

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

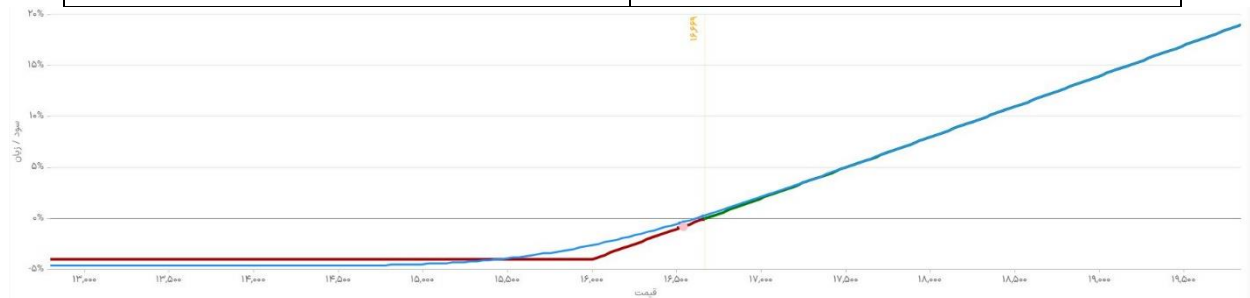
پس از واکنش مثبت اهرم به ناحیه حمایتی شاهد شکل گیری روندی صعودی در کوتاه مدت هستیم. پس از اصلاح اخیر اهرم ضمن رسیدن به محدوده حمایتی استاتیک در حوالی قیمت ۱۶۴۰ تومان به خط روند صعودی مشکی نیز رسیده و احتمال شروع حرکت مثبت وجود دارد. اما با توجه به ریسک بازار و احتمال عدم واکنش مثبت و قفل شدن در صف فروش، بهتر است که معامله خرید با پوشش ریسک انجام گردد که برای این کار 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.

اسم نماد پایه	اهرم
اسم نماد ((اختیار فروش))	طهرم ۷۰۲۵
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۷/۲۵
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۱۶۵۰۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۱۲۹ ریال

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	۱۰ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	۴ درصد
نقطه سر به سر	۱۶۶۶۹ ریال



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

تحلیل‌گر: شریف بخش