

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۲۸ آذرماه ۱۴۰۴



هفته اخیر بازار سرمایه با تشدید و **تداوم تقاضا** در کلیت بازار و رشد بیش از ۵ درصدی شاخص کل سپری شد. **شاخص کل هم وزن** نیز در هفته اخیر حدود ۵ درصد رشد کرد و بیش از هفته های پیش، صعود بازار را همراهی کرد.

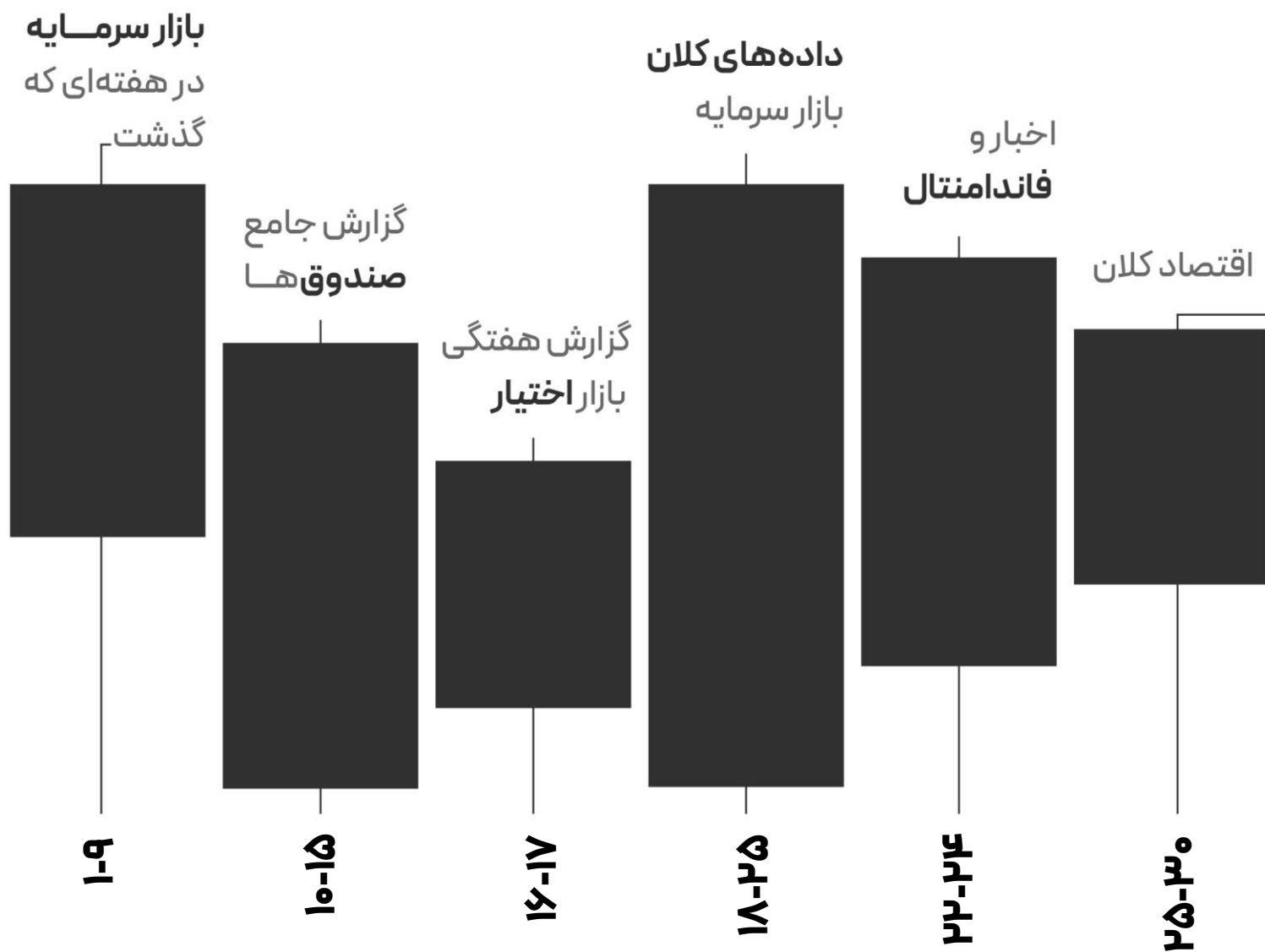
در بازارهای موازی شاهد رشد نرخ دلار در بازار آزاد و رسیدن آن به سطوح بالای ۱۳۰ هزار تومان بودیم. در بازار طلا نیز، با وجود خروج پول حقیقی که از صندوق های طلا رقم خورد، شاهد تداوم تقاضا و رسیدن نرخ طلای گرمی به بیش از ۱۳.۵ میلیون تومان بودیم. در بازار خودرو هم، پیرو افزایش نرخ دلار، قیمت ها افزایشی بود و همانطور که پیش تر هم اشاره شد، بوی تشدید تورم را تمامی بازارها احساس کرده اند و در برخی زودتر و در برخی دیرتر تاثیر این موضوع را خواهیم دید.

نکته مهمی که در معاملات هفته پیش شاهد بودیم، خروج پول از صندوق های طلا، وارد نشدن پول به صندوق های درآمد ثابت و **ورود پول حقیقی** به معاملات خرد بازار سهام بودیم!

این موضوع می‌تواند توضیح دهد، پولی که از بازار طلا در حال خروج است، در سوی مقابل، بازاری جذاب‌تر از بازار سهام پیدا نکرده و در حال ورود به این بازار است!

برایند گردش حقیقی‌ها در معاملات خرد بازار سهام هفته پیش هم مشابه هفته پیش‌تر از آن مثبت بود و بیش از ۵.۲ همت پول حقیقی به معاملات خرد بازار سهام وارد شد. در سوی مقابل گردش پول در صندوق‌های درآمد ثابت تقریباً خنثی بود و در صندوق‌های طلا خروج پول حقیقی به ثبت رسید.

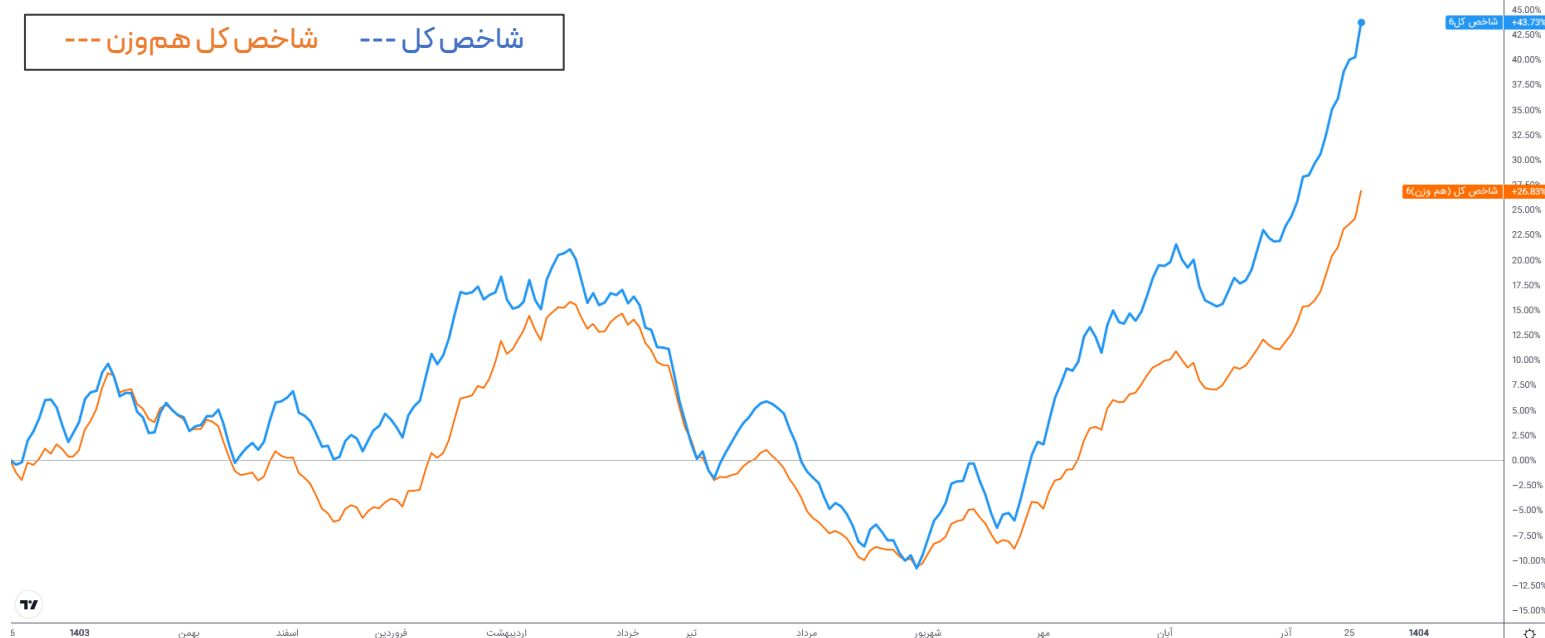
به لحاظ تکنیکالی نیز، همانطور که پیش‌تر هم اشاره شد، شرایط خوبی برقرار شده است. شاخص کل پس از سقف‌شکنی موفق به تثبیت بر فراز سقف تاریخی شده و همچنین هر نوع خط داینامیک مقاومتی ۵ ساله از سقف سال ۹۹ تا کنون را به سمت بالا شکسته است. بنابراین تایید اتمام اصلاح کوتاه‌مدتی بازار به لحاظ تکنیکالی مدتی‌ست که صادر شده است و می‌توان با ارتقای حد زیان سهام، روند صعودی بازار را همراهی کرد.



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 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	+ ۵.۷۹ %	+ ۱۸.۶۶ %	+ ۴۵.۲۹ %	+ ۲۶.۲۳ %	+ ۴۳.۷۳ %
بازده شاخص کل هم‌وزن	+ ۴.۷۲ %	+ ۱۳.۶۱ %	+ ۳۲.۵۵ %	+ ۱۳.۴۶ %	+ ۲۶.۸۳ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

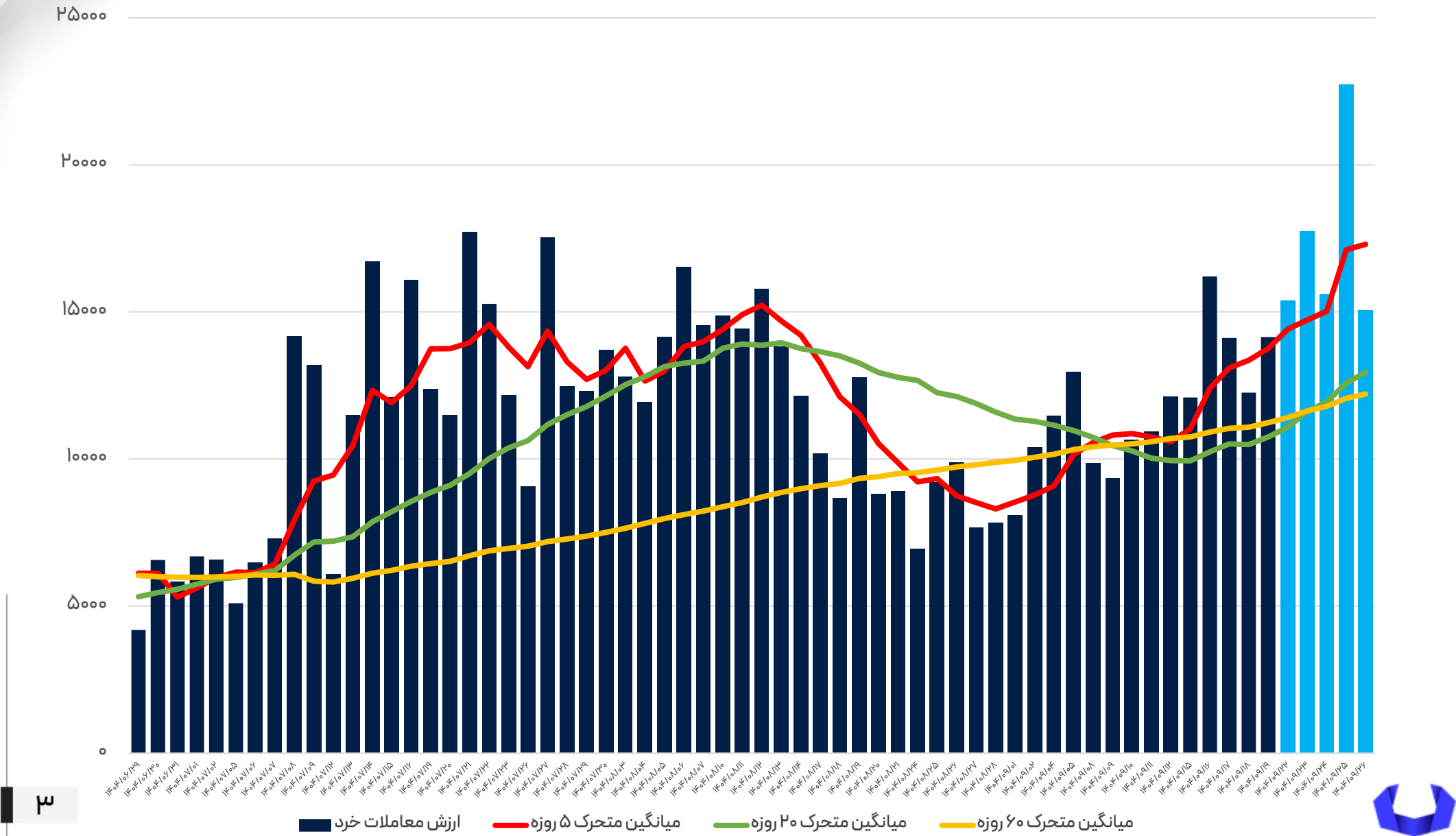
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل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

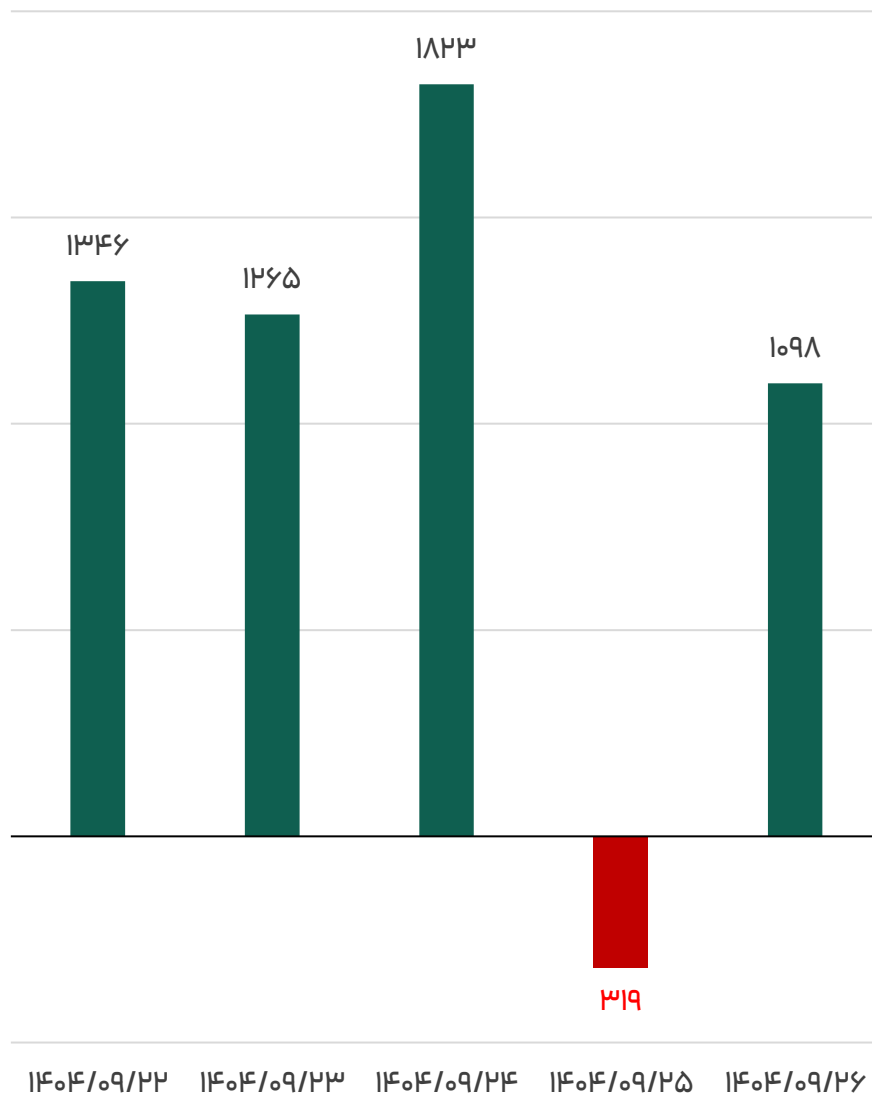


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

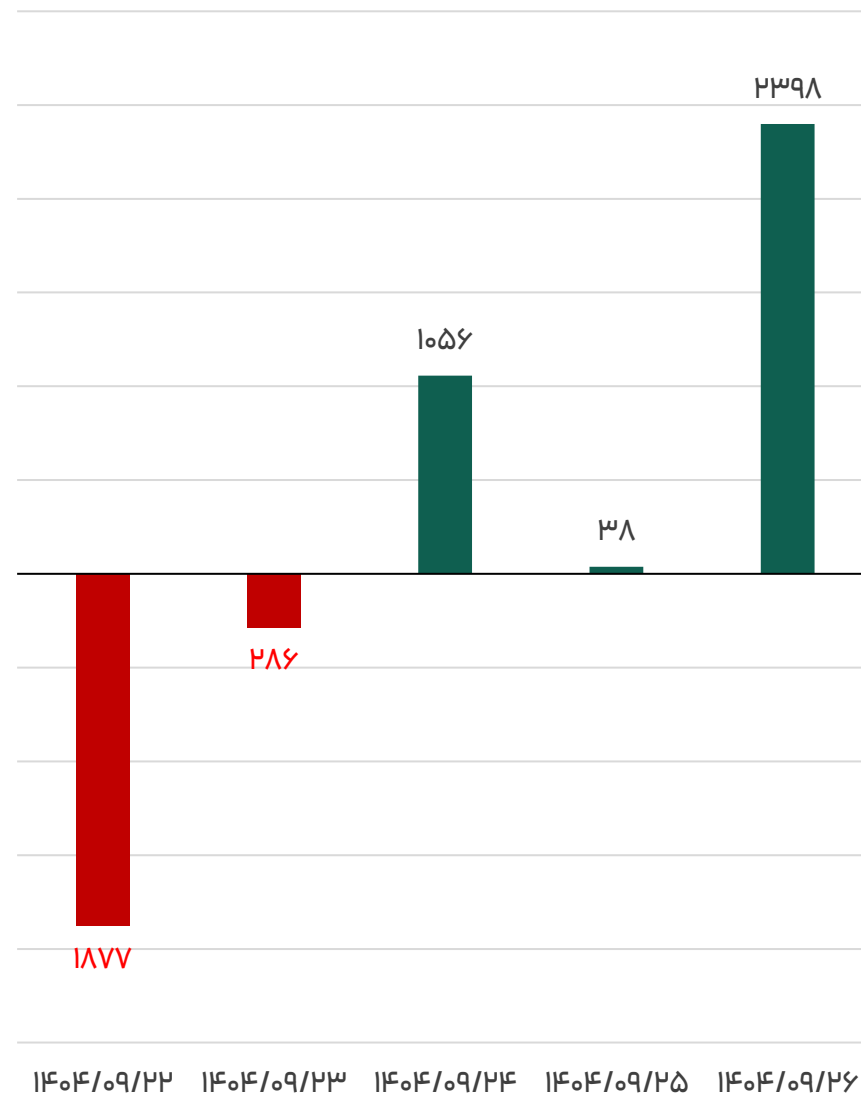


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

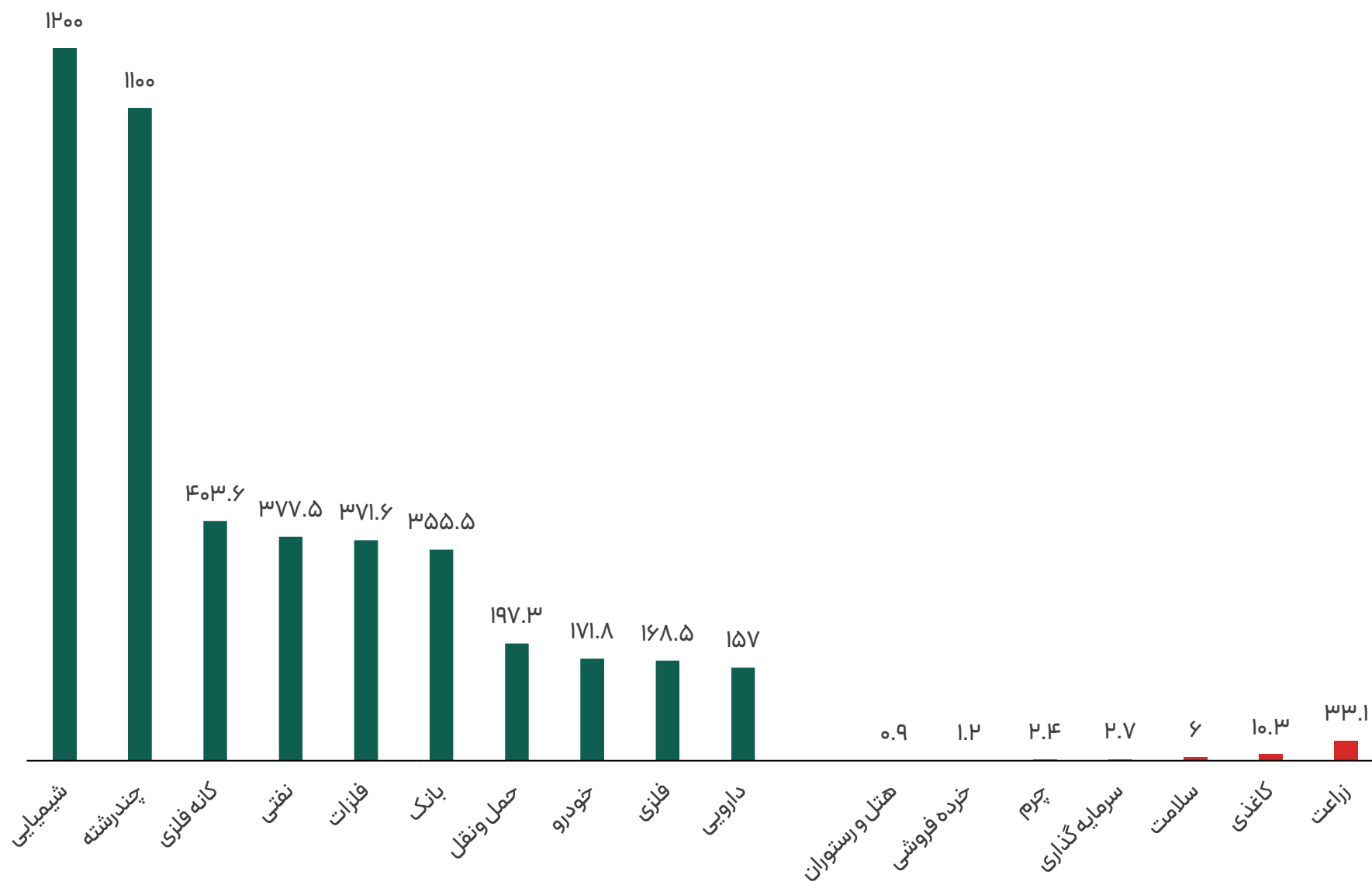
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



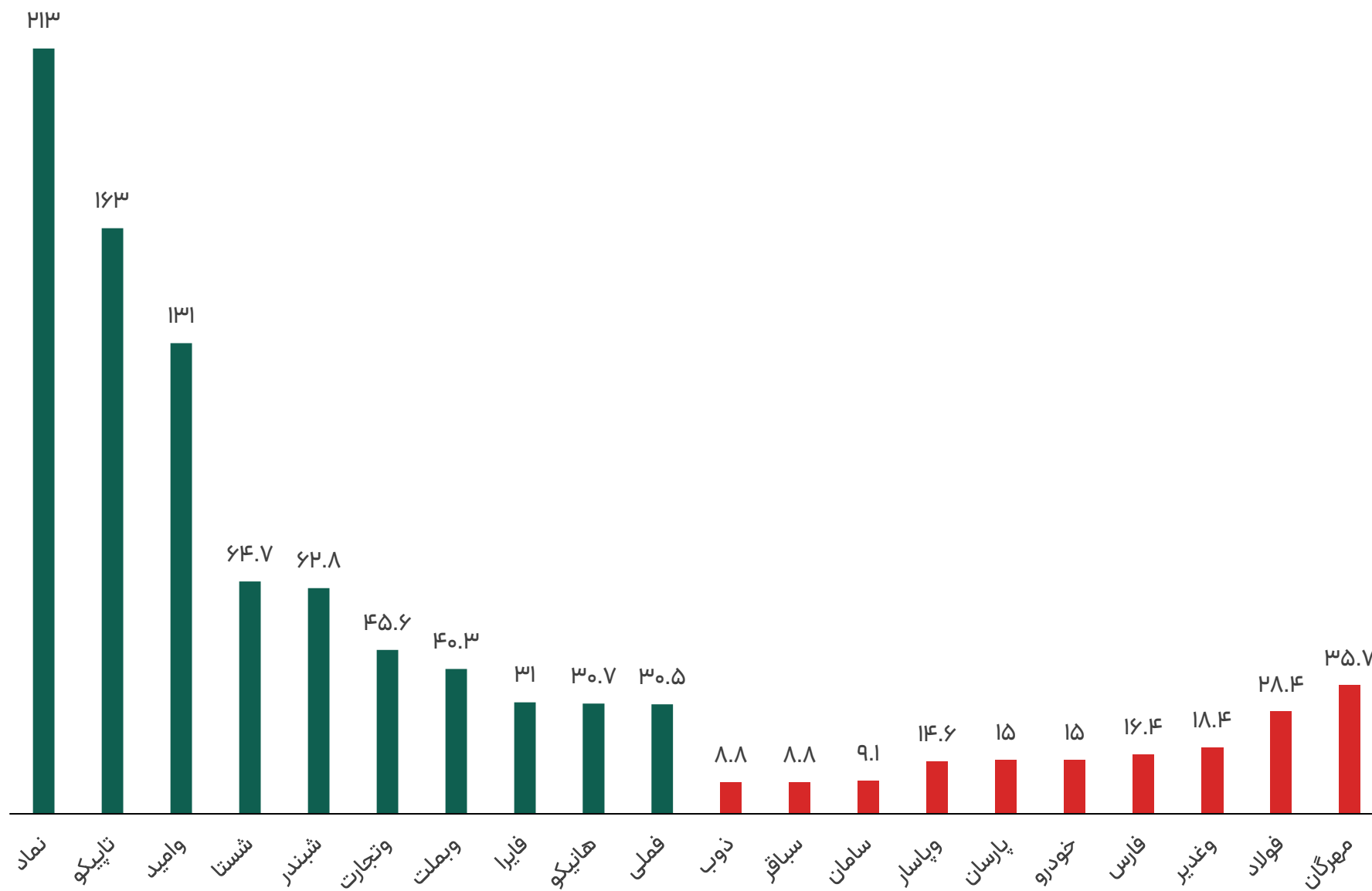
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



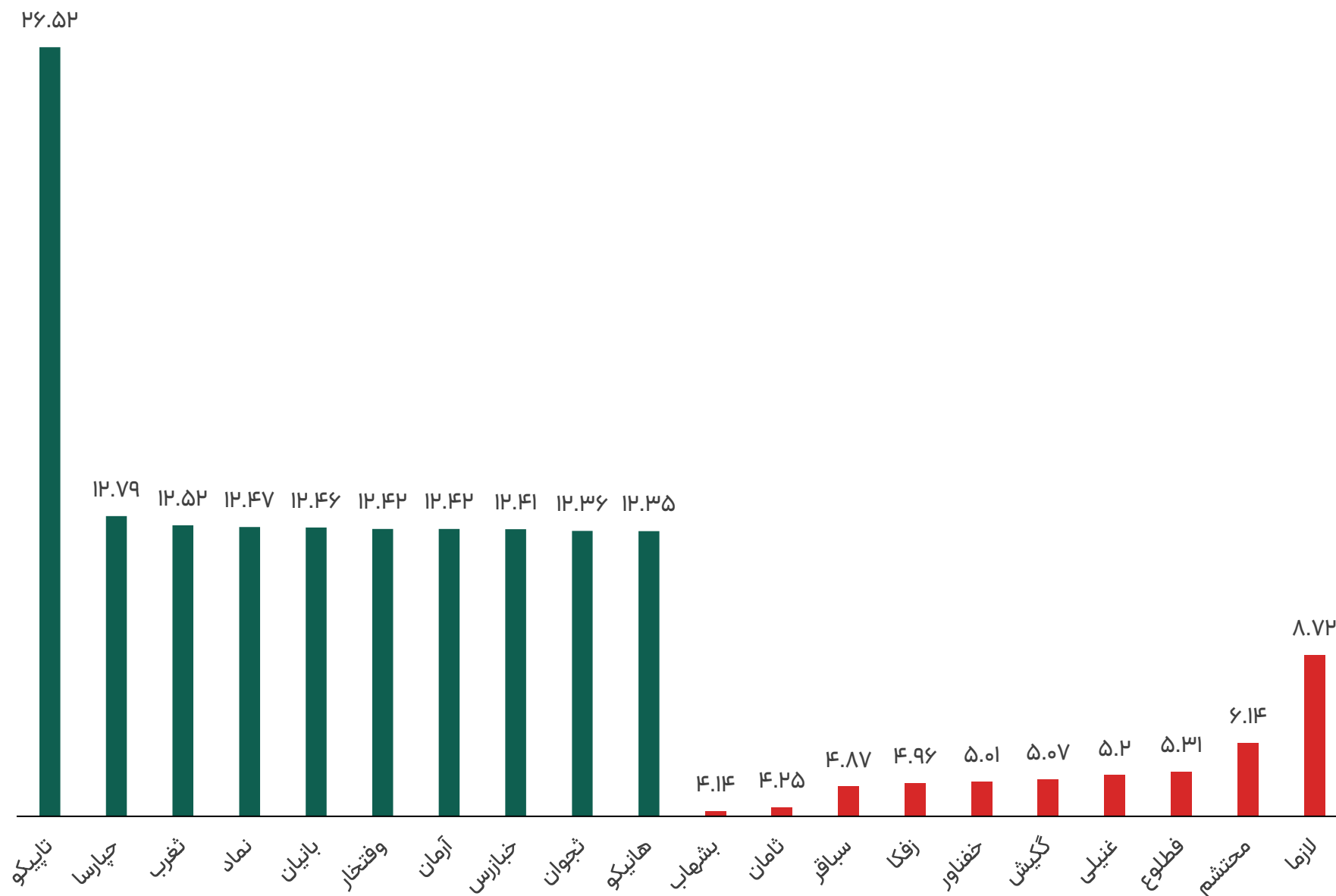
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)

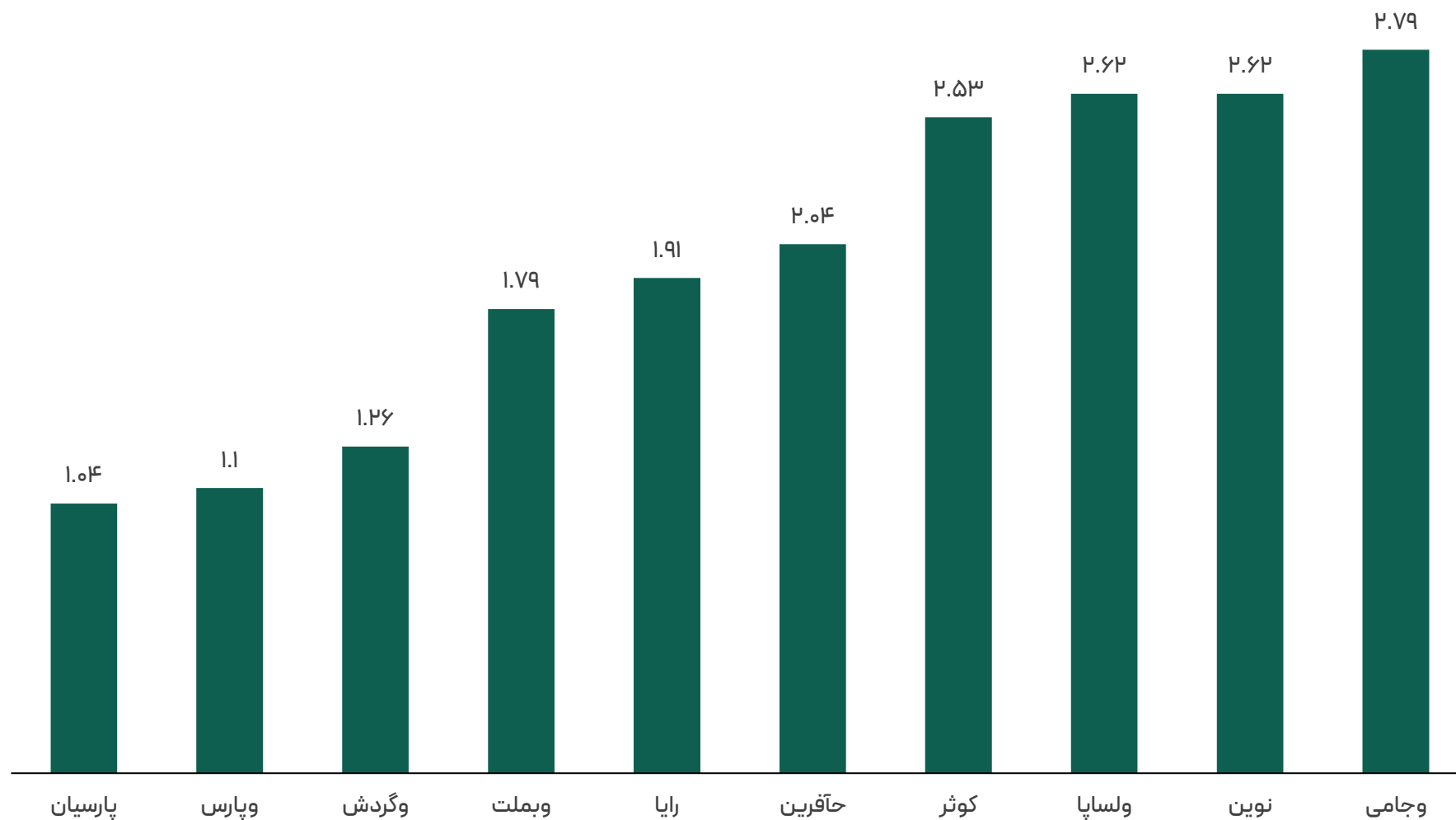


دسته بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر نماد | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نماد



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					ماهانه	سه ماهه	سالانه
 پیشران	-۳.۵۱	-۳.۵	-۳.۷۴	۱.۶۲	۰.۹۱	۱.۴۷	۱.۵۲	۳۳.۸۱	۸۴.۸	۴۰.۴۳
 موج	-۵.۴۳	-۴.۷۲	-۳.۶۷	۱.۷۹	۰.۹۷	۱.۷۴	۱.۸۳	۴۰.۳۲	۱۰۲.۲۵	۶۷.۱۹
 نارنج اهرم	-۸.۳۱	-۸.۴۶	-۵.۷۷	۱.۸۵	۰.۸۵	۱.۵۷	۱.۷	۳۷.۵۵	۱۰۳.۵۸	۶۲.۳۹
 دواپکس	-۸.۵۲	-۱.۶۵	-۰.۲۵	۱.۹۸	۰.۹۴	۱.۸۶	۲.۰۲	۴۱.۰۲	۱۰۸.۳۱	۹.۲۶
 اهرم	-۱۱.۸۱	-۷.۳۴	-۴.۷	۱.۶۴	۰.۹۲	۱.۵۱	۱.۶۹	۳۱.۸۵	۷۹.۹۲	۲۱.۷۶
 توان	-۱۲.۶۳	۴.۴۳	۰.۲۸	۱.۹۳	۰.۸۷	۱.۶۸	۱.۸۹	۳۶.۰۲	۸۶.۱	۲۷.۳۹
 شتاب	-۱۲.۷۳	-۱۱.۲۷	-۸.۵۶	۱.۹۳	۰.۸۴	۱.۶۲	۱.۸۳	۲۹.۴۹	۷۸.۹۴	۴۷.۴۸
 جهش	-۱۳.۶۴	-۱۱.۳۸	-۸.۸۹	۱.۹۲	۰.۸۸	۱.۶۹	۱.۹۲	۳۵.۲	۹۲.۲۹	۳۳.۵۳
 بیدار	-۱۴.۷۸	-۱۱.۸۴	-۹.۲۵	۱.۹۳	۰.۸۷	۱.۶۸	۱.۹۳	۳۳.۲۹	۸۵.۸۸	۴۵.۳۶



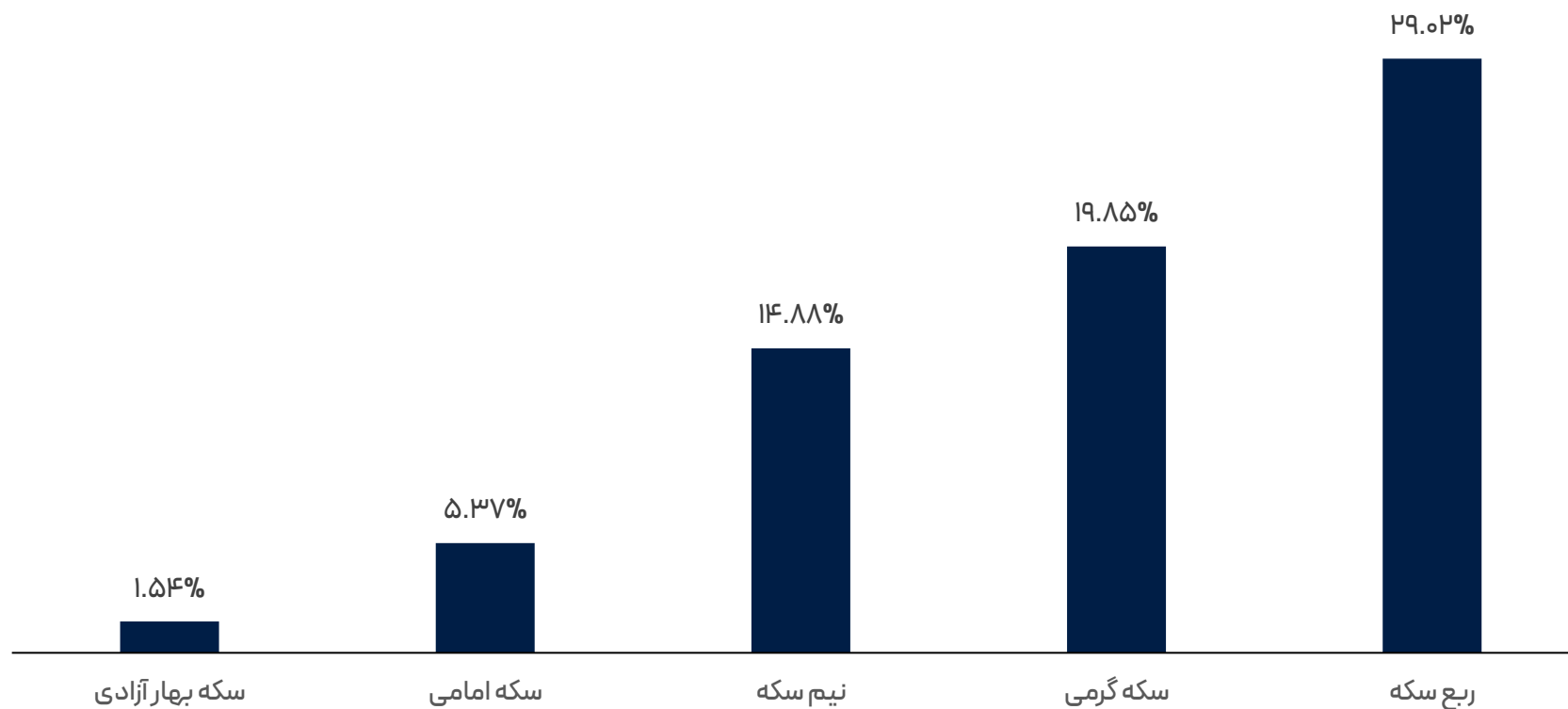
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۰.۵۳%) ۱,۳۲۰,۰۰۰ ریال انس طلا (۰.۱۲%) ۴,۳۳۸ دلار انس نقره (۰%) ۶۷ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حباب
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۱ آینده	۱,۴۰۴,۲۷۸	-۰.۴	۴.۱۸
تمام سکه طرح جدید ۱۳۱۲ رفاه	۱,۴۰۳,۳۰۰	-۰.۵	۴.۱
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۲ سامان	۱,۴۱۲,۱۰۰	-۰.۵	۴.۷۶
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۳,۰۶۵,۸۸۰	۱.۰	۷.۶۱
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۴۰۹,۹۹۹,۸۰۰	-۰.۱۲	۴.۶
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۱۸,۲۵۰,۰۸۰	۱.۳۵	-۰.۴



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
پیروز 	۲۷.۱	۵۷.۸۱	۲۴.۹۱	۰.۴۷	۰.۹۳	-۱.۵۹
رونق 	۲۳.۴	۴۰.۷۷	۲۵	۰.۵۷	۰.۵۳	-۳.۶۹
فیروزه 	۲۲.۶۱	۵۹.۲۲	-۴۸.۲	۱۱.۱۱	۱۵.۶۲	-۰.۰۸
دیار 	۲۲.۴۳	۴۴.۱۱	۲۶.۱	۰.۲۵	۰.۱۲	-۳.۳۹
آرام 	۲۱.۷۷	۵۴.۵۵	۳۴.۸۵	۱۸.۲	۱۵.۴۸	۰
آمیتیس 	۲۱.۲۵	۴۵.۹۹	۵۷.۹۹	۱.۰۸	۱.۵۱	۰.۵۶
اکسیژن 	۲۱.۱۲	۴۴.۹۶	۳۳.۹۳	۰.۴۵	۰.۵۹	-۰.۱۹
ویستا 	۲۰.۸۶	۳۹.۳۳	۳۱.۸۸	۰.۵۴	۰.۵۷	۰.۶۴
هومان 	۲۰.۸۵	۴۹.۵۹	۵۰.۰۸	۰.۰۹	۰.۳۴	-۰.۰۸

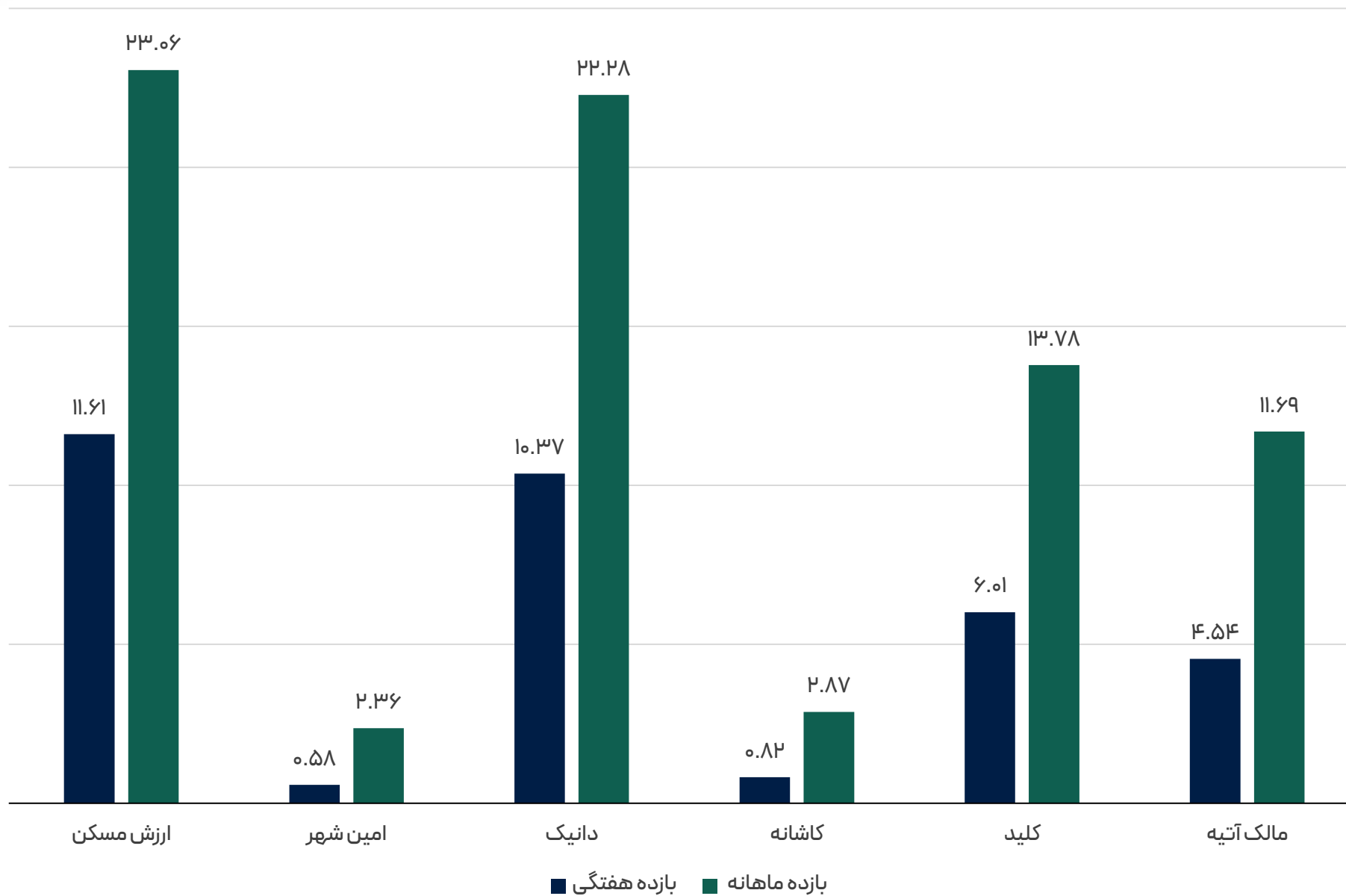


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه		یک ماهه	سه ماهه
 داب متال	۲۸.۷۲	۷۰.۲۹	۳۳.۶۵	۸.۷	۰.۲۵	-۰.۰۵	۰.۰۹
 استیل	۲۵.۴	۶۸.۵۸	۲۲.۵۷	۱۲.۲۱	۰.۳۱	-۰.۱	-۰.۱۸
 آلیاژ	۲۵.۲۶	۶۷.۰۶	۳۵.۴۳	۷.۹۵	-۰.۵۴	-۰.۶	-۰.۷۹
 رسانا	۲۵.۱۶	۵۰.۲۷	۷.۵۳	۲.۸۳	-۰.۰۱	۰.۱۸	۰.۳۶
 فلزا	۲۵.۰۲	۷۱.۷۸	۶۲.۷۸	۷.۷۶	۰.۱۲		-۱.۳۲
 پتروآگاه	۲۴.۹۱	۵۲.۶۱	۳۵.۶	۱۲.۲۲	۱.۰۲	-۰.۴۲	-۰.۹۶
 فارما کیان	۲۴.۸	۶۱.۱۷	۵۰.۲۴	۱۷.۸۸	۱.۲۹		-۰.۹۱
 معدن	۲۳.۶۶	۴۷.۴۴	۱۸.۱	۱۴.۲۷	-۰.۹۱	-۰.۹۷	-۰.۴۹
 پتروداريوش	۲۳.۳۳	۴۵.۱۹	۱۵.۲۳	۲.۰۶	-۰.۴۷	-۰.۵۳	-۰.۴۶



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



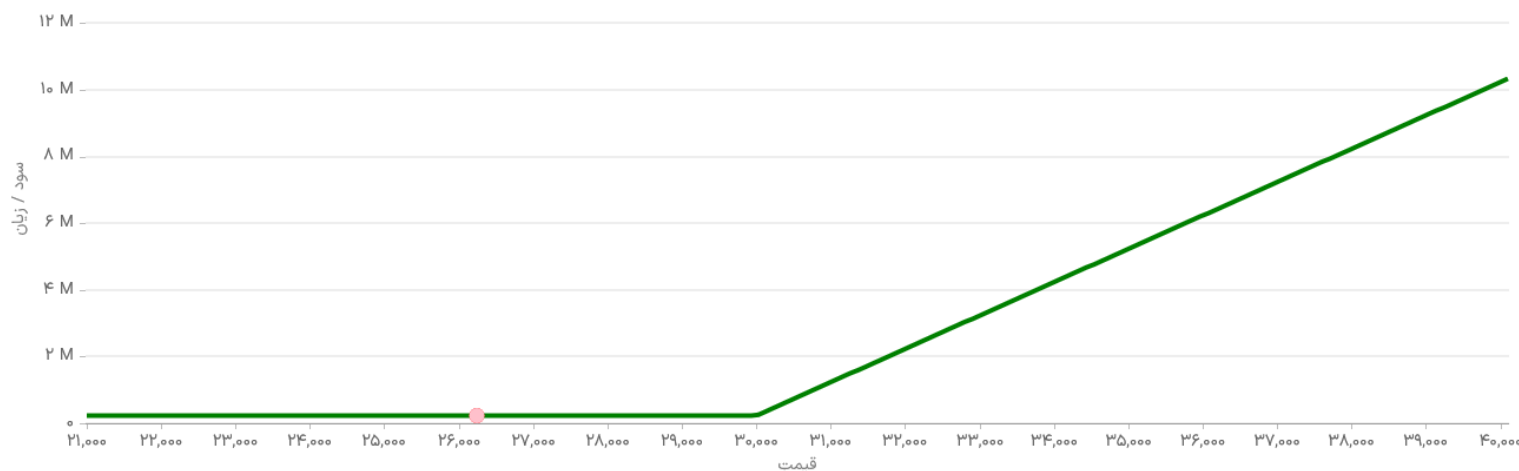
گزارش هفتگی بازار آپشن

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)

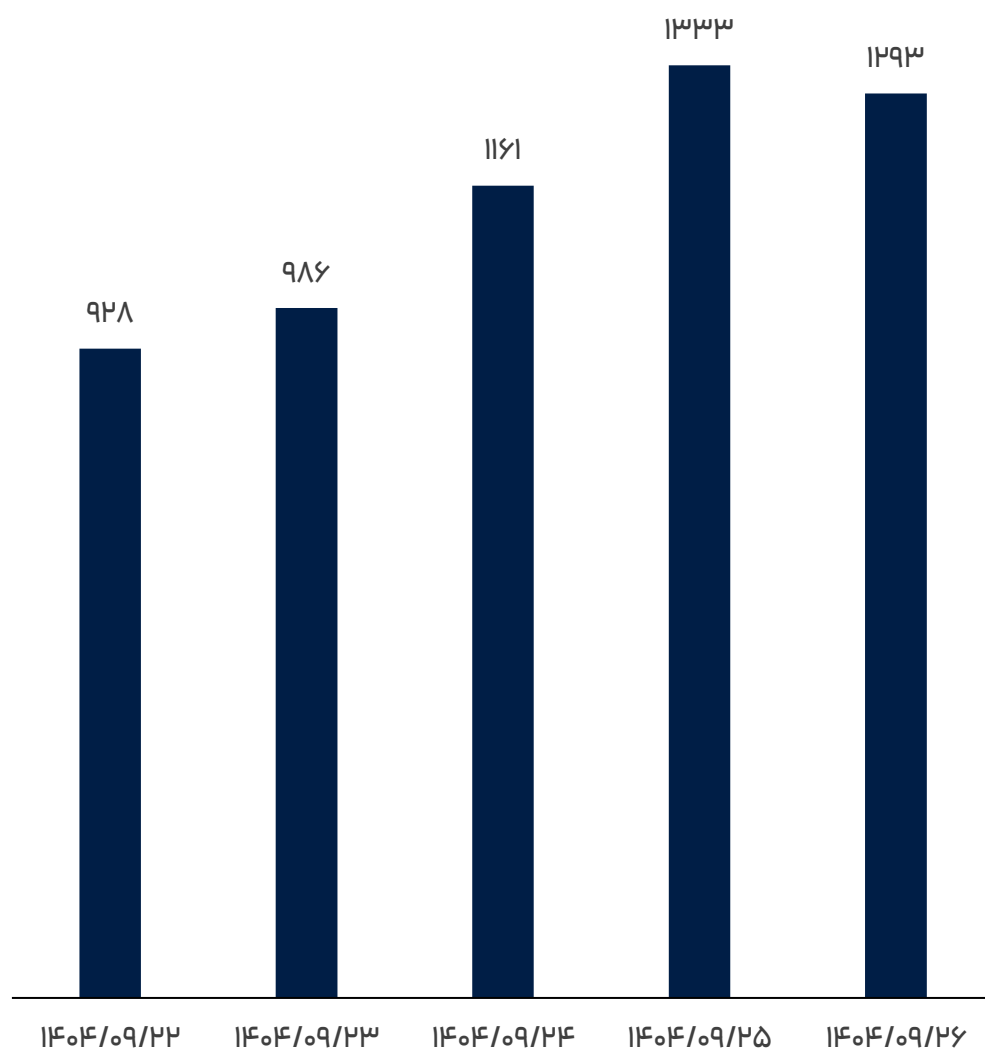
این استراتژی با خرید همزمان دارایی پایه (صندوق اهرم) و خرید اختیار فروش آن انجام می‌شد. اشاره شد که با توجه به اینکه دیدگاه و ریسک‌پذیری معامله‌گر به چه صورت باشد، قراردادهای طهرم ۱۰۲۷، طهرم ۱۰۲۶ و طهرم ۱۰۲۵ می‌توانند مناسب باشند. طهرم ۱۰۲۷ استراتژی بدون ریسک می‌ساخت، و سودآوری استراتژی از قیمت ۳,۰۲۱ تومان در صندوق اهرم آغاز می‌شود. حداکثر ریسک استراتژی با استفاده از طهرم ۱۰۲۶ اما ماهانه ۱.۴ درصد است و در عوض، سودآوری استراتژی از قیمت ۲,۸۶۵ تومان در صندوق اهرم آغاز می‌شود. همچنین با استفاده از طهرم ۱۰۲۵، حداکثر ریسک استراتژی ماهانه ۴ درصد خواهد بود و در عوض، از قیمت ۲,۷۷۰ تومان در صندوق اهرم، سودآوری استراتژی آغاز می‌شود. (آخرین قیمت فعلی صندوق اهرم: ۳,۲۶۲ تومان) با توجه به اینکه این استراتژی در سود قرار دارد، سیو سود و خروج از استراتژی در مسیر، به اختیار شما عزیزان خواهد بود.

خالص	آفست	وجه تضمین	۱۷%	Σ	دلتا	قیمت	اعمال	تعداد	نوع	نماد	خرید/فروش		
-۲۶,۲۷۰,۰۰۰	▶				۱	۲۶,۲۷۰		۱	دارایی پایه	اهرم	خرید	☒	×
-۳,۴۸۰,۰۰۰	▶		۴۸	۴۶	-۰.۷۴	۳,۴۸۰	۳۰,۰۰۰	۱	اختیار فروش	طهرم ۱۰۲۷	خرید	☒	×
-۲,۳۴۲,۰۰۰	▶		۵۲	۴۶	-۰.۵۵	۲,۳۴۲	۲۸,۰۰۰	۱	اختیار فروش	طهرم ۱۰۲۶	خرید	☐	×
-۱,۴۱۰,۰۰۰	▶		۵۴	۴۶	-۰.۳۴	۱,۴۱۰	۲۶,۰۰۰	۱	اختیار فروش	طهرم ۱۰۲۵	خرید	☐	×
-۲۹,۷۵۰,۰۰۰	-۶۸,۰۰۰ (-۰.۲%)				۰.۲۶						روز ۴۶	☒	+



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۰۲۶ صهرم ۲۸,۹۴۶.۴ B	۱۱۲۶ صهرم ۳,۹۴۹.۶ B	۱۰۲۶ صهرم ۱,۶۹۱.۸ B
۱۰۲۵ صهرم ۸,۱۱۰.۲ B	۱۰۲۶ صهرم ۳,۲۳۶.۲ B	۱۱۲۶ صهرم ۹۳۵.۷ B
۱۱۲۶ صهرم ۵,۳۷۳ B	۱۱۲۵ صهرم ۲,۷۰۸.۳ B	۱۰۲۷ صهرم ۹۰۷.۳ B
۱۰۲۷ صهرم ۵,۲۹۰.۳ B	۱۰۲۷ صهرم ۱,۷۴۹.۲ B	۱۰۲۸ صهرم ۸۲۰.۷ B
۱۰۲۳ صهرم ۴,۸۴۰.۲ B	۱۰۵۴ صستا ۱,۵۴۰.۲ B	۱۱۲۵ صهرم ۵۴۴.۴ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۰۲۶ طهرم ۷,۸۴۷.۷ B	۱۱۲۵ طهرم ۸۰۶.۵ B	۱۰۲۸ طهرم ۱۹۹.۸ B
۱۰۲۴ طهرم ۱,۶۰۹.۱ B	۱۰۲۶ طهرم ۶۴۸.۳ B	۱۰۲۷ طهرم ۱۹۴.۱ B
۱۰۲۵ طهرم ۱,۳۷۸.۳ B	۱۰۲۷ طهرم ۵۳۱.۱ B	۱۰۲۶ طهرم ۱۷۹.۱ B
۱۱۲۵ طهرم ۱,۱۷۴.۱ B	۱۰۲۸ طهرم ۴۶۸.۲ B	۱۱۲۶ طهرم ۹۳.۹ B
۱۰۲۷ طهرم ۱,۰۸۷.۶ B	۱۱۲۶ طهرم ۴۰۳.۶ B	۱۱۲۵ طهرم ۹۰.۸ 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 ادامه داشت، 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 انتهای 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 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.

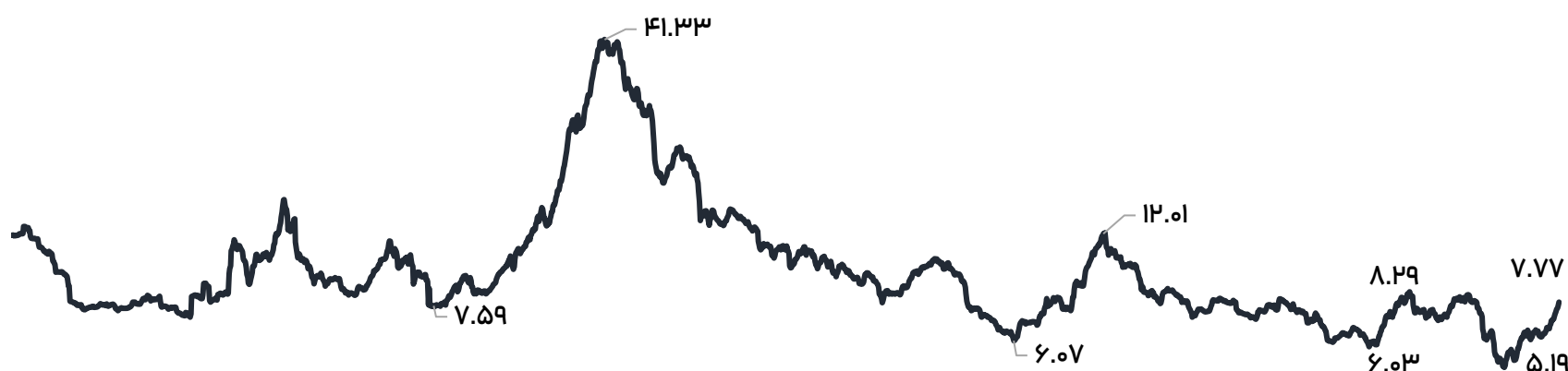
در هفته های اخیر اما، شاهد واکنش مثبت بازار به محدوده ۳ میلیون واحد بودیم (باکس سبز درج شده روی چارت) که در نهایت منجر به سقف شکنی مجدد شاخص کل و تداوم روند صعودی در شاخص کل و کلیت بازار شد. در ادامه، تثبیت کندل ها بر فراز سقف تاریخی رخ داد و طی هفته اخیر هم، با رشد ۵ درصدی شاخص کل، شاهد ادامه یافتن 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

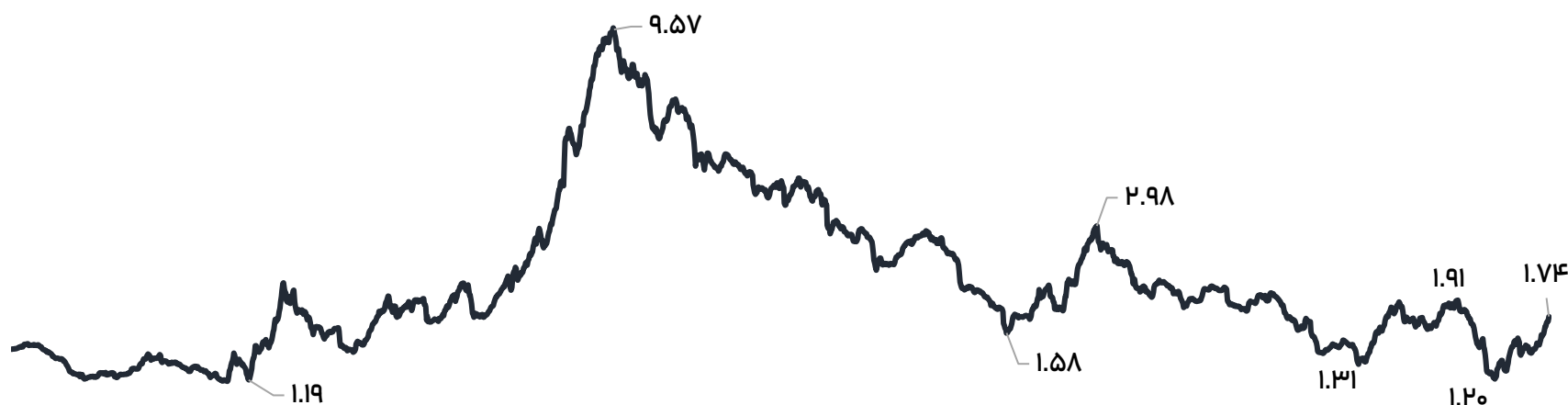
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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)





صدور مجوز پذیره‌نویسی ۳ صندوق نقره

سقف تعداد واحدهای سرمایه‌گذاری در این صندوق‌ها معادل ۹,۰۰۰ میلیارد ریال به ارزش مبنا است. پذیره‌نویسی این صندوق‌ها این هفته آغاز می‌شود.



سهام عدالت یلدایی تکذیب شد

درحالی‌که برخی رسانه‌ها خبر از پرداخت سود سهام عدالت در شب یلدا داده‌اند، مسئولان مربوطه از این موضوع اظهار بی‌اطلاعی کرده‌اند. مدیر نظارت بر ناشران بورس در پاسخ به سوال فارس گفت تا این لحظه هیچ تصمیم‌گیری در این موضوع انجام نشده است.

خداحافظی با حجم مبنا در بورس

حجم مبنا برای نمادهای معاملاتی شرکت‌های پذیرفته‌شده در بورس تهران و فرابورس ایران برابر یک سهم تعیین و از روز یکم دی‌ماه اجرایی خواهد شد.



دعبید

دعبید نرخ فروش محصولات خود را ۳۵ درصد افزایش داد.

غانیزان

افزایش نرخ ۱۹ درصدی در محصولات غانیزان اعلام شد.

فارس

فارس، ۲۵ درصد افزایش سرمایه می دهد.



کرک اسپرد پالایشی‌ها

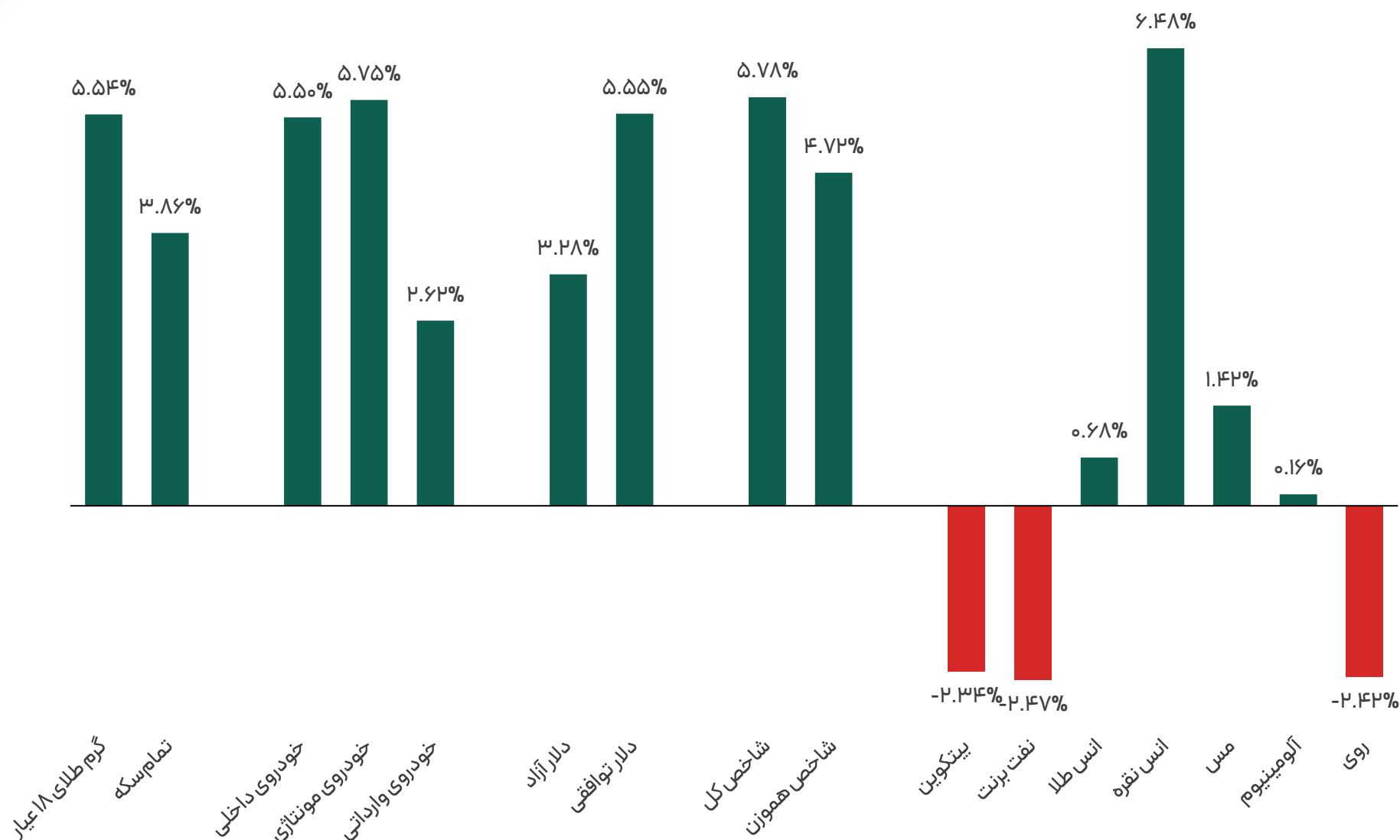
نمودار کرک اسپرد



میانگین کرک اسپرد: شبندر \$ ۵ شاولان \$ ۱۱.۴ شتران \$ ۷.۵ شپنا \$ ۱۳.۸ شبریز \$ ۳.۳ شراز \$ ۱۱.۱



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

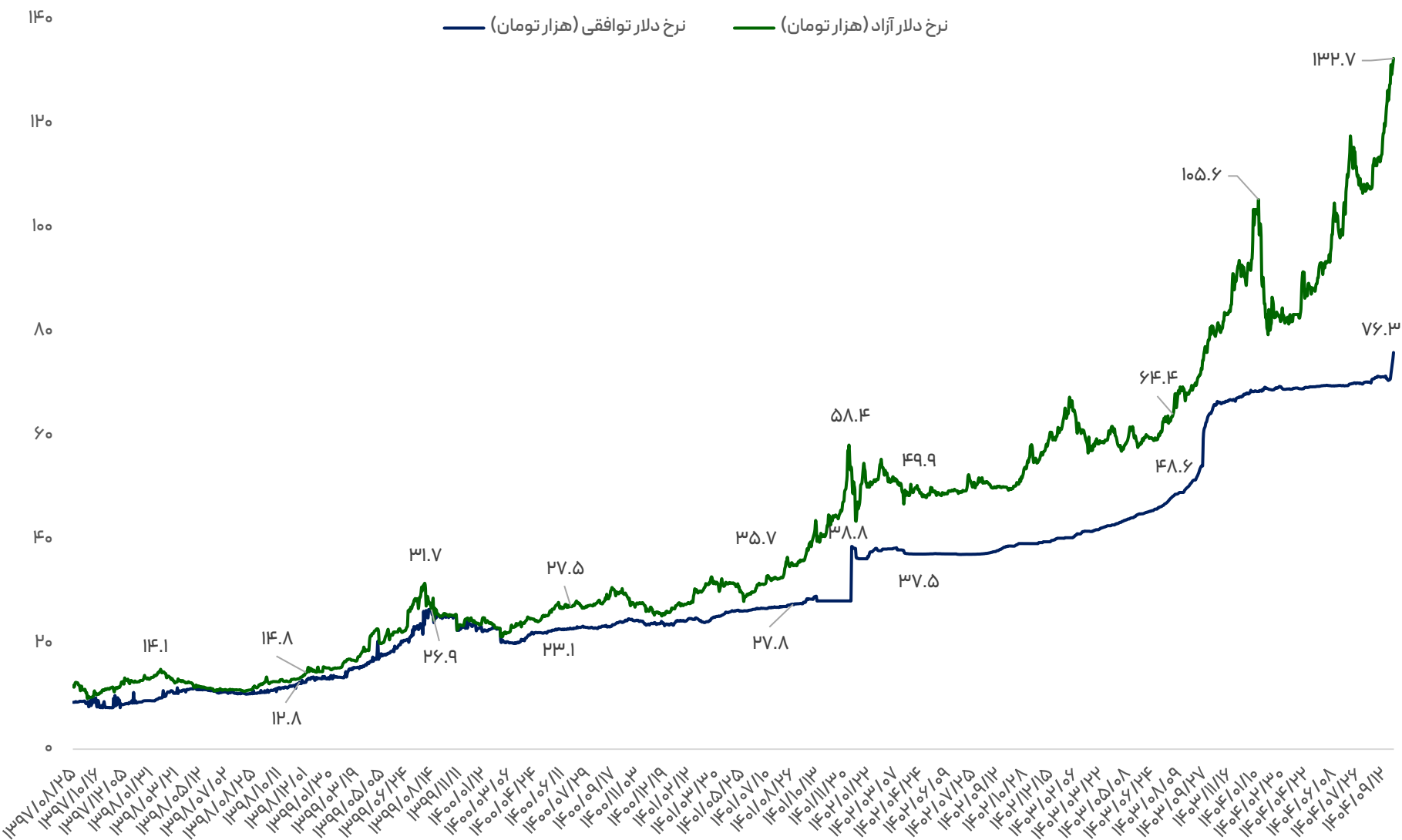


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K5 در نظر گرفته شده است.



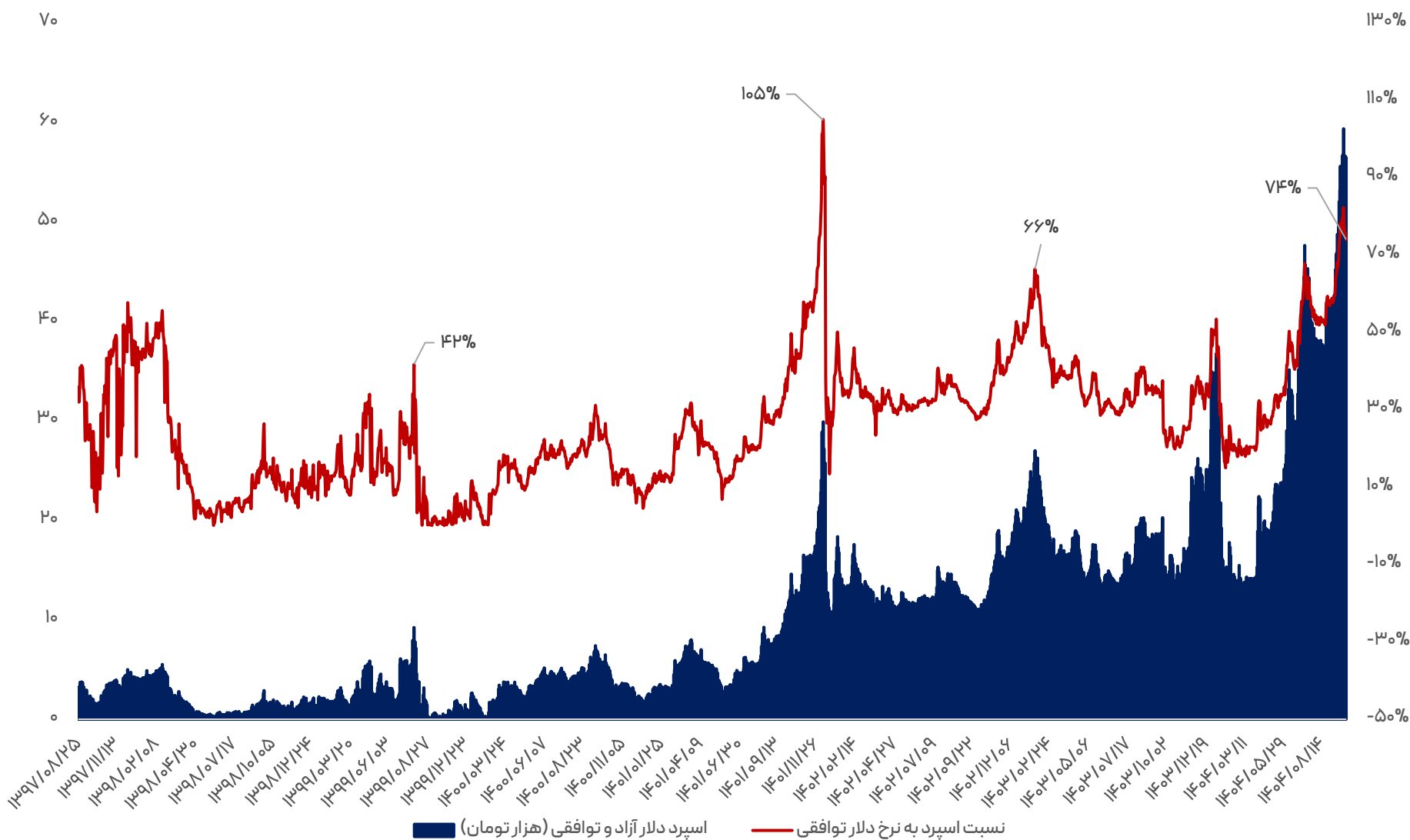
روند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۳۹,۴۴۷ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۷۴۹,۸۶۰ ریالی ایستاد.



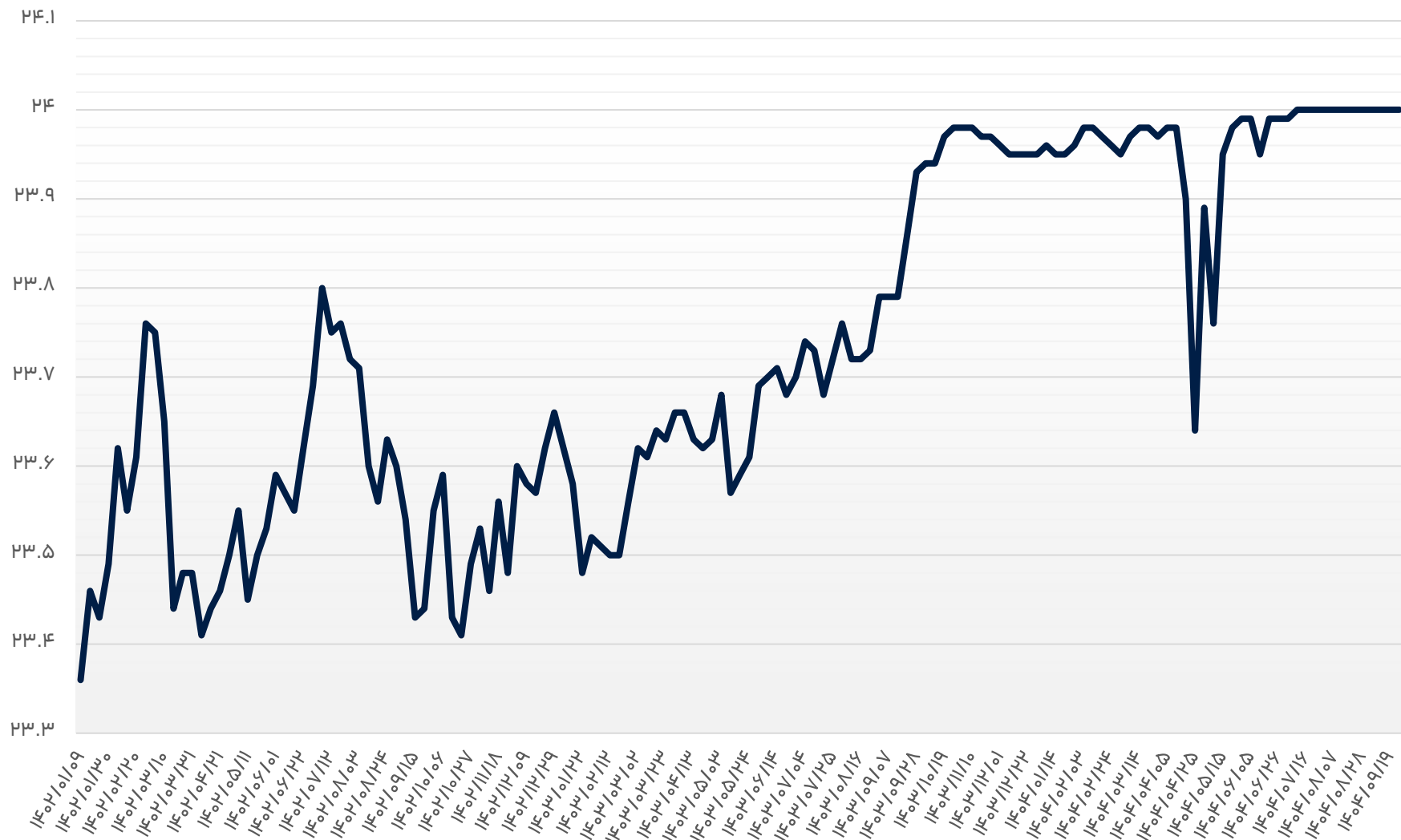
اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

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.



نتایج طرح «گردآوری اطلاعات پروانه‌های ساختمانی صادر شده توسط شهرداری‌های کشور» در فصل تابستان سال ۱۴۰۴

کاهش ۱۱.۱ درصدی واحدهای مسکونی پیش‌بینی شده در پروانه‌های صادر شده برای احداث ساختمان توسط شهرداری تهران و ۲۷.۹ درصدی آن در شهرداری‌های کل کشور در تابستان ۱۴۰۴ نسبت به تابستان ۱۴۰۳؛ بررسی نتایج طرح «گردآوری اطلاعات پروانه‌های ساختمانی صادر شده توسط شهرداری‌های کشور» در فصل تابستان سال ۱۴۰۴ نشان می‌دهد:

شهر تهران

در تابستان سال ۱۴۰۴، تعداد ۱۳,۱۵۲ واحد مسکونی در پروانه‌های صادر شده برای احداث بنا از سوی شهرداری تهران، پیش‌بینی شده است که نسبت به فصل گذشته ۱۹.۱ درصد افزایش و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۱۱.۱ درصد کاهش داشته است. متوسط تعداد واحد مسکونی برای هر یک از این پروانه‌های احداث بنا ۸.۹ واحد بوده است.

تعداد ۱,۴۸۲ پروانه‌ی احداث بنا توسط شهرداری تهران در تابستان ۱۴۰۴ صادر شده است که نسبت به فصل گذشته ۱۱.۳ درصد افزایش و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۲۵.۴ درصد کاهش داشته است.

مجموع مساحت زیربنا در پروانه‌های احداث بنا صادر شده از سوی شهرداری تهران در تابستان ۱۴۰۴ بالغ بر ۲,۳۷۶ هزار مترمربع بوده است که نسبت به فصل گذشته ۲۸.۳ درصد افزایش و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۹.۸ درصد کاهش داشته است. متوسط مساحت زیربنای این دسته از پروانه‌ها در دوره‌ی مورد بررسی ۱,۶۰۳ مترمربع بوده است.



کل نقاط شهری کشور

در تابستان سال ۱۴۰۴، تعداد ۸۲,۱۹۹ واحد مسکونی در پروانه‌های صادرشده برای احداث بنا از سوی شهرداری‌های کشور پیش‌بینی شده است که نسبت به فصل گذشته ۲۴.۷ درصد و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۲۷.۹ درصد کاهش داشته است. متوسط تعداد واحد مسکونی در هر پروانه‌ی احداث بنا ۳.۷ واحد بوده است.

تعداد ۲۲,۴۱۴ پروانه‌ی احداث بنا توسط شهرداری‌های کشور در تابستان ۱۴۰۴ صادرشده است که نسبت به فصل گذشته ۲۳.۵ درصد و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۳۲.۲ درصد کاهش داشته است.

مجموع مساحت زیربنا در پروانه‌های صادرشده برای احداث بنا در تابستان ۱۴۰۴ حدود ۱۷,۴۲۶ هزار مترمربع بوده است که نسبت به فصل گذشته ۱۱.۹ درصد و نسبت به فصل مشابه سال گذشته ۱۵.۰ درصد کاهش داشته است. متوسط مساحت زیربنا در این پروانه‌ها ۷۷۷ مترمربع بوده است.



با سپاس از توجه شما

