

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

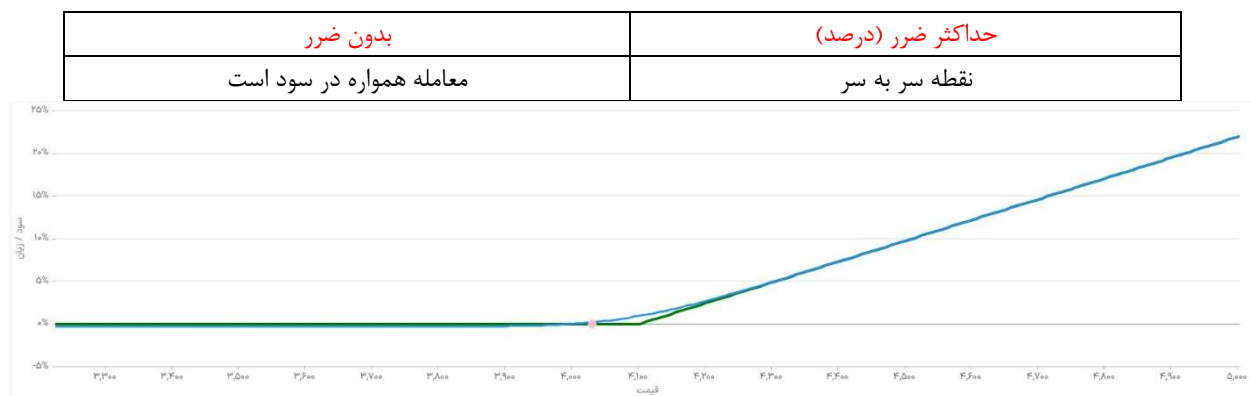
فولاد را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

نماد فولاد طی اصلاح اخیر به محل همپوشانی دو ناحیه حمایتی یعنی سطح استاتیک و خط داینامیک رسیده است. در صورتی که نماد فولاد با بهبود تقاضا و رشد مواجه شود اهداف ۴۲۵ و ۴۵۵ تومان خواهد داشت. با توجه به نزولی بودن نماد، ریسک معامله بالا است به همین منظور، نیازمند پوشش ریسک معامله خرید هستیم و برای این کار استفاده از ابزار اختیار توصیه 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.

فولاد	اسم نماد پایه
طفلا ۷۰۴۲	اسم نماد ((اختیار فروش))
۱۴۰۳/۰۷/۱۸	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
۴,۰۳۲ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))
۷۰ ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
۱۰ درصد	حداکثر سود (درصد)



تحلیل‌گر: شریف بخش