

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:

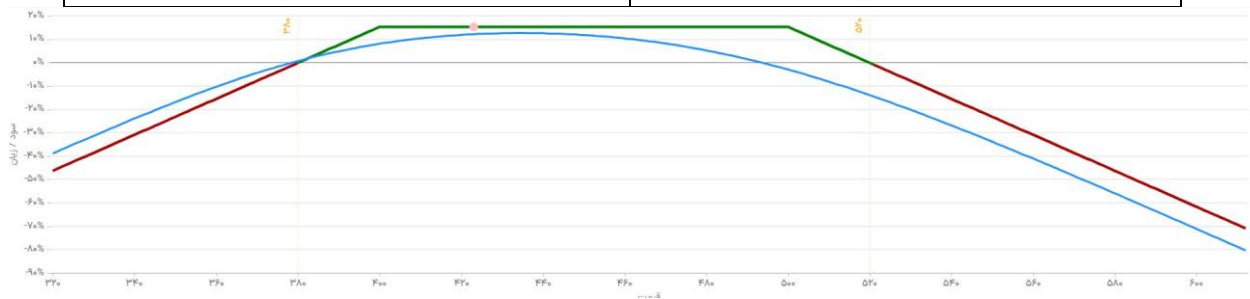
سهم با عبور از روند نزولی ساختار نوسانات خود را تغییر داده است. پس از شکسته شدن خط روند، انتظار می‌رود که ابتدا بازار در فاز خنثی قرار گیرد. با توجه به چارت، ذوب میتواند نوساناتی بین ۳۸۰ الی ۵۲۰ تومان داشته باشد. با توجه به این محدودیت‌ها استراتژی زیر در بازار اختیار توصیه می‌شود.

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.

۹۰۱۴ ضذوب	اسم نماد ((اختیار خرید))
۹۰۱۳ طذوب	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۹/۲۸	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۱۰ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر
۱۰ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر

هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۵ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۵۲۰ ریال
	۳۸۰ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش