

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۷ آذرماه ۱۴۰۴



دیدگاه دانایان

هفته اخیر، بازار با **تداوم تقاضا** سپری شد. با خبر معافیت پتروشیمی‌های اوره‌ساز، نیمه اول هفته با تقاضای خوبی آغاز شد. هرچند در ادامه و در نیمه دوم هفته، افزایش نسبی عرضه‌ها در کلیت بازار مشهود بود. تنها یک روز پس از سقف‌شکنی شاخص کل (در روز سه‌شنبه) بازار دوباره با افزایش عرضه همراه شد و چهارشنبه را منفی و پرنرخ سپری کردیم.

اتفاقی که دقیقا در سقف‌شکنی آبان‌ماه هم رخ داده بود و بلافاصله یک روز پس از سقف‌شکنی شاخص کل، بازار با عرضه همراه شد و دو سه هفته را در **روند اصلاحی** سپری کرد.

برایند **گردش حقیقی‌ها** در معاملات خرد بازار سهام هفته پیش نزدیک به خنثی بود اما خروج پول ا همتی در روز چهارشنبه، تراز حقیقی‌ها در معاملات خرد هفته پیش را منفی کرد. در سوی مقابل در صندوق‌های درآمد ثابت حدود ۵۰۵ همت ورود پول به ثبت رسید. صندوق‌های طلا هم در ادامه روند جذب پول، در هفته اخیر ۴۰۱ همت منابع حقیقی جذب کردند.

به لحاظ تکنیکالی، هفته گذشته شاخص کل موفق به سقف شکنی دوباره شد و از سقفی که در آبان ماه اخیر تشکیل شده بود عبور کرد. حال در ادامه، باید دید آیا این بار شاخص کل توانایی تثبیت بر فراز سقف تاریخی را دارد و یا بار دیگر روند اصلاحی در پیش خواهد گرفت.

هفته‌های پیش اشاره شد که در **پارامترهای نقدینگی** بازار، روند اصلاحی کوتاه‌مدت بازار تایید شده است. اما در نمودار **ارزش معاملات خرد** روزانه گارد صعودی میانگین‌های متحرک مشاهده می‌شود. میله‌های ارزش معاملات خرد روزانه هم میانگین‌ها را به سمت بالا شکسته‌اند و حال، باید دید کراس رو به بالا بین میانگین‌ها هم رخ خواهد داد یا نه. در صورت رخداد، می‌توان دوباره نسبت به صعود بازار، خوش‌بین بود.

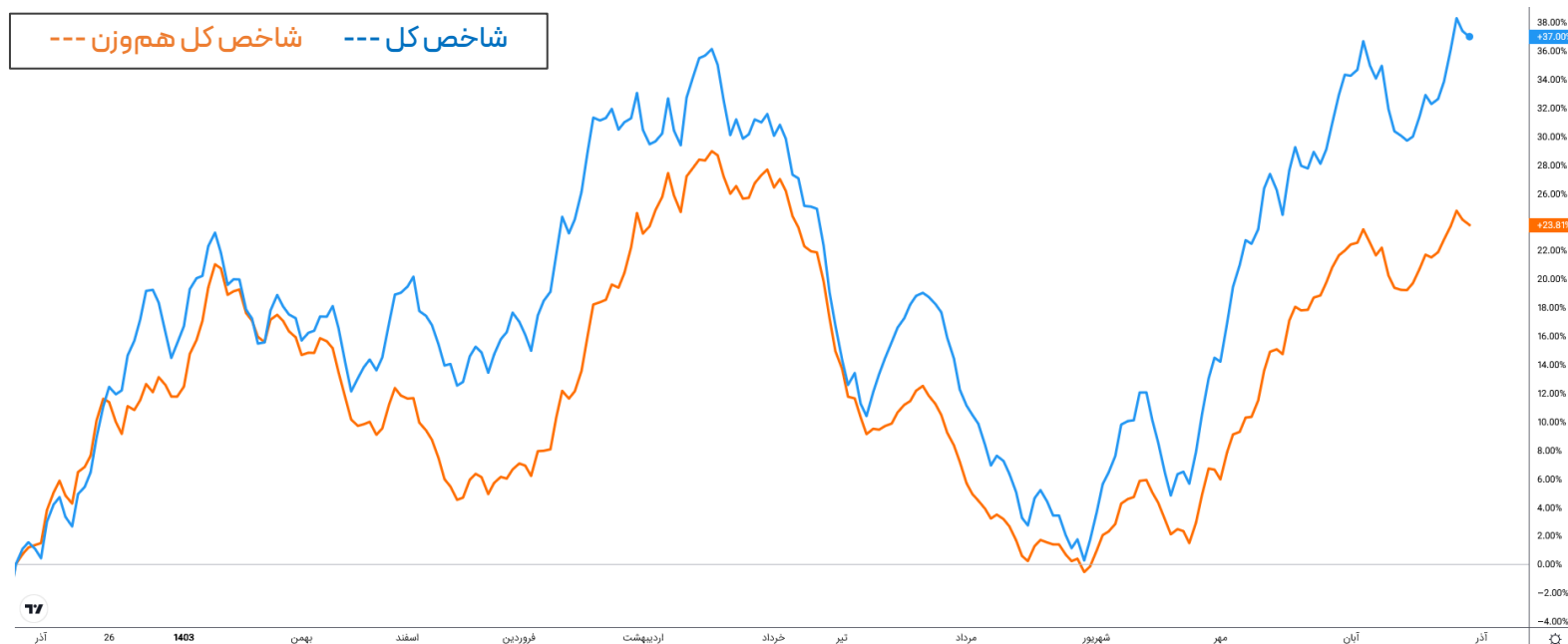
در بازار طلا هم همانطور که پیش‌تر اشاره شد، تا زمانی که نرخ دلار در بازار آزاد افزایش پیدا کند، هر اصلاحی می‌تواند بخشی از روند صعودی بزرگتر باشد.



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	۲۶-۲۷	۲۸-۳۰

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 هم در دوره‌های رکود و هم در دوران رونق، در مجموع کمی بهتر از شاخص هم‌وزن 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 هم‌وزن 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 هم‌وزن بیشتر در قالب قیمت اصلاح کرد. با این وجود، در لگ دوم ریزش، ریزش پرشتاب‌تری از سوی شاخص کل، نسبت به شاخص هم‌وزن رخ داد و بازده دو شاخص را به هم نزدیک‌تر کرد؛ در نهایت اما در حرکت اخیر بازار بار دیگر شاهد عملکرد بهتر شاخص‌سازان و شاخص کل، نسبت به شاخص هم‌وزن بودیم که مجموع اتفاقات اخیر، باعث عملکرد بهتر شاخص کل در مجموع یک سال اخیر نسبت به شاخص هم‌وزن شد.



دوره زمانی	یک هفته	یک ماهه	سه ماهه	شش ماهه	یک ساله
بازده شاخص کل	+ ۳.۵۹ %	+ ۴.۹۵ %	+ ۳۵.۰۲ %	+ ۵.۵۶ %	+ ۳۷.۰۰ %
بازده شاخص کل هم وزن	+ ۱.۸۷ %	+ ۲.۷۸ %	+ ۲۳.۶۸ %	- ۱.۲۲ %	+ ۲۳.۸۱ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

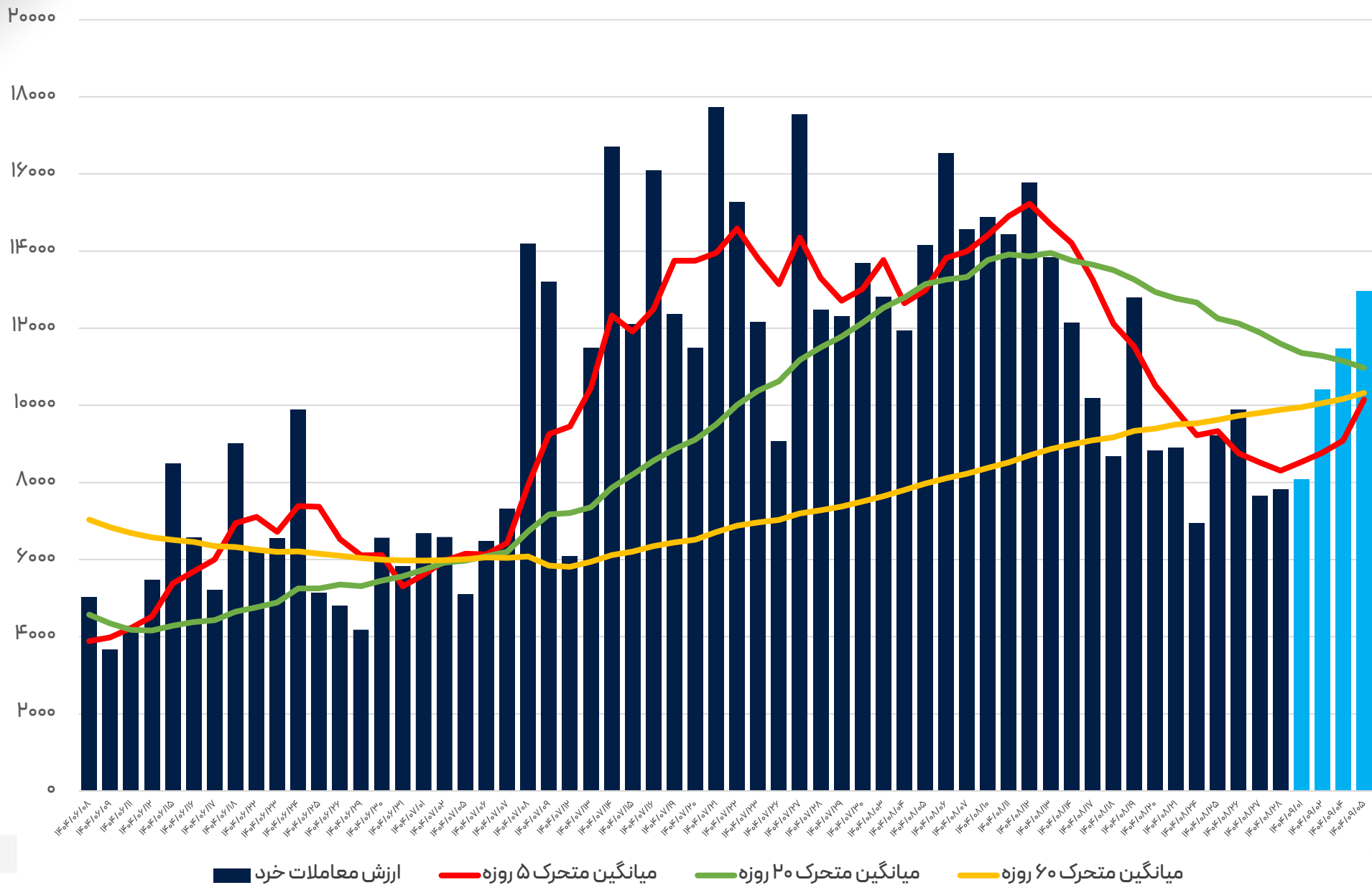
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل 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. در غیر این صورت، با شکست محدوده حمایتی به سمت پایین، موج E ادامه پیدا خواهد کرد و کماکان بازده شاخص‌سازان نسبت به سهام کوچک‌تر بهتر خواهد بود.

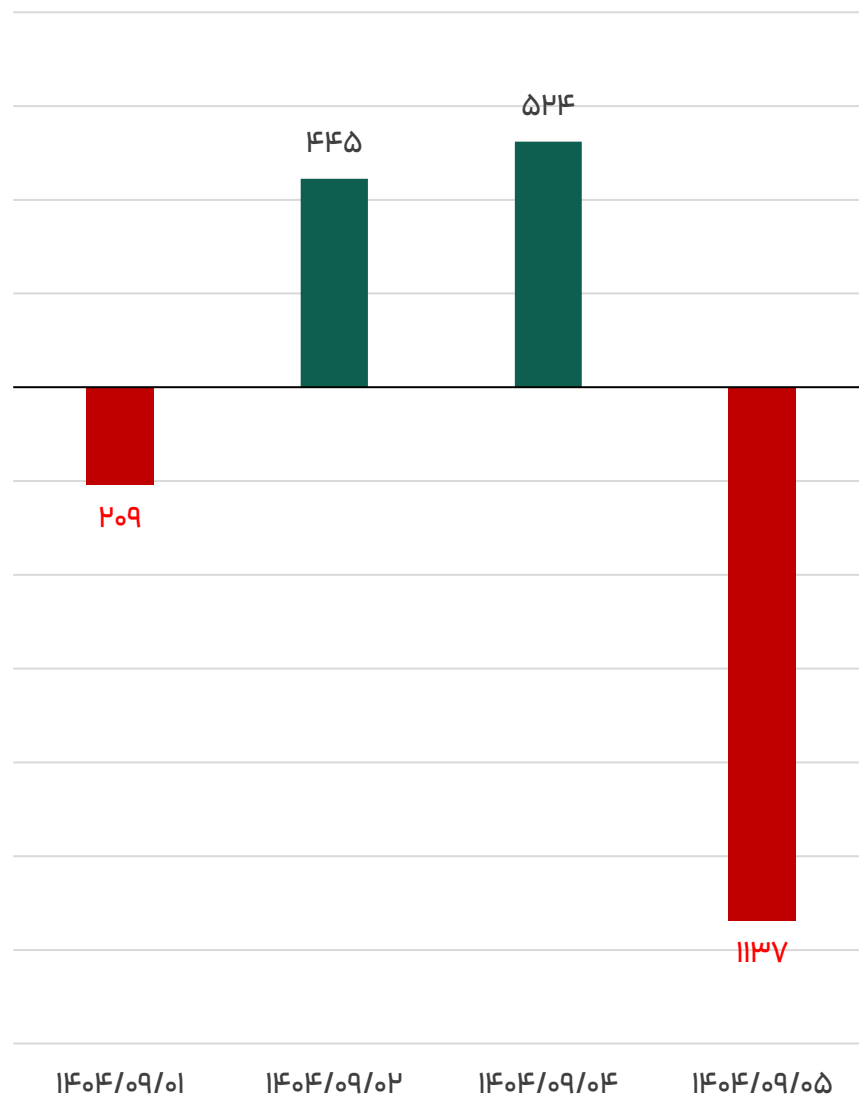


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

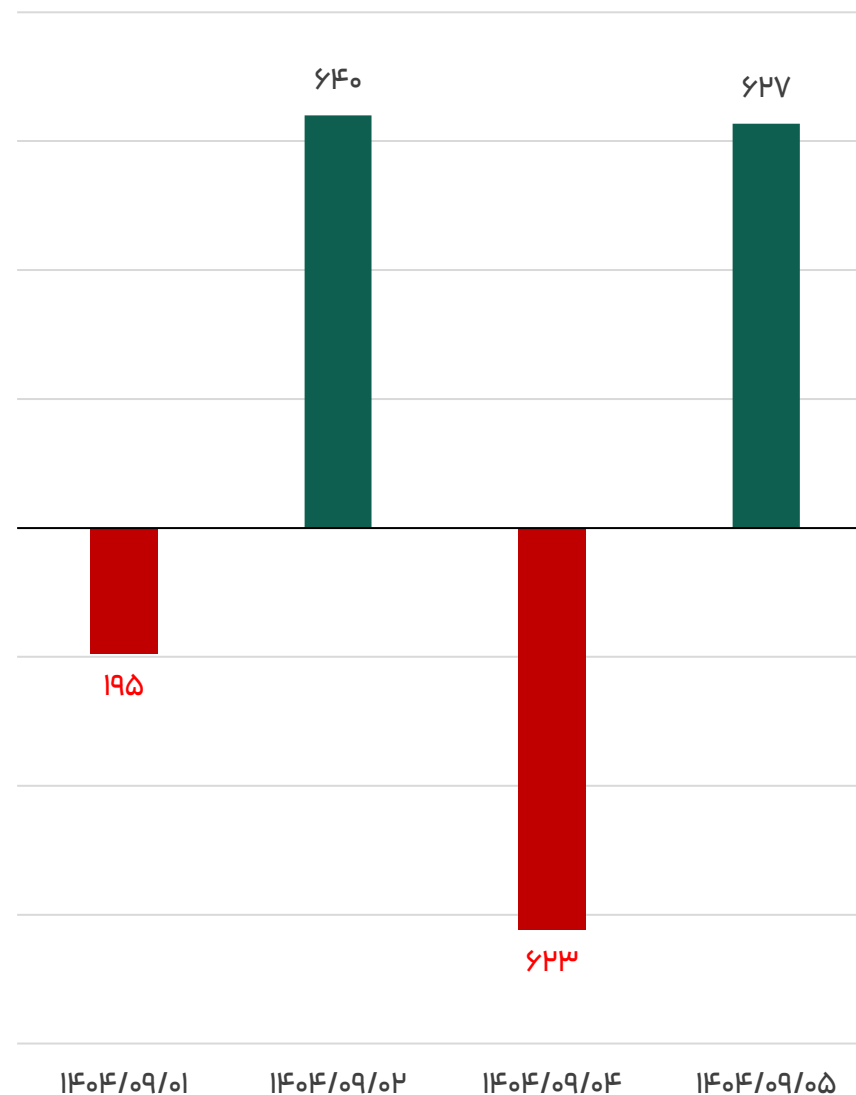


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

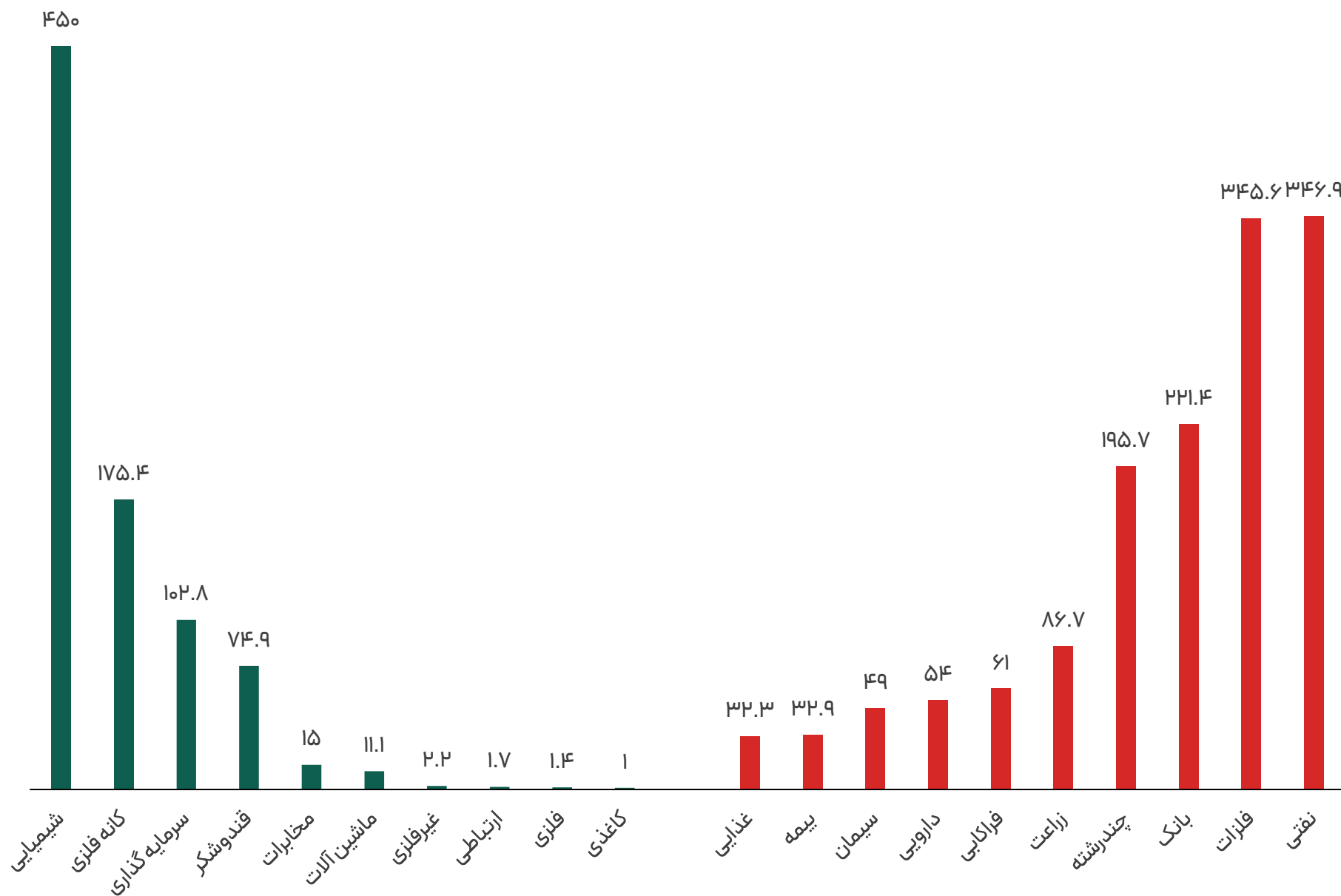
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



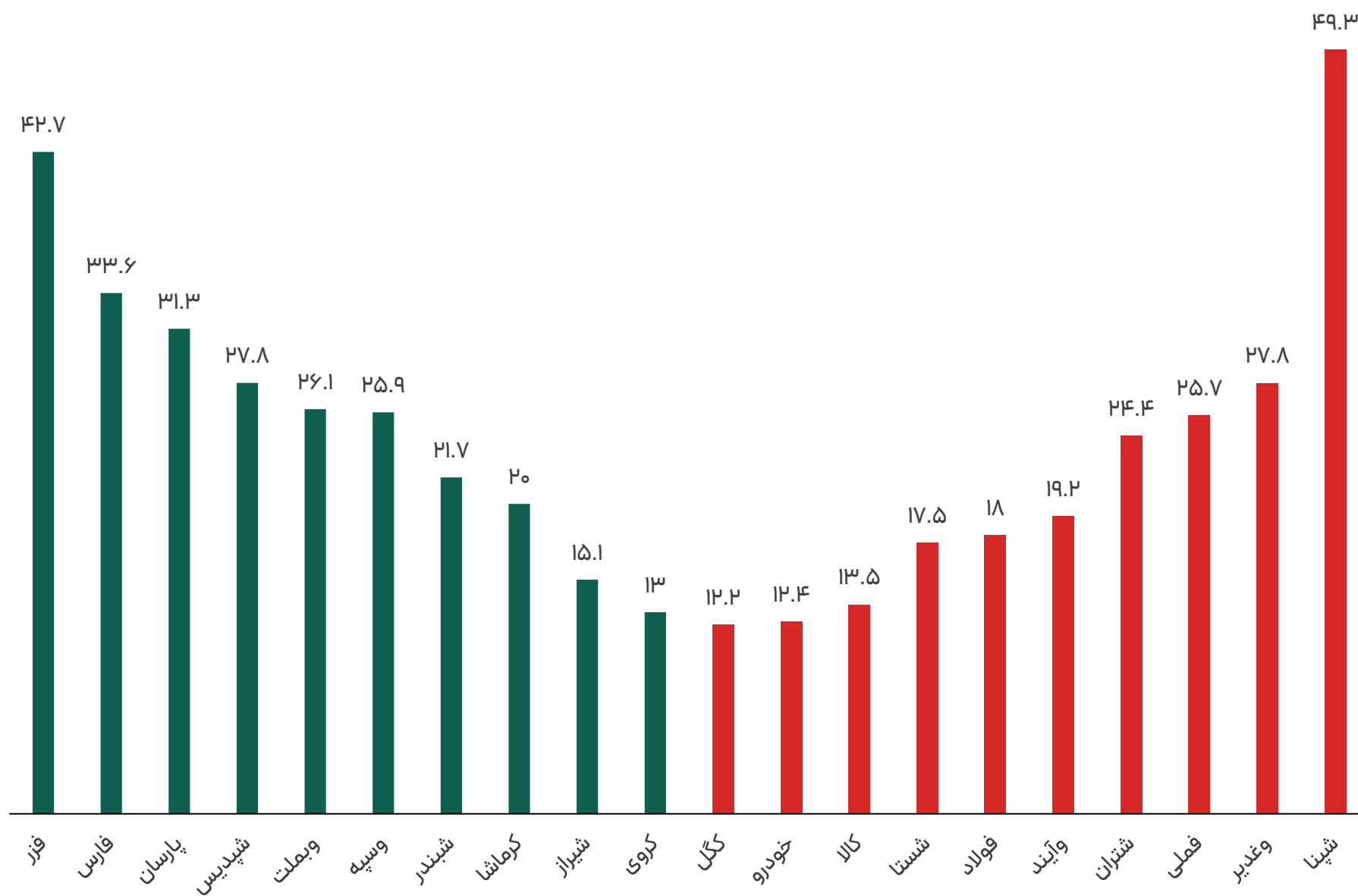
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



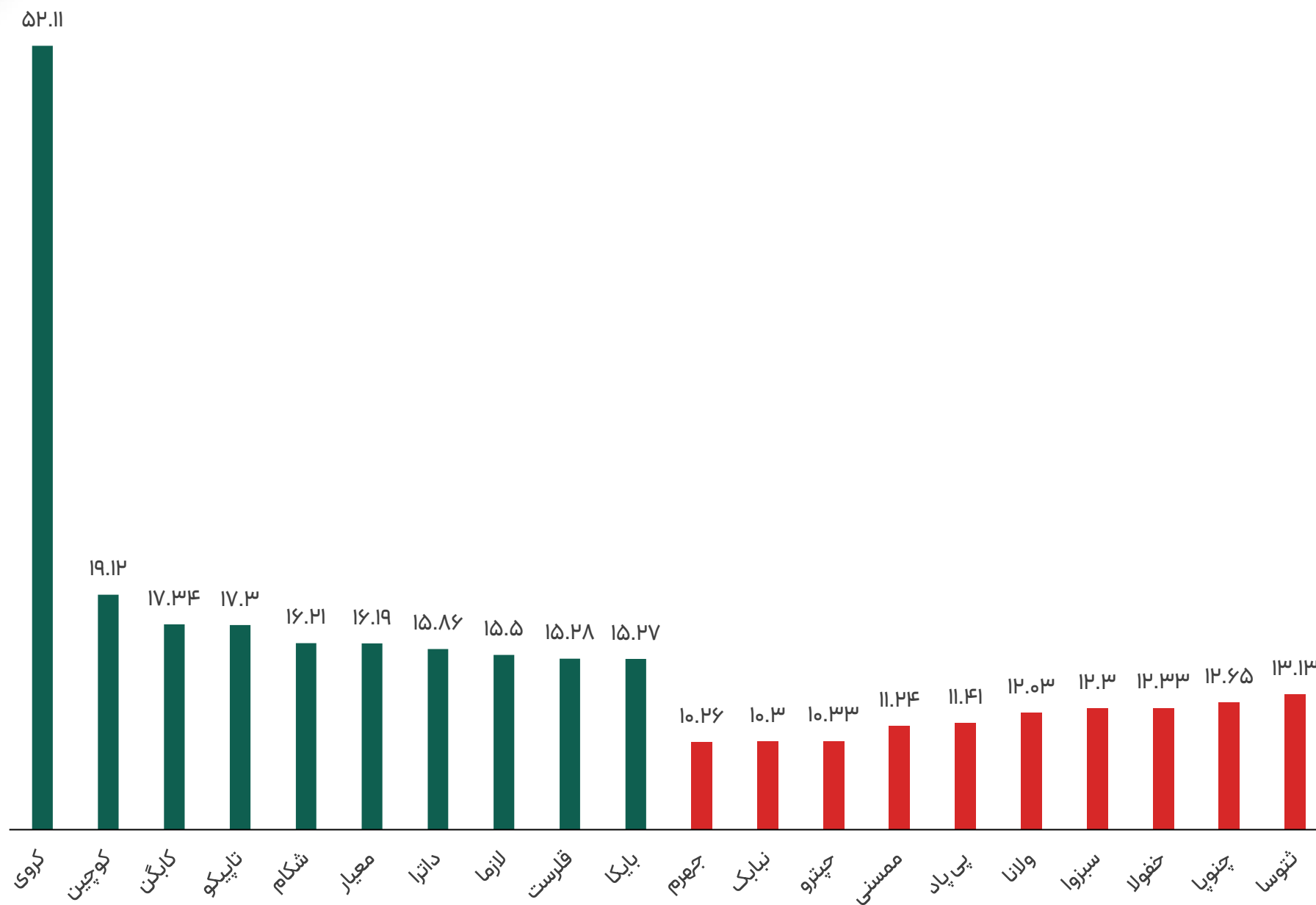
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



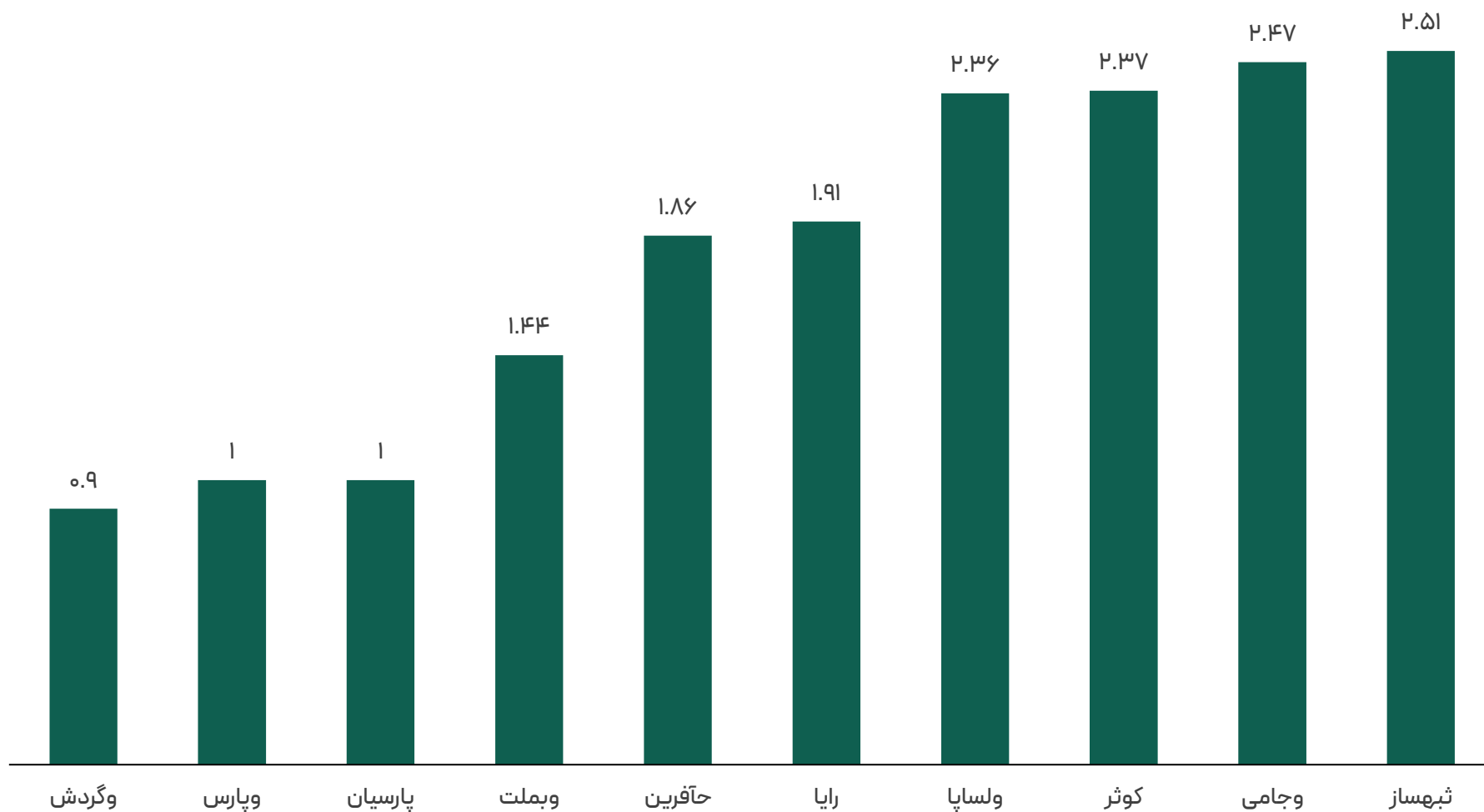
بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)



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

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	بازدهی	درصد حباب	میانگین حباب		ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل
			سه ماهه	یک ماهه				
پیشران	۵.۲۲	۳۷.۲۲	۹.۸۲	-۳.۷۹	۱.۸۲	۰.۹۴	۱.۷۱	۱.۷۷
دوایکس	۳.۳۷	۸۷.۸۵	-۱۳.۵۹	۰.۰۶	۲.۲	۰.۹۴	۲.۰۷	۲.۰۷
جهش	-۱.۱۹	۷۴.۰۹	۳۵.۸۷	-۱۰.۸	۲.۲۴	۰.۸۷	۱.۹۵	۲.۱۶
شتاب	-۳.۳۷	۶۶.۱۴	۵۲.۴۷	-۱۰.۵۲	۲.۳۲	۰.۸۳	۱.۹۳	۲.۱۳
توان	-۴.۶۲	۶۹.۱۵	۲۷.۰۱	-۹.۷۹	۲.۳۱	۰.۸۳	۱.۹۲	۲.۱۱
نارنج اهرم	-۴.۶۴	۷۶.۶۷	۶۷.۱۳	-۶.۴۳	۲.۰۹	۰.۹۸	۲.۰۵	۲.۱۸
اهرم	-۵.۱	۵۹.۰۹	۲۷.۷۴	-۵.۷۳	۱.۹۷	۰.۸۹	۱.۷۵	۱.۸۵
بیدار	-۵.۱۸	۵۵.۹۸	۴۴.۶۴	-۱۱.۹۸	۲.۰۳	۰.۸۶	۱.۷۵	۱.۹۶
موج	-۵.۷۹	۸۱.۲۵	۶۶.۶۵	-۵.۱۹	۲.۱۹	۰.۹۸	۲.۱۵	۲.۲۶



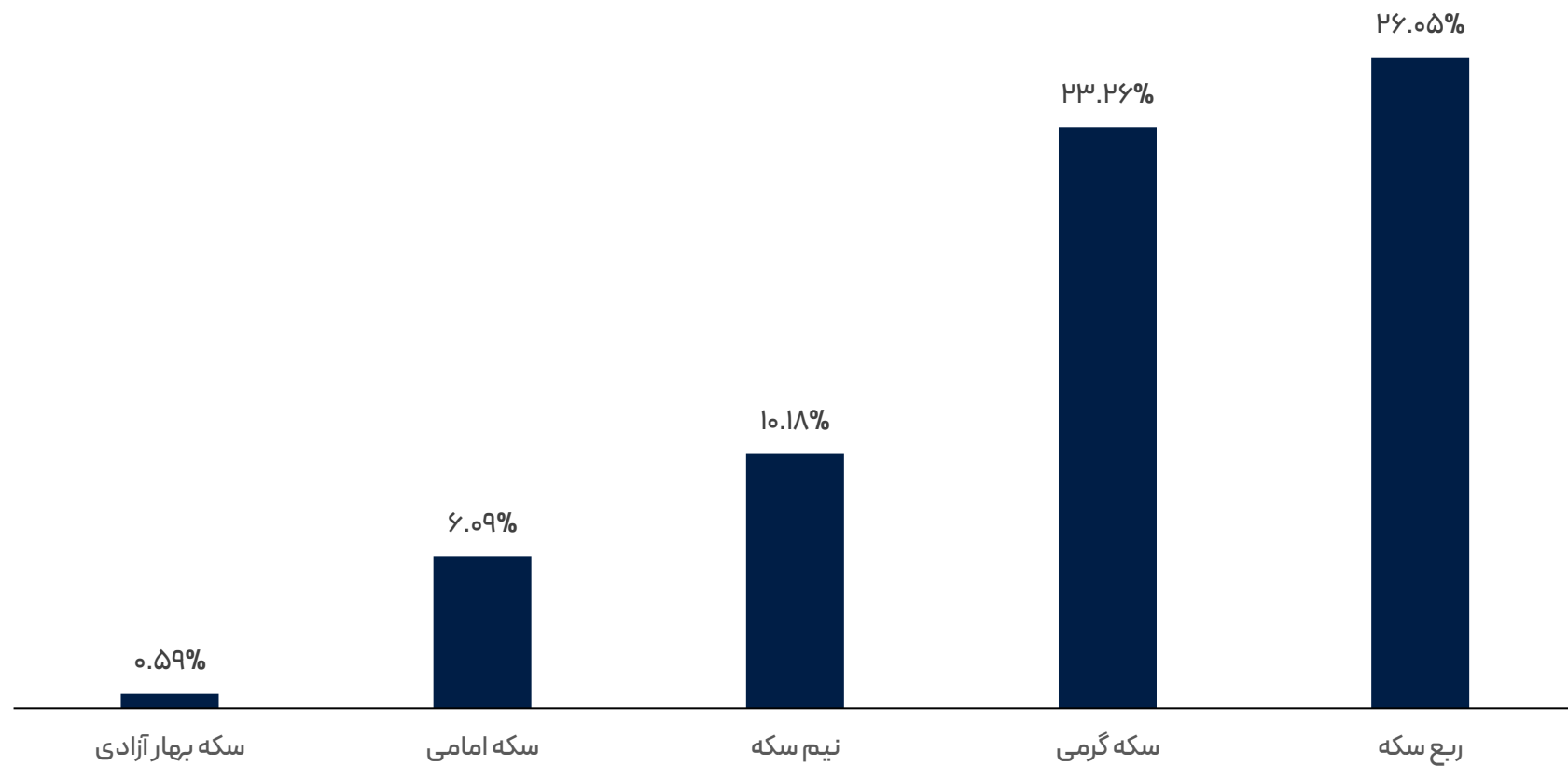
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۰.۷%) ۱,۱۵۲,۵۰۰ ریال انس طلا (۱.۴۹%) ۴,۲۱۹ دلار انس نقره (۰%) ۵۶ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حساب
تمام سکه طرح جدید ۴۱۱ آینده	۱,۲۰۵,۰۱۹	۲.۴۶	۵.۲۸
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ رفاه	۱,۲۰۶,۷۷۷	۲.۶۴	۵.۴۴
تمام سکه طرح جدید ۴۱۲ سامان	۱,۲۱۵,۹۹۸	۳.۰۴	۶.۲۴
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۲,۱۷۹,۰۰۰	۶.۵۴	۴.۲۸
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۲۰۰,۰۰۰,۰۰۰	۱.۸۴	۴.۸۵
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۱۵,۶۵۵,۰۰۰	۲.۶۹	۰.۶۳



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		میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	درصد حساب
 سهامدار	۷.۷۶	۳۱.۵۱	۱۷.۷	۰.۷۸	۰.۳۷	۲.۶۸
 رخس	۶.۴۱	۲۴.۳۴	۴۹.۰۱	۰.۰۲	۰.۰۲	-۰.۰۱
 آبنوس	۶.۱۶	۴۰.۴۸	۳۹.۵۸	۰.۹۵	۲.۳۸	۱.۰۶
 ثهام	۵.۹۸	۲۷.۸۴	۵۳.۴۹	۱.۲۵	۳.۱۴	۰.۰۸
 خبرگان	۵.۷۷	-۹۳.۶۴	-۹۱.۰۷	۱.۷۳	۱.۹	۰.۲۸
 هومان	۵.۴۷	۳۳.۶۵	۳۹.۲۵	۰.۷	۰.۴۱	۰.۲۹
 ثروتم	۵.۳۵	۳۴.۴۷	۵۵.۸۵	۱.۳۸	۵.۹۱	۰.۱۳
 مروارید	۵.۲	-۰.۲۱	۷.۷۲	۰.۱	۰.۸۲	۲۰.۳۲
 ابتکار	۵.۰۸	۲۱.۲۹	۱۴.۰۱	۰.۵۳	۰.۹۹	۰.۳۳

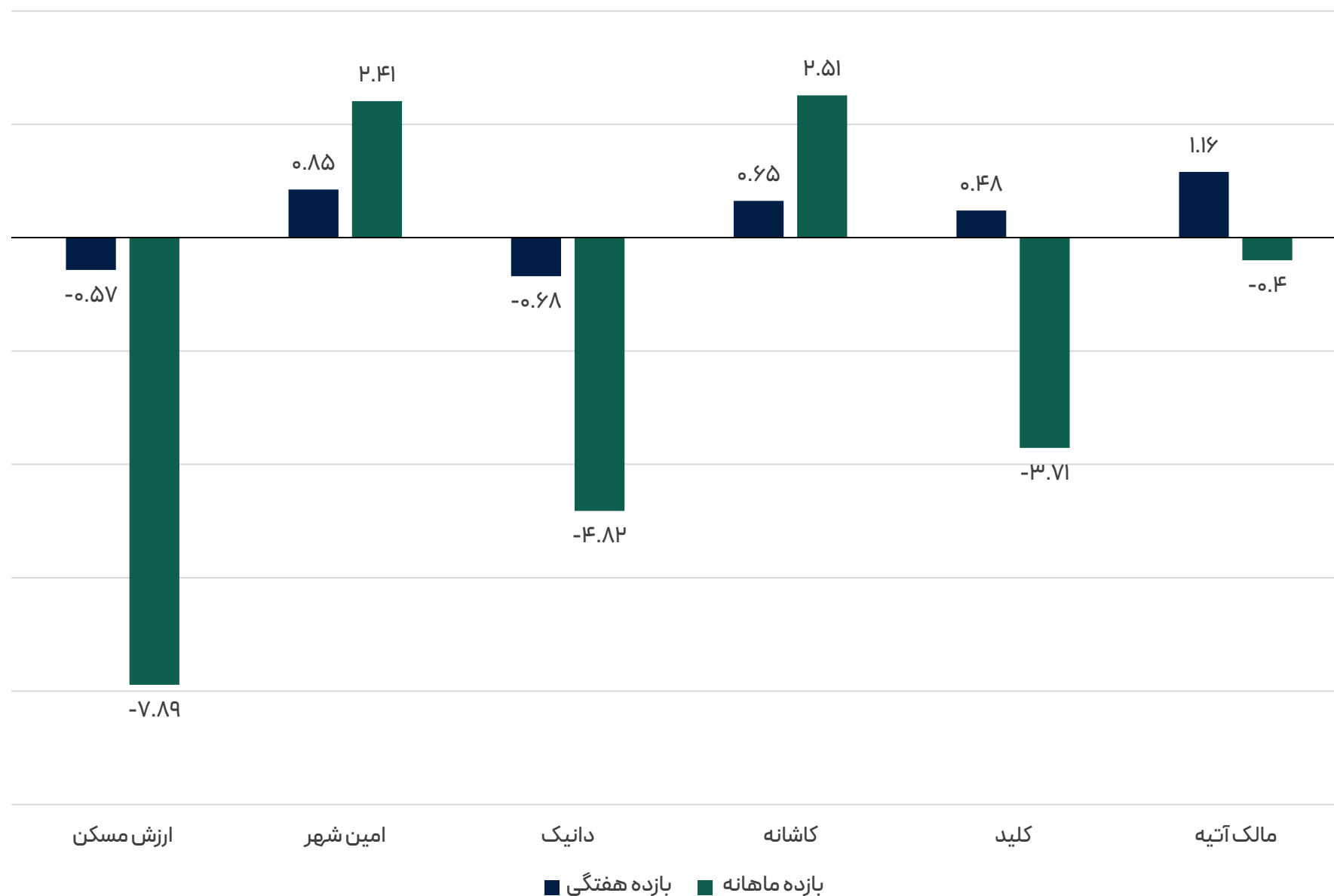


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	یک ماهه
فلزا 	۹.۰۵	۵۰.۱۳	۳۵.۷	۹.۳۶	۱.۲۵	-۰.۷۸
فرا الگوریتم 	۷.۵۴	۴۳.۲۶	۳۵.۵	۰.۱۹	-۰.۲۱	-۰.۴۵
آذین 	۷.۴۸	۴۷.۶۵	۳۶.۳۴	۱.۳۶	۰.۱۲	-۰.۱۴
سورنافود 	۷.۰۹	۴۲.۳۱	۳۳	۰.۸۷	۰.۵۸	۰.۰۱
طعام 	۷.۰۳	۳۲.۴۱	۲۸.۴۴	۲.۵۱	۳.۸۱	-۱.۸۸
نمک 	۶.۸۴	۴۴.۵۷	۳۸.۶۷	۵.۰۱	۱.۰۳	-۰.۰۱
دایب متال 	۶.۳۵	۴۲	۲۴.۵۶	۷.۵۲	۰.۳۲	-۰.۲۱
فلزفارابی 	۶.۱۹	۳۹.۸۱	۵۴.۶۴	۳.۰۷	۱.۹۶	۰.۰۴
دایب مزه 	۶.۰۵	۳۷.۳۵	۱۴	۲.۷۸	۴.۵۲	-۰.۱۱



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)

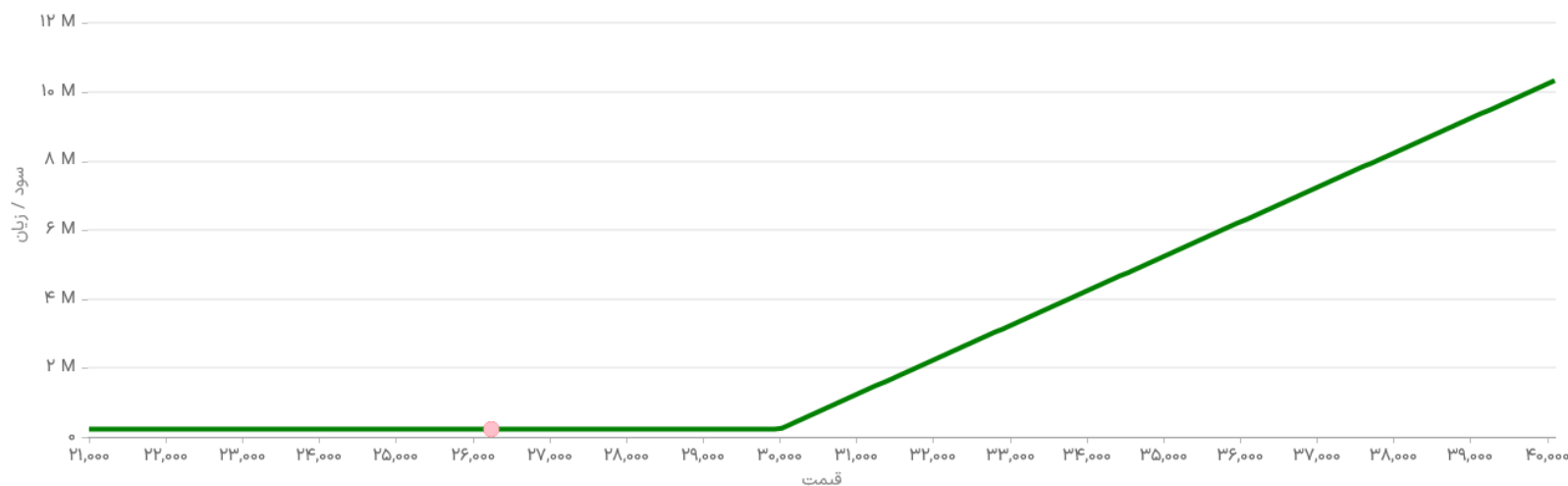


گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

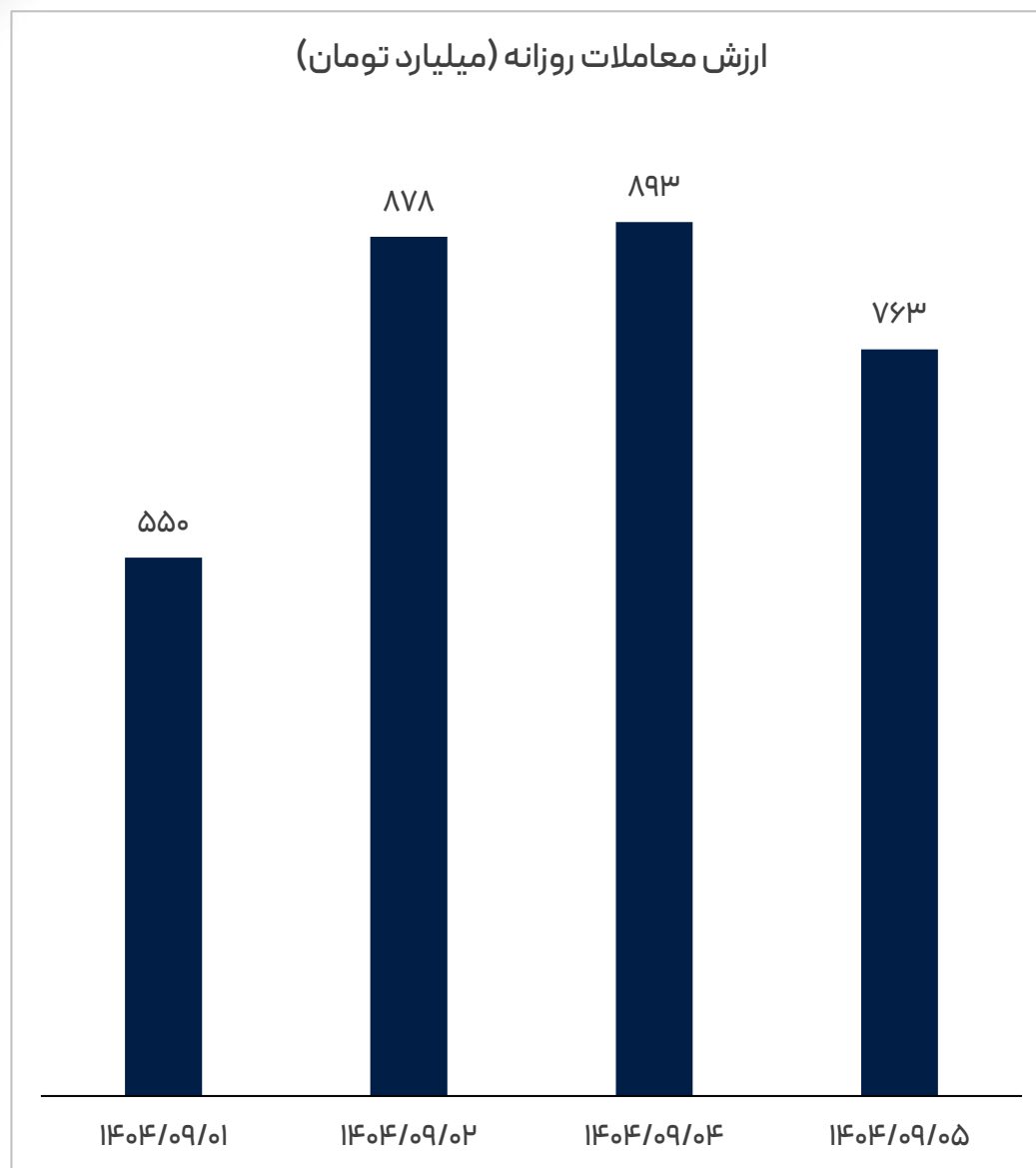
استراتژی بیمه دارایی پایه (Protective Put) با استفاده از قراردادهای اختیار فروش برج ۱۰ صندوق اهرم این استراتژی با خرید همزمان دارایی پایه (صندوق اهرم) و خرید اختیار فروش آن انجام می‌شود. با توجه به اینکه دیدگاه و ریسک‌پذیری معامله‌گر به چه صورت باشد، قراردادهای طهرم ۱۰۲۷، طهرم ۱۰۲۶ و طهرم ۱۰۲۵ می‌توانند مناسب باشند. طهرم ۱۰۲۷ استراتژی بدون ریسک می‌سازد، و سودآوری استراتژی از حدود ۱۵ درصد بالاتر از قیمت فعلی صندوق اهرم آغاز می‌شود. حداکثر ریسک استراتژی با استفاده از طهرم ۱۰۲۶ اما ماهانه ۱.۴ درصد می‌باشد و در عوض، سودآوری استراتژی از حدود ۹ درصد بالاتر از قیمت فعلی صندوق اهرم آغاز می‌شود. و همچنین با استفاده از طهرم ۱۰۲۵، حداکثر ریسک استراتژی ماهانه ۴ درصد می‌باشد و در عوض، از حدود ۵.۵ درصد بالاتر از قیمت فعلی صندوق اهرم، سودآوری استراتژی آغاز می‌گردد.

خرید/فروش	نماد	نوع	تعداد	اعمال	قیمت	دلتا	Σ	% IV	وجه تضمین	آفست	خالص
✓ خرید	اهرم	دارایی پایه ✓	۱		۲۶,۲۷۰	۱					-۲۶,۲۷۰,۰۰۰
✓ خرید	طهرم ۱۰۲۷	اختیار فروذ ✓	۱	۳۰,۰۰۰	۳,۴۸۰	-۰.۷۴	۴۶	۴۸			-۳,۴۸۰,۰۰۰
✓ خرید	طهرم ۱۰۲۶	اختیار فروذ ✓	۱	۲۸,۰۰۰	۲,۳۴۲	-۰.۵۵	۴۶	۵۲			-۲,۳۴۲,۰۰۰
✓ خرید	طهرم ۱۰۲۵	اختیار فروذ ✓	۱	۲۶,۰۰۰	۱,۴۱۰	-۰.۳۴	۴۶	۵۴			-۱,۴۱۰,۰۰۰
+ ۴۶ روز ۰.۲۶ ۲۹,۷۵۰,۰۰۰ -۶۸,۰۰۰ (-۰.۲%)											



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۰۲۶ صهرم ۲۰,۷۲۰.۹ B	۱۰۲۶ صهرم ۱۰,۳۴۵.۵ B	۱۰۲۶ صهرم ۲,۰۶۳ B
۹۰۱۸ صهرم ۷,۳۸۴.۵ B	۱۰۲۵ صهرم ۲,۷۶۰.۳ B	۱۰۲۵ صهرم ۴۵۵.۸ B
۱۰۲۵ صهرم ۵,۳۲۹.۶ B	۹۰۳۰ ضملت ۱,۸۵۶.۲ B	۱۰۲۳ صهرم ۳۰۱.۲ B
۱۰۲۳ صهرم ۴,۴۳۳ B	۱۰۲۳ صهرم ۱,۸۰۸.۹ B	۹۰۳۰ ضملت ۲۶۷.۶ B
۹۰۳۰ ضملت ۳,۷۵۵.۵ B	۱۰۲۴ صهرم ۱,۷۸۳.۹ B	۹۰۴۱ ضستا ۲۶۲.۸ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۰۲۶ طهرم ۵,۵۴۹.۸ B	۱۰۲۶ طهرم ۲,۵۶۸.۷ B	۱۰۲۶ طهرم ۵۰۰.۵ B
۹۰۲۰ طهرم ۳,۱۷۲.۳ B	۱۰۲۴ طهرم ۸۱۱.۴ B	۹۰۴۲ طستا ۱۷۸.۹ B
۱۰۲۴ طهرم ۲,۱۲۱.۲ B	۱۰۲۵ طهرم ۶۱۷.۶ B	۱۰۲۴ طهرم ۱۴۹.۶ B
۹۰۲۱ طهرم ۱,۰۱۲.۹ B	۹۰۴۲ طستا ۴۳۳.۲ B	۱۰۲۵ طهرم ۱۳۹.۵ B
۱۰۲۵ طهرم ۹۲۴.۸ B	۱۰۲۷ طهرم ۱۸۴.۱ B	۱۰۲۷ طهرم ۵۹.۸ B



تحليل تکنیکال هفتگی شاخص کل بورس

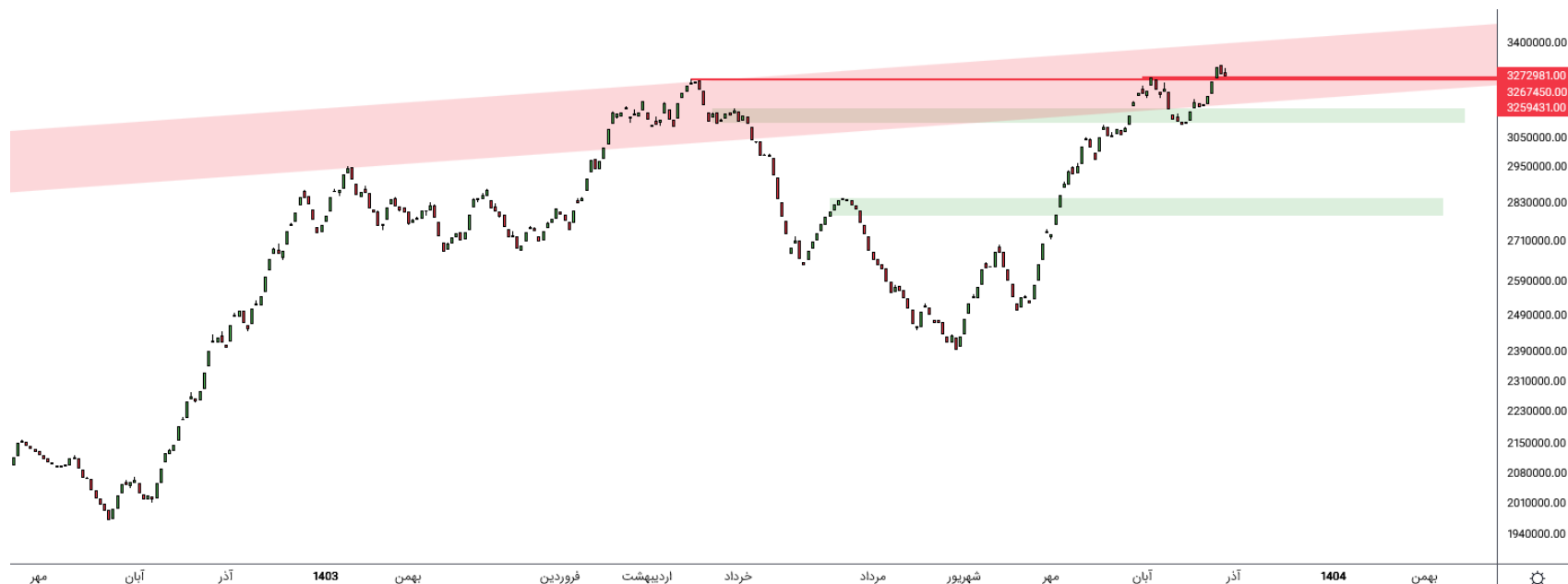


تحلیل تکنیکال هفتگی شاخص کل بورس

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.

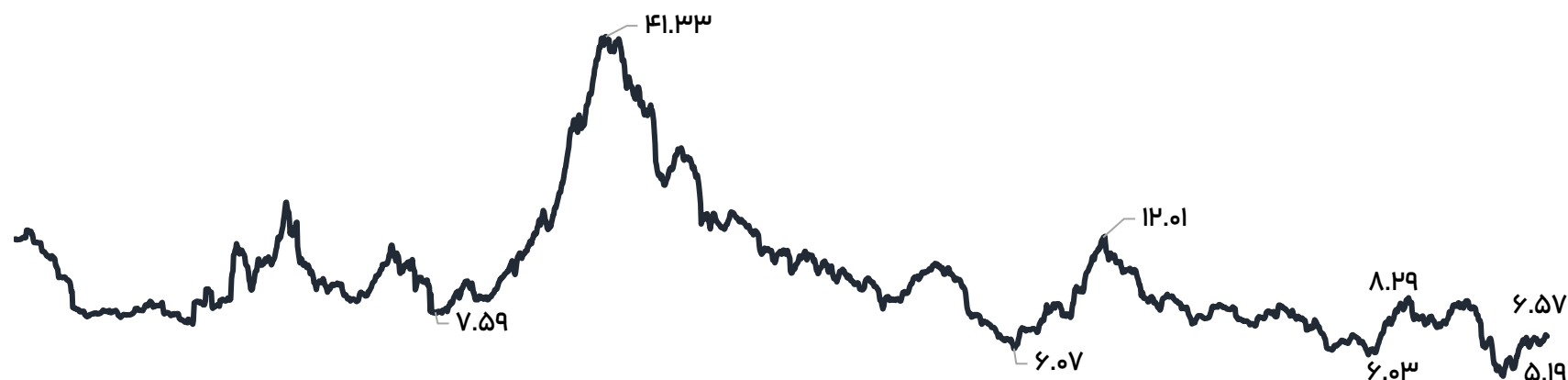
در هفته های اخیر اما، شاهد واکنش مثبت بازار به محدوده ۳ میلیون واحد بودیم (باکس سبز اول درج شده روی چارت) که در نهایت منجر به سقف شکنی مجدد شاخص کل شد. حال باید دید بازار این بار توانایی تثبیت بر فراز سقف تاریخی را دارد یا نه. همچنین مقاومت داینامیک پنج ساله که در نمودار هفتگی مشخص است نیز، بر سر راه شاخص کل قرار دارد که شکست این ناحیه به سمت بالا، می تواند تاییدکننده اتمام پنج سال روند غالب رکودی باشد.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

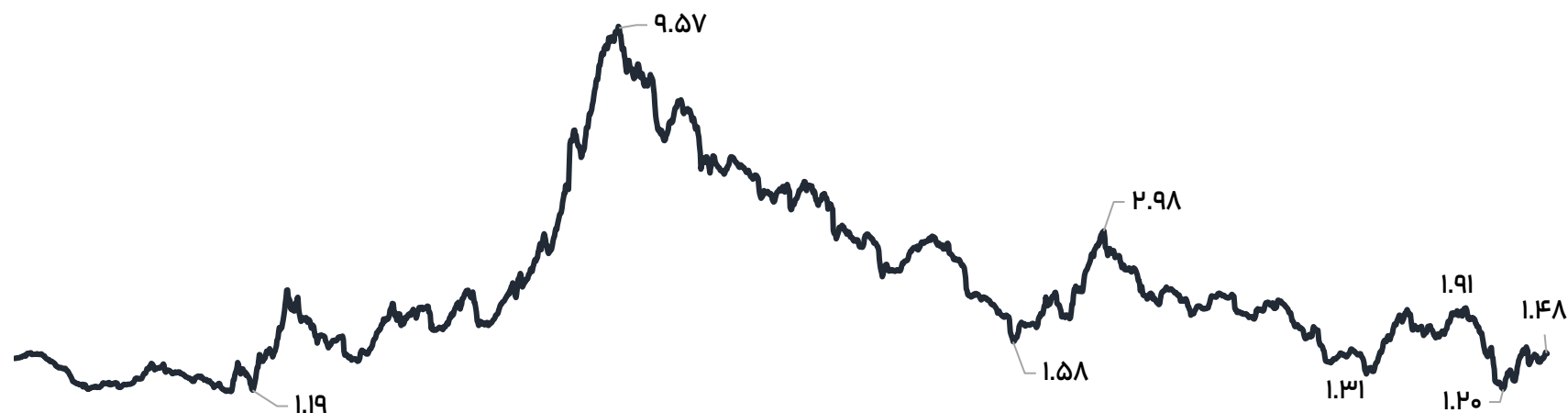
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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 هشت‌ساله‌ی ارزش ریالی و دلاری بازار را مشاهده می‌کنید.

ارزش ریالی بازار بورس (هزار همت)





تسویه t+۱

قادر معصومی مدیر نظارت بر بورس‌ها: موضوع تسویه t+۱ در حال نهایی شدن است و بزودی در هیات‌مدیره مطرح خواهد شد.



نامه رسمی سازمان بورس به وزیر نفت

سازمان بورس با ارسال نامه‌ای رسمی به وزیر نفت، خواستار اعلام فوری نتیجه اصلاح فرمول قیمت‌گذاری خوراک گاز شد؛ درخواستی که می‌تواند مسیر شفافیت در بازار سرمایه را تعیین کند.

پتروشیمی‌های اوره ساز از مالیات معاف شدند.

دبیرکل انجمن صنفی کارفرمایی صنعت پتروشیمی خبر داد: با پیگیری‌های هلدینگ نفت و گاز پارسیان و همراهی انجمن صنفی پتروشیمی، کود اوره با تصویب هیات محترم وزیران رسماً از فهرست مواد خام و نیمه خام موضوع بند «پ» قانون برنامه هفتم خارج شد.



نان

نان روی گروه محصولات اشترو دل، گروه محصولات اسفنجی، گروه محصولات بیسکوییت، گروه محصولات کلوچه، گروه محصولات روغنی و گروه محصولات ویفر افزایش نرخ ۵۳ درصدی اعمال کرد.

غنوش

غنوش نرخ فروش انواع کنسانتره مرکبات را ۴۰ درصد افزایش داد.

ونوین

مجوز افزایش سرمایه ۱۳۵ درصدی بانک اقتصاد نوین از محل تجدید ارزیابی دارایی‌ها صادر شد.



کرک اسپرد پالایشی‌ها

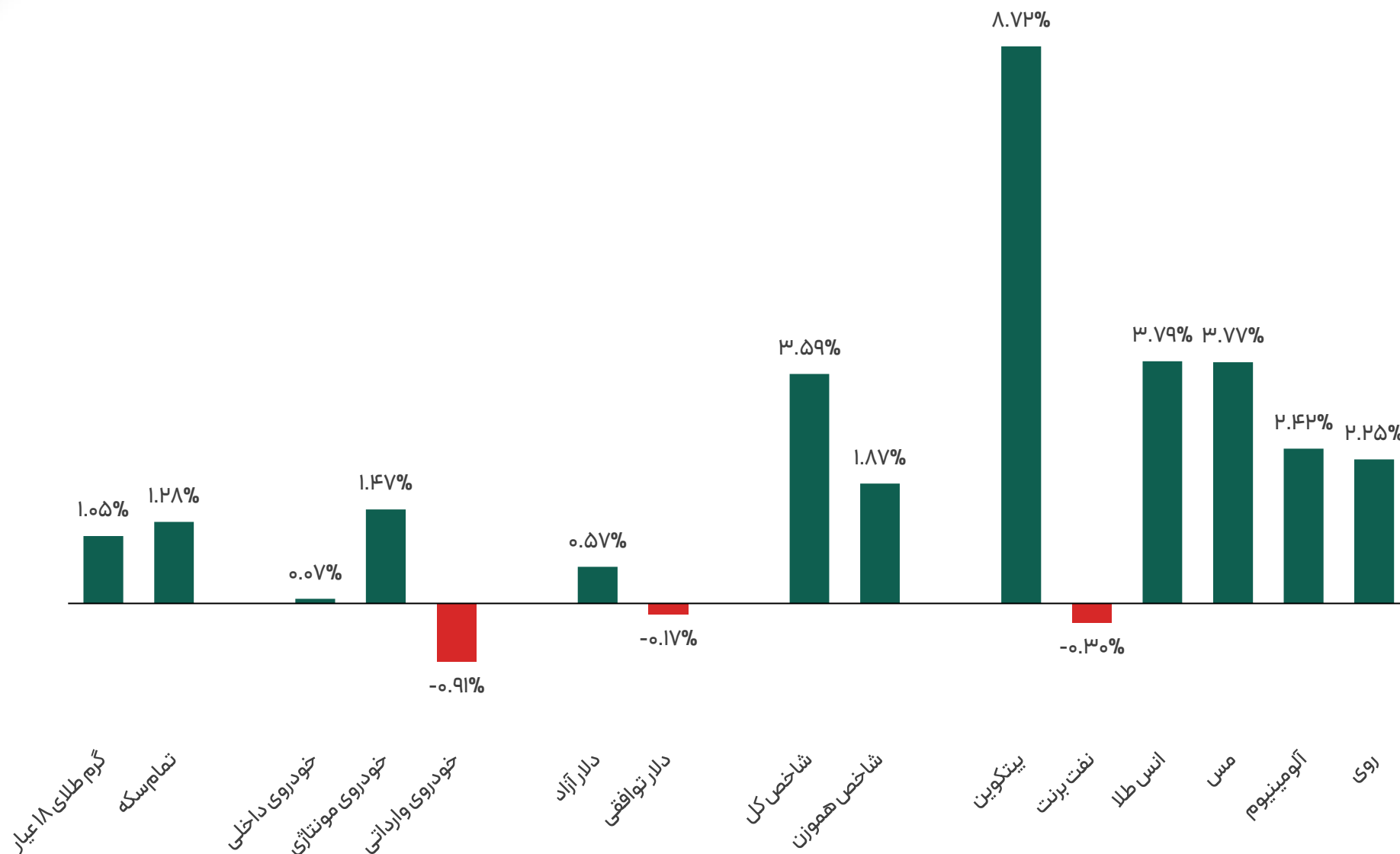
نمودار کرک اسپرد



میانگین کرک اسپرد: شبندر \$ ۵.۲ شاوان \$ ۱۱.۳ شتران \$ ۷.۵ شپنا \$ ۱۳.۶ شبریز \$ ۳.۷ شیراز \$ ۱۱.۱

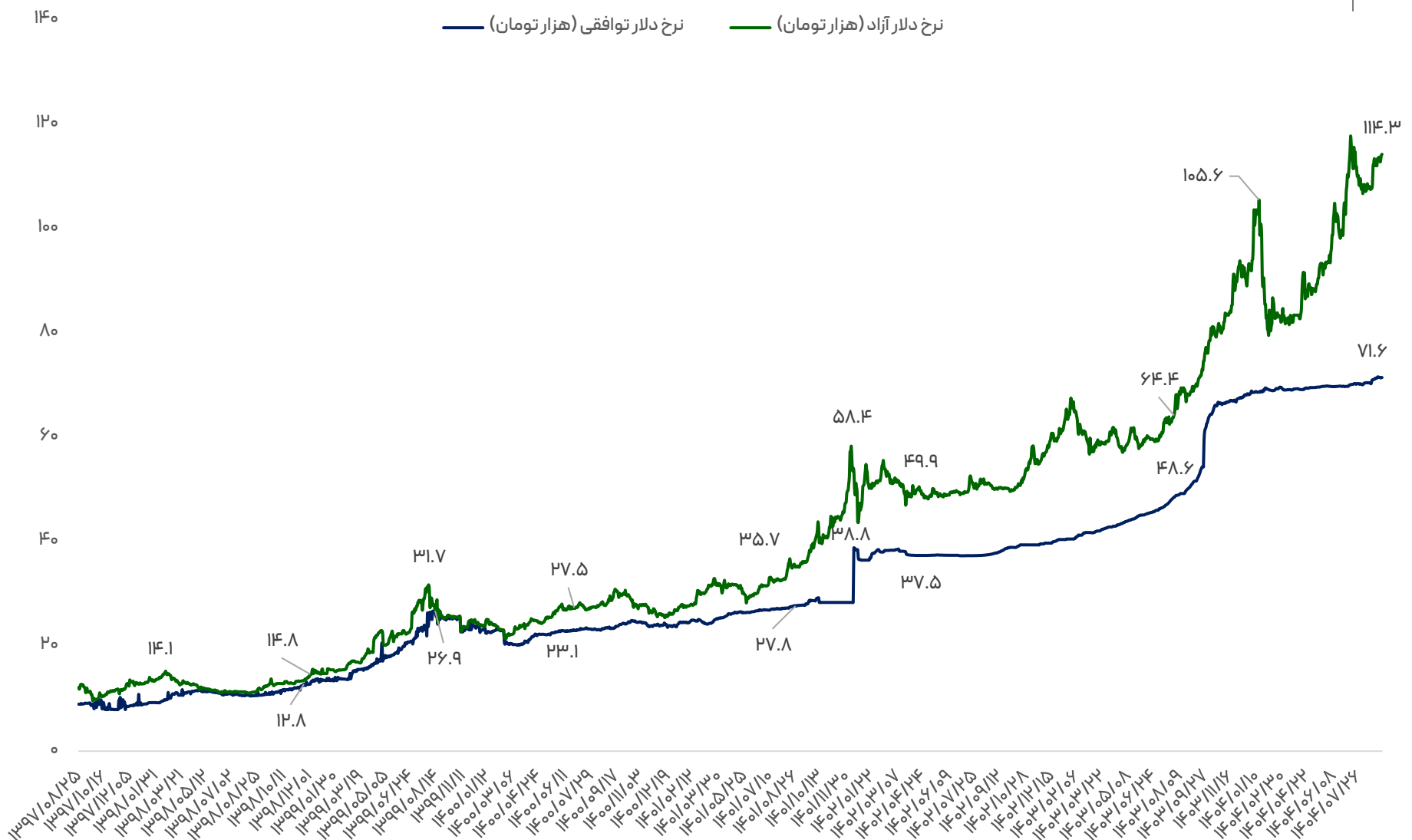


بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر



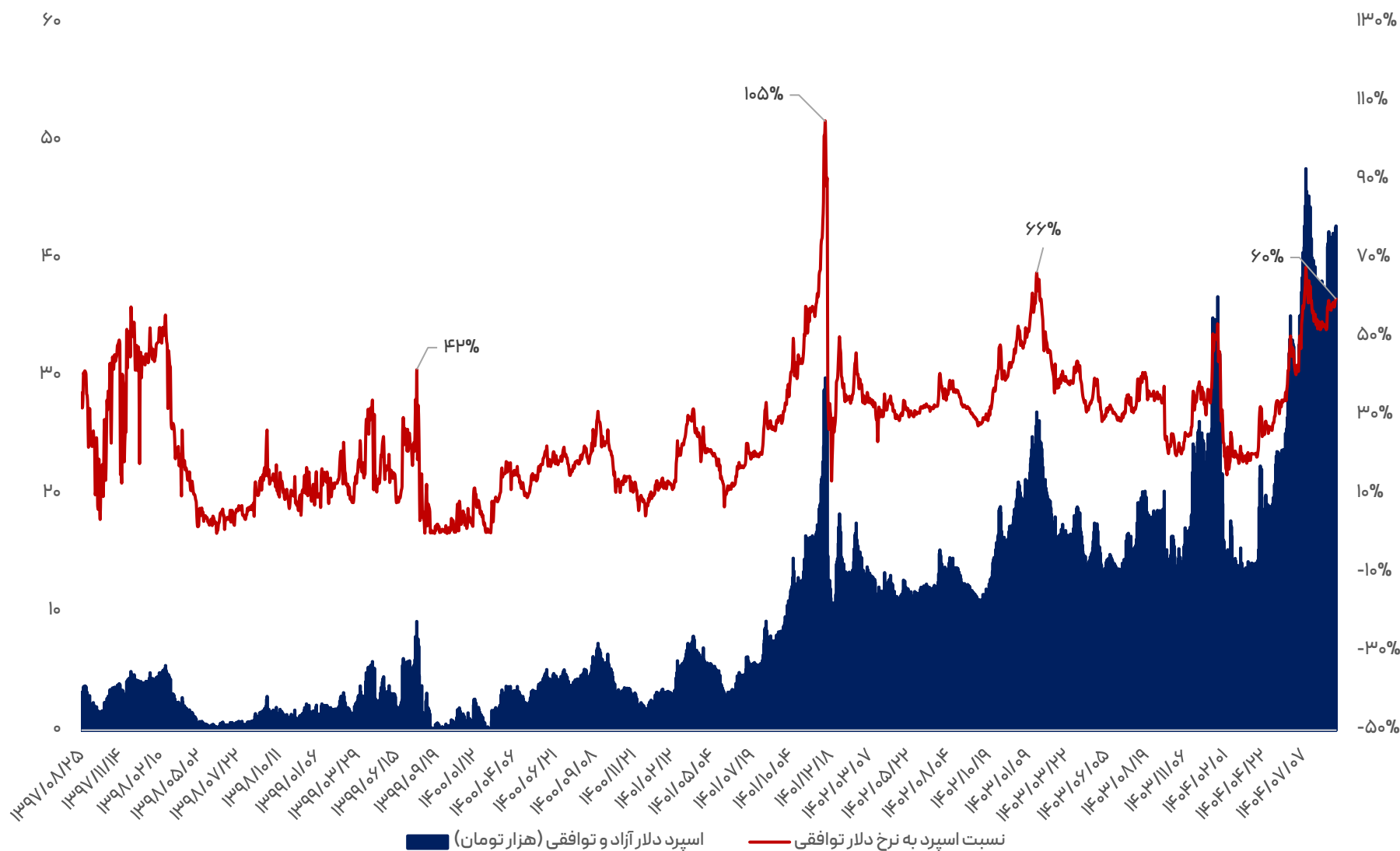
رشد تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با کاهش ۳,۵۵۷ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۷۱۵,۷۱۳ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

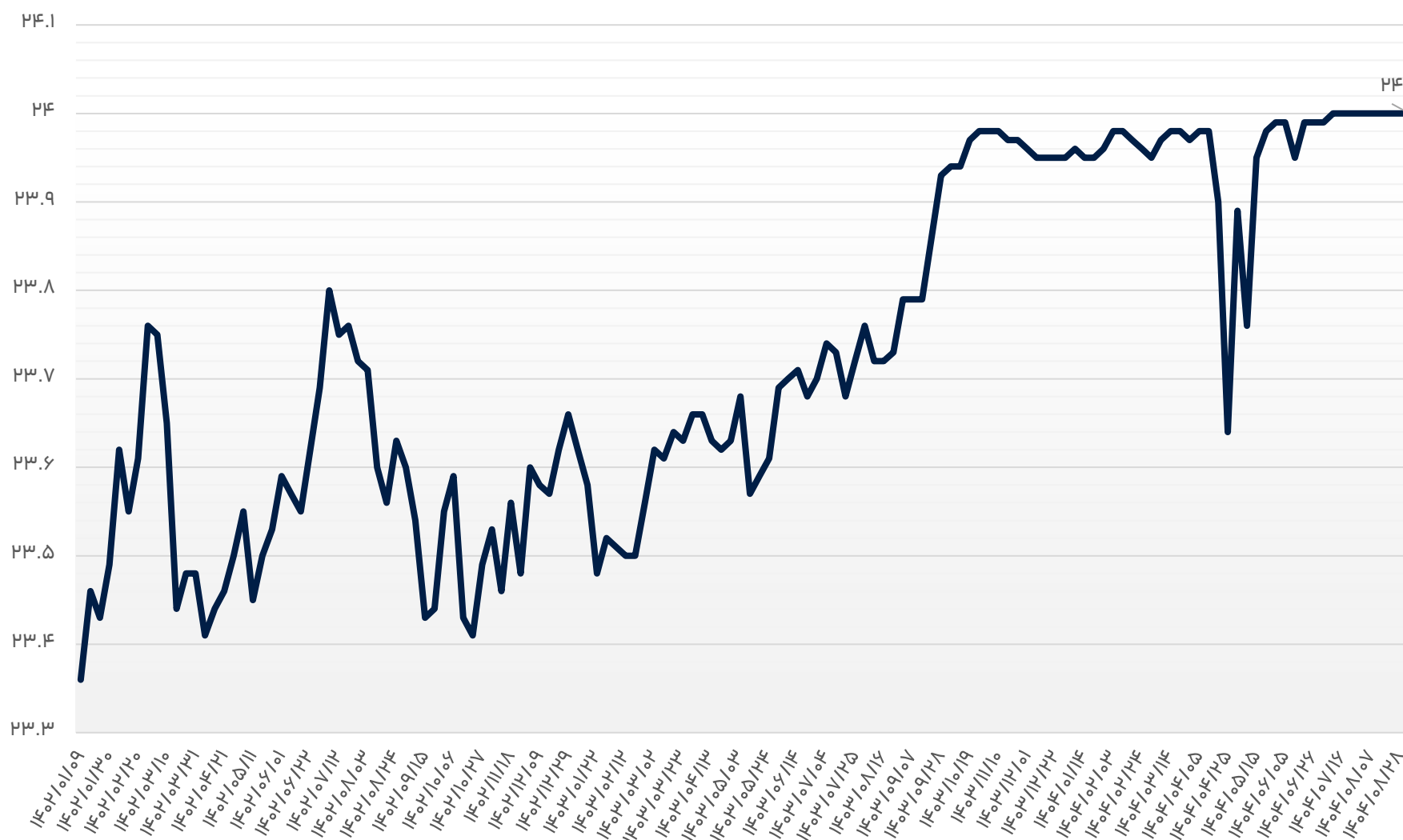
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



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 می‌کنید.



شاخص قیمت مصرف کننده – آبان ماه ۱۴۰۴

شاخص قیمت

در آبان ماه ۱۴۰۴ شاخص قیمت مصرف کننده خانوارهای کشور به عدد ۴۱۷.۵ رسیده است که نسبت به ماه قبل، ۳.۴ درصد افزایش، نسبت به ماه مشابه سال قبل، ۴۹.۴ درصد افزایش و در دوازده ماهه منتهی به ماه جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۴۰.۴ درصد افزایش داشته است.

تورم نقطه به نقطه خانوارهای کشور

منظور از تورم نقطه به نقطه، درصد تغییر عدد شاخص قیمت نسبت به ماه مشابه سال قبل است. در آبان ماه ۱۴۰۴ تورم نقطه به نقطه خانوارهای کشور، ۴۹.۴ درصد بوده است؛ یعنی خانوارهای کشور به طور میانگین، ۴۹.۴ درصد بیشتر از آبان ماه ۱۴۰۳ برای خرید یک «مجموعه کالاها و خدمات یکسان» هزینه کرده‌اند. تورم نقطه به نقطه آبان ماه ۱۴۰۴ در مقایسه با ماه قبل، ۰.۸ واحد درصد افزایش داشته است.



تورم ماهانه خانوارهای کشور

منظور از تورم ماهانه، درصد تغییر عدد شاخص قیمت، نسبت به ماه قبل است. در آبان ماه ۱۴۰۴ تورم ماهانه خانوارهای کشور برابر ۳.۴ درصد بوده است. تورم ماهانه برای گروه‌های عمده «خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات»، ۴.۷ درصد و برای گروه عمده «کالاهای غیرخوراکی و خدمات»، ۲.۶ درصد بوده است.

نرخ تورم سالانه خانوارهای کشور

منظور از نرخ تورم سالانه، درصد تغییر میانگین اعداد شاخص قیمت در یک سال منتهی به ماه جاری، نسبت به دوره مشابه قبل از آن است. در آبان ماه ۱۴۰۴ نرخ تورم سالانه برای خانوارهای کشور به ۴۰.۴ درصد رسیده که نسبت به همین اطلاع در ماه قبل، ۱.۵ واحد درصد افزایش یافته است.

درصد تغییرات شاخص قیمت در دهک‌های هزینه‌ای کل کشور در آبان ماه ۱۴۰۴

نرخ تورم سالانه کشور در آبان ماه ۱۴۰۴ برابر ۴۰.۴ درصد است که دامنه تغییرات آن برای دهک‌های مختلف هزینه‌ای از ۳۹.۵ درصد برای دهک دهم، تا ۴۱.۷ درصد برای دهک اول است. بر این اساس فاصله تورمی دهک‌ها در این ماه به ۲.۲ واحد درصد رسید که نسبت به ماه قبل (۱.۹ واحد درصد) ۰.۳ واحد درصد افزایش داشته است.



با سپاس از توجه شما

