

دیلی تحلیلی Daily Tahlil

w w w . d a i l y t a h l i l . c o m



صندوق سرمایه گذاری
در اوراق با درآمد ثابت
با نماد ((خورشید))

خورشید ما همواره خوش می درخشد





تحلیلگر: الیاس شریف بخش

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار (خودرو)



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

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

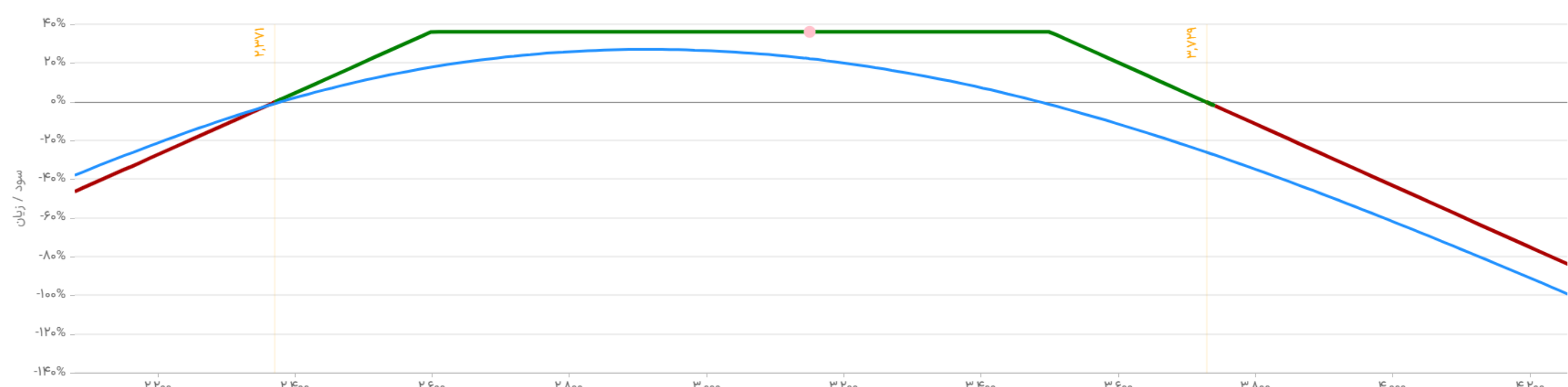
با توجه به نوسان شاری خودرو و نزدیک شدن قیمت به ناحیه مقاومتی و همچنین بالا رفتن حجم معاملات در انتهای حرکت شارپ صعودی، احتمال افت قیمت وجود داشته و ممکن است روند خودرو موقتا به حالت خنثی بین دو ناحیه مقاومتی و حمایتی ۳۴۵ و ۲۸۸

تومان تبدیل شود. از طرفی با توجه به وجود تقاضای شدید فعلی در بازار خودرو قرار دادهای اختیار این نماد با قیمت مناسبی معامله می‌شوند. با در نظرگیری تمام شرایط استراتژی فروش اختیار خرید و فروش می‌تواند مورد جذابی باشد.

اسم نماد ((اختیار خرید))	ضخود۱۰۸۹
اسم نماد ((اختیار فروش))	طخود۱۰۸۵
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۰۷/۲۵
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۲۰۳ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین‌تر	۲۶ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۳۶٫۳ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۳۷۲۹ ریال - ۲۳۷۱ ریال

نکات اختیار معامله:

با توجه به این که بازار خنثی بوده و تعیین جهت غیر قابل پیش بینی است، با این استراتژی میتوان از حالت فعلی نوسانات به کسب سود پرداخت. این استراتژی پر ریسک بوده زیرا میزان ضرر مینیمم ندارد و بدیهی است هر چه پریمیم دریافتی بیشتر باشد سود بیشتری کسب خواهد شد. برای اجرای این استراتژی باید قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و قرارداد اختیار فروش با قیمتی پایین تر از قیمت بازار فروخت.





تحلیلگر: الیاس شریف بخش

استراتژی پوشش ریسک خرید سهام با استفاده از ابزار اختیار (شستا)



تحلیل تکنیکال سهم پایه:

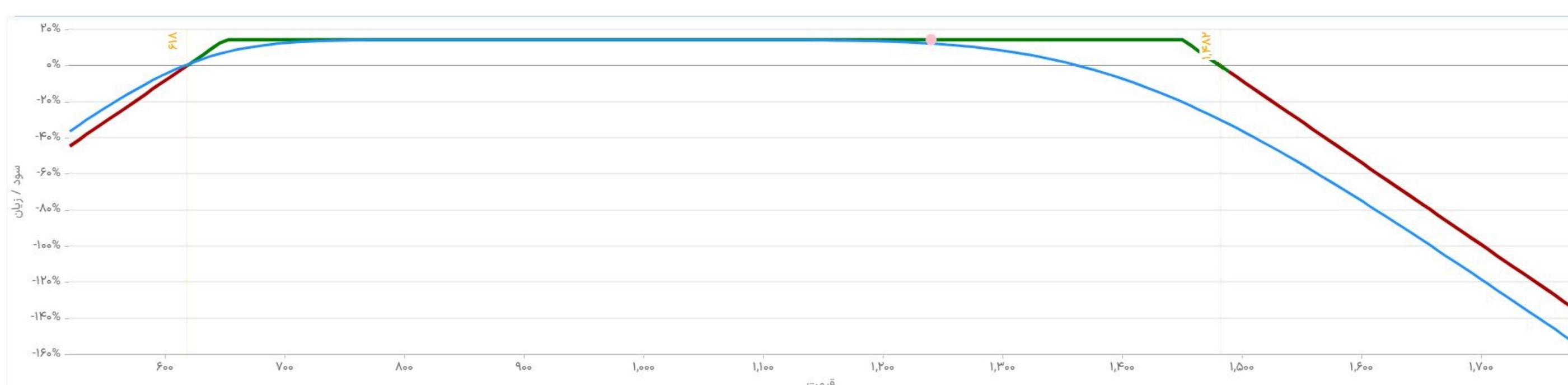
شستا را در چارت عملکردی، مقیاس لگاریتمی و تایم فریم روزانه مورد بررسی قرار دادیم:

با توجه به صعود شارپ این نماد و نزدیک شدن قیمت به ناحیه حمایتی، احتمال واکنش قیمت و اصلاح کوتاه مدت وجود دارد. بررسی‌ها نشان می‌دهد که احتمال عبور قیمت از ۱۴۸۲ ریال و یا افت قیمت به زیر ۶۱۸ ریال طی ۳۵ روز آینده از احتمال بسیار کمی برخوردار است. به همین جهت استفاده از ابزار اختیار برای کسب سود توصیه می‌شود.

اسم نماد ((اختیار خرید))	ضستا ۱۰۴۰
اسم نماد ((اختیار فروش))	طستا ۱۰۳۲
تاریخ سر رسید	۱۴۰۳/۱۰/۱۲
اسم استراتژی	کسب سود از محدوده خنثی
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار خرید)) قیمت اعمال بالاتر	۳۰ ریال
محدوده قیمت مناسب فروش ((اختیار فروش)) قیمت اعمال پایین‌تر	۲ ریال
هدف از استراتژی	کسب سود بدون توجه به این که روند صعودی خواهد شد یا نزولی
حداکثر سود (درصد)	۱۲ درصد
حداکثر ضرر (درصد)	از دست رفتن تمامی پول
نقاط سر به سر	۱۴۸۲ ریال - ۶۱۸ ریال

نکات اختیار معامله:

با توجه به این که بازار خنثی بوده و تعیین جهت غیر قابل پیش بینی است، با این استراتژی میتوان از حالت فعلی نوسانات به کسب سود پرداخت. این استراتژی پر ریسک بوده زیرا میزان ضرر مینیمم ندارد و بدیهی است هر چه پرمیم دریافتی بیشتر باشد سود بیشتری کسب خواهد شد. برای اجرای این استراتژی باید قرارداد اختیار خرید در قیمت اعمال بالاتر از قیمت بازار و قرارداد اختیار فروش با قیمتی پایین تر از قیمت بازار فروخت.



بازار جهانی



تحلیلگر، ریحانه پرویزیان

نوسانات بازار کامودیتی‌ها

نفت و انرژی:

– نفت خام: قیمت نفت برنت به ۷۳٫۲۲ دلار و نفت سبک آمریکا به ۷۵٫۴۹ دلار رسیده است. این تغییرات در قیمت نفت ناشی از تقاضای بالاتر در بازارهای جهانی و کاهش نرخ بهره است که هزینه‌های وام‌گیری را کاهش می‌دهد.

– گاز طبیعی: قیمت گاز طبیعی با افزایش قابل توجهی به ۳٫۲۱۶ دلار رسیده که حاکی از تقاضای بالا در فصل سرد سال است.

کاهش نرخ بهره توسط فدرال رزرو، که به تازگی اعلام شده، تأثیرات قابل توجهی بر روی بازار کامودیتی‌ها خواهد داشت. این سیاست باعث می‌شود تا تقاضا برای کالاهای اساسی افزایش یابد، زیرا سرمایه‌گذاران تمایل بیشتری به خرید کالاهای فیزیکی پیدا می‌کنند تا نگهداری پول نقد یا دارایی‌های مالی با بازده کم.

– افزایش تقاضا برای انرژی: با کاهش هزینه‌های وام‌گیری، انتظار می‌رود تقاضا برای نفت و گاز طبیعی افزایش یابد، که می‌تواند منجر به رشد قیمت‌ها شود.

– جذابیت طلا و فلزات گرانبها: در شرایط نرخ بهره پایین، طلا و سایر فلزات گرانبها جذاب‌تر می‌شوند، زیرا بازده سایر دارایی‌ها کاهش می‌یابد. به طور کلی، بازار کامودیتی‌ها در حال حاضر تحت تأثیر تحولات اقتصادی کلان قرار دارد و انتظار می‌رود که این روندها در هفته‌های آینده ادامه یابد.

در تاریخ ۲۷ نوامبر ۲۰۲۴، بازارهای جهانی کامودیتی‌ها تحت تأثیر چندین عامل کلیدی قرار دارند که به تحلیل دقیق‌تری نیاز دارد. در ادامه، وضعیت فعلی و روندهای بازار را بررسی می‌کنیم.

وضعیت قیمت کامودیتی‌ها

فلزات گرانبها:

– طلا: قیمت هر انس طلا به ۲۶۵۰٫۶۱ دلار رسیده که نسبت به روز گذشته ۰٫۷٪ افزایش نشان می‌دهد. این افزایش قیمت به دلیل انتظارات از سیاست‌های فدرال رزرو و کاهش نرخ بهره در ایالات متحده است که موجب افزایش جذابیت طلا به عنوان یک دارایی امن می‌شود.

– نقره: نقره نیز با قیمت ۳۱٫۰۷ دلار و افزایش ۰٫۷۱٪ نسبت به روز قبل معامله می‌شود.

– پلاتین و پالادیوم: قیمت پلاتین ۹۶۳٫۹۵ دلار و پالادیوم ۱۰۲۱٫۵۳ دلار است که به ترتیب افزایش‌های ۱٫۸۴٪ و ۱٫۷۸٪ را تجربه کردند.

کالاهای کشاورزی:

– گندم: قیمت گندم با کاهش جزئی به ۵۵۴٫۳ دلار رسیده است. – ذرت: ذرت نیز با قیمت ۴۳۱٫۶ دلار و افزایش ۰٫۹۸٪ در حال معامله است. – سویا: قیمت سویا به ۹۹۳٫۱۲ دلار رسیده که نشان‌دهنده یک افزایش خفیف است.

تغییرات قیمت‌ها در هفته‌ای که گذشت

تاریخ	سکه	دلار آزاد	دلار نیما
۱۴۰۳/۰۹/۰۶	۴۹۳,۳۵۰,۰۰۰	۶۹۳,۸۶۸	۵۱۶,۴۱۱
۱۴۰۳/۰۹/۰۵	۴۹۵,۲۵۰,۰۰۰	۶۹۳,۲۹۸	۵۱۴,۸۳۰
۱۴۰۳/۰۹/۰۴	۴۹۴,۰۵۰,۰۰۰	۷۰۳,۲۷۳	۵۱۲,۹۹۱
۱۴۰۳/۰۹/۰۳	۵۰۵,۰۵۰,۰۰۰	۷۰۳,۲۷۳	۵۱۱,۱۹۰
۱۴۰۳/۰۹/۰۱	۴۹۵,۳۰۰,۰۰۰	۶۹۲,۰۶۷	۵۱۰,۲۵۹
۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۴۹۱,۴۵۰,۰۰۰	۶۸۵,۹۷۸	۵۰۸,۲۷۷

سکه و دلار



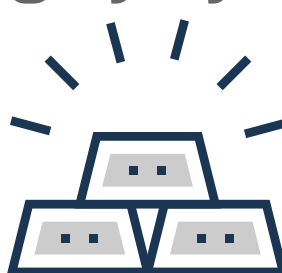
تاریخ	نفت سنگین ایران	نفت برنت	نفت WTI	گاز طبیعی
۱۴۰۳/۰۸/۲۹	۶۷,۳	۷۳,۴۵	۶۹,۴۱	۲,۹۷۱
۱۴۰۳/۰۸/۲۸	۶۶,۵۹	۷۳,۴	۶۹,۲۵	۲,۹۷۱
۱۴۰۳/۰۸/۲۶	۶۷,۴۵	۷۱,۰۴	۶۷,۰۲	۲,۸۲۳
۱۴۰۳/۰۸/۲۵	۶۷,۴۵	۷۱,۰۶	۶۷	۲,۸۲۵
۱۴۰۳/۰۸/۲۴	۶۷,۰۴	۷۲,۴۲	۶۸,۵۶	۲,۷۶۶
۱۴۰۳/۰۸/۲۳	۶۷,۰۴	۷۲	۶۸,۰۸	۳

انرژی



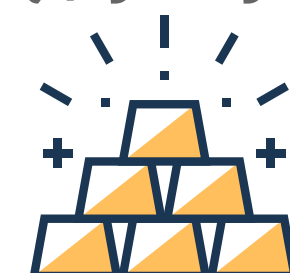
تاریخ	مس	آلومینیوم	روی	سرب	قلع	نیکل
۱۴۰۳/۰۹/۰۶	۸۹۷۳	۲۶۱۱	۳۰۷۲	۲۰۱۸	۲۸۹۷۶	۱۶۰۰۰۵
۱۴۰۳/۰۹/۰۵	۹۰۵۴	۲۶۵۲	۳۰۲۱	۲۰۲۸	۲۸۹۱۴	۱۶۱۹۰۵
۱۴۰۳/۰۹/۰۲	۸۹۸۵	۲۶۳۵	۲۹۷۶	۲۰۲۶	۲۸۷۵۰	۱۵۸۵۶
۱۴۰۳/۰۹/۰۱	۹۰۳۴	۲۶۳۴	۳۰۰۵	۲۰۰۵	۲۹۰۲۶	۱۵۷۰۷
۱۴۰۳/۰۸/۳۰	۹۰۹۱	۲۶۳۲	۲۹۸۱	۲۰۱۸	۲۸۸۸۰	۱۵۸۷۸
۱۴۰۳/۰۸/۲۹	۹۱۲۲	۲۶۴۷	۲۹۶۱	۲۰۰۵	۲۹۰۲۳	۱۵۸۰۶

فلزات رنگی



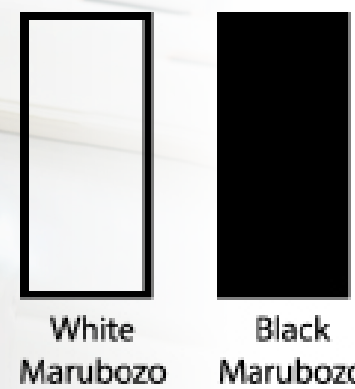
تاریخ	طلا	نقره	پلاتین	پالادیوم
۱۴۰۳/۰۹/۰۶	۲,۶۲۸,۰۱	۳۰,۴۶	۹۳۰,۶۵	۹۹۴,۲۸
۱۴۰۳/۰۹/۰۵	۲,۶۲۵,۹۰	۳۰,۳۳	۹۴۴,۷۵	۹۹۱,۰۳
۱۴۰۳/۰۹/۰۳	۲,۷۱۲,۵۵	۳۱,۳۱	۹۷۱,۰۰	۱,۰۲۵,۵۰
۱۴۰۳/۰۹/۰۲	۲,۷۰۷,۵۵	۳۱,۲۲	۹۷۱,۱۰	۱,۰۱۵,۰۰
۱۴۰۳/۰۹/۰۱	۲,۶۶۹,۸۱	۳۰,۸۱	۹۷۰,۲۵	۱,۰۱۷,۷۸
۱۴۰۳/۰۸/۲۶	۲,۵۶۱,۲۴	۳۰,۲۱	۹۴۵,۱۰	۱,۰۰۸,۵۳

فلزات گرانبها



آموزش کندل شناسی

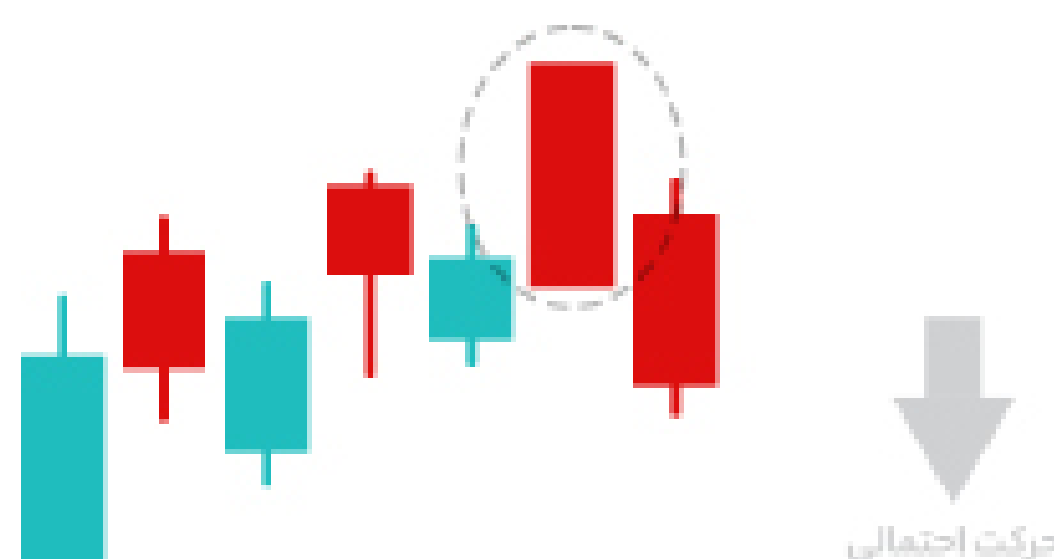
الگوی کندل استیک (Marubozu)



ماروبزو به دو الگوی
 ماروبزو سیاه (قرمز) و
 ماروبزو سفید (سبز)
 تقسیم می‌شود.

- الگو ماروبزو سفید (سبز) روند صعودی در بازار را نشان می‌دهد**
- سایه بالایی و پایینی در این الگو دیده نمی‌شود.
 - فشار بیشتر خریداران مهم‌ترین نتیجه کندل استیک ماروبزو سفید است.
 - در این الگو قیمت کف با قیمت باز شدن و قیمت سقف با قیمت بسته شدن برابر است.

- الگو ماروبزو سیاه (قرمز) نشان دهنده روند نزولی در بازار است**
- سایه بالایی و پایینی در این الگو دیده نمی‌شود (و یا بسیار کوچک هستند).
 - در این الگو قیمت سقف با قیمت شروع و قیمت کف با قیمت پایان برابر است (به زبان ساده، کندل استیک سایه ندارد).
 - کندل استیک ماروبزو سیاه نشان دهنده فشار بیشتر فروشندگان است.



NEWS



اخبار کوتاه هفته

- رشد ۵۹۵۲ واحدی شاخص کل بورس در آغاز معاملات ۷ آذر ۱۴۰۳
- قیمت دلار صرافی ملی به ۵۳,۲۰۴ تومان رسید.
- افزایش قیمت طلا به ۲,۶۳۹ دلار در بازار جهانی
- بازار تیرآهن بی‌جان؛ قیمت‌ها ثابت ماندند.
- کاهش پروژه‌های ساختمانی به دلیل افزایش قیمت تیرآهن
- گرانی اینترنت و پایان قطعی برق در ایران
- افزایش ۰.۵۶ درصدی قیمت طلا در بازار ایرا
- تأثیر رکود بر بازار مسکن و ساختمان سازی
- نوسانات قیمت دلار و تأثیر آن بر اقتصاد ایران
- رکود در بازار فولاد و کاهش تقاضا برای مصالح ساختمانی
- تداوم مشکلات تأمین سیمان در پروژه‌های عمرانی
- تحلیل وضعیت اقتصادی ایران در روزنامه‌های اقتصادی
- پیش‌بینی ثبات قیمت‌ها در بازار کالاها به دلیل رکود
- تغییرات قیمتی در بازار طلا و تأثیر آن بر سرمایه‌گذاری‌ها

اعتبار بیشتر سود بیشتر



تخصیص اعتبار معاملاتی
در باشگاه مشتریان تدیرگران فردا