

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:

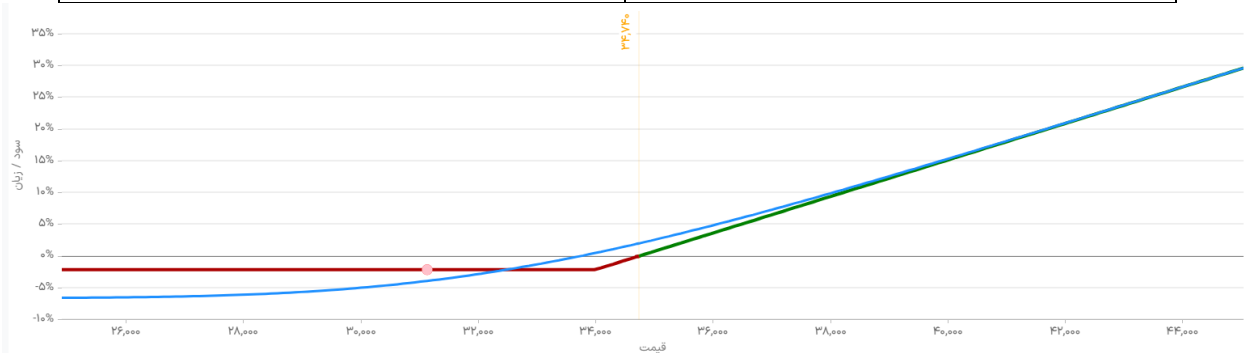
پس از برخورد قیمت با سقف تاریخی، شاهد اصلاح نماد اهرم بوده ایم. طی رشد اخیر، شاهد رسیدن مجدد قیمت به مقاومت تاریخی بوده با این تفاوت که این بار سقف تاریخی این نماد شکسته شده است. با توجه به این که به تازگی روند صعودی جدید تشکیل شده، احتمال رشد بیشتر قیمت وجود دارد اما باید در نظر گرفت که معمولاً پس از نفوذ قیمت به بالای سقف تاریخی، احتمال اصلاح وجود خواهد داشت. افزایش حجم معاملات طی روزهای اخیر، احتمال ذکر شده را تایید می کند. به طور کلی احتمال رشد بیشتر قیمت تا حوالی 3,830 تومان وجود دارد اما با توجه به این که اهرم از حد ضرر تکنیکالی فاصله زیادی دارد، ریسک معامله خرید بالا رفته است. به همین جهت توصیه می شود که با استفاده از ابزار اختیار، ریسک معامله را پوشش 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 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 3019

1404/03/28	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
ریال 31,140	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهام پایه))
ریال 3,600	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
متناسب با اهداف تکنیکالی	حداکثر سود (درصد)
2.5 درصد	حداکثر ضرر (درصد)
ریال 34,740	نقطه سر به سر



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

تحلیل گر: شریف بخش