

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:

نوسانات قیمت نماد ذوب بین دو محدوده مقاومتی و حمایتی قرار دارد.

بررسی ساختار نوسانات نشان دهنده‌ی خنثی بودن روند است.

سطح مقاومتی حوالی ۵۱۲ ریال و سطح حمایتی حوالی ۳۸۰ ریال است.

هم اکنون قیمت در میان این دو عدد بوده و میل به مقداری افت تا اواسط محدوده دارد.

با توجه به این که در ساختار خنثی معامله پر ریسک است و جهت حرکت بعدی مشخص نیست

استفاده از ابزار اختیار برای کسب بازدهی، توصیه می‌گردد.

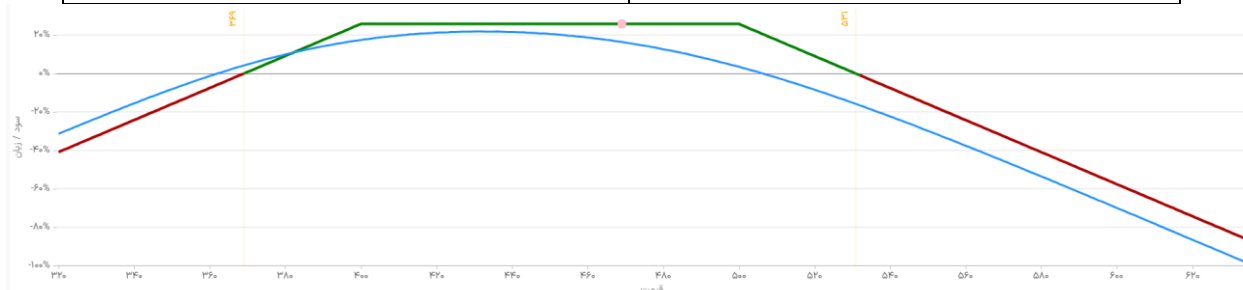
در ادامه به یکی از انواع این استراتژی‌ها می‌پردازیم.

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 پریمیم 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))	ضدوب ۰۱۱۴
اسم نماد ((اختیار فروش))	ظدوب ۰۱۱۳
تاریخ سر رسید	1404/01/20
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی

۲۸ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر
۳ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر
کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی	هدف از استراتژی
۲۵ درصد	حداکثر سود (درصد)
از دست رفتن تمامی پول	حداکثر ضرر (درصد)
۵۳۱ ریال	نقاط سر به سر
۳۶۹ ریال	



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

تحلیل گر: شریف بخش