

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:

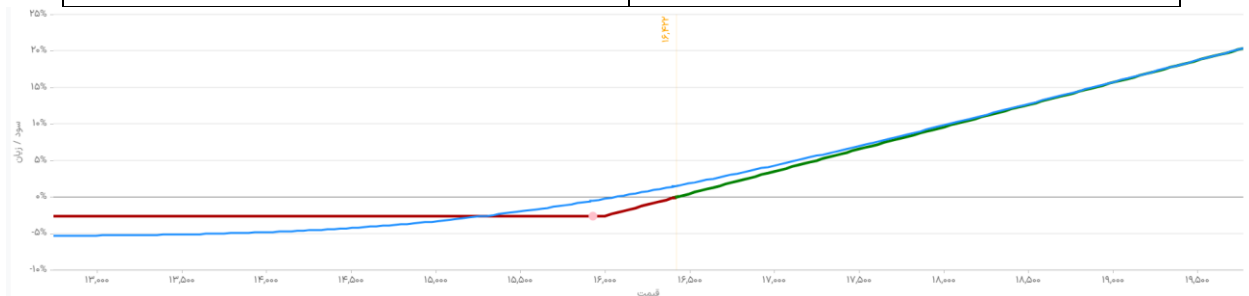
نماد اهرم از منظر تکنیکالی در ناحیه به شدت پر ریسکی قرار داشته و شواهد متعددی از جمله روند نزولی هفتگی و الگوی سر و شانه نزولی در تایم فریم کوتاه مدت و ... برای افت بیشتر قیمت وجود دارد. با تمامی این موارد ناحیه حمایتی برای نماد اهرم وجود داشته که اکنون قیمت در این ناحیه قرار دارد. با توجه به پر ریسک بودن معامله خرید، توصیه می‌شود که در صورت تمایل به انجام این معامله با استفاده از ابزار اختیار ریسک حاصل پوشش داده شود.

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 ۸۰۰۳
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۸/۳۰
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۱۵۹۳۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۴۹۲ ریال

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	در مرحله اول ۳ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	۲.۶ درصد
نقطه سر به سر	۱۶۴۲۲ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش