

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

اهرم را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

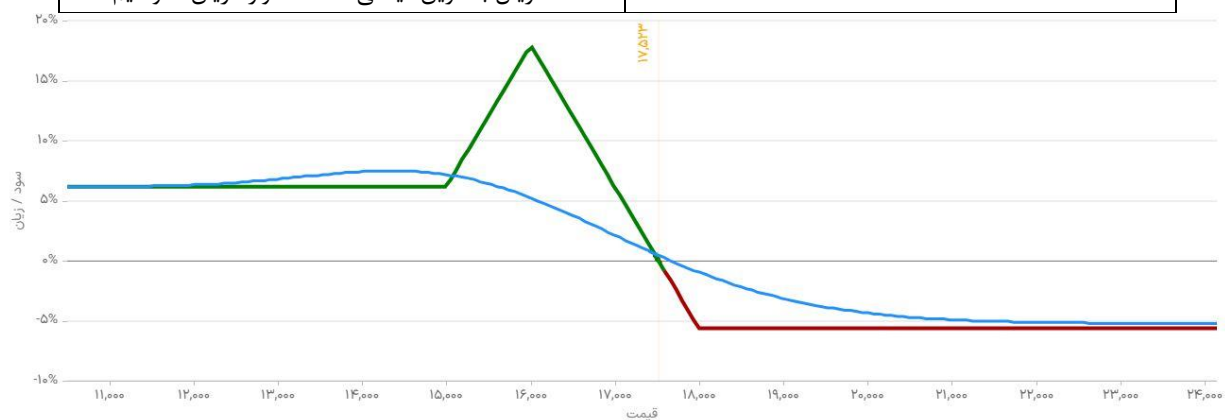
پس از هر مرحله افت شدید قیمت در نماد اهرم و رسیدن به سطح حمایتی، شاهد درجا زدن قیمت برای نماد اهرم هستیم. پس از اصلاح اخیر، قیمت به سقف پیشین رسیده و احتمالاً با افزایش تقاضا رو به رو خواهد شد. با توجه به شدید بودن افت قیمت، انتظار نمی‌رود که در صورت افزایش تقاضا نیز، شاهد رشد چشم گیر نماد اهرم باشیم و هدف پیش رو حوالی ۱۶۹۰ تومان خواهد بود. از منظر تکنیکال انتظار می‌رود که اهرم مدتی از نظر زمانی حوالی قیمت‌های ۱۶۰۰ تومان به نوسان خنثی مشغول شود. با توجه به خنثی بودن احتمالی روند، بهتر است برای کسب سود از استراتژی‌های حوزه بازار اختیار بهره برد.

نکات اختیار معامله:

با توجه به این که بازار خنثی بوده و تعیین جهت غیر قابل پیش بینی است، با این استراتژی میتوان از حالت فعلی نوسانات به کسب سود پرداخت و با توجه به این که ضرر حاصل از این معامله مقدار ثابتی است و بدیهی است هر چه پرمیم پرداختی کمتر باشد این مبلغ کمتر خواهد بود، حالتی بدون ریسک را ایجاد کرده است. برای اجرای این استراتژی باید ۱ قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و ۱ قرارداد اختیار خرید با قیمتی پایین تر از قیمت بازار خرید. همچنین باید ۲ قرار داد خرید با قیمت اعمالی بین دو قرار داد خرید قبلی نیز فروخت تا این استراتژی تکمیل گردد.

ضهرم ۶۰۱۵	اسم نماد ((اختیار خرید))
ضهرم ۶۰۱۶	اسم نماد ((اختیار خرید))
ضهرم ۶۰۱۷	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۴۰۳/۰۶/۲۸	تاریخ سر رسید

اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	خرید ضهرم ۶۰۱۷ با قیمت ۵۸۳ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال میانگین دو قرارداد قبلی	فروش ضهرم ۶۰۱۶ با قیمت ۱۴۵۱ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار خرید)) قیمت اعمال پایین تر	خرید ضهرم ۶۰۱۵ با قیمت ۱۷۹۶ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۷ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	۵.۶ درصد
نقاط سر به سر	در شدیدترین افت قیمت حداقل ۶ درصد سودآوری دارد
	۱۷۵۲۳ ریال بالاترین قیمتی است که وارد زیان نخواهیم شد



این گزارش صرفاً جنبه تحلیلی دارد و هیچگونه سیگنال خرید و یا فروش نمیباشد. (سلب مسئولیت)

تحلیل گر: شریف بخش