

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:

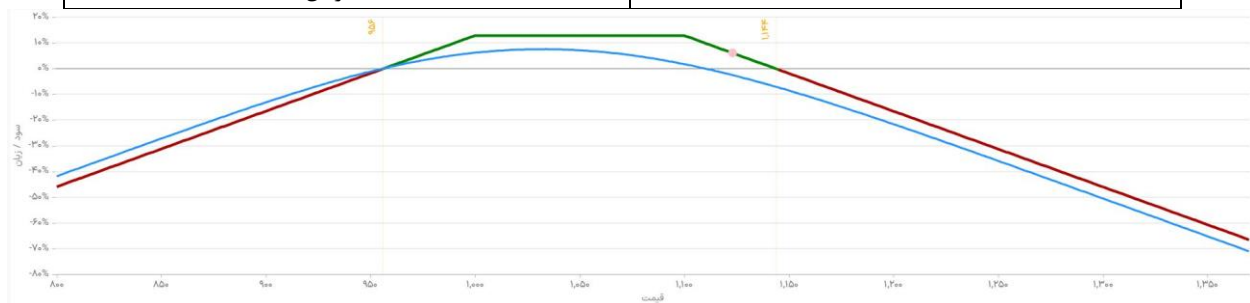
با توجه به واکنش منفی قیمت به ناحیه مقاومتی و حضور قیمت در محدوده نوسانات خنثی، احتمال ادامه یافتن درجا زدن قیمت زیاد است. در صورتی که سهم افت بیشتری تجربه کند و زیر ۱۱۰ تومان تثبیت دهد، خنثی شدن نوسانات تایید می‌شود. با توجه به خنثی بودن بازار و نداشتن جهت انجام معامله به صورت عادی دشوار بوده و جهت کسب سود از بازار نیازمند به استفاده از ابزار اختیار هستیم.

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 ضستا	اسم نماد ((اختیار خرید))
۷۰۲۵ طستا	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۷/۱۱	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۴۲ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ضستا ۷۰۲۶
۲ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش طستا ۷۰۲۵

هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۲ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۱۱۴۴ ریال
	۹۵۶ ریال



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

تحلیل‌گر: شریف بخش