

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:

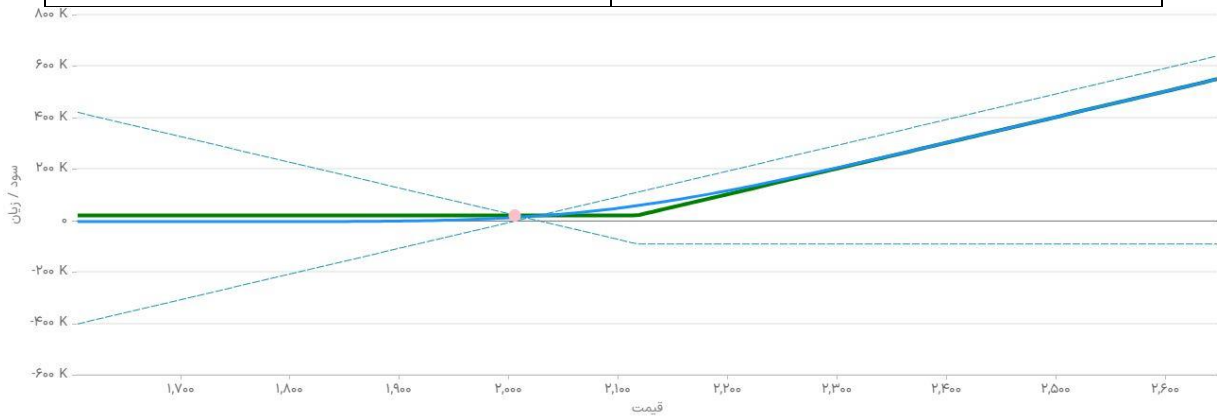
نماد وبملت در یک محدوده خنثی در حال نوسان است. هم اکنون قیمت به نزدیکی کف محدوده رسیده و احتمال مثبت شدن وجود دارد. با توجه به این که بازار نزولی است کنترل ریسک ضروری است. حد ضرر تکنیکالی افت قیمت و تثبیت زیر ۱۹۳۰ ریال است که حدوداً ۳.۵ درصد حد ضرر از قیمت فعلی سهم محسوب می‌شود. در صورتی که نماد با افزایش تقاضا همراه شود، اهداف وبملت به ترتیب ۲۱۴۰ ریال و ۲۳۸۰ ریال خواهد بود.

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.

وبملت	اسم نماد پایه
طملت ۵۰۰۴	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۵/۲۴	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۲۰۱۰ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))
۹۰ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	به اندازه حد سود تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	ندارد
نقطه سر به سر	ندارد



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

تحلیل گر: شریف بخش