



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

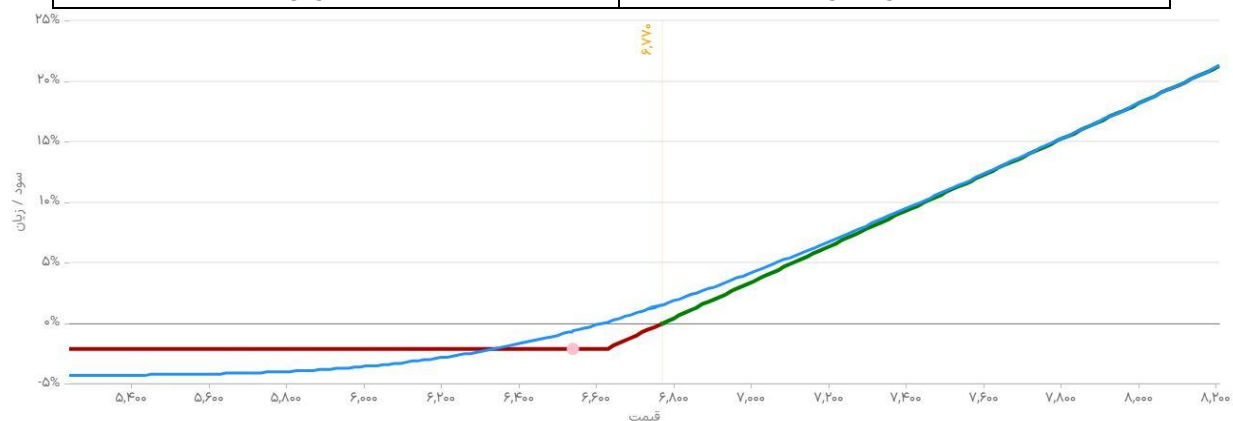
پس از اصلاح قیمتی، شاهد واکنش مثبت این نماد به سقف تاریخی شکسته شده هستیم. با توجه به ساختار صعودی میان مدت در نماد فملی، احتمال رشد بیشتر قیمت پس از واکنش وجود دارد اما با توجه به این که قیمت از محدوده حمایتی فاصله گرفته است، از منظر ریسک به ریواردی ورود به معامله خرید منطقی به نظر نمی‌رسد. برای جبران این امر نیازمند پوشش‌دهی ریسک معامله خرید با استفاده از ابزار اختیار هستیم. در حال حاضر، فاصله قیمت تا حد ضرر تکنیکالی یعنی تثبیت زیر ۶۰۰ تومان حدود ۸ درصد زیان می‌باشد. در صورتی که از استراتژی زیر جهت ورود به معامله خرید استفاده کنیم، میزان زیان احتمالی ماکسیمم ۲۰۱ درصد شده که مقدار به شدت پایین‌تری خواهد بود همچنین ضروری است تا اشاره کنیم که هدف تکنیکالی نماد فملی در مرحله اول ۷۱۰ تومان 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.

اسم نماد پایه	فملی
اسم نماد ((اختیار فروش))	فملی ۷۰۴۳
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۷/۰۴
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید

محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))	۶۵۵۰ ریال به پایین
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۲۲۰ ریال به پایین
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	۶ درصد در هدف اول
حداکثر ضرر (درصد)	۲۰.۱ درصد
نقطه سر به سر	۶۷۷۰ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش