

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:

پس از شکسته شدن روند نزولی کوتاه مدت و پولبک وبملت به سطح حمایتی، شاهد واکنش مثبت این نماد هستیم.

اگر نوسانات صعودی ادامه یابد، احتمال رشد قیمت بیشتر تا حوالی اهداف 323 و 380 تومان وجود دارد.

هم اکنون قیمت از حد ضرر چارتی یعنی افت قیمت و تثبیت زیر 248 تومان فاصله گرفته و ریسک معامله خرید در حدود 8 درصد است.

می توان با استفاده از ابزار اختیار، ریسک معامله خرید را کاهش دهیم.

در ادامه استراتژی جهت پوشش ریسک معامله خرید مطرح 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 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	وبملت
اسم نماد ((اختیار فروش))	طملت 3054
تاریخ سر رسید	1404/03/21
اسم استراتژی	پوشش ریسک خرید
محدوده قیمت مناسب خرید ((سهم پایه))	2,724 ریال
محدوده قیمت مناسب خرید ((اختیار فروش))	48 ریال
هدف از استراتژی	ثابت سازی میزان ضرر احتمالی در صورت افت قیمت
حداکثر سود (درصد)	متناسب با اهداف تکنیکال
حداکثر ضرر (درصد)	5 درصد
نقطه سر به سر	2,772 ریال

عکس نمودار اختیار

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

تحلیل گر: شریف بخش