

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:

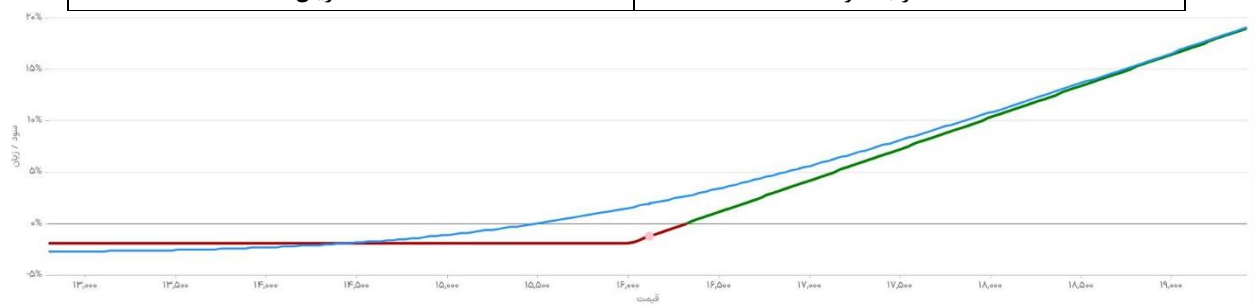
همان طور که از نوسانات قیمت پیداست، اهرم از دو تایم فریم مختلف دارای روند نزولی است. با این وجود فشار خرید موجود در بازار منجر شده تا احساس جا ماندن از بازار مثبت منجر به اقدامات احساسی شود. با توجه به این موضوع بهترین راهکار پوشش ریسک معامله خرید با استفاده از ابزار اختیار است. در صورتی که معامله خرید انجام شود باید توجه داشت که اهداف سهم در کوتاه مدت به ترتیب ۱۶۰ و ۱۷۸۰ تومان است. حد ضرر چارتری تثبیت زیر ۱۴۶۰ تومان بوده که با استفاده از ابزار اختیار می‌توان آن را به حداقل رساند.

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))	۱۶۱۲۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۱۹۷ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت

تا اهداف تکنیکالی	حداکثر سود (درصد)
۲ درصد	حداکثر ضرر (درصد)
ریال ۱۶۳۲۴	نقطه سر به سر



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

تحلیل گر: شریف بخش