

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۲۱ آذرماه ۱۴۰۴



دیدگاه دانایان

هفته اخیر بازار سرمایه با تداوم تقاضا در کلیت بازار سپری شد. رسیدن نرخ دلار در بازار آزاد به بیش از ۱۲۵ هزار تومان، کماکان این باور را به بازارها القا می‌کند که تشدید تورم در راه بوده و پول، در حال هجوم به بازارهای مختلف برای حفظ ارزش خود در برابر تورم است.

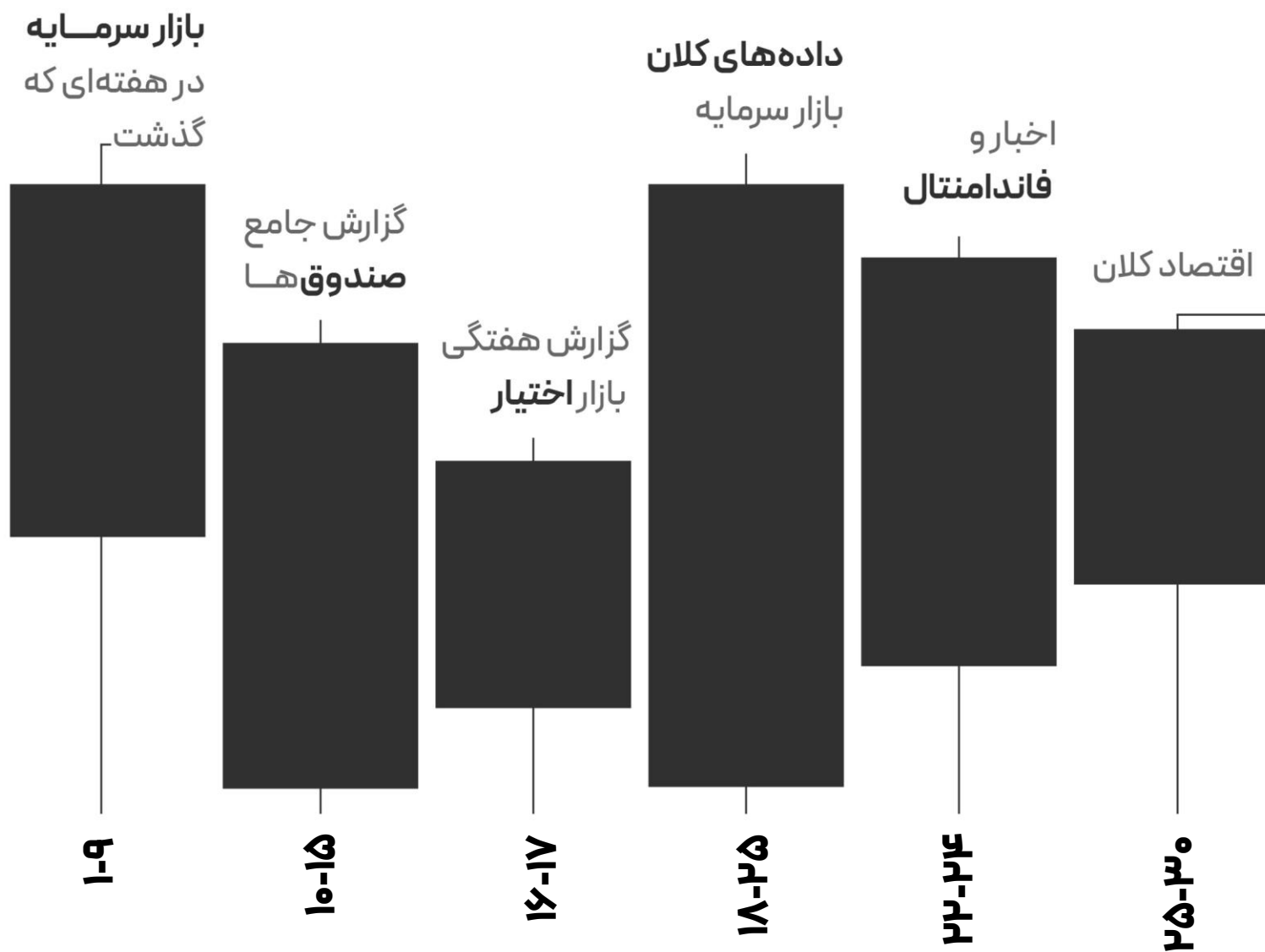
طی هفته اخیر، شاخص کل با رشد بیش از ۵ درصدی و شاخص هموزن با رشد بیش از ۴ درصدی همراه شدند. در سایر بازارهای موازی شامل ارز، طلا و خودرو هم شاهد تشدید تقاضا و افزایش قیمت‌ها بودیم.

برایند گردش حقیقی‌ها در معاملات خرد بازار سهام هفته پیش بالاخره مثبت شد و بیش از ۳.۵ همت پول حقیقی به معاملات خرد بازار سهام وارد شد. در سوی مقابل اما نکته قابل توجه، گردش نقدینگی حقیقی‌ها در صندوق‌های طلا بود که بالاخره بعد از حدود ۴۰-۵۰ روز تقویمی شاهد خروج پول حقیقی از این صندوق‌ها بودیم! پولی که به نظر بیشتر جذب صندوق‌های درآمد ثابت شد و این صندوق‌ها نزدیک به ۴.۸ همت پول حقیقی جذب کردند.

به لحاظ تکنیکالی، همانطور که پیش تر هم اشاره شد، شرایط خوبی برقرار شده است. شاخص کل پس از سقف شکنی موفق به تثبیت بر فراز سقف تاریخی شده و همچنین هر نوع خط داینامیک مقاومتی ۵ ساله از سقف سال ۹۹ تا کنون را به سمت بالا شکسته است. بنابراین تأیید اتمام اصلاح کوتاه مدتی بازار به لحاظ تکنیکالی مدتی ست که صادر شده است.

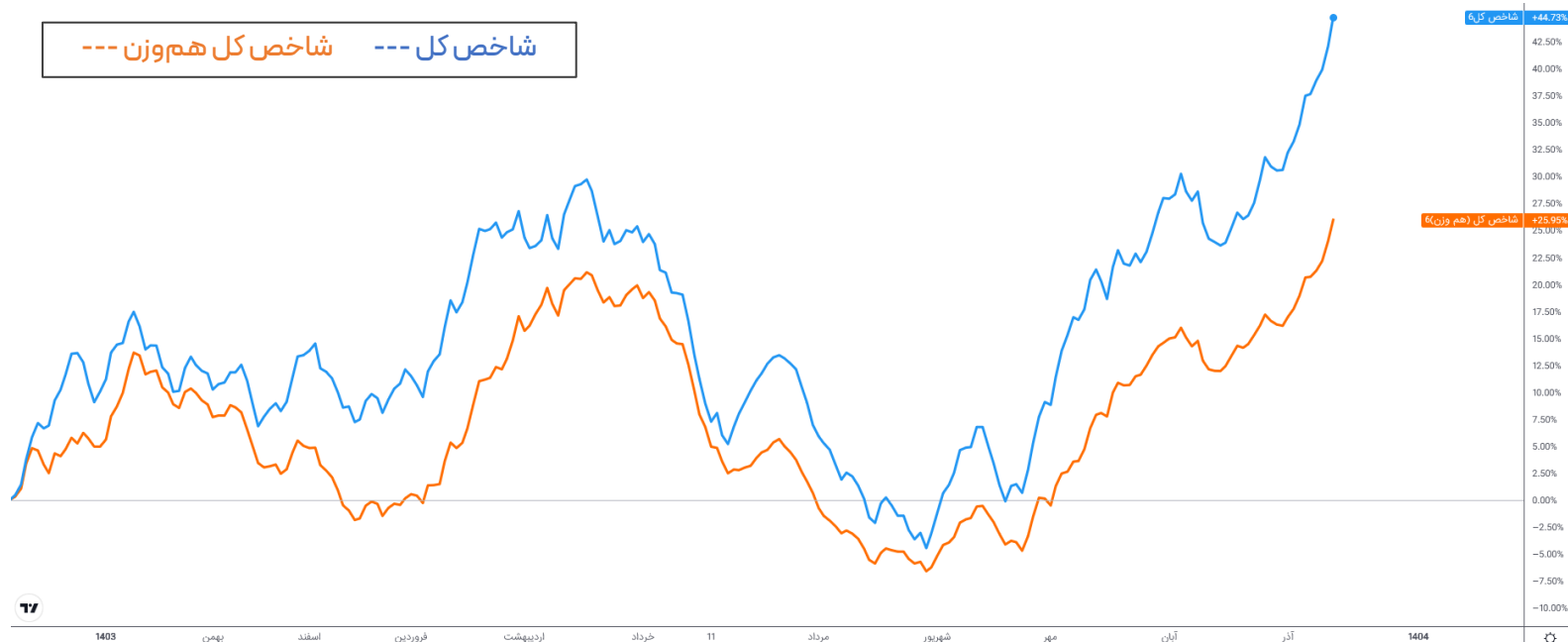
همچنین در پارامترهای نقدینگی بازار، شاهد افزایشی شدن ارزش معاملات خرد، شکست میانگین های متحرک توسط میله های ارزش معاملات خرد روزانه، کراس رو به بالا در میانگین هفتگی و ماهانه و همچنین ازسرگیری ورود پول حقیقی به معاملات خرد بازار سهام هستیم که همگی به نوعی تاییدکننده روند صعودی فعلی در بازار هستند.

چنانچه خروج پول ثبت شده از بازار طلا طی هفته های آتی نیز ادامه پیدا کند و با اعتمادسازی بورس، این پول سمت بازار سهام روانه شود، شاهد اتفاقات بسیار خوبی در بازار سرمایه، در افق چندماه آینده خواهیم بود.



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	+ ۵.۳۷ %	+ ۱۴.۳۵ %	+ ۳۵.۴۶ %	+ ۱۹.۱۳ %	+ ۴۴.۷۳ %
بازده شاخص کل هم‌وزن	+ ۴.۲۵ %	+ ۱۰.۵۹ %	+ ۲۶.۲۵ %	+ ۷.۹۶ %	+ ۲۵.۹۵ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

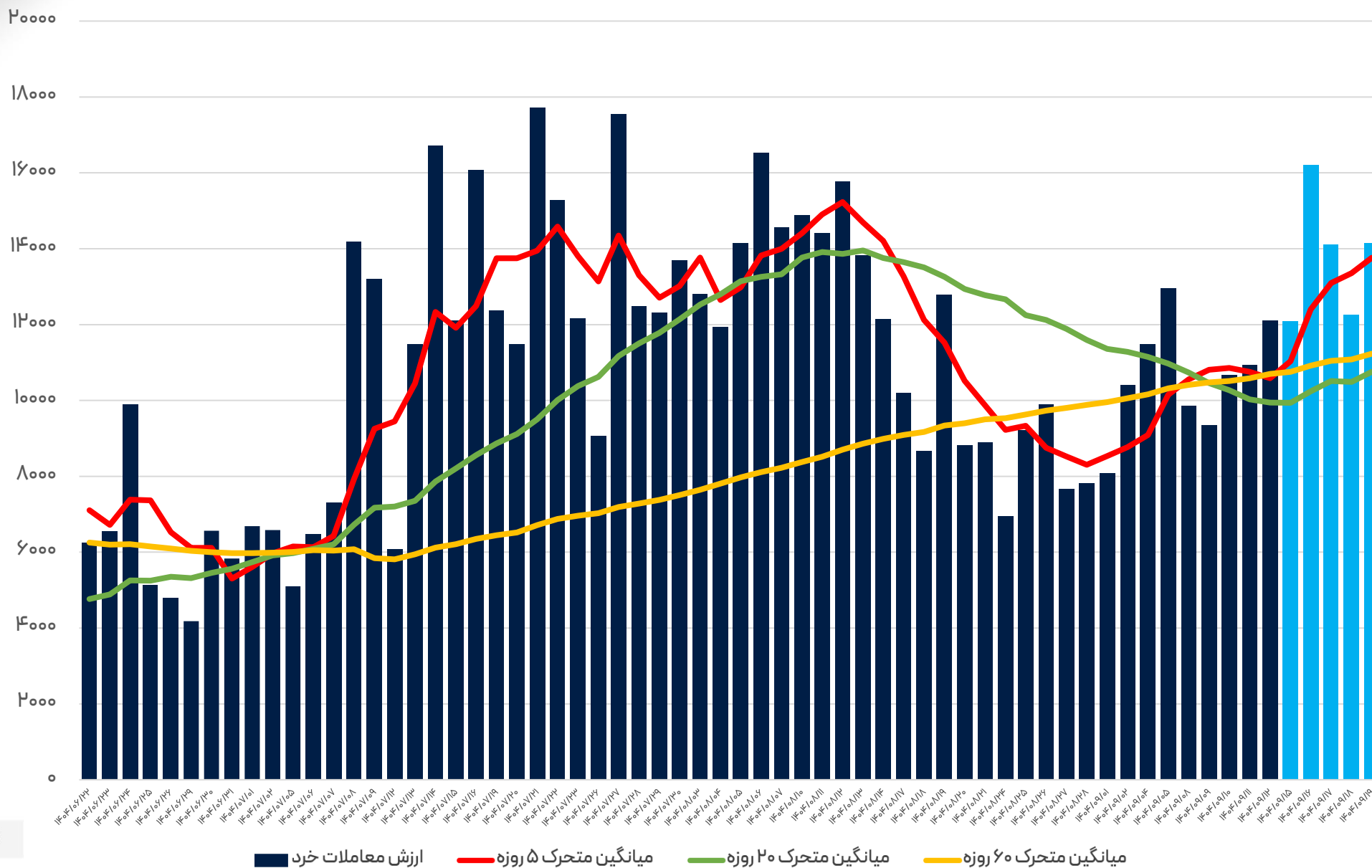
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل 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.



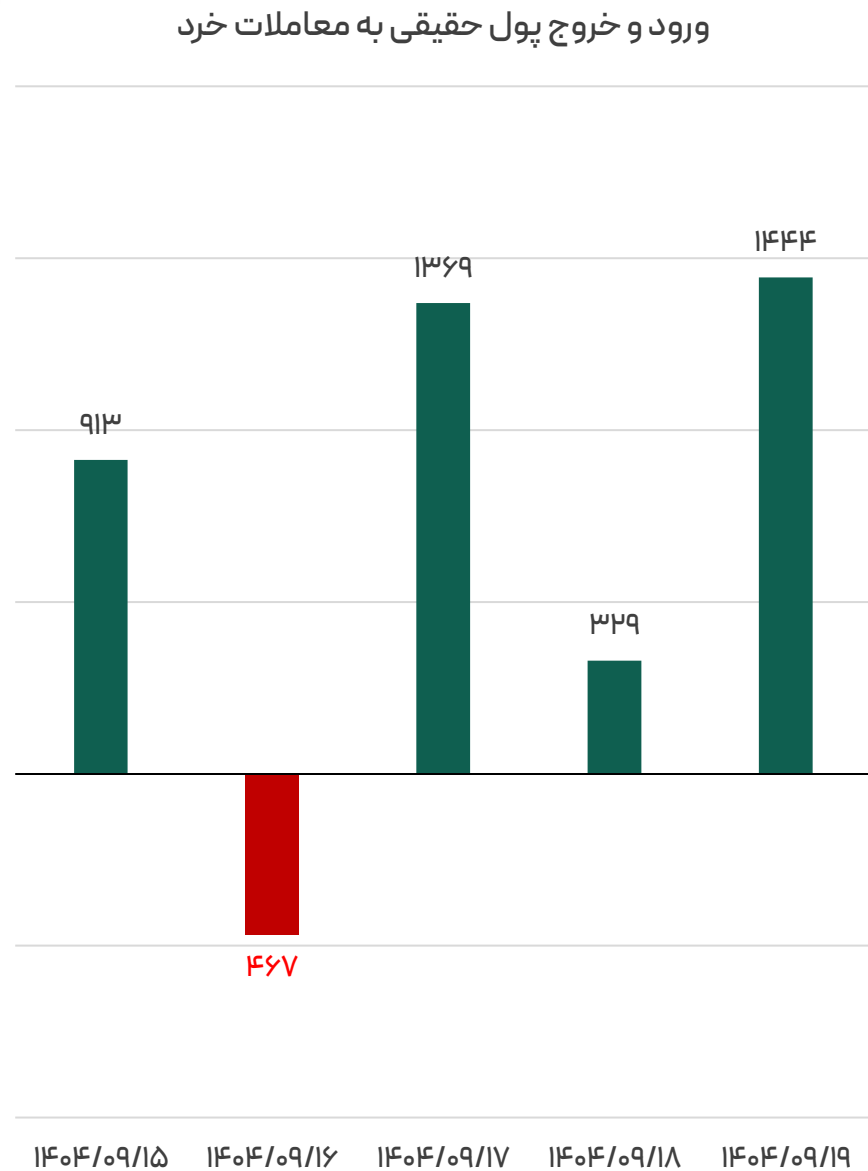
در تصویر، نمودار نسبی شاخص هم وزن به شاخص کل را مشاهده می‌کنید. مدت‌هاست که بازده و عملکرد سهام شاخص‌ساز و شاخص کل، نسبت به سهام و صنایع کوچک‌تر بازار و شاخص کل هم وزن، بهتر و قوی‌تر بوده است. علی‌رغم نوسانات مثبتی که در چند ماه اخیر در این نمودار و رشدهای مقطعی صنایع کوچک‌تر بازار بودیم، اما کماکان روند کلی نمودار نزولی‌ست و کف قبلی هم از دست رفته است. بنابراین برای کسب بازده از سهام کوچک‌تر و عملکرد بهتر نسبت به شاخص‌سازان، کماکان باید منتظر ماند. بازگشت نمودار به سمت بالا، تا زمانی که خط روند نزولی میان مدت به سمت بالا شکسته نشود، ممکن است صرفاً نوسان مثبت مقطعی مشابه حرکات قبل باشد. بنابراین تایید نهایی بازده و عملکرد بهتر صنایع کوچک‌تر نسبت به شاخص‌سازان، با شکست خط روند نزولی ترسیم شده بصورت خط چین روی چارت، محقق خواهد شد. عملکرد بهتر، در روندهای اصلاحی به این صورت ظاهر می‌شود که اصلاح، ضعیف‌تر و با شتاب کمتری شکل بگیرد.



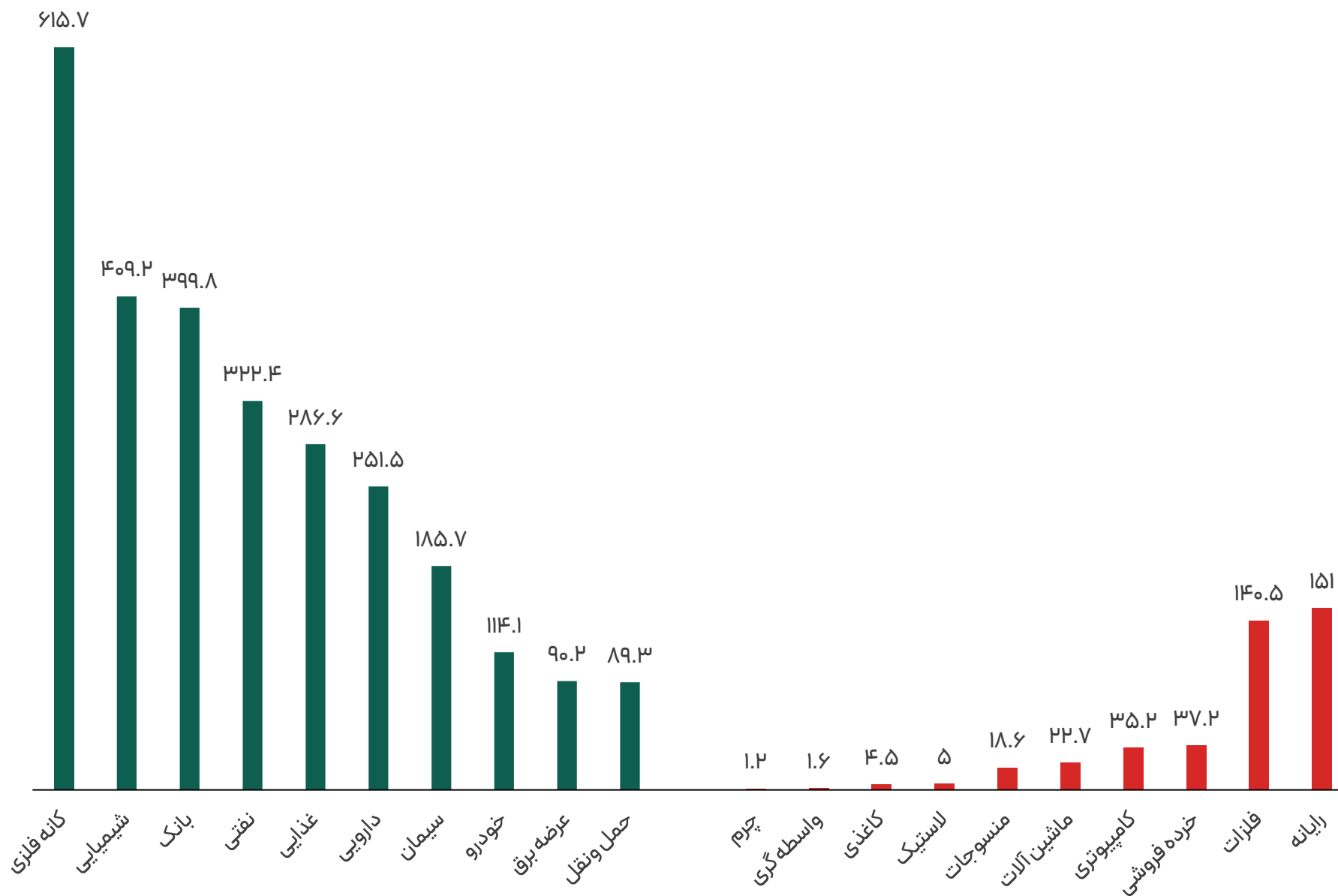
ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)



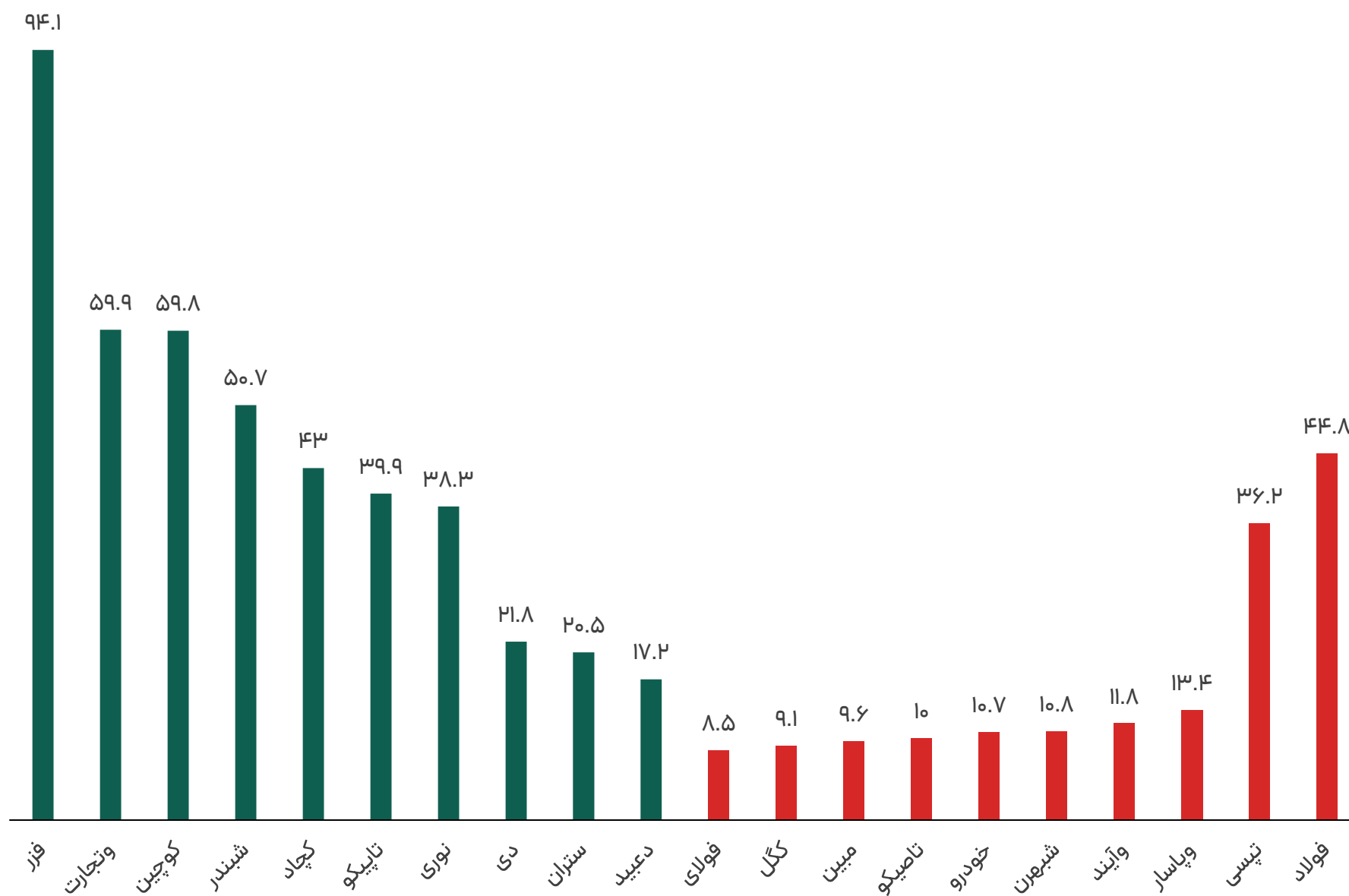
ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)



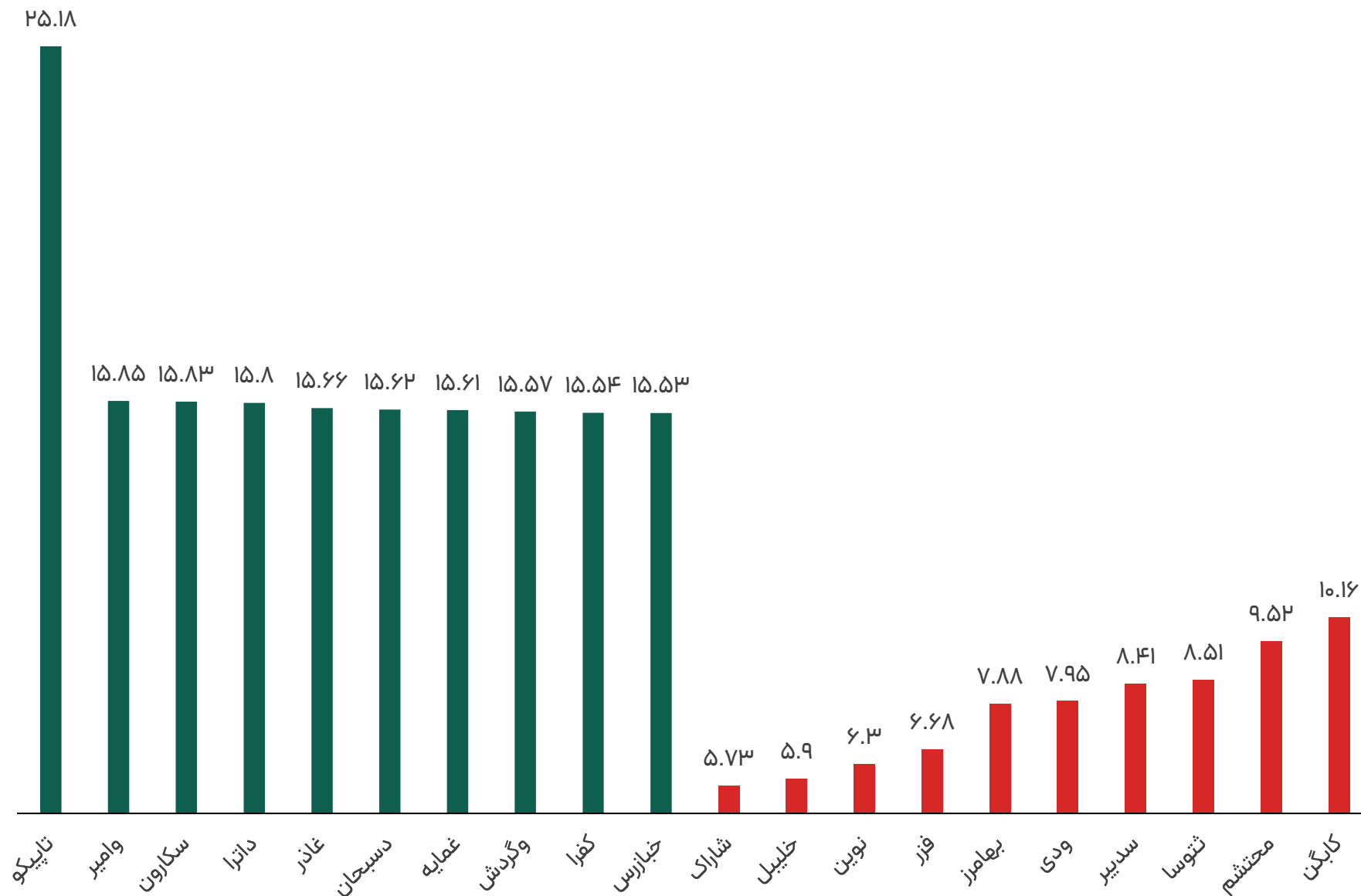
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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 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	بازدهی ماهانه ↓	بازدهی سه ماهه	سالانه	میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل
				یک ماهه	سه ماهه					
 دوبکس	۳۶.۳۲	۸۶.۴۳	۴.۲۷	۷۶.۶۸	۵۹.۲۴	-۲.۶۸	۲.۱۷	۰.۹۵	۲.۰۶	۲.۱۲
 موج	۳۳.۴۶	۷۲.۶۱	۷۴.۳۶	۵۱۹.۱۱	۵۵۵.۳۷	-۳.۳۱	۱.۹۷	۰.۹۵	۱.۸۷	۱.۹۳
 جهش	۳۰.۵۷	۶۷.۴۴	۳۴.۲۸	۱۸۰.۳۷	۱۸۱.۷	-۱۲.۴۴	۲.۱۳	۰.۸۲	۱.۷۵	۱.۹۷
 پیشران	۲۸.۴۳	۵۵.۶۱	۳۰.۴۵	۵.۲۲	۱۳.۴۹	-۲.۲۹	۱.۷۲	۰.۹۴	۱.۶۲	۱.۶۶
 توان	۲۷.۹۵	۶۳	۲۷.۹	۲۲۲.۷۷	۲۲۷.۶۵	-۱۱.۵۲	۲.۰۶	۰.۸۷	۱.۷۹	۲
 بیدار	۲۵.۰۳	۵۸.۶۸	۴۲.۱۲	۱۳۴.۹۹	۱۸۹.۲۶	-۱۳.۲۸	۲.۱۲	۰.۸۵	۱.۸	۲.۰۴
 شتاب	۲۴.۶۲	۵۵.۳۶	۵۱.۱۲	۱۳۳.۹۶	۱۵۸.۵	-۱۲.۲۹	۲.۰۴	۰.۸۶	۱.۷۵	۱.۹۷
 نارنج اهرم	۲۴.۳۱	۶۷.۶۲	۶۳.۵	۱۲۴.۹۵	۱۸۷.۱۳	-۱۰.۸۴	۱.۹۵	۰.۹۱	۱.۷۷	۱.۹۶
 اهرم	۲۱.۹۵	۵۶.۶۵	۲۰.۴	۷۹۹.۲	۹۲۴.۸	-۸.۹۳	۱.۸۲	۰.۸۹	۱.۶۲	۱.۷۶



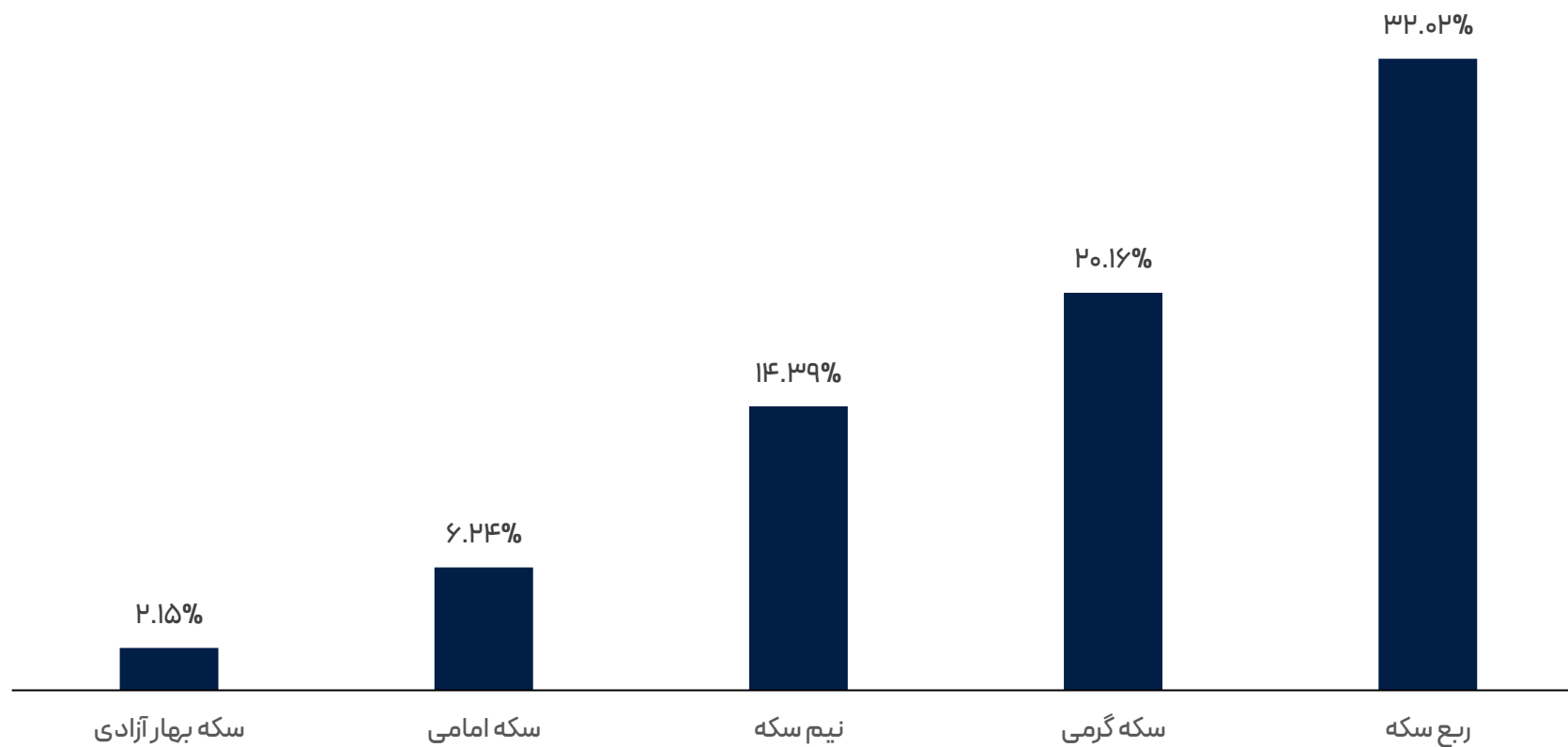
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۱.۰۲%) ۱,۲۹۰,۰۰۰ ریال انس طلا انس نقره (۰.۱۹%) ۴,۲۹۹ دلار انس نقره (۰%) ۶۱ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حباب
تمام سکه طرح جدید ۴۱۱ آینده	۱,۳۷۷,۸۹۰	۵.۵۲	۵.۵۵
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ رفاه	۱,۳۷۶,۵۰۰	۵.۵۳	۵.۴۵
تمام سکه طرح جدید ۴۱۲ سامان	۱,۳۸۴,۰۰۰	۵.۶۸	۶.۰۲
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۲,۶۸۹,۰۰۰	۵.۷۴	۴.۶۹
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۳۷۵,۰۰۰,۰۰۰	۵.۶۹	۵.۳۳
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۱۷,۶۰۰,۰۴۰	۵.۵۲	-۰.۸۱



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
 فیروزه	۲۰.۲۸	۴۵.۸۱	-۴۸.۸	۹.۸۲	۱۵.۳	۱.۸۱	۰.۳۳
 وبازار	۱۹.۶۲	۵۲.۱۴	۵۳.۹۴	۱.۴۵	۱.۸۷	۱.۷۲	۰.۵۳
 هامون	۱۸.۷۶	۳۰.۴۲	۲۶.۹۳	۳.۱	۳.۲۹	۰.۹۳	۰.۴۴
 آرام	۱۸.۶۱	۳۹.۳۷	۳۳.۸۳	۱۵.۰۸	۱۴.۳۵	۱.۰۹	۰
 سرو	۱۷.۵۲	۳۴.۷۵	۴۹.۰۱	۲۸.۴۵	۴۷.۷	۱.۴۲	-۰.۰۶
 پیروز	۱۷.۴۴	۴۲.۳۸	۱۵.۴۶	۰.۱۸	۰.۸۷	۱.۰۹	۰.۴۹
 اتیمس	۱۶.۹۱	۳۵.۶۷	۳۷.۹۶	۰.۶	۲.۱۷	۰.۲۲	-۰.۲۵
 ابتکار	۱۶.۶۷	۲۸.۱۸	۲۶	۰.۵	۱.۰۲	-۰.۱۲	-۰.۲۴
 هومان	۱۶.۵۵	۳۵.۸۴	۴۵.۶۷	۰.۶	۰.۳۳	-۰.۱۷	۰.۰۶

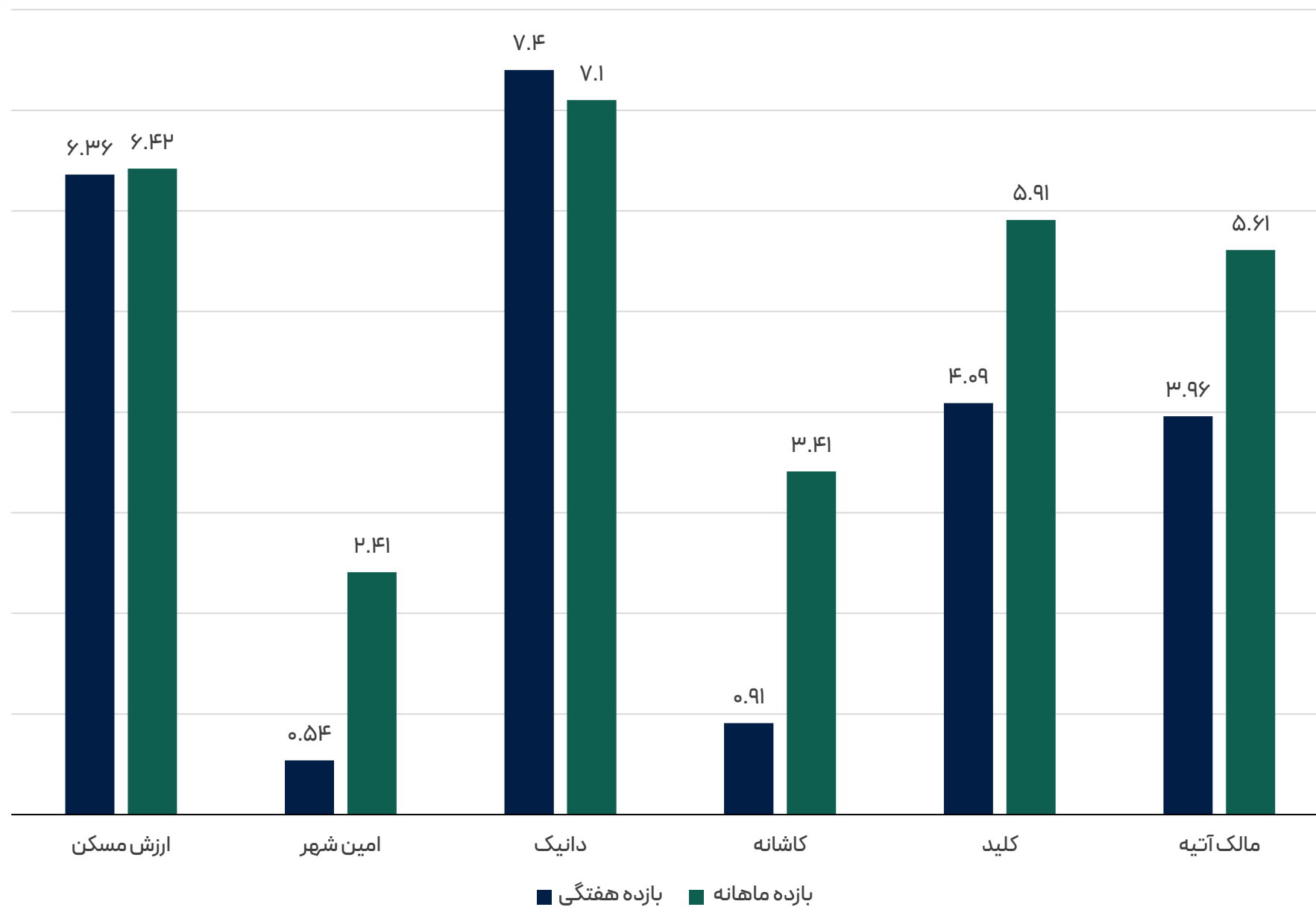


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه		یک ماهه	سه ماهه
 آلیاژ	۲۳.۸۴	۵۰.۱۵	۴۰.۶۶	۴.۱۳	۰.۹۷	-۰.۸۷	-۰.۹۱
 استیل	۲۲.۷۷	۵۱.۴۳	۲۷.۲۹	۱۲.۲۲	۱.۱۷	-۰.۵۱	-۰.۲۸
 دایب متال	۲۱.۷۵	۵۰.۹۶	۳۵.۲۲	۵.۹۳	۰.۵۴	-۰.۱۲	۰.۰۸
 فلزا	۲۱.۰۸	۵۴.۸	۵۳.۱	۶.۸۹	۰.۱۲		-۰.۹۹
 آذرین	۱۹.۳۶	۵۰.۹۴	۳۸.۷۷	۲.۰۲	-۰.۰۹	-۰.۰۵	-۰.۰۴
 پتروداريوش	۱۸.۵۲	۳۱.۱۵	۲۲.۵۱	۲.۱۹	-۰.۲۳	-۰.۸۱	-۰.۴۵
 روبین	۱۸.۴۷	۴۳.۶۴	۲۶.۴	۴.۸۵	-۰.۳۲	۰.۲۷	۰.۲۱
 پتروآگاه	۱۸.۳۶	۳۳.۳۱	۴۳.۶	۴.۹۷	۰.۳۹	-۰.۸۲	-۱.۰۵
 رسانا	۱۸.۱۷	۳۱.۹۵	۴.۰۹	۶.۲۳	۰.۳۴	۰.۲۵	۰.۴۲



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)

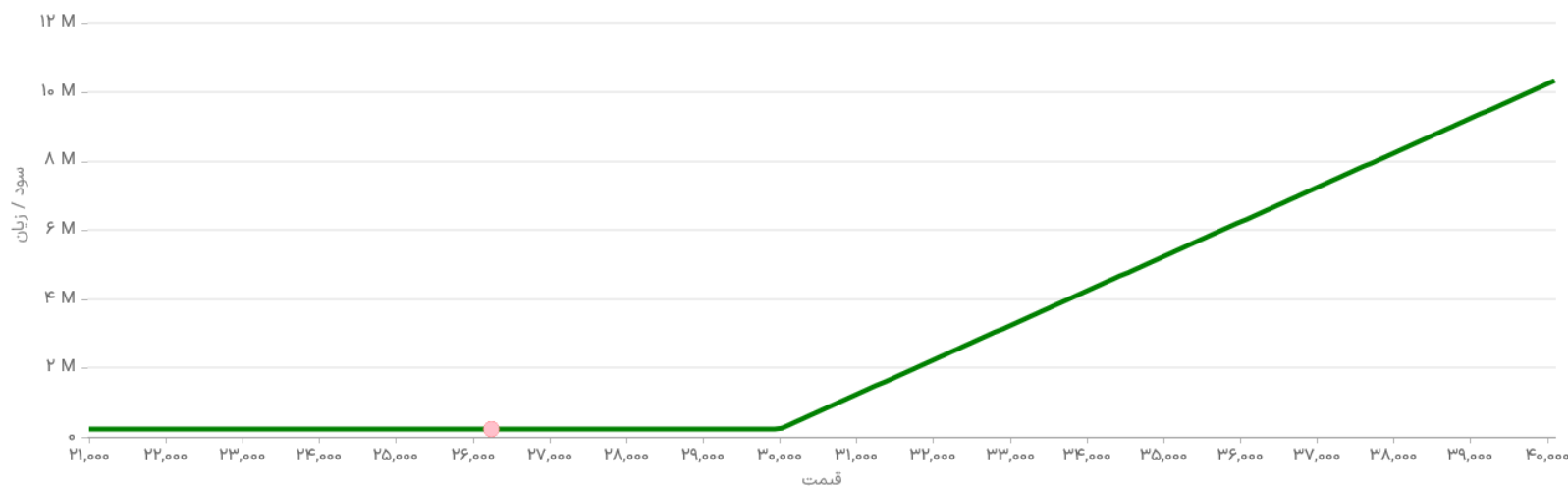


گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

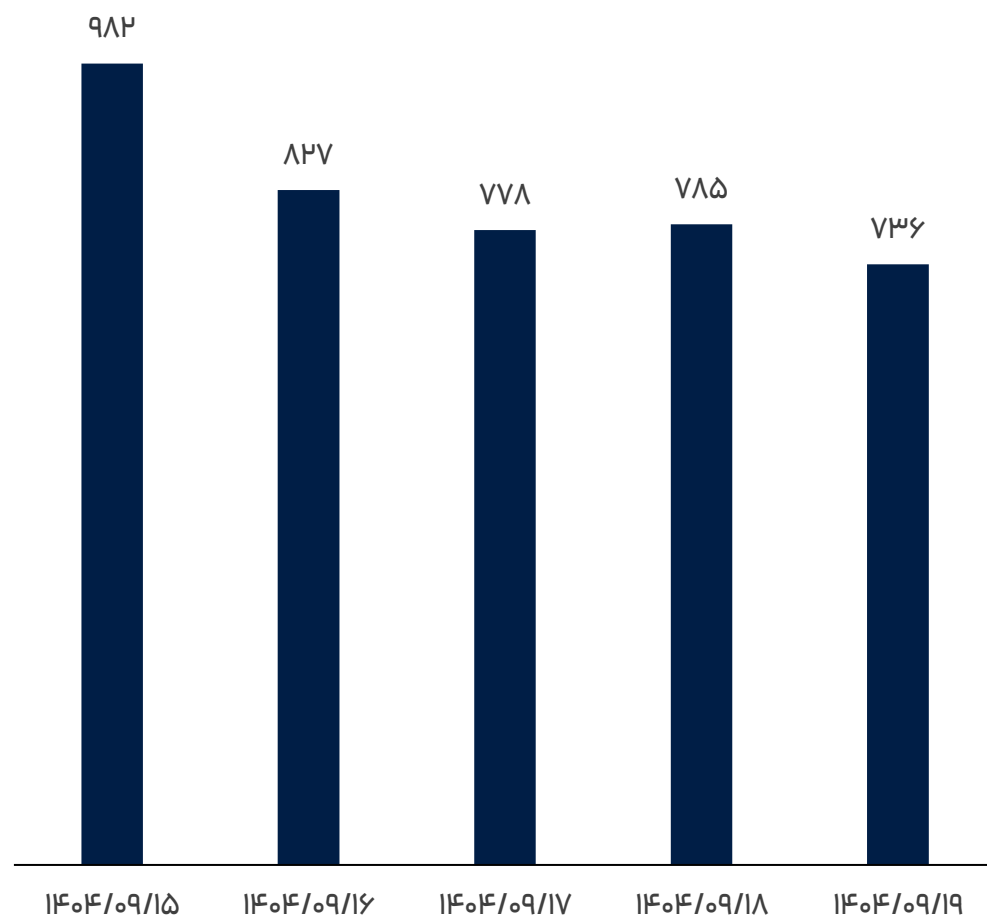
مروری بر استراتژی بیمه دارایی پایه (Protective Put) با قراردادهای اختیار فروش برج ۱۰ صندوق اهرم (پیشنهاد شده در بولتن هفتگی منتهی به ۷ آذرماه) این استراتژی با خرید همزمان دارایی پایه (صندوق اهرم) و خرید اختیار فروش آن انجام می‌شد. اشاره شد که با توجه به اینکه دیدگاه و ریسک‌پذیری معامله‌گر به چه صورت باشد، قراردادهای طهرم ۱۰۲۷، طهرم ۱۰۲۶ و طهرم ۱۰۲۵ می‌توانند مناسب باشند. طهرم ۱۰۲۷ استراتژی بدون ریسک می‌ساخت و سودآوری استراتژی از قیمت ۳,۰۲۱ تومان در صندوق اهرم آغاز می‌شود. حداکثر ریسک استراتژی با استفاده از طهرم ۱۰۲۶ اما ماهانه ۱.۴ درصد می‌باشد و در عوض، سودآوری استراتژی از قیمت ۲,۸۶۵ تومان در صندوق اهرم آغاز می‌شود. و همچنین با استفاده از طهرم ۱۰۲۵، حداکثر ریسک استراتژی ماهانه ۴ درصد می‌باشد و در عوض، از قیمت ۲,۷۷۰ تومان در صندوق اهرم، سودآوری استراتژی آغاز می‌شود. (قیمت امروز صندوق اهرم، شنبه ۱۵ آذرماه: ۳۰۴۰ تومان)

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



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

روزانه	هفتگی	ماهانه
ضهرم ۱۱۲۶ ۸۹۲.۲ B	ضهرم ۱۰۲۶ ۷,۱۴۳.۹ B	ضهرم ۱۰۲۶ ۳۱,۵۶۲.۱ B
ضهرم ۱۱۲۵ ۸۴۹.۸ B	ضهرم ۱۰۲۵ ۲,۰۳۷.۹ B	ضهرم ۱۰۲۵ ۸,۳۱۲.۱ B
ضخود ۱۳۰۹ ۳۹۲.۱ B	ضهرم ۹۰۲۱ ۱,۸۹۵.۵ B	ضهرم ۱۰۲۳ ۵,۷۷۹.۳ B
ضستا ۱۰۵۲ ۲۹۳.۳ B	ضهرم ۱۰۲۷ ۱,۵۹۷.۸ B	ضهرم ۱۰۲۴ ۵,۲۲۵.۷ B
ضملت ۱۰۰۸ ۲۹۱.۹ B	ضستا ۱۰۵۲ ۱,۵۱۳.۸ B	ضهرم ۱۰۲۷ ۴,۰۴۰ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

روزانه	هفتگی	ماهانه
طهرم ۱۱۲۵ ۲۲۶.۳ B	طهرم ۱۰۲۶ ۲,۴۴۲.۱ B	طهرم ۱۰۲۶ ۸,۹۶۶.۵ B
طستا ۱۰۵۳ ۹۰.۹ B	طهرم ۹۰۲۱ ۵۲۴.۶ B	طهرم ۱۰۲۴ ۲,۴۹۷.۳ B
طهرم ۱۱۲۶ ۵۷ B	طهرم ۱۱۲۵ ۳۵۶.۳ B	طهرم ۱۰۲۵ ۱,۵۱۴.۲ B
طهرم ۱۱۲۳ ۴۶.۲ B	طهرم ۱۰۲۷ ۲۴۴.۸ B	طهرم ۹۰۲۱ ۷۲۰.۵ B
طخود ۱۳۱ ۴۵.۶ B	طهرم ۱۰۲۵ ۲۴۰.۵ B	طهرم ۱۰۲۷ ۶۲۸.۶ B



تحليل تکنیکال 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.

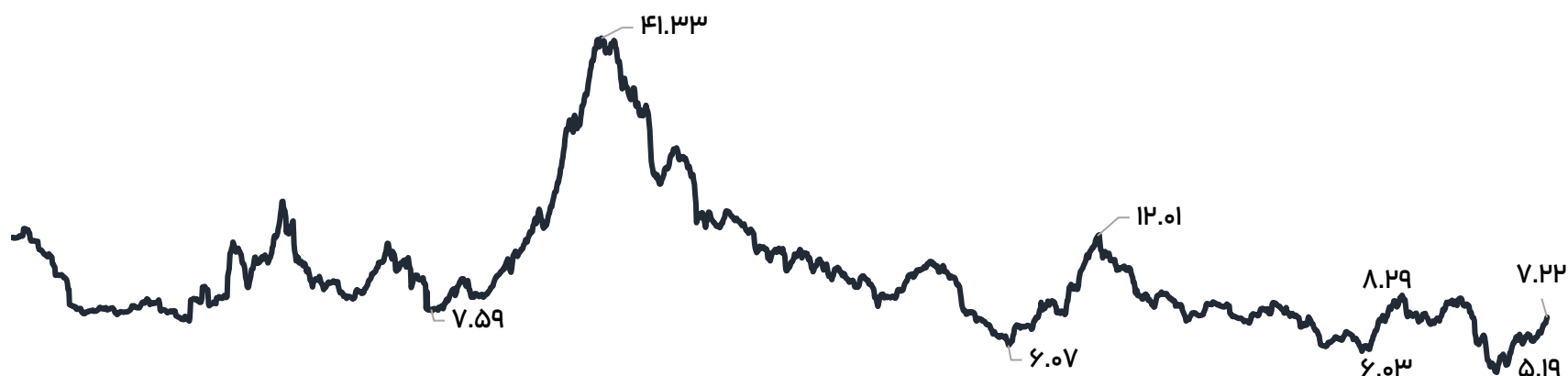
در هفته های اخیر اما، شاهد واکنش مثبت بازار به محدوده ۳ میلیون واحد بودیم (باکس سبز درج شده روی چارت) که در نهایت منجر به سقف شکنی مجدد شاخص کل و تداوم روند صعودی در شاخص کل و کلیت بازار شد. در ادامه، تثبیت کندل ها بر فراز سقف تاریخی نیز انجام شده و طی هفته اخیر، با رشد ۵ درصدی شاخص کل، شاهد ادامه یافتن روند صعودی در بازار بودیم. با حد نقض شکست میانگین متحرک دوره ۲۶ به سمت پایین که در گذشته کندل ها واکنش های خوبی به این میانگین داشته اند، می تواند روند صعودی بازار را دنبال کرد.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

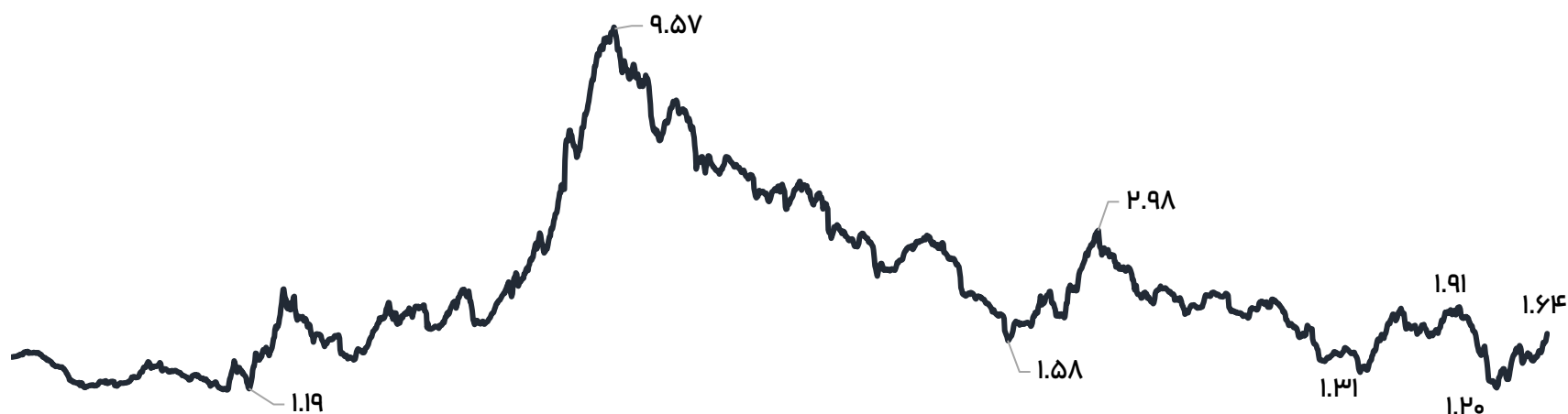
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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 سقف شکنی شاخص کل و شاخص هم وزن طی یک سال اخیر، اما از لحاظ ارزش دلاری، بازار تقریباً رشدی نداشته و در کف ۵ ساله و بلندمدت خود قرار دارد که می تواند به نوعی نشان دهنده ارزندگی بازار سرمایه حتی با وجود رشد اخیر باشد.

در دو نمودار زیر، روند هشت ساله ی ارزش ریالی و دلاری بازار را مشاهده می کنید.

ارزش ریالی بازار بورس (هزار همت)



ارزش دلاری بازار بورس (میلیارد دلار)





پرداخت طلب پالایشی‌ها

مصوبه شورای اقتصاد درباره دستورالعمل نحوه صدور مجوز صادرات فرآورده‌های نفتی اصلی در راستای پرداخت طلب شرکت‌های پالایش نفت ابلاغ شد.



برگزاری هفتگی حراج سکه طلا

بانک مرکزی اعلام کرد حراج سکه طلا تا پایان سال، هر هفته انجام می‌شود.

بیتکوین در راه بازار ایران

مدیر بازارهای مشتقه و ابزارهای نوین بورس کالای ایران: طرح گواهی سپرده بیت‌کوین به عنوان یک ابزار مالی بومی‌سازی شده آماده شده است.



شپنا

افزایش سرمایه ۲۲ درصدی شپنا از محل سود انباشته مورد تایید حسابرسان قرار گرفت.

شتران

شفاف سازی شتران و تعدیل مثبت ۹۹ هزار میلیارد ریالی؛ شتران درباره مجوز صادرات فرآورده های نفتی نیز شفاف سازی کرد.

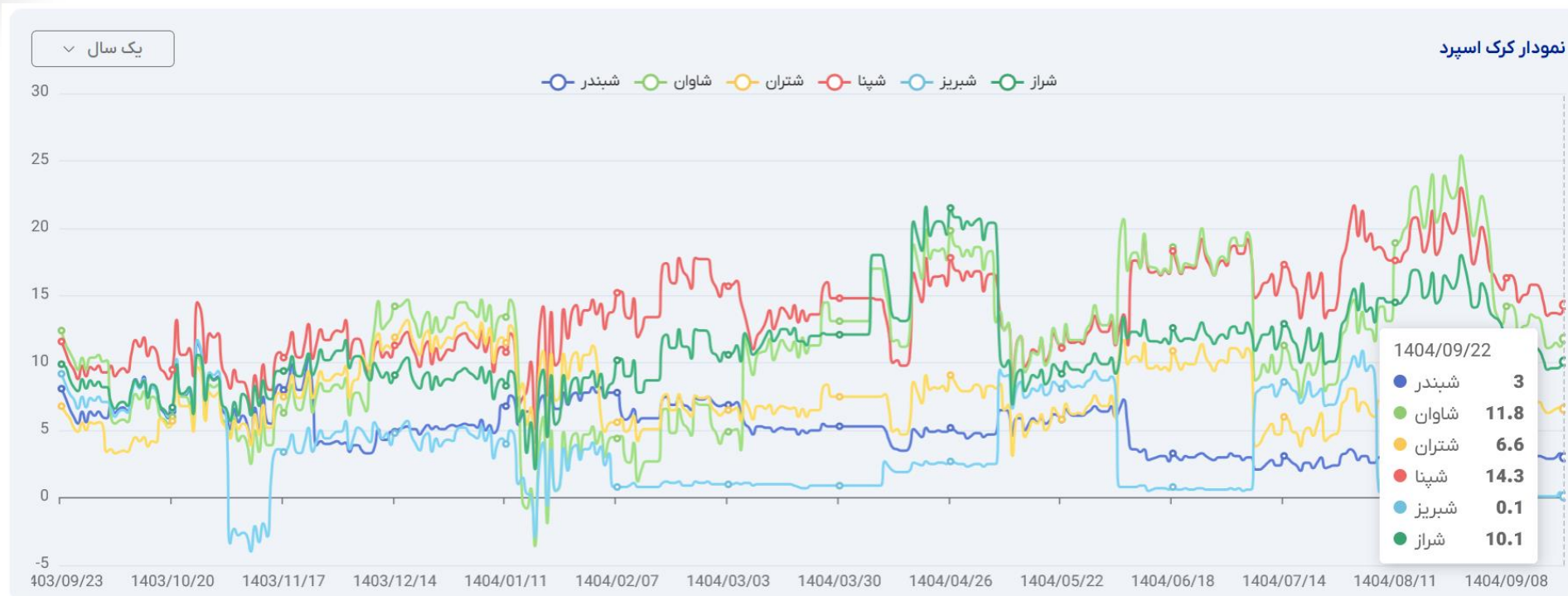
وبملت

اطلاع رسانی به سهامداران درباره افزایش سرمایه از محل سود انباشته



کرک اسپرد پالایشی‌ها

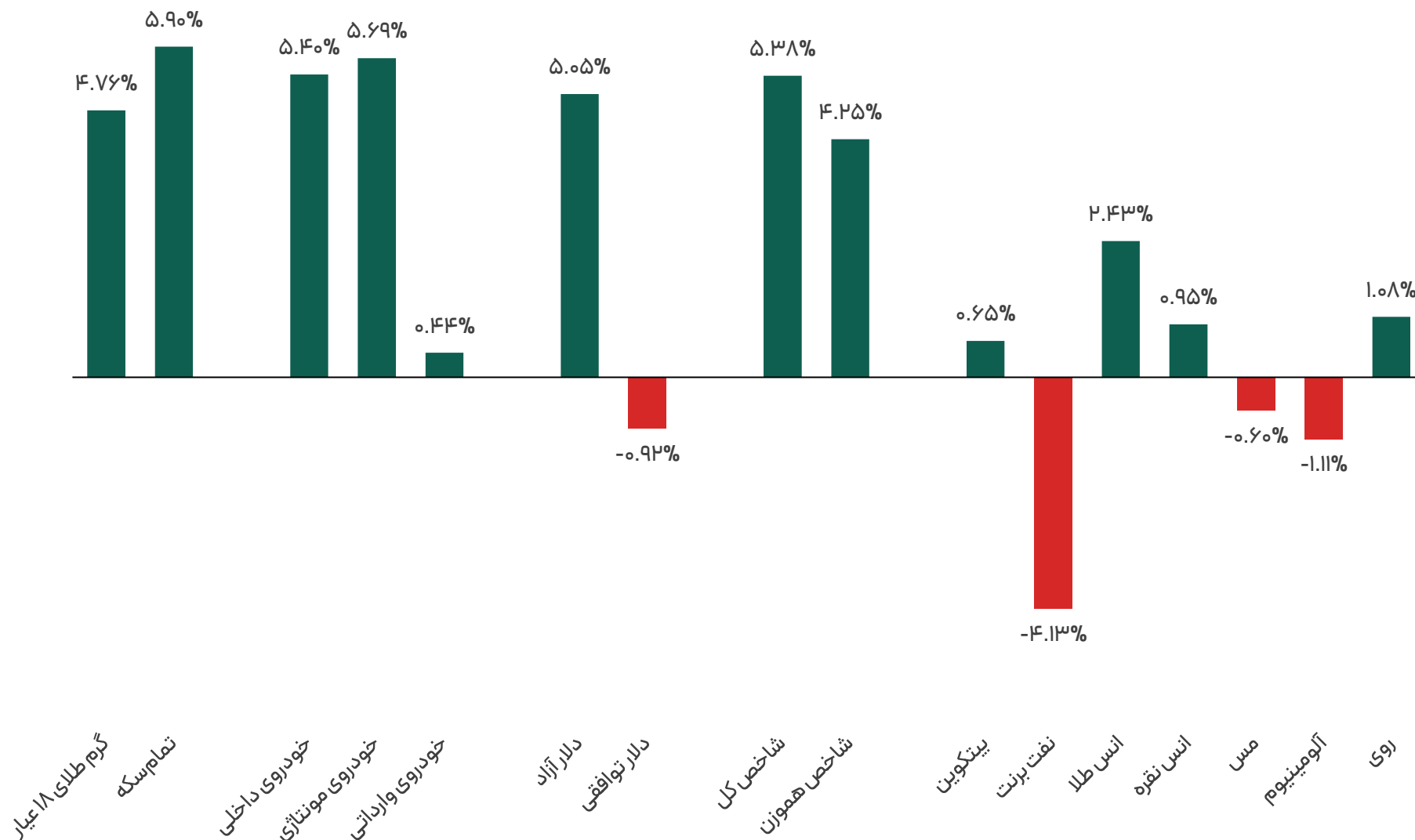
نمودار کرک اسپرد



میانگین کرک اسپرد: شبندر \$ ۵.۱ شاون \$ ۱۱.۴ شتران \$ ۷.۵ شپنا \$ ۱۳.۸ شبریز \$ ۳.۴ شراز \$ ۱۱.۱



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

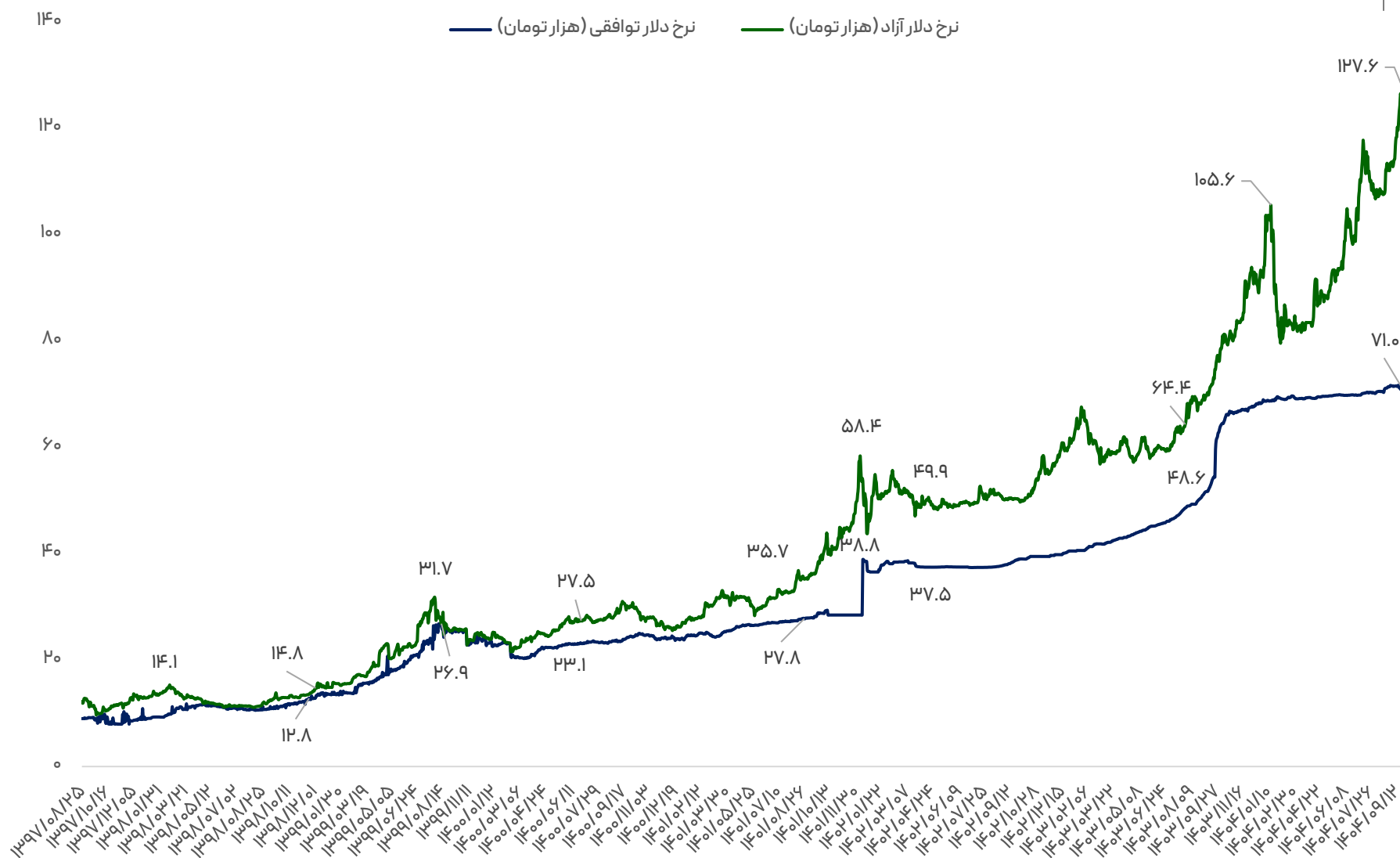


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایپلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K۵ در نظر گرفته شده است.



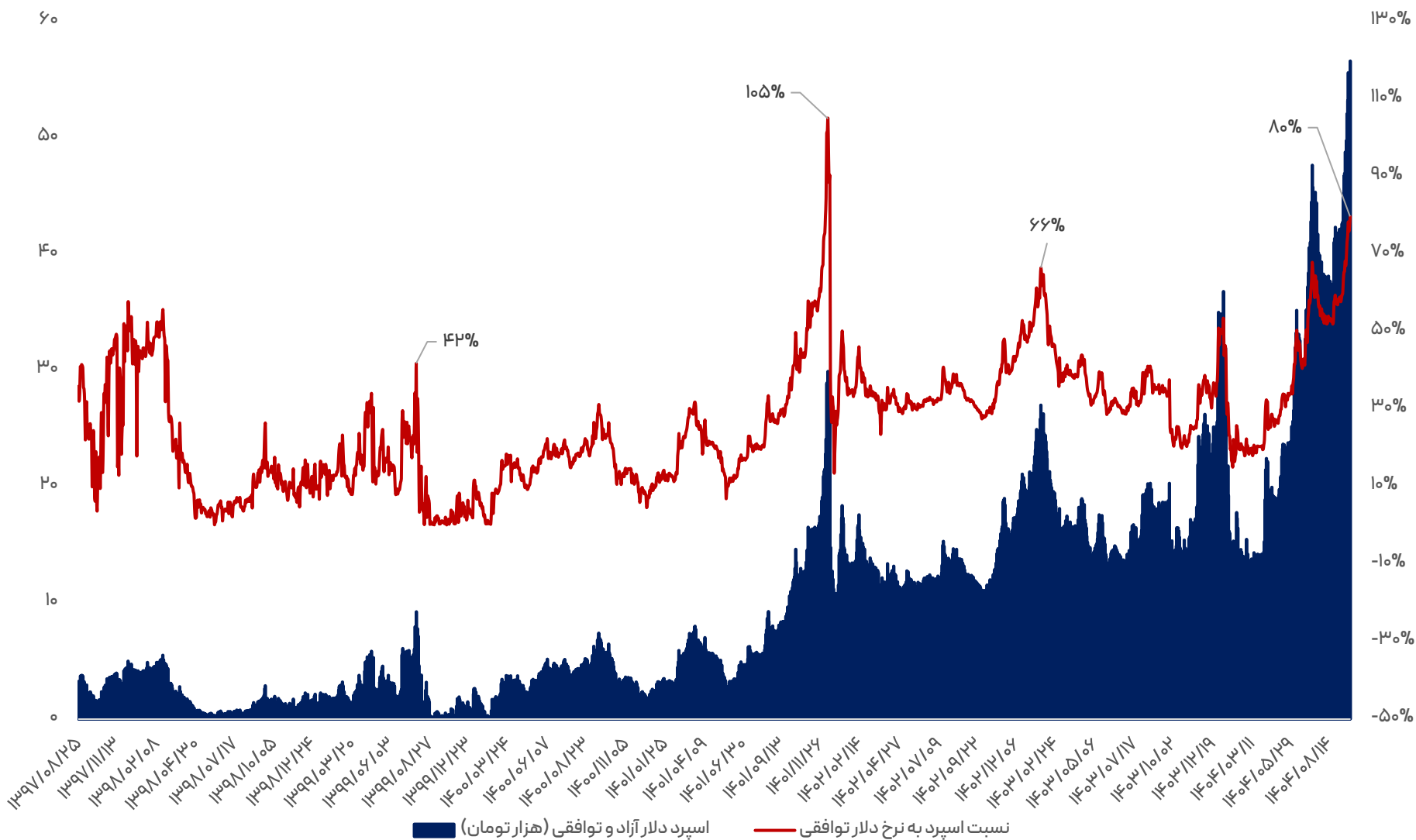
روند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با کاهش ۲۹۷ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۷۱۰،۴۱۳ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

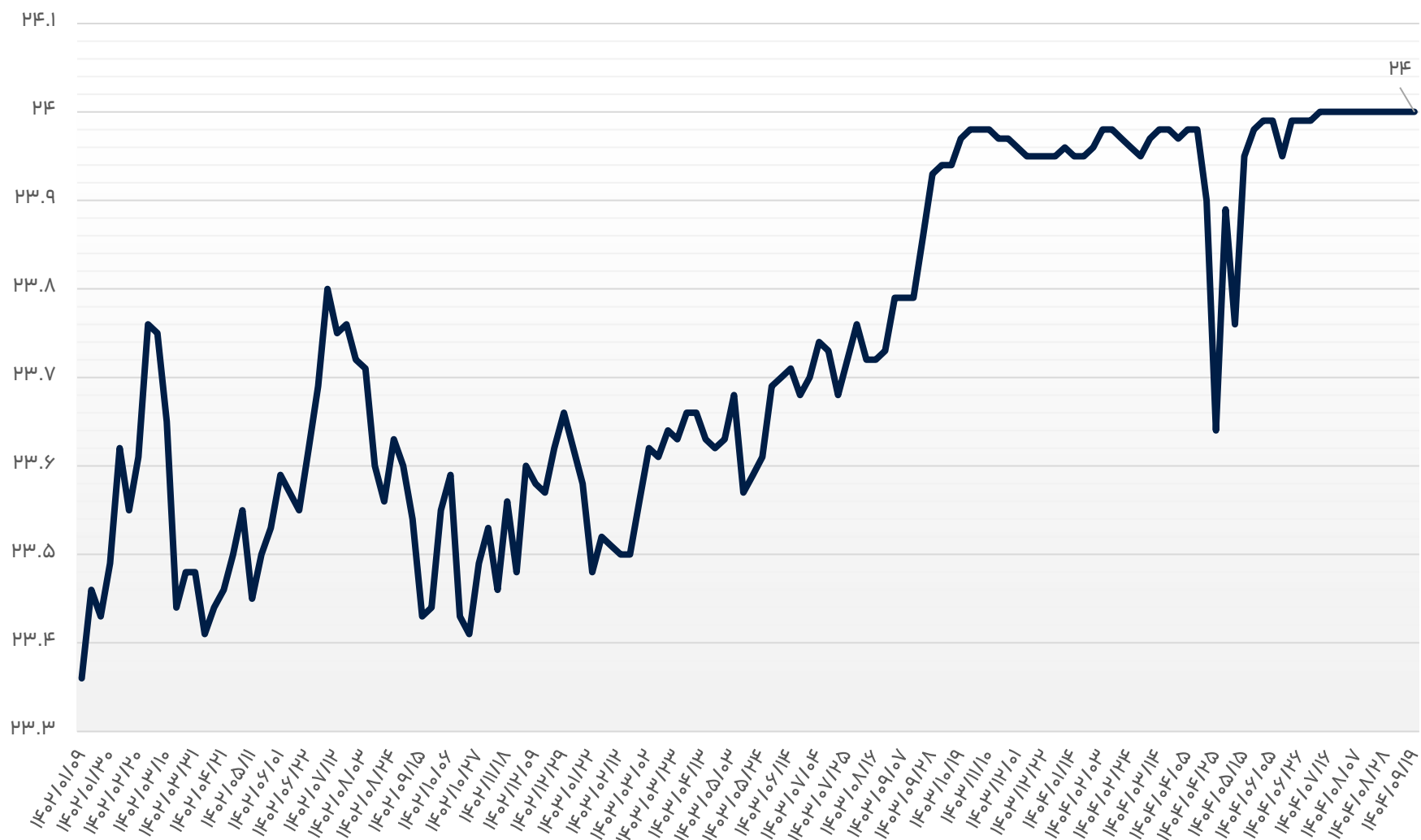
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



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 کل تولیدکننده - فصل تابستان ۱۴۰۴ (بر مبنای سال پایه ۱۴۰۰)

شاخص قیمت کل

در فصل تابستان ۱۴۰۴، شاخص قیمت کل تولیدکننده ۳۴۰.۴ بوده است که نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۱۰.۲ درصد، نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۴۶.۱ درصد و در ۴ فصل منتهی به فصل جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل (تورم سالانه) ۳۸.۵ درصد افزایش داشته است.

افزایش تورم فصلی

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت کل تولیدکننده نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۱۰.۲ درصد بوده است که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۶.۵ درصد)، ۳.۷ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان به ازای تولید محصولاتشان در داخل کشور، در فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به فصل قبل، ۱۰.۲ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم فصلی با ۲۱.۰ درصد مربوط به گروه «کشاورزی» و کم‌ترین تورم فصلی با ۷.۱ درصد مربوط به گروه «معدن» بود.



افزایش تورم نقطه به نقطه

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت کل تولیدکننده نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۴۶.۱ درصد بوده است که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۷.۵ درصد)، ۸.۶ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان به ازای تولید محصولاتشان در داخل کشور، در فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به فصل مشابه سال قبل، ۴۶.۱ درصد افزایش داشت. در این فصل بیش‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۹۴.۷ درصد مربوط به گروه «تولید، انتقال و توزیع برق» و کم‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۳۵.۱ درصد مربوط به گروه «معدن» بود.

افزایش تورم سالانه

در فصل تابستان ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت کل تولیدکننده در چهار فصل منتهی به فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به مدت مشابه در سال قبل ۳۸.۵ درصد بوده است که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۲.۲ درصد)، ۶.۳ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان به ازای تولید محصولاتشان در داخل کشور، در چهار فصل منتهی به فصل تابستان ۱۴۰۴ نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۳۸.۵ درصد افزایش داشته است. در این فصل بیش‌ترین تورم سالانه با ۵۹.۶ درصد مربوط به گروه «تولید، انتقال و توزیع برق» و کم‌ترین تورم سالانه با ۳۳.۵ درصد مربوط به گروه «معدن» بود.



با سپاس از توجه شما

