

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

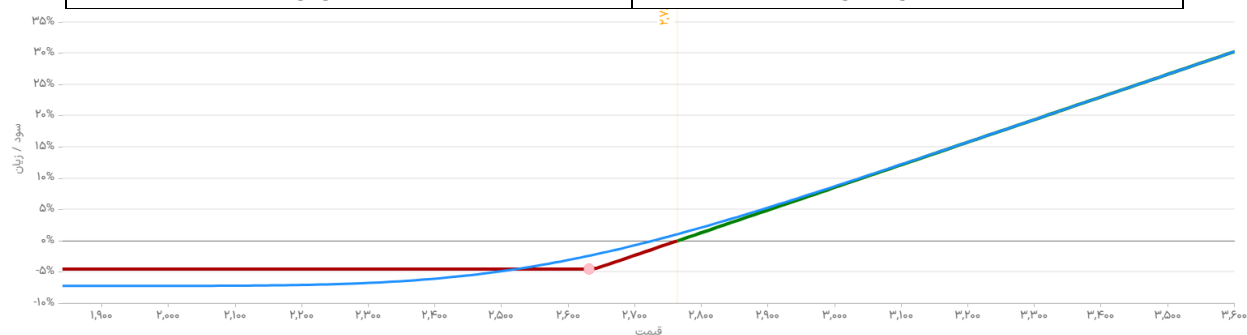
وبملت را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

در انتهای رشد شارپ وبملت شاهد افزایش شدید حجم معاملات و ورود به فاز اصلاحی بوده‌ایم. با توجه به این که اصلاح اخیر به مهمترین ناحیه حمایتی پیش رو رسیده است باید واکنش نماد را به این محدوده تحت نظر بگیریم. اگر وبملت بتواند با واکنش مثبت به این محدوده مواجه شود و بالای 276 تومان تثبیت قیمت کند، تاییدی بر رشد بیشتر صادر می‌شود. در صورت ایجاد تایید، قیمت‌های 325 و 395 تومان به ترتیب اهداف وبملت هستند. اما اگر افت قیمت ادامه یابد و تثبیت زیر 257 تومان صورت گیرد، ناحیه حمایتی نقض شده و وبملت پتانسیل افت تا حوالی 233 و 213 تومان را خواهد داشت. به دلیل این که در اثر نقض شدن ناحیه حمایتی، احتمال افت شدید سهم وجود دارد و ریسک معامله خرید بالا رفته است، پیشنهاد می‌شود که با استفاده از ابزار اختیار ریسک این معامله را محدود کنیم. در ادامه استراتژی برای پوشش ریسک معامله خرید ارائه گردیده 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.

وبملت	اسم نماد پایه
طملت3054	اسم نماد ((اختیار فروش))
1404/03/21	تاریخ سر رسید
پوشش ریسک خرید	اسم استراتژی
2,632 ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))
132 ریال	محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))
ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت	هدف از استراتژی
متناسب با اهداف تکنیکال	حداکثر سود (درصد)
5 درصد	حداکثر ضرر (درصد)
2,764 ریال	نقطه سر به سر



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

تحلیل گر: شریف بخش