

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

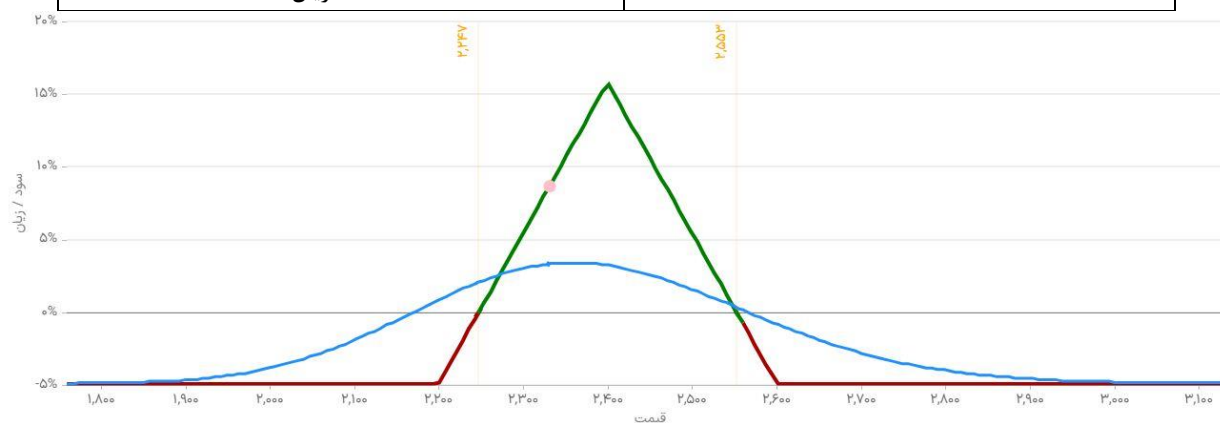
پس از شکسته شدن روند صعودی (روند مشکی) شاهد افت قیمت و ورود به محدوده حمایتی کف قبلی هستیم. با توجه به این که پس از تغییر و شکست یک روند ابتدا وارد فاز خنثی می‌شویم و همچنین نزول شارپی قیمت خودرو، احتمال درجا زدن قیمت در این ناحیه (بین ۲۲۹۰ تا ۲۵۰۰ ریال) بالا می‌رود. معامله در فاز خنثی با توجه به تلاطم شدید سخت است برای این کار بهتر است که از ابزار اختیار استفاده شود.

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.

۶۰۲۷ خود	اسم نماد ((اختیار خرید))
۶۰۲۸ خود	اسم نماد ((اختیار خرید))
۶۰۲۹ خود	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۴۰۳/۰۶/۰۷	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب خرید ۶۰۲۹ خود	۲۲ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ۶۰۲۸ خود	۶۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ۶۰۲۷ خود	۱۴۵ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۵ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	۵ درصد
نقاط سر به سر	۲۲۴۷ ریال
	۲۵۵۳ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش