

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۳ مردادماه ۱۴۰۴



هفته گذشته، مشابه هفته پیش از آن با تقاضای نسبی دنبال شد. اگرچه شدت صعود بازار کم شد و این موضوع در شتاب رشد کندل‌ها در شاخص‌های بازار مشهود بود. ارزش معاملات خرد کماکان نشان‌دهنده دوران رکود است. فصل مجامع نیز در این مورد بی‌تاثیر نبوده و در هفته پیش، بسیاری از نمادها جهت برگزاری مجامع سالیانه بسته بودند و بخشی از کاهش ارزش معاملات بازار را می‌توان به این موضوع نسبت داد.

خروج نقدینگی حقیقی از سهام و معاملات خرد کماکان به شکل عجیبی، بدون ترمز ادامه دارد و سهامداران هیچ مثبتی را جهت خروج پول، دریغ نمی‌کنند. بدیهی‌ست تا زمانی که شرایط کلان، به نفع بازار تغییر نکند، اعتماد از دست رفته، به بازار باز نخواهد گشت. بخشی از پولی که از سهام خارج می‌شود، این روزها وارد صندوق‌های درآمد ثابت و در درجه دوم، وارد صندوق‌های طلا می‌شود و بخشی از آن نیز بلامتکلیف و سرگردان باقی می‌ماند.

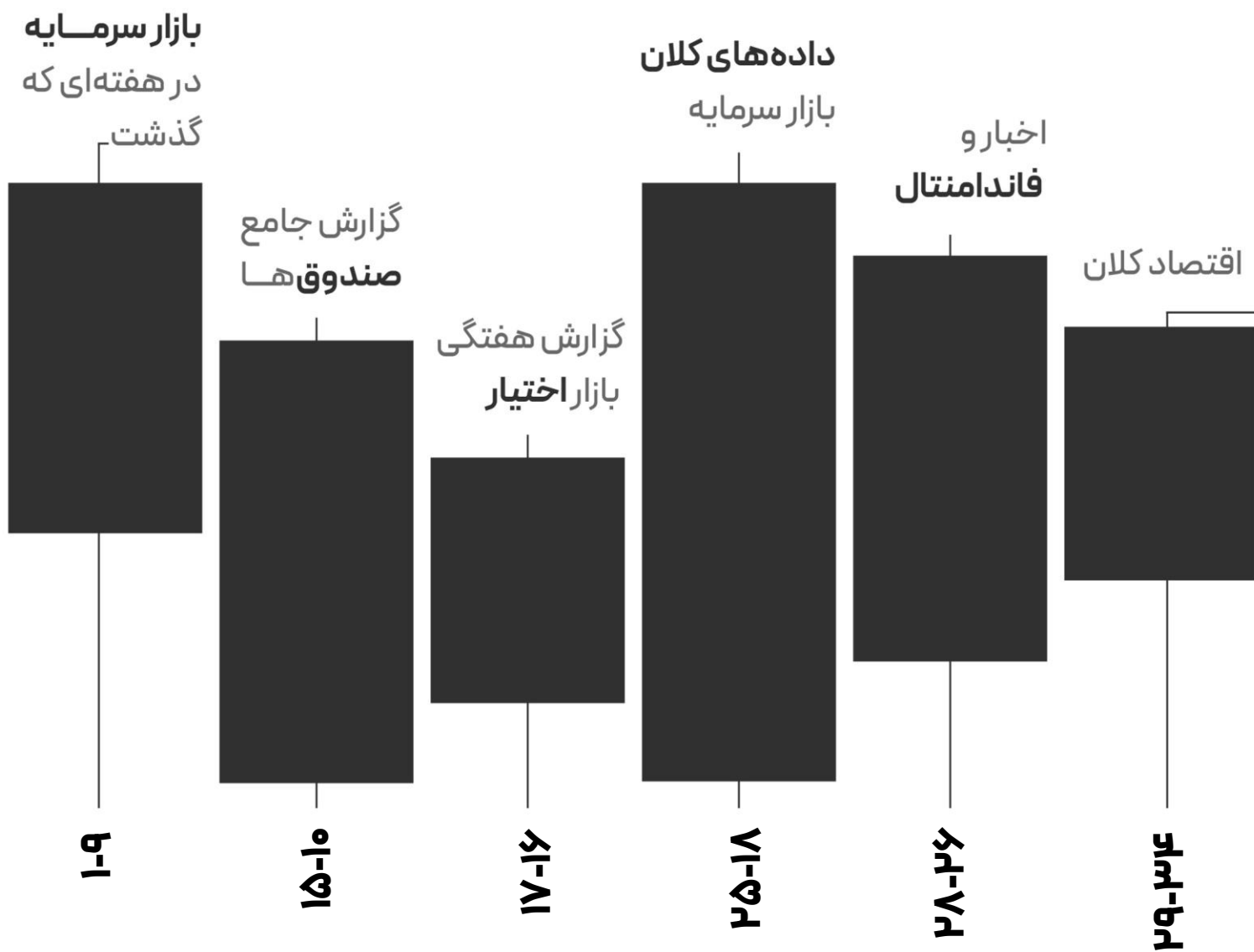
مصوبه افزایش ضریب اعتبار صندوق‌های اهرمی، تا حدی می‌تواند در جهت کاهش حباب منفی سنگین این صندوق‌ها و به تعادل رسیدن معاملات‌شان موثر باشد، به شرط آنکه بازار هم تا حدی همراهی کند.



در بازار طلا و بازار ارز هم، اگرچه تقریباً تمام حجم پول حقیقی که از سقف دلار ۱۰۵ هزار تومانی و شروع مذاکرات ایران و آمریکا خارج شده بود، طی مدت اخیر خرد خرد به صندوق‌های طلا وارد شد، اما تقاضای قدرتمندی در کلیت روند معاملات این صندوق‌ها مشاهده نمی‌شود. با توجه به روند خنثی در انس طلای جهانی و دلار، بازار طلای داخل هم در رکود قرار دارد. بازار خودرو و مسکن نیز در رکود کامل قرار دارند و علاوه بر کاهش قیمت‌ها، تعدد معاملات هم به شدت کاهش یافته و به طور کلی در یک جمله می‌توان گفت، رونق از معاملات تمام بازارها افتاده است.

به طور کلی، شرایط فعلی بازارها ناشی از اتفاقات سیاسی اخیر است و تا زمانی که افق آینده‌ی سیاسی کشور و روابط بین‌الملل مشخص نشود، نمی‌توان انتظار شرایط پایدار و مشخصی را در هیچ یک از بازارها داشت! تمامی معامله‌گران در تمامی بازارها فاز احتیاط به خود گرفته‌اند و باید منتظر ماند و دید شرایط به چه سمت و سویی پیش می‌رود.

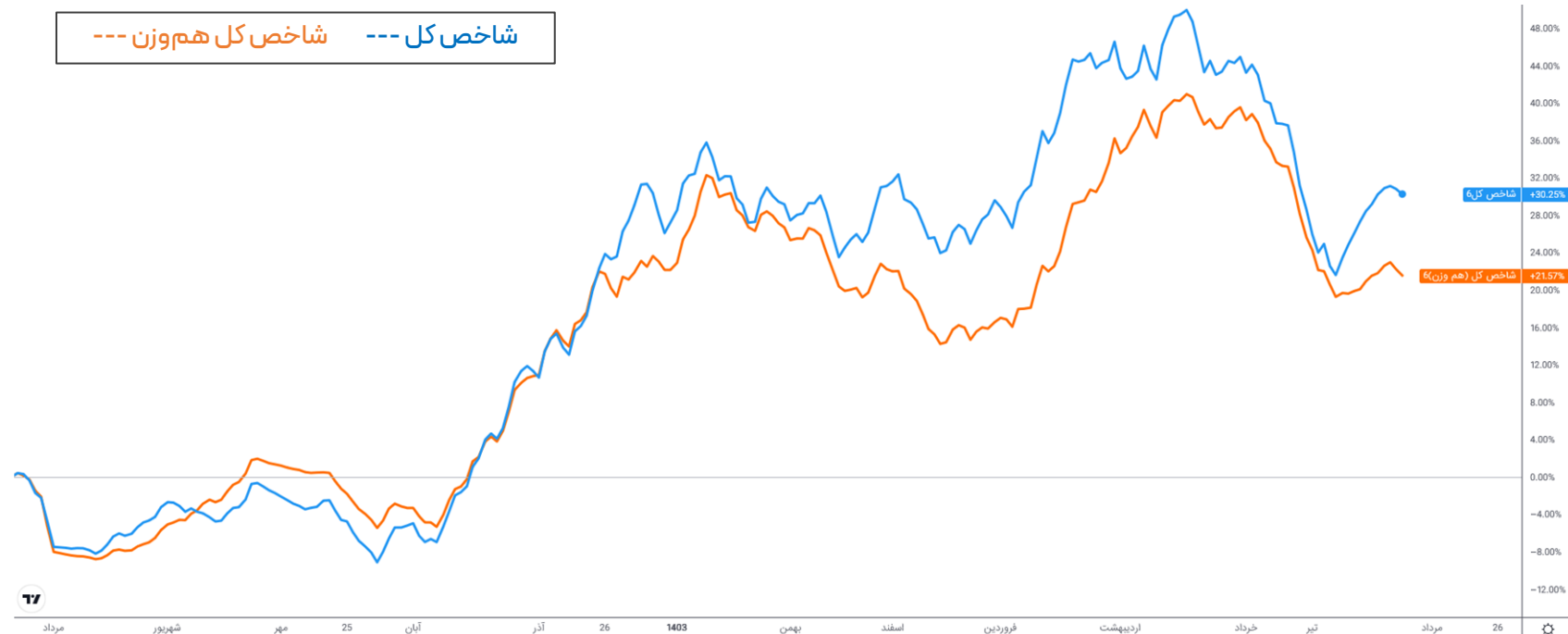




نمودار مقایسه‌ی

عملکرد شاخص کل و شاخص کل هموزن

در تصویر زیر، عملکرد مقایسه‌ای شاخص کل و شاخص کل هموزن در یک نمودار قابل مشاهده است. مشخص است که طی دوره زمانی یک ساله‌ی اخیر، عملکرد شاخص کل هموزن در دوره‌های رکود و هم در دوران رونق بهتر از شاخص هموزن بوده است. در رشد اخیر بازار که از پاییز آغاز شد نیز شاخص کل نسبت به شاخص هموزن صعود پرشتاب‌تری را تجربه کرد. همچنین در روند اصلاحی پس از آن نیز، شاخص کل، بیشتر اصلاح را در قالب زمان تجربه کرد در حالی که شاخص کل هموزن بیشتر در قالب قیمت اصلاح کرد. با وجود اینکه در افق سه‌ماهه شاخص کل هموزن عملکرد بهتری نسبت به شاخص کل داشت، اما در افق یک‌ماه و یک هفته اخیر، بار دیگر شاخص کل نسبت به شاخص هموزن، بهتر عمل کرد.



دوره زمانی	یک هفته	یک ماهه	سه ماهه	شش ماهه	یک ساله
بازده شاخص کل	+ ۱.۸۰ %	- ۴.۹۹ %	- ۹.۶۱ %	+ ۲.۷۸ %	+ ۳۰.۷۴ %
بازده شاخص کل هم وزن	+ ۱.۰۶ %	- ۸.۲۴ %	- ۵.۴۰ %	- ۳.۵۵ %	+ ۲۲.۲۲ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

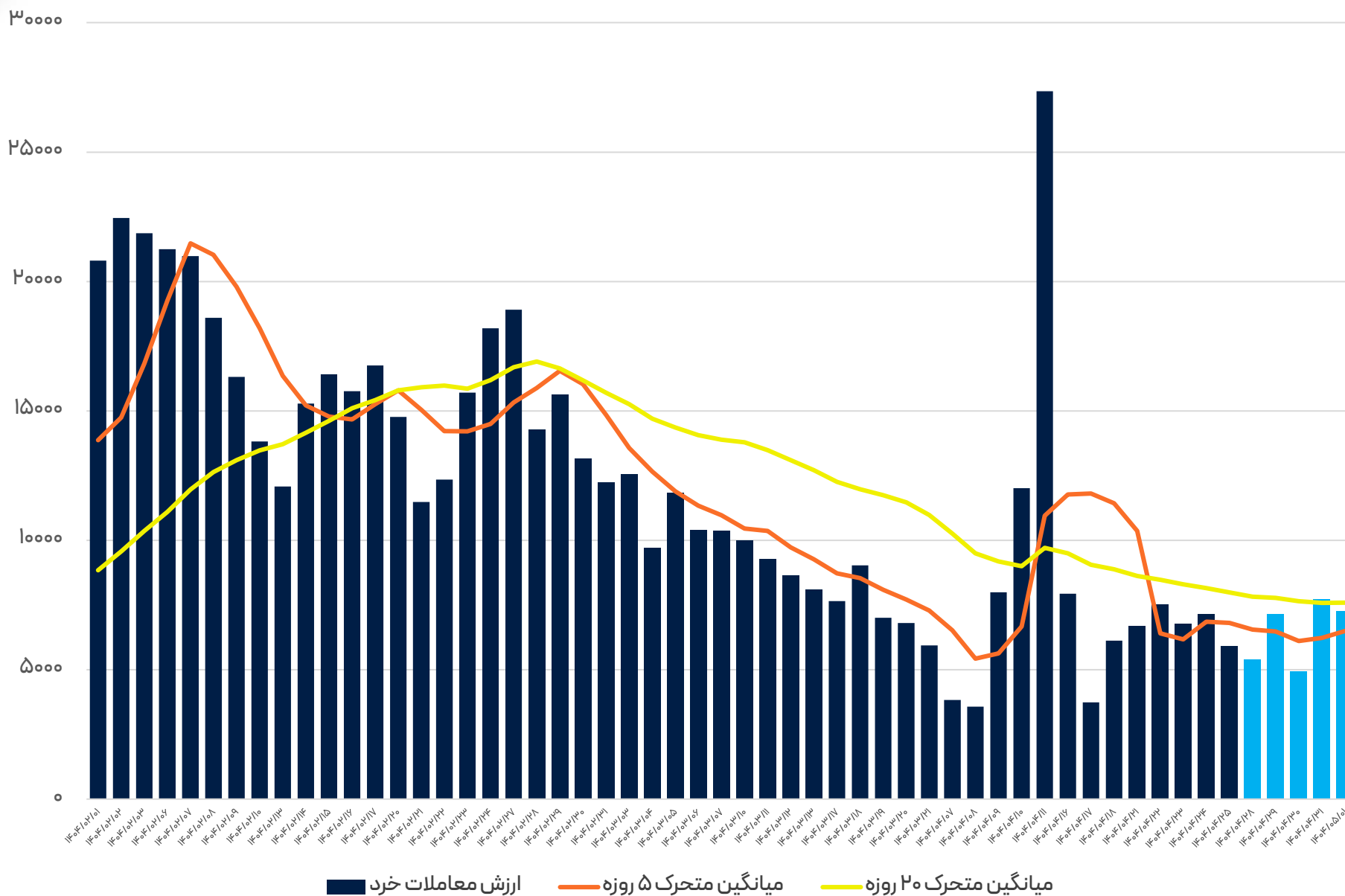
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل است. همچنین اگر آینده‌ی نمودار صعودی ارزیابی شود، انتظار می‌رود شاخص هم وزن نسبت به شاخص کل بازده و عملکرد بهتری را به ثبت برساند. بازده بهتر می‌تواند شامل رشد بیشتر شاخص هم وزن نسبت به شاخص کل، یا اصلاح کمتر شاخص هم وزن نسبت به شاخص کل و یا رشد شاخص هم وزن و اصلاح قیمتی یا زمانی شاخص کل باشد.



در تصویر، نمودار نسبی شاخص هم وزن به شاخص کل را مشاهده می‌کنید. پس از مدت‌ها بازده بهتر شاخص کل نسبت به شاخص کل هم وزن، نمودار نسبی شاخص هم وزن به شاخص کل به سطح مهمی واکنش داد و پس از آن موفق به شکست خط روند نزولی چندماهه شد و در حال حاضر، به نظر تثبیت بر فراز خط روند نزولی ترسیم شده - که با خط چین مشخص شده - انجام شده و پولبک به نقطه شکست هم در حال تکمیل است. در این صورت، با شرط عدم بازگشت نمودار به زیر خط چین مینوری ترسیم شده در انتهای نمودار، می‌توانیم در سال جاری شاهد بازده و عملکرد بهتر **سهام کوچک‌تر** (مرتبط با شاخص کل هم وزن) نسبت به **سهام شاخص‌ساز** باشیم. این عملکرد بهتر در زمان اصلاح بازار، به این شکل نمود پیدا می‌کند که شاخص هم وزن نسبت به شاخص کل اصلاح کمتر و کندتری را تجربه می‌کند.

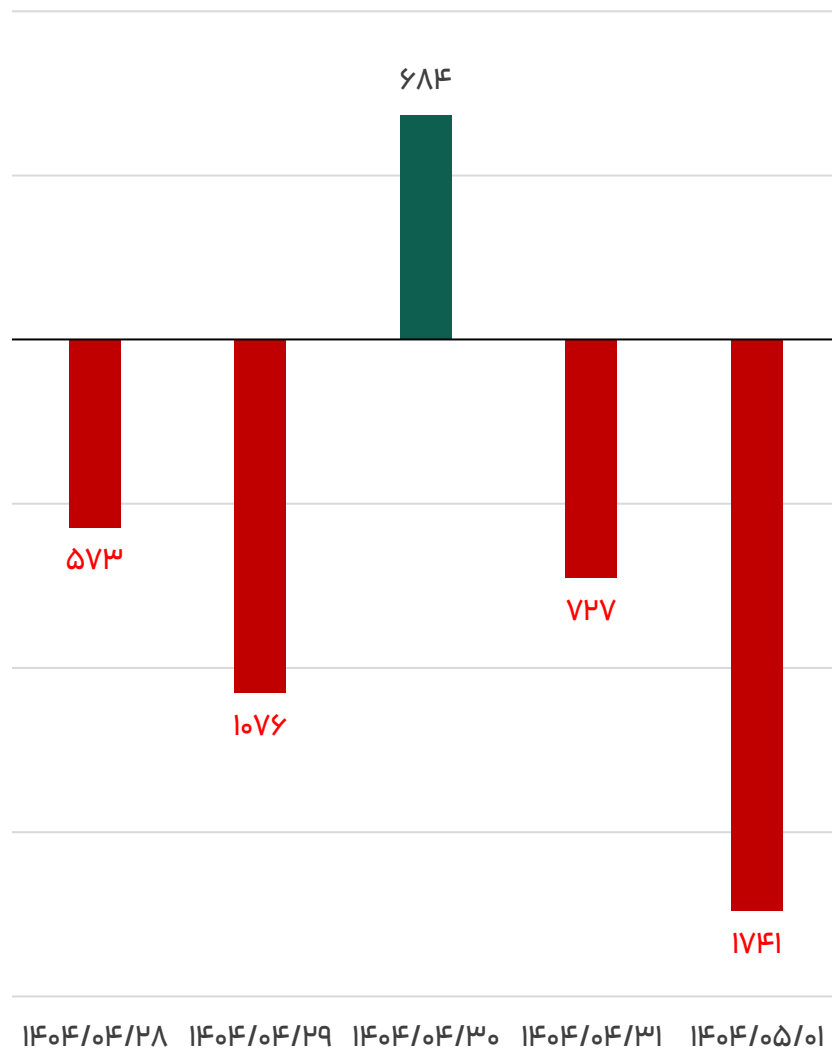


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

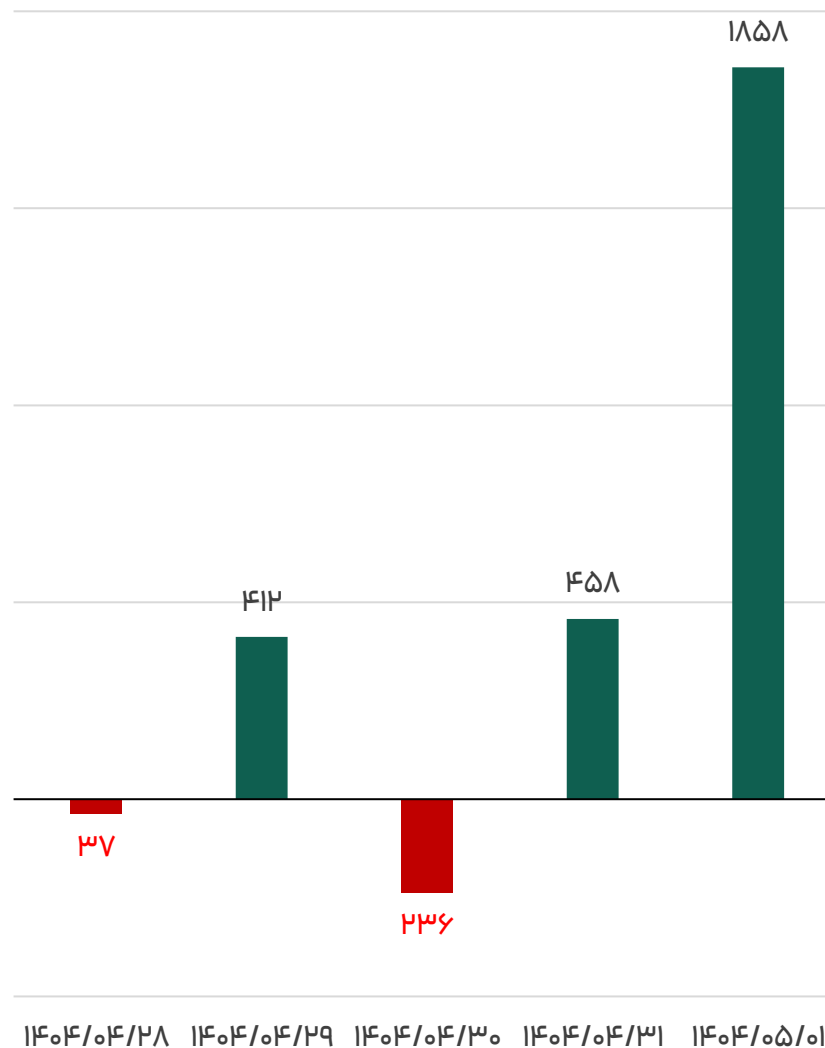


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد

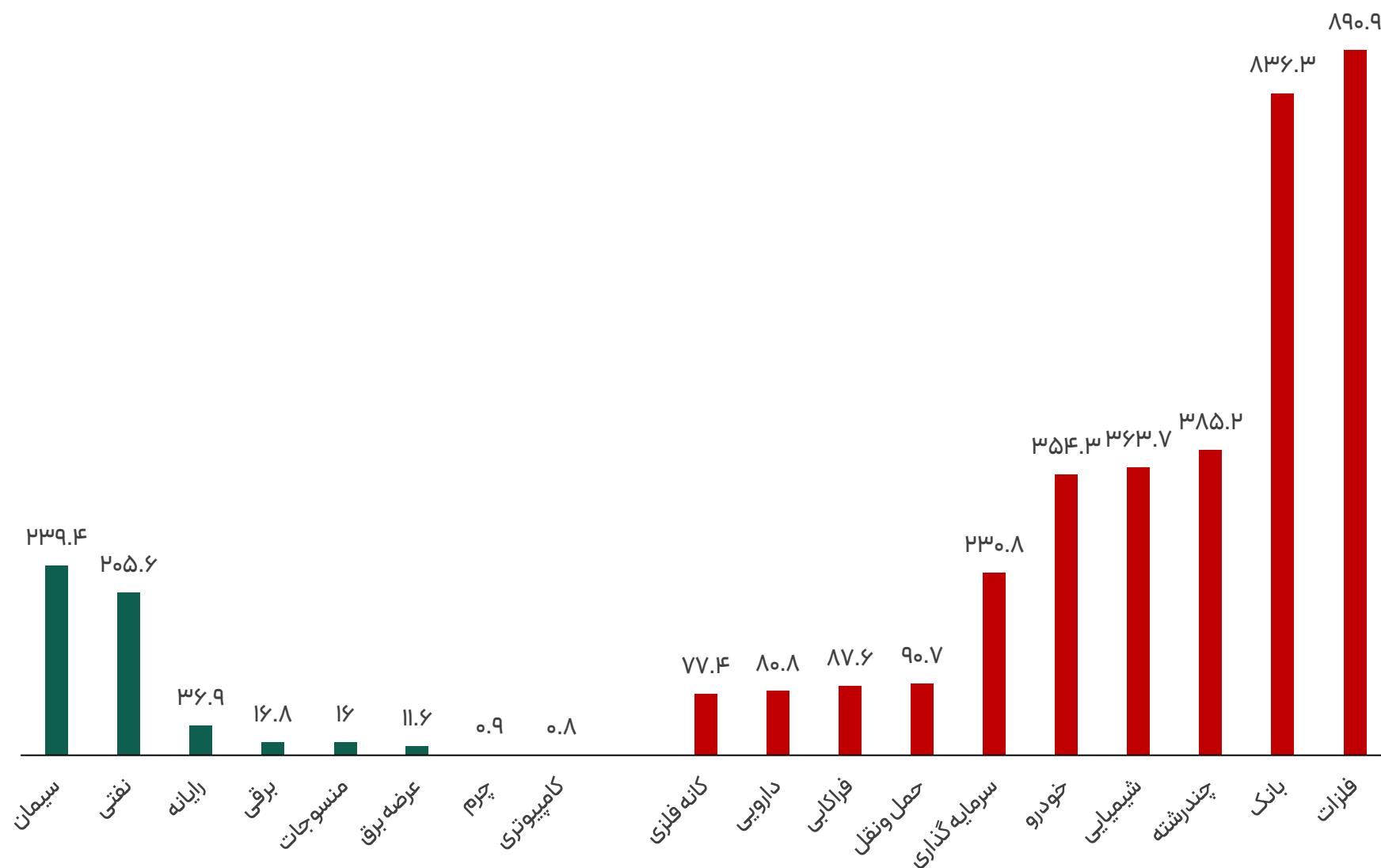


ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها

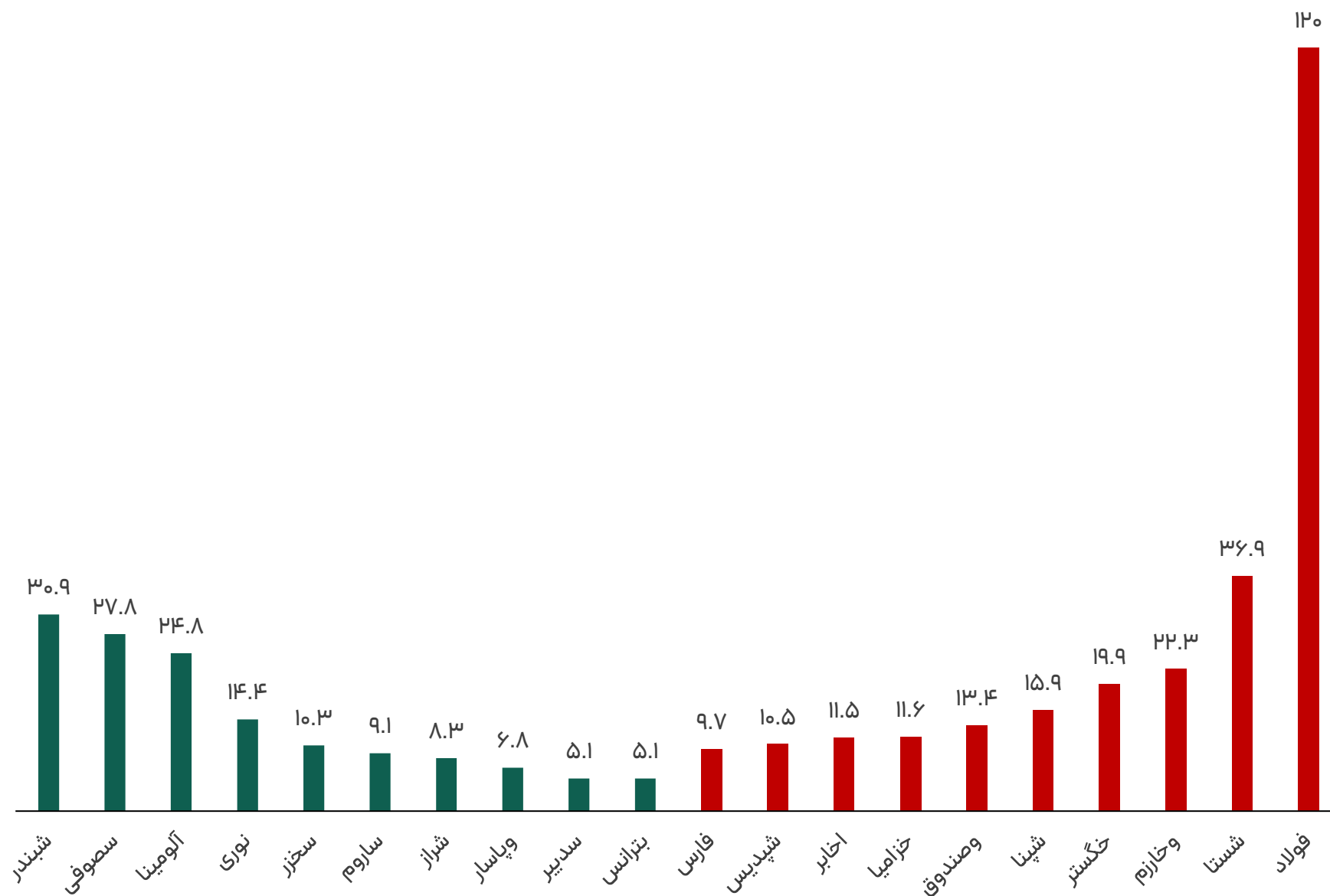


بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)

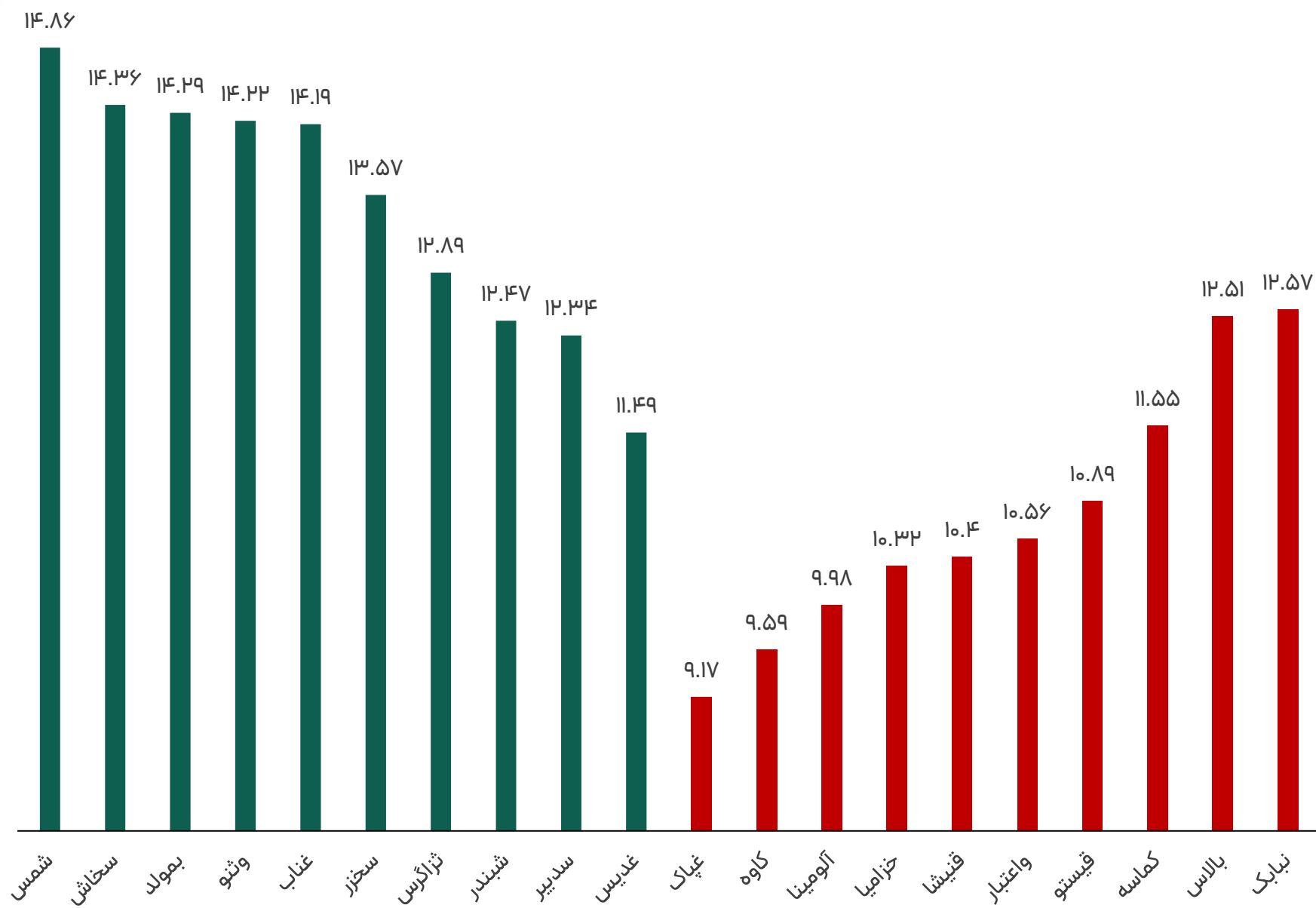
فقط هشت صنعت در بین کل صنایع بازار، طی هفته اخیر، ورود پول حقیقی داشته‌اند.



میانگین بیشترین ورود و خروج پول روزانه به نمادها در هفته اخیر (میلیارد تومان)



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



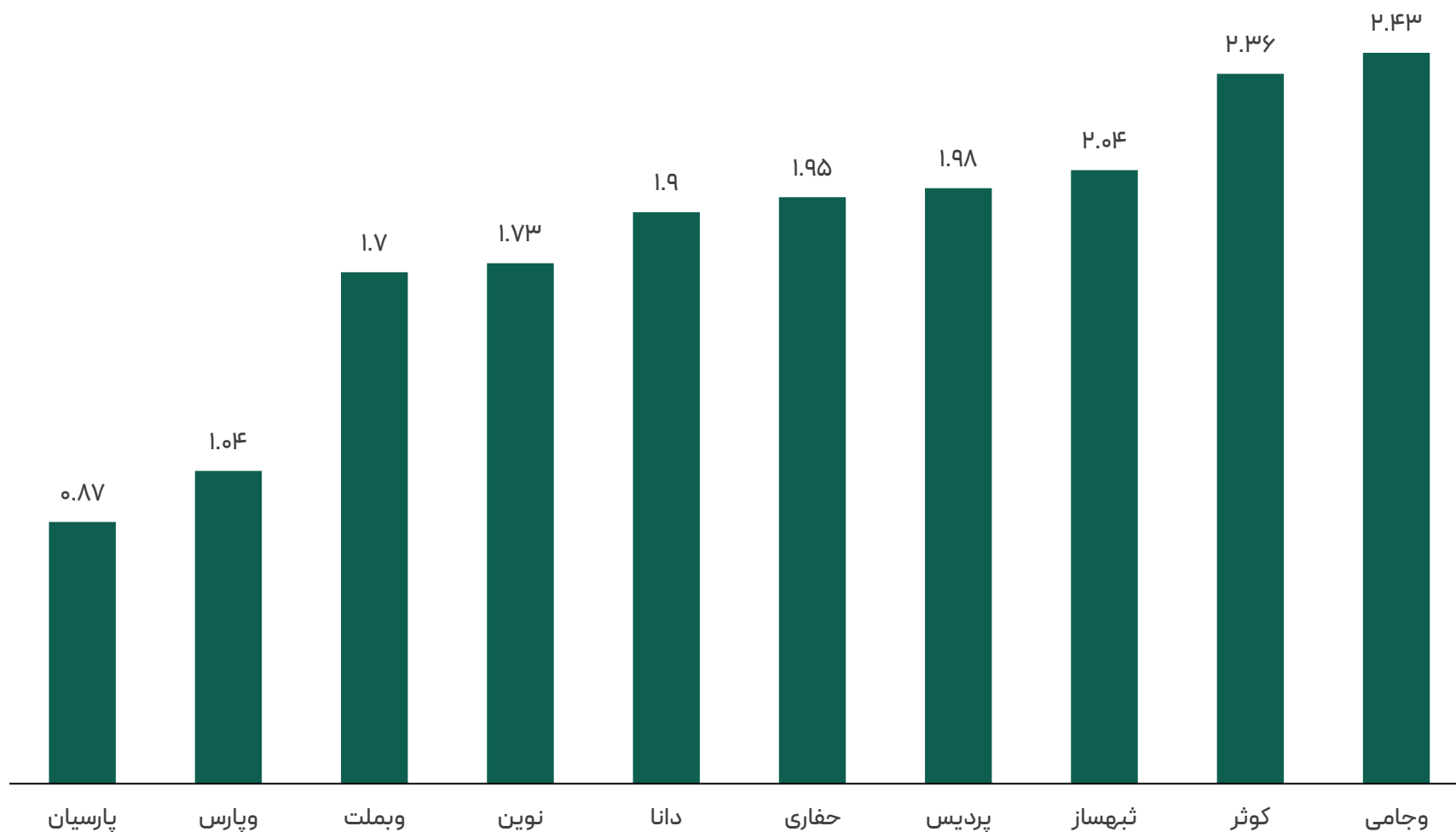
بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)



دسته‌بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نماد

ده نماد با کمترین نسبت P/E

نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم (EPS) به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.



گزارش صندوق‌های اهرمی

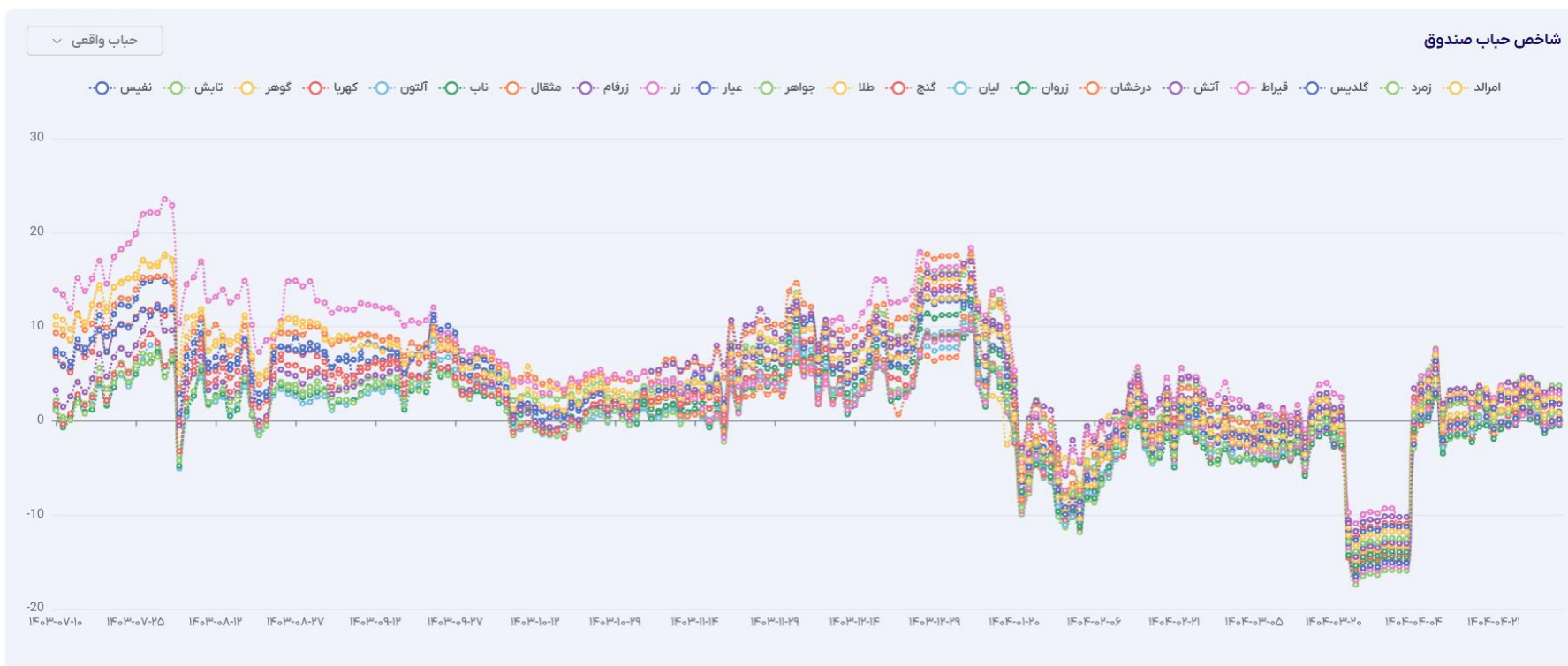
نماد	درصد حباب ↓	ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل	بازدهی ماهانه	بازدهی سه‌ماهه	بازدهی سالانه
 پیشران	-۲.۱۳	۱.۵۹	۰.۹۱	۱.۴۵	۱.۴۸	-۸.۲۲	-۱۳.۳۷	-۱۳.۳۷
 دوایکس	-۵.۲	۲.۳۱	۰.۹۵	۲.۱۹	۲.۳	-۲۰.۶۳	-۴۰.۷۷	-۳۶.۳۳
 موج	-۱۲.۱۳	۲.۳۹	۰.۹۵	۲.۲۷	۲.۵۵	-۱۷.۳۸	-۳۹.۵۹	۵۸.۲۸
 نارنج اهرم	-۱۲.۹	۳.۱۲	۰.۸۶	۲.۶۸	۳.۰۳	-۱۶.۷۴	-۳۱.۱۱	۳۱.۶۱
 توان	-۱۳.۴۸	۲.۵۵	۰.۸۳	۲.۱۲	۲.۴۱	-۲۲.۵۹	-۳۶.۸۴	۱۲.۵۸
 اهرم	-۱۳.۶۹	۲.۰۴	۰.۹۳	۱.۹	۲.۱۶	-۲۰.۲۴	-۳۹.۱۳	۸.۹۱
 بیدار	-۱۴.۵۵	۲.۵۳	۰.۹۴	۲.۳۸	۲.۷۳	-۲۱.۱۷	-۳۴.۸۸	۸.۲۶
 شتاب	-۱۴.۷۶	۲.۷۷	۰.۹۲	۲.۵۵	۲.۹۳	-۲۲.۸۸	-۳۵.۲۹	۲۸.۵۶
 جهش	-۱۵.۰۷	۳	۰.۸۶	۲.۵۸	۲.۹۷	-۲۵.۳۸	-۳۶.۹۷	۲.۷۳
 میانگین	-۱۱.۵۵	-	-	-	-	-۱۹.۴۷	-۳۴.۲۲	۱۱.۲۵

گزارش کامل صندوق‌های اهرمی را در سامانه دانافیو، از بخش صندوق‌ها مشاهده کنید.

ورود به دانافیو



گزارش صندوق‌های طلا

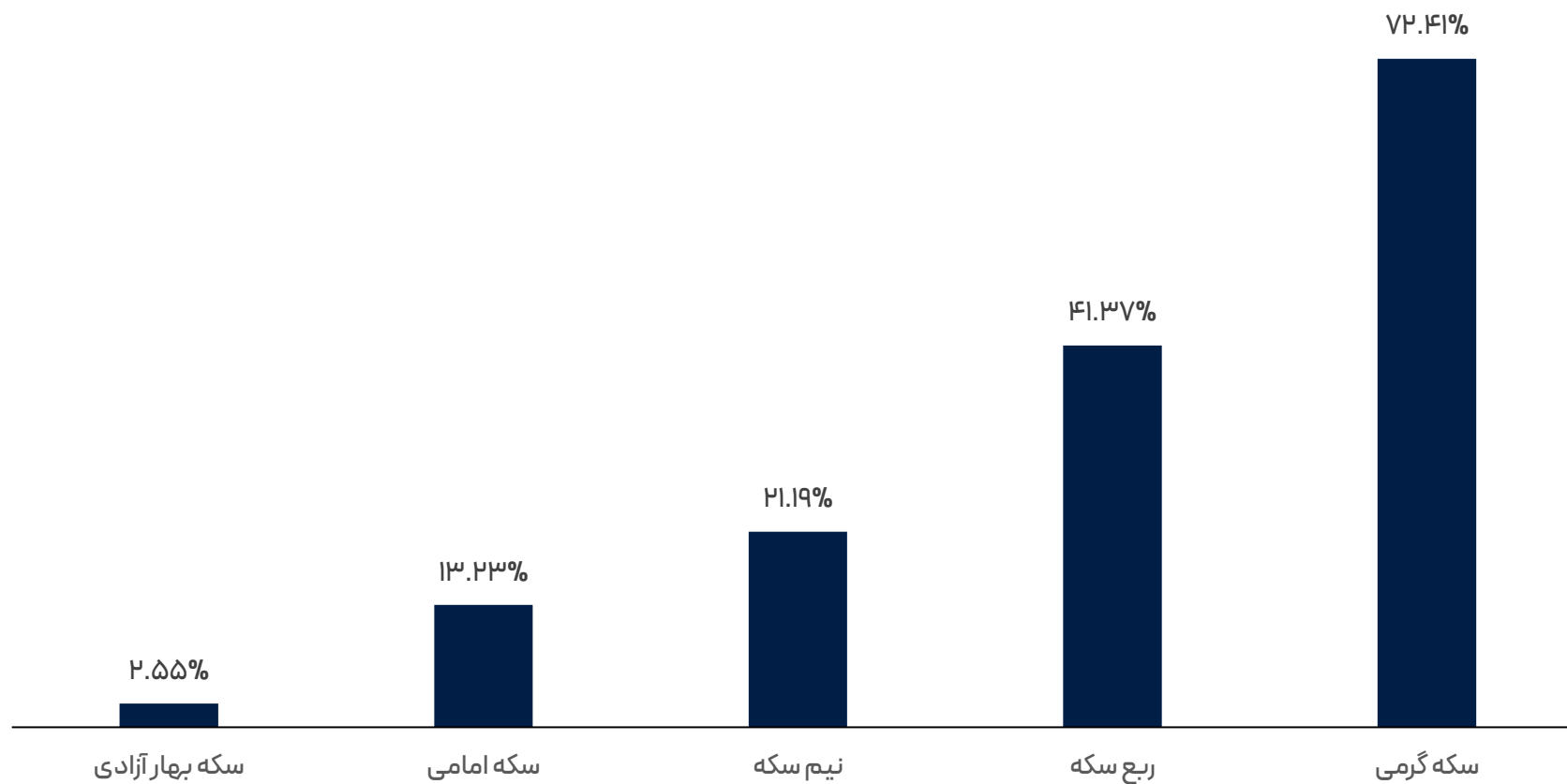


گزارش کامل صندوق‌های طلا را در سامانه دانا فیبو، از بخش صندوق‌ها مشاهده کنید.

ورود به دانا فیبو



حباب ربع سکه، نیم سکه، تمام سکه و سکه گرمی (درصد)

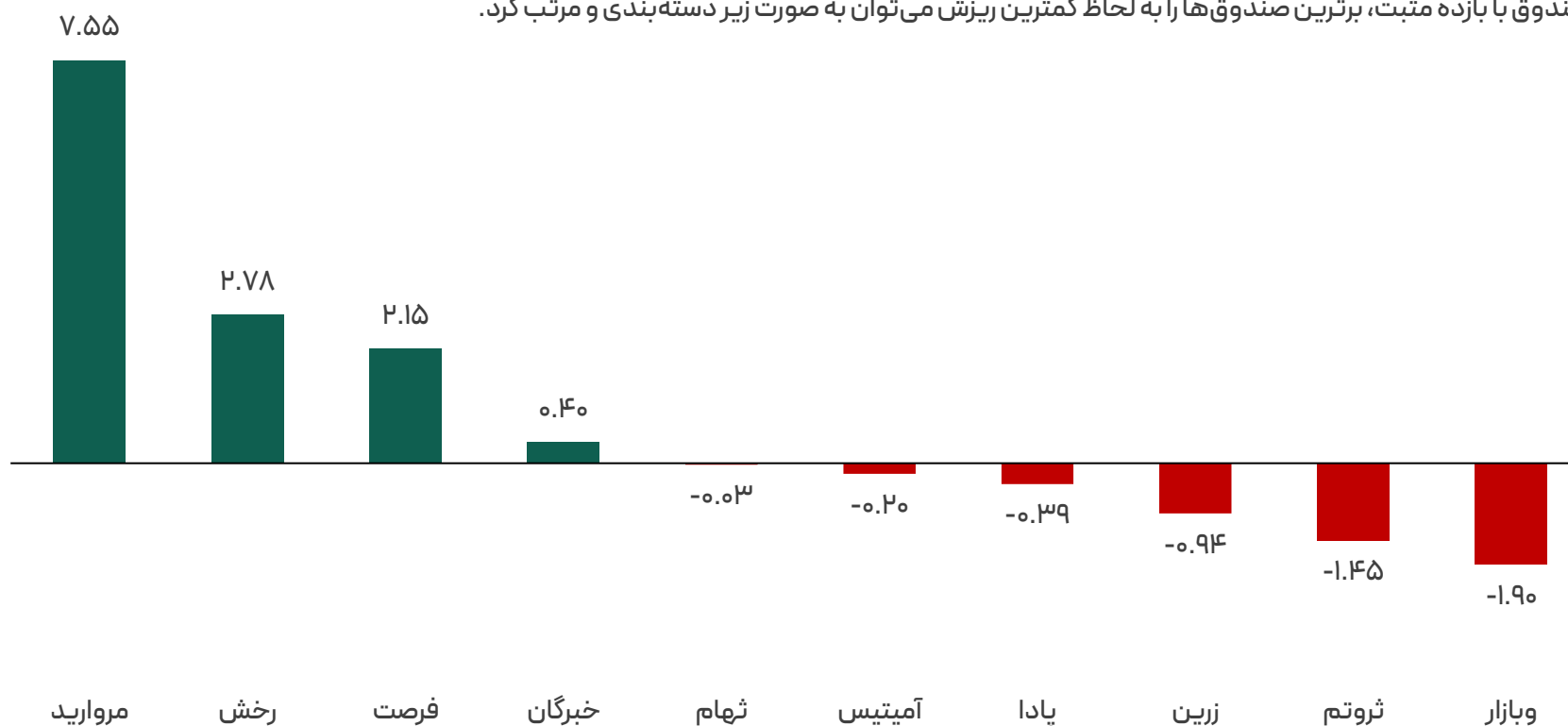


حباب سکه از طریق نسبت قیمت روز سکه، به ارزش ذاتی آن به دست می آید.



بازده ماهانه صندوق‌های سهامی به درصد (ده صندوق برتر)

شرایط بحرانی یکی دو ماه اخیر، باعث ریزش شدید بازار شد. به طوری که جز چهار مورد، سائز صندوق‌های سهامی بازده مثبت ماهانه نداشته‌اند و علاوه بر چهار صندوق با بازده مثبت، برترین صندوق‌ها را به لحاظ کمترین ریزش می‌توان به صورت زیر دسته‌بندی و مرتب کرد.



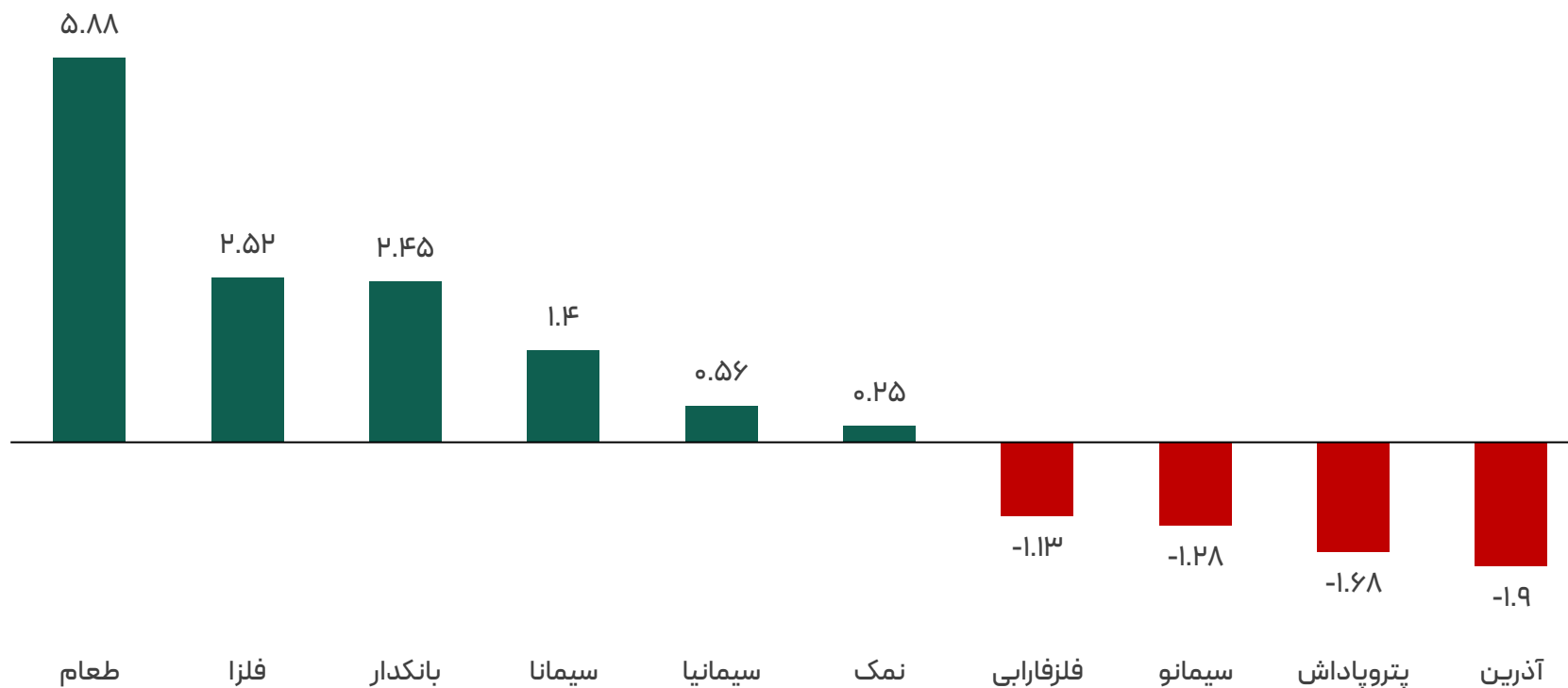
گزارش کامل صندوق‌های سهامی را در سامانه دانافیبو، از بخش صندوق‌ها مشاهده کنید.

ورود به دانافیبو



بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

شرایط بحرانی یکی دو ماه اخیر، باعث ریزش شدید بازار شد. به طوری که تنها شش صندوق بخشی، بازده مثبت ماهانه داشته است و سایر صندوق‌های بخشی، جملگی بازده منفی به ثبت رسانده‌اند. برترین صندوق‌ها را به لحاظ بازده مثبت و سپس کمترین ریزش می‌توان به صورت زیر دسته‌بندی و مرتب کرد.

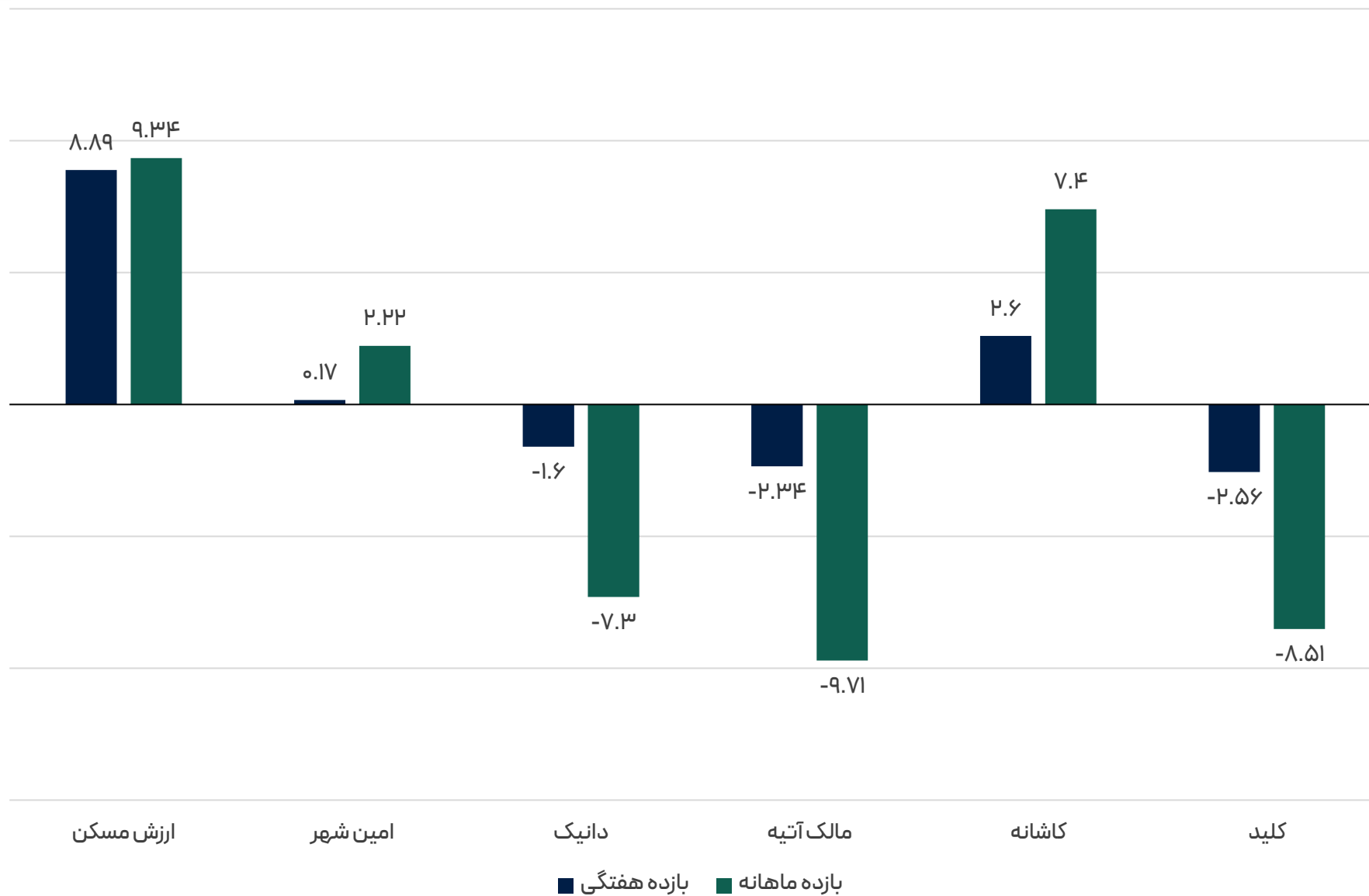


گزارش کامل صندوق‌های بخشی را در سامانه دانافیبو، از بخش صندوق‌ها مشاهده کنید.

ورود به دانافیبو



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)

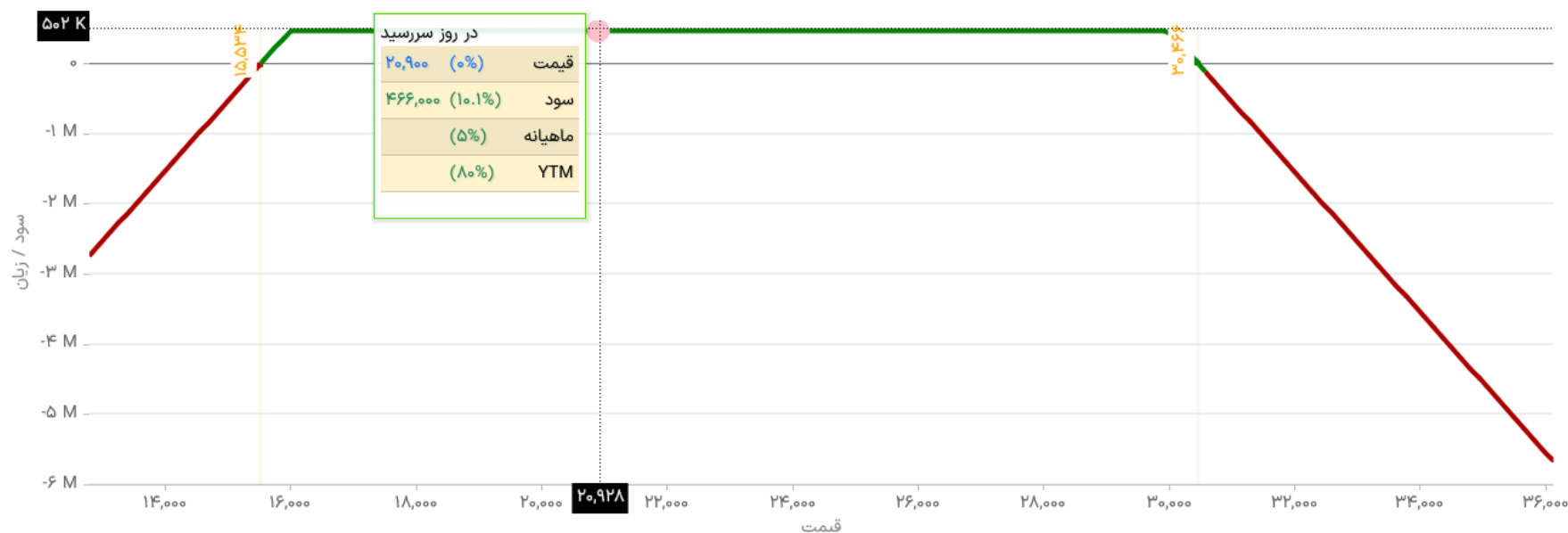


گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

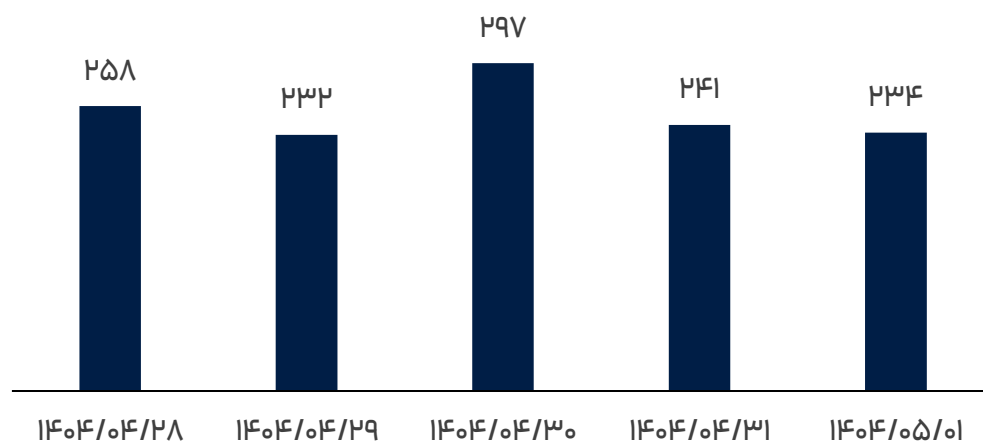
مروری بر استراتژی استرانگل فروش روی قراردادهای برج ۶ صندوق اهرم که در بولتن هفتگی منتهی به ۲۷ تیرماه، ارائه شد...
با توجه به پر بودن سقف برج ۵، سراغ قراردادهای برج ۶ رفتیم. این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش ها و اختیار خریدهای در زیان صندوق اهرم انجام می‌شد. چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم در بازه قیمتی ۳۰۴۶۶ و ۱۵۵۳۴ ریال باقی بماند، استراتژی در سود بسته خواهد شد. حداکثر سود احتمالی این استراتژی، برابر با ۵ درصد ماهانه (۱۰.۱ درصد تا روز سررسید) می‌باشد و زیان احتمالی نامحدود خواهد بود. بنابراین لازم است چنانچه بازار به سمت بازه‌های زیان حرکت کرد، موقعیت‌ها مدیریت شوند.

خرید/فروش	نماد	نوع	تعداد	اعمال	قیمت	دلتا	IV %	وجه تضمین	آفست	خالص
فروش	طهرم ۶۰۲۵	اختیار فروش	۱	۱۶,۰۰۰	۲۶۱	-۰.۰۱	۶۵	۱,۶۱۰,۰۰۰		-۱,۶۱۰,۰۰۰
فروش	ضهرم ۶۰۳۲	اختیار خرید	۱	۳۰,۰۰۰	۲۰۵	۰.۰۱	۵۹	۳,۰۱۰,۰۰۰		-۳,۰۱۰,۰۰۰
+ روز ۶۰ ۰.۰۰ ۱۰۵,۰۰۰ (-۲.۳%) -۴,۶۲۰,۰۰۰										

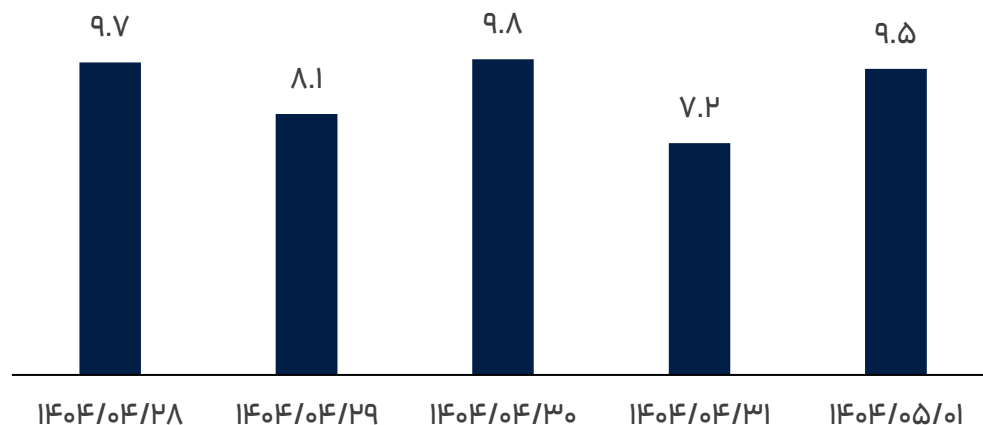


گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



حجم معاملات روزانه



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

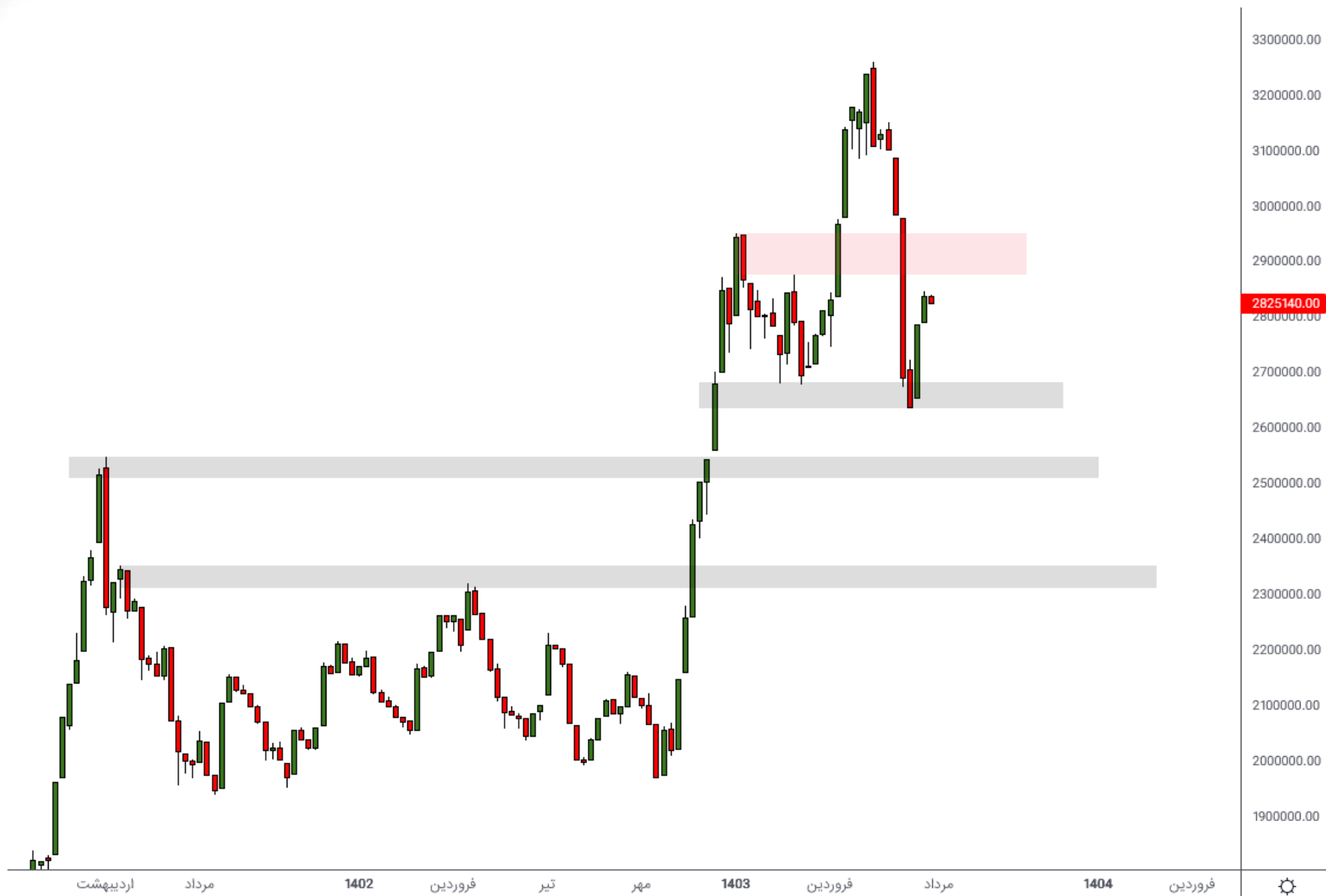
ماه‌یانه	هفتگی	روزانه
ضهرم ۵۰۱۷ ۵,۹۳۵.۴ B	ضهرم ۶۰۲۸ ۴,۳۵۰.۴ B	ضهرم ۶۰۲۸ ۶۶۶.۲ B
ضهرم ۶۰۲۸ ۴,۴۲۰.۷ B	ضهرم ۶۰۲۷ ۲,۸۲۲.۷ B	ضهرم ۶۰۲۷ ۳۸۲.۳ B
ضهرم ۵۰۱۶ ۳,۴۹۶.۷ B	ضهرم ۶۰۲۹ ۱,۱۸۷.۸ B	ضهرم ۶۰۲۶ ۱۴۷.۲ B
ضهرم ۶۰۲۷ ۳,۰۱۹.۱ B	ضهرم ۶۰۲۶ ۱,۰۰۲.۵ B	ضهرم ۶۰۲۹ ۱۱۷ B
ضهرم ۵۰۱۹ ۱,۵۳۱.۱ B	ضهرم ۶۰۲۵ ۸۸۴.۵ B	ضهرم ۶۰۲۵ ۱۰۴.۶ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماه‌یانه	هفتگی	روزانه
طهرم ۶۰۲۷ ۹۷۵.۷ B	طهرم ۶۰۲۷ ۹۷۵ B	طهرم ۶۰۲۷ ۲۵۹.۶ B
طهرم ۵۰۱۷ ۹۵۵.۵ B	طهرم ۶۰۲۸ ۵۶۴ B	طهرم ۶۰۲۸ ۱۳۹.۵ B
طهرم ۵۰۲۰ ۸۹۵.۶ B	طهرم ۶۰۲۹ ۲۲۳.۳ B	طهرم ۶۰۲۹ ۲۷.۵ B
طهرم ۵۰۱۶ ۶۷۴.۸ B	طهرم ۶۰۲۶ ۱۱۰.۶ B	طهرم ۶۰۲۶ ۲۴.۷ B
طهرم ۶۰۲۸ ۵۶۸.۱ B	طستا ۵۰۳۰ ۹۱.۶ B	طستا ۵۰۳۰ ۱۹.۶ B

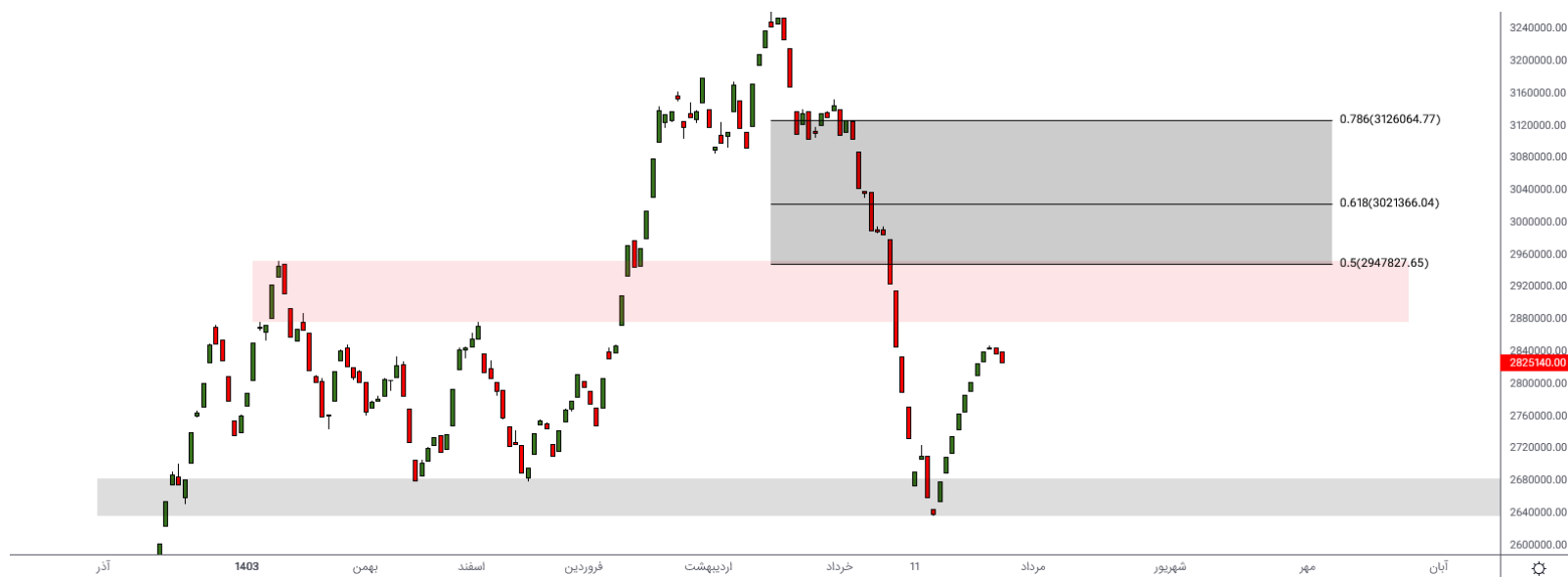


تحلیل تکنیکال هفتگی شاخص کل بورس



تحلیل تکنیکال هفتگی شاخص کل بورس

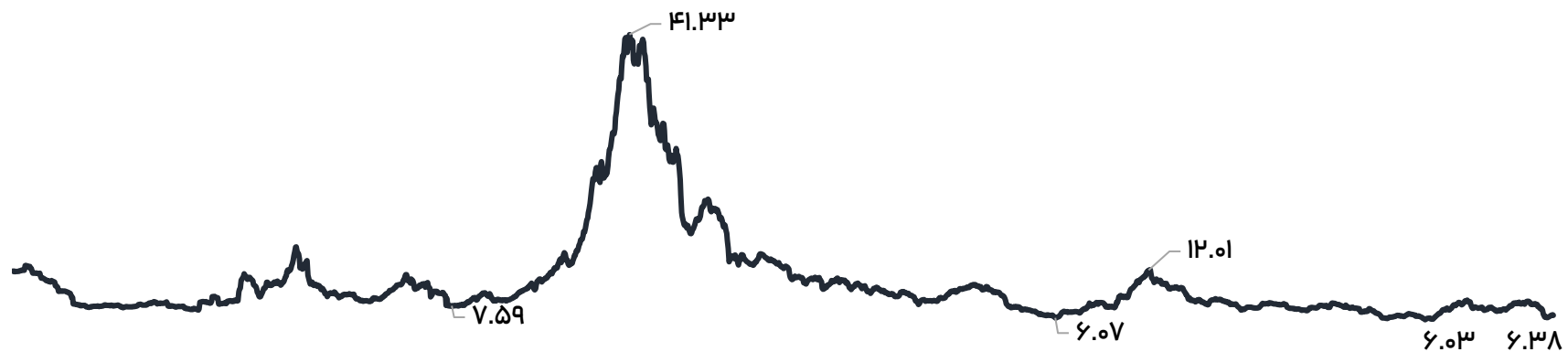
- نمودار تکنیکال شاخص کل بورس در تایم فریم هفتگی را در اسلاید قبل مشاهده کردید. در این اسلاید نیز، از نمای نزدیک تر و در تایم فریم روزانه، نمودار تکنیکال شاخص کل قابل مشاهده است. بعد از تحلیلی که در کف آبان ماه درباره شاخص کل بورس در کانال تلگرام کارگزاری دانایان به نشانی @DanayanBroker منتشر شد، واکنش بسیار خوبی را به محدوده اول اعلامی شاهد بودیم و شاخص کل و کلیت بازار سرمایه روند قدرتمندی را در جهت صعود آغاز کرد. همچنین هدف اولیه شاخص کل، در ادامه تحلیل اولیه در کانال تلگرام کارگزاری دانایان، محدوده ۲ میلیون و ۸۰۰ الی ۹۰۰ هزار واحد اعلام شد که بعد از رسیدن به هدف ذکر شده، و از تاریخ ۵ دی ماه تا انتهای اسفندماه، شاهد اصلاح، بیشتر در قالب زمان و حجم، در بازار سرمایه بودیم.
- در به روزرسانی تحلیل تکنیکال شاخص کل نیز، پس از پایان الگوی اول اصلاحی در شاخص کل که تا اواسط فروردین ماه به طول انجامید، شاهد یک موج صعودی خوب و شکست مقاومت داینامیک ۵ ساله در شاخص کل بودیم که کف این موج اصلاحی نیز در کانال تلگرام کارگزاری دانایان، تحلیل و اعلام شد. پس از موج صعودی آخر اما، کشور با شرایط اضطراری جنگی روبرو شد و بازار بورس اصلاح قیمتی و نسبتاً عمیقی را تجربه کرد. برای انتهای موج اصلاح، هفته پیش در بولتن هفتگی دو محدوده ابتدایی در نظر گرفته شد که محدوده اول بصورت فیک، شکسته شد اما بلافاصله شاخص کل به بالای حمایت شکسته شده بازگشت و حالا بعد از نوسان مثبتی که در بازار شکل گرفت، به نظر می رسد در کوتاه مدت به سمت تست کف تشکیل شده پیش می رویم اما به شرط حفظ کف شکل گرفته در ۲ میلیون و ۶۳۵ هزار واحدی، می توانیم مجدداً شاهد نوسان مثبت در بازار باشیم.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

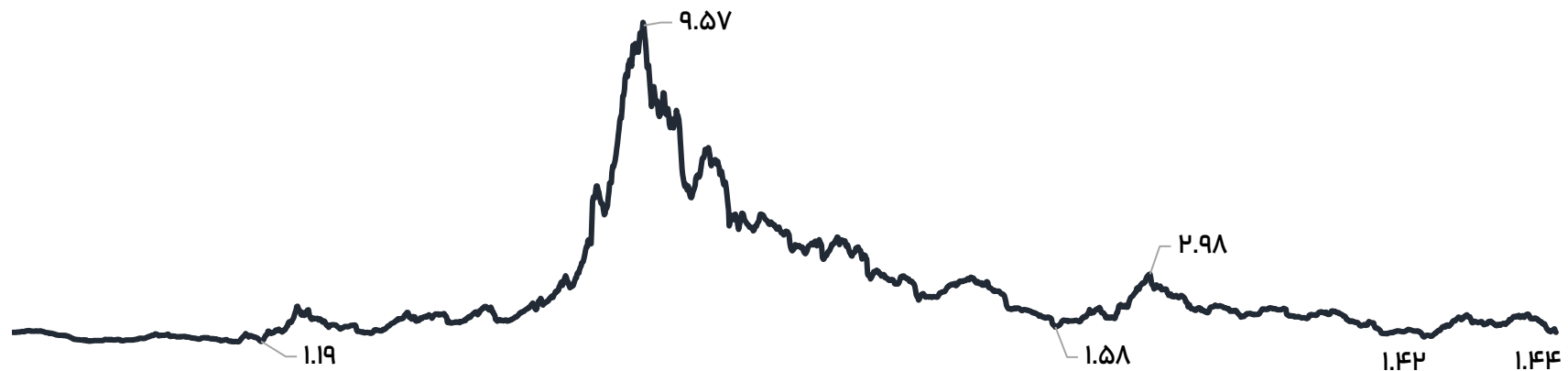
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

روند تغییرات P/E بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



نسبت P/S نیز یکی از مهم‌ترین نسبت‌های مالی بازار برای تحلیل و ارزش‌سنجی سهام است؛ P/S ارزش روز شرکت را با میزان فروش سالیانه مقایسه می‌کند و نشان‌دهنده این است که ارزش شرکت چند برابر فروش آن شرکت است یا قیمت سهم، چند برابر فروش شرکت به ازای هر سهم است.

روند تغییرات P/S بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



تحلیل تکنیکال روند P/E بازار سرمایه

با دقت در نمودار روزانه P/E بازار سرمایه، و در مقیاس لگاریتمی، مشخص است که هر بار نمودار به رسیدن به حوالی ۶ واحد، برگشت خوبی را به سمت بالا داشته که منجر به صعود خوبی در کلیت بازار شده است. اولین بار آبان ماه سال ۱۴۰۱ و سپس آبان ماه سال ۱۴۰۳ که منجر به موج صعودی اخیر شد. با این وجود، بار دیگر شاهد بازگشت نمودار به کانال ۶ واحد بودیم که بار دیگر با حمایت و واکنش مثبت مواجه شدیم. با وجود واکنش مثبت اولیه نمودار به محدوده مد نظر، اما اتمام روند اصلاحی فعلی زمانی تایید می‌شود که خط روند نزولی ترسیم شده با رنگ مشکی، به سمت بالا شکسته شود.



تحلیل تکنیکال روند نسبت P/S بازار سرمایه

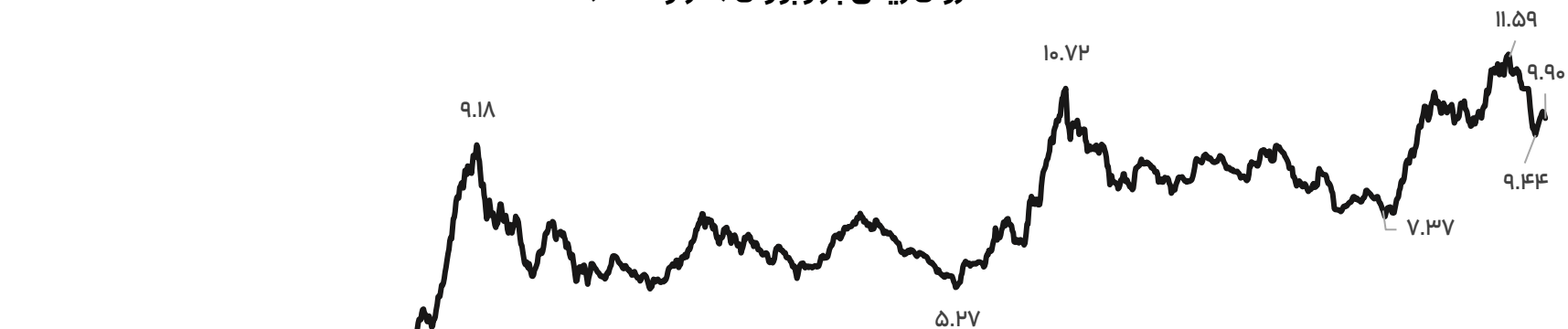
با دقت در نمودار P/S بازار سرمایه، در تایم فریم روزانه و مقیاس لگاریتمی، شاهد ریزش پرشتاب نمودار پس از رخ دادن جنگ ۱۲ روزه هستیم. کف آخر نمودار در آبان ماه سال اخیر در محدوده ۱.۳ واحدی رخ داد و در حال حاضر نیز، در محدوده ۱.۵ قرار داریم که نشان از ارزندگی بازار دارد. تا زمانی که خط روند نزولی در نمودار به سمت بالا شکسته نشود، نمی‌توان اتمام اصلاح را تایید کرد، اما به هر صورت، همواره این گونه بوده است که معامله‌گران پرریسک پیش از گرفتن تاییدیه و در نواحی حمایتی به دید سرمایه‌گذاری و تایید احتمالی اتمام روند نزولی، وارد بازار می‌شوند و حال، در حال نزدیک شدن به حمایت استاتیکی نمودار هستیم.



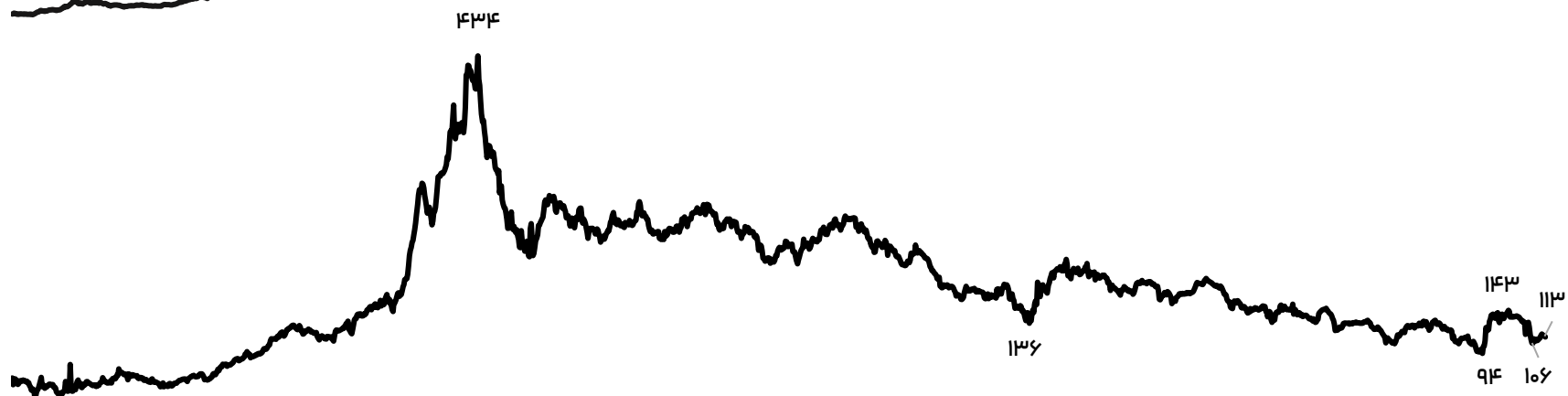
ارزش دلاری و ریالی بازار سرمایه

با وجود رشد ریالی بازار و سقف‌شکنی شاخص کل و شاخص هم‌وزن، اما از لحاظ ارزش دلاری، بازار تقریباً رشدی نداشته و در کف ۵ ساله و بلندمدت خود قرار دارد که می‌تواند به نوعی نشان‌دهنده ارزندگی بازار سرمایه حتی با وجود رشد اخیر باشد. در دو نمودار زیر، روند هشت ساله‌ی ارزش ریالی و دلاری بازار را مشاهده می‌کنید.

ارزش ریالی بازار بورس (هزار همت)



ارزش دلاری بازار بورس (میلیارد دلار)



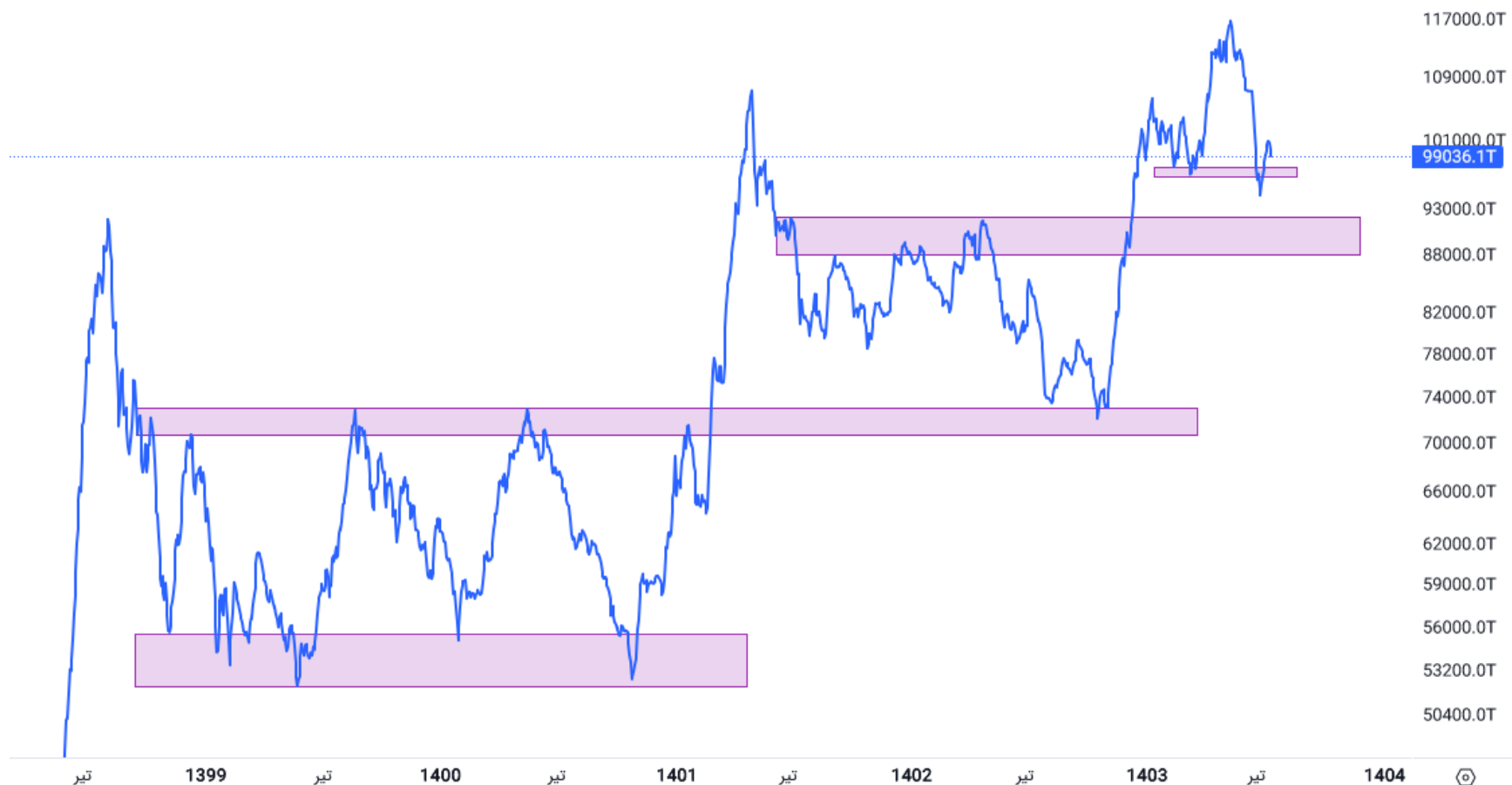
تحلیل تکنیکال روند ارزش دلار بازار سرمایه

با دقت در نمودار ارزش دلار بازار سرمایه، در مقیاس لگاریتمی و تایم فریم هفتگی، از آبان ماه سال گذشته شاهد رشد نسبی نمودار بودیم. با این وجود با توجه به رشد همزمان نرخ دلار در بازار آزاد، رشد بازار سرمایه کاملاً خنثی و پس گرفته شد و حتی کف نمودار نیز در فروردین ماه، به سمت پایین شکسته شد! پس از رسیدن نمودار به کف کانال نزولی ترسیم شده و سطوح پایین تر از سطوح سال ۱۳۹۲ بار دیگر شاهد واکنش مثبت بسیار شارپ به سمت بالا بودیم. واکنشی که نتوانست منجر به شکست سقف کانال شود و بار دیگر شاهد کاهش ارزش دلار بازار بودیم. حال، انتهای نمودار مشکوک به الگوی بازگشتی سروشانه معکوس می باشد و واکنش مثبت اولیه به حمایت استاتیکی هم مشهود است. با این حال، انتهای روند اصلاحی نمودار زمانی تأیید می شود که سقف کانال به سمت بالا شکسته شود.



تحلیل تکنیکال روند ارزش ریالی بازار سرمایه

نمودار ارزش ریالی بازار سرمایه در تایم فریم روزانه و مقیاس لگاریتمی، قابل مشاهده است. نمودار ارزش ریالی بازار، شباهت قابل توجهی به نمودار شاخص کل دارد. پس از آنکه طی موج صعودی آغاز شده از فروردین ماه، سقف تاریخی نمودار شکسته شد، شرایط بحرانی جنگ ۱۲ روزه را داشتیم و مشاهده می شود با ریزش اخیر بازار، کفی که نمودار در فروردین ماه اخیر تشکیل داد، شکسته شد اما مشابه اتفاقی که در شاخص کل افتاد، بلافاصله نمودار، حمایت شکسته شده را پس گرفت. حال با شرط حفظ کف آخر، می توان انتظار تکمیل پولبک به این سطح، و سپس نوسان مثبت از بازار داشت. در غیر این صورت باید منتظر حمایت بعدی مشخص شده روی چارت باشیم.





نقدینگی از ۱۰ هزار همت عبور کرد!

بانک مرکزی بالاخره آمار اسفند ۱۴۰۳ را منتشر کرد که بر اساس این آمار، نقدینگی به رقم بی‌سابقه ۱۰,۱۶۵ همت رسید.



افزایش ضریب اعتبار صندوق‌های اهرمی

بر اساس مصوبات کمیته پایش ریسک بازار با موضوع تعدیل ضرایب اعتباری، از شنبه ۱۴ مردادماه، ضریب اعتباری صندوق‌های اهرمی معادل ۷۰ درصد سهام است.

«طرح مالیات بر سوداگری و سفته‌بازی» در شورای نگهبان تایید شد.

سخنگوی شورای نگهبان: طرح «مالیات بر سوداگری و سفته‌بازی» که در مراحل قبل با ابهامات و اشکالاتی مواجه شده بود، پس از انجام اصلاحات در مجلس شورای اسلامی و بررسی مجدد در شورای نگهبان، مغایر با موازین شرع و قانون اساسی شناخته نشد.



خصدرا

افزایش سرمایه ۹۱۲ درصدی خصدرا از محل مازاد تجدید ارزیابی دارایی‌ها مورد تأیید حسابرس قرار گرفت.

تقسیم سود نقدی

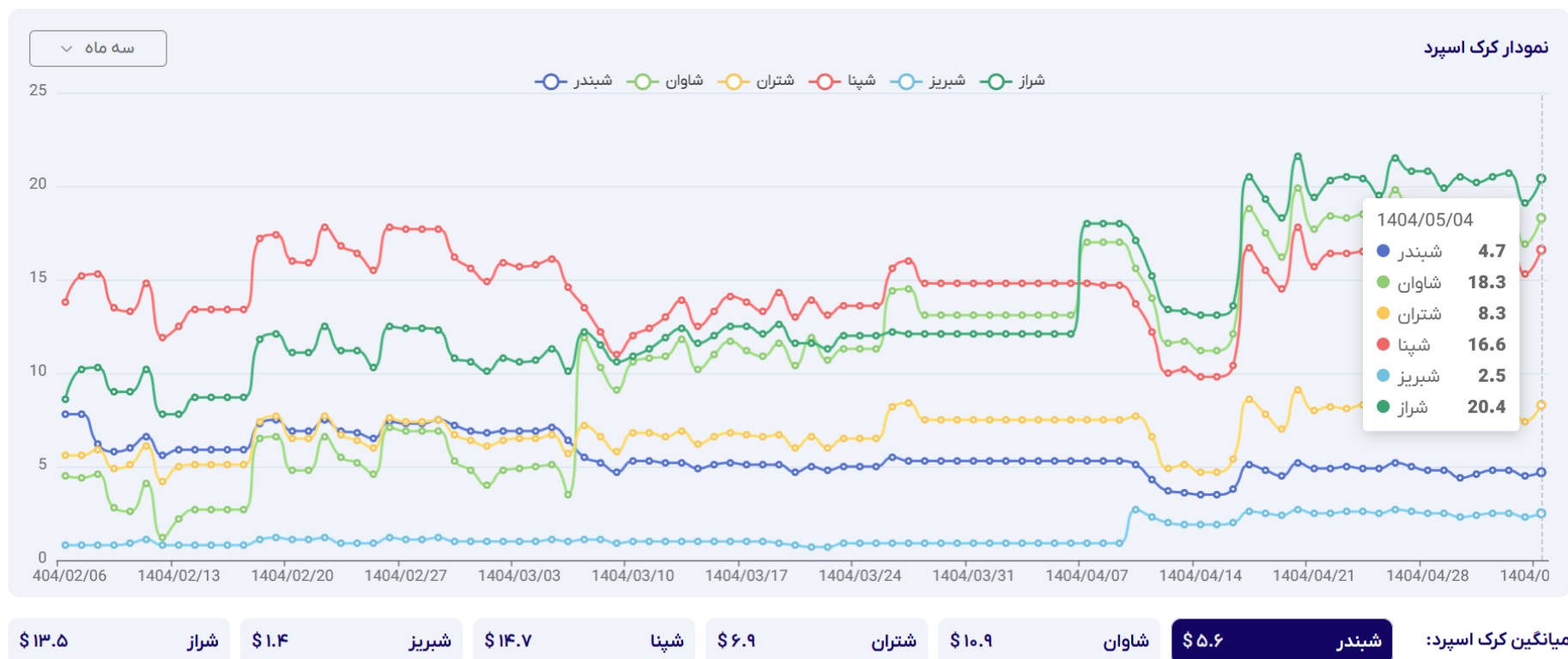
مارون ۸,۳۷۵ ریال
شاراک ۳۰۰ ریال
و خاور ۲۵۰ ریال
وبملت ۹۰ ریال
شپنا ۳۶۰ ریال

امید

افزایش سرمایه ۸۴ درصدی خصدرا از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی و سود انباشته مورد تأیید حسابرس قرار گرفت.



کرک اسپرد پالایشی‌ها

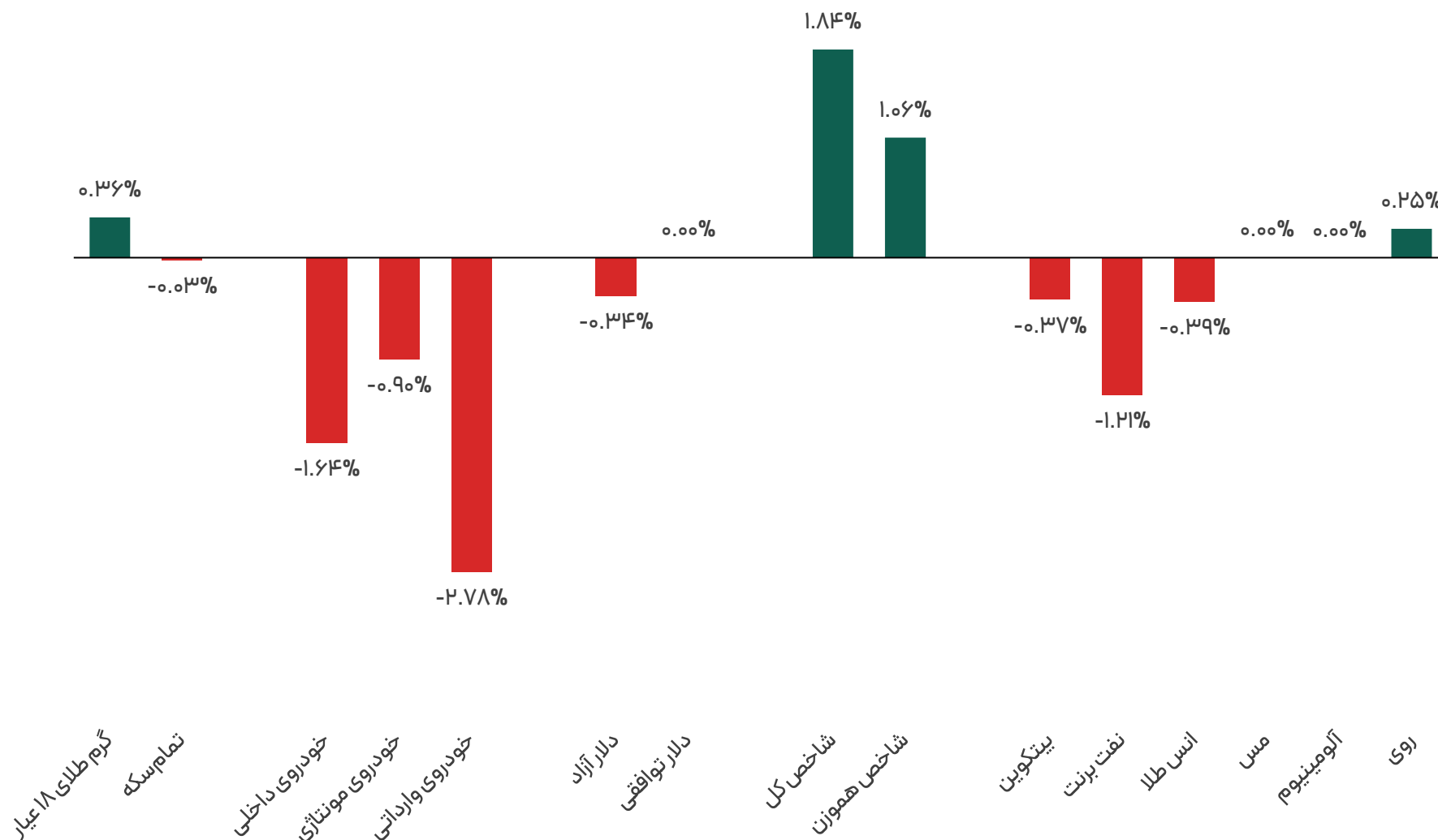


گزارش کامل کرک اسپرد پالایشی‌ها را در سامانه دانافیبو، بخش ابزار کمکی (ابزارهای محاسباتی فیبو) >> محاسبات پالایشگاه‌ها، مشاهده کنید.

ورود به دانافیبو



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

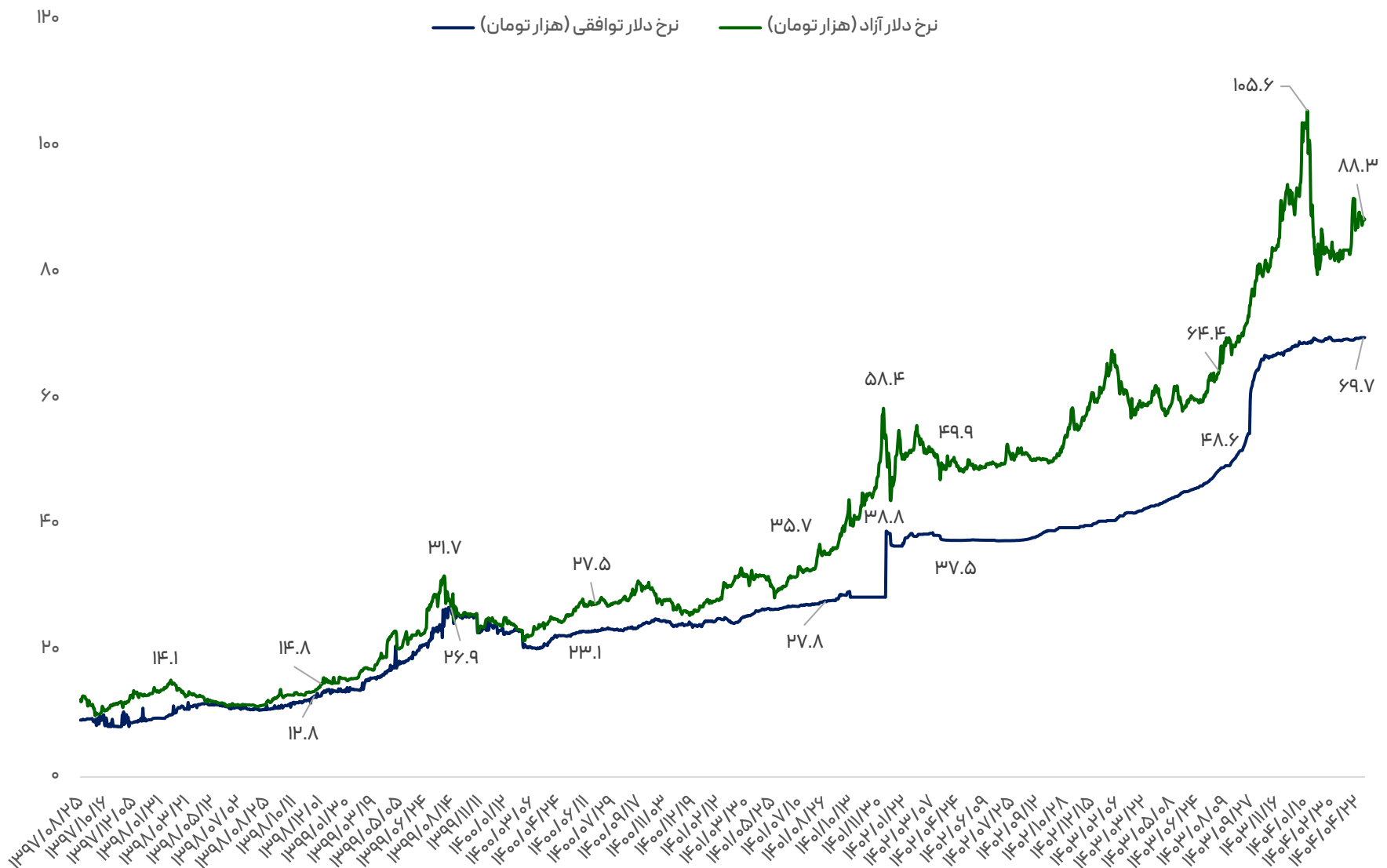


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایپلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی، KMC JV و خودروی وارداتی، نیسان سیلفی مکس در نظر گرفته شده است.



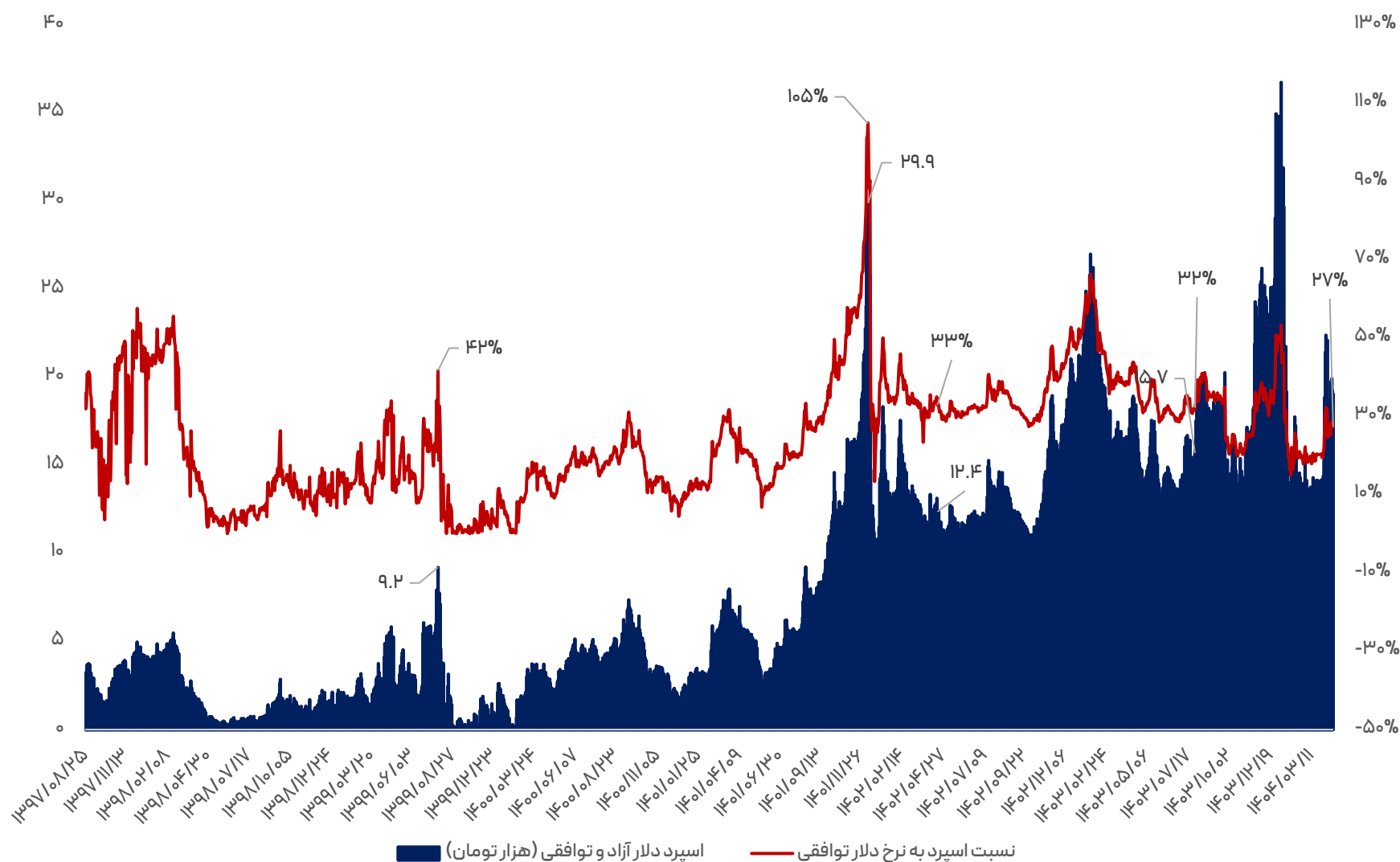
روند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی ثابت بود و در پایان هفته در سطح ۶۹۶,۷۰۱ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

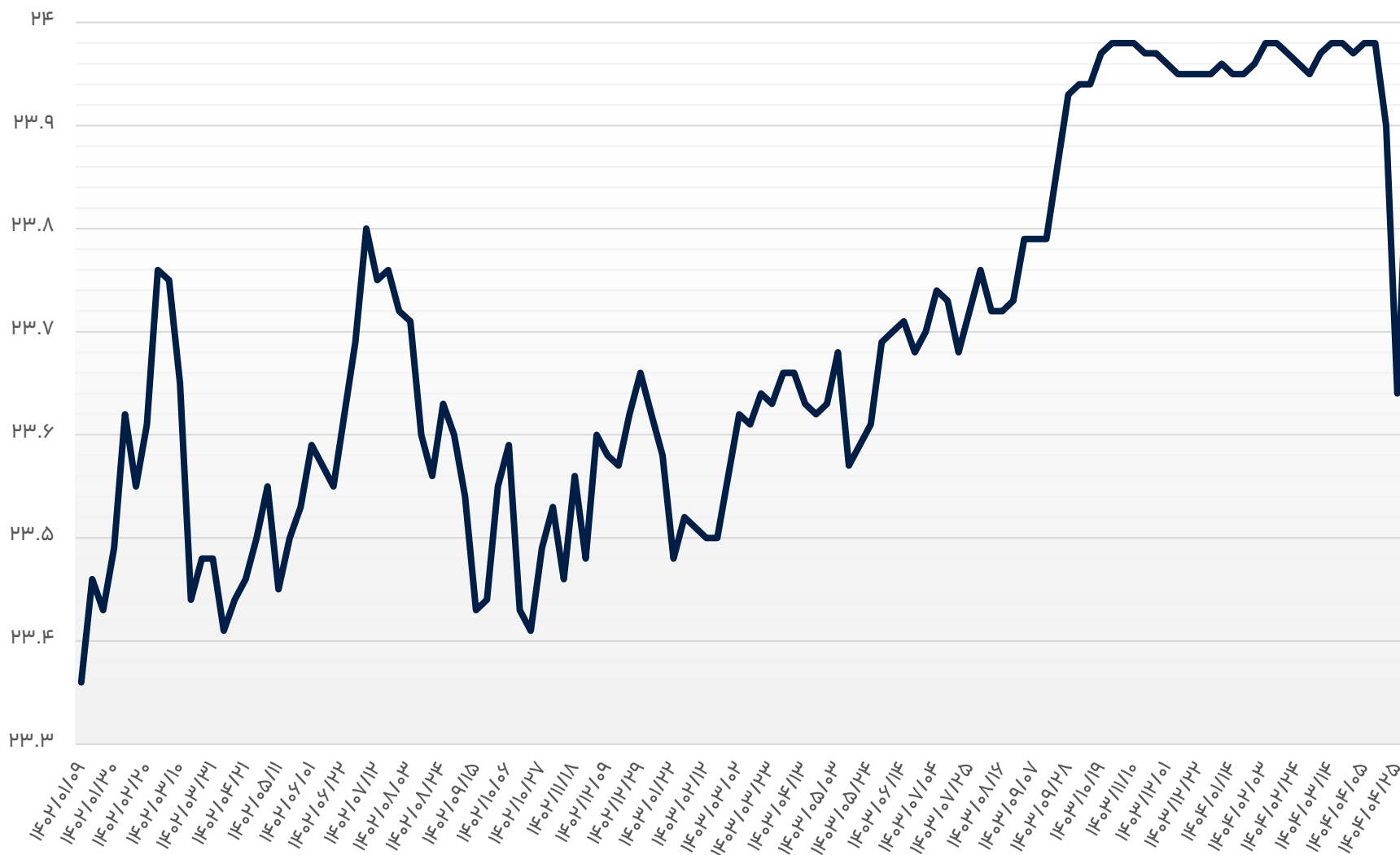
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



نرخ بهره بین بانکی

با اعلام بانک مرکزی، هفته اخیر، نرخ بهره بین بانکی با افزایش ۰.۲۵ درصدی همراه شد و در سطح ۲۳.۸۹ درصدی ایستاد.

در نمودار زیر تغییرات نرخ بهره بین بانکی از ابتدای سال ۱۴۰۲ تا کنون را مشاهده می‌کنید.



شاخص قیمت تولیدکننده بخش برق اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ (بر مبنای سال پایه ۱۳۹۵)

در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده کل بخش برق در دوازده ماه منتهی به اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه در سال قبل ۲۴.۶ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در ماه قبل (۱۹.۳ درصد)، ۵.۳ واحد درصد افزایش داشته است.

شاخص قیمت کل

در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴، شاخص قیمت تولیدکننده بخش برق ۵۵۱.۵ بود که نسبت به ماه قبل (تورم ماهانه) ۱.۴ درصد افزایش، نسبت به ماه مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۷۱.۱ درصد افزایش و در دوازده ماه منتهی به ماه جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل (تورم سالانه) ۲۴.۶ درصد افزایش داشته است.

کاهش تورم ماهانه

در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده کل بخش برق نسبت به ماه قبل (تورم ماهانه) ۱.۴ درصد بوده که در مقایسه با همین اطلاع در ماه قبل (۲۹.۵ درصد)، ۲۸.۱ واحد درصد کاهش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط نیروگاه‌های برق به ازای فروش محصول خود به شرکت‌های توزیع برق، در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به ماه قبل، ۱.۴ درصد افزایش دارد. در ماه مورد بررسی، تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش برق نسبت به ماه قبل، برای ساعات مختلف اوج بار، میان بار و کم بار، به ترتیب ۳.۷-، ۳.۸ و ۰.۴ درصد بوده است.



افزایش تورم نقطه به نقطه

در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده کل بخش برق نسبت به ماه مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۷۱.۱ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در ماه قبل (۶۵.۲ درصد)، ۵.۹ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط نیروگاه‌های برق به ازای فروش محصول خود به شرکت‌های توزیع برق، در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۷۱.۱ درصد افزایش دارد. تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش برق در ماه مورد بررسی نسبت به ماه مشابه سال قبل، برای ساعات مختلف اوج بار، میان بار و کم بار، به ترتیب ۶۴.۰، ۷۱.۰ و ۷۶.۱ درصد بوده است.

افزایش تورم سالانه

در اردیبهشت ماه ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده کل بخش برق در دوازده ماه منتهی به اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه در سال قبل ۲۴.۶ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در ماه قبل (۱۹.۳ درصد)، ۵.۳ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط نیروگاه‌های برق به ازای فروش محصول خود به شرکت‌های توزیع برق، در دوازده ماه منتهی به اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به دوره مشابه در ماه قبل، ۲۴.۶ درصد افزایش دارد. همچنین تغییرات میانگین شاخص قیمت تولیدکننده بخش برق در دوازده ماه منتهی به اردیبهشت ماه ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه در سال قبل، برای ساعات مختلف اوج بار، میان بار و کم بار، به ترتیب ۲۴.۶، ۲۴.۹ و ۲۴.۳ درصد بوده است.



با سپاس از توجه شما

