



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

با توجه به این که قیمت به محدوده عرضه رسیده احتمال افت قیمت وجود دارد.

همین دلیل معامله خرید را با ریسک همراه می‌کند.

در صورت افت قیمت نواحی حمایتی حوالی ۴۰۰۰ و ۳۷۵۰ ریال وجود دارد.

با توجه به چارت تکنیکالی استراتژی کاوردکال پیشنهاد می‌شود.

در این استراتژی با فروش اختیار خرید همزمان با خرید خود سهم پایه، در لحظه وارد بازدهی مثبت شده و در صورت افت قیمت با مقدار زیان کمتری معامله تمام می‌شود.

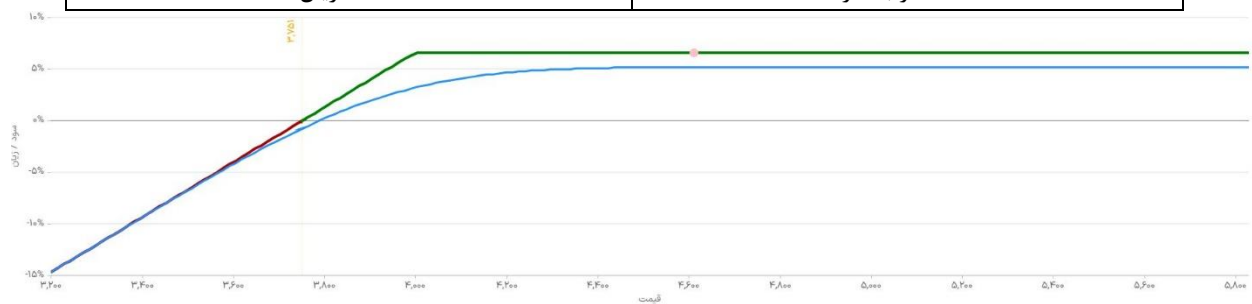
در ادامه، جزئیات این دست از معاملات قید شده است.

نکات اختیار معامله:

هر چه قیمت سهم بالاتر از قیمت اعمال یک قرارداد اختیار خرید باشد، مبلغ پرمیم دریافتی از فروش قرارداد اختیار خرید بالاتر خواهد بود. با توجه به این نکته، می‌توانیم نمادی را در همان قیمت خریداری کنیم و در همان لحظه اختیار خرید آن نماد در قیمت اعمال کمتر را بفروشیم. در حالت ذکر شده در لحظه معامله به سود مورد انتظار می‌رسیم. نکته مهم این است که در تحلیل نماد پایه به درستی عمل کنیم و شاهد افت قیمت نماد پایه نباشیم.

شپنا	اسم نماد پایه
ضشنا ۱۰۷۰	اسم نماد ((اختیار خرید))
۱۴۰۳/۱۰/۱۲	تاریخ سر رسید

پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۴۶۱۱ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))
۸۶۰ ریال	محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
۶.۶ درصد	حداکثر سود (درصد)
به اندازه افت قیمت سهم به جز پرمیم	حداکثر ضرر (درصد)
۳۷۵۱ 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