

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

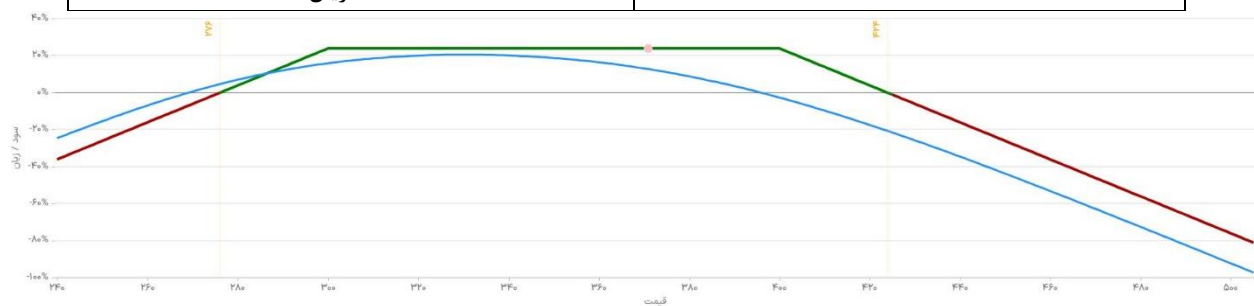
نوسانات قیمت نماد ذوب بیانگر روند نزولی است. با توجه به چارت، هم اکنون قیمت در ناحیه مقاومتی قرار دارد. در صورت امتداد واکنش منفی، ذوب اهداف نزولی ۳۳۲ و ۲۸۱ ریال را دارد. از طرفی در صورتی که با بهبود تقاضا و افزایش قیمت رو به رو شود، پیش روی خود مقاومت ۴۰۴ تومانی را می بیند. با توجه به شرایط ذکر شده ذوب احتمالا در محدوده‌ای بین ۲۷۶ الی ۴۲۴ تومان به نوسانات خود ادامه دهد. به همین منظور استراتژی تهیه شده که در بازه ذکر شده امکان کسب سود را با استفاده از معامله ابزار اختیار فراهم می کند. در ادامه به بررسی این استراتژی می پردازیم.

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.

اسم نماد ((اختیار خرید))	ضد ذوب ۹۰۱۳
اسم نماد ((اختیار فروش))	ط ذوب ۹۰۱۲
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۹/۲۸
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۲۳ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	۳ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۲۴ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۴۲۴ ریال
	۲۷۶ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش