

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:

نوسانات قیمت نماد خودرو صعودی است.

در حال حاضر قیمت در فاز اصلاحی بوده و به اولین ناحیه حمایتی رسیده است.

نواحی حمایتی به ترتیب ۳۴۵ و ۳۲۵ تومان است.

در صورت واکنش مثبت به این نواحی، احتمال رشد قیمت برای رسیدن به هدف ۴۱۵ تومانی وجود دارد.

حد ضرر دیدگاه صعودی، افت قیمت و تثبیت زیر ۳۱۰ تومان است.

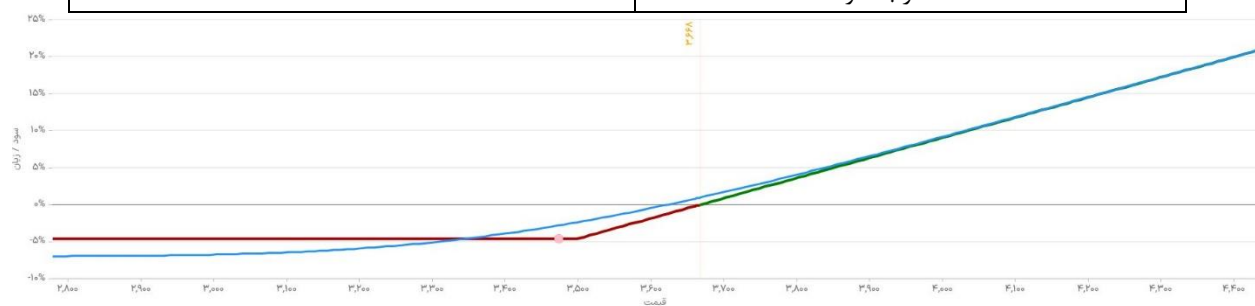
با توجه به نزولی بودن کلیت بازار، ریسک معامله خرید بالا بوده به همین جهت استفاده از ابزار اختیار به منظور پوشش ریسک پیشنهاد می‌شود.

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.

اسم نماد پایه	خودرو
اسم نماد ((اختیار فروش))	طخود۱۲۳۶
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۲/۰۱

پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۳۴۷۴	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))
۱۹۴	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
۱۵ درصد	حداکثر سود (درصد)
۵ درصد	حداکثر ضرر (درصد)
۳۶۶۸	نقطه سر به سر



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

تحلیل‌گر: شریف بخش