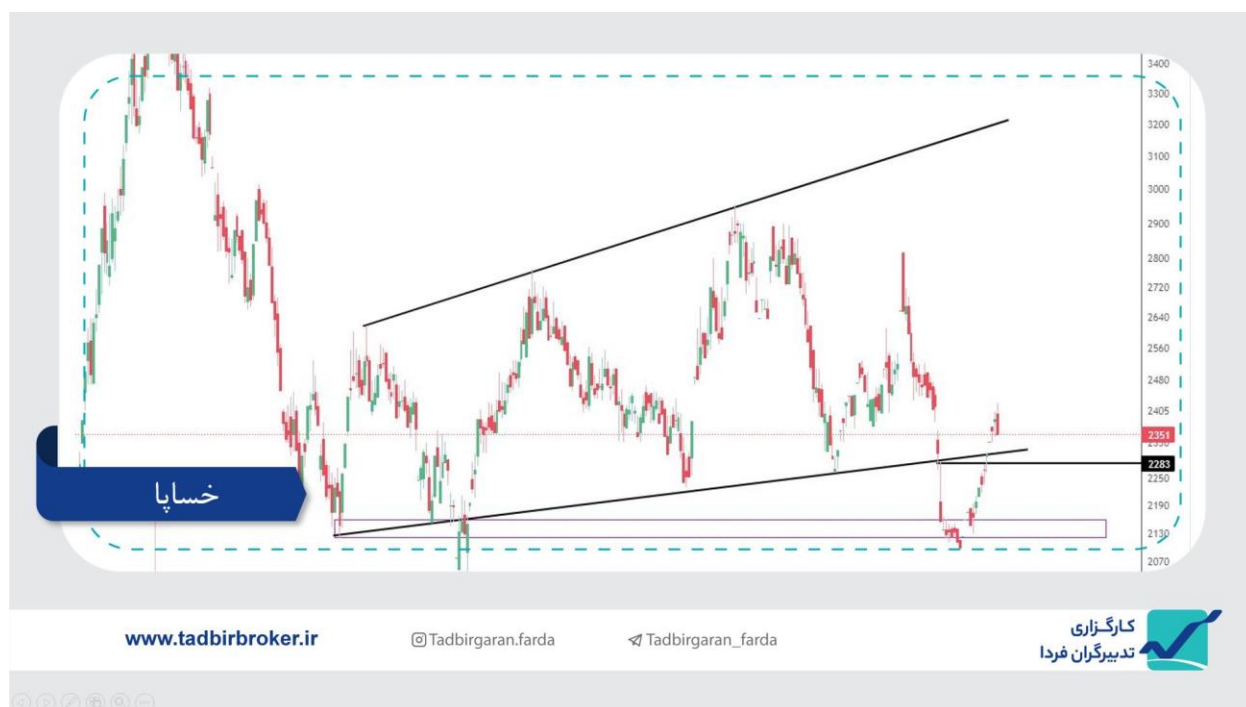


استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

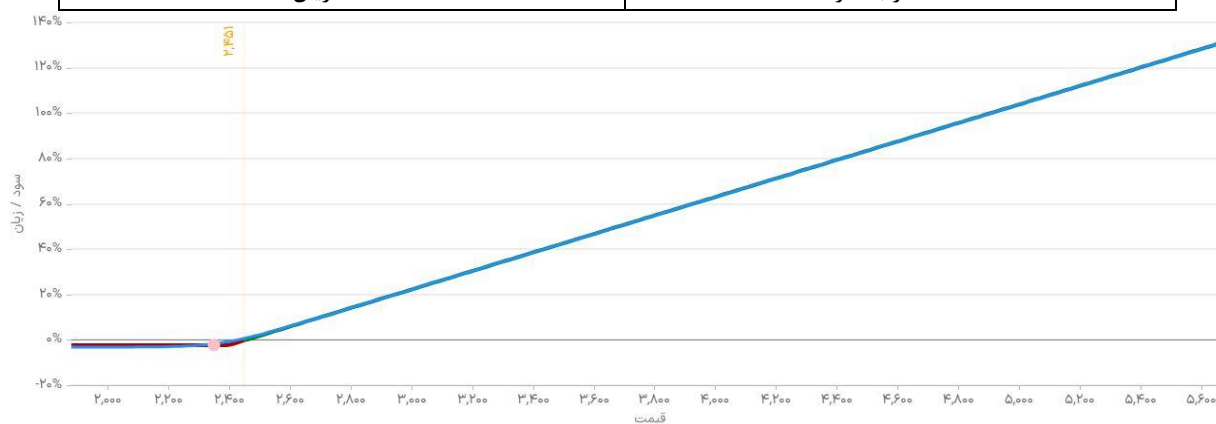
نماد خسپا پس از واکنش مثبت اخیر به ناحیه حمایتی با بازپس گیری مجدد روند صعودی داینامیک همراه شده است. با توجه به این که اکنون بالای ناحیه حمایتی قرار دارد، انتظار داریم که قیمت به رشد خود ادامه دهد. اولین هدف قیمت حوالی ۲۵۰ تومان است که در صورت افزایش بیشتر تقاضا اهداف بعدی ۲۶۰ تومان است در دسترس خواهد بود. از نگاه دیگر رشد قیمت سهم شارپ بوده و احتمال نزول موقتی وجود دارد. با توجه به بررسی جوانب مختلف ریسک معامله خرید بالا می‌رود. می‌توان با استفاده از ابزار اختیار معامله‌ای کوتاه مدت با حد ضرری معقول تعیین کرد تا هم از مسیر رشد جا نمانیم و هم متحمل ضرر احتمالی نشویم.

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 می‌کند. 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 می‌شود نزدیک‌تر 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	خسپا
اسم نماد ((اختیار فروش))	طسپا۶۰۲۲
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۶/۲۸

پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۲۳۵۰ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))
۱۰۰ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
تا هدف تکنیکالی	حداکثر سود (درصد)
۲.۵ درصد	حداکثر ضرر (درصد)
۲۴۵۱ ریال	نقطه سر به سر



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

تحلیل گر: شریف بخش