

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

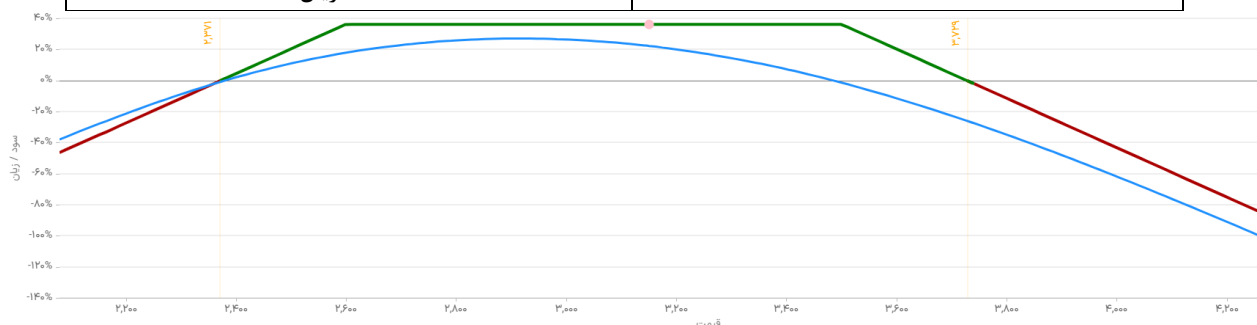
با توجه به نوسان شاری خودرو و نزدیک شدن قیمت به ناحیه مقاومتی و همچنین بالا رفتن حجم معاملات در انتهای حرکت شارپ صعودی، احتمال افت قیمت وجود داشته و ممکن است روند خودرو موقتاً به حالت خنثی بین دو ناحیه مقاومتی و حمایتی ۳۴۵ و ۲۸۸ تومان تبدیل شود. از طرفی با توجه به وجود تقاضای شدید فعلی در بازار خودرو قرار دادهای اختیار این نماد با قیمت مناسبی معامله می‌شوند. با در نظرگیری تمام شرایط استراتژی فروش اختیار خرید و فروش می‌تواند مورد جذابی باشد.

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.

۱۰۸۹ خودد	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۰۸۵ طخود	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۷/۲۵	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۲۰۳ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	۲۶ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۳۶.۳ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۳۷۲۹ ریال
	۲۳۷۱ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش