

استراتژی کسب سود از محدوده خنثی با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

با توجه به این که نماد اهرم در حال نزدیک شدن به سقف مینور قبلی است.

و همچنین نوسانات قیمت شتاب اولیه را از دست داده است.

احتمال در جا زدن قیمت وجود دارد.

با توجه به این که دو قرار داد اختیار با تاریخ سر رسید نزدیک وجود دارد.

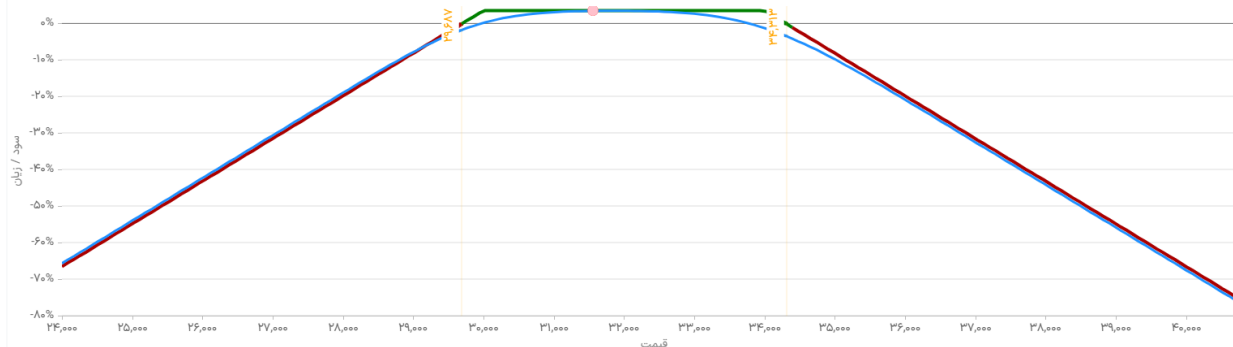
میتوان از ابزار اختیار استفاده کرد تا از نوسانات خنثی بهره برداری شود.

استراتژی پر ریسک زیر معرفی می گردد.

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))	ضهرم 2020
اسم نماد ((اختیار فروش))	طهرم 2019
تاریخ سر رسید	1404/02/31
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	61 ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین تر	252 ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	3.7 درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	34313 ریال
	29687 ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش