

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:

نزولی شدید قیمت در نماد خودرو با رسیدن به ناحیه حمایتی همراه شده است. ناحیه حمایتی اخیر از همپوشانی دو سطح دینامیک و استاتیک به دست آمده است. با توجه به این که بازار شرایط مطلوبی ندارد، واکنش مثبت یا عدم واکنش مثبت به این ناحیه مشخص نیست. با توجه به این که سهم نزول شارپی داشته و پس از هر افت قیمت شدید احتمالاً فاز استراحت و نوسانات خنثی پدید می‌آید، دیدگاه درجا زدن قیمت را برای آینده نزدیک سهم داریم. با توجه به چارت، احتمالاً قیمت بین دو محدوده ۲۶۵۰ و ۲۱۵۰ ریال به نوسانات مشغول شود، از این رو استراتژی زیر جهت کسب سود مطلوب است.

### 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. این استراتژی پر ریسک بوده زیرا میزان ضرر مینیمم ندارد و بدیهی است هر چه پرمیم دریافتی بیشتر باشد سود بیشتری کسب خواهد شد. برای اجرای این استراتژی باید ۱ قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و ۱ قرارداد اختیار فروش با قیمتی پایین تر از قیمت بازار فروخت.

|                        |                          |
|------------------------|--------------------------|
| ۶۰۲۹دخود               | اسم نماد ((اختیار خرید)) |
| ۶۰۲۷طخود               | اسم نماد ((اختیار فروش)) |
| 1403/06/07             | تاریخ سر رسید            |
| کسب سود از محدوده خنثی | اسم استراتژی             |

|                                                            |                                                          |
|------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------|
| محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر   | ۱۰ ریال                                                  |
| محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر | ۴۳ ریال                                                  |
| هدف از استراتژی                                            | کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی |
| حداکثر سود (درصد)                                          | ۸ درصد                                                   |
| حداکثر ضرر (درصد)                                          | از دست رفتن تمامی پول                                    |
| نقاط سر به سر                                              | ۲۶۵۳ ریال                                                |
|                                                            | ۲۱۴۷ ریال                                                |



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

تحلیل گر: شریف بخش