

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

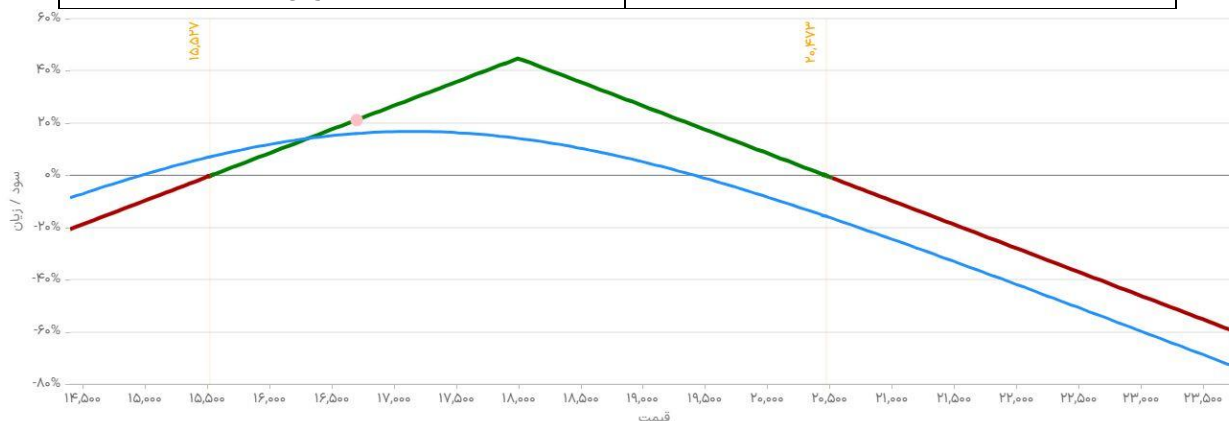
پس از واکنش قیمت به سطح مهم حمایتی، شاهد نوسانات صعودی هستیم. اهداف نوسانات صعودی به ترتیب ۱۶۸۰ و ۱۸۰۰ تومان است. از طرفی با توجه به شارپ بودن نزول، احتمالاً نوسانات درجا برای ریکاوری قیمت خواهیم داشت. با توجه احتمال خنثی شدن روند پیشنهاد می‌شود که از ابزار اختیار جهت کسب سود استفاده کرد. استراتژی زیر پر ریسک بوده اما سوددهی مناسبی دارد. در صورتی که در تاریخ سر رسید قیمت اهرم حوالی ۱۸۰۰ تومان باشد بیشترین بازدهی ایجاد خواهد شد.

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.

۷۰۲۶ صهرم	اسم نماد ((اختیار خرید))
۷۰۲۶ طهرم	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۷/۲۵	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۶۲۳ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	۱۸۵۰ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۴۴ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۲۰۴۷۳ ریال
	۱۵۵۲۷ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش