



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

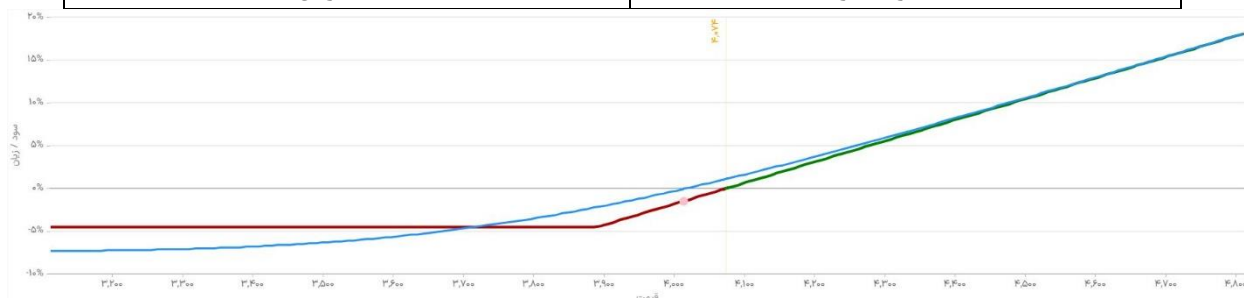
شپنا پس از نقض روند صعودی، با رسیدن به ناحیه حمایتی با افزایش تقاضای خرید و رشد قیمت همراه شد. بررسی ریز ساختار نوسانات نشان می‌دهد که شپنا ضمن این که با یک کندل زیر ناحیه حمایتی نفوذ داشته، توانسته با یک کندل به بالای روند نقض شده صعود کند. شرایط پیش آمده منجر به بلا تکلیفی تحلیلی برای جهت حرکت بعدی شپنا شده است. با توجه به این که پس از نقض روند صعودی، در فاز اول وارد روند خنثی می‌شویم و همچنین در حال حاضر قیمت در محدوده کف قیمتی ناحیه خنثی قرار دارد، می‌توان همچنان دیدگاه را بر رشد احتمالی قیمت قرار داد. دیدگاه ذکر شده به شدت پر ریسک بوده که ما را به پوشش دهی ریسک چنین معاملاتی نیازمند می‌کند. به جهت پوشش دهی ریسک، استراتژی زیر معرفی می‌شود.

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.

شپنا	اسم نماد پایه
طشنا ۸۰۳۲	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۸/۰۹	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی

محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))	۴۰۱۴ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۶۰ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	اهداف تکنیکالی به ترتیب ۴۵۲۵ ریال ۴۹۲۵ ریال
حداکثر ضرر (درصد)	۴.۵ درصد
نقطه سر به سر	۴۰۷۴ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش