

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:

بررسی نوسانات قیمت نماد ذوب نشان دهنده خنثی بودن روند میان مدت است.

هم اکنون قیمت در وسط محدوده قرار داشته و تعیین جهت حرکت بعدی به شدت سخت و غیر قابل پیش بینی است.

با توجه به شرایط موجود و همچنین فاصله مناسب قیمت هم از ناحیه حمایتی بعدی و هم از ناحیه مقاومتی بعدی، اقدام به معامله بسیار سخت است.

به همین جهت میتوان از استراتژی کسب سود از بازار خنثی با استفاده از ابزار اختیار استفاده کرد.

مهمترین مقاومت ذوب حوالی ۵۱۲ ریال و مهمترین حمایت این سهم حوالی ۳۸۰ ریال است.

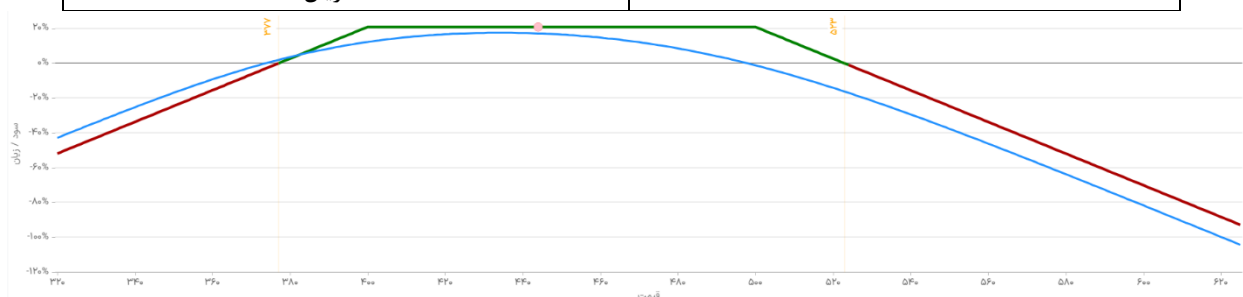
با توجه به این دو محدوده مهم، استراتژی زیر تعریف شده است.

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))	ضد ذوب ۰۱۱۴
اسم نماد ((اختیار فروش))	طذوب ۰۱۱۳
تاریخ سر رسید	۱۴۰۴/۰۱/۲۰
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی

۲۱ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر
۲ 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
۲۰ درصد	حداکثر سود (درصد)
از دست رفتن تمامی پول	حداکثر ضرر (درصد)
۵۲۳ ریال	نقاط سر به سر
۳۷۷ ریال	



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

تحلیل گر: شریف بخش