

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۱۲ دی ماه ۱۴۰۴



هفته اخیر بازار سرمایه متعادل و پرنوسان بود و البته پر اتفاق! شاخص کل و شاخص هموزن واگرا شدند و با وجود رشد ۱ درصدی شاخص کل، شاخص هموزن با کاهش همراه شد و عملکرد شاخص سازان در هفته اخیر بهتر از سهام هموزن و صنایع کوچکتر بازار بود.

در هفته اخیر شاهد رکوردشکنی **ارزش معاملات خرد روزانه** بازار بودیم و اگرچه ارزش معاملات ریالی، سقف سال ۹۹ را شکست، اما به لحاظ دلاری، رکورد ارزش معاملات روز دوشنبه، همچنان حدود یک چهارم تا یک پنجم رکورد سال ۹۹ است. این روزها ارزش معاملات خرد بر فراز ۲۰ همت تثبیت شده است و کماکان روند کاهشی و آلارم منفی در این پارامتر نقدینگی بازار مشاهده نمی‌شود.

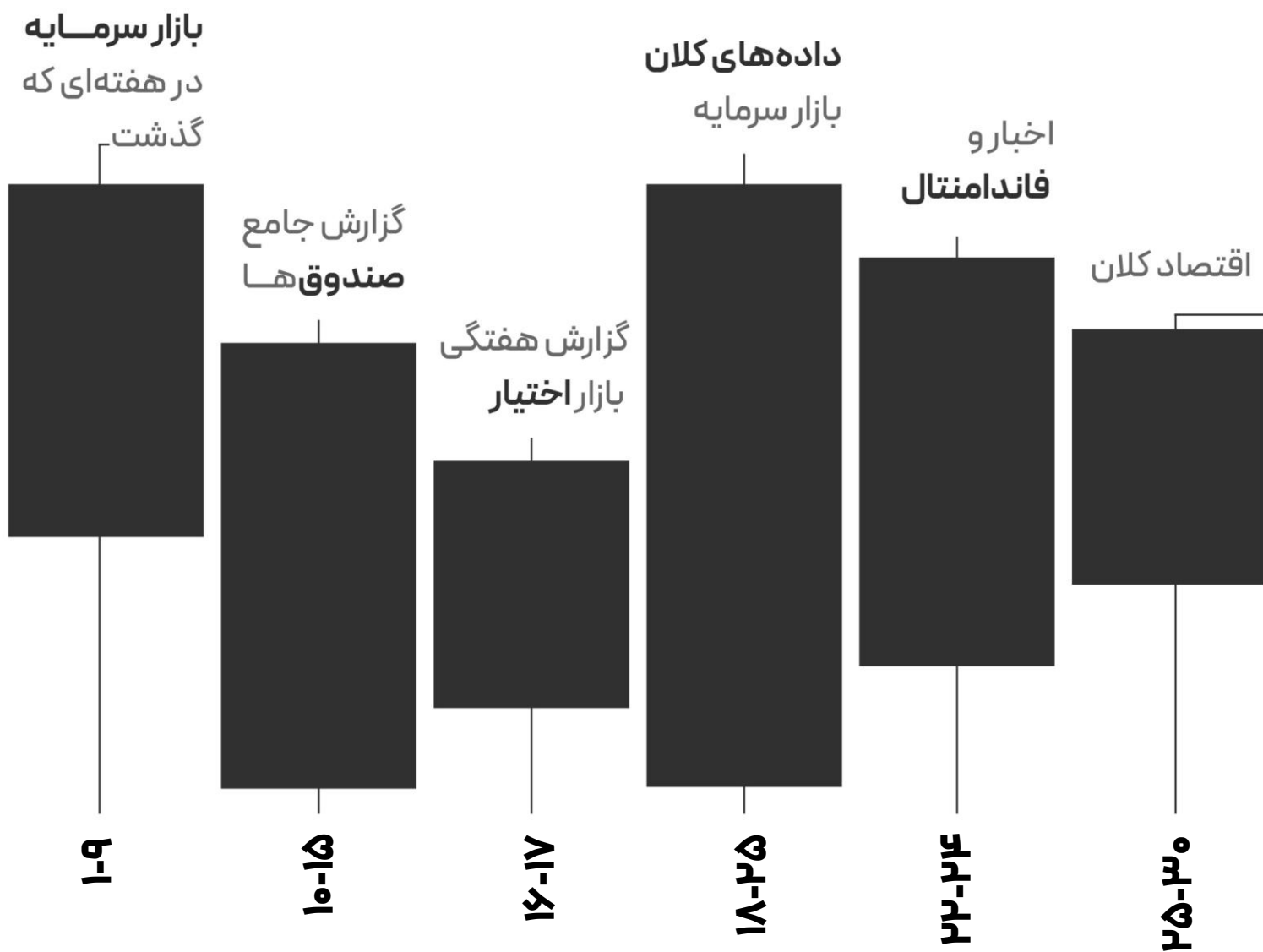
از اخبار مهم تاثیرگذار بر بازار که در هفته اخیر منتشر شد، جایگزینی همتی به جای فرزین در ریاست بانک مرکزی بود. همچنین نرخ دلار توافقی و تالار دوم افزایشی بود که این موضوع نیز فاند مثبت مهمی برای بازار به حساب می‌آید.



برایند گردش حقیقی‌ها در معاملات خرد بازار سهام هفته پیش، پرنوسان بود. دو روز ابتدایی ورود پول، سپس دو روز خروج پول سنگین و روز انتهایی هفته، دوباره ورود پول به بازار رقم خورد. در نهایت، برایند کل هفته، خروج ۲.۱ همتی منابع حقیقی از معاملات خرد بازار سهام بود.

صندوق‌های طلا هم، بار دیگر خروج پول حقیقی به ثبت رساندند و در هفته گذشته، ۷.۵ همت پول حقیقی از این صندوق‌ها خارج شد. در سوی مقابل گردش پول در صندوق‌های درآمد ثابت هم حدود ۱۱.۴ همت مثبت بود که نشان می‌دهد حقیقی‌ها کمی نسبت به ادامه روند صعودی در بازارها محتاط شده‌اند و در حال سیو سود هستند.

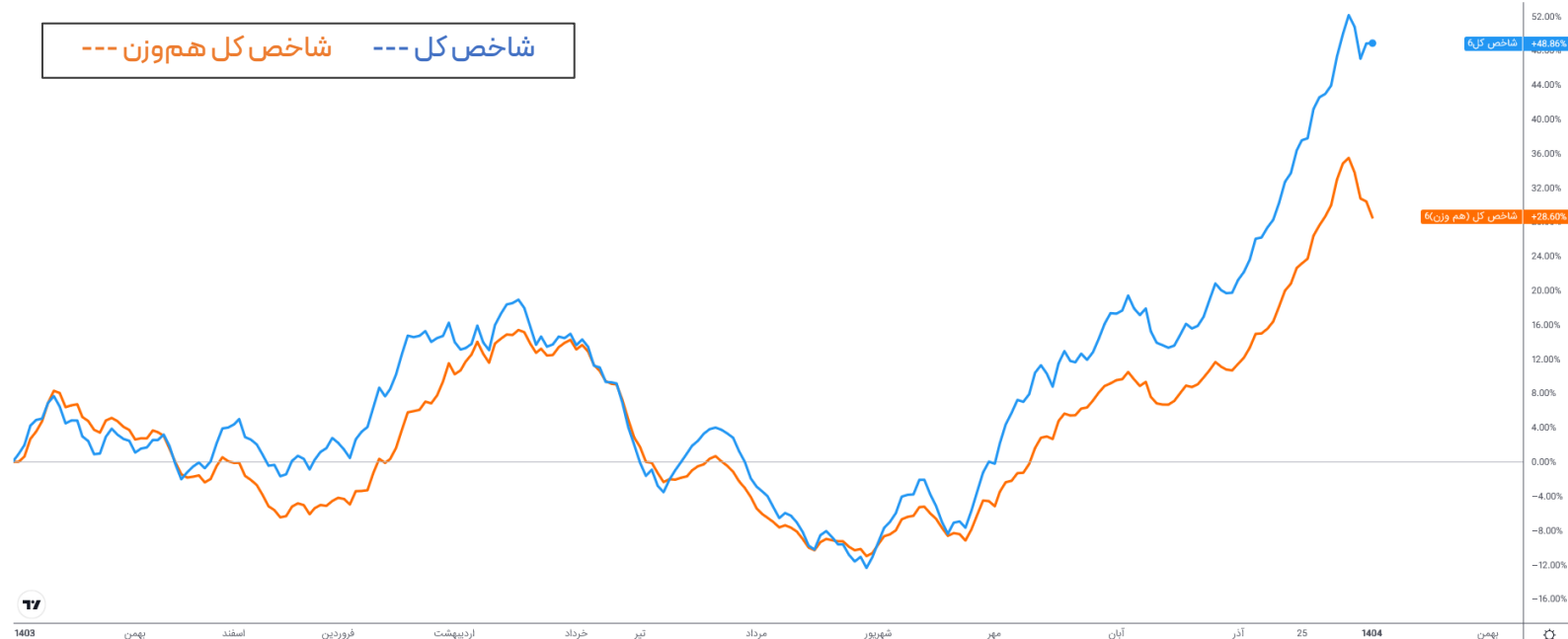
به لحاظ تکنیکالی اما، کماکان هشدار خاصی مشاهده نمی‌شود و با حد ضرر کوتاه‌مدتی آخرین کف در شاخص کل، حوالی ۴ میلیون واحد، می‌توان روند صعودی بازار را با ارتقای حد زیان سهام، همراهی کرد.



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. در لگ دوم ریزش اما، 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 صعودی 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	+ ۱.۰۳ %	+ ۲۲.۷۸ %	+ ۴۹.۱۷ %	+ ۴۸.۹۹ %	+ ۴۸.۸۶ %
بازده شاخص کل هم وزن	- ۱.۹۳ %	+ ۱۷.۰۲ %	+ ۳۷.۵۴ %	+ ۲۸.۱۶ %	+ ۲۸.۶۰ %



شاخص کل هم وزن به شاخص کل

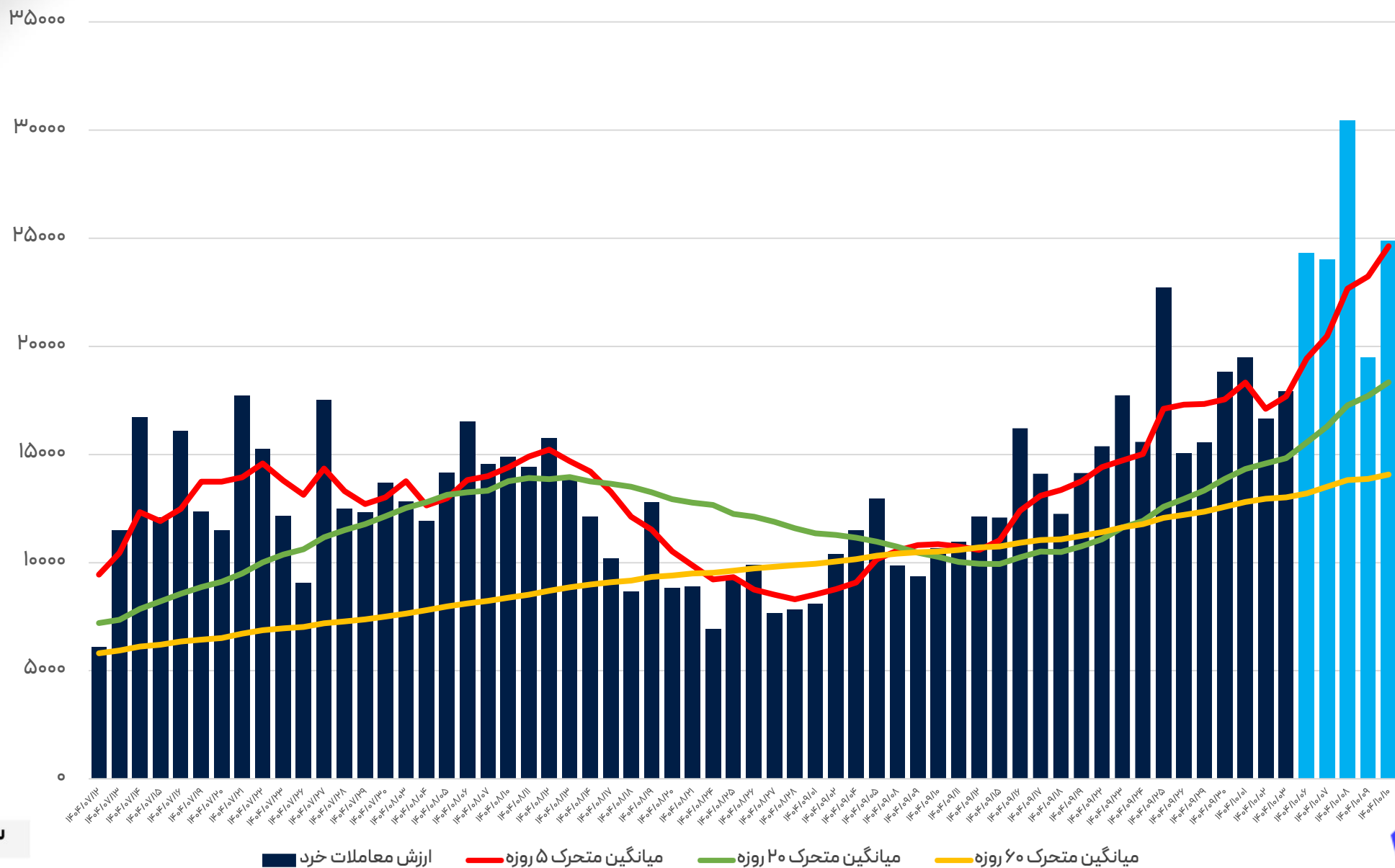
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هم وزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هم وزن نسبت به شاخص کل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



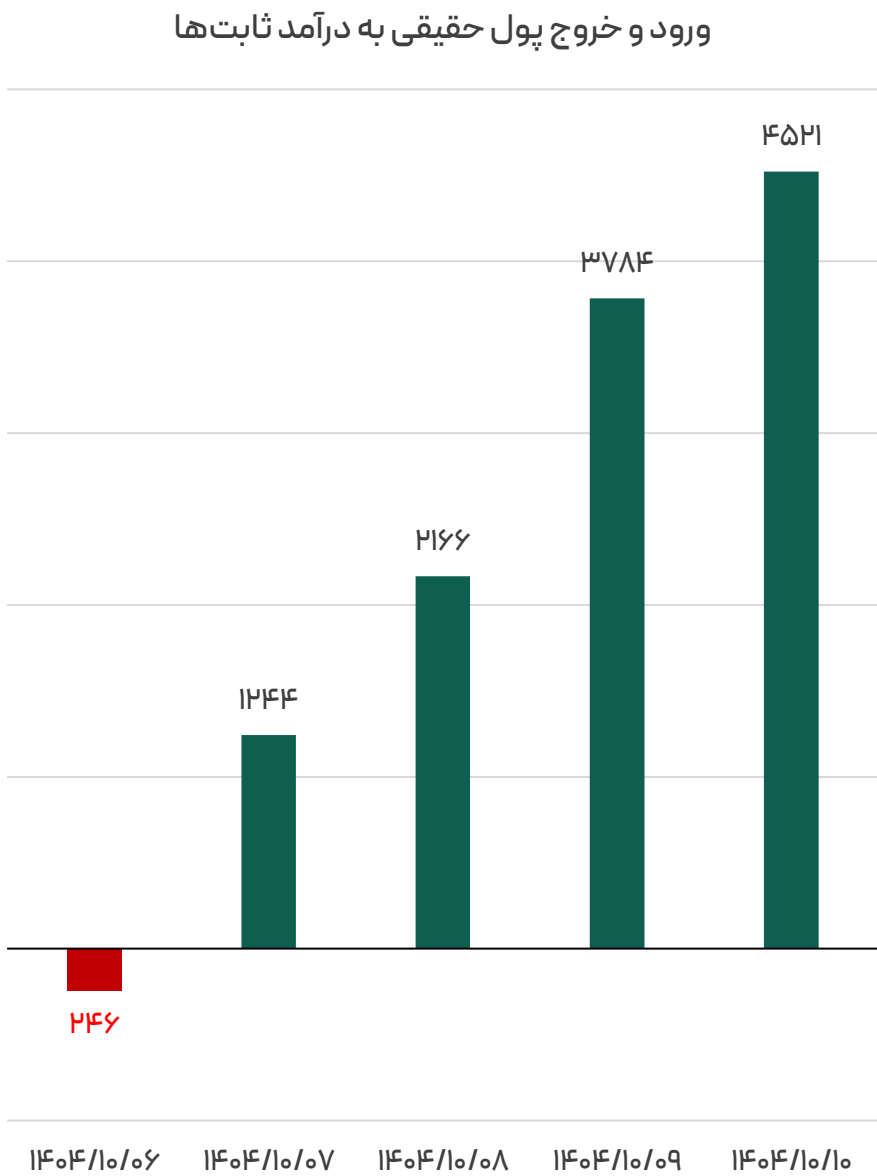
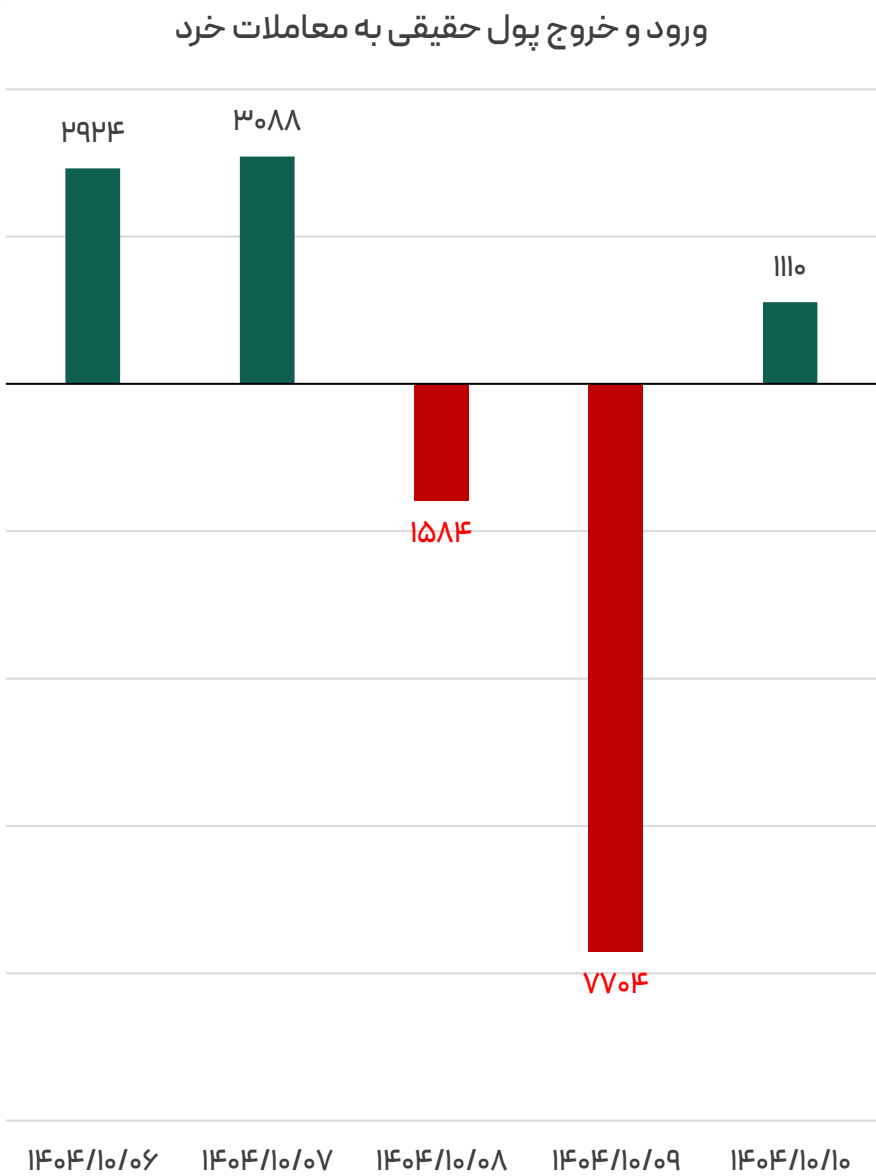
در تصویر، نمودار نسبی شاخص هم وزن به شاخص کل را مشاهده می‌کنید. مدت‌هاست که بازده و عملکرد سهام شاخص ساز و شاخص کل، نسبت به سهام و صنایع کوچکتر بازار و شاخص کل هم وزن، بهتر و قوی‌تر بوده است. علی‌رغم نوسانات مثبتی که در چند ماه اخیر در این نمودار و رشدهای مقطعی صنایع کوچکتر بازار بودیم، اما کماکان روند 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. اگرچه نمودار به دو کف اخیر نزدیک می‌شود، اما 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 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.



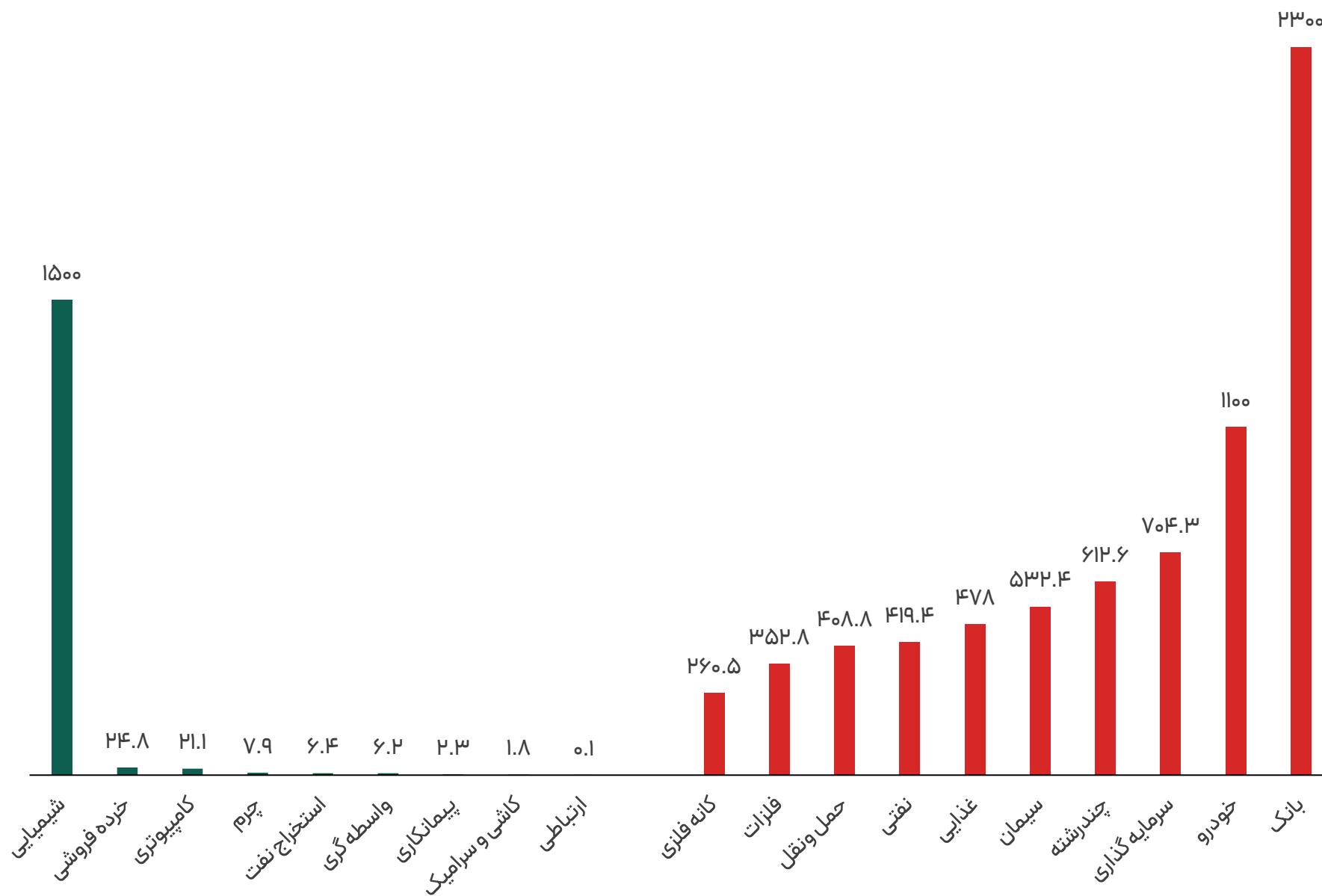
ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)



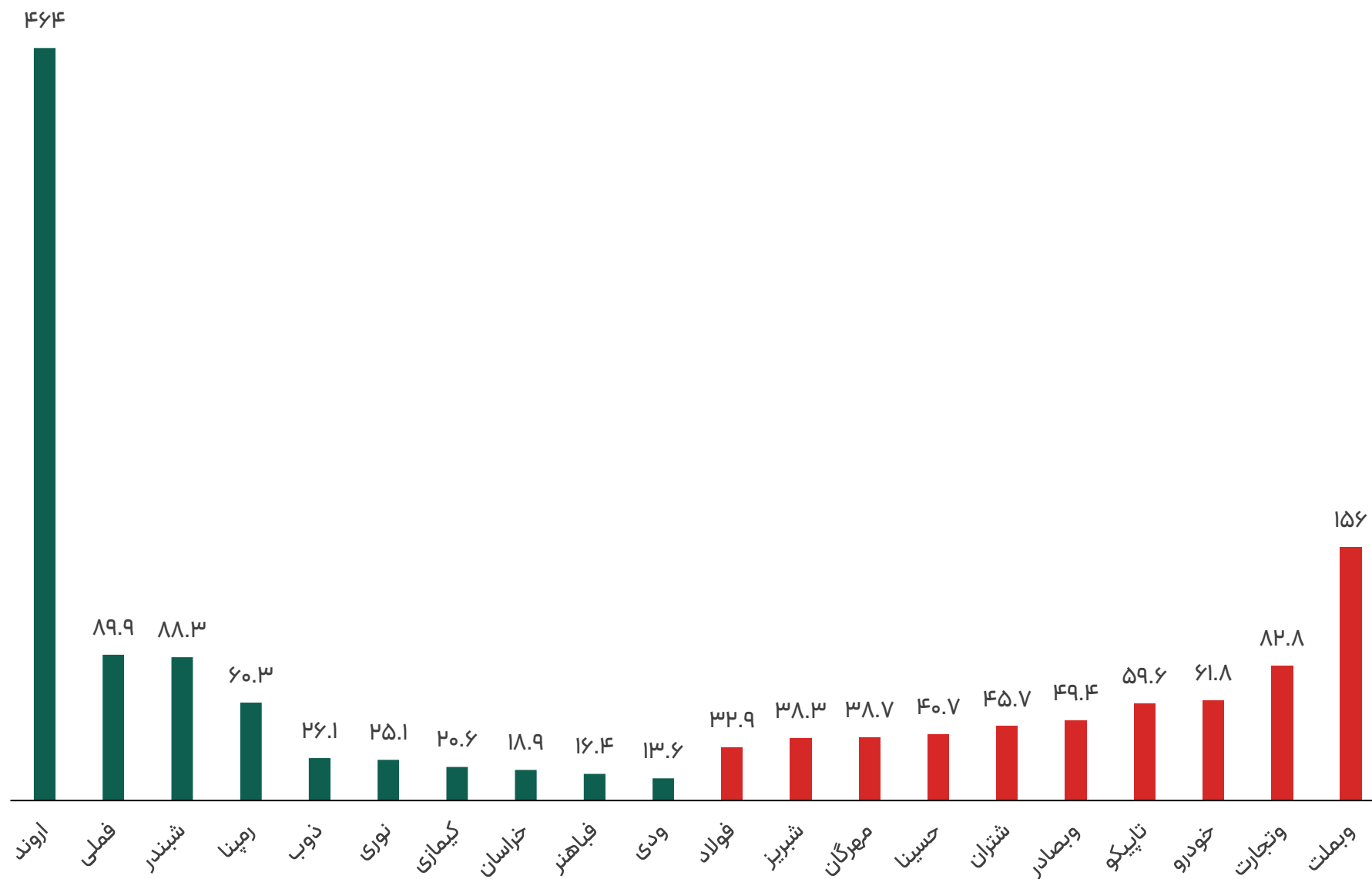
ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)



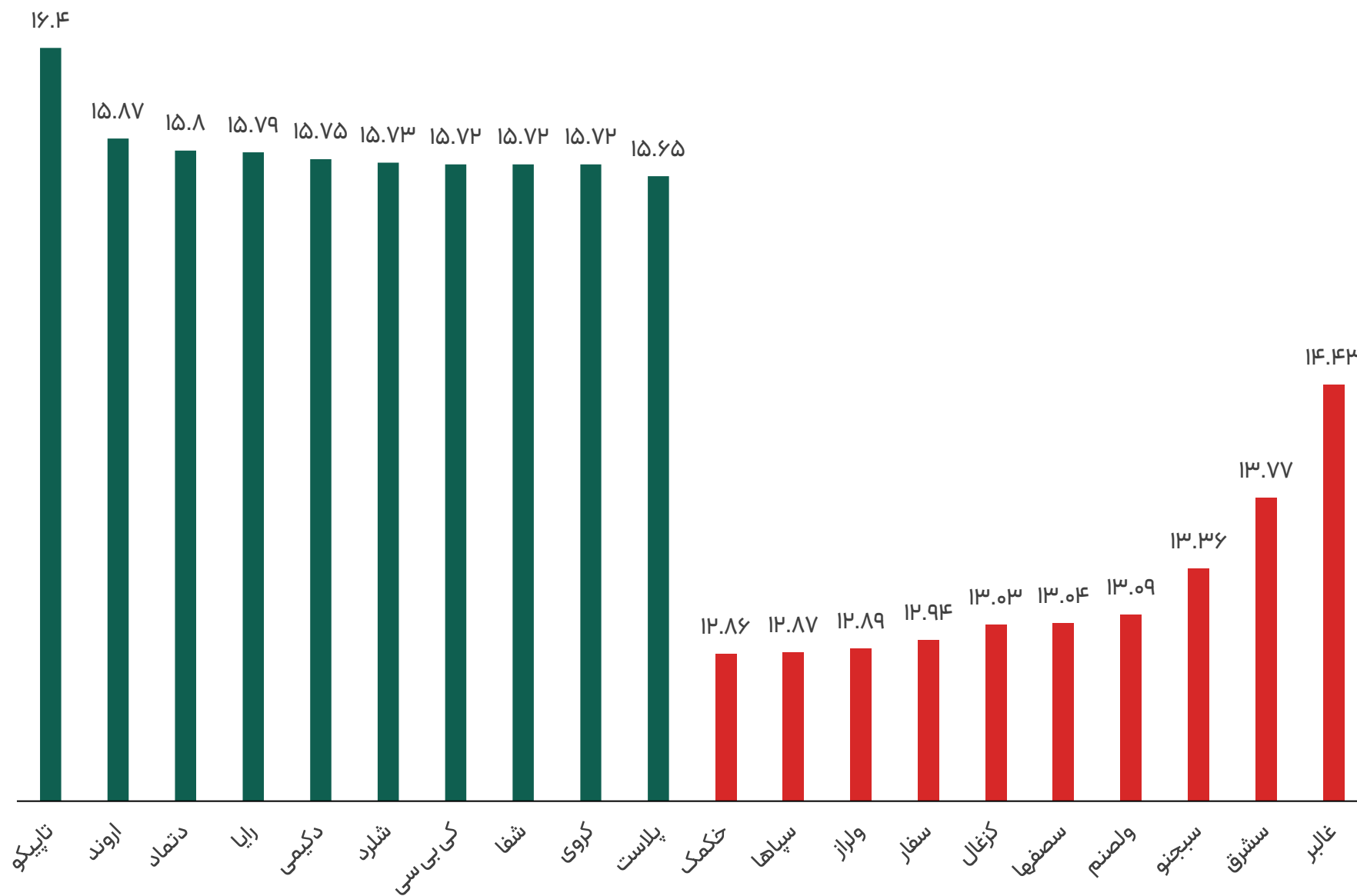
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



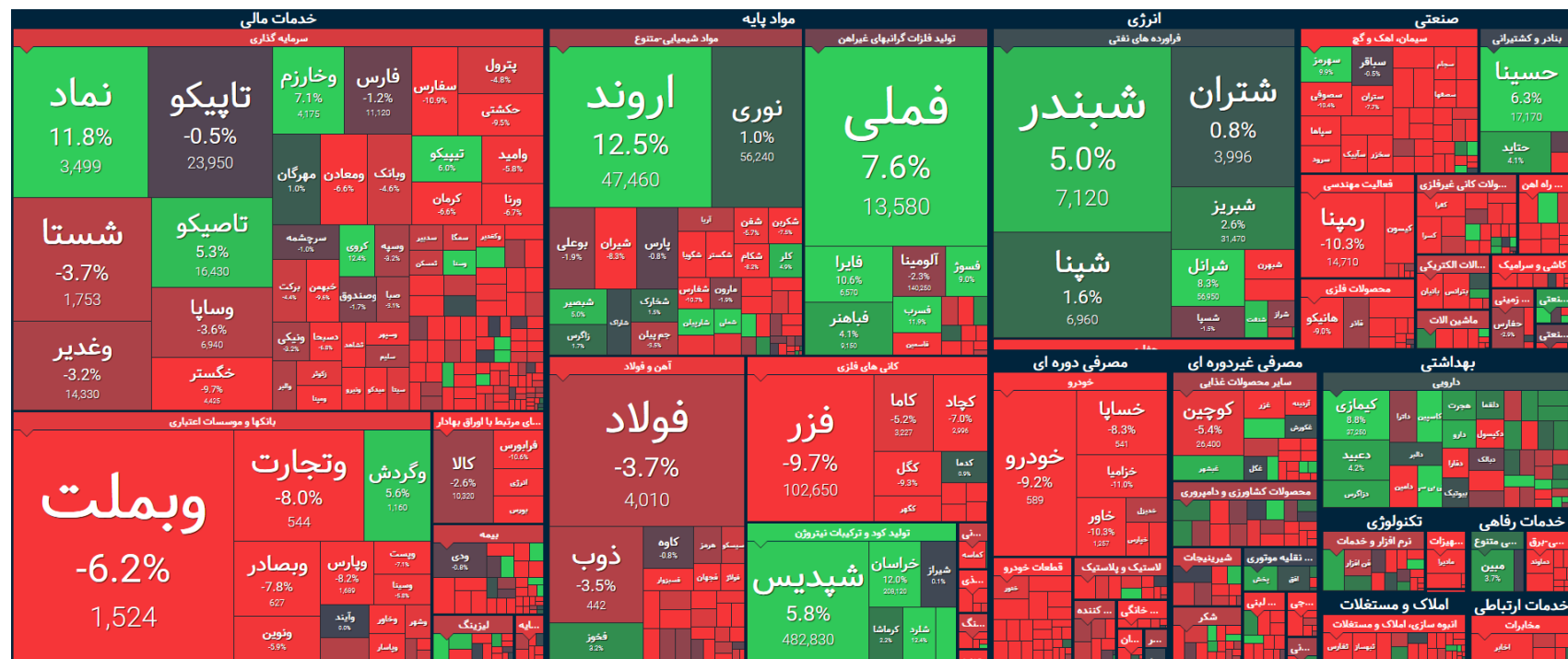
میانگین بیشترین ورود و خروج پول روزانه به نمادها در هفته اخیر (میلیارد تومان)



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)

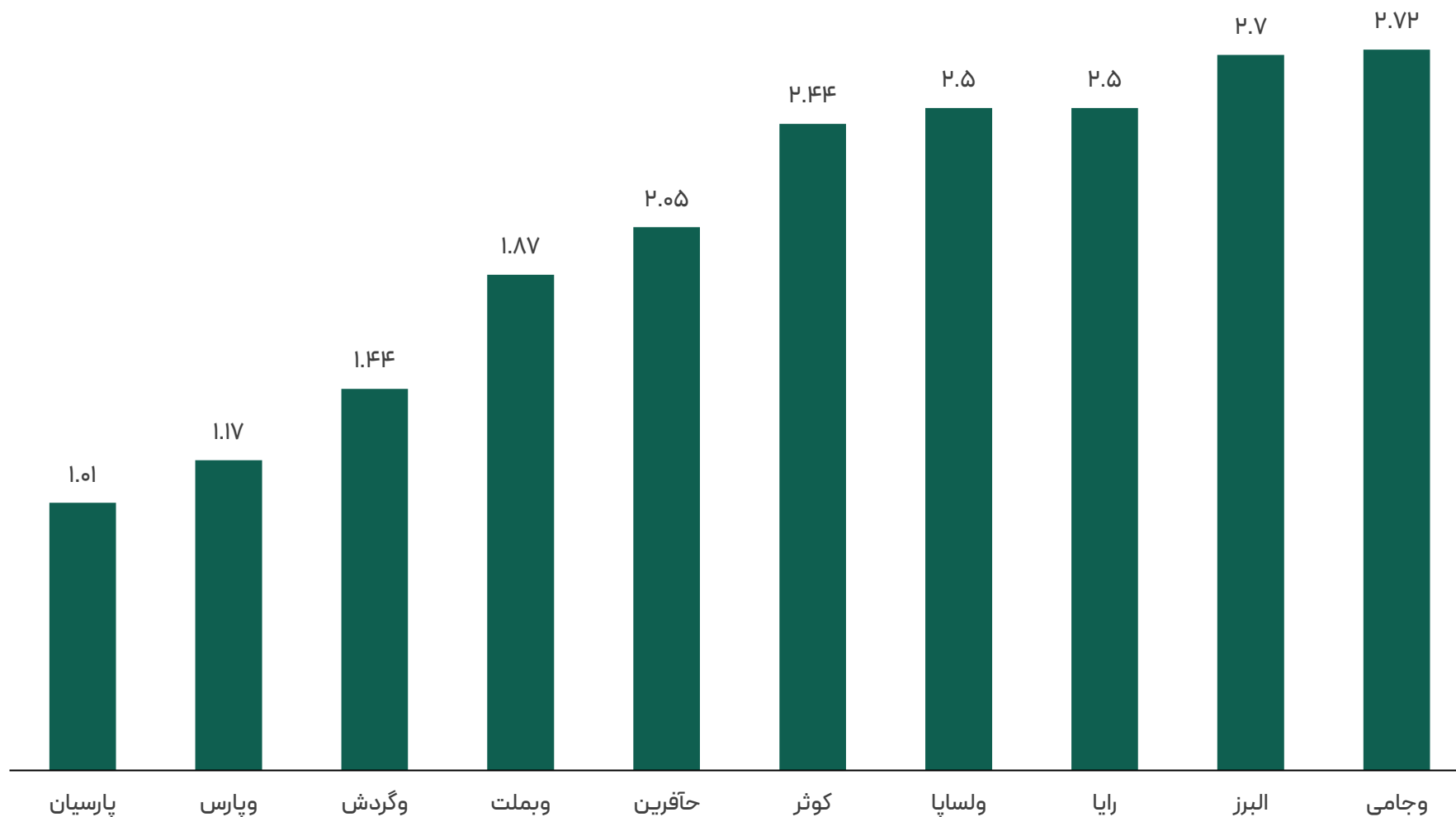


دسته بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر نماد | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نماد



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	بازدهی			درصد حباب	ضریب اهرمی کلاسیک	نسبت سهامی	ضریب اهرمی بالقوه	ضریب اهرمی بالفعل
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه					
 نارنج اهرم	۴۴	۱۰۹.۷۸	۹۷.۳۵	۰.۲۳	۱.۸۷	۰.۹۷	۱.۸۱	۱.۸۱
 توان	۳۸.۴۱	۸۴.۹۴	۴۹.۳۶	-۵.۵۳	۱.۸۶	۰.۸۹	۱.۶۶	۱.۷۵
 جهش	۳۶.۸۷	۹۷.۱۱	۵۲.۴	-۹.۰۳	۱.۹۴	۰.۸۵	۱.۶۵	۱.۸
 بیدار	۳۲.۶۴	۷۹.۶۱	۶۲.۵۹	-۱۰.۵۹	۱.۹۱	۰.۸۶	۱.۶۴	۱.۸۱
 پیشران	۲۸.۹۷	۶۹.۱۳	۵۶.۸۵	-۰.۶۲	۱.۶	۰.۹	۱.۴۴	۱.۴۵
 شتاب	۲۷.۴۲	۷۴.۱۸	۶۰.۶۹	-۱۰.۱۷	۱.۸۳	۰.۸۶	۱.۵۷	۱.۷۳
 اهرم	۲۵.۰۹	۶۹.۲۱	۳۶.۴۱	-۷.۹۸	۱.۶۶	۰.۹۳	۱.۵۴	۱.۶۶
 موج	۲۴.۷	۹۰.۰۶	۷۰.۵۴	-۷.۸۴	۱.۷۲	۰.۹۷	۱.۶۷	۱.۸
 دوایکس	۲۴.۲۴	۱۰۶.۲۱	۲۶.۸۶	-۷.۲۶	۰.۹۲	۰.۹۸	۰.۹	۰.۹۷



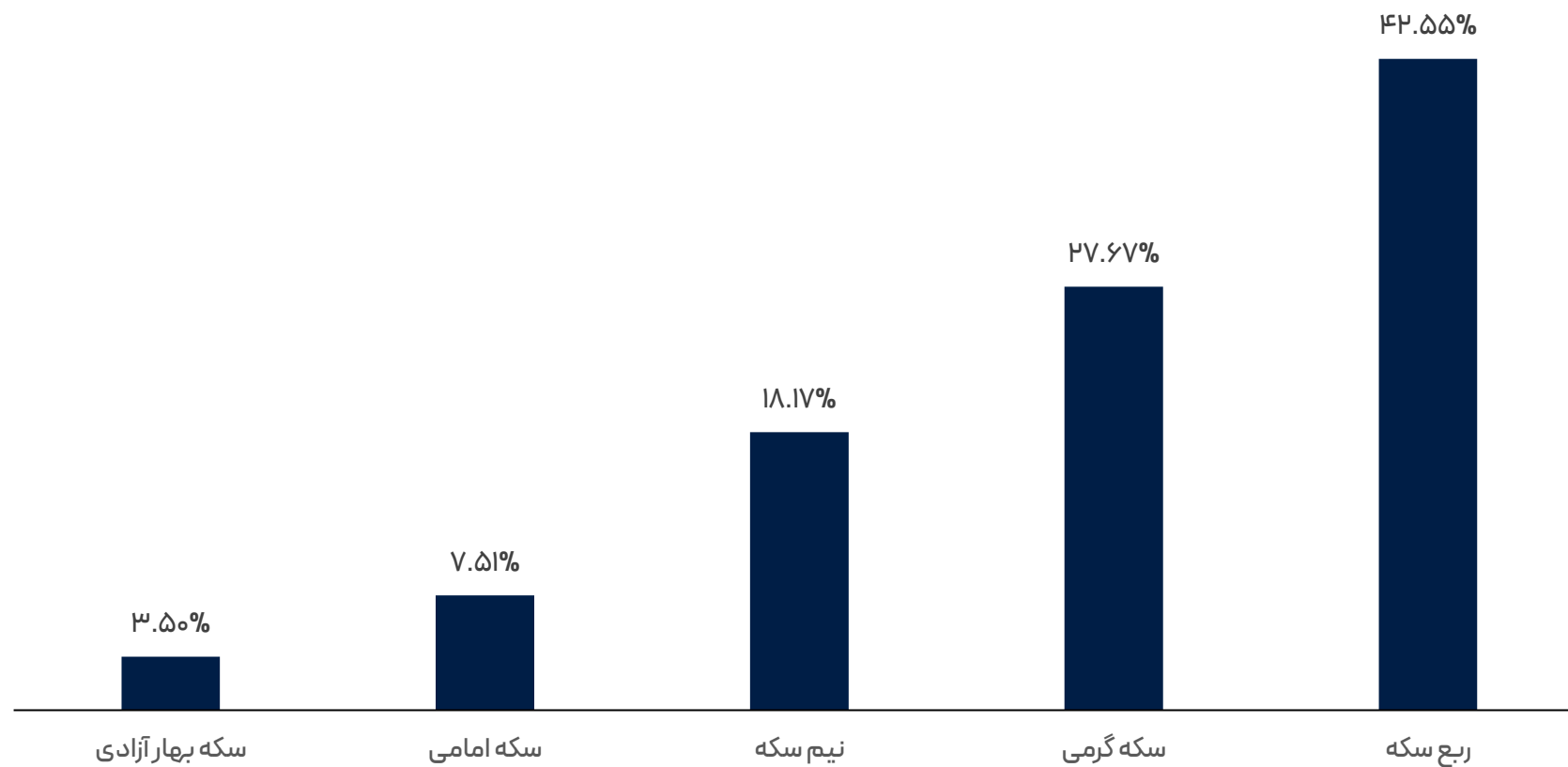
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۱.۱۹%) ۱,۳۶۸,۵۰۰ ریال انس طلا (۰.۱۲%) ۴,۳۳۲ دلار انس نقره (۰%) ۷۲ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حباب
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۱ آینده	۱,۵۱۴,۰۰۰	۱.۷۴	۸.۵
تمام سکه طرح جدید ۱۳۱۲ رفاه	۱,۳۹۳,۹۲۰	-۱.۱۴	-۰.۱۱
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۲ سامان	۱,۵۱۸,۹۵۰	۲.۱۵	۸.۸۵
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۴,۰۵۶,۰۱۰	۱.۵۷	۲۶.۶۹
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۵۰۵,۰۰۰,۰۰۰	۱.۸۶	۷.۸۵
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۱۹,۲۴۷,۹۵۰	۲.۱۴	۱.۴۸



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
رونق 	۲۳.۴۸	۴۶.۲۴	۳۴.۱	۱.۲۱	۰.۶۲	-۲.۲	-۵.۳۳
پیروز 	۲۱.۶۶	۵۰.۱۸	۳۰.۰۱	۴.۷۲	۲.۳۳	-۳.۰۶	۰.۴۴
فیروزه 	۲۱.۴۳	۵۴.۱۱	-۴۵.۵۸	۲۴.۰۳	۱۶.۲۲	۰.۰۱	۰.۲۴
آمیتیس 	۲۰.۸۱	۴۳.۶۷	۷۲.۶۵	۴.۳۲	۱.۷۹	۰.۶۲	۰.۵۳
افق ملت 	۲۰.۴۸	۳۷.۱۴	۲۳.۱۲	۰.۲۳	۰.۱۳	۰.۳۶	-۱.۳۳
رشدی کیان 	۱۹.۸۵	۴۳.۳۶	۵۰.۶۷	۶.۷۹	۳.۶	۰.۰۱	۰.۷۱
خلیج 	۱۹.۶۶	۴۳.۰۱	۵۷.۹۴	۰.۰۶	۱.۱۵	-۱.۴۷	۰.۳۷
اکسیژن 	۱۹.۱۳	۳۹.۱۷	۳۳.۷۷	۰.۶	۰.۶۶	-۰.۱۹	-۰.۲۱
پرتو 	۱۸.۳۳	۳۶.۲۳	۵۱.۰۸	۰.۵۹	۰.۳۴	۱.۶۵	-۰.۳

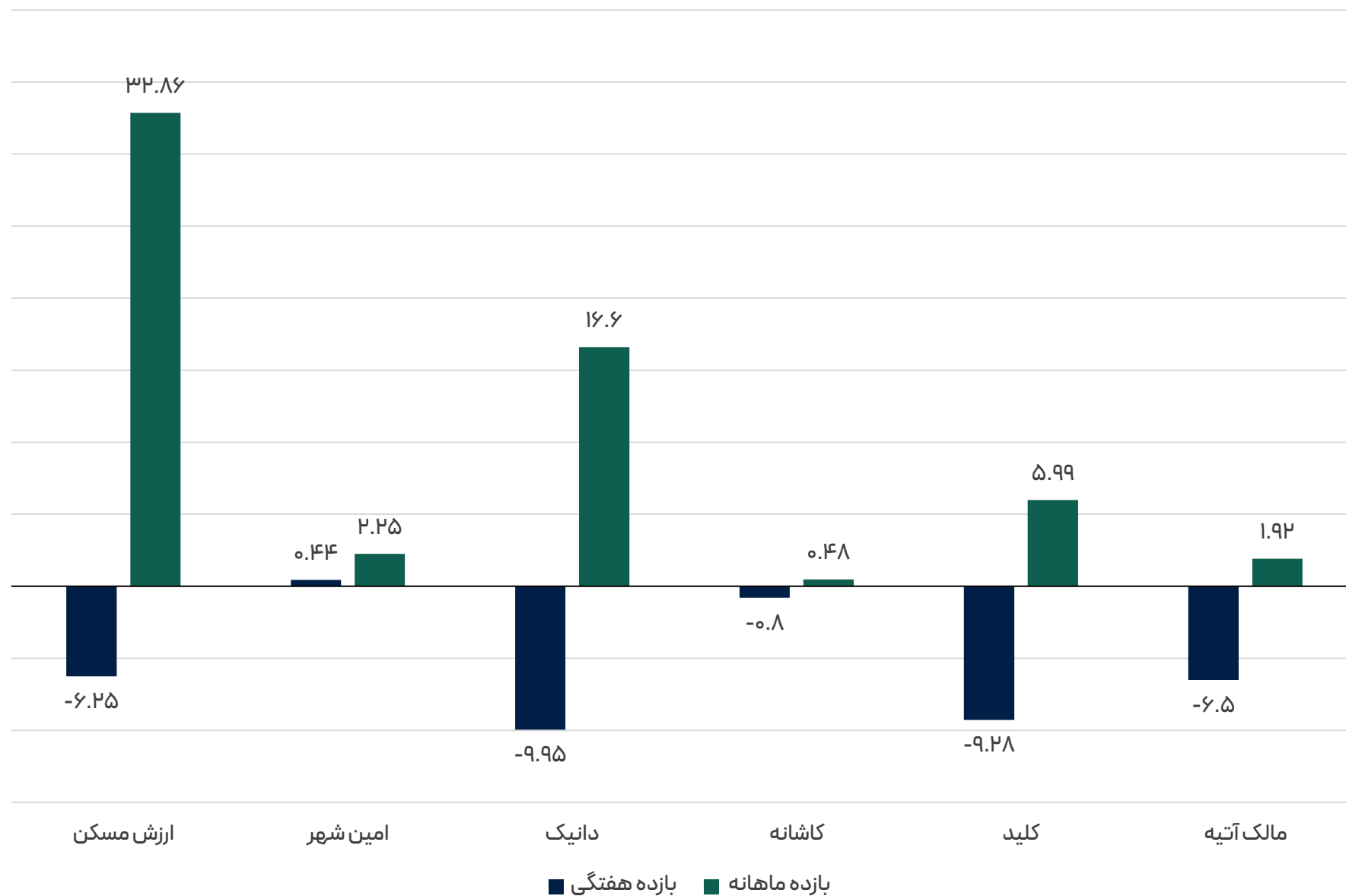


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	یک ماهه
دایم متال	۲۷.۰۵	۶۹.۹۹	۴۶.۲۴	۷.۱۴	۸.۸	۱.۰۲
فارما کیان	۲۵.۰۳	۶۳.۳۸	۵۳.۴۹	۳۳.۸۷	۲۳.۵۸	۰.۵۵
پترودارپوش	۲۴.۴۶	۴۵	۲۴.۹	۵.۵۸	۷.۵۲	۱.۱۷
دارونو	۲۴.۰۳	۶۰.۶۱	۵۸.۳۵	۳۱.۰۵	۲۲.۱۱	۰.۹۴
فلزا	۲۳.۴۸	۶۵.۹۶	۷۹.۳	۹.۱	۹.۸۹	۱.۵۱
پالایش	۲۳.۲۲	۶۲.۱۱	۷۵.۲۹	۳۹۶.۶۱	۴۰۵.۱۸	-۱۸.۳۸
فارمانی	۲۲.۱۱	۵۴.۷۲	۵۱.۰۸	۱۱.۰۸	۵.۳۸	-۱.۵۳
آذری	۱۹.۷۸	۵۴.۶۴	۴۳.۴۹	۳.۱۸	۶.۸۵	-۰.۴۸
پتروآبان	۱۹.۷۳	۴۵.۵۲	۲۵.۰۶	۳.۳۷	۵.۶۳	-۰.۱۱



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



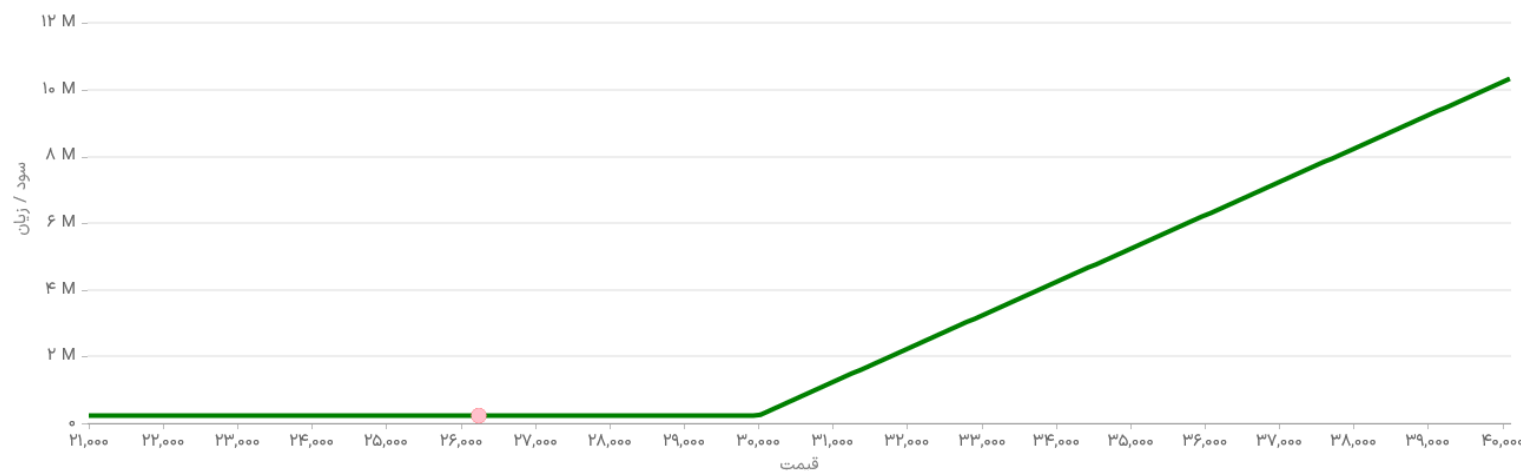
گزارش هفتگی بازار آپشن

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)

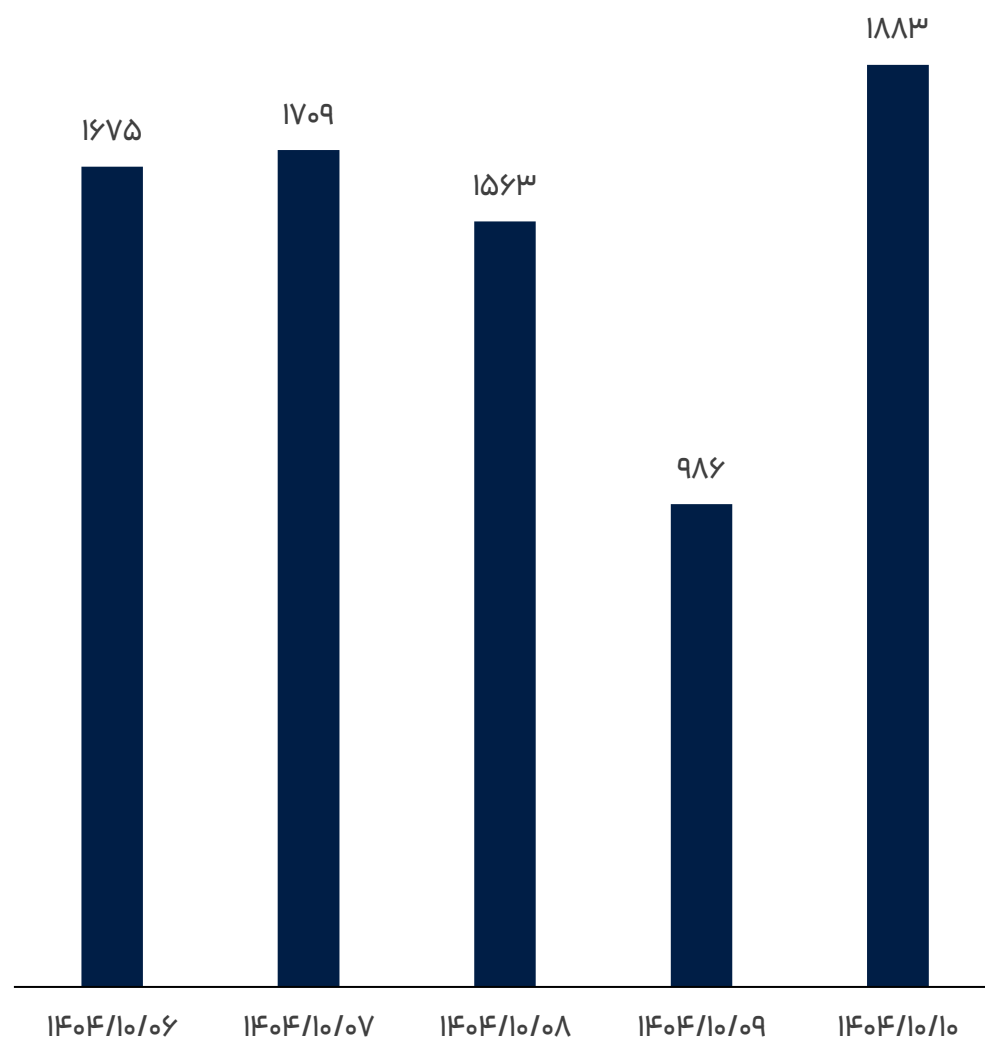
این استراتژی با خرید همزمان دارایی پایه (صندوق اهرم) و خرید اختیار فروش آن انجام می‌شود. اشاره شد که با توجه به اینکه دیدگاه و ریسک‌پذیری معامله‌گر به چه صورت باشد، قراردادهای طهرم ۱۰۲۷، طهرم ۱۰۲۶ و طهرم ۱۰۲۵ می‌توانند مناسب باشند. طهرم ۱۰۲۷ استراتژی بدون ریسک می‌ساخت، و سودآوری استراتژی از قیمت ۳,۰۲۱ 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 است و در عوض، از قیمت ۲,۷۷۰ تومان در صندوق اهرم، سودآوری استراتژی آغاز می‌شود. (آخرین قیمت فعلی صندوق اهرم: ۳,۶۶۰ 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

ماه‌یانه	هفتگی	روزانه
۱۱۲۶ ضهرم ۳۳,۵۱۰.۲ B	۱۱۲۶ ضهرم ۲۱,۱۱۱.۵ B	۱۱۲۶ ضهرم ۳,۹۴۸.۸ B
۱۰۲۶ ضهرم ۱۵,۹۷۱.۶ B	۱۱۲۵ ضهرم ۴,۳۶۹ B	۱۱۲۸ ضهرم ۹۱۲.۳ B
۱۰۲۸ ضهرم ۱۴,۱۹۱.۷ B	۱۱۲۸ ضهرم ۳,۶۴۷.۶ B	۱۰۲۸ ضهرم ۹۰۷.۴ B
۱۱۲۵ ضهرم ۱۱,۷۰۵.۲ B	۱۱۲۷ ضهرم ۳,۲۸۰.۹ B	۱۱۲۷ ضهرم ۵۷۷.۹ B
۱۰۲۷ ضهرم ۸,۰۶۷.۵ B	۱۱۵۴ ضخود ۱,۵۳۴.۸ B	۱۱۲۵ ضهرم ۵۲۸.۴ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماه‌یانه	هفتگی	روزانه
۱۱۲۶ طهرم ۶,۲۹۹ B	۱۱۲۶ طهرم ۵,۰۶۶.۳ B	۱۱۲۶ طهرم ۹۶۱.۸ B
۱۰۲۶ طهرم ۳,۶۴۹ B	۱۱۲۵ طهرم ۹۰۸.۱ B	۱۰۲۸ طهرم ۲۱۷.۹ B
۱۰۲۸ طهرم ۳,۰۲۴.۹ B	۱۱۲۷ طهرم ۹۰۵.۴ B	۱۰۲۹ طهرم ۱۸۸ B
۱۱۲۵ طهرم ۲,۶۱۸.۱ B	۱۰۱۲ طملت ۴۵۴.۶ B	۱۱۲۷ طهرم ۱۵۱.۴ B
۱۰۲۷ طهرم ۲,۰۴۹.۸ B	۱۱۲۸ طهرم ۴۵۴.۱ B	۱۱۲۵ طهرم ۱۲۵.۲ 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.

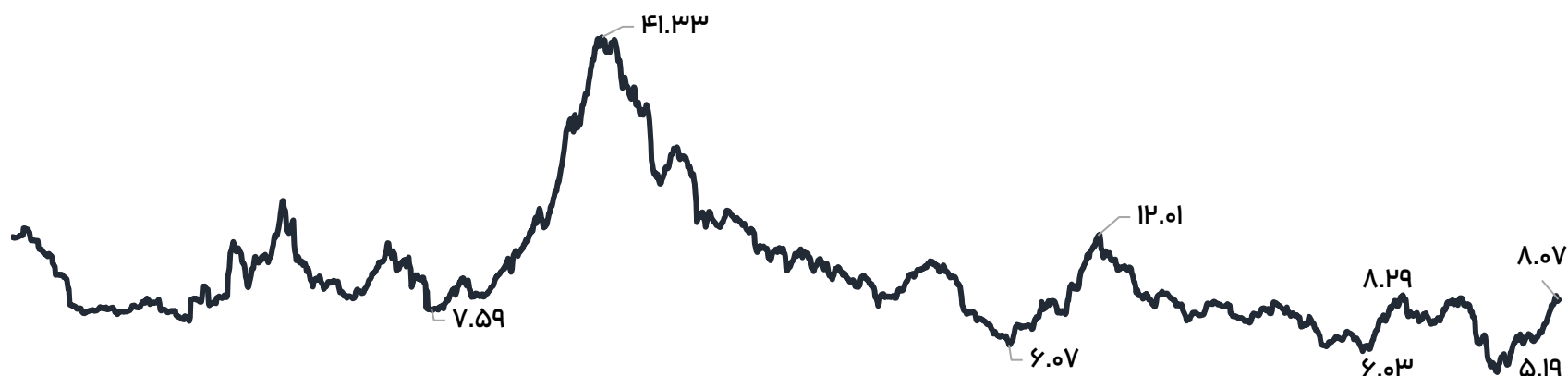
در نهایت اما، شاهد واکنش مثبت بازار به محدوده ۳ میلیون واحد بودیم که در نهایت منجر به سقف شکنی مجدد شاخص کل و تداوم روند صعودی در شاخص کل و کلیت بازار شد. در ادامه، تثبیت کندل ها بر فراز سقف تاریخی نیز انجام شده و طی هفته های اخیر هم، رشد بازار ادامه یافته و به تراز ۱۰۰ فیبوناچی از نسبت موج صعودی سال گذشته رسیده که با تثبیت بر فراز این تراز، می توان تارگت بعدی شاخص کل را در دسترس ارزیابی کرد و 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

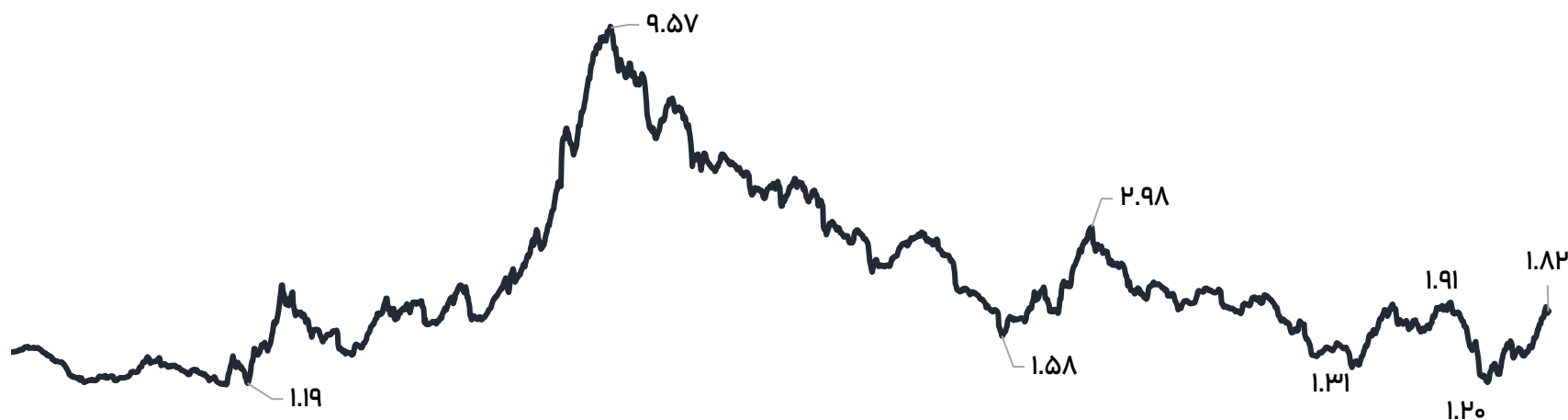
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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

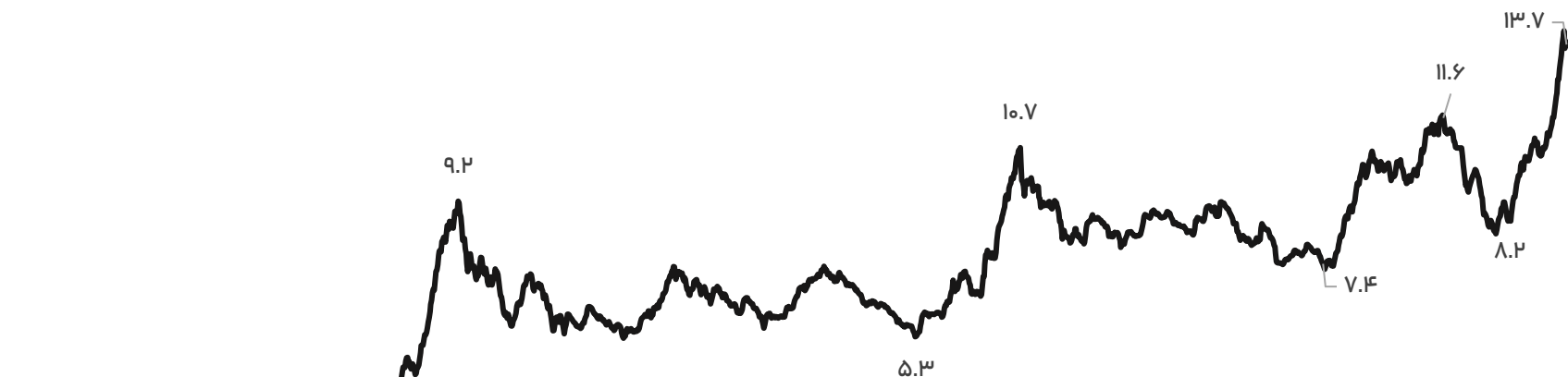


ارزش دلاری و ریالی بازار سرمایه

با وجود رشد ریالی بازار و سقف‌شکنی شاخص کل و شاخص هم‌وزن طی یک سال اخیر، اما از لحاظ ارزش دلار، 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.

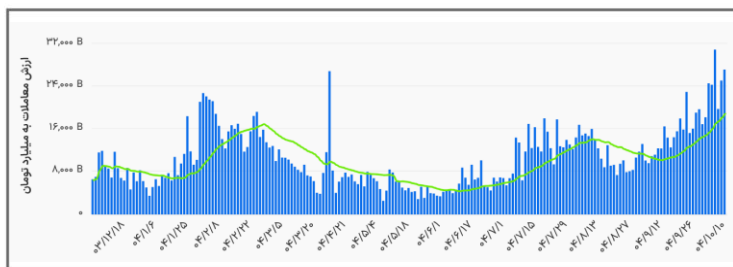
در دو نمودار زیر، روند هشت ساله‌ی ارزش ریالی و دلاری بازار را مشاهده می‌کنید.

ارزش ریالی بازار بورس (هزار همت)



ارزش دلاری بازار بورس (میلیارد دلار)





رکورد ارزش معاملات ریالی بازار شکسته شد.

ارزش معاملات خرد بازار سهام در روز دوشنبه ۸ دی ماه ۱۴۰۴ در رقم ۳۰.۶ همت به ثبت رسید و رکورد ریالی ارزش معاملات روزانه بازار سهام، شکسته شد.



سود سهام عدالت همزمان با عید مبعث واریز می‌شود.

ولی‌اله جعفری، مدیر نظارت بر ناشران سازمان بورس و اوراق بهادار در گفت‌گو با دانشجو: بخش اول سود سهام عدالت مربوط به عملکرد سال مالی ۱۴۰۳ شرکت‌های سرمایه‌پذیر به همراه باقی‌مانده سود سهام عدالت مربوط به عملکرد سال مالی ۱۴۰۲ و عواید حاصل از آن‌ها همزمان با عید مبعث به حساب دارندگان سهام عدالت واریز خواهد شد.

همتی جانشین فرزین شد.

معاون ارتباطات و اطلاع‌رسانی دفتر رییس جمهوری: با نظر و تصمیم رییس جمهور عبدالناصر همتی جایگزین محمدرضا فرزین شد.



کرماشا

گزارش توجیهی هیات مدیره کرماشا به منظور پیشنهاد افزایش سرمایه ۹۷ درصدی از محل سود انباشته به تصویب هیات مدیره رسید و جهت اظهار نظر به حسابرس و بازرس قانونی ارسال شد.

فملی

جهش ۶۰ درصدی درآمد «فملی» در ۹ ماهه ۱۴۰۴؛ فروش آذر رکورد ۲۸ همتی ثبت کرد.

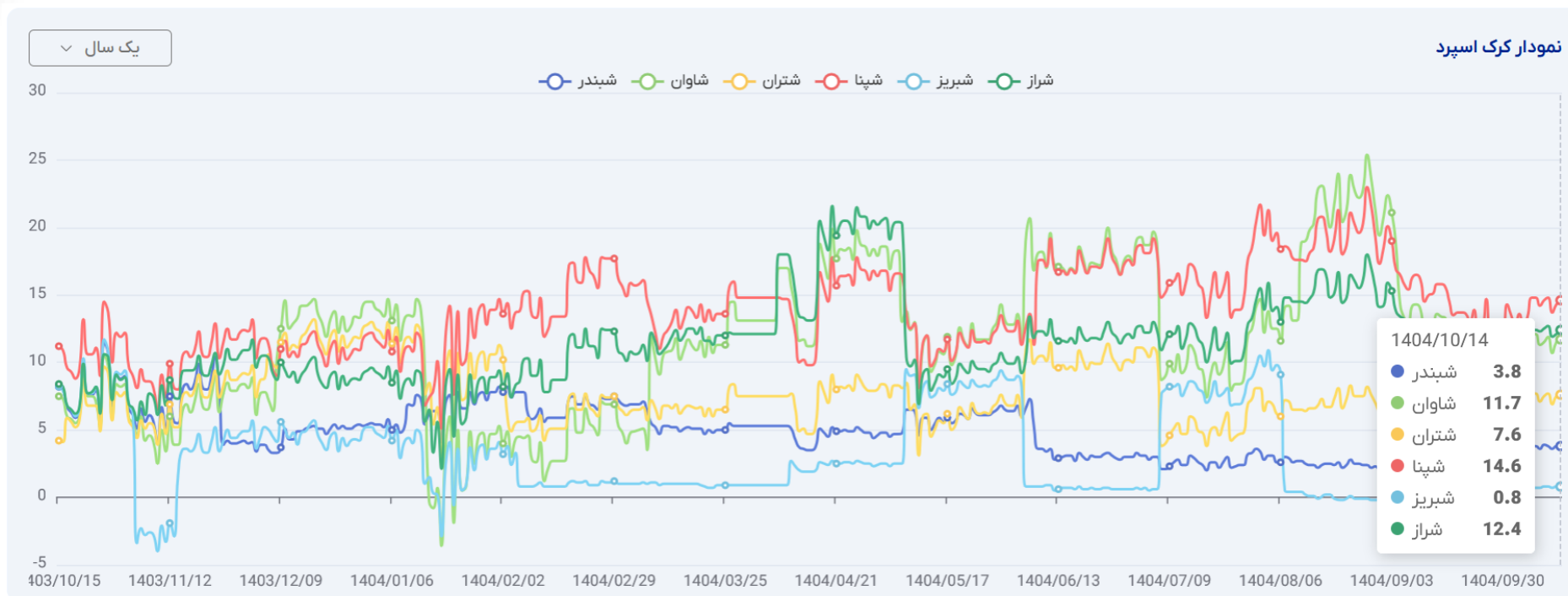
فولاد

پیشنهاد هیات مدیره فولاد مبارکه اصفهان به مجمع عمومی فوق العاده در خصوص افزایش سرمایه ۳۰ درصدی شرکت از محل سود انباشته.



کرک اسپرد پالایشی‌ها

نمودار کرک اسپرد



میانگین کرک اسپرد:

شبندر

\$ ۴.۹

شاون

\$ ۱۱.۶

شتران

\$ ۷.۶

شپنا

\$ ۱۴

شبریز

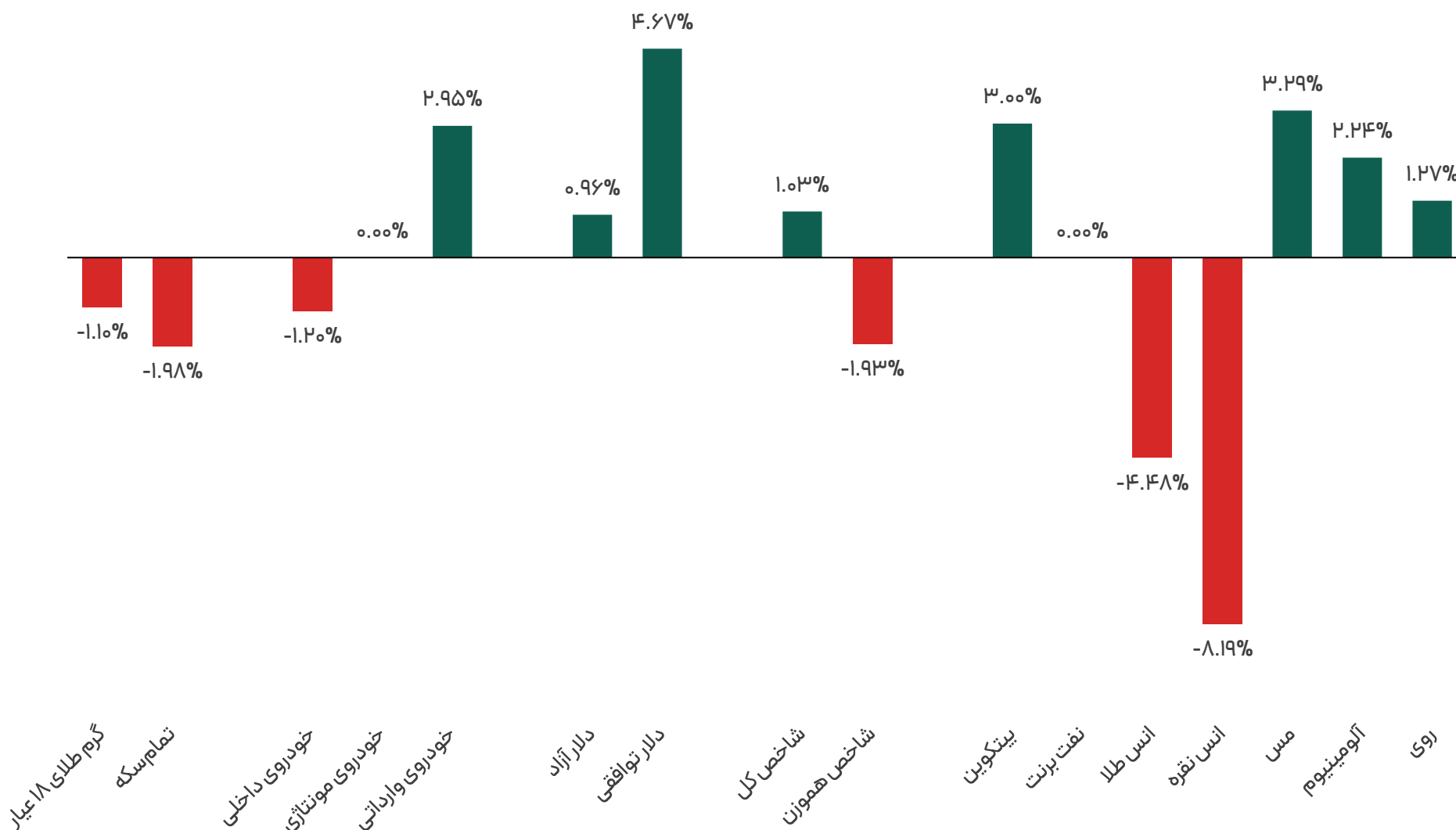
\$ ۳

شراز

\$ ۱۱.۳



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

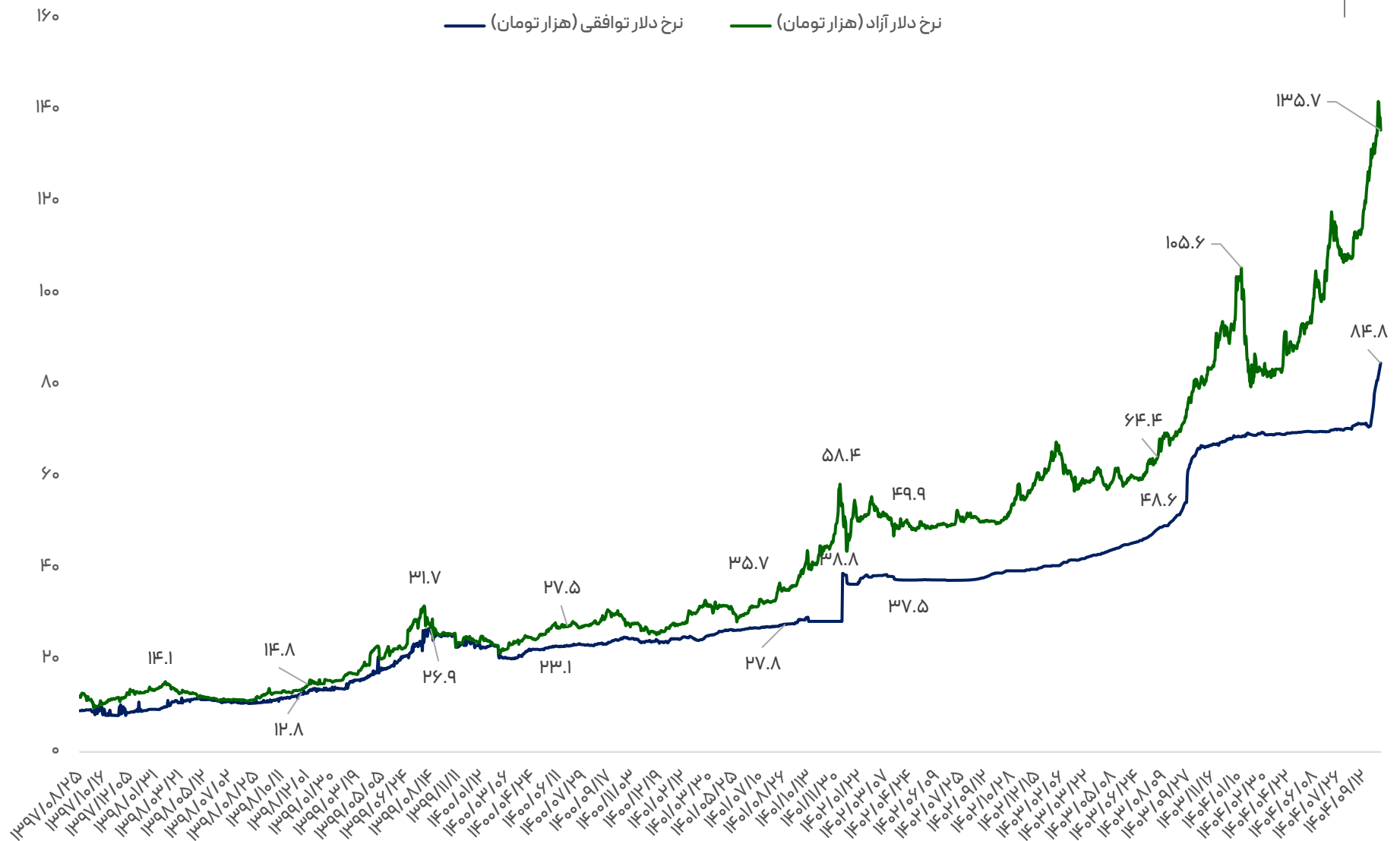


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K5 در نظر گرفته شده است.



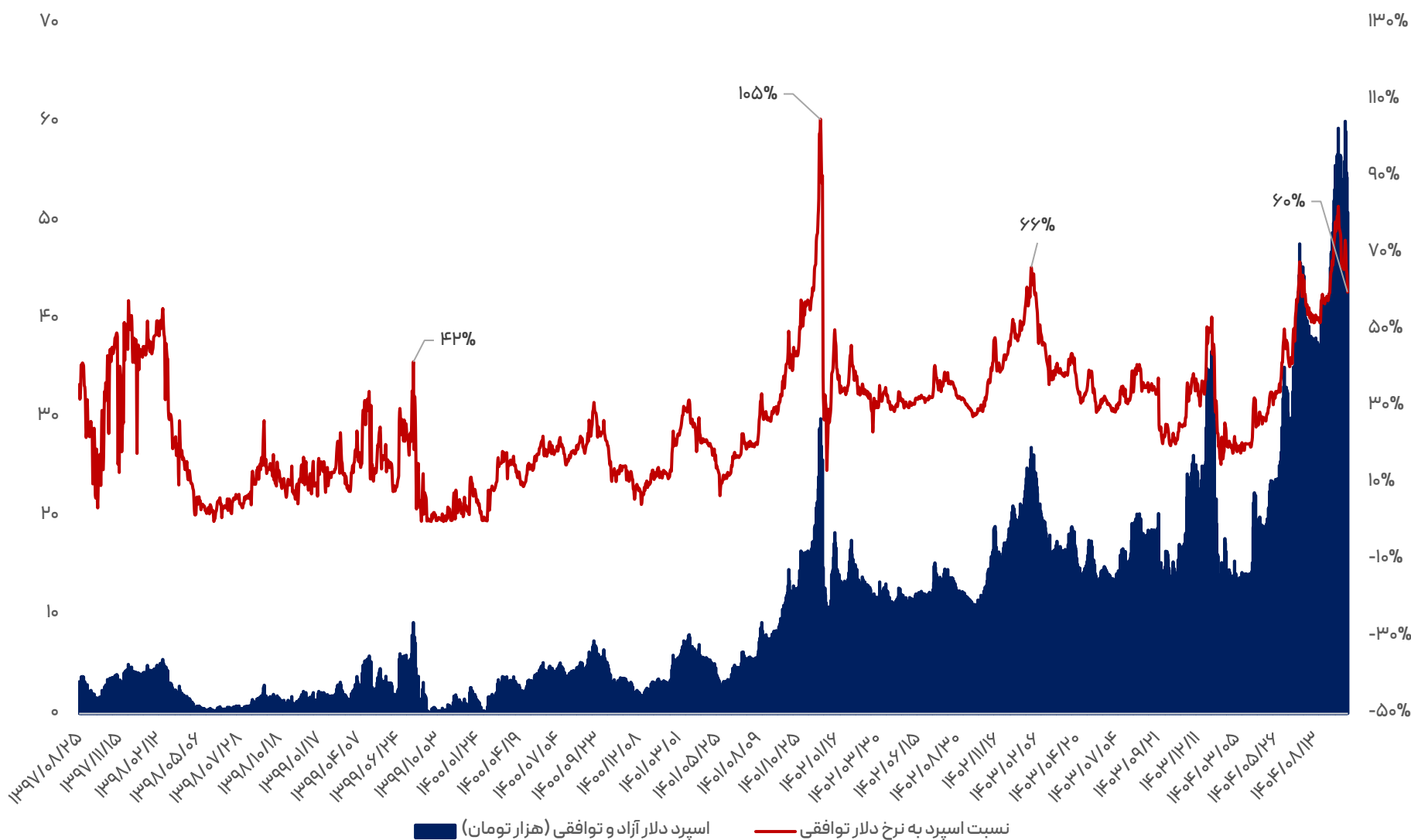
رند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۳۷,۸۴۶ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۸۴۸,۳۳۰ 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.



شاخص قیمت مصرف کننده – آذر ماه ۱۴۰۴

شاخص قیمت

در آذر ماه ۱۴۰۴ شاخص قیمت مصرف کننده خانوارهای کشور به عدد ۴۳۵.۱ رسیده است که نسبت به ماه قبل، ۴.۲ درصد افزایش، نسبت به ماه مشابه سال قبل، ۵۲.۶ درصد افزایش و در دوازده ماهه منتهی به ماه جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۴۲.۲ 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 آذر ماه ۱۴۰۴ تورم نقطه به نقطه خانوارهای کشور، ۵۲.۶ درصد بوده است؛ یعنی خانوارهای کشور به طور میانگین، ۵۲.۶ درصد بیشتر از آذر ماه ۱۴۰۳ برای خرید یک «مجموعه کالاها و خدمات یکسان» هزینه کرده‌اند. تورم نقطه به نقطه آذر ماه ۱۴۰۴ در مقایسه با ماه قبل، ۳.۲ واحد درصد افزایش داشته است.



تورم ماهانه خانوارهای کشور

منظور از تورم ماهانه، درصد تغییر عدد شاخص قیمت، نسبت به ماه قبل است. در آذر ماه ۱۴۰۴ تورم ماهانه خانوارهای کشور برابر ۴.۲ درصد بوده است. تورم ماهانه برای گروه‌های عمده «خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات»، ۵.۵ درصد و برای گروه عمده «کالاهای غیرخوراکی و خدمات»، ۳.۴ 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 آذر ماه ۱۴۰۴ نرخ تورم سالانه برای خانوارهای کشور به ۴۲.۲ درصد رسیده که نسبت به همین اطلاع در ماه قبل، ۱.۸ واحد درصد افزایش یافته است.

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

نرخ تورم سالانه کشور در آذر ماه ۱۴۰۴ برابر ۴۲.۲ درصد است که دامنه تغییرات آن برای دهک‌های مختلف هزینه‌ای از ۴۱.۲ درصد برای دهک دهم، تا ۴۳.۷ درصد برای دهک‌های اول و دوم است. بر این اساس فاصله تورمی دهک‌ها در این ماه به ۲.۵ واحد درصد رسید که نسبت به ماه قبل (۲.۲ واحد درصد) ۰.۳ واحد درصد افزایش داشته است.



با سپاس از توجه شما

