

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 تثبیت قیمت شستا بالای سقف قبلی دیدگاهی صعودی برای رشد بیشتر ایجاد شده است.

نوسانات قیمت پتانسیل تشکیل الگوی کاپ را ایجاد کرده است.

در صورتی که شستا بالای 168 تومان تثبیت دهد، تایید رشد بیشتر صادر می‌شود.

در صورت صدور تایید، هدفی حوالی 200 تومان وجود خواهد داشت.

حد ضرر دیدگاه تحلیلی تثبیت قیمت زیر 152 تومان است.

با توجه به این که فاصله قیمت از حد ضرر زیاد بوده، توصیه می‌شود که با استفاده از ابزار اختیار به پوشش دهی ریسک خرید اقدام شود.

در ادامه استراتژی مناسب برای کنترل ریسک معامله خرید ارائه می‌گردد.

نکات اختیار معامله:

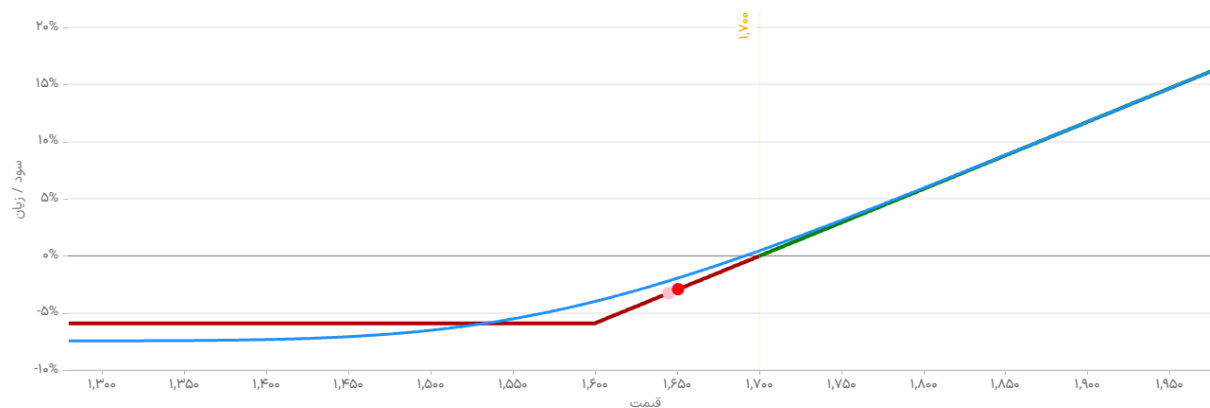
در این استراتژی میزان ضرر به اندازه مشخصی ثابت شده و اجازه ضرر بیشتر در صورت نزول بازار را از سهم و دارایی شما سلب می‌کند. بدیهی

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.

شستا	اسم نماد پایه
طستا3031	اسم نماد ((اختیار فروش))
1404/03/13	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
1,652 ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))
48 ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
متناسب با هدف تکنیکال	حداکثر سود (درصد)
6 درصد	حداکثر ضرر (درصد)
1,700 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