

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۲۳ آبان ماه ۱۴۰۴



دیدگاه دانایان

هفته گذشته، بازار با افزایش عرضه همراه شد. نیمه اول هفته موج عرضه شدیدتر بود اما در انتهای هفته و به خصوص روز چهارشنبه، کمی از فشار عرضه کاسته شد و بازار با امیدواری به استقبال معاملات هفته بعد رفت. عملکرد هفتگی شاخص‌های بازار هم منفی بود. به طوری که شاخص کل و شاخص هموزن به ترتیب با کاهش سه و دو درصدی همراه شدند.

برایند گردش حقیقی‌ها در معاملات خرد بازار سهام نیز هفته پیش منفی بود و حدود ۴ همت پول حقیقی از معاملات خرد بازار سهام خارج شد. در مجموع دو هفته اخیر، حدود ۷ همت خروج پول حقیقی از معاملات خرد بازار سهام رقم خورده است! در سوی مقابل در صندوق‌های درآمد ثابت حدود ۲ همت ورود پول به ثبت رسید که نشان از که نشان از احتیاط بیشتر فعالان بازار نسبت به بازار سهام طی هفته گذشته است. طی دو هفته اخیر حدود ۵ همت پول حقیقی به صندوق‌های درآمد ثابت وارد شده است.

به لحاظ تکنیکالی نیز، هفته گذشته شاخص کل با رسیدن به محدوده ۳ میلیون و ۱۰۰ هزار واحدی، کمی آرام گرفت و با افزایش نسبی تقاضا همراه شد که باید دید این واکنش مثبت، یک واکنش موقت بوده یا در معاملات هفته بعد، ادامه خواهد یافت.

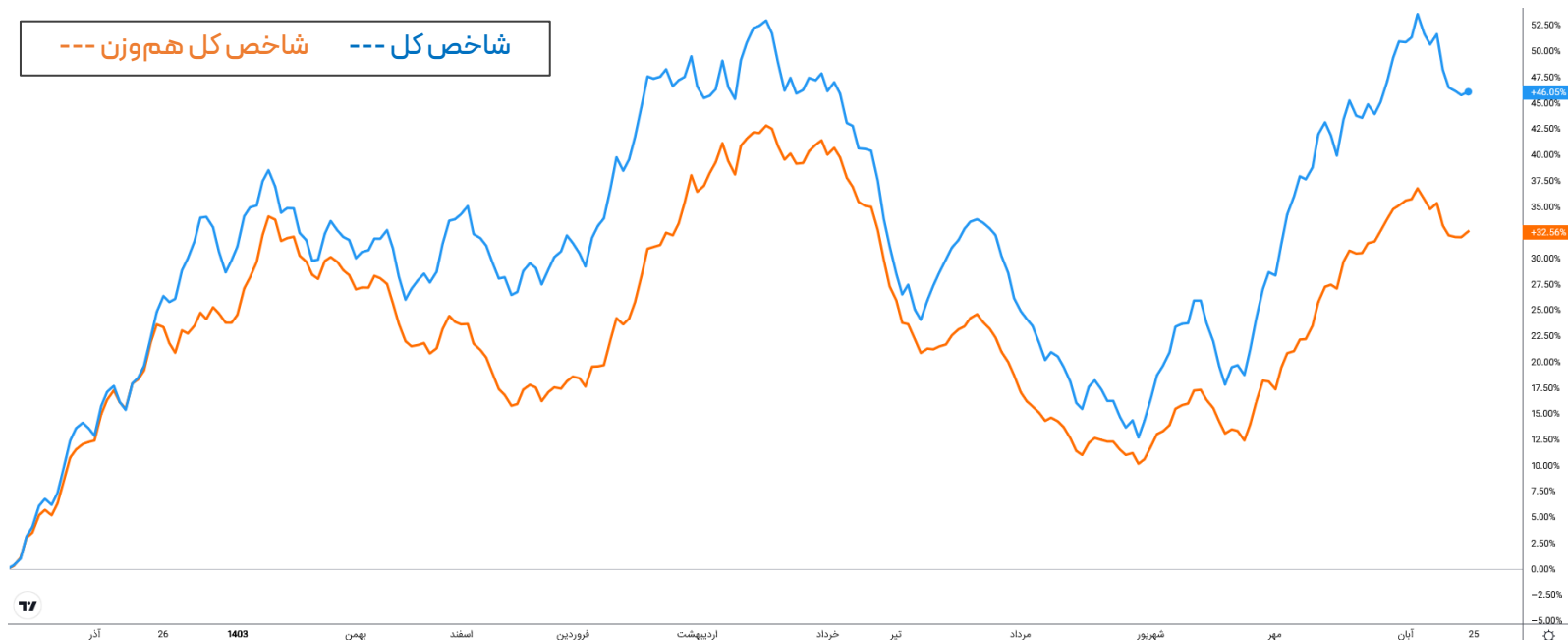
پارامترهای نقدینگی روند اصلاحی کوتاه مدت بازار را تایید کرده اند. ارزش معاملات خرد کاهشی شده و زیر ۱۰ همت به ثبت رسیده و کراس نزولی بین میانگین های متحرک ارزش معاملات خرد، رخ داده است. فلذا برای شکل گیری روند مطمئن و پایدار تقاضا، باید دوباره شاهد شکل گیری تاییدیه های مثبت، شامل افزایشی شدن ارزش معاملات خرد، تثبیت مقدار روزانه آن بر فراز ۱۰ همت و بازگشت پول های حقیقی خارج شده از معاملات خرد بازار سهام باشیم.

در بازار طلا اما، هفته گذشته شاهد ثبت رکورد و سقف قیمتی جدید بودیم. نیمه اول هفته رشد نرخ انس جهانی طلا و بازگشت به بالای ۴ هزار دلار، و نیمه دوم هفته افزایش نرخ دلار در بازار آزاد تا سطوح ۱۱۳ هزار تومان، محرک افزایش تقاضا در بازار طلای داخلی شدند و گرم طلا تا سطح ۱۱.۵ میلیون تومان افزایش یافت! بنابراین، تا زمانی که محرک بازار طلای داخل، رشد نرخ دلار در بازار آزاد باشد، نمی توان روندهای اصلاحی عمیقی را برای آن متصور بود.

بازار سرمایه در هفته‌ای که گذشت	گزارش جامع صندوق‌ها	گزارش هفتگی بازار اختیار	داده‌های کلان بازار سرمایه	اخبار و فاندامنتال	اقتصاد کلان
۱-۹	۱۰-۱۵	۱۶-۱۷	۱۸-۲۵	۲۲-۲۴	۲۵-۳۰

عملکرد شاخص کل و شاخص کل هم وزن

در تصویر زیر، عملکرد مقایسه‌ای شاخص کل و شاخص کل هم وزن در یک نمودار قابل مشاهده است. مشخص است که طی دوره زمانی یک ساله‌ی اخیر، عملکرد شاخص کل هم در دوره‌های رکود و هم در دوران رونق، در مجموع کمی بهتر از شاخص هم وزن بوده است. در رشد اخیر بازار که از پاییز سال گذشته آغاز شد و تا دی‌ماه سال گذشته ادامه یافت شاخص کل نسبت به شاخص هم وزن صعود پرشتاب‌تری را تجربه کرد. همچنین در لگ اول از روند اصلاحی پس از آن نیز، شاخص کل، بیشتر اصلاح را در قالب زمان تجربه کرد در حالی که شاخص کل هم وزن بیشتر در قالب قیمت اصلاح کرد. با این وجود، در لگ دوم ریزش، ریزش پرشتاب‌تری از سوی شاخص کل، نسبت به شاخص هم وزن رخ داد و بازده دو شاخص را به هم نزدیک‌تر کرد؛ در نهایت اما در حرکت اخیر بازار بار دیگر شاهد عملکرد بهتر شاخص سازان و شاخص کل، نسبت به شاخص هم وزن بودیم که مجموع اتفاقات اخیر، باعث عملکرد بهتر شاخص کل در مجموع یک سال اخیر نسبت به شاخص هم وزن شد.



دوره زمانی	یک هفته	یک ماهه	سه ماهه	شش ماهه	یک ساله
بازده شاخص کل	-۳.۲۵%	+۱.۸۶%	+۲۳.۴۵%	+۰.۲۵%	+۴۶.۰۵%
بازده شاخص کل هم وزن	-۲.۰۰%	+۳.۷۶%	+۱۷.۲۵%	-۴.۳۹%	+۳۲.۵۶%



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

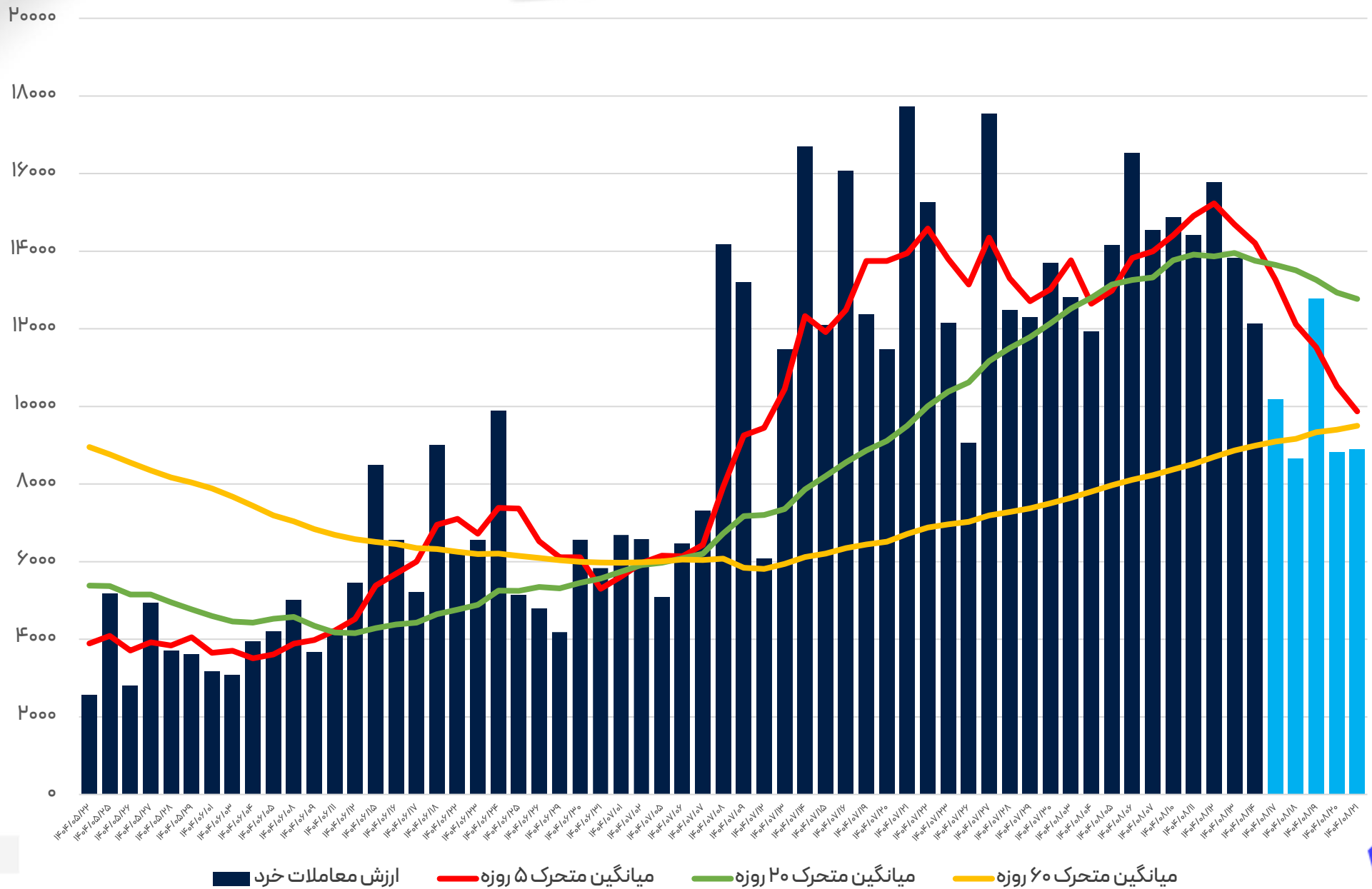
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل 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 هم وزن، نمودار نسبی فوق به سطح مهمی واکنش داد و پس از آن موفق به شکست خط روند نزولی چندماهه شد. با این وجود، نتوانست بر فراز خط روند نزولی اولیه باقی بماند و با توجه به عملکرد بهتر شاخص‌سازان در مدت اخیر، شاهد بازگشت نمودار به حوالی کف قبل هستیم. حال، شاهد واکنش مثبت نمودار طی روزهای اخیر به محدوده کف قبلی بوده‌ایم و در ادامه، در صورت شکست خط روند ترسیم شده بر روی چارت به سمت بالا، می‌توانیم در زمستان شاهد بازده و عملکرد بهتر سهام کوچک‌تر 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.

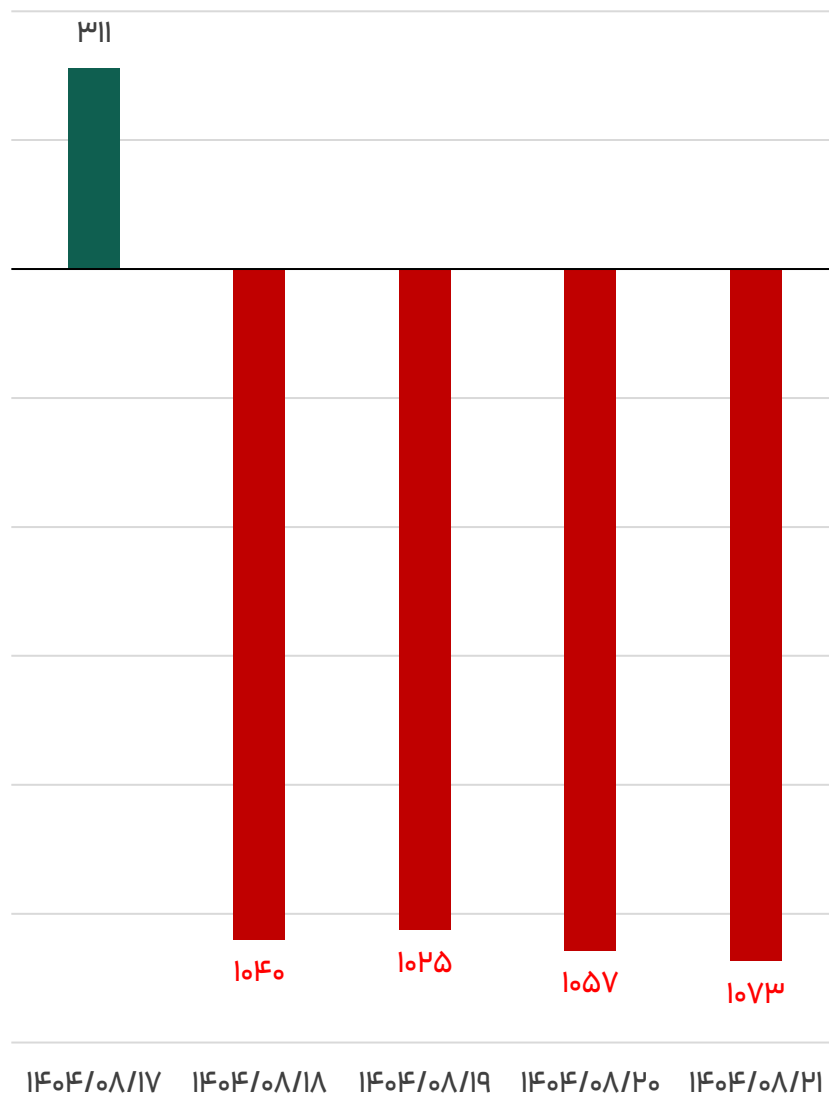


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

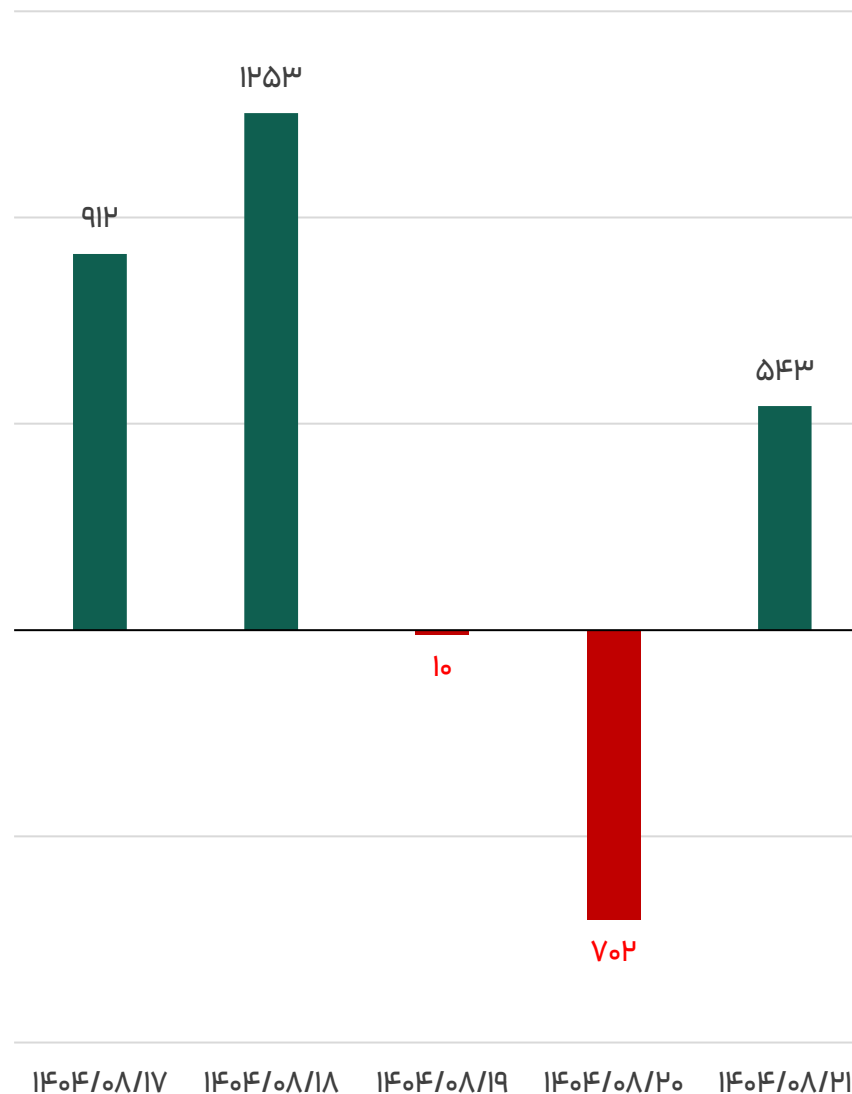


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

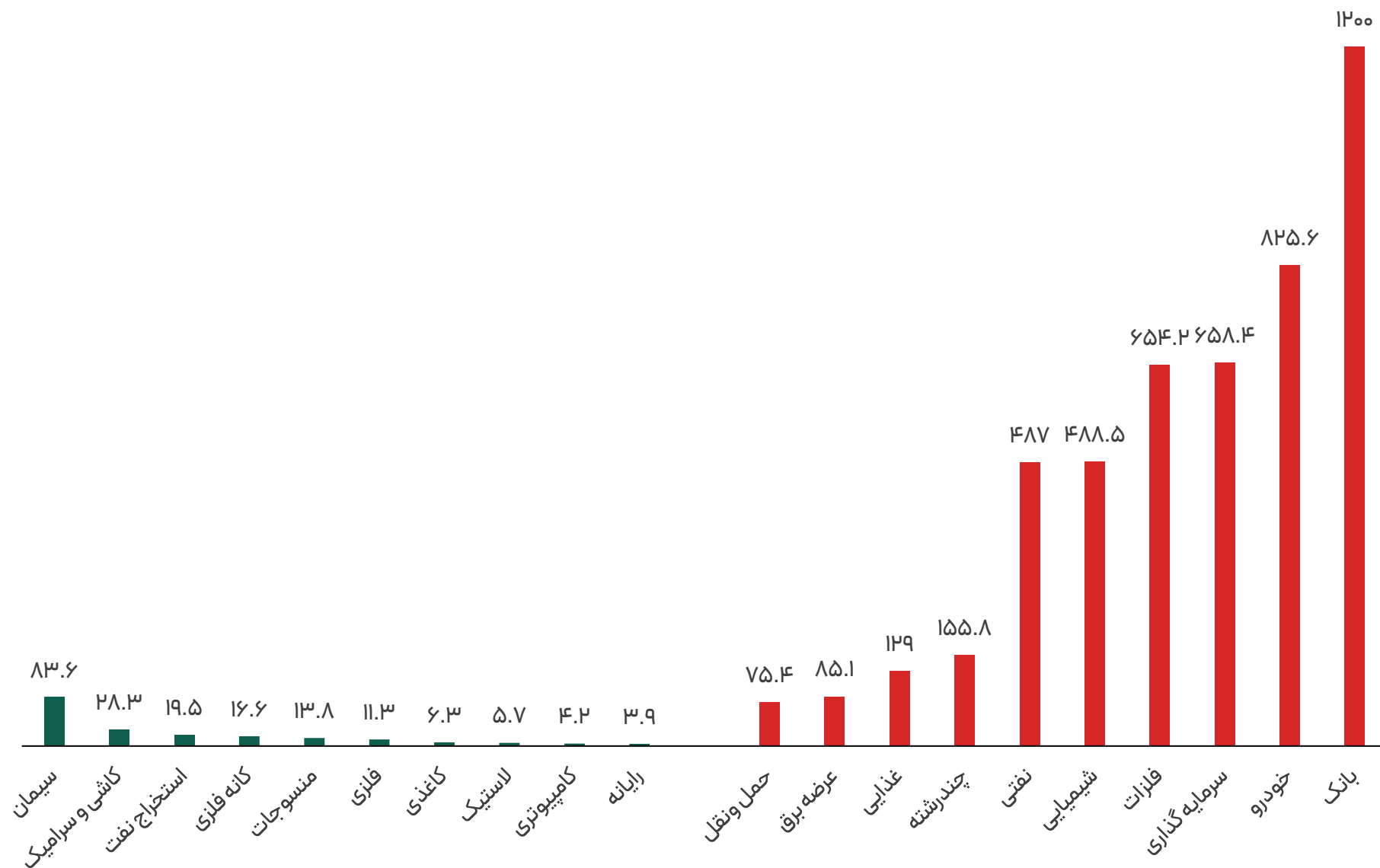
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



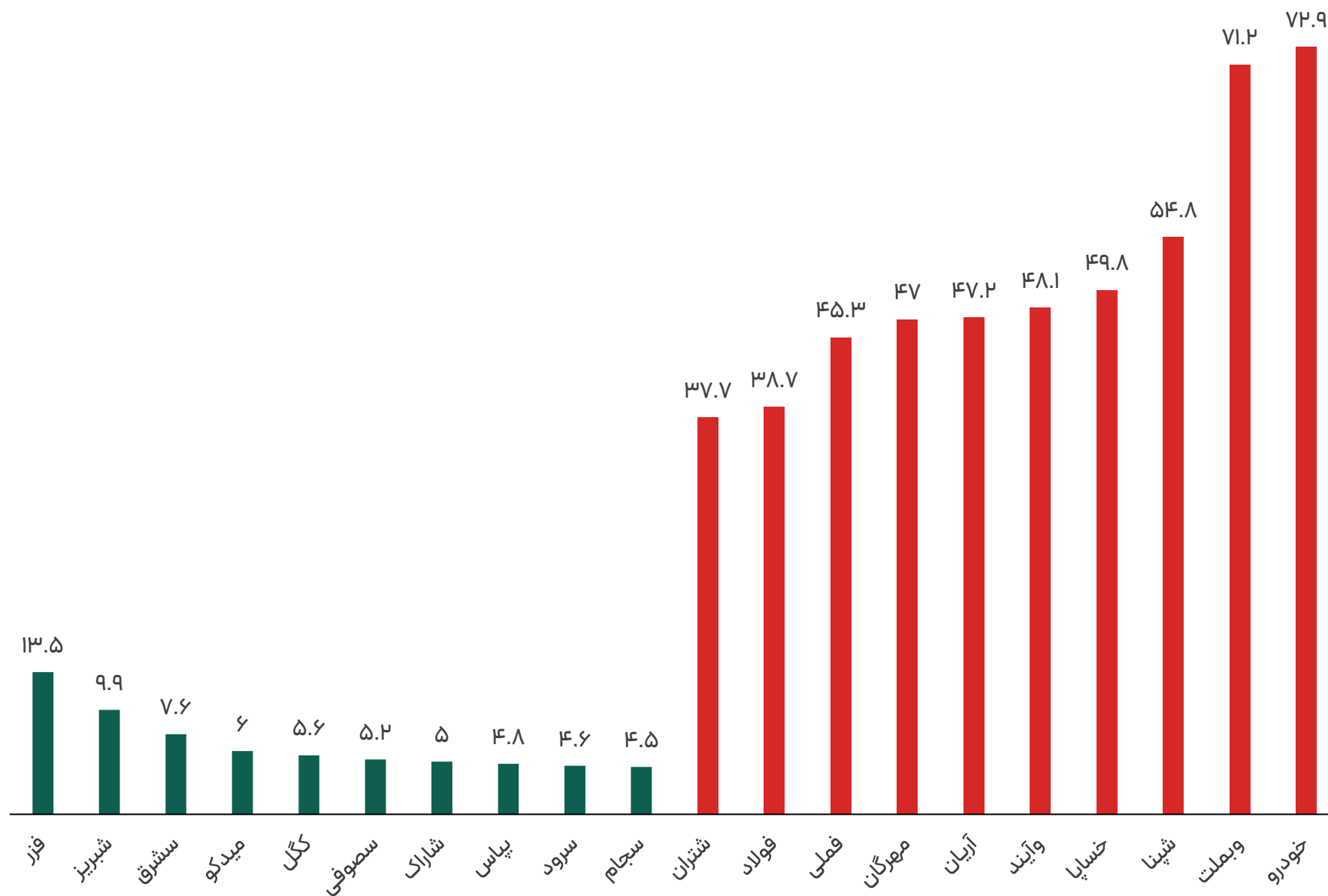
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



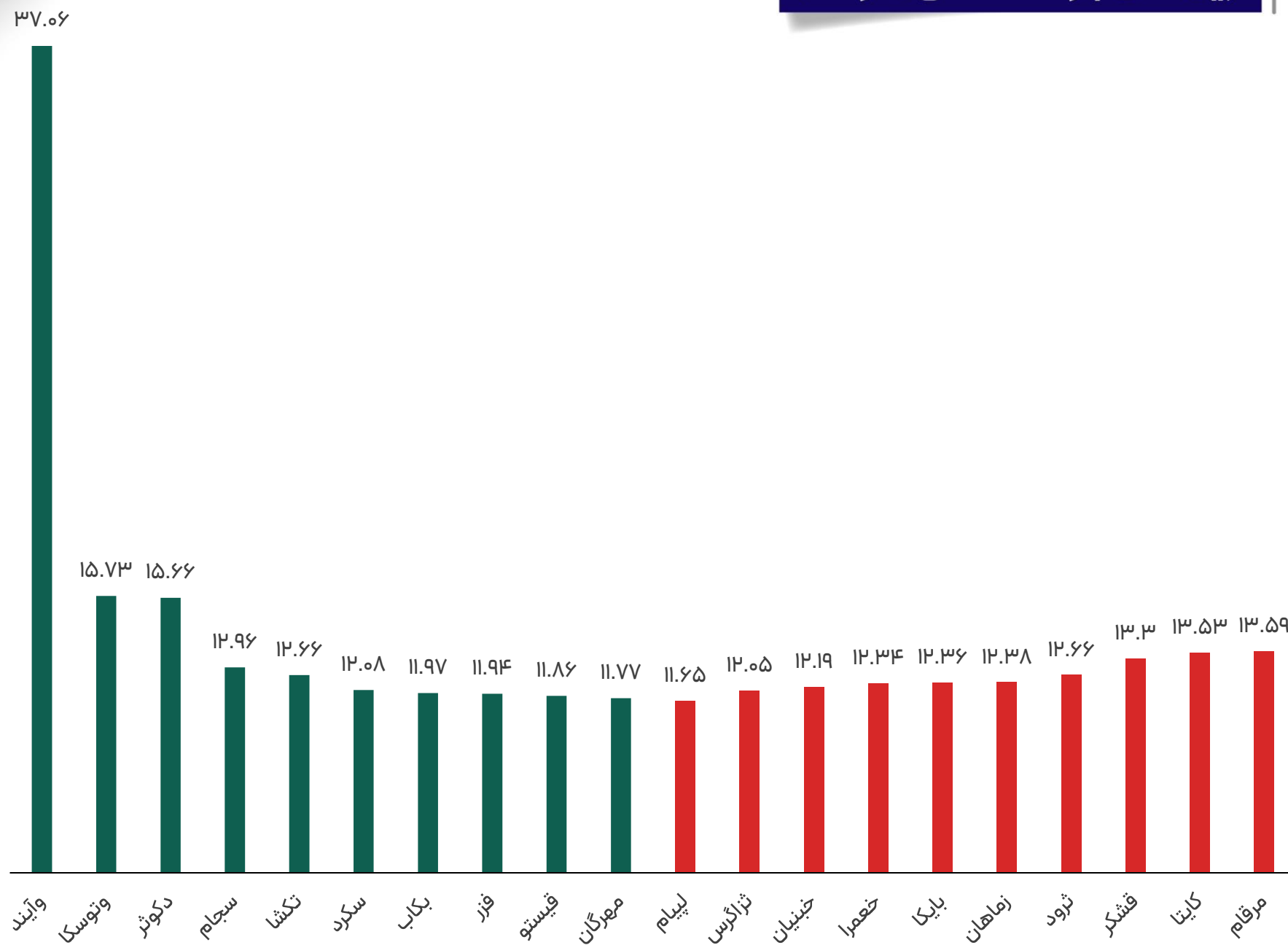
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)

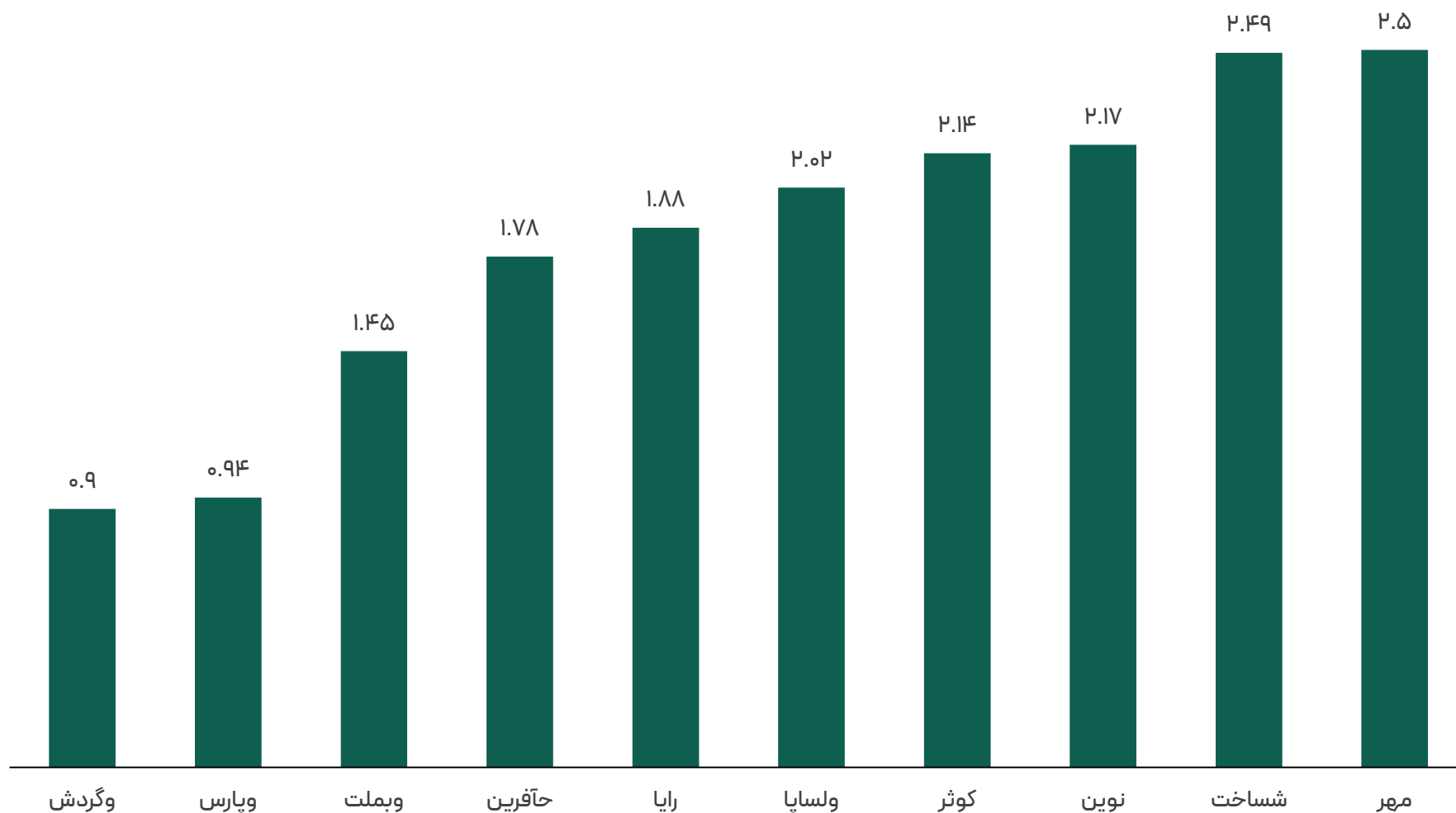


دسته بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر نماد | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نماد



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 ↓	میانگین حباب		ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل	بازدهی	
		یک ماهه	سه ماهه					سه ماهه	سالانه
 دوایکس	-۱.۳۴	۱.۵۲	۱.۰۸	۲.۳۶	۰.۹۱	۲.۱۵	۲.۱۸	۶۳.۵۵	-۲۳.۵۱
 پیشران	-۳.۲۵	-۴.۲۷	-۲.۷۹	۱.۸۸	۰.۹۱	۱.۷۱	۱.۷۷	۳۵.۴۲	۱.۵۷
 اهرم	-۳.۵۸	-۲.۶۵	-۲.۹۳	۲.۰۸	۰.۸۵	۱.۷۷	۱.۸۳	۴۸.۵۱	۴۳.۴۷
 موج	-۳.۶۳	-۱.۹۲	-۳.۷۴	۲.۳۴	۰.۹۶	۲.۲۵	۲.۳۳	۶۶.۹۵	۷۹.۰۶
 نارنج اهرم	-۵.۳۹	-۱.۸	-۴.۷۲	۲.۲	۰.۹۴	۲.۰۷	۲.۱۸	۶۷.۶۶	۸۱.۸۱
 بیدار	-۹.۴۸	-۷.۵۴	-۷.۴	۲.۰۹	۰.۸۴	۱.۷۶	۱.۹۳	۵۷.۷۱	۷۸.۵۴
 جهش	-۹.۷۳	-۸.۰۹	-۷.۱۶	۲.۳۶	۰.۷۹	۱.۸۶	۲.۰۴	۶۴.۰۲	۴۹.۴۲
 توان	-۹.۹	۲.۸۷	-۷.۰۳	۲.۳۴	۰.۸۳	۱.۹۴	۲.۱۳	۵۶.۹۸	۳۲.۴
 شتاب	-۱۰.۱۵	-۷.۱۹	-۶.۹۲	۲.۵	۰.۷۸	۱.۹۵	۲.۱۵	۶۵.۴۶	۵۲.۷۱

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



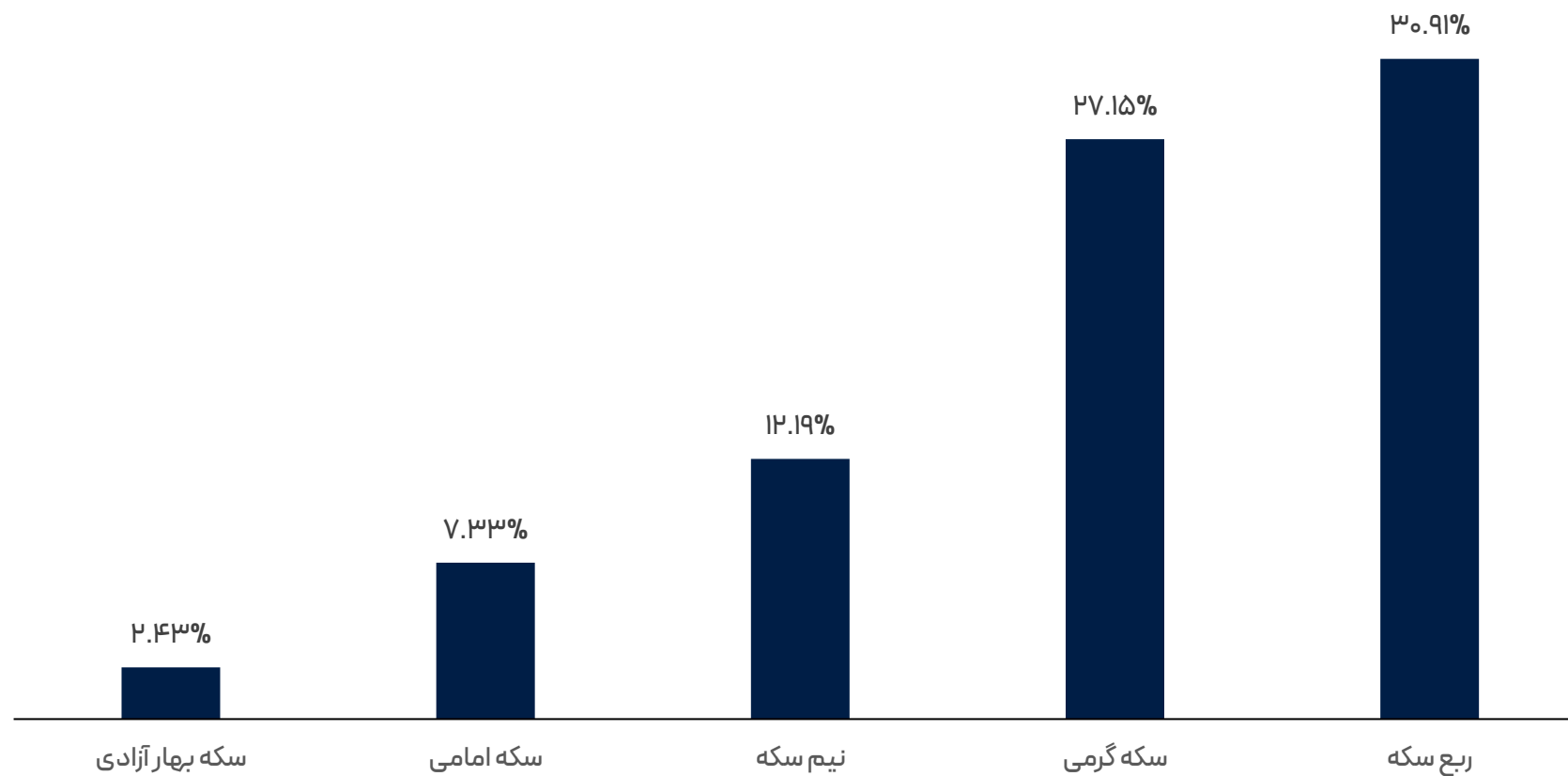
گزارش صندوق‌های طلا



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



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)

نماد	بازدهی			میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه		یک ماهه	سه ماهه
ک فراز 	۱۰.۶	۲۴.۱۶	۴۶.۹۲	۰.۴	۰.۴۹	۷.۲	۳.۴۸	۲.۹۹
رونق 	۹.۱۲	۲۱.۵۱	۱.۷	۰.۳۸	۰.۴۴	-۴.۷	-۵.۵۳	-۴.۸۷
رماس 	۸.۹۸	۲۲.۸۳	۱۰.۳۶	۰.۰۷	۰.۰۴	۳.۸۱	-۱.۸۳	-۱.۱۳
صدف 	۷.۱۱	۳۱.۷۸	۸۵.۲۹	۰.۲۷	۰.۳۱	۱.۲۵	-۰.۵۳	-۰.۶
درسا 	۶.۹	۲۰.۳۶	۴۳.۵۲	۰.۰۶	۰.۱۲	-۶.۲۵	-۴.۱۹	-۳.۱۵
دی سهام 	۶.۴۳	۲۶.۳۲	-۸۰.۵۸	۰.۰۹	۰.۷۲	۰.۵	۰.۲۷	۰.۱۹
ثهام 	۵.۹۲	۲۴.۹۴	۵۷.۷۶	۱.۷۶	۳.۴۸	۰.۳۱	۰.۰۵	-۰.۱۵
وبازار 	۵.۸۸	۳۴.۴	۵۰.۳۵	۱.۸۵	۱.۸۱	-۰.۱۵	-۰.۵۷	-۴
عرش 	۵.۸۴	۲۱.۱۸	۱۸.۱۱	۴.۶۴	۳.۰۱	۰.۲۷	-۳.۵۸	-۷.۲۳

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



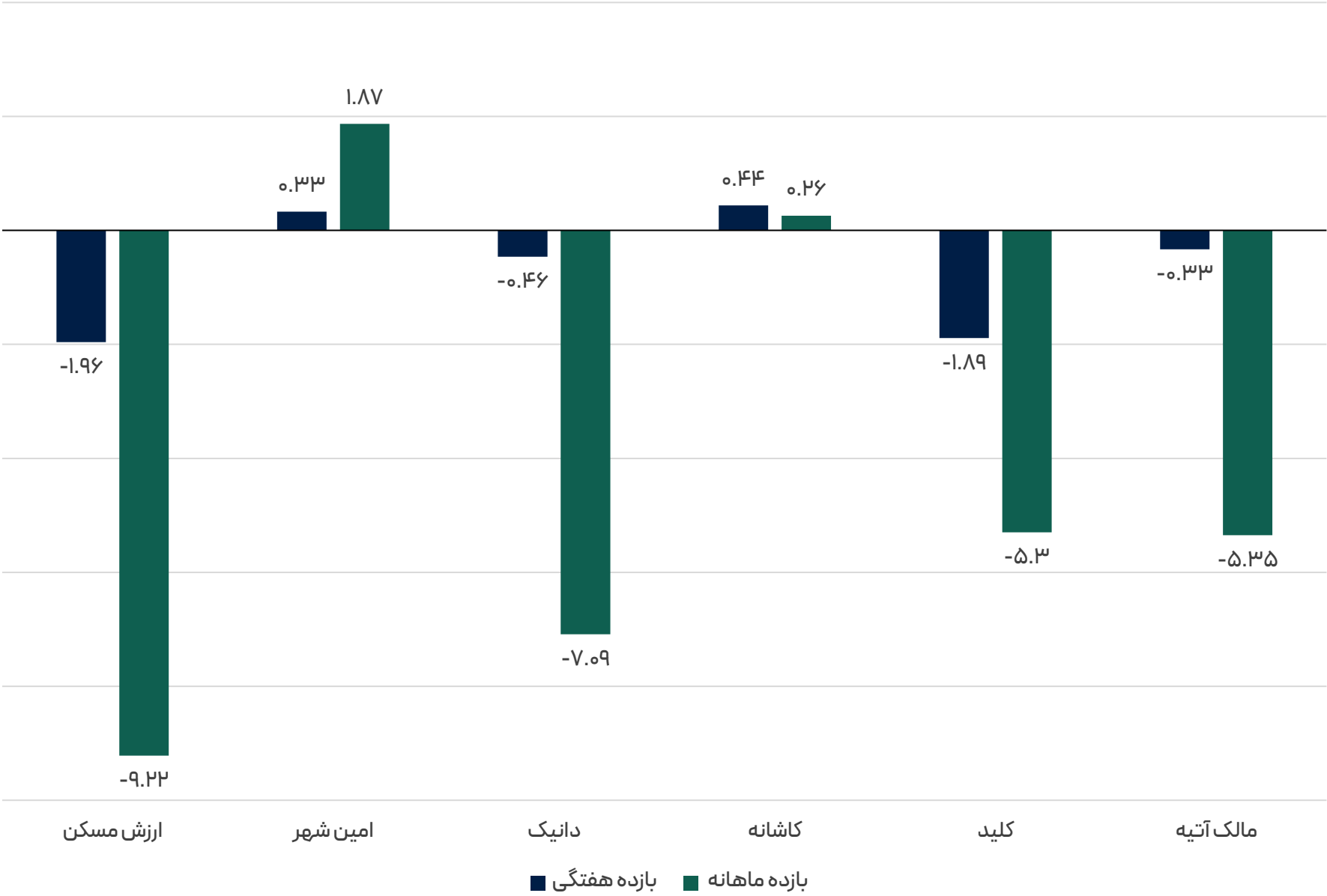
بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی			میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه		یک ماهه	سه ماهه
نمک 	۱۵.۲۸	۳۷.۵۶	۳۲.۷۷	۸.۵۳	۴.۱۹	۰.۷۴	۰.۰۹	-۰.۱۱
پالایش 	۱۴.۸۶	۶۲.۸۲	۸۱.۷۷	۴۵۴.۹	۳۳۶.۳۲	-۱۰.۷۸	-۱۲.۰۴	-۱۶.۶۷
سورنافود 	۱۳.۷۸	۳۰.۵	۲۶.۷۵	۱.۰۳	۱.۹۱	۰.۴۴	۰.۰۴	-۰.۰۳
فارما کیان 	۱۲.۰۳	۲۸.۱۶	۳۲.۳۶	۲۰.۳۴	۱۳.۳۸	-۰.۳۸	-۰.۴۷	-۰.۹۱
فرا الگوریتم 	۱۰.۷۳	۳۵.۰۸	۲۹	۰.۴۵	۰.۴۱	-۰.۱۹	-۰.۲۳	-۰.۵
فارمانی 	۱۰.۲۷	۲۵.۰۵	۱۳.۸	۲.۱۹	۱.۶	-۰.۲۴	-۰.۳۳	-۰.۳۱
بازیمه 	۹.۲۸	۱۹.۰۳	۴۸.۳۷	۴.۶۵	۱.۷۳	۰.۹۶	۰.۰۴	۰.۶۸
فلزا 	۹.۰۵	۴۰.۱۹	۲۶.۴۵	۱۰.۱۱	۸.۱۸	۰.۶۱		-۰.۵۷
دایب 	۹.۰۱	۳۴.۷۳	۲۴.۶۵	۱۳.۱۱	۷.۱۵	۰.۵۸	۰.۰۴	۰.۰۹

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



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



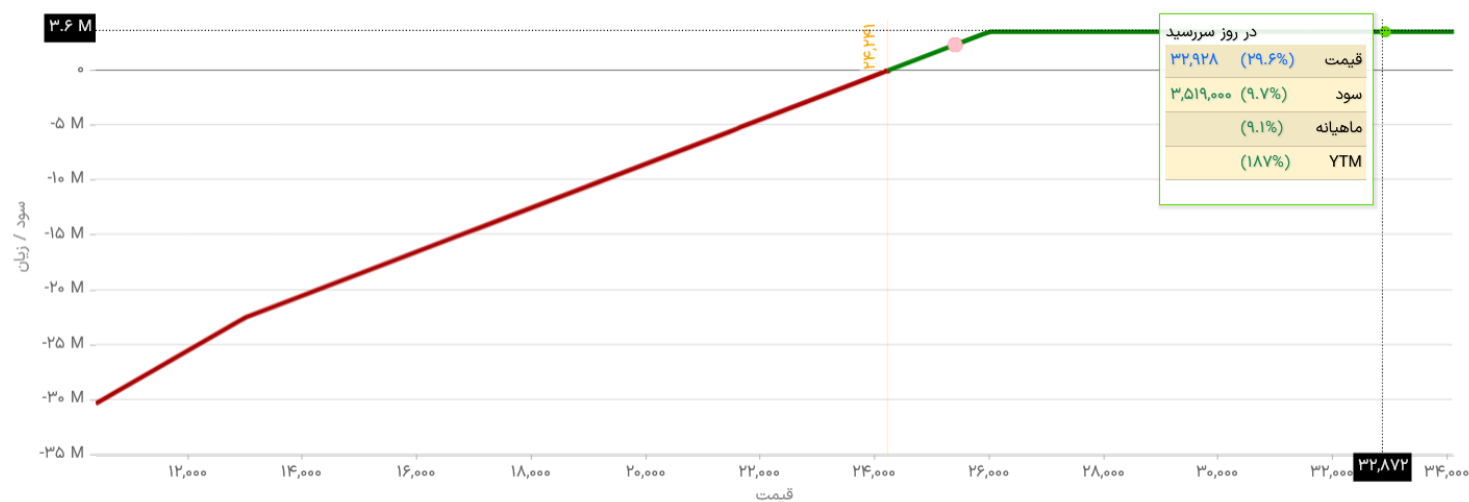
گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

مروری بر استراتژی استرانگل فروش روی قراردادهای برج ۸ صندوق اهرم (پیشنهاد شده در بولتن هفتگی منتهی به ۲۸ شهریورماه ۱۴۰۴)

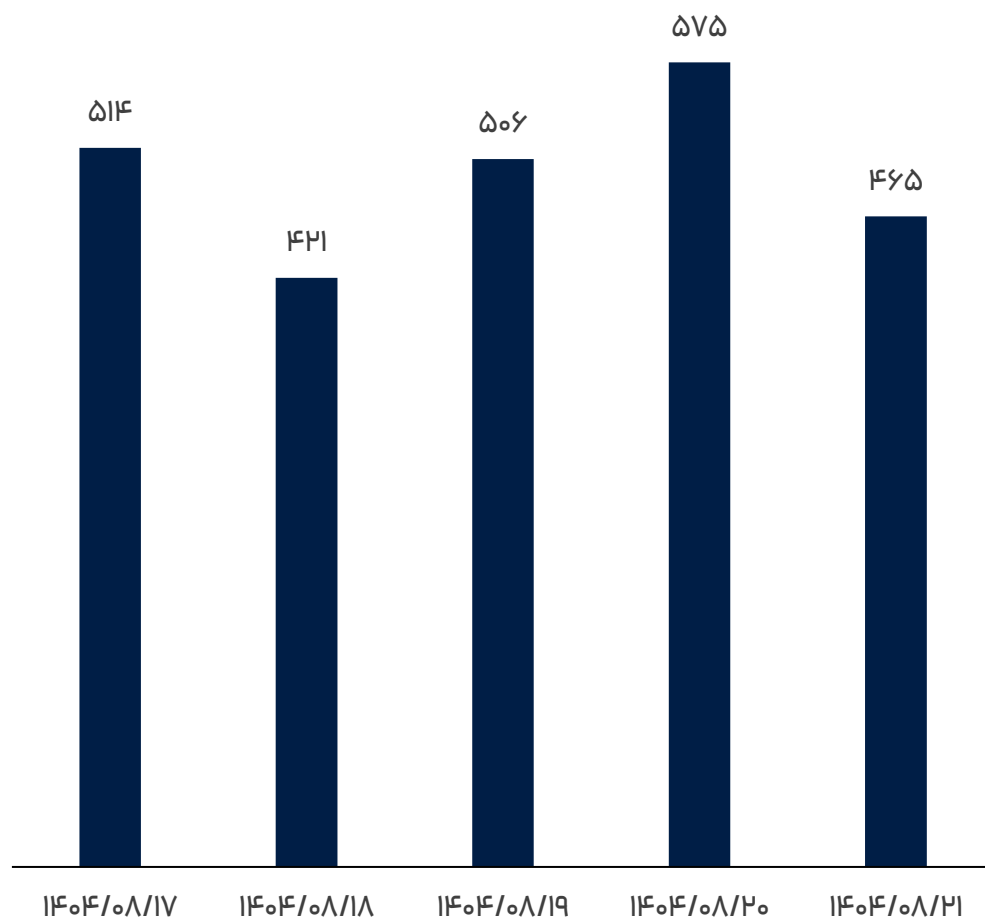
این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش‌ها و اختیار خریدهای در زیان صندوق اهرم (طهرم ۸۰۱۲ و ضرهم ۸۰۲۰) با قیمت‌های روز، انجام می‌شد و چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم (نماد پایه) در بازه قیمتی ۲۶,۴۷۴ و ۱۲,۵۲۶ ریال باقی می‌ماند، استراتژی در سود بسته می‌شد. با این وجود با توجه به اینکه بازار به سمت بازه‌ی زیان حرکت کرد، با ذکر اینکه اولویت با مدیریت ریسک می‌باشد، دو هفته پیش دو پله جدید به استراتژی پیشنهادی اضافه شد که ریسک استراتژی را پوشش دهد. در نهایت با توجه به اضافه شدن دو پله جدید به استراتژی پیشنهادی، چنانچه قیمت صندوق اهرم (نماد پایه) در روز سررسید بالاتر از ۲۴,۲۴۱ ریال باشد، استراتژی در نهایت بدون ضرر، و با حداکثر سود ۹.۱ درصد ماهیانه (۹.۷ درصد تا روز سررسید) بسته خواهد شد.

خرید/فروش	نماد	نوع	تعداد	اعمال	قیمت	دلتا	٪ IV	وجه تضمین	آفست	خالص
فروش	طهرم ۸۰۱۲	اختیار فروذ	۱	۱۳,۰۰۰	۲۳۹	۰	۳۲	۱,۳۱۰,۰۰۰		-۱,۳۱۰,۰۰۰
فروش	ضرهم ۸۰۲۰	اختیار خری	۱	۲۶,۰۰۰	۲۳۵	۰.۵۳	۳۲	۴,۵۰۰,۰۰۰		-۴,۵۰۰,۰۰۰
خرید	اهرم	دارایی پایه	۱		۲۵,۴۵۰	۱				-۲۵,۴۵۰,۰۰۰
فروش	طهرم ۸۰۲۰	اختیار فروذ	۱	۲۶,۰۰۰	۲,۴۹۵	-۰.۴۷	۳۲	۵,۰۹۰,۰۰۰		-۵,۰۹۰,۰۰۰
روز ۳۲ + ۰.۹۴ ۲,۲۰۴,۰۰۰ (-۶.۱%) -۳۶,۳۵۰,۰۰۰										



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریده‌ها با بیشترین ارزش معاملات

روزانه	هفتگی	ماهانه
۱۰۲۶ صهرم ۱,۰۷۵.۲ B	۱۰۲۶ صهرم ۵,۷۵۱.۱ B	۹۰۱۸ صهرم ۱۷,۱۲۱.۱ B
۹۰۳۰ ضملت ۴۱۷.۴ B	۱۰۲۵ صهرم ۱,۶۵۴.۲ B	۱۰۲۶ صهرم ۶,۵۷۱ B
۱۰۲۳ صهرم ۳۵۲.۵ B	۱۰۲۳ صهرم ۱,۵۰۳.۸ B	۹۰۲۰ صهرم ۶,۲۹۱.۹ B
۱۰۲۴ صهرم ۲۳۶.۹ B	۸۰۱۹ صهرم ۱,۳۷۵.۸ B	۹۰۲۱ صهرم ۴,۸۸۹.۲ B
۱۰۲۵ صهرم ۲۲۷.۴ B	۱۰۲۴ صهرم ۱,۰۵۹.۸ B	۹۰۱۹ صهرم ۴,۶۴۸.۳ B

اختیار فروش‌ها با بیشترین ارزش معاملات

روزانه	هفتگی	ماهانه
۱۰۲۶ طهرم ۲۸۳.۶ B	۱۰۲۶ طهرم ۱,۷۵۸.۶ B	۹۰۲۰ طهرم ۴,۶۱۴.۸ B
۱۰۲۴ طهرم ۲۲۶.۵ B	۸۰۲۰ طهرم ۷۵۷.۹ B	۹۰۱۸ طهرم ۲,۳۳۸.۸ B
۹۰۴۱ طستا ۵۶.۱ B	۱۰۲۴ طهرم ۷۵۰ B	۱۰۲۶ طهرم ۱,۸۶۸ B
۱۰۲۳ طهرم ۴۳ B	۹۰۴۶ طخود ۳۸۲ B	۸۰۱۹ طهرم ۱,۶۳۱.۱ B
۱۰۲۵ طهرم ۴۰.۷ B	۹۰۴۱ طستا ۳۵۶.۸ B	۸۰۲۰ طهرم ۱,۴۶۵.۸ 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 رشد خوبی که آبان ماه سال گذشته در شاخص کل و کلیت بازار شروع شد و تا دی ماه نیز به طول انجامید، بازار سرمایه حد فاصل انتهای دی ماه و اواخر اسفندماه، روند اصلاحی خنثی همراه با نوسانات متعدد را سپری کرد و سپس موج صعود را تا سقف ۳ میلیون و ۲۶۰ هزار واحد ادامه داد و از اواخر اردیبهشت ماه وارد روند اصلاحی شد که این روند، با جنگ ۱۲ روزه میان ایران و اسرائیل، تشدید شد.

در نهایت این روند اصلاحی، شاخص کل پس از رسیدن به خط روند حمایتی بلندمدتی، شاهد بازگشت قدرتمند بازار بودیم. با شکست خط روند نزولی چندماهه و در ادامه شکست سقف قبل در محدوده ۲ میلیون و ۸۵۰ هزار واحدی نیز (که اکنون به حمایت بدل شده است)، روند صعودی کوتاه مدت در شاخص کل و کلیت بازار به سمت بالا بازار تایید شد. همچنین محدوده مقاومتی ۳ میلیون و ۱۰۰ تا ۱۵۰ هزار واحد با موفقیت شکسته شد اما در ادامه شاهد واکنش منفی شاخص کل به سقف تاریخی در سطح ۳ میلیون و ۲۶۰ هزار واحدی بودیم.

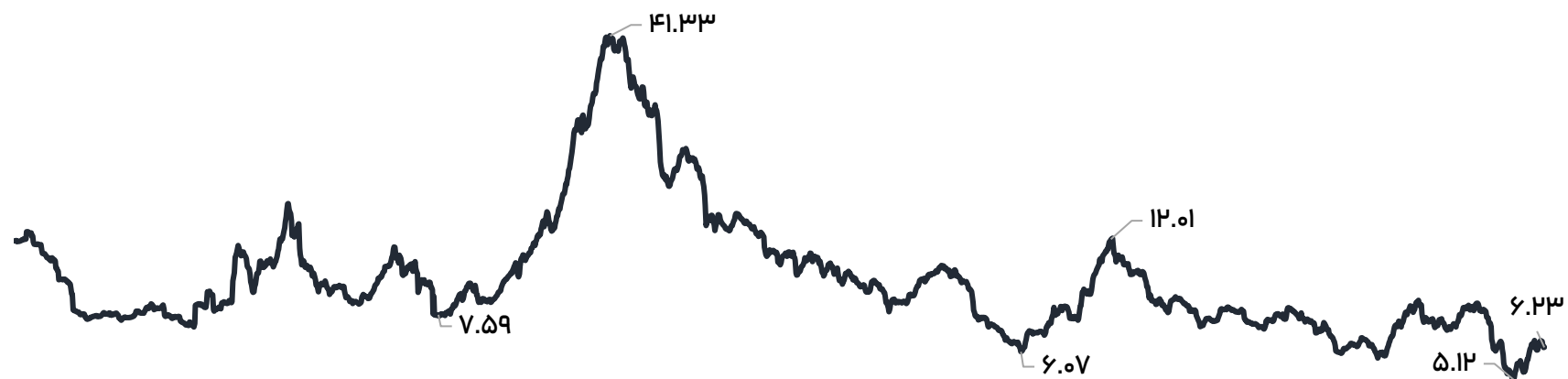
در هفته اخیر نیز روند اصلاحی بازار ادامه پیدا کرد و شاخص کل به محدوده ۳ میلیون و ۱۰۰ الی ۱۵۰ هزار واحد بازگشت که با رسیدن به این محدوده شاهد کاهش فشار عرضه در کلیت بازار و بهبود وضعیت تقاضا بودیم. حال باید دید، این محدوده پتانسیل به بالا پرتاب کردن کندل ها را برای تست مجدد سقف تاریخی دارد، یا اینکه به سمت پایین شکسته شده و روند اصلاح بازار ادامه خواهد یافت.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

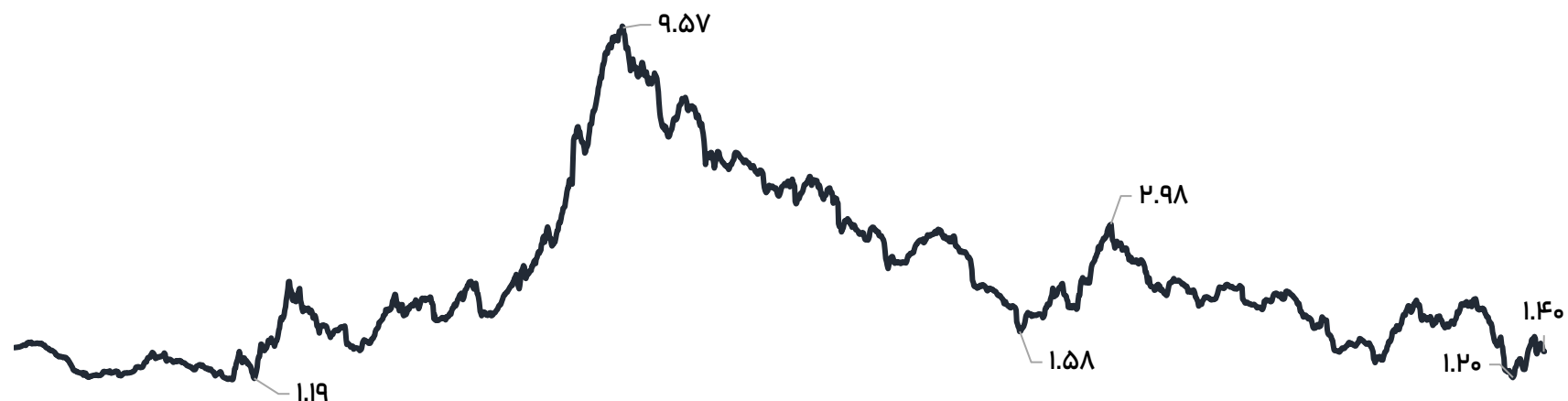
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

رشد 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.

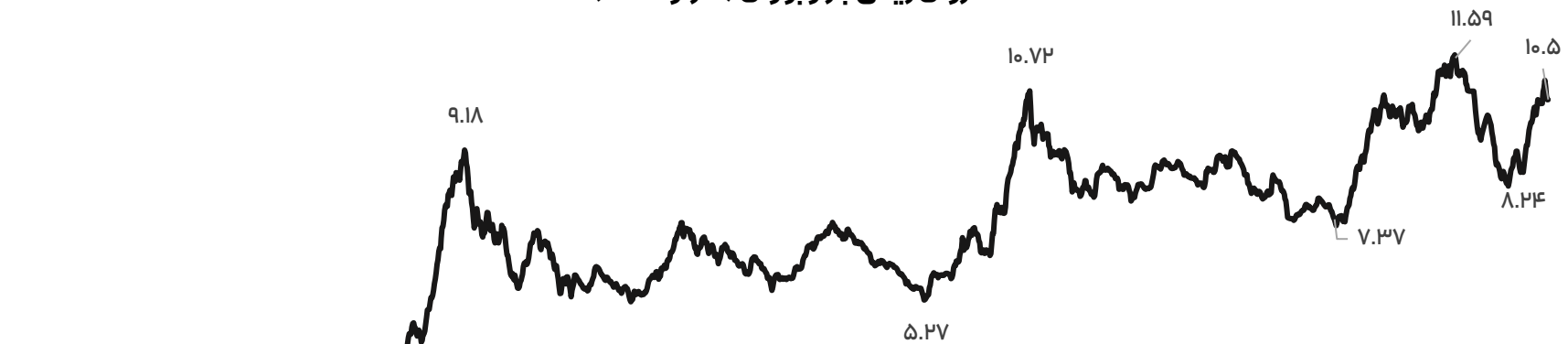
رشد تغییرات P/S بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



ارزش دلاری و ریالی بازار سرمایه

با وجود رشد ریالی بازار و سقف‌شکنی شاخص کل و شاخص هم‌وزن طی یک سال اخیر، 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)





توقف انتشار پیام‌های نظارتی فرا بورس از ۲۴ آبان

مدیر نظارت بر بورس‌های سازمان بورس در نامه‌ای به مدیرعامل فرا بورس، خواستار توقف انتشار پیام‌های نظارتی شد که در آن‌ها به سرمایه‌گذاران درباره توجه به ارزش ذاتی برخی نمادها توصیه شده بود. بر اساس دستور سازمان بورس، از تاریخ ۲۴ آبان انتشار این‌گونه پیام‌ها تا زمان تدوین و ابلاغ ضوابط رسمی متوقف خواهد شد.



عرضه قریب‌الوقوع خودروهای داخلی در بورس کالا

صیدی، رییس سازمان بورس:

خودروهای وارداتی در بورس کالا پذیرش و عرضه شدند، در بحث عرضه خودروهای داخلی هم ما و بورس کالا به شکل کامل آمادگی داریم و اکنون خودروسازان در حال هماهنگی با وزارت صمت هستند که انشالله عرضه داشته باشند و مشکل خاصی هم وجود ندارد.

کارمزد معامله صندوق‌های بورسی از چهارشنبه ۲۱ آبان ماه، تغییر کرد.

بر این اساس، به ازای هر ۱۰۰ میلیون تومان معامله روی صندوق‌های بورسی، کارمزدها به شرح زیر است:

صندوق طلا: ۴۳۰ هزار تومان / صندوق سهامی و اهرمی: ۴۵۰ هزار تومان

صندوق مختلط: ۲۴۰ هزار تومان / صندوق درآمد ثابت: ۷۰ هزار تومان



تایرا

تایرا نرخ فروش ۵ نوع تراکتور را ۱۲ درصد افزایش داد.

بترانس

مجوز افزایش سرمایه ۸۳ درصدی بترانس از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی و انباشته صادر شد.

سیسکو

مجوز افزایش سرمایه ۴۷ درصدی سیسکو از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی صادر شد.



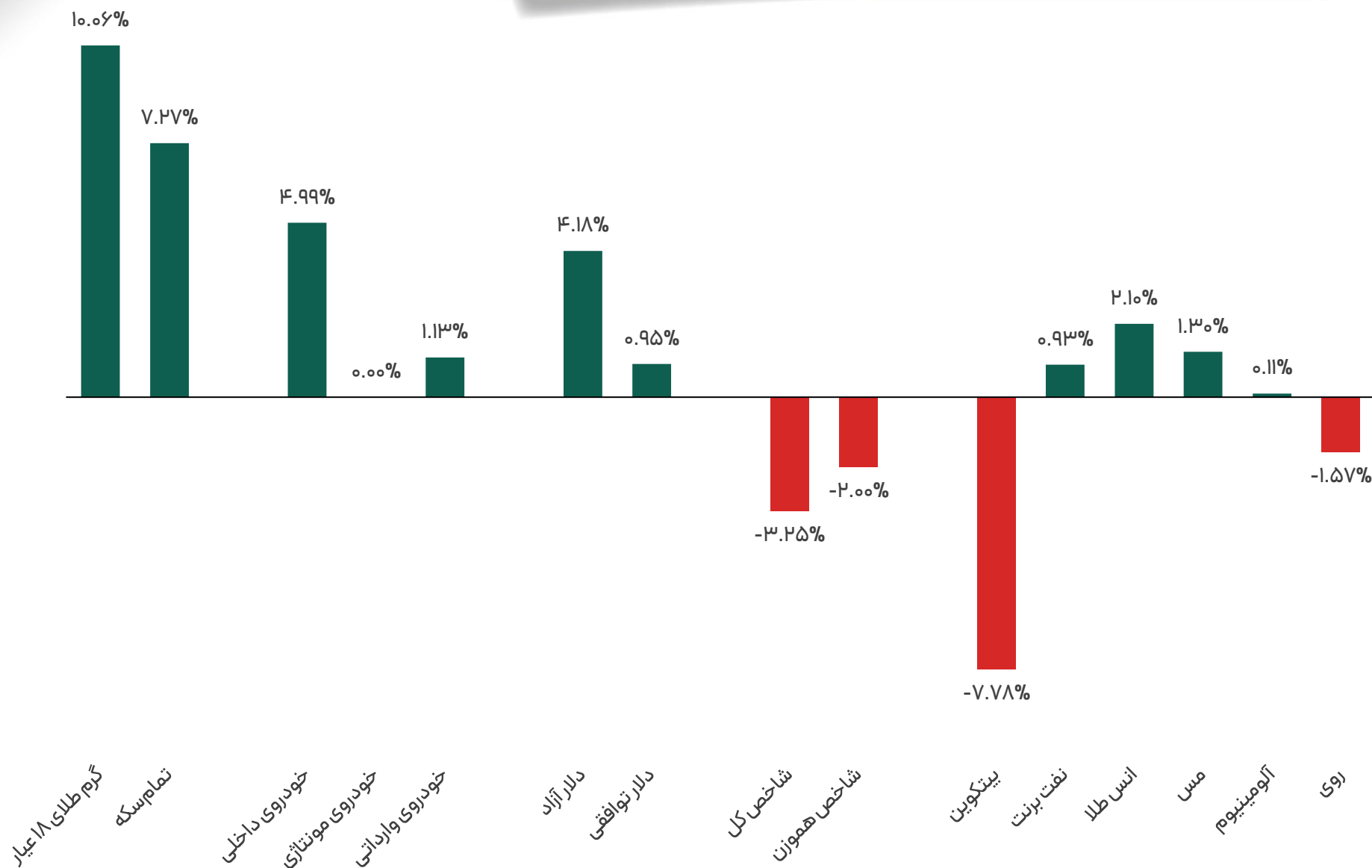
کرک اسپرد پالایشی‌ها



گزارش کامل کرک اسپرد پالایشی‌ها را در سامانه دانافیو، بخش ابزار کمکی (ابزارهای محاسباتی فیو) << محاسبات پالایشگاه‌ها، مشاهده کنید.



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

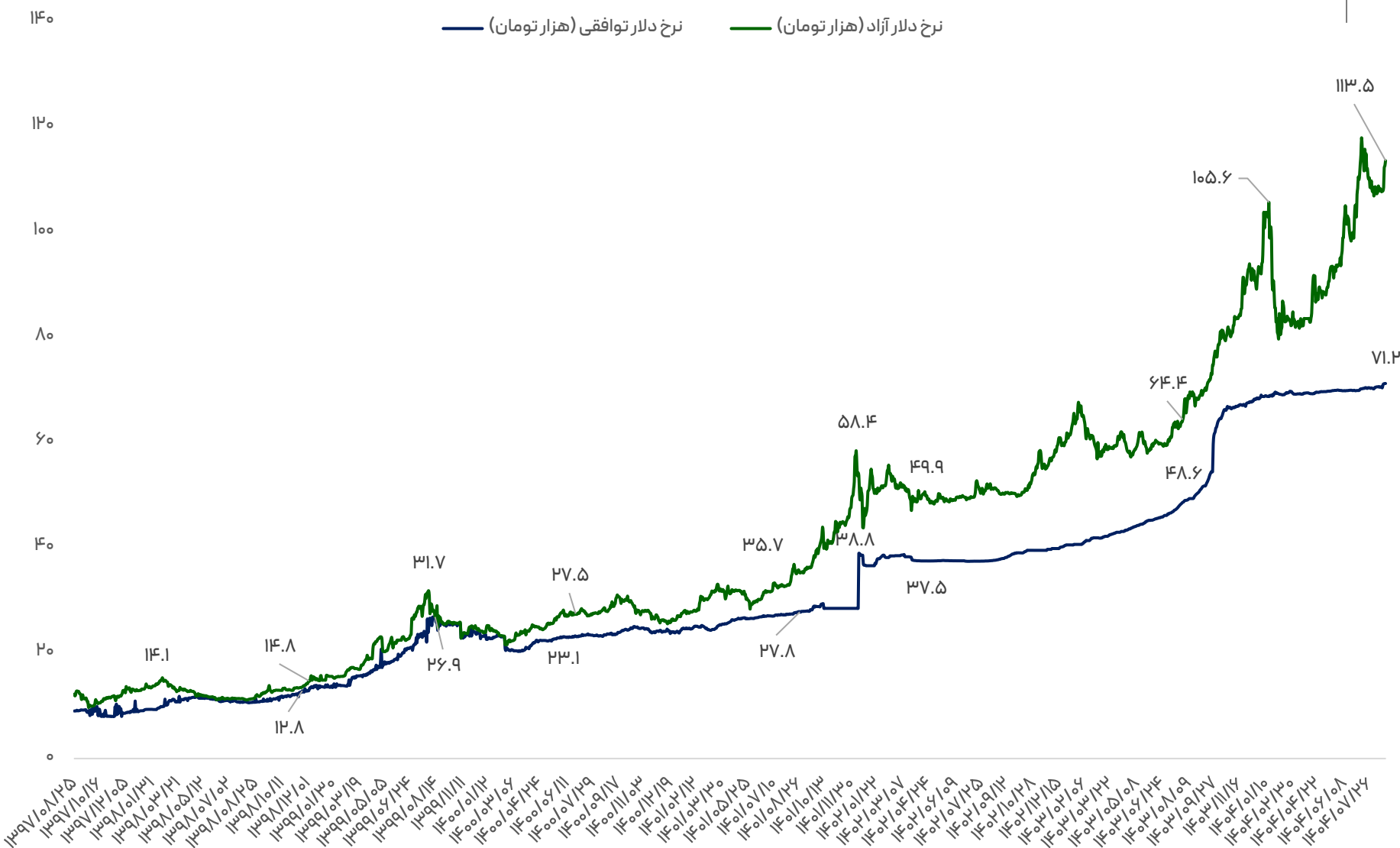


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K۵ در نظر گرفته شده است.



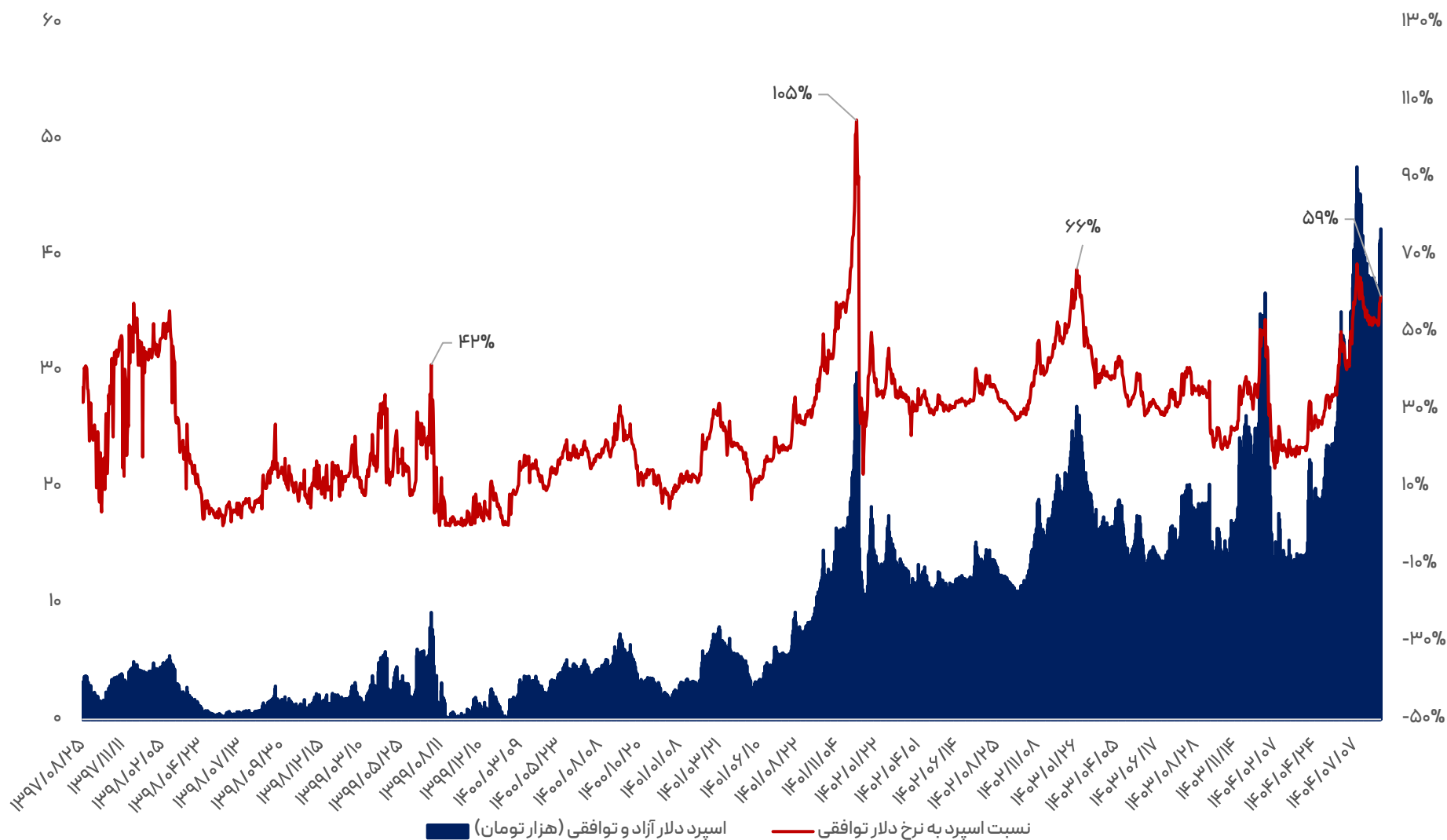
رند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۶,۷۰۴ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۷۱۲,۱۵۶ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

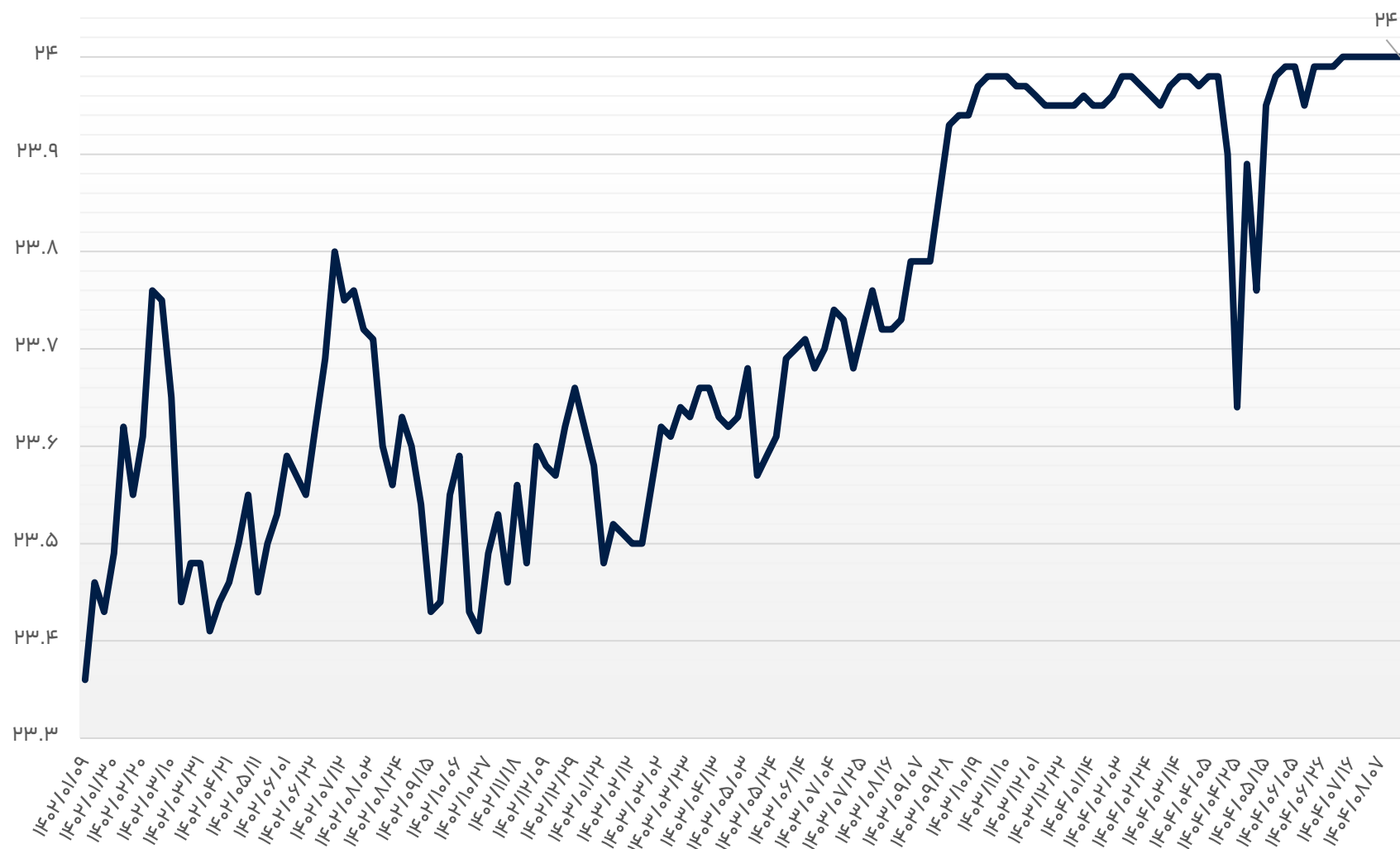
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



نرخ بهره بین بانکی

با اعلام بانک مرکزی، هفته اخیر، نرخ بهره بین بانکی هفته اخیر در سطح ۲۴ درصدی ثابت باقی ماند.

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



شاخص قیمت تولیدکننده بخش‌های خدمات - فصل تابستان ۱۴۰۴ (بر مبنای سال پایه ۱۴۰۰)

شاخص قیمت کل

در فصل تابستان ۱۴۰۴، شاخص قیمت تولیدکننده بخش‌های خدمات ۳۷۸.۵ بود که نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۹.۸ درصد، نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۴۲.۰ درصد و در ۴ فصل منتهی به فصل جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل (تورم سالانه) ۳۹.۱ درصد افزایش داشته است.

کاهش تورم فصلی

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش‌های خدمات نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۹.۸ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۱۰.۸ درصد)، ۱ واحد درصد کاهش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط عرضه‌کنندگان خدمات به ازای تولید خدماتشان در داخل کشور، در فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به فصل قبل، ۹.۸ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم فصلی با ۴۸.۵ درصد مربوط به گروه «آبرسانی، مدیریت پسماند، فاضلاب و فعالیتهای تصفیه» و کم‌ترین تورم فصلی با ۲.۹ درصد مربوط به گروه «اطلاعات و ارتباطات» بوده است.



افزایش تورم نقطه به نقطه

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش‌های خدمات نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۴۲.۰ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۹.۷ درصد)، ۲.۳ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط عرضه‌کنندگان خدمات به ازای تولید خدماتشان در داخل کشور، در فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به فصل مشابه سال قبل، ۴۲.۰ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۸۲.۶ درصد مربوط به گروه «آب‌رسانی، مدیریت پسماند، فاضلاب و فعالیت‌های تصفیه» و کم‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۱۱.۳ درصد مربوط به گروه «اطلاعات و ارتباطات» بوده است.

افزایش تورم سالانه

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش‌های خدمات در چهار فصل منتهی به فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه در سال قبل ۳۹.۱ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۷.۹ درصد)، ۱.۲ واحد درصد افزایش داشته و به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط عرضه‌کنندگان خدمات به ازای تولید خدماتشان در داخل کشور، در چهار فصل منتهی به تابستان ۱۴۰۴ نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۳۹.۱ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم سالانه با ۵۹.۵ درصد مربوط به گروه «آب‌رسانی، مدیریت پسماند، فاضلاب و فعالیت‌های تصفیه» و کم‌ترین تورم سالانه با ۱۲.۴ درصد مربوط به گروه «اطلاعات و ارتباطات» بوده است.



با سپاس از توجه شما

