

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۵ دی ماه ۱۴۰۴



دیدگاه دانایان

هفته اخیر بازار سرمایه با تداوم تقاضا در کلیت بازار و رشد ۷ درصدی شاخص کل سپری شد. شاخص کل هم‌وزن نیز هفته اخیر بیش از ۷ درصد رشد را به ثبت رساند و بیش از هفته‌های پیش، صعود بازار را همراهی کرد و حتی از شاخص کل هم پیشی گرفت.

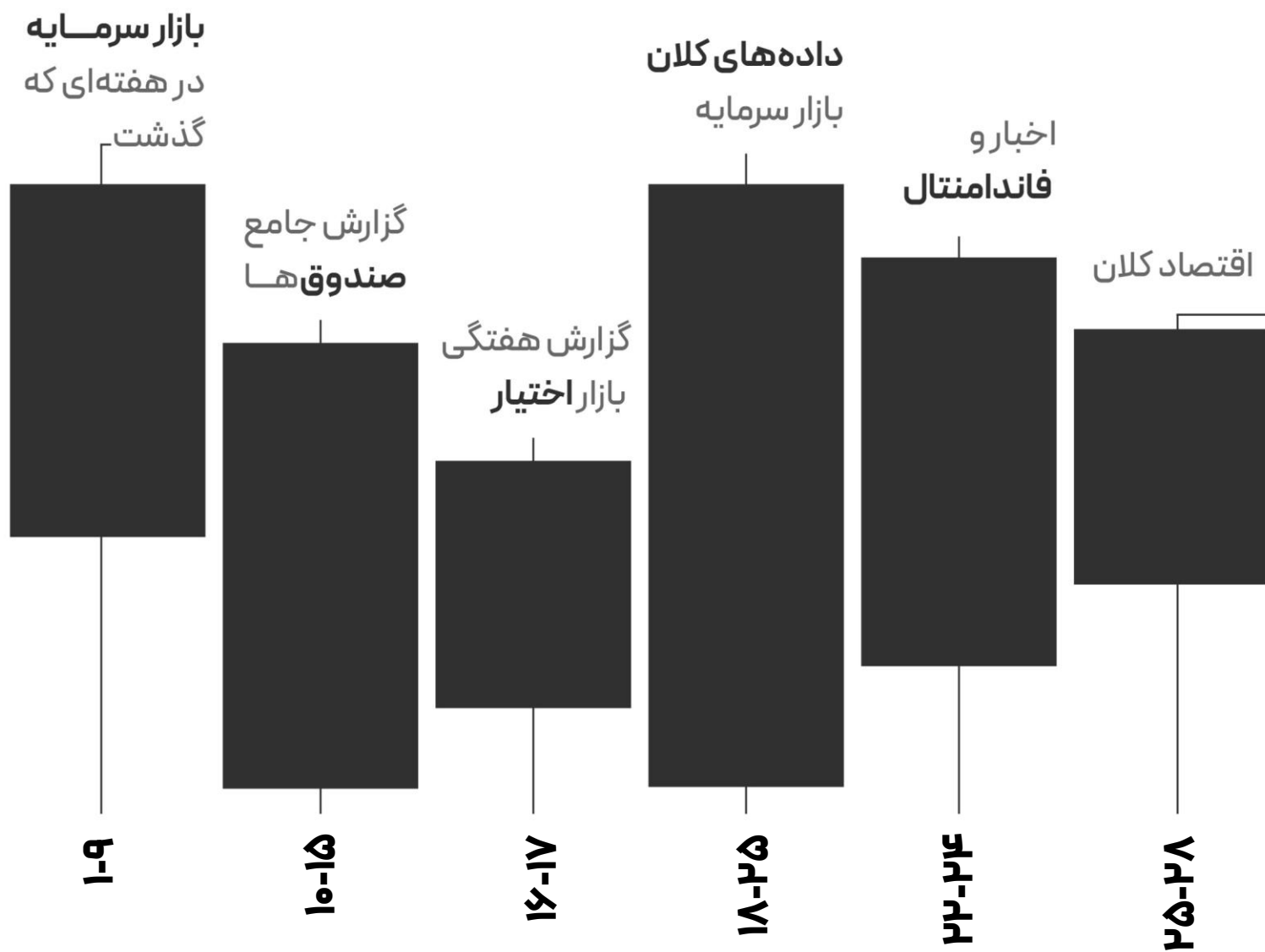
در بازارهای موازی شاهد رشد نرخ دلار در بازار آزاد و رسیدن آن به سطوح بالای ۱۳۷ هزار تومان بودیم. در بازار طلا نیز، با وجود تداوم خروج پول حقیقی از **صندوق‌های طلا**، شاهد تداوم تقاضا و رسیدن نرخ طلای گرمی به بیش از ۱۴ میلیون تومان بودیم. در بازار خودرو اما در هفته اخیر، همراهی با روند افزایشی نرخ دلار را شاهد نبودیم و آرامش نسبی در قیمت‌های بازار خودرو حاکم شد.

اخبار مربوط به بازار هم‌کامکان مثبت است. افزایش نرخ دلار توافقی و رسیدن به بالای ۸۱ هزار تومان، و همچنین اخبار مربوط به بودجه پیشنهادی سال ۱۴۰۵ از سوی دولت به مجلس، مزید بر علت صعود بازار سهام در هفته اخیر شد.

برایند گردش حقیقی‌ها در معاملات خرد بازار سهام هفته پیش هم مشابه دو هفته پیش‌تر از آن مثبت بود و بیش از ۷.۳ همت پول حقیقی به معاملات خرد بازار سهام وارد شد. طی سه هفته اخیر بیش از ۱۶ همت منابع حقیقی به معاملات خرد بازار سهام وارد شده است!

در سوی مقابل گردش پول در صندوق‌های درآمد ثابت هم حدود ۲ همت مثبت بود. اما در صندوق‌های طلا، روند خروج پول حقیقی ادامه پیدا کرد و علی‌رغم افزایش قیمت‌ها، بیش از ۸ همت پول حقیقی از صندوق‌های طلا خارج شد.

به لحاظ تکنیکالی نیز، کماکان شرایط خوبی برقرار است و بهتر است به جای پیشگویی نقطه انتهایی روند صعودی بازار، با ارتقای حد زیان سهام، روند صعودی بازار را همراهی کرد و یا منتظر شکل‌گیری نشانه‌های اصلاحی در پارامترهای نقدینگی بازار (ارزش معاملات خرد و روند ورود و خروج پول حقیقی) و یا نقض شدن شرایط صعود به لحاظ تکنیکالی بود.



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	+ ۶.۹۳ %	+ ۲۳.۹۱ %	+ ۵۹.۵۹ %	+ ۳۴.۹۸ %	+ ۴۱.۴۱ %
بازده شاخص کل هم وزن	+ ۷.۴۷ %	+ ۲۰.۱۲ %	+ ۴۶.۴۱ %	+ ۲۱.۹۳ %	+ ۳۲.۵۹ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

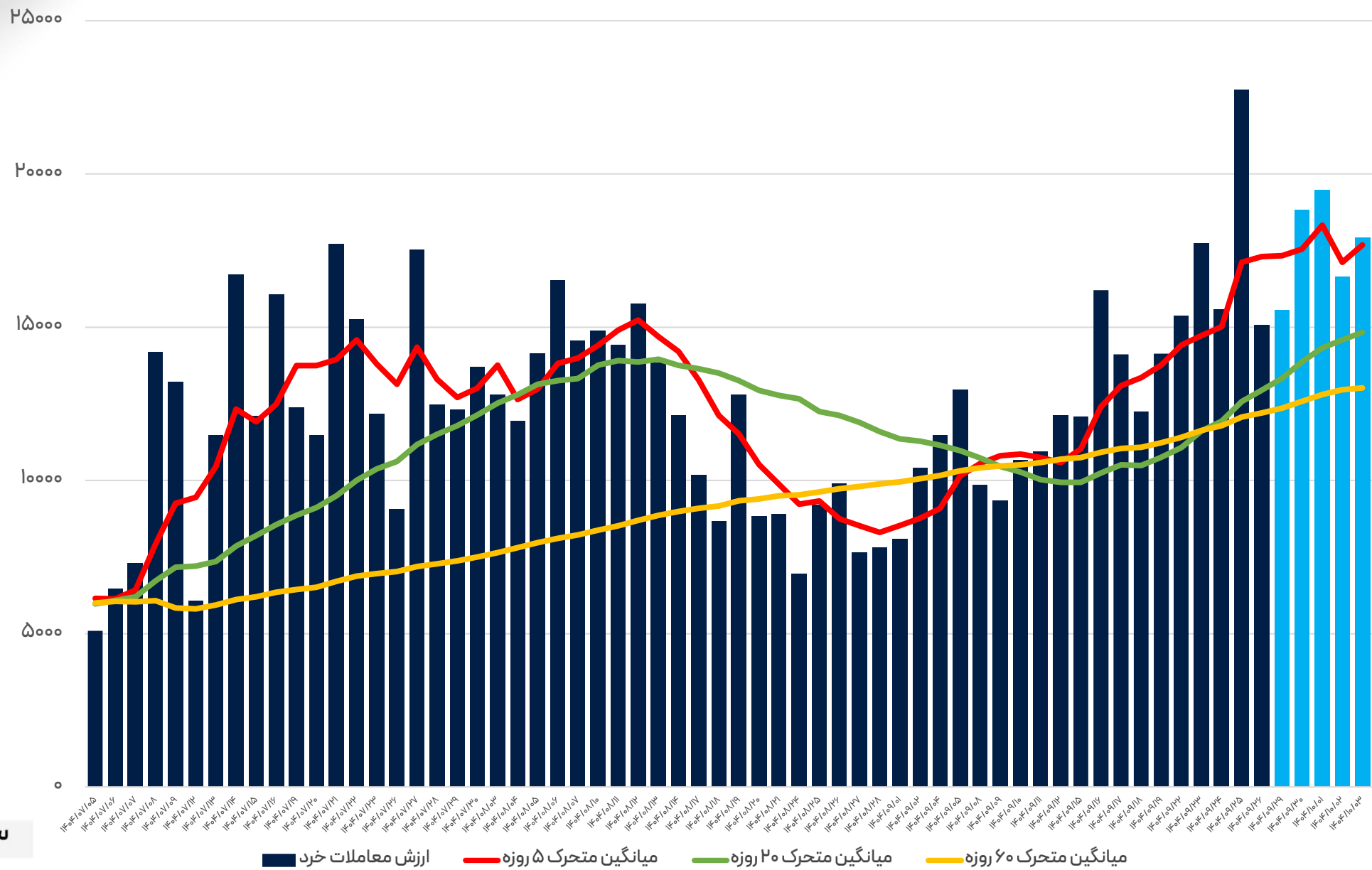
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل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

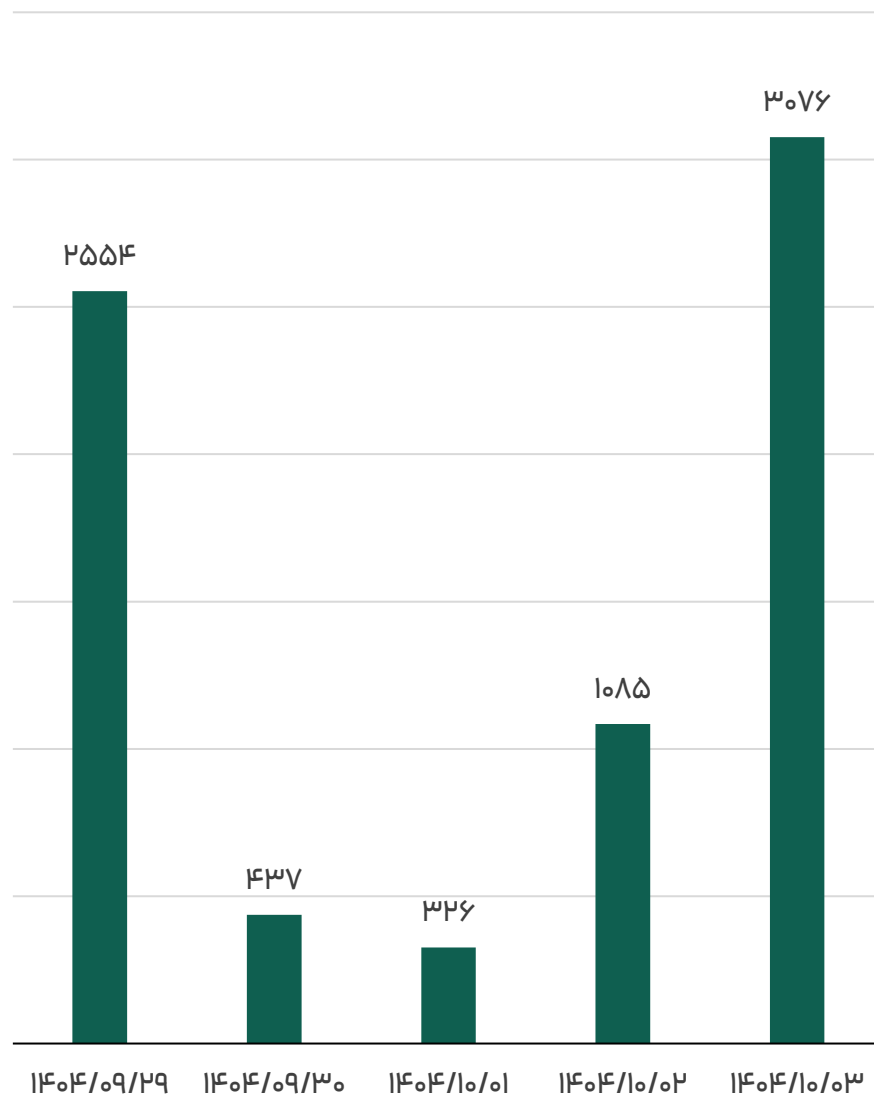


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

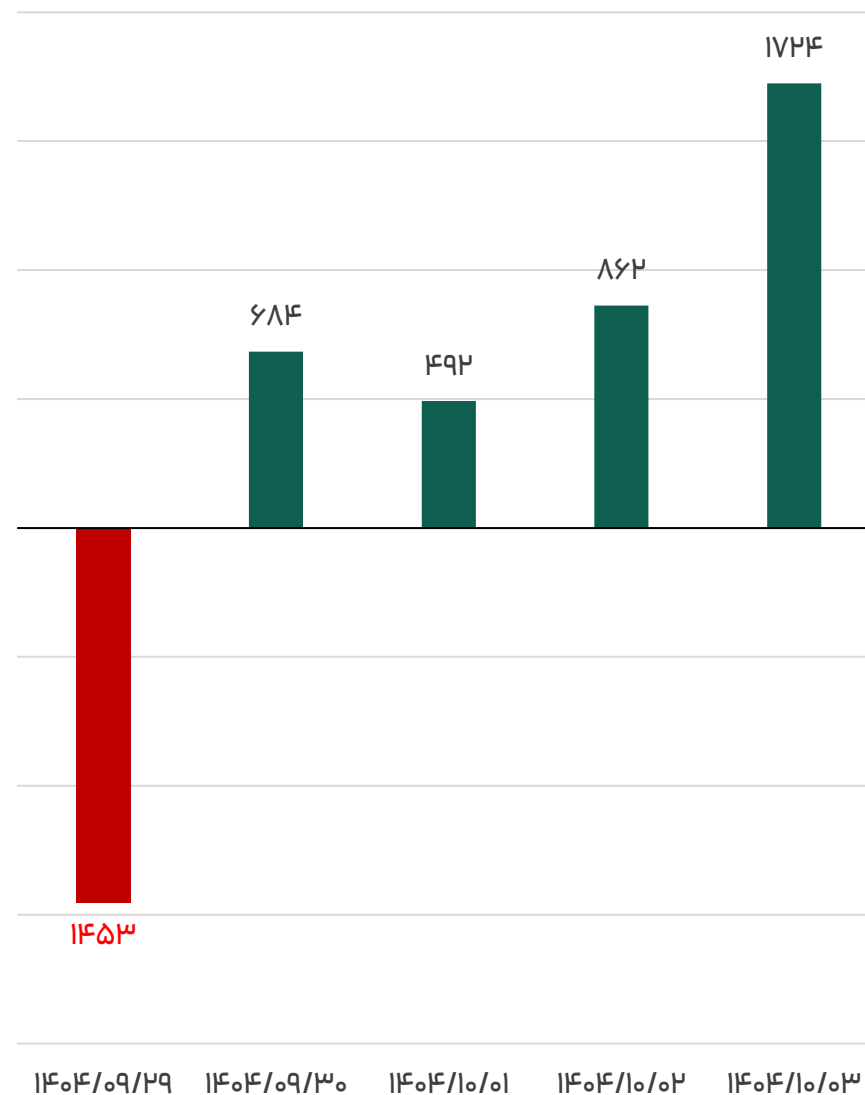


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

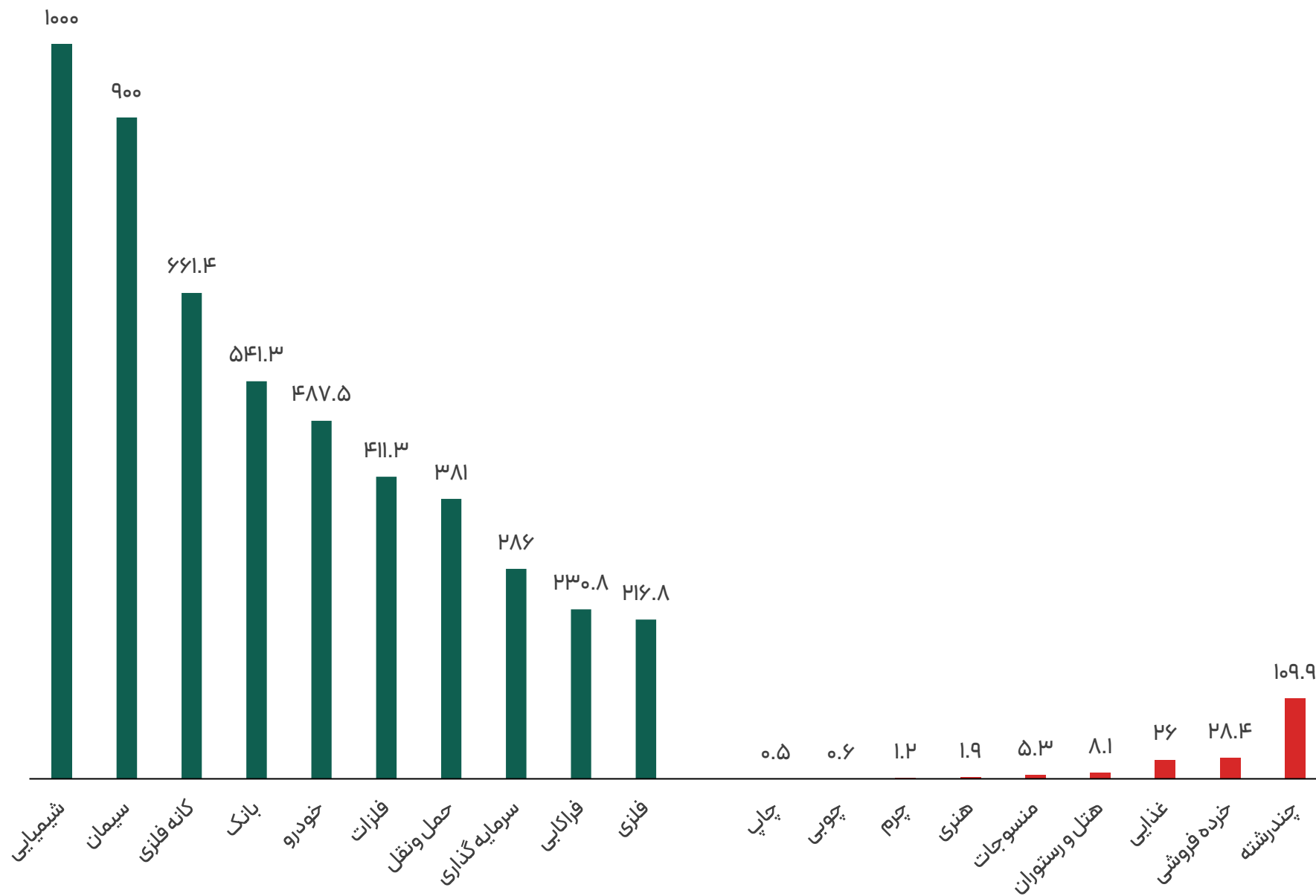
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



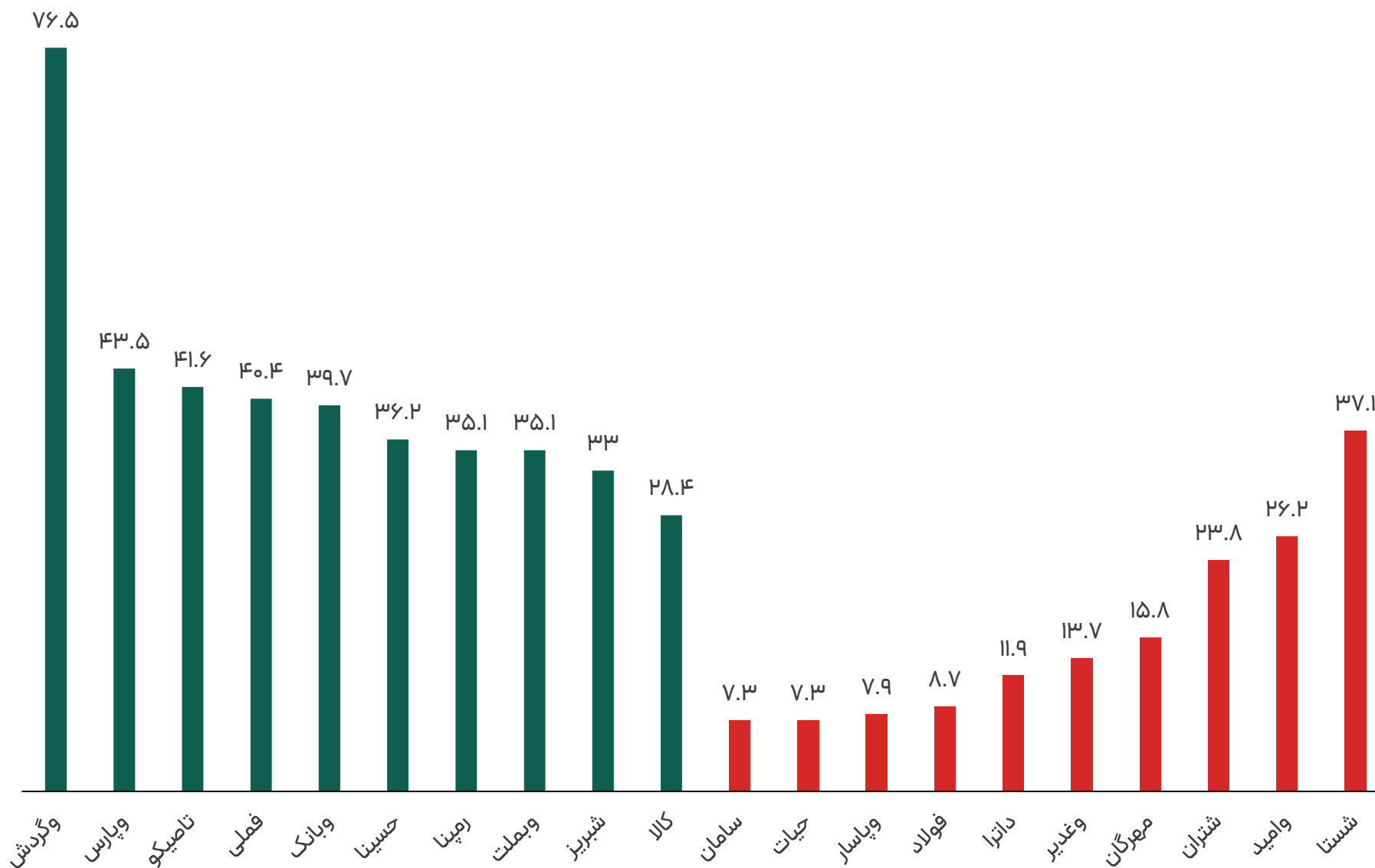
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



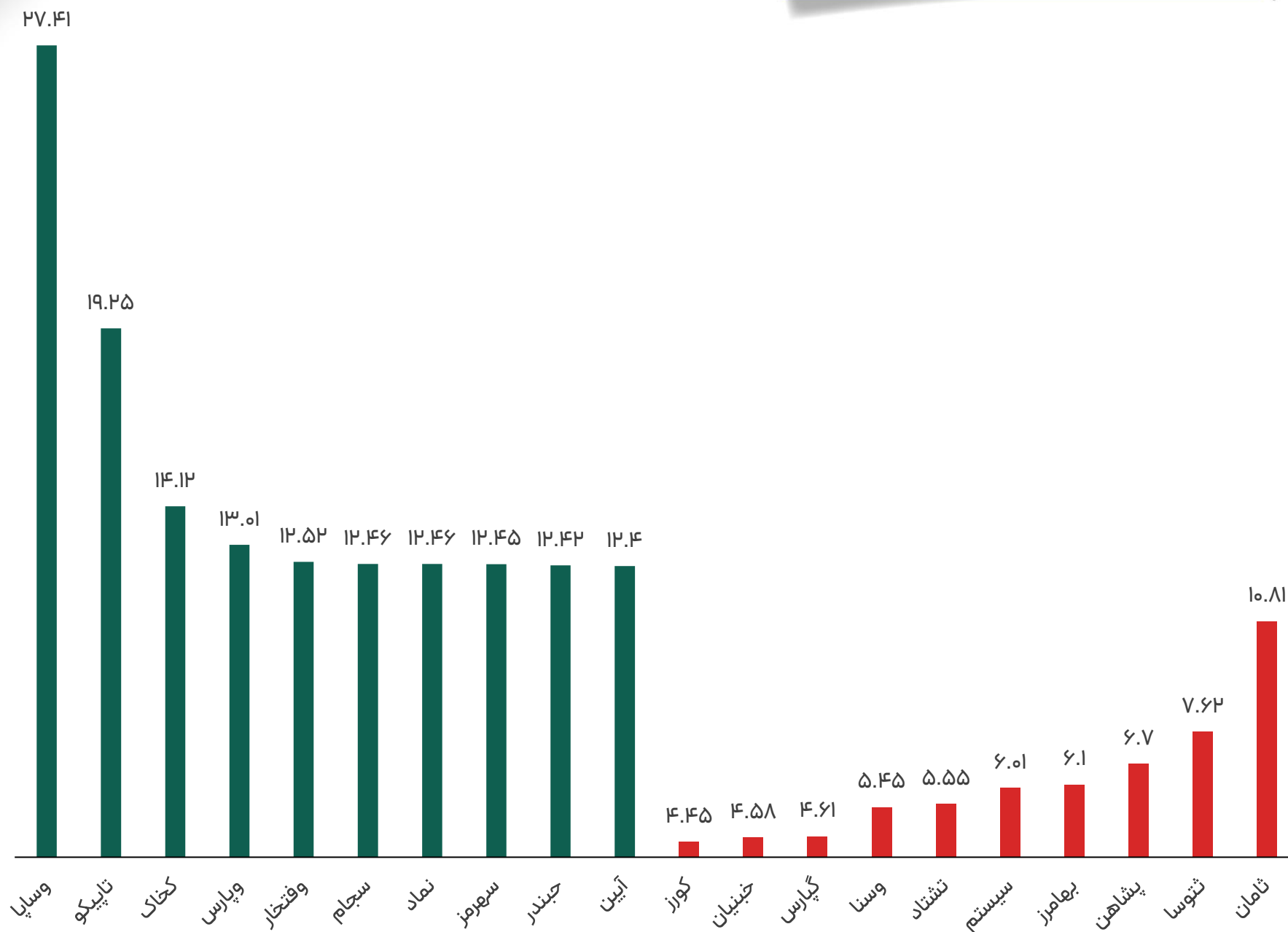
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



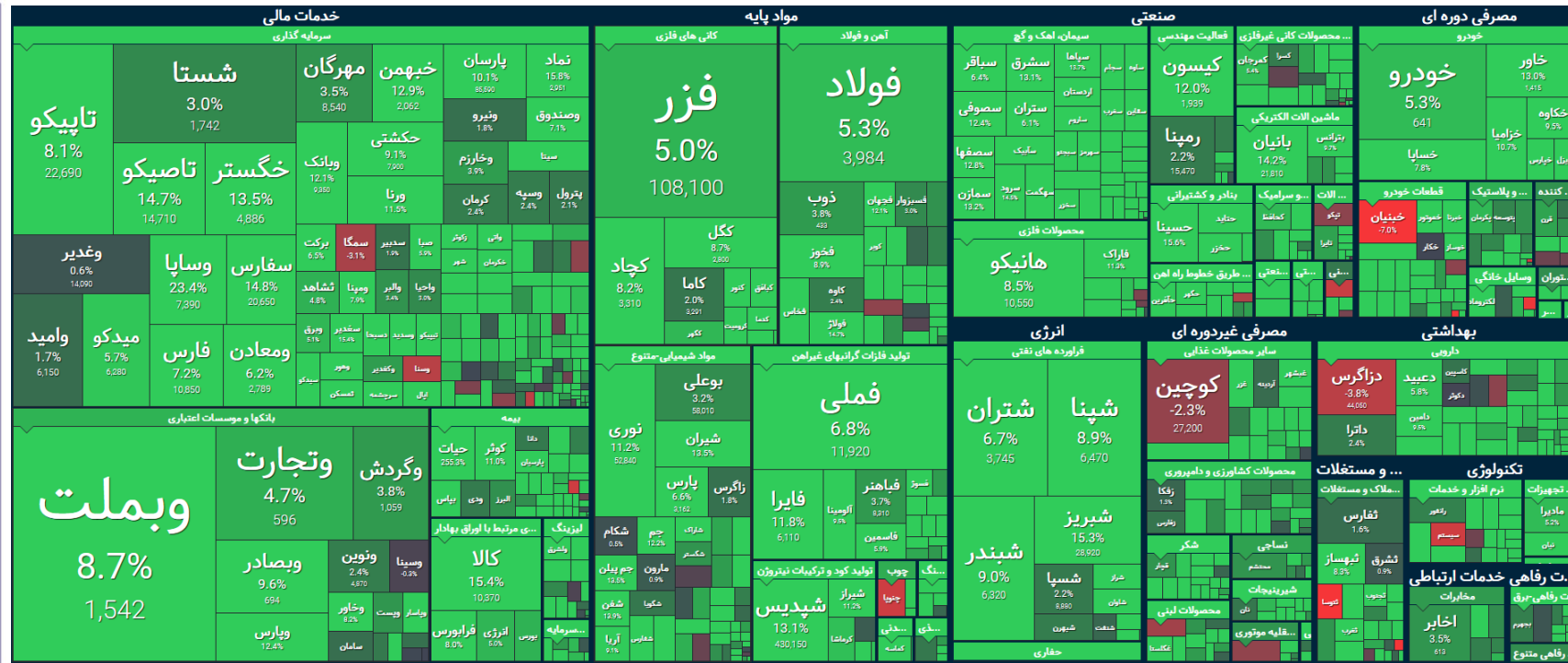
میانگین بیشترین ورود و خروج پول روزانه به نمادها در هفته اخیر (میلیارد تومان)



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 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.

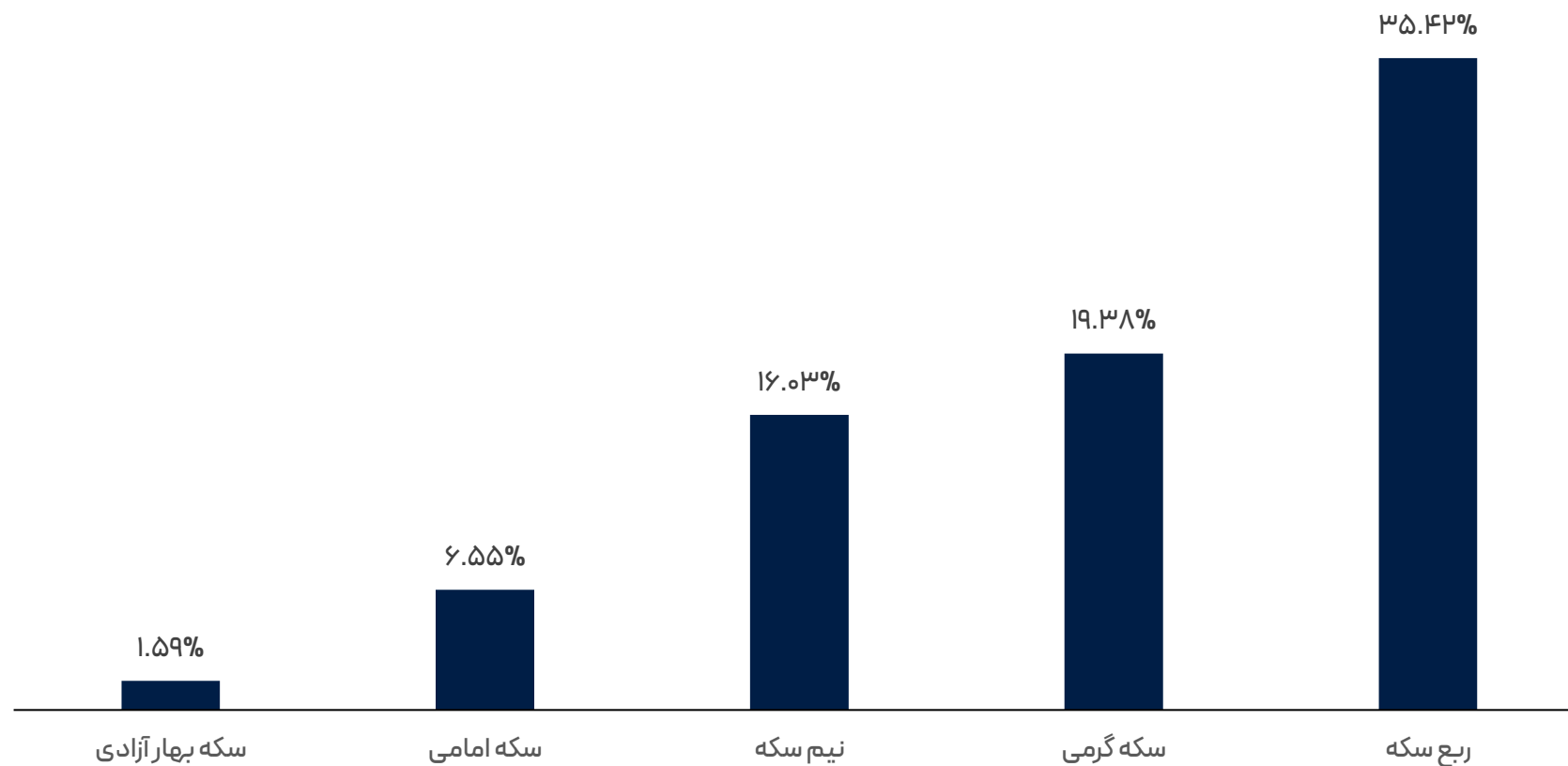


گزارش صندوق‌های اهرمی

نماد	درصد حباب ↓	میانگین حباب		ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل	بازدهی	
		یک ماهه	سه ماهه					ماهانه	سالانه
 پیشران	۰.۸۲	-۳.۲	-۳.۴۸	۱.۵۹	۰.۸۹	۱.۴۲	۱.۴۱	۳۸.۱۱	۱۰۰.۸۵
 موج	-۴.۷۴	-۴.۵۴	-۳.۸۱	۱.۷۳	۰.۹۷	۱.۶۸	۱.۷۶	۴۱.۶۳	۱۲۳.۱۸
 نارنج اهرم	-۴.۸۴	-۸.۰۳	-۵.۶۹	۱.۹	۰.۹۱	۱.۷۳	۱.۸۱	۴۵.۲۴	۱۲۹.۱۲
 دوایکس	-۸.۷	-۲.۵۵	-۰.۹۵	۱.۸۴	۰.۹۹	۱.۸۲	۱.۹۸	۴۰.۶۱	۱۳۴.۷۱
 توان	-۹.۹۳	۶.۸۲	۲.۱۶	۱.۸۳	۰.۸۸	۱.۶۱	۱.۷۷	۳۹.۷۵	۱۱۰.۵۳
 اهرم	-۱۰.۹۹	-۸.۰۵	-۵.۱۳	۱.۶۴	۰.۹۱	۱.۴۹	۱.۶۵	۳۱.۶۴	۹۶.۹۸
 شتاب	-۱۲.۳۸	-۱۱.۴۲	-۸.۹۴	۱.۸	۰.۸۵	۱.۵۳	۱.۷۲	۳۲.۳۴	۱۰۲.۱۴
 جهش	-۱۲.۵۵	-۱۱.۶۹	-۹.۳۸	۱.۸۷	۰.۸۶	۱.۶۱	۱.۸۱	۳۸.۲۹	۱۲۱.۶
 بیدار	-۱۳.۲۹	-۱۲.۳۳	-۹.۶	۱.۸۹	۰.۸۸	۱.۶۶	۱.۸۸	۳۶.۳۳	۱۰۹.۱۸



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
پیروز 	۲۸.۸۷	۶۴.۶۷	۳۳.۳۲	۰.۶۵	۰.۹۶	-۰.۶	۰.۷۸	۰.۳۹
رونق 	۲۵.۵۴	۵۵.۵۷	۳۲.۷	۰.۷۴	۰.۶	-۲.۵۶	-۶.۰۸	-۵.۹۴
ک فراز 	۲۴.۸۶	۵۳.۶۲	۳۰.۵۸	۰.۴۶	۰.۶۲	۰.۲۸	۰.۳۴	۱.۵۱
بذر 	۲۴.۸۱	۴۸.۰۹	۳۴.۹۲	۰.۲	۰.۵۸	-۰.۱	-۰.۸۳	-۰.۴۹
ابتکار 	۲۴.۰۵	۴۹.۷۹	۴۰.۸	۲.۴۹	۱.۷۴	۰.۰۷	-۰.۰۳	-۰.۱۱
فیروزه 	۲۴.۰۴	۶۴.۲۱	-۴۷.۴۹	۱۵.۰۲	۱۷.۳۱	۱.۳	۰.۶۴	۰.۰۴
آرام 	۲۲.۸۹	۶۰.۷۵	۳۴.۷	۲۱.۴۲	۱۷.۰۵	۰.۴۸	۰.۰۸	-۰.۰۶
خبرگان 	۲۲.۵۹	۴۹.۴۹	-۹۰.۷۶	۳.۷۲	۲.۸۷	۰.۸۵	۰.۷۹	۱.۰۲
آمینیس 	۲۲.۵۲	۴۹.۲۶	۶۶.۵۷	۱.۶۵	۱.۳۹	۰.۵۳	۰.۳۹	۰.۵

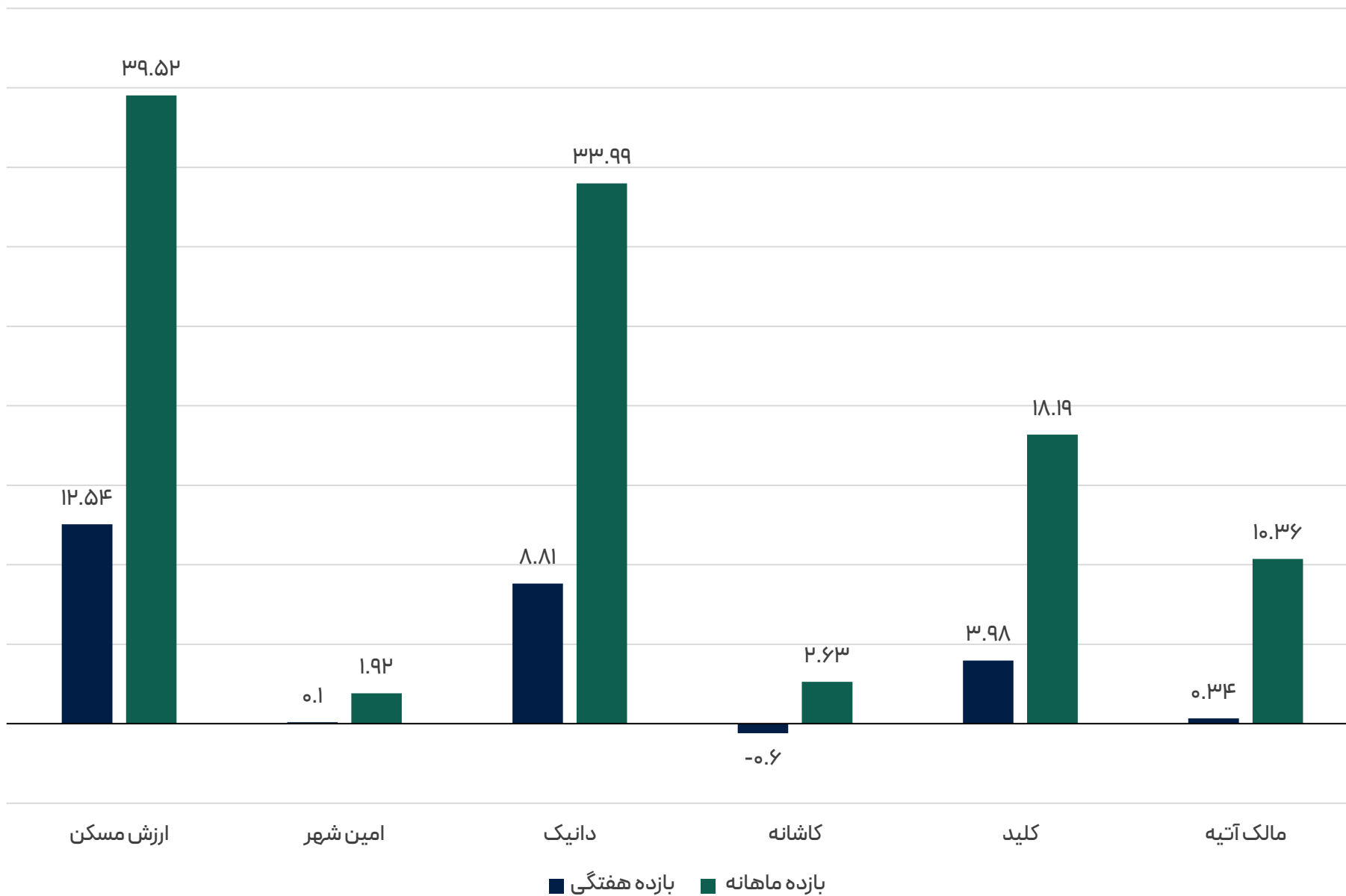


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی			میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه		یک ماهه	سه ماهه
 معدن	۲۹.۰۳	۵۵.۶۹	۲۵.۸	۱۶.۶	۱۳.۶۶	۰.۱۹	-۰.۸۵	-۰.۴۹
 رسانا	۲۸.۵۹	۵۴.۹۳	۱۰.۹۸	۳.۱	۴.۰۵	۰.۱۴	۰.۱۷	۰.۳۲
 داب	۲۷.۸۷	۷۷.۷۶	۳۳.۶۶	۷.۸۵	۹.۲۲	۰.۶۹	۰.۰۲	۰.۱۳
 استیل	۲۷.۰۲	۷۳.۷۲	۲۷.۴۵	۱۱.۳۴	۱۵.۹۷	۱.۳۴	۰.۰۵	-۰.۰۴
 فارمانی	۲۵.۷۹	۵۹.۷۸	۴۴.۹	۴.۲۸	۲.۹۹	-۰.۲۹	-۰.۴	-۰.۳۹
 فارما کیان	۲۵.۵۲	۶۵.۴۲	۵۲.۲۸	۱۹.۲۱	۱۸.۳۴	۰.۰۷		-۰.۵۵
 پترودارپوش	۲۵.۴۱	۵۶.۳۶	۱۹.۰۳	۱.۹۲	۶.۲۲	۰.۹۱	-۰.۳۶	-۰.۳۵
 پتروفارس	۲۵.۳۵	۵۳.۴۴	۳۲.۹	۰.۴۷	۲.۳۶	۹.۷۶	۰.۲۲	-۰.۳
 آلیاز	۲۵.۱	۶۸.۹۴	۳۶.۰۹	۷.۳۵	۷.۵۶	-۰.۹۸	-۰.۶۶	-۰.۷۴



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



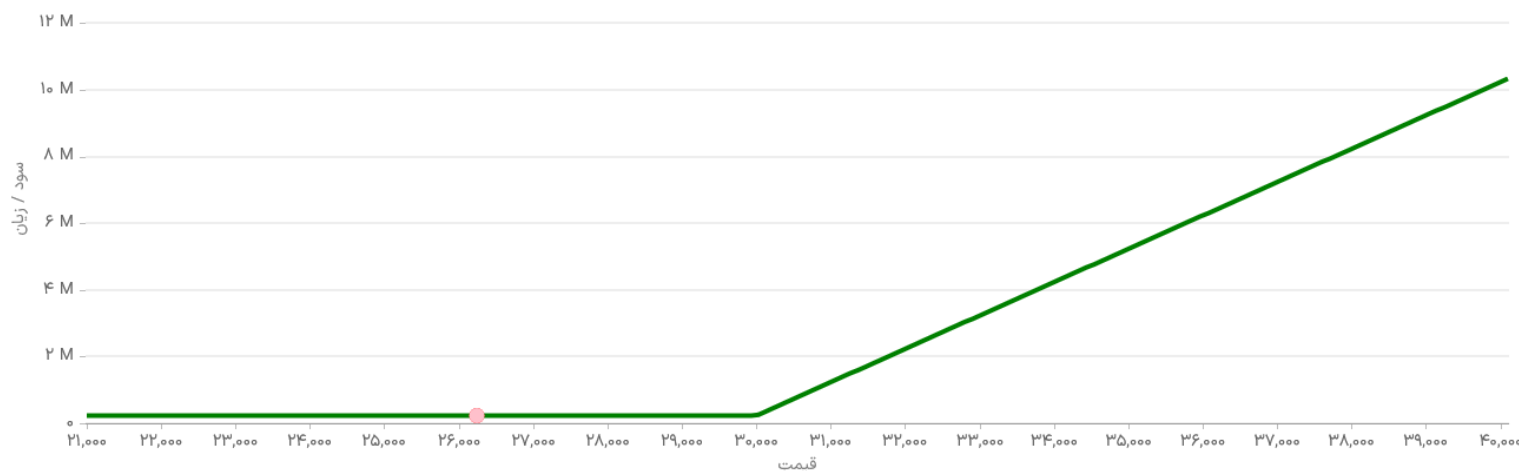
گزارش هفتگی بازار آپشن

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)

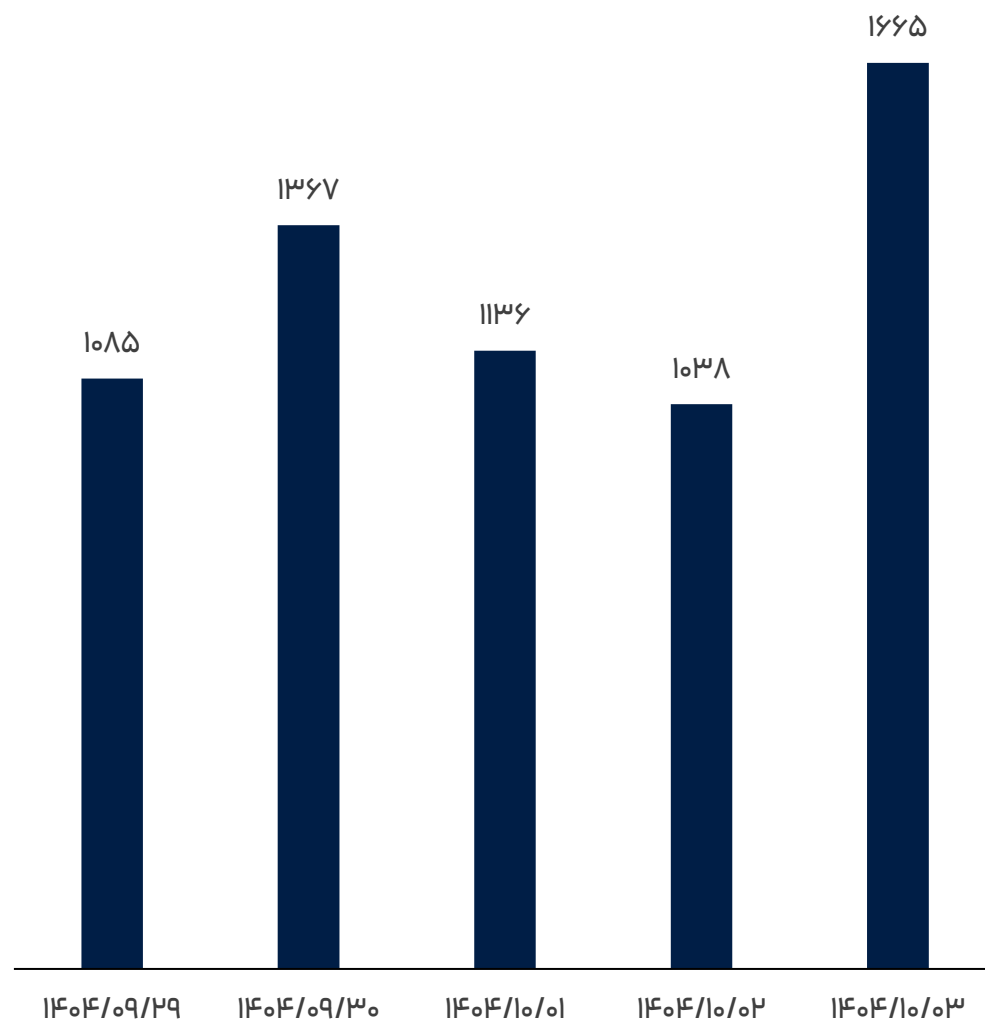
این استراتژی با خرید همزمان دارایی پایه (صندوق اهرم) و خرید اختیار فروش آن انجام می‌شد. اشاره شد که با توجه به اینکه دیدگاه و ریسک‌پذیری معامله‌گر به چه صورت باشد، قراردادهای طهرم ۱۰۲۷، طهرم ۱۰۲۶ و طهرم ۱۰۲۵ می‌توانند مناسب باشند. طهرم ۱۰۲۷ استراتژی بدون ریسک می‌ساخت، و سودآوری استراتژی از قیمت ۳,۰۲۱ 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. و همچنین با استفاده از طهرم ۱۰۲۵، حداکثر ریسک استراتژی ماهانه ۴ درصد بوده و در عوض، از قیمت ۲,۷۷۰ تومان در صندوق اهرم، سودآوری استراتژی آغاز می‌گردد. (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	افست	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
۱۰۲۶مهرم ۲۶,۲۵۳.۴ B	۱۰۲۸مهرم ۹,۲۶۶.۹ B	۱۰۲۸مهرم ۲,۳۶۶.۶ B
۱۱۲۶مهرم ۱۰,۷۲۸ B	۱۱۲۶مهرم ۶,۲۹۱.۱ B	۱۱۲۶مهرم ۱,۸۶۹.۷ B
۱۰۲۸مهرم ۱۰,۴۱۲.۸ B	۱۰۲۶مهرم ۵,۶۷۷.۱ B	۱۰۲۶مهرم ۱,۰۶۷.۱ B
۱۰۲۵مهرم ۷,۷۶۰.۷ B	۱۰۲۷مهرم ۴,۰۶۴.۵ B	۱۰۲۷مهرم ۸۹۵.۶ B
۱۰۲۷مهرم ۷,۷۳۶.۳ B	۱۱۲۵مهرم ۳,۰۳۶.۶ B	۱۱۲۵مهرم ۷۸۲.۳ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۰۲۶مهرم ۷,۰۲۶.۹ B	۱۰۲۸مهرم ۱,۹۲۹.۹ B	۱۰۲۸مهرم ۳۹۲.۴ B
۱۰۲۸مهرم ۲,۲۸۰.۹ B	۱۰۲۷مهرم ۱,۳۴۹.۹ B	۱۱۲۶مهرم ۱۳۹.۹ B
۱۰۲۷مهرم ۲,۱۸۵.۳ B	۱۰۲۶مهرم ۶۸۰.۳ B	۱۰۲۷مهرم ۱۰۵.۹ B
۱۱۲۵مهرم ۱,۶۴۰.۷ B	۱۱۲۶مهرم ۶۰۸.۳ B	۱۱۲۵مهرم ۷۸.۷ B
۱۰۲۴مهرم ۱,۱۸۱.۱ B	۱۱۲۵مهرم ۵۵۷.۳ B	۱۰۲۶مهرم ۵۲.۶ 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.

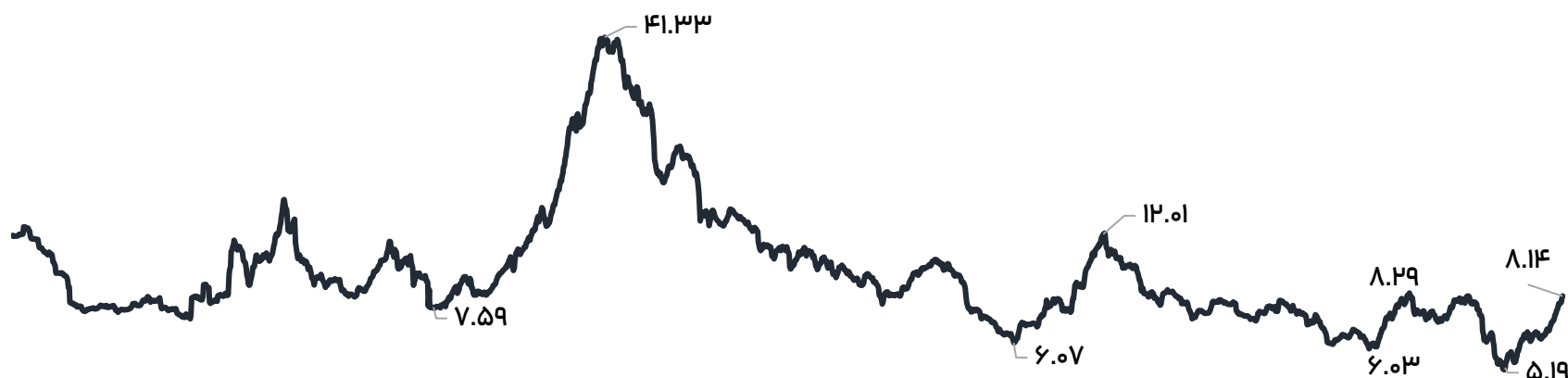
در هفته های اخیر اما، شاهد واکنش مثبت بازار به محدوده ۳ میلیون واحد بودیم (باکس سبز درج شده روی چارت) که در نهایت منجر به سقف شکنی مجدد شاخص کل و تداوم روند صعودی در شاخص کل و کلیت بازار شد. در ادامه، تثبیت کندل ها بر فراز سقف تاریخی نیز انجام شده و طی هفته اخیر هم، با رشد ۷ درصدی شاخص کل، شاهد ادامه 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

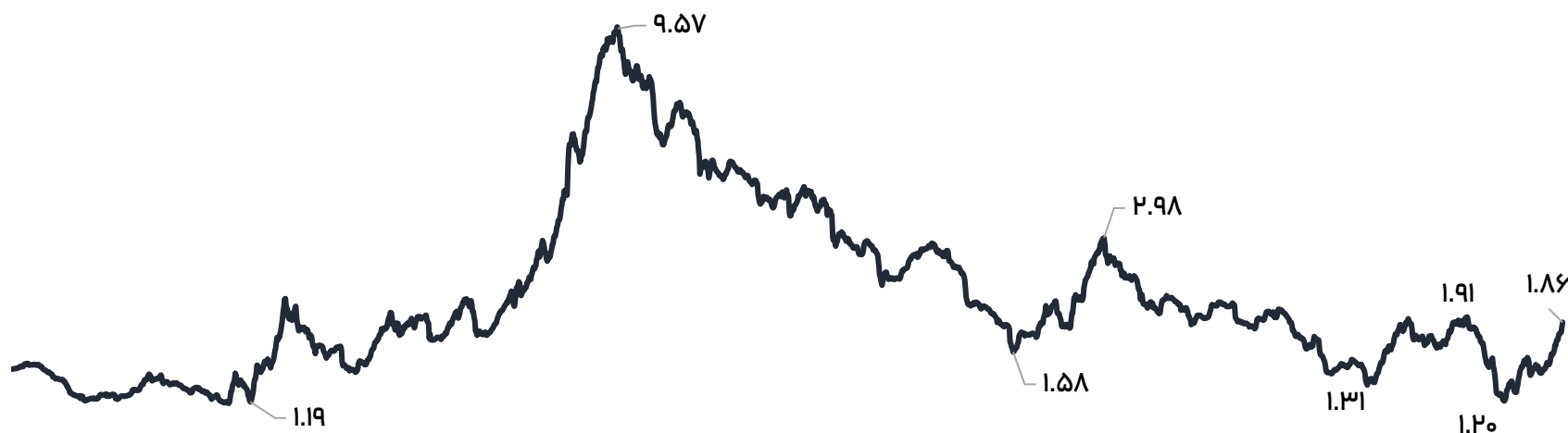
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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.

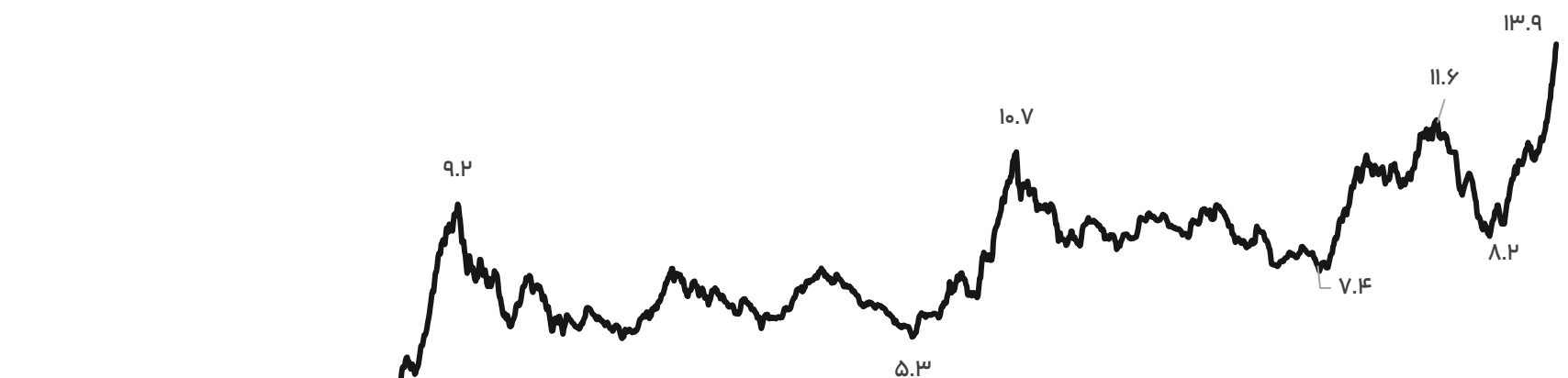
رشد تغییرات P/S بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



ارزش دلاری و ریالی بازار سرمایه

با وجود رشد ریالی بازار و 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)



ارزش دلاری بازار بورس (میلیارد دلار)





افزایش دامنه نوسان روی میز مدیران بورس قرار گرفت.

قادر معصومی خانقاه مدیر نظارت بر بازار سازمان بورس خبر داد:
«در حال حاضر افزایش دامنه نوسان در حال بررسی است و در آینده‌ای نزدیک در این خصوص تصمیماتی اتخاذ خواهد شد.»



رشد شدید انس جهانی نقره و اتمام پذیره‌نویسی صندوق‌های نقره بورسی

در هفته گذشته شاهد افزایش قیمت شدید انس جهانی نقره تا سطوح نزدیک به ۸۰ دلار بودیم. پذیره‌نویسی سه صندوق نقره بورسی هم هفته گذشته با استقبال خریداران و تقاضای سنگین، انجام شد و به اتمام رسید.

دلار توافقی به بالای ۸۱ هزار تومان رسید!

با وجود رشد نرخ دلار توافقی طی دو هفته اخیر از حدود ۷۰ هزار تومان به سطوح بالای ۸۱ هزار تومان، شکاف میان نرخ دلار آزاد و توافقی چندان کاهش نیافته که علت آن هم، رشد افسارگسیخته نرخ دلار در بازار آزاد است!



وسکاب، شپنا

بلوک شپنا که توسط زیرمجموعه بانک تجارت عرضه شد نیز توسط صندوق بازنشتستگی کارکنان بانک ها خریداری شد.

وسکاب، ونیکی، شبندر و شتران

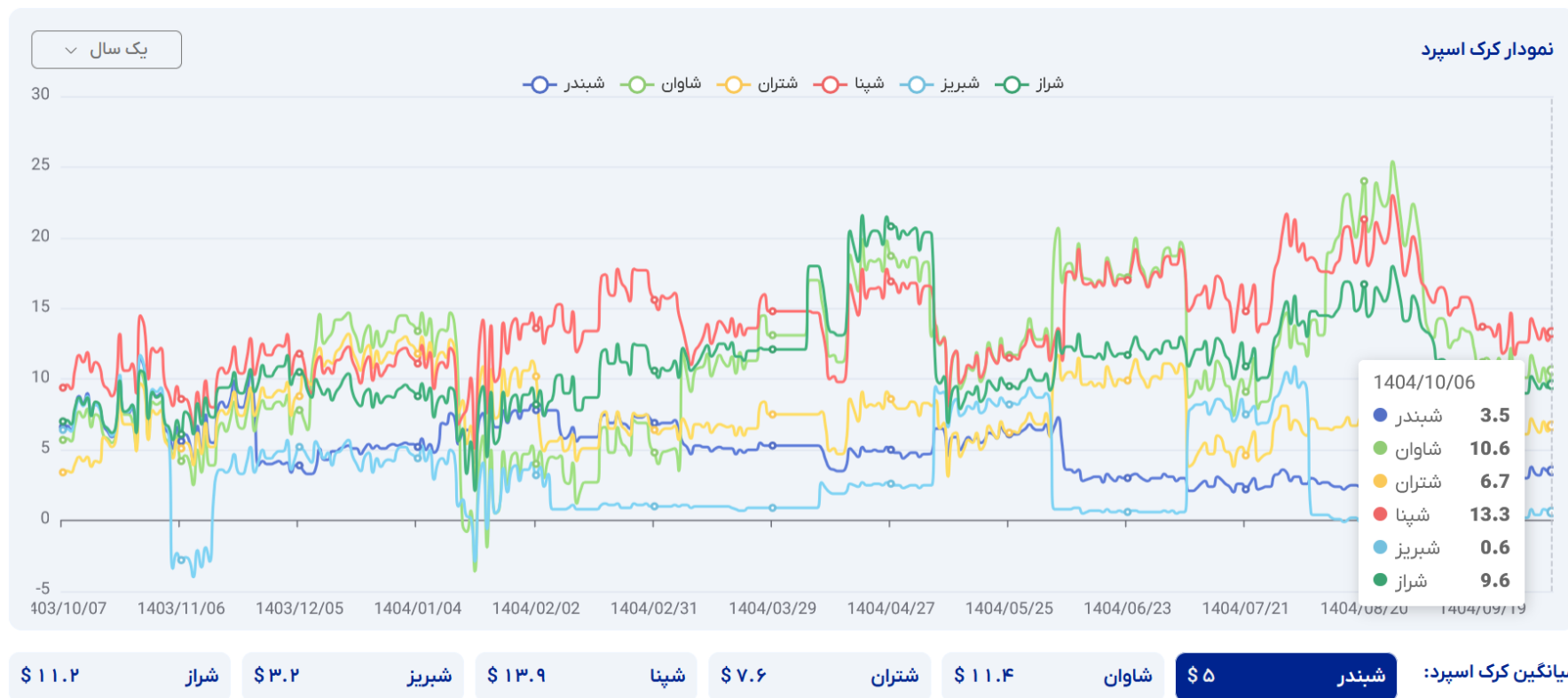
هر سه بلوک سرمایه گذاری ملی، پالایشگاه بندرعباس و پالایشگاه تهران که از سوی سرمایه گذاری توسعه معین ملت (زیرمجموعه بانک ملت) عرضه شد، توسط صندوق بازنشتستگی کارکنان بانک ها (با نماد وسکاب) به همان قیمت های پایه خریداری شد.

وتجارت و وبملت

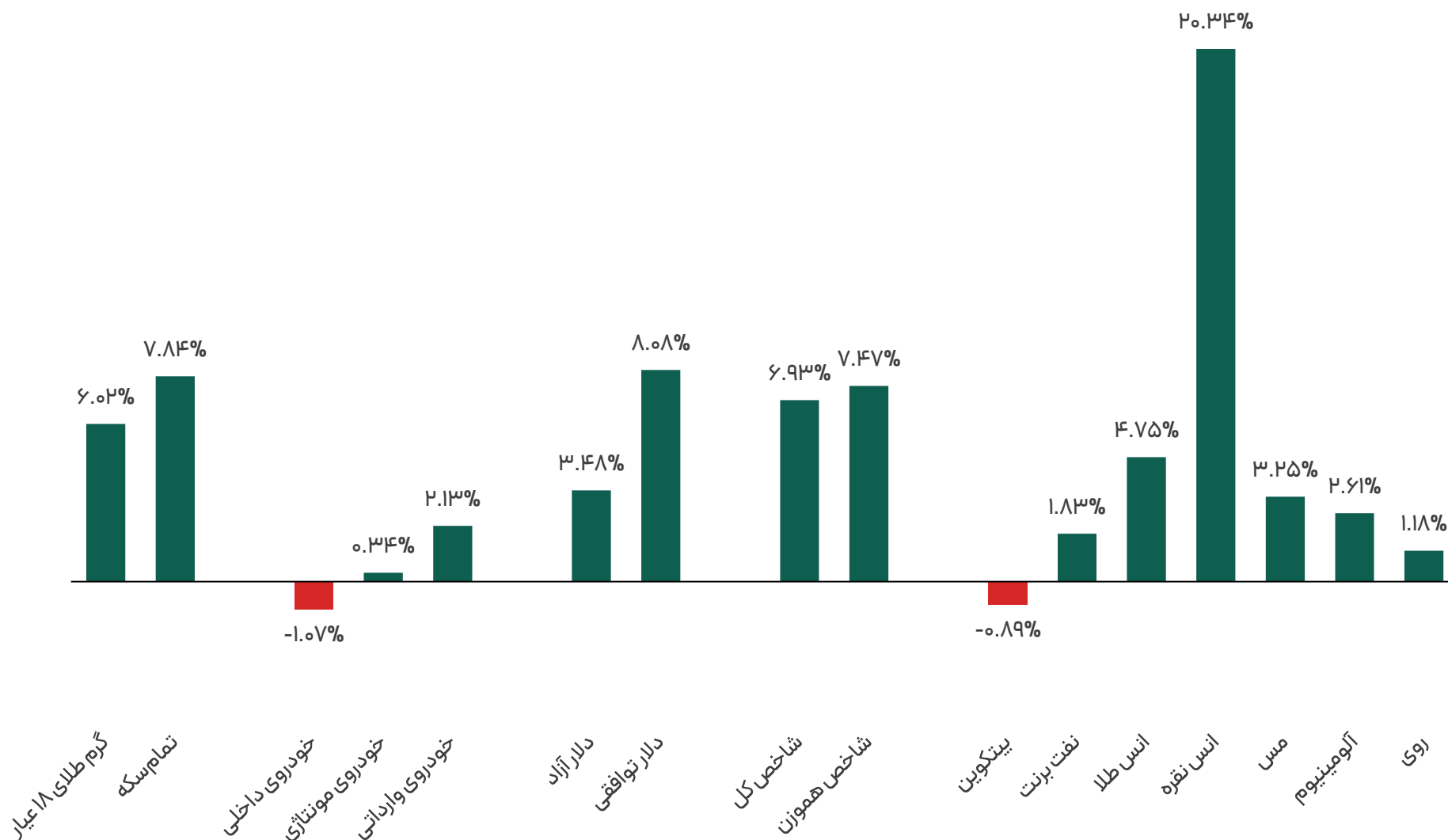
وتجارت و شناسایی سود ۱۲,۱۷۳ میلیارد تومانی از واگذاری ۴,۴۳ درصد از شپنا؛ زیرمجموعه وبملت نیز ۱۱,۶۶۴ میلیارد تومان سود بابت فروش بلوک شبندر، شتران و ونیکی شناسایی کرده است.



کرک اسپرد پالایشی‌ها



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

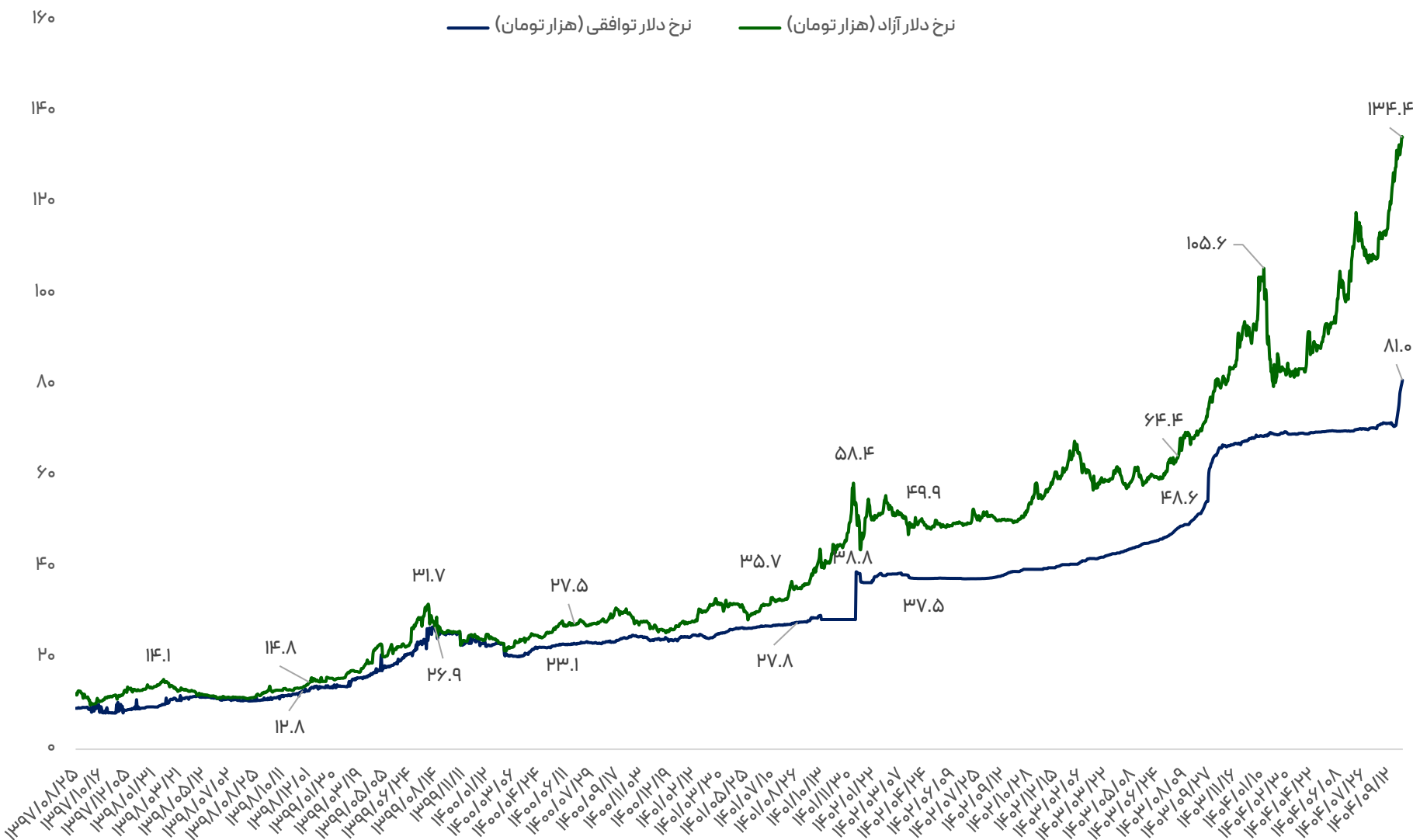


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K۵ در نظر گرفته شده است.



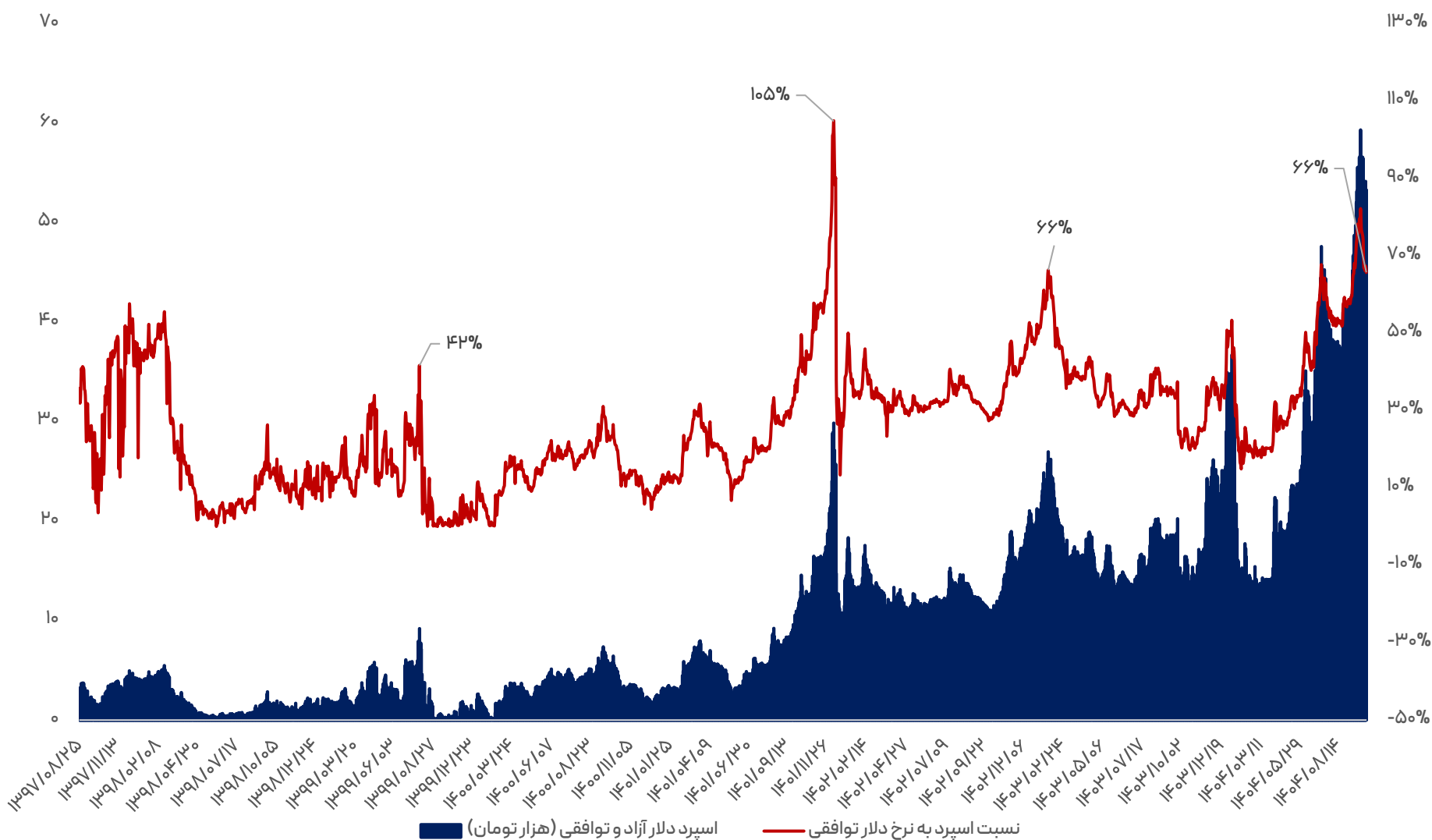
رند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۶۰,۶۲۴ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۸۱۰,۴۸۴ 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.



با سپاس از توجه شما

