

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

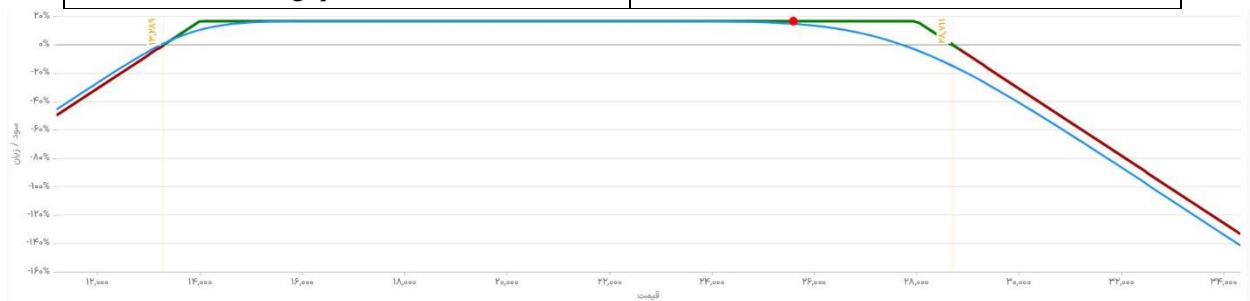
پس از رسیدن قیمت اهرم به سقف تاریخی با افت قیمت و اصلاح سهم مواجه شده‌ایم. با توجه به شارپ بودن روند قبلی ممکن است که اصلاح قیمت مدتی ادامه یابد. با توجه به این که یا ممکن است که نماد اهرام دچار افت بیشتر قیمت شود و یا به صورت نوسانات درجا به کار خود ادامه دهد، استراتژی برای کسب سود با استفاده از ابزار اختیار معرفی می‌گردد.

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.

۱۰۱۲ ضهرم	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۰۰۴ طهرم	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۱۰/۲۶	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۷۰۱ 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)	۱۶.۸ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	ریال ۲۸۷۱۱
	ریال ۱۳۲۸۹



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

تحلیل گر: شریف بخش