

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

سهم را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

با توجه به گارد صعودی در ساختار چارت اهداف احتمالی حرکت صعودی حوالی 2480 و 2800 تومان است.

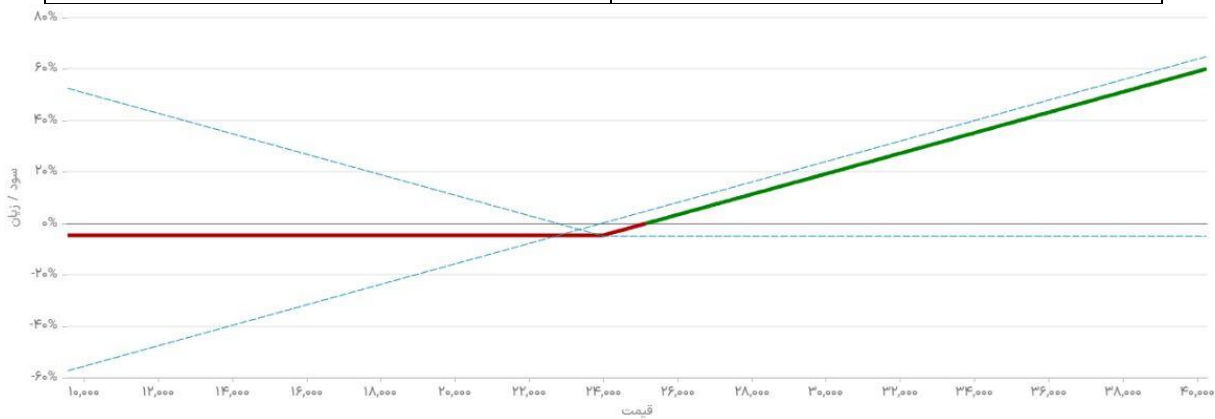
فاصله قیمت تا حد ضرر تکنیکالی زیاد بوده برای همین استراتژی پوشش ریسک توصیه می‌شود.

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	اهرم
اسم نماد ((اختیار فروش))	طهرم 3008
تاریخ سر رسید	1403/03/23
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	محدوده 2300 الی 2400 تومان
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	110 الی 120 تومان
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	بی نهایت

5 درصد	حداکثر ضرر (درصد)
سهام پایه قیمت 2511 تومان	نقطه سر به سر



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

تحلیل‌گر: شریف بخش