

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

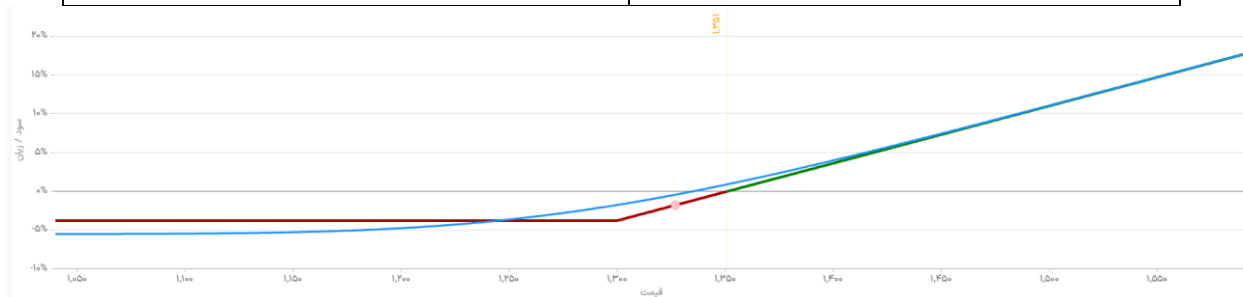
شستا را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم: پس از روند شارپ صعودی، شاهد اصلاح قیمت با شیب ملایم و نوسانات هارمونیک هستیم. در صورتی که شستا با افزایش تقاضا خرید مواجه شود و بالای ۱۴۰ تومان تثبیت دهد، تاییدی برای اتمام فاز اصلاحی و رشد قیمت ایجاد می‌گردد. در صورت صدور تایید، ۱۵۰ و ۱۶۸ تومان به ترتیب اهداف قیمت هستند. نکته مهم فاصله زیاد قیمت تا حد ضرر ۱۱۵ تومانی است که ریسک معامله خرید را بالا می‌برد. برای پوشش ریسک این معامله استراتژی زیر توصیه 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.

شستا	اسم نماد پایه
طستا۲۰۳۹	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۴/۰۲/۱۰	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۱,۳۲۷ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))

محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۲۴ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	مناسب با اهداف تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	۴ درصد
نقطه سر به سر	۱,۳۵۱ ریال



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

تحلیل‌گر: شریف بخش