

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

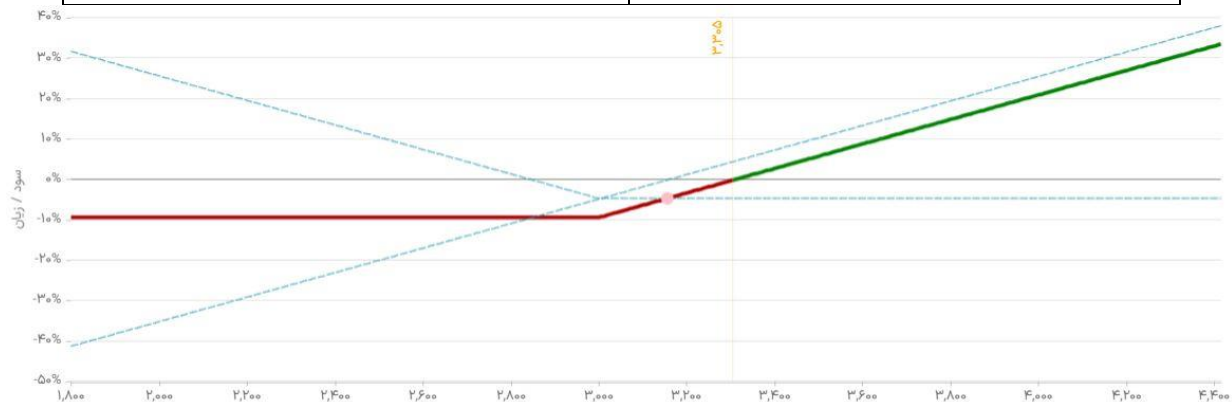
بررسی میان مدت نوسانات قیمت در نماد خودرو نشان دهنده تشکیل الگوی سر و شانه بازگشتی در انتهای روند نزولی است. با توجه به این که قیمت توانسته بالای خط گردن تثبیت کند، الگو تایید شده است و افت قیمت اخیر را می توان نوعی از پولبک در نظر گرفت. با رسیدن قیمت به محدوده حمایتی حوالی 290 تومان، شاهد رشد و تاییدی برای رشد بیشتر نماد هستیم. در صورتی که حرکت صعودی ادامه یابد، حوالی 350 تومان دارای هدف قیمتی هستیم. با افت قیمت و تثبیت زیر 275 تومان دیدگاه صعودی نقض می گردد.

نکات اختیار معامله:

در این استراتژی میزان ضرر به اندازه مشخصی ثابت شده و اجازه ضرر بیشتر در صورت نزول بازار را از سهم و دارایی شما سلب می کند. بدیهی است که هر چه میزان پرمیم پرداختی کمتر باشد، از میزان ضرر کمتر شده و همچنین هر چه قیمت اعمال قرارداد نسبت به قیمتی که دارایی پایه خریداری می شود نزدیک تر باشد میزان حد ضرر ثابت کمتر خواهد بود. توجه شود که به اندازه تعداد سهام توافق شده در قرارداد اختیار، باید دارایی پایه خریداری گردد.

اسم نماد پایه	خودرو
اسم نماد ((اختیار فروش))	طخود4042
تاریخ سر رسید	1403/04/06
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	295 تا 320 تومان
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	کمتر از 150 تومان

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	تا اهداف تکنیکالی
حداکثر ضرر (درصد)	10 درصد
نقطه سر به سر	330 تومان



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

تحلیل‌گر: شریف بخش