

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

در انتهای حرکت شارپ صعودی با نزدیک شدن قیمت به مقاومت داینامیک شاهد افزایش شدید حجم معاملات هستیم. افزایش حجم اخیر دو علت دارد، اول سیو سود از حرکت شارپ فعلی و دوم نفوذ قیمت به بالای سقف تاریخی که منجر به افزایش عرضه می‌گردد.

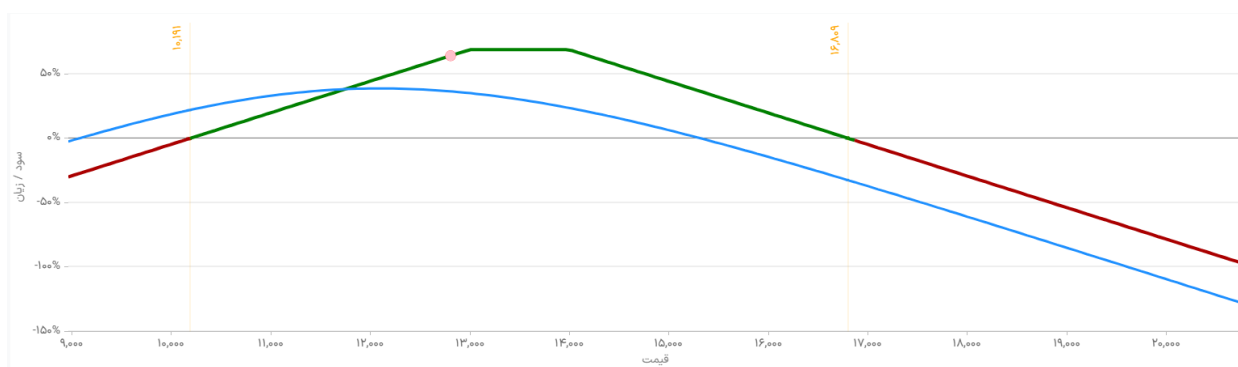
با توجه به چارت افت اخیر به منزله اصلاح بوده و نواحی حمایتی 1205 و 1070 تومان را پیش روی خود می‌بیند. در صورتی که سهم مجدداً وارد مدار صعودی شود، حوالی 1490 تومان گه همپوشانی مقاومت داینامیک و فیبوناچی است، هدف قیمتی دارد. با توجه به این که قیمت فعلی برای ورود به معامله خرید، قیمت بالایی محسوب می‌شود، پیشنهاد میشود که با استفاده از ابزار اختیار به معامله با این نماد بپردازیم.

از آنجا که افزایش شدید حجم معاملات ممکن است نوسانات سهم را با اصلاحات مواجه کند و روند سهم را از حالت صعودی به حالت خنثی تبدیل کند، استراتژی زیر توصیه 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 1 قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و 1 قرارداد اختیار فروش با قیمتی پایین تر از قیمت بازار فروخت.

اسم نماد ((اختیار خرید))	ضران 5022
اسم نماد ((اختیار فروش))	طران 5021
تاریخ سر رسید	1404/05/29
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	2,000 ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	809 ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	68 درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	16,809 ریال
	10,191 ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش