

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:

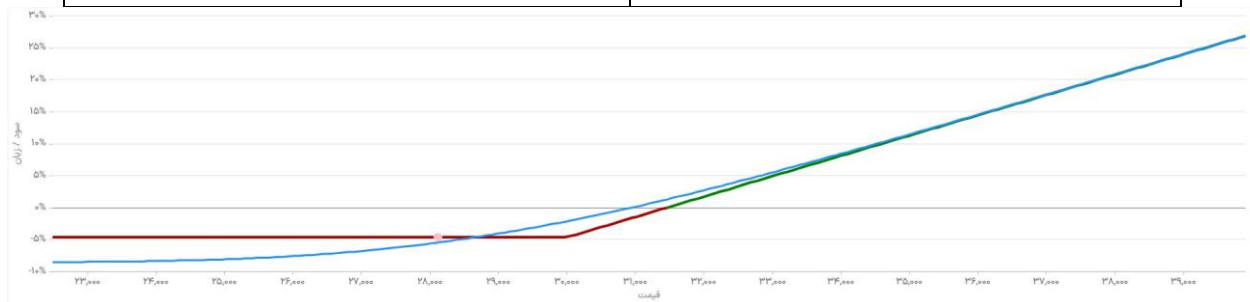
نوسانات قیمت نماد اهرم به شدت شارپی بوده و این امر منجر به بالا رفتن ریسک ورود به معامله خرید می‌شود. از طرفی با توجه به این که چارت تکنیکال، حد ضرر مشخصی را نشان نمی‌دهد و از طرف ترس از جا ماندگی از بازار وجود دارد، پیشنهاد می‌شود که در صورت انجام معامله خرید، با استفاده از ابزار اختیار به پوشش دهی ریسک خرید احتمالی بپردازیم. با توجه به چارت، اهداف اهرم به ترتیب ۲۸۸۳، ۳۳۰۰ و ۳۶۵۰ تومان است.

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 ۱۱۱۲
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۱/۲۴
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۲۸۱۲۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۳۳۳۱ ریال

هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	با توجه به اهداف تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	۵ درصد
نقطه سر به سر	۳۰۲۵۰ ریال



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

تحلیل گر: شریف بخش