

برای محافظت از سرمایه خود از مشاوران کارگزاری تدبیرگران فردا کمک بگیرید





تحلیلگر: الیاس شریف بخش

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار (خودرو)

تحلیل تکنیکال سهم پایه:

خودرو را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم: خودرو پس از نوسانی شارپ وارد فاز صعودی با شیب ملایم شده است. هم اکنون قیمت در فاز اصلاحی بوده و به ناحیه حمایتی رسیده است. با توجه به این که احتمال واکنش مثبت به این ناحیه حمایتی وجود دارد، همچنان دیدگاه مثبتی به ادامه روند برقرار است. در صورتی که شاهد مثبت شدن نماد و رشد سهم باشیم، هدفی حوالی ۷۹۴ ریال وجود خواهد داشت. در صورتی که ناحیه حمایتی

موثر واقع نشود و تثبیت قیمت زیر ۶۰۴ ریال صورت گیرد، تاییدی بر شکست ناحیه حمایتی صورت می‌گیرد.

در صورت تثبیت زیر ۶۰۴ ریال احتمال افت شدید قیمت بالا می‌رود. به همین دلیل توصیه می‌شود که با استفاده از ابزار اختیار به ثابت سازی ریسک معامله خرید پردازیم. در ادامه استراتژی مناسب برای پوشش دهی ریسک آورده شده است.

اسم نماد پایه	خودرو
اسم نماد ((اختیار فروش))	طخود۳۰۹۹
تاریخ سر رسید	۱۴۰۴/۰۳/۰۷
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۶۵۲ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۲۶ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	متناسب با هدف تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	۴ درصد
نقطه سر به سر	۶۷۸ ریال

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.



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



تحلیلگر: الیاس شریف بخش

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار (شستا)

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 ۱۶۸ تومان تثبیت دهد، تایید رشد بیشتر صادر می‌شود. در صورت صدور تایید، هدفی حوالی ۲۰۰ تومان وجود خواهد داشت.

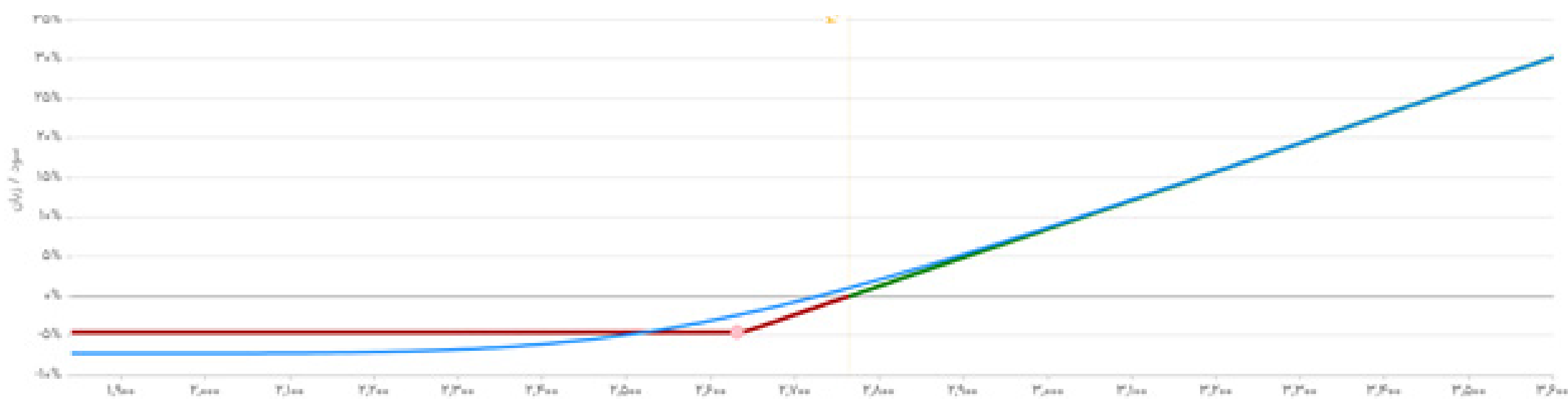
حد ضرر دیدگاه تحلیلی تثبیت قیمت زیر ۱۵۲ تومان است.

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.

شستا	اسم نماد پایه
طستا۳۱۳۰۳	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۴/۰۳/۱۳	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۱۵۶۵۲ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))
۴۸ 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)
۶ درصد	حداکثر ضرر (درصد)
۱,۷۰۰ ریال	نقطه سر به سر

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.





بالا‌تر تشکیل می‌دهد؛ در واگرایی نزولی، قیمت سقف بالا‌تر می‌سازد ولی RSI سقف پایین‌تر نشان می‌دهد. این سیگنال‌ها می‌توانند نشانگر تغییر روند احتمالی باشند.

با این حال، RSI تنها یک ابزار کمکی است و باید در کنار سایر ابزارها مانند خطوط روند، حمایت و مقاومت، الگوهای قیمتی و مدیریت ریسک استفاده شود. استفاده از RSI به‌تنهایی ممکن است منجر به سیگنال‌های اشتباه شود، بنابراین ترکیب آن با سایر ابزارهای تحلیل تکنیکال توصیه می‌شود.

احتمالاً فشار فروش زیاد و احتمال بازگشت صعودی وجود دارد.

سیگنال خرید زمانی صادر می‌شود که RSI ابتدا به زیر ۳۰ رفته و سپس به بالای ۳۰ بازگردد. این حرکت نشان‌دهنده کاهش فشار فروش و تقویت خریداران است. سیگنال فروش نیز زمانی پدیدار می‌شود که RSI ابتدا به بالای ۷۰ برود و سپس به زیر ۷۰ برگردد، که می‌تواند نشانگر کاهش قدرت خریداران و تقویت فروشندگان باشد. همچنین، مفهوم واگرایی (Divergence) در RSI اهمیت زیادی دارد. در واگرایی صعودی، قیمت کف پایین‌تر می‌سازد، اما RSI کف

اندیکاتور RSI (شاخص قدرت نسبی) یکی از ابزارهای مهم تحلیل تکنیکال است که برای شناسایی نقاط ورود و خروج به معاملات استفاده می‌شود. این اندیکاتور به صورت یک نوسان‌ساز در محدوده ۰ تا ۱۰۰ نمایش داده می‌شود و قدرت نسبی خریداران و فروشندگان را در دوره زمانی مشخص (معمولاً ۱۴ روز) نشان می‌دهد. سطوح مهم RSI شامل ۷۰ (اشباع خرید) و ۳۰ (اشباع فروش) هستند. هنگامی که RSI به بالای ۷۰ می‌رسد، نشان‌دهنده فشار خرید زیاد و احتمال اصلاح نزولی است. بالعکس، اگر RSI به زیر ۳۰ برسد،

تغییرات قیمت ها در هفته ای که گذشت

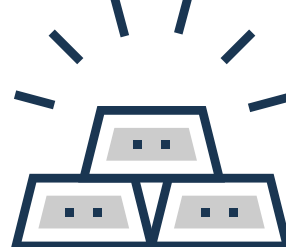
تاریخ	سکه	دلار آزاد	دلار نیما
۱۴۰۴/۰۲/۲۳	۷۰۰,۱۰۰,۰۰۰	۸۴۰,۵۵۹	۶۹۴,۰۸۰
۱۴۰۴/۰۲/۲۲	۷۰۰,۸۵۰,۰۰۰	۸۲۷,۴۱۴	۶۹۳,۸۵۳
۱۴۰۴/۰۲/۲۱	۷۱۶,۸۰۰,۰۰۰	۸۳۵,۸۰۸	۶۹۴,۹۹۱
۱۴۰۴/۰۲/۲۰	۷۰۵,۰۰۰,۰۰۰	۸۳۵,۸۰۸	۶۹۳,۴۰۴
۱۴۰۴/۰۲/۱۸	۷۰۵,۹۵۰,۰۰۰	۸۳۱,۱۵۲	۶۹۲,۷۳۸
۱۴۰۴/۰۲/۱۷	۷۰۱,۸۵۰,۰۰۰	۸۱۸,۵۳۳	۶۹۰,۹۲۳

سکه و دلار



تاریخ	مس	آلومینیوم	روی	سرب	قلع	نیکل
۱۴۰۴/۰۲/۲۳	۹۶۰۸,۹۵	۲۴۹۰,۹۵	۲۷۱۶,۴۵	۱۹۹۰,۱۳	۳۲۵۶۴	۱۵۶۸۲,۶۳
۱۴۰۴/۰۲/۲۲	۹۴۸۴	۲۴۷۰,۹	۲۶۷۸	۱۹۷۵,۶۵	۳۱۸۲۱,۹۹	۱۵۵۳۶,۲۵
۱۴۰۴/۰۲/۱۹	۹۴۴۸	۲۴۲۱,۱	۲۶۵۵,۹	۱۹۸۱,۹۸	۳۱۶۹۸,۹۳	۱۵۷۹۹,۸۸
۱۴۰۴/۰۲/۱۸	۹۴۳۶,۵۵	۲۴۲۱,۱	۲۶۲۸	۱۹۸۱,۹۸	۳۱۴۶۱	۱۵۵۶۰,۳۸
۱۴۰۴/۰۲/۱۷	۹۴۲۳,۳۵	۲۴۰۸,۷۵	۲۶۱۷,۹	۱۹۵۲,۷۳	۳۱۸۱۷	۱۵۵۱۹,۸۸
۱۴۰۴/۰۲/۱۶	۹۵۴۰,۳۵	۲۳۸۰,۰۵	۲۶۳۱,۸۵	۱۹۵۸,۷۳	۳۰۴۸۷,۰۲	۱۵۶۶۴,۳۸

فلزات رنگی



تاریخ	نفت سنگین ایران	نفت برنت	نفت WTI	گاز طبیعی
۱۴۰۴/۰۲/۱۶	۵۶,۴۹	۶۲,۱	۵۹,۰۹	۳,۴۸۹
۱۴۰۴/۰۲/۱۵	۵۶,۴۹	۶۰,۲۸	۵۷,۱۶	۳,۵۸۵
۱۴۰۴/۰۲/۱۳	۵۸,۲۳	۶۱,۲۹	۵۸,۲۹	۳,۶۳
۱۴۰۴/۰۲/۱۲	۵۸,۲۳	۶۱,۵۸	۰	۳,۶۴۶
۱۴۰۴/۰۲/۱۱	۵۸,۲۳	۶۱,۸۶	۰	۳,۴۵۱



تاریخ	طلا	نقره	پلاتین	پالادیوم
۱۴۰۴/۰۲/۲۳	۳,۲۵۲,۲۰	۳۲,۹۳	۹۹۱,۱۵	۹۵۶,۰۰
۱۴۰۴/۰۲/۲۲	۳,۲۳۶,۷۴	۳۲,۵۹	۹۷۷,۷۵	۹۴۲,۰۰
۱۴۰۴/۰۲/۲۰	۳,۳۲۴,۶۳	۳۲,۷۲	۱,۰۰۱,۶۰	۹۸۱,۵۰
۱۴۰۴/۰۲/۱۹	۳,۳۲۸,۹۵	۳۲,۷۷	۱,۰۰۰,۰۰	۹۸۲,۲۵
۱۴۰۴/۰۲/۱۸	۳,۳۰۹,۱۹	۳۲,۴۴	۹۸۱,۴۰	۹۸۱,۲۵
۱۴۰۴/۰۲/۱۷	۳,۳۶۹,۲۲	۳۲,۴۰	۹۷۸,۶۵	۹۶۸,۵۰

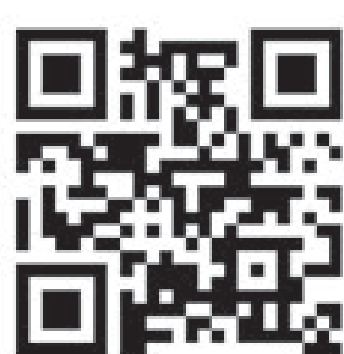


با دریافت اعتبار، از هر صعود بازار، بیشتر سود کنید



از صعود بازار، سود بیشتری بگیرند
تا منفی های گذشته را به اعتبار هم
و با هم جبران کنیم.

شرایط دریافت اعتبار در کارگزاری
تدیرگران فردا تسهیل شد



tadbirbroker.ir

کارگزاری
تدیرگران فردا

