

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:

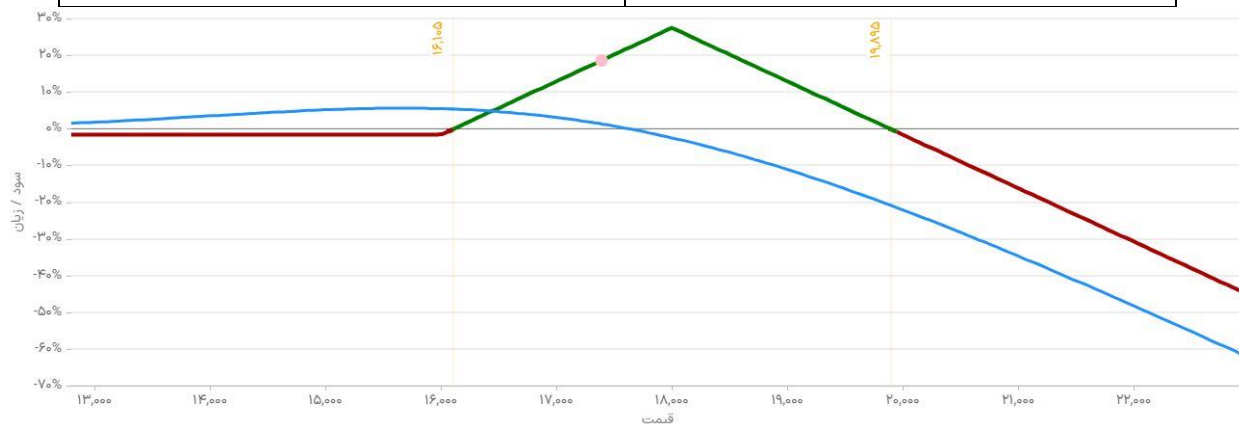
با توجه به این که اهرم پس از برخورد با ناحیه حمایتی به رشد و صعود خود ادامه داده است، اهداف قیمتی که به ترتیب ۱۷۸۰ و ۱۹۶۵ تومان است در دستر هستند. انتظار می‌رود که اهرم در برخورد با این نواحی با اصلاح قیمتی رو به رو شود و مدتی را در نوسانات خنثی سپری کند. با توجه به خنثی شدن، بررسی استراتژی‌ها جهت کسب سود توسط ابزار اختیار خالی از لطف نیست. در ادامه این گزارش استراتژی خاصی مطرح شده است. در این استراتژی بیان می‌شود که در صورت باقی ماندن قیمت نماد اهرم تا پایان سر رسید بین محدوده ۱۶۱۰ و ۱۹۸۰ تومان امکان کسب سود مناسب برقرار 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 و ۱ قرارداد اختیار فروش فروخت. جهت کنترل ریسک بازار در صورت نزولی شدن در این استراتژی میتوان اختیار فروشی با قیمت اعمال پایین تر خرید. در جدول زیر پیشنهادات مطرح شده است.

۸۰۰۴ طهرم	اسم نماد ((اختیار خرید))
۸۰۰۴ طهرم	اسم نماد ((اختیار فروش))
۸۰۰۳ طهرم	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۸/۳۰	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) ضهرم ۸۰۰۴	۱۱۵۵ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) طهرم ۸۰۰۴	۱۱۴۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر طهرم ۸۰۰۳	۴۰۰ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۲۷ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	در صورت صعودی شدن روند سهم پایه تا از دست رفتن تمامی پول احتمال ضرر وجود دارد در صورت نزولی شدن سهم پایه تا ماکسیمم ۱.۵ درصد ضرر
نقاط سر به سر	۱۹۸۹۵ ریال
	۱۶۱۰۵ ریال



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

تحلیل‌گر: شریف بخش