

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

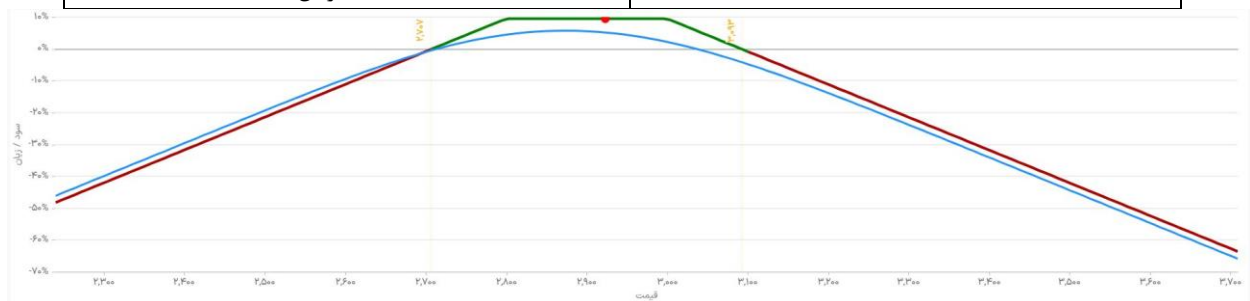
پس از شکسته شدن سطح استاتیک مقاومتی در نماد خساپا، شاهد نوسانات قیمت در بازه‌ای خنثی به منظور تثبیت خارج از سطح مقاومتی هستیم. معامله در محدوده خنثی منجر به ریسک نگهداری و عدم داشتن بینش مناسب نسبت به جهت بعدی حرکت سهم است. به همین منظور توصیه می‌شود که با استفاده از ابزار اختیار به کسب بازدهی از نماد خساپا بپردازیم.

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.

۱۰۲۷ ضسپا	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۰۲۵ طسپا	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۱۰/۲۶	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۹۲ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر
۵ 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)	۱۲ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۳۰۹۷ ریال
	۲۰۵۳ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش