

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

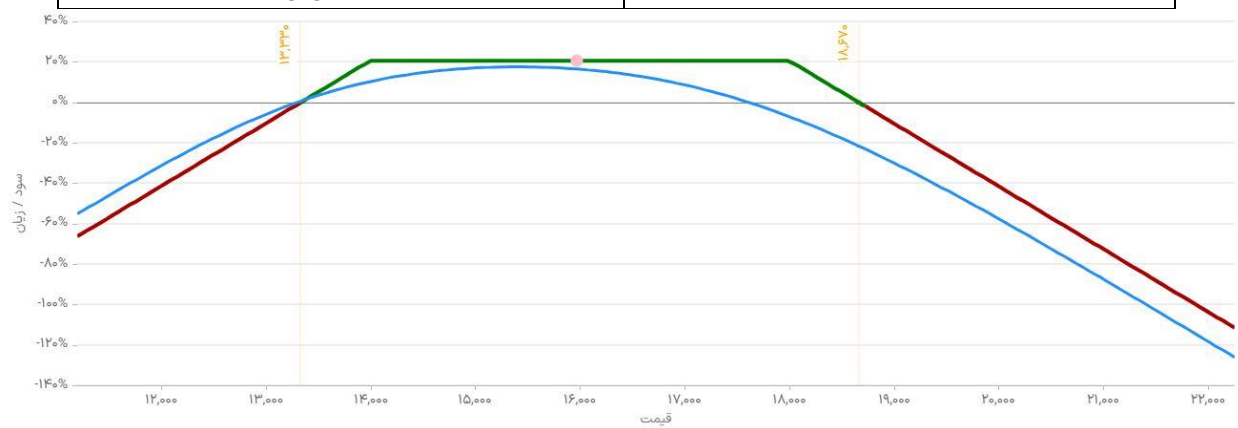
با توجه به افت شدید قیمت نماد اهرم و رسیدن به ناحیه حمایتی، در مرحله اول انتظار واکنش مثبت و در مرحله دوم انتظار ورود نوسانات به فاز خنثی به منظور تکمیل سیکل زمانی نوسانات داریم. اهرم ر حال حاضر در محدوده قیمتی ۱۵۵۰۰ تومان در حال نوسان خنثی است. با توجه به حمایت‌ها و مقاومت‌های پیش رو، احتمالاً بین ۱۴۴۰۰ و ۱۷۸۰۰ تومان، نوسانات خنثی خود را ادامه دهد. در فاز خنثی، معامله بر روی نماد پر ریسک بوده زیر جهت بعدی حرکت قیمت مشخص نیست، از این رو معامله با ابزار اختیار بهترین روش ممکن هت کسب سود 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.

۶۰۱۷ سهم	اسم نماد ((اختیار خرید))
۶۰۱۴ سهم	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۶/۲۸	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۵۷۰ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	۱۰۰ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۲۰ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۱۸۶۷۰ ریال
	۱۳۳۳۰ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش