

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

خودران را در چارت مقیاس حسابی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

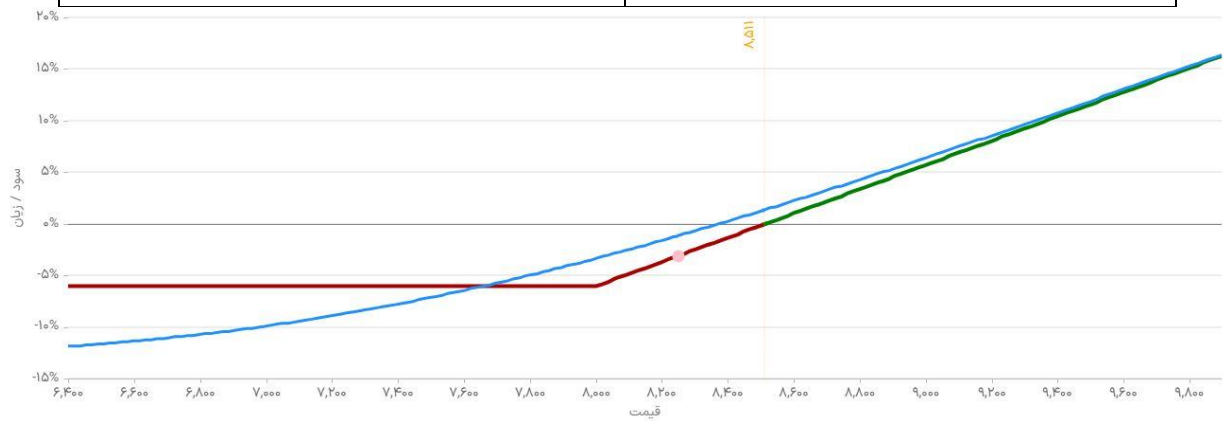
بررسی نوسانات قیمت نماد خودران نشان می‌دهد که روند اصلی حاکم بر سهم نزولی است. در حال حاضر قیمت در حال بازگشت صعودی کوتاه مدت است که در دل نوسانات نزولی وجود دارد. بازگشت قیمت اخیر بیش از اندازه مورد پیشبینی بوده و احتمال را برای رشد قیمت بیشتر ایجاد کرده است که در صورت رشد قیمت، هدفی حوالی ۹۰۰ تومان خواهد داشت. با توجه به این که نوسان گیری از این رشد احتمالی پر ریسک است، نیاز مند به پوشش دهی ریسک برای معامله خرید هستیم که بهترین ابزار در این مورد، ابزار اختیار است.

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	خودران
اسم نماد ((اختیار فروش))	طران ۹۰۰۶
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۹/۲۱
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۸۰۰۰ الی ۸۲۵۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۲۵۰ ریال به پایین

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	مطابق با هدف تکنیکالی
حداکثر ضرر (درصد)	۶ درصد
نقطه سر به سر	۸۵۱۱ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش