

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:

با توجه به نوسانات قیمت نماد اهرم و چشم انداز صعودی، احتمال دارد که روند قیمت مجدد وارد فاز صعودی شده و تا اهداف مشخص شده در چارت نوسان مثبتی داشته باشد. اما شارپ بودن روند منجر به بالا رفتن ریسک معامله خرید می شود. به همین جهت استفاده از ابزار اختیار که بتواند معامله را از ریسک صف فروش و یا قیمت های پایین تر رها کند، توصیه می گردد.

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 می کند. 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 می شود 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	اهرم
اسم نماد ((اختیار فروش))	طهرم ۱۰۱۱
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۰/۲۶
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	۲۶۱۲۰ ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	۹۲۰ ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	متناسب با اهداف تکنیکالی



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

تحلیل‌گر: شریف بخش