

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

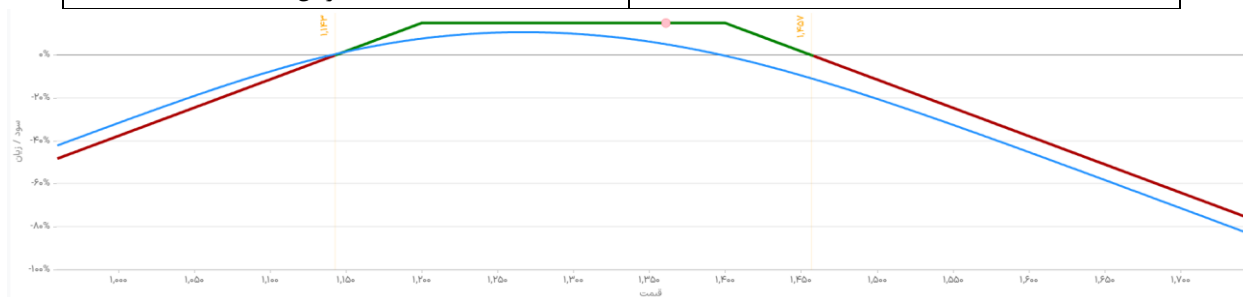
در انتهای روند شارپ صعودی، شاهد درجا زدن نوسانات قیمت بین دو محدوده ۱۲۲ و ۱۴۳ تومان هستیم. با توجه به این که روند نوسانات به صورت خنثی است، ریسک معاملات خرید بالا است. به همین دلیل توصیه می‌شود که از ابزار اختیار استفاده شود.

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.

ضستا ۲۰۴۰	اسم نماد ((اختیار خرید))
طستا ۲۰۳۸	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۴/۰۲/۱۰	تاریخ سر رسید
کسب سود از محدوده خنثی	اسم استراتژی
۵۲ 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)	۱۵ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	ریال ۱۴۵۷
	ریال ۱۱۴۳



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

تحلیل گر: شریف بخش