

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

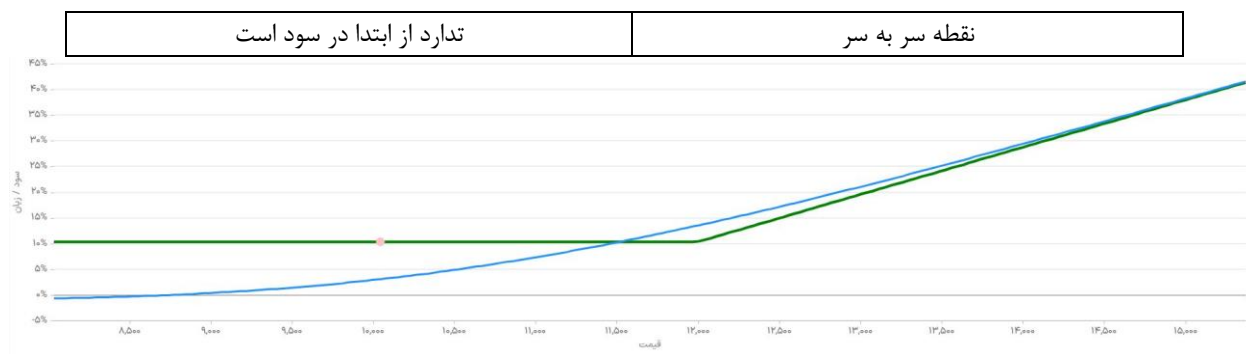
رویین را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

با توجه به این که نوسانات سهم روندی نزولی دارد، معامله خرید پر ریسک محسوب می‌شود. با توجه به چارت و قیمت‌های فعلی ابزار اختیار، با خرید اختیار فروش این سهم می‌توان این سهم را به نوعی تبدیل به دارایی با دارم ثابت کرد با این تفاوت که اگر بازار با رشد و صعود همراه شود و بالای ۱۲۰۷ تومان تثبیت دهد می‌توانیم سرمایه گذاری بدون ریسک با بازدهی مناسبی انجام دهیم.

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 نزدیک تر 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	رویین
اسم نماد ((اختیار فروش))	طرویین ۱۲۰۶
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۲/۲۶
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۱۰۰۴۵ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۸۲۴ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداقل سود (درصد)	۱۰ درصد



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

تحلیل‌گر: شریف بخش