱.۴

طهرم ۶۰۲۵
۵۷
۱۶۰۰۰ ۲۸,۱۴۸.۸

طهرم ۶۰۲۷
۵۷
۲۰۰۰۰ ۲۰,۰۱۰.۰

طستا ۵۰۲۹
۱۵
۱۲۰۰ ۱۶,۰۶۰.۹

طهرم ۶۰۲۸
۵۷
۲۲۰۰۰ ۱۵,۴۴۱.۸

میلیون تومان

بیشترین موقعیت‌های بسته شده در روز جاری

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

طهرم ۵۰۱۵
۲۹
۱۸۰۰۰ (۵,۵۰۴.۴)

طهرم ۵۰۱۶
۲۹
۲۰۰۰۰ (۲,۲۶۰.۰)

طهرم ۵۰۱۹
۲۹
۲۶۰۰۰ (۲,۱۸۹.۲)

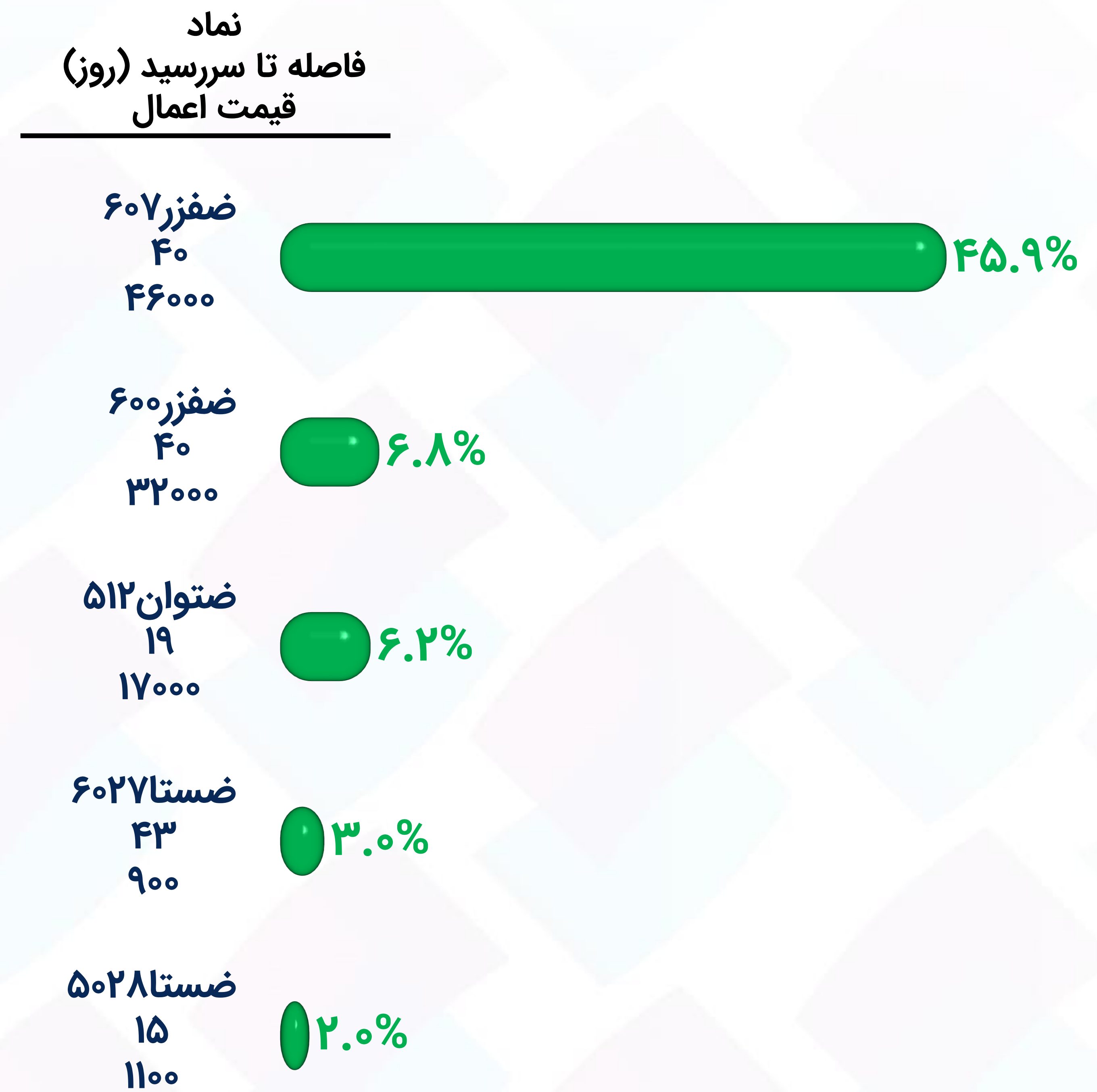
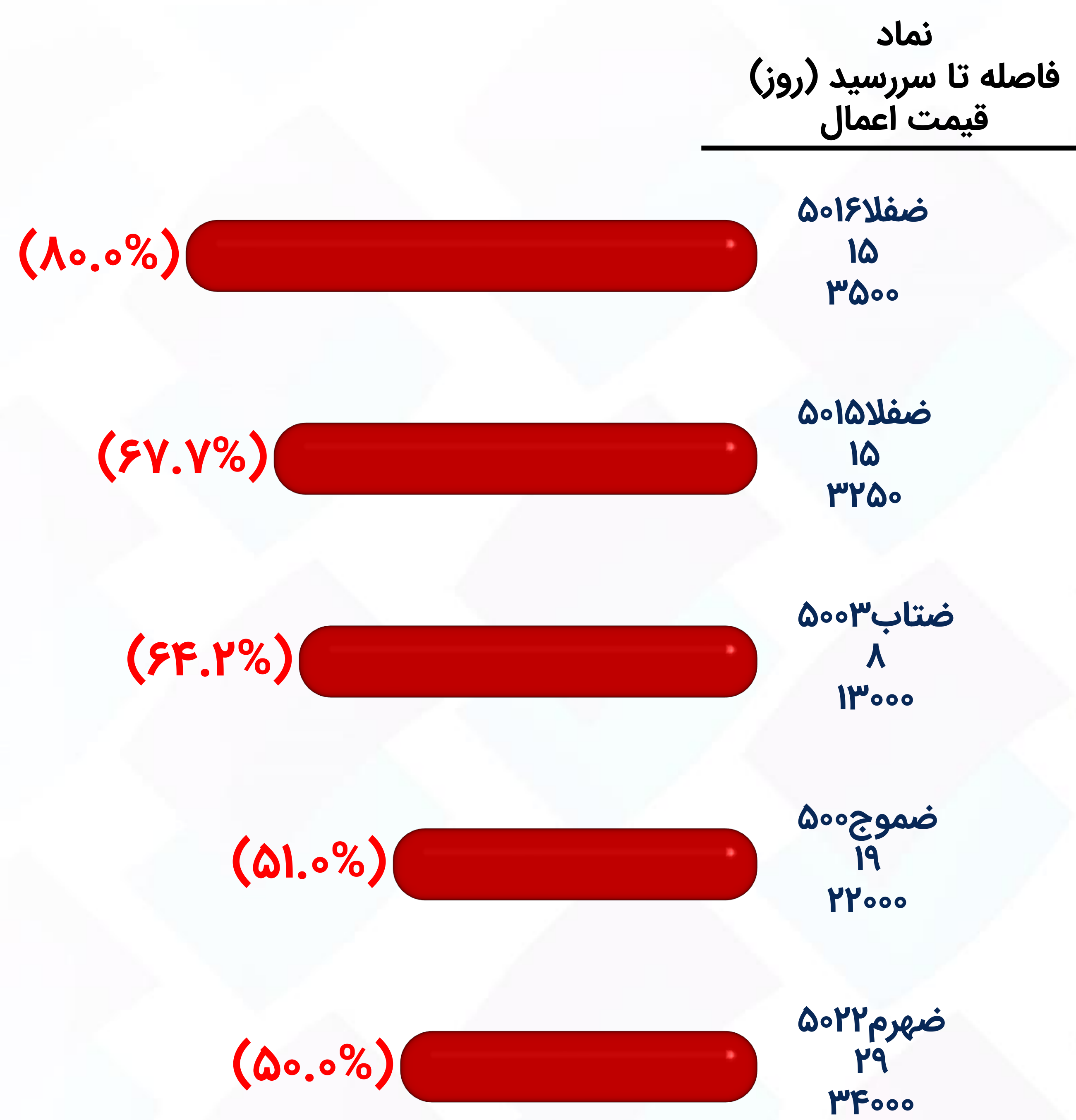
طهرم ۵۰۱۷
۲۹
۲۲۰۰۰ (۱,۸۲۳.۸)

طستا ۵۰۲۸
۱۵
۱۱۰۰ (۱,۳۲۰.۰)

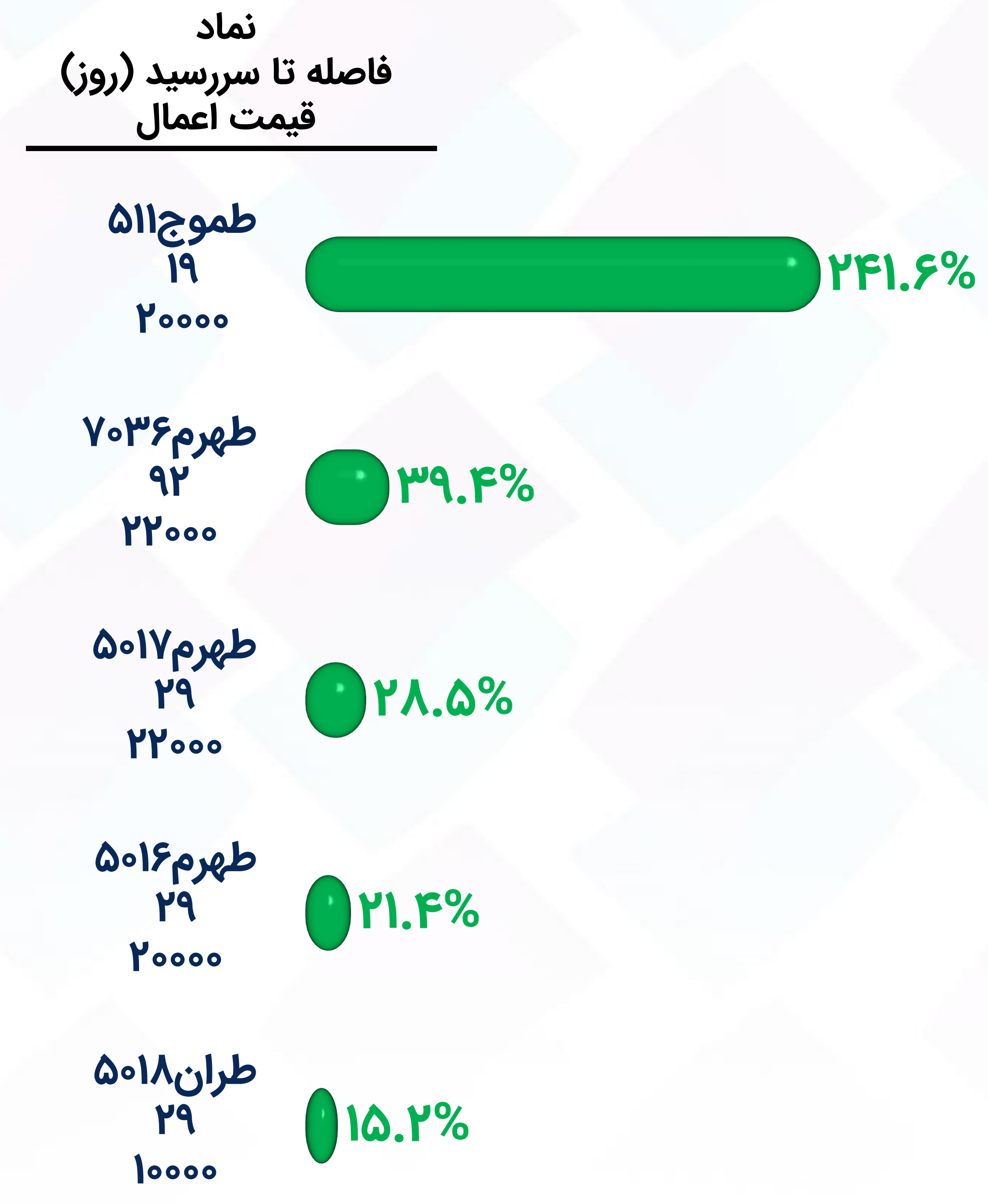
میلیون تومان

بیشترین تغییرات قیمت (۱)

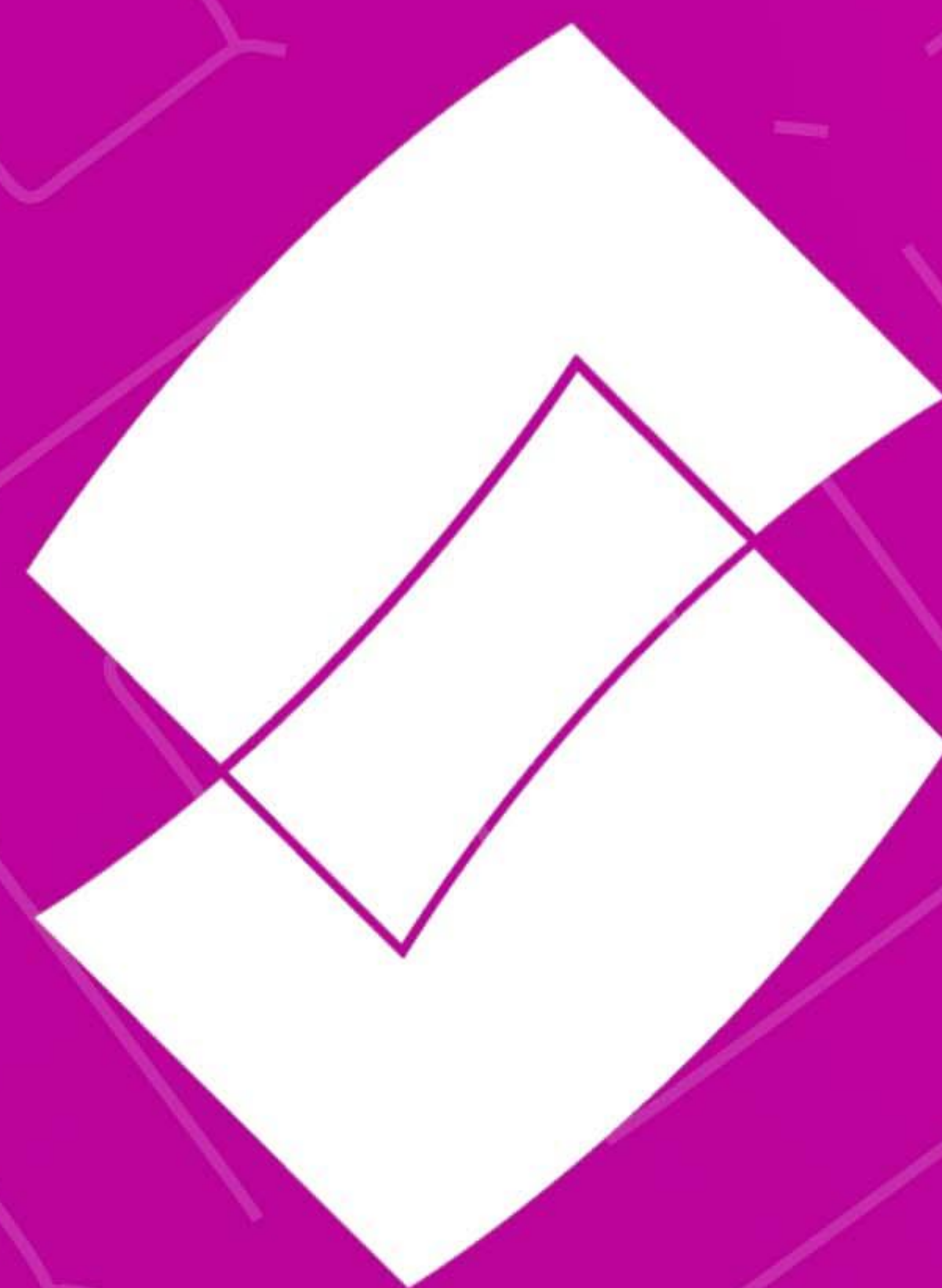
اختیار خرید



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.