

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

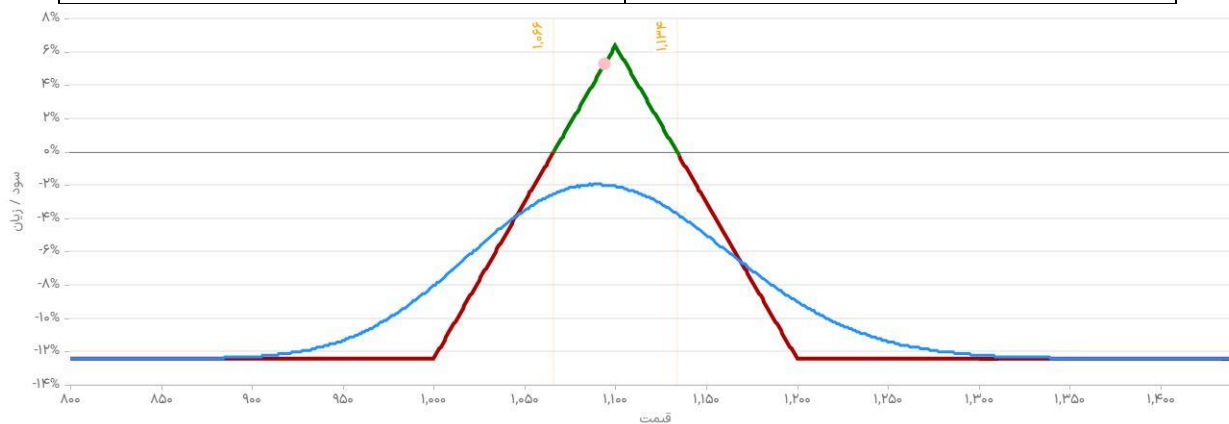
آخرین حرکت اصلی قیمت نزولی بوده است. قیمت پس از رسیدن به ناحیه حمایتی مدتی را با رشد همراه شده است. در حال حاضر قیمت در شرایط تشکیل پیوت صعودی قرار گرفته است. سطح نارنجی، سطحی است که در صورت تثبیت قیمت بالای آن، تاییدی برای تشکیل پیوت صعودی است. هم اکنون قیمت در حال کلنجر برای شکست این سطح است. به همین دلیل، احتمالاً بازاری نوسانی در محدوده‌ای خنثس خواهیم داشت. توجه به مقاومت‌ها و حمایت‌های پیش روی قیمت‌ریال بیان می‌کند که حوالی ۱۱۳۴ ریال دارای ناحیه مقاومتی هستیم و از طرفی حوالی ۱۰۵۰ ریال نیز دارای ناحیه حمایتی که با این شرایط احتمالاً قیمت مدتی را بین این دو محدوده به نوسان خنثس مشغول خواهد شد. با توجه به این شرایط استراتژی کسب سود از بازار خنثی مطلوب ماست.

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.

ضستا ۶۰۱۸	اسم نماد ((اختیار خرید))
ضستا ۶۰۱۹	اسم نماد ((اختیار خرید))
ضستا ۶۰۲۰	اسم نماد ((اختیار خرید))

تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۶/۱۱
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب خرید ((ضستنا ۶۰۲۰)) قیمت اعمال بالاتر	۳ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((ضستنا ۶۰۱۹)) قیمت اعمال میانگین دو قرارداد قبلی	۱۳ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((ضستنا ۶۰۱۸)) قیمت اعمال پایین تر	۸۹ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۶ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	۱۲ درصد
نقاط سر به سر	۱۱۳۴ ریال
	۱۰۶۶ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش