

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:

نماد خودرو با تقاضایی شدید همراه شده و در حال رسیدن به اعداد قیمتی بالاتر است.

با توجه به رشد اخیر، ریسک معامله خرید بالا رفته و خودرو فاصله‌ی زیادی از حد ضرر تکنیکالی گرفته است.

با توجه به چارت، اهداف قیمتی ۴۳۸ و ۵۱۵ تومان در دسترس است.

نفوذ اخیر به بالای مقاومتی مینور قبلی یعنی بالای ۳۸۷ تومان نشانه‌ی رشد بیشتر است.

توصیه می‌گردد که اگر قصد خرید نماد خودرو وجود دارد، به پوشش دهی ریسک معامله با استفاده از ابزار اختیار پردازیم.

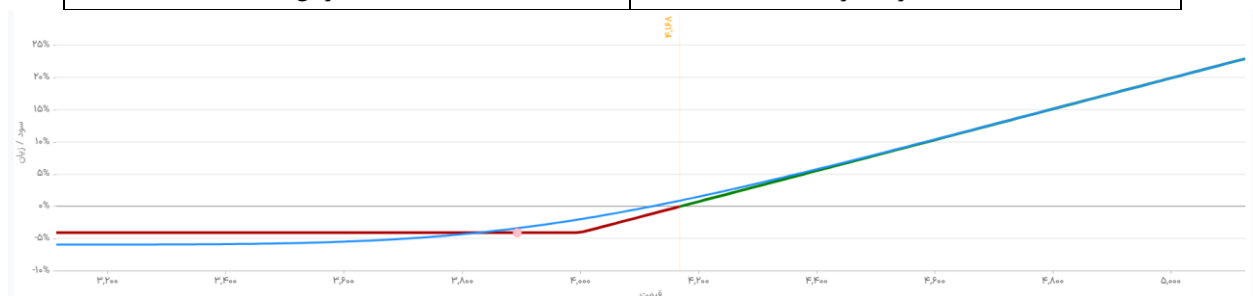
در ادامه استراتژی پوشش ریسک ارائه می‌گردد.

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))	طخود ۰۱۴۰
تاریخ سر رسید	1404/01/06
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۳,۸۹۳ ریال

محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۲۷۵ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	متناسب با اهداف تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	۴ درصد
نقطه سر به سر	۴,۱۶۸ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش