

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:

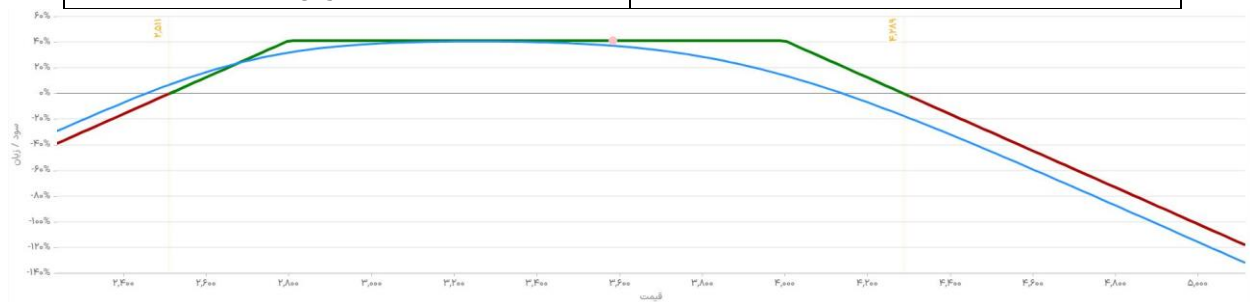
همان طور که از چارت پیداست، پس از شکسته شدن سطح استاتیک مقاومتی، شاهد ایجاد تراکم قیمتی و تثبیت بالای مقاومت هستیم. از نگاه کلی نوسانات صعودی بر روند خودرو حاکم است، اما هنوز تاییدی برای رشد بیشتر صادر نشده که این امر منجر به بالاتر رفتن احتمال روند خنثی و یا حتی اصلا جزئی قیمت می شود. به همین منظور استراتژی ابزار اختیار برای کسب سود توصیه می گردد. با توجه به حمایت ها و مقاومت های پیش رو، در صورت رشد قیمت، خودرو حوالی ۴۰۰ تومان به سقف تاریخی میرسد که ناحیه ای مقاومتی محسوب می شود. در صورت افت قیمت نیز، حوالی ۳۰۰ تومان ناحیه حمایتی دارد.

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))	ضخود۱۱۴۰د
اسم نماد ((اختیار فروش))	طخود۱۱۳۵د
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۱/۰۳
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی

محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۲۶۲ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	۲۷ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۴۰ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۴۲۸۹ ریال
	۲۵۱۱ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش