

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:

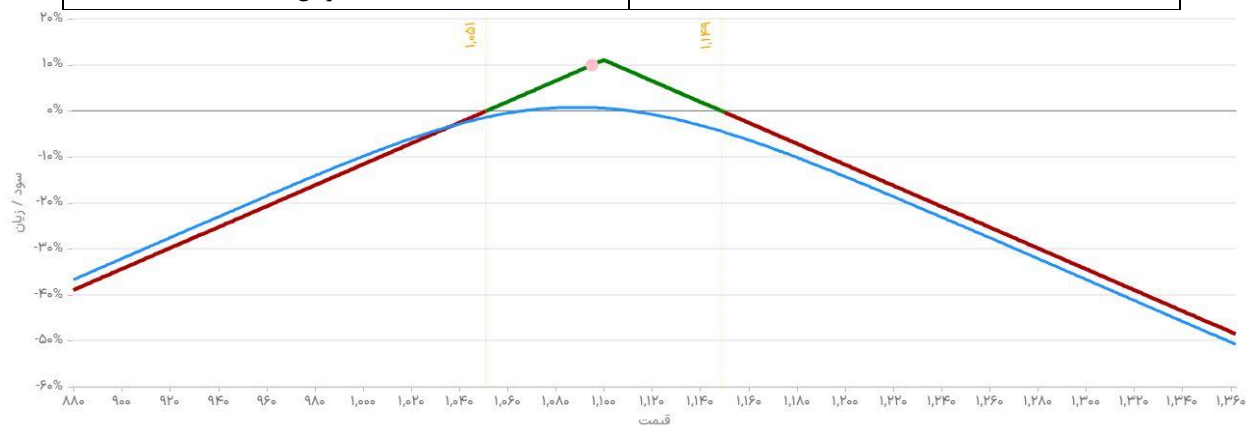
آخرین حرکت اصلی قیمت نزولی بوده است. قیمت پس از رسیدن به ناحیه حمایتی مدتی را با رشد همراه شده است. در حال حاضر قیمت در شرایط تشکیل پیوت صعودی قرار گرفته است. سطح نارنجی، سطحی است که در صورت تثبیت قیمت بالای آن، تاییدی برای تشکیل پیوت صعودی است. هم اکنون قیمت در حال کلنجر برای شکست این سطح است. به همین دلیل، احتمالاً بازاری نوسانی در محدوده‌ای خنثی 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 خنثی 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. 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.

ضستا ۶۰۱۹	اسم نماد ((اختیار خرید))
طستا ۶۰۱۹	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۶/۱۱	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید))	۱۴ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش))	۳۵ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۰ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۱۱۴۹ ریال
	۱۰۵۱ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش