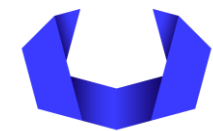


بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۱۰ بهمن ماه ۱۴۰۴



دانایان
کارگزاری

دیدگاه دانایان

هفته اخیر بازار سرمایه با عرضه سنگین همراه شد. احتمال تنش و درگیری نظامی در منطقه، عرضه‌ها را به اوج خود رساند. رشد بازار در ماه‌های اخیر هم مزید بر علت شد که بسیاری از معامله‌گران اقدام به خروج از بازار و شناسایی سود کنند.

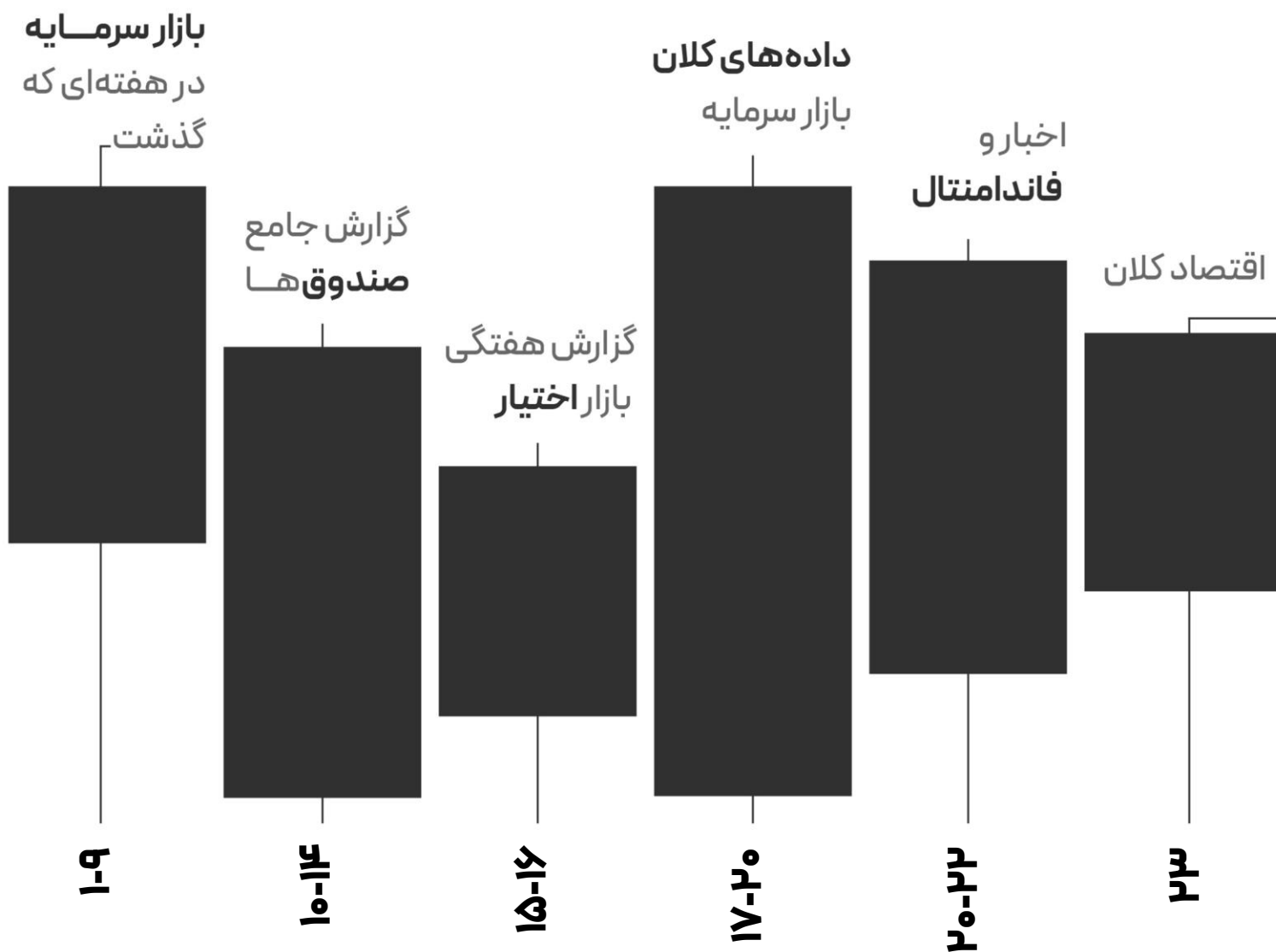
بعد از اینکه در هفته‌های گذشته، شاهد **خروج پول حقیقی** نسبتاً سنگینی از معاملات خرد بازار سهام بودیم، هفته اخیر، مهم‌ترین پارامتر نقدینگی بازار، یعنی ارزش معاملات خرد هم سیگنال اصلاحی صادر کرد و **کراس نزولی** بین میانگین‌های هفتگی و ماهانه رخ داد. فلذا تا زمان برقراری دوباره تاییدیه‌های مثبت از سوی پارامترهای نقدینگی، می‌توان گارد محتاطانه‌تری نسبت به صعود بازار داشت.

تاییدیه‌های مثبت، شامل صعودی شدن ارزش معاملات خرد روزانه، کراس صعودی در میانگین‌های هفتگی و ماهانه و سپس فصلی و همچنین بازگشت پول‌های حقیقی به بازار سهام است. اخبار بنیادی مهم، یا اخبار مثبت در سطح کلان و بین‌المللی می‌توانند محرک شکل‌گیری این موارد باشند.

از زمان قطعی اینترنت و اعمال محدودیت‌ها، یعنی از ۱۷ دی‌ماه تا پایان هفته اخیر، حدود **۲۴ همت** پول حقیقی از معاملات خرد خارج شده است. این مقدار برای صندوق‌های درآمد ثابت، بیش از ۴ همت ورود پول بوده است که گواهی از فضای محتاطانه در بین معامله‌گران بازار سهام می‌دهد.

به لحاظ تکنیکالی نیز، تا زمانی که شاخص کل، زیر میانگین متحرک ۲۶ روزه باشد، نمی‌توان انتظار شکل‌گیری صعود پایداری در بازار سرمایه داشت. فلذا حد تایید روند صعودی کوتاه‌مدت را شکست و تثبیت میانگین متحرک توسط کندل‌های شاخص کل، دانست.

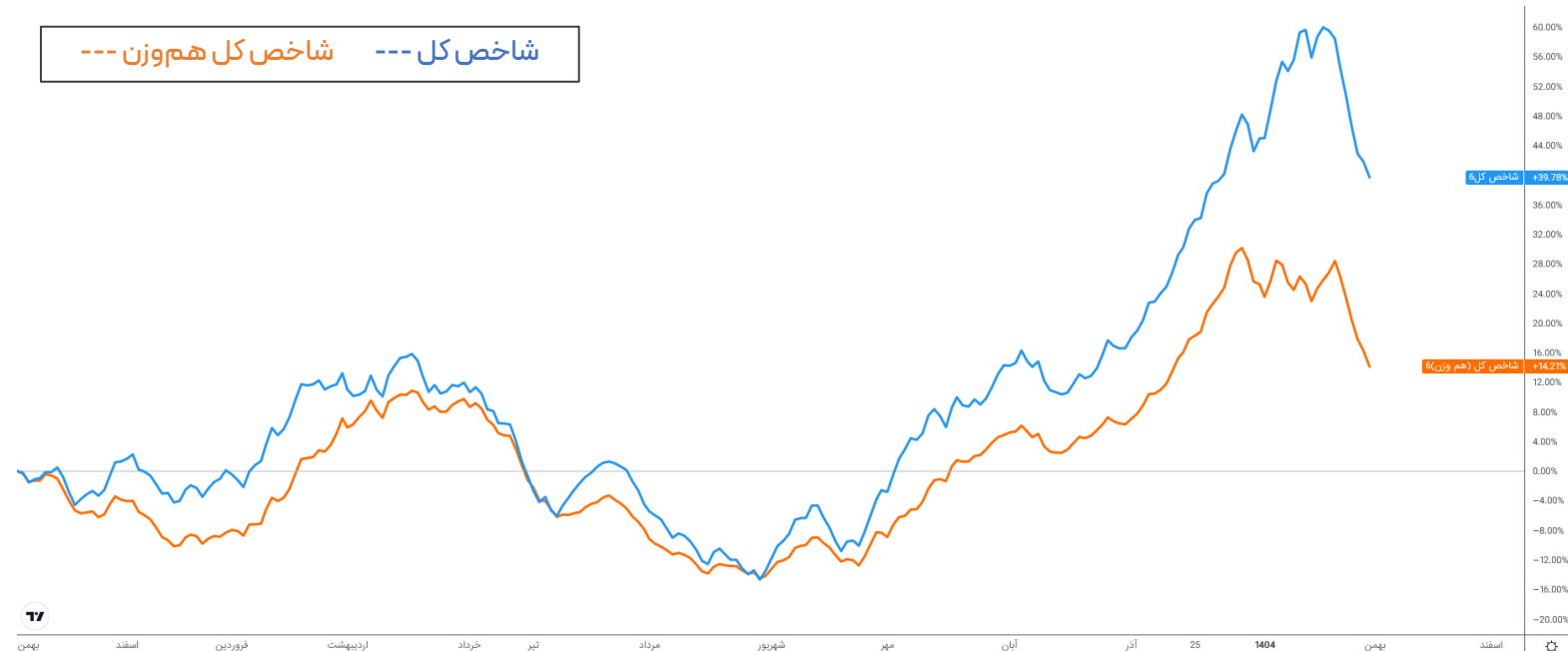
همچنین، **صندوق‌های طلا** در هفته اخیر، با رشد بسیار قابل توجهی، پیرو رشد افسارگسیخته نرخ دلار در بازار آزاد و انس جهانی طلا، همراه شدند. با این وجود، با ریزش حدوداً ۱۰ درصدی انس در پایان هفته، انتظار می‌رود در ادامه، تقاضا در معاملات صندوق‌های طلای داخلی هم، حداقل در کوتاه‌مدت فروکش کند.



نمودار مقایسه‌ی

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. در لگ دوم ریزش اما، 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 صعودی 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	-۱۰.۴۹%	-۳.۴۴%	+۲۴.۰۷%	+۴۸.۴۶%	+۴۱.۸۲%
بازده شاخص کل هم وزن	-۹.۴۵%	-۹.۵۳%	+۱۰.۸۷%	+۲۶.۱۹%	+۱۶.۲۷%



شاخص کل هموزن به شاخص کل

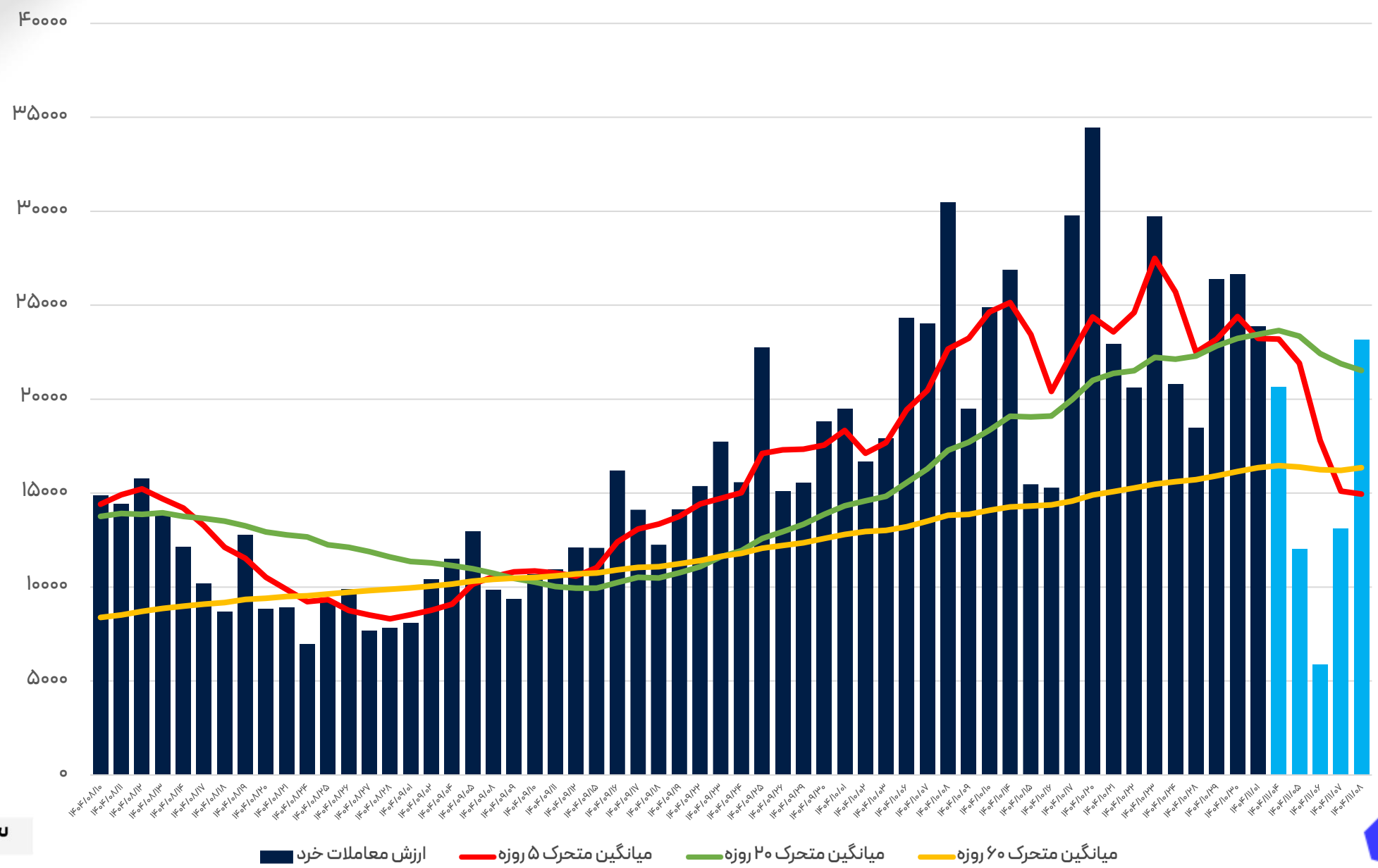
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هموزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هموزن نسبت به شاخص کل است. همچنین اگر آینده‌ی نمودار صعودی ارزیابی شود، انتظار می‌رود شاخص هموزن نسبت به شاخص کل بازده و عملکرد بهتری را به ثبت برساند. بازده بهتر می‌تواند شامل رشد بیشتر شاخص هموزن نسبت به شاخص کل، یا اصلاح کمتر شاخص هموزن نسبت به شاخص کل و یا رشد شاخص هموزن و اصلاح قیمتی یا زمانی شاخص کل باشد.



در تصویر، نمودار نسبی شاخص هموزن 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 هموزن، چه در صعود و چه در اصلاح، بهتر و قوی‌تر بوده است. علی‌رغم نوسانات مثبتی که در چند ماه اخیر در این نمودار و رشدهای مقطعی صنایع کوچک‌تر بازار بودیم، اما روند کلی نمودار نزولی بوده و حال، بعد از حدوداً ۳۰ ماه، ریزش در این نمودار، به نظر می‌رسد الگوی مثلث فرض شده در آستانه تمام شدن قرار گرفته است. اگرچه حد تایید نهایی پایان این اصلاح، شکست خط روند نزولی ترسیم شده به سمت بالا است، اما با حد نقض بازگشت به زیر آخرین کف نیز، می‌توان صعود احتمالی در این نمودار را مد نظر قرار داد. صعود نمودار فوق به معنای عملکرد بهتر سهام کوچک‌تر و مرتبط با شاخص هموزن نسبت به شاخص‌سازان خواهد بود که در شرایط اصلاحی بازار، در قالب ریزش کم‌شتاب‌تر نمود پیدا خواهد کرد.

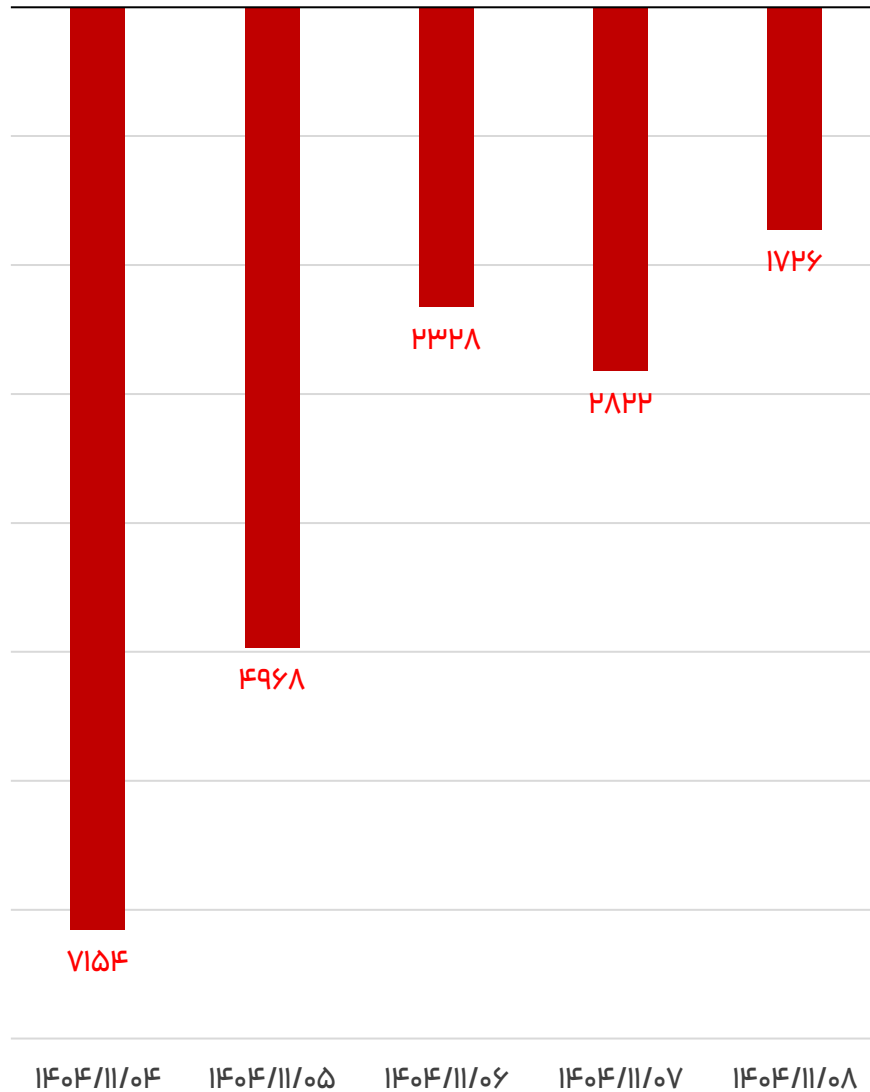


ارزش معاملات خرد ۹ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

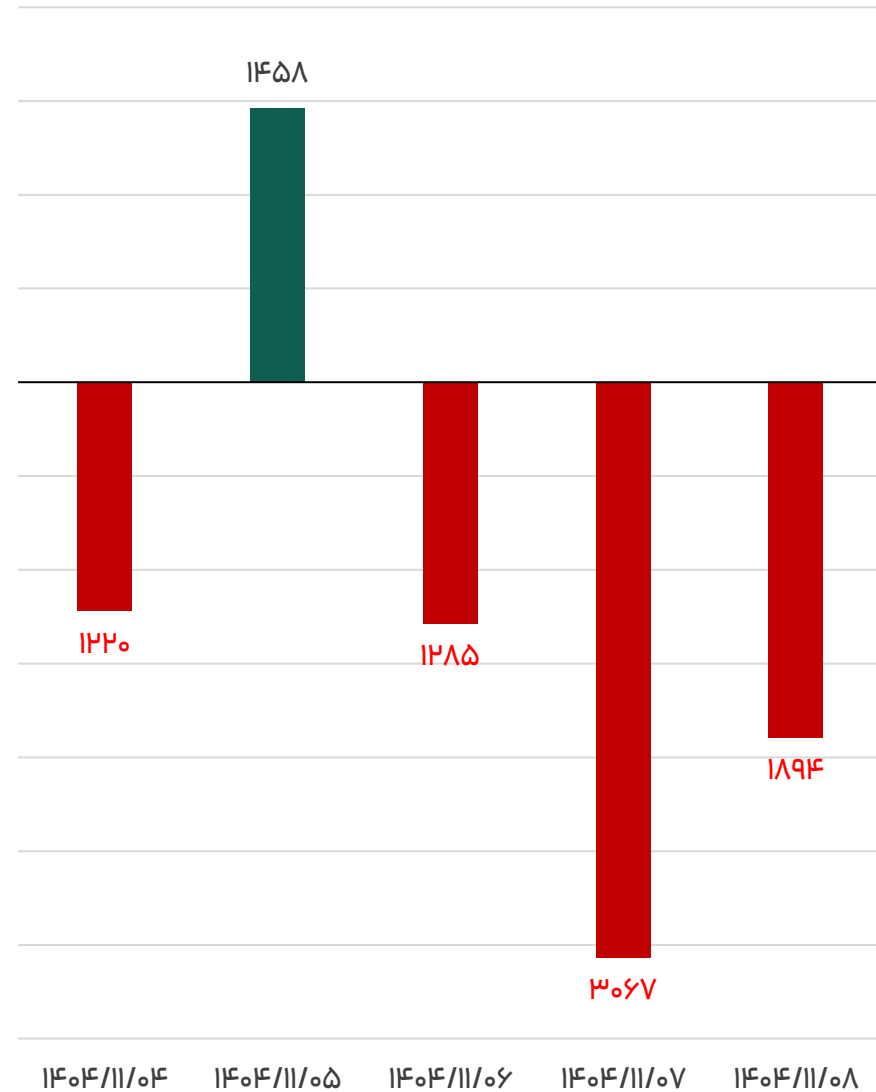


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

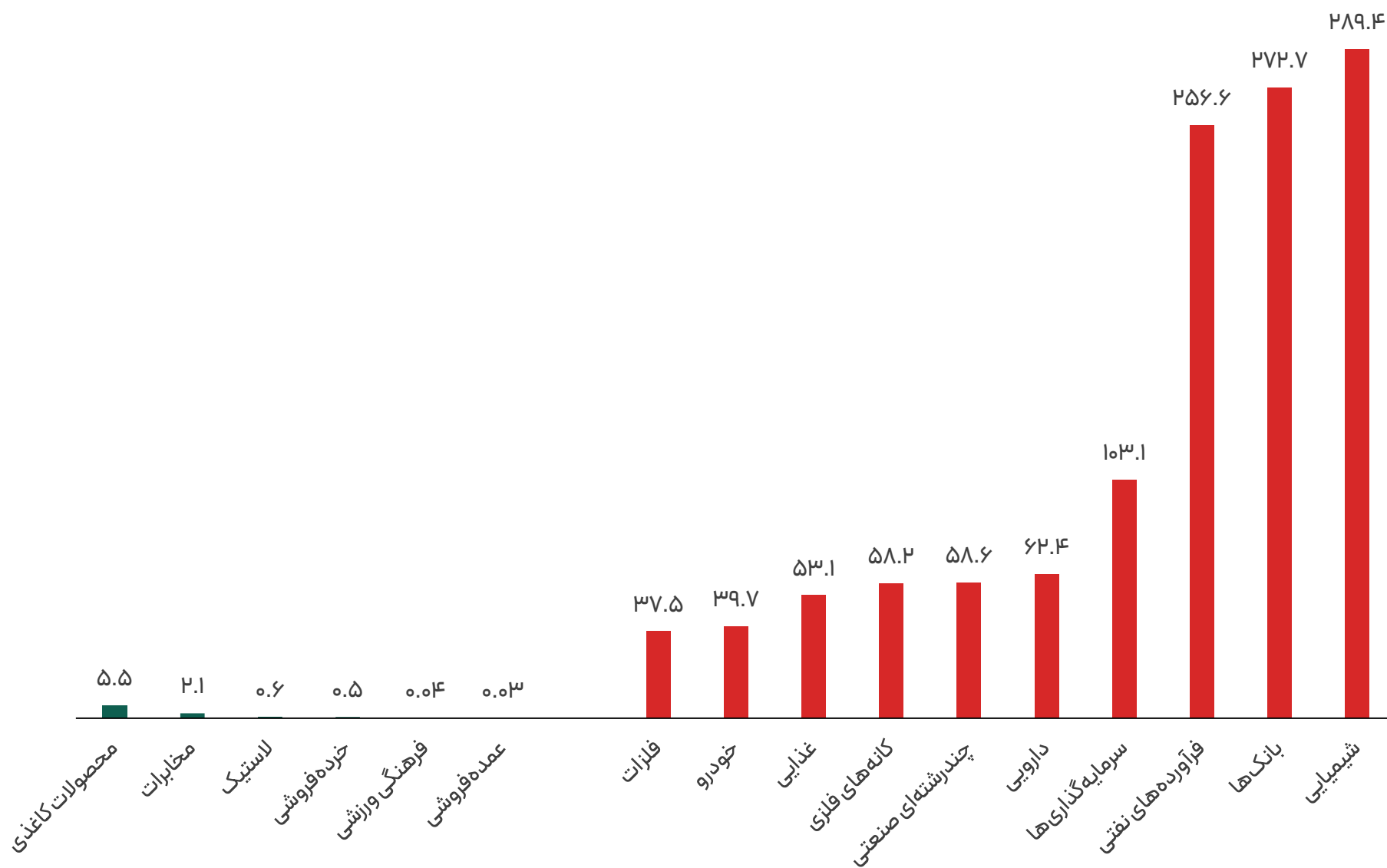
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



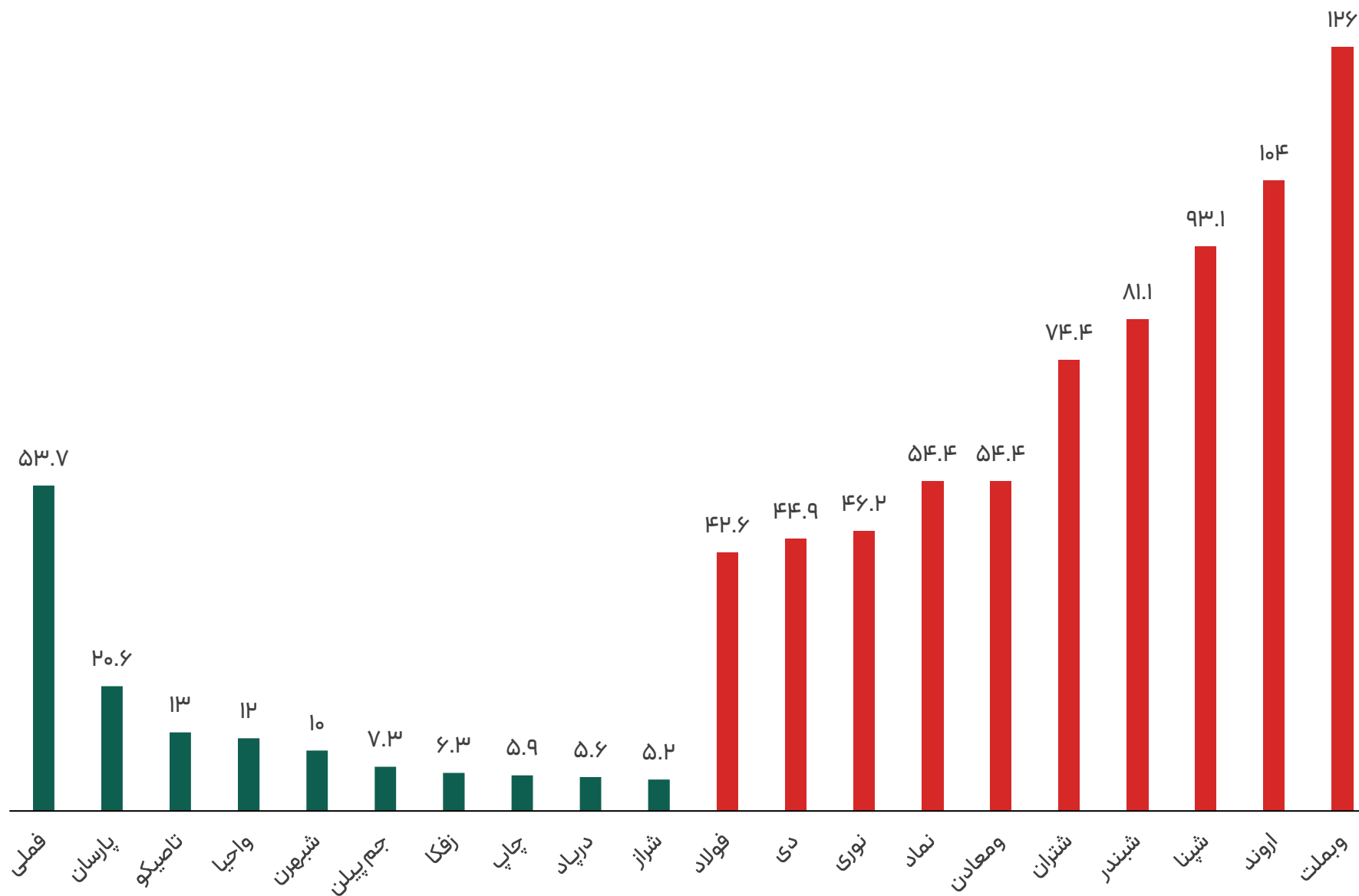
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



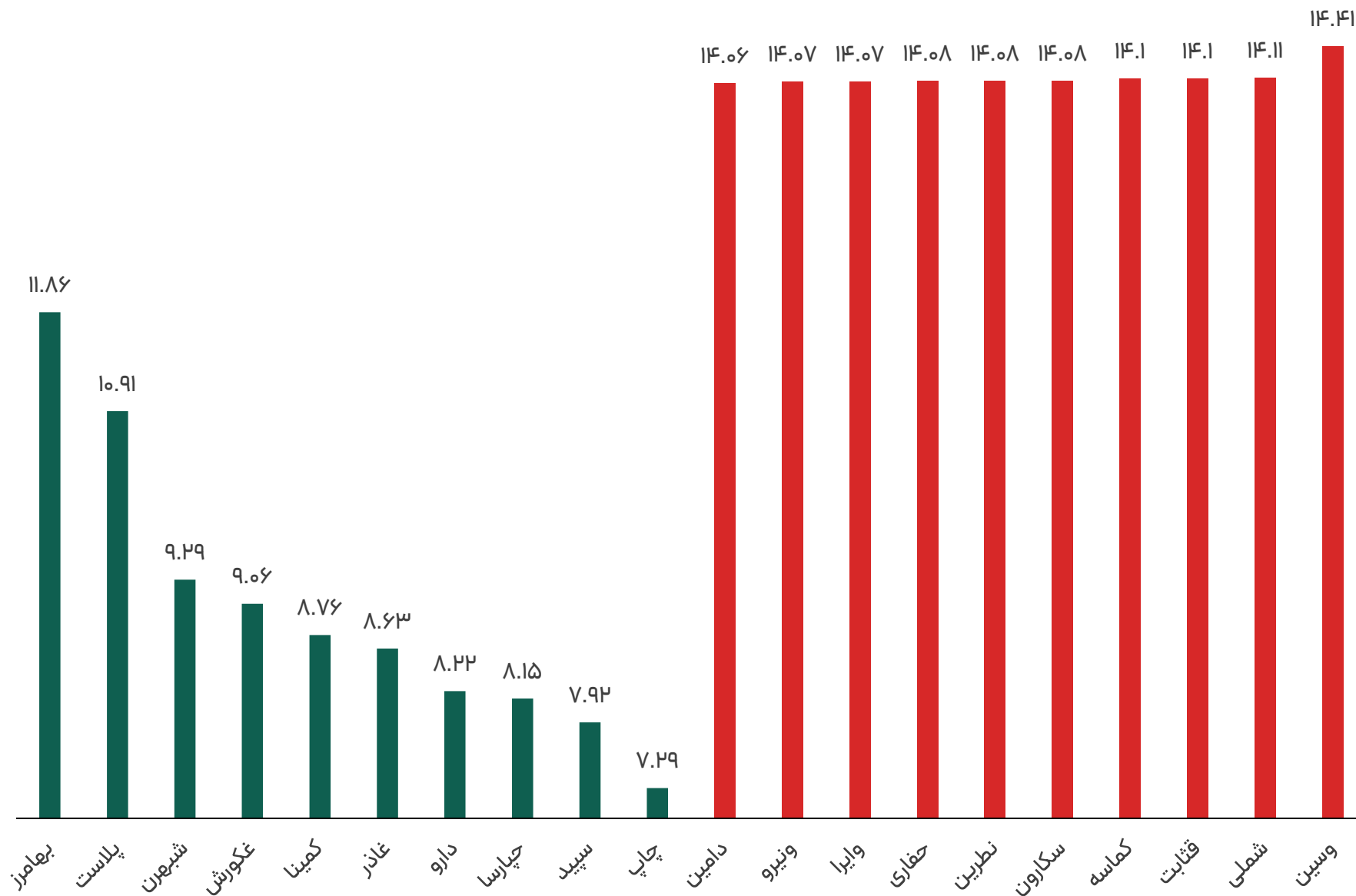
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)

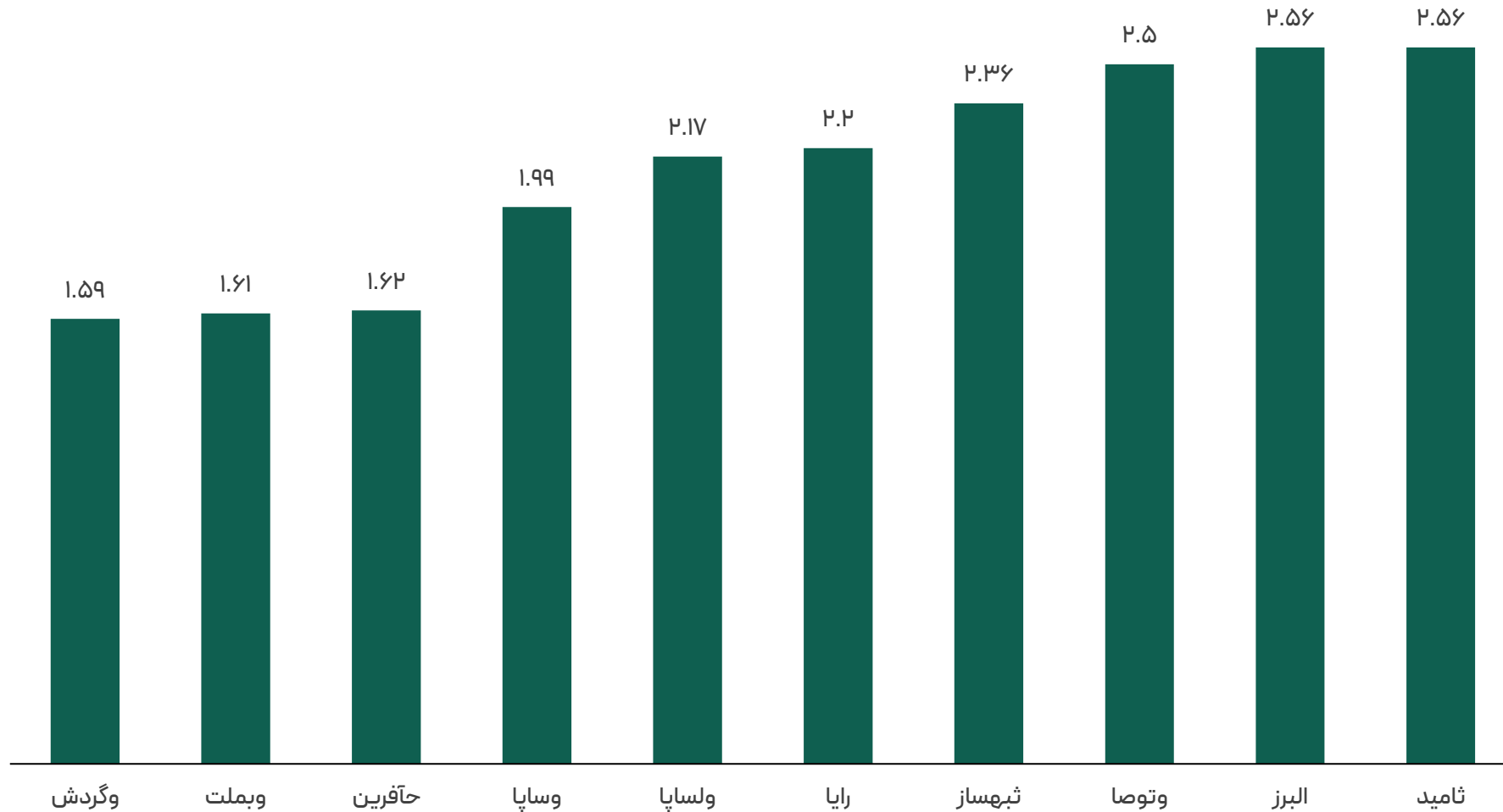


دسته بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نماد




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		
		سه ماهه	یک ماهه					سالانه	سه ماهه	ماهانه
دواپکس 	-۰.۹۱	۲.۷۳	-۰.۹	۱.۹۵	۰.۹۶	۱.۸۷	۱.۸۹	۷.۹۸	۶۲.۲	۳۶.۹۸
پیشران 	-۴.۷۳	-۱.۸۹	-۲.۴۷	۱.۷۴	۰.۹۱	۱.۵۸	۱.۶۵	-۶.۲۱	۴۵.۰۸	۴۷.۱۱
موج 	-۱۲.۴۴	-۷.۹۷	-۵.۶۹	۱.۵۶	۰.۹۹	۱.۵۴	۱.۷۳	-۸.۶۲	۳۱.۹۵	۶۲.۸۴
توان 	-۱۴.۰۱	۲۹.۱۸	۱۳.۴۸	۱.۸	۰.۹۴	۱.۶۹	۱.۹۳	-۱۳.۳۴	۳۱.۱۷	۳۳.۲۵
نارنج اهرم 	-۱۵.۰۵	-۵.۰۱	-۶.۰۱	۲.۰۱	۰.۹۶	۱.۹۳	۲.۲۲	-۱۸.۴۷	۲۹.۸۷	۶۴.۷۹
اهرم 	-۱۶.۴۳	-۱۰.۰۹	-۸.۰۸	۱.۶۵	۰.۹۲	۱.۵۲	۱.۷۷	-۱۲.۹۸	۱۹.۵۶	۲۵.۲۵
شتاب 	-۱۸.۳۶	-۱۲.۷۲	-۱۱.۴۵	۱.۸۶	۰.۸۵	۱.۵۸	۱.۸۷	-۱۱.۵۶	۲۵.۷۸	۳۷.۹۵
جهش 	-۱۹.۲۵	-۱۱.۵۵	-۱۱.۲	۱.۹۸	۰.۹۲	۱.۸۲	۲.۱۷	-۱۵.۰۹	۳۲.۴۶	۳۱.۴۹
بیدار 	-۱۹.۶	-۱۴.۲	-۱۲.۳۸	۱.۷۶	۰.۸۲	۱.۴۴	۱.۷۲	-۸.۶۱	۳۳.۳۹	۴۶.۵۸



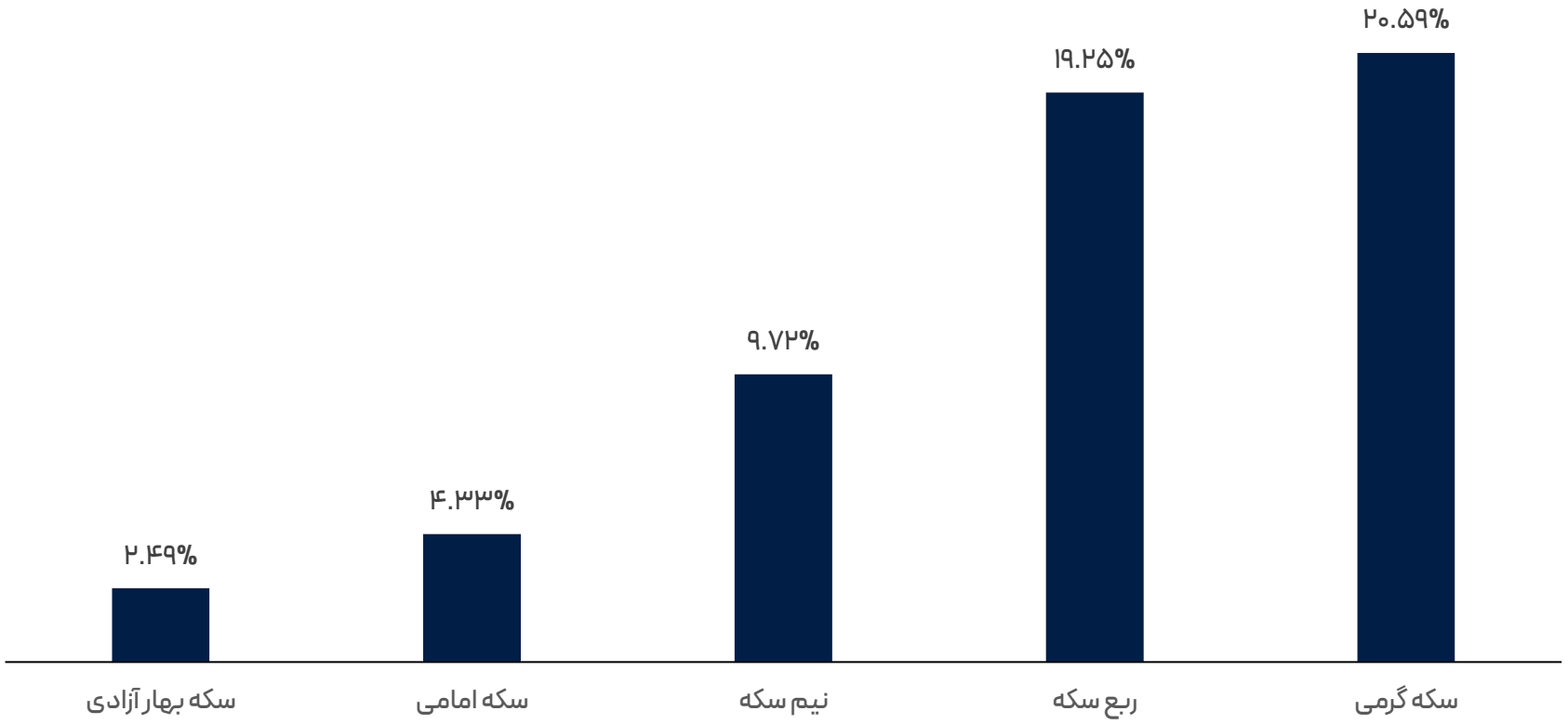
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۲.۴۴%) ۱,۵۸۴,۶۵۰ ریال انس طلا انس نقره (۰.۰۴%) ۴,۹۸۶ دلار (۲۴.۳۱%) ۱۰۳ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حساب
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۱ آینده	۱,۸۵۵,۹۰۰	-۲.۱۲	-۰.۲
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ رفاه	۱,۳۹۳,۹۲۰	-۱.۱۴	-۲۵.۰۴
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۲ سامان	۱,۸۹۷,۰۰۰	-۱.۶۷	۲.۰۱
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۵,۷۲۷,۳۷۰	-۷	۸.۸۷
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۸۵۹,۹۹۸,۹۰۰	-۱.۶۹	۰.۰۲
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۲۴,۰۴۹,۸۴۰	-۲.۴۵	-۴.۸۶



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	یک ماهه	سه ماهه
مانا 	۴.۴۱	۳۰.۸۸	-۸۶.۳۱	۰.۷۲	۹	-۰.۱۸	-۰.۲۸	-۰.۲۶
خبرگان 	۲.۹۲	۳۲.۹۹	-۹۰.۵۹	۹.۵۸	۵.۸۵	۰.۷۶	۰.۶۱	۰.۹۳
انار 	۲.۵۹	۹.۳۵	۲۶.۰۸	۱۱.۵۹	۲۸.۱۳	۰.۸۸	-۱.۹۹	-۱.۲۹
صدف 	۲.۱۳	۳۱.۹۹	۶۶.۹	۱.۱۱	۰.۶۱	-۱.۲۸	-۰.۵۱	۰.۲۸
خلیج 	۲.۰۶	۳۲.۰۲	۴۹.۰۴	۲.۸۲	۱.۳	۱.۴۲	۱.۱۱	۰.۵۳
وبازار 	۱.۷	۳۳.۳۳	۵۸.۶	۱.۹۲	۱.۶۳	۰.۰۵	-۰.۳۱	۰.۱۱
پادا 	۱.۶۱	۲۷.۹۱	۴۱.۴۹	۱.۳	۲.۸۳	۰.۲۳		
سلام 	۱.۵	۳۲.۵۷	۴۳.۱۷	۲۷.۹	۱۸.۰۷	۱.۱۸	-۰.۳۲	۰.۰۹
مروارید 	۱.۳	۶.۰۴	-۱۱.۷۵	۰.۰۶	۰.۴۸	۶.۱۲	۳.۰۵	۱۰.۹۸

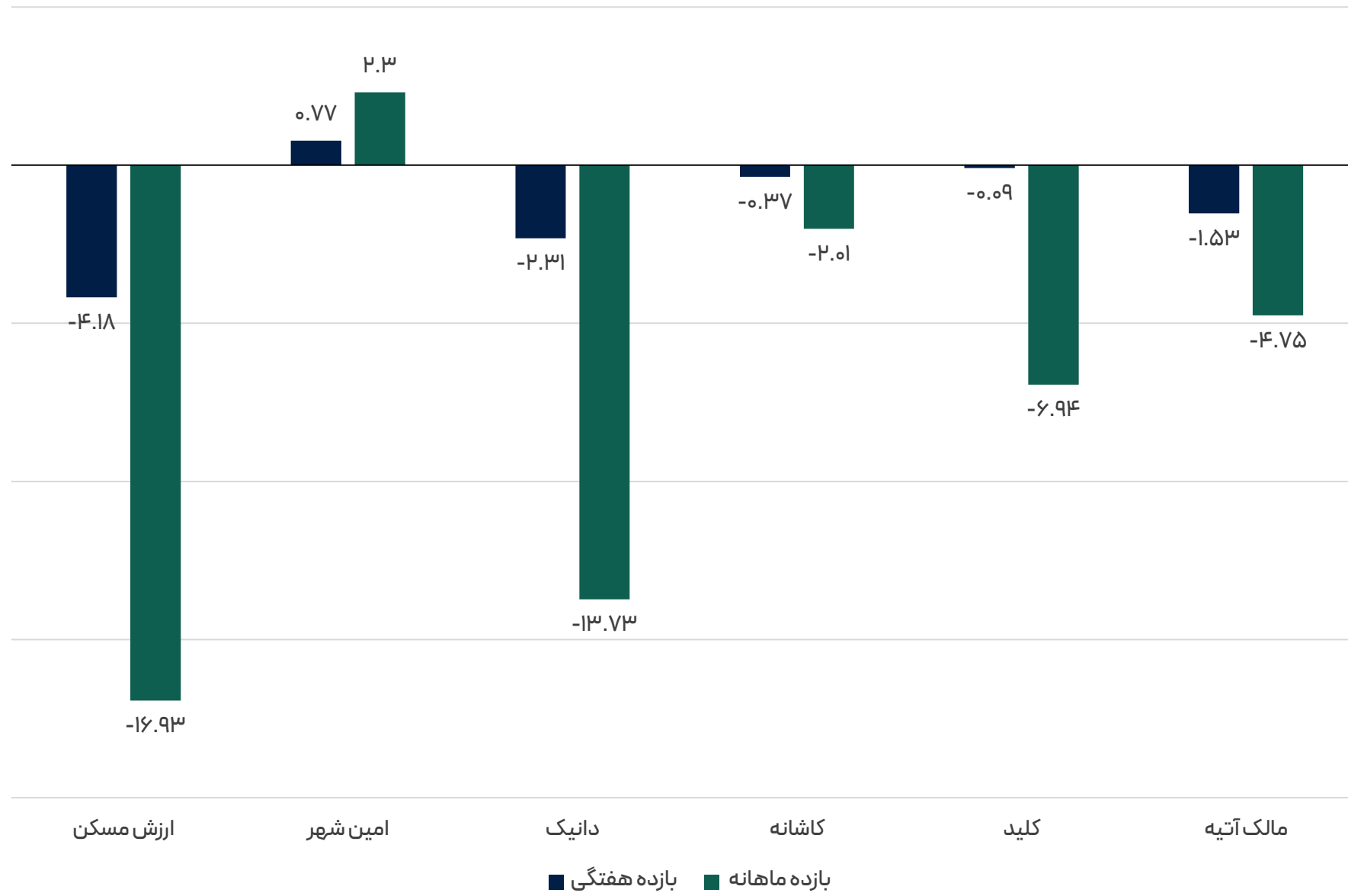


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حساب	میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه		سه ماهه	یک ماهه
دایب مزه 	۹.۰۷	۳۲.۱۲	۴۱.۹	۱۰.۳۲	۰.۱۳	۰.۳۸	۰.۲۴
فرا الگوریتم 	۷.۱۹	۲۸.۹۶	۶۲.۵	۱.۶۳	۰.۲۹	-۰.۳۷	-۰.۲۶
سورنافود 	۷.۰۵	۲۵.۷۴	۵۶.۳	۵.۴۲	۱.۰۹	-۰.۶۵	-۰.۱۶
پتروفارس 	۴.۵۱	۳۴.۸۱	۳۸.۳۱	۱۱.۶۱	-۰.۴۲	-۱.۰۲	-۰.۲۷
نمک 	۴.۰۳	۳۴.۳۳	۷۱.۸۴	۸.۵۸	۱.۲۱	-۰.۶	-۰.۰۹
طعام 	۳.۳۷	۲۵.۸۳	۵۱	۲.۱۹	۱.۷	۰.۶۷	۰.۴۸
پتروپاداش 	۲.۳۴	۲۷.۴۸	۳۴.۷۸	۱۴.۵۲	-۳.۱۳		
پتروصبا 	۲.۲۵	۲۵.۷۶	۲۸.۲۳	۱۵.۵۶	-۰.۲۷	-۰.۳۷	-۰.۱۴
دایب متال 	۱.۸۴	۵۰.۱۱	۵۷.۷۸	۱۰.۳۸	-۰.۵	-۰.۰۴	۰.۰۲



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



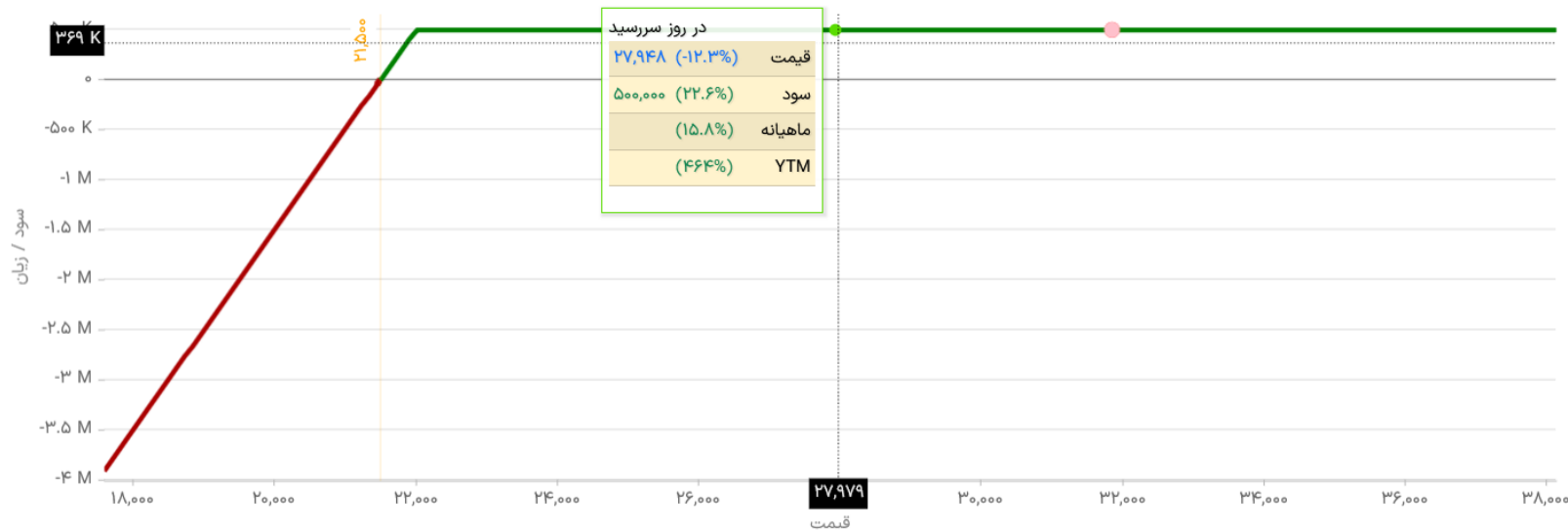
گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

استراتژی استرانگل فروش (Short Strangle) با قراردادهای اختیار فروش برج ۱۲ صندوق اهرم

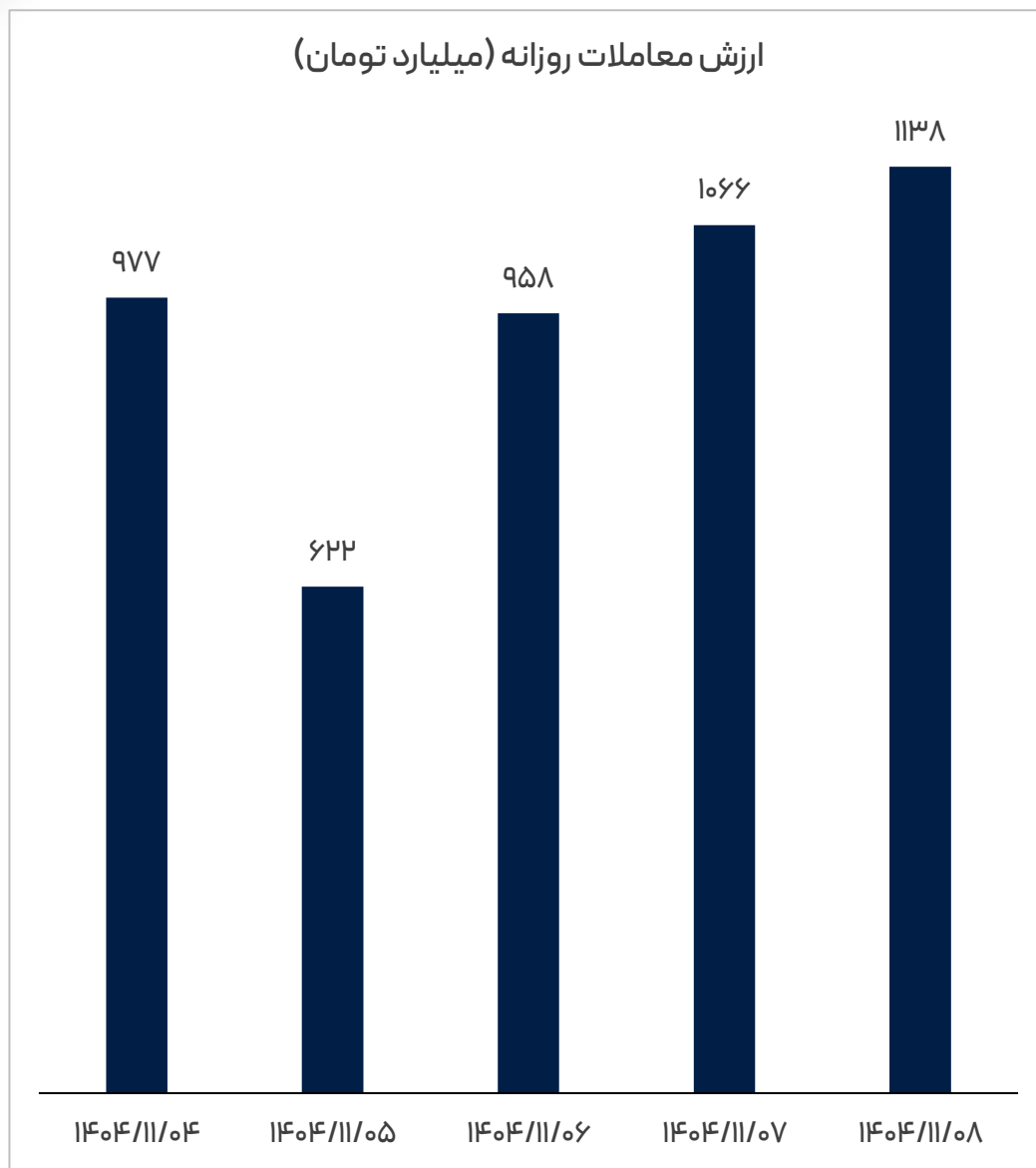
این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش و اختیار خرید (هر دو در زیان) با نمادهای ضرهم ۱۲۶ و طهرم ۱۲۵ انجام می‌شود. چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم بین ۲,۰۶۸ و ۵,۱۳۲ تومان باقی بماند، استراتژی در سود به میزان ۲۴.۷ درصد، (۱۷.۲ درصد ماهانه) بسته خواهد شد. با این وجود اگر معامله‌گر تصور می‌کند قیمت آستانه بالا در دسترس خواهد بود، می‌توان تنها فروش طهرم ۱۲۵ را انجام داد که در این صورت، اگر قیمت صندوق اهرم در روز سررسید بالاتر از ۲,۱۵۰ تومان باشد، استراتژی در سود بسته خواهد شد. ۲۲.۶ درصد سود معادل ۱۵.۸ درصد سود ماهانه. همچنین به تبع، اگر معامله‌گر تصور می‌کند قیمت آستانه پایین استراتژی در دسترس خواهد بود، می‌توان تنها فروش ضرهم ۱۲۶ را انجام داد. در تصویر زیر، حالت دوم به تصویر کشیده شده است (در دسترس بودن آستانه بالای قیمت و اقدام به فروش طهرم ۱۲۵ به تنهایی)

خرید/فروش	نماد	نوع	تعداد	اعمال	قیمت	دلتا	IV %	وجه تضمین	آفست	خالص
فروش	ضرهم ۱۲۶	اختیار خرید	۱	۵۰,۰۰۰	۸۲۰	۰	۱۰۲	۳,۱۴۰,۰۰۰		-۳,۱۴۰,۰۰۰
فروش	طهرم ۱۲۵	اختیار فروذ	۱	۲۲,۰۰۰	۵۰۰	۰	۱۰۳	۲,۲۱۰,۰۰۰		-۲,۲۱۰,۰۰۰
روز ۴۳										-۲,۲۱۰,۰۰۰



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۱۲۶ ضرر ۳۹,۵۶۵.۴ B	۱۲۵۸ ضرر ۶,۴۵۹.۹ B	۱۲۵۸ ضرر ۲,۹۰۳.۹ B
۱۲۵۸ ضرر ۲۱,۲۰۴.۴ B	۱۱۲۶ ضرر ۶,۲۳۱.۱ B	۱۲۵۷ ضرر ۱,۰۱۹.۷ B
۱۱۲۸ ضرر ۱۵,۳۶۰.۲ B	۱۲۵۶ ضرر ۲,۵۸۸.۸ B	۱۲۵۵ ضرر ۹۶۹.۲ B
۱۱۲۵ ضرر ۱۰,۸۰۶.۶ B	۱۲۵۷ ضرر ۲,۳۶۱ B	۱۲۵۶ ضرر ۹۳۰.۹ B
۱۱۲۷ ضرر ۹,۸۵۴ B	۱۲۵۵ ضرر ۲,۳۳۶.۷ B	۱۲۴۲ ضرر ۴۹۰.۱ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۱۲۶ ضرر ۱۲,۴۵۳.۳ B	۱۱۲۶ ضرر ۴,۷۹۱.۵ B	۱۲۵۶ ضرر ۵۲۰ B
۱۲۵۸ ضرر ۵,۵۷۷.۳ B	۱۲۵۸ ضرر ۲,۴۲۱.۵ B	۱۲۵۷ ضرر ۳۲۰.۲ B
۱۱۲۸ ضرر ۴,۶۹۶.۶ B	۱۲۵۶ ضرر ۲,۱۴۲.۳ B	۱۲۵۵ ضرر ۲۹۳.۵ B
۱۱۲۷ ضرر ۳,۹۶۵.۳ B	۱۲۵۷ ضرر ۲,۰۴۳.۵ B	۱۲۵۸ ضرر ۱۸۸.۸ B
۱۲۵۷ ضرر ۳,۵۵۴.۹ B	۱۱۲۵ ضرر ۱,۹۱۰.۲ B	۱۲۵۴ ضرر ۸۹.۱ 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.

پس از اصلاحی که از سقف اردیبهشت ماه سال ۱۴۰۲ آغاز شد، شاخص کل بورس در آبان ماه سال گذشته، صعود خوبی را آغاز کرد که در شاخص کل به بیش از ۶۵ درصد رشد رسید و در اردیبهشت ماه سال جاری، سقف جدیدی در تاریخچه ی شاخص کل، به ثبت رسید. پس از آن، روند اصلاحی آغاز شد که در تابستان با شکل گیری جنگ ۱۲ روزه بین ایران و اسرائیل، سرعت گرفت و به لحاظ فیبوناچی، ۶۱.۸ درصد از موج صعودی پیش از خود را تصحیح یا اصلاح، یا بازگشت کرد. پس از آن، بار دیگر در شهریورماه اخیر، شاهد شکل گیری موج جدیدی از تقاضا بودیم که تا سقف اخیر به ۹۰ درصد رشد در شاخص کل رسید که نسبت ۱۲۷.۲ فیبوناچی سه نقطه ای نیز است.

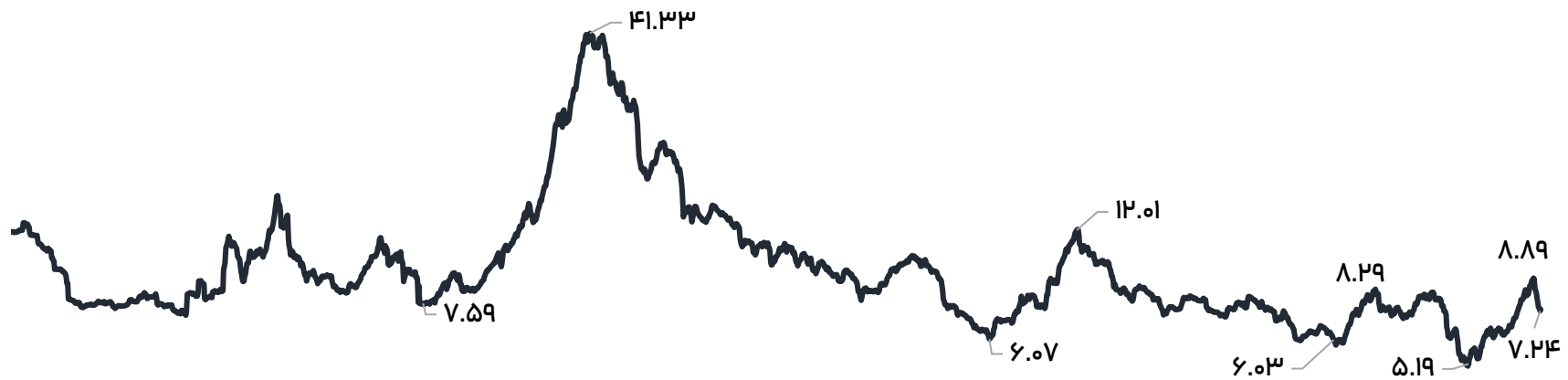
در بولتن هفته اخیر، گفته شد که به نظر می رسد در آستانه شکل گیری الگوی بازگشتی سقف دوقلو هستیم که در صورت شکست کف آخر در ۴ میلیون و ۲۵۵ هزار واحد، و سپس شکست میانگین متحرک ۲۶ روزه، می توان روند اصلاحی کوتاه مدت بازار را تأیید شده دانست که همین اتفاق هم افتاد! و حال، باید منتظر رسیدن کندل ها به محدوده مقاومت داینامیک شکسته شده که با محدوده قرمز مشخص شده است، و بررسی واکنش بازار به این محدوده بمانیم.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

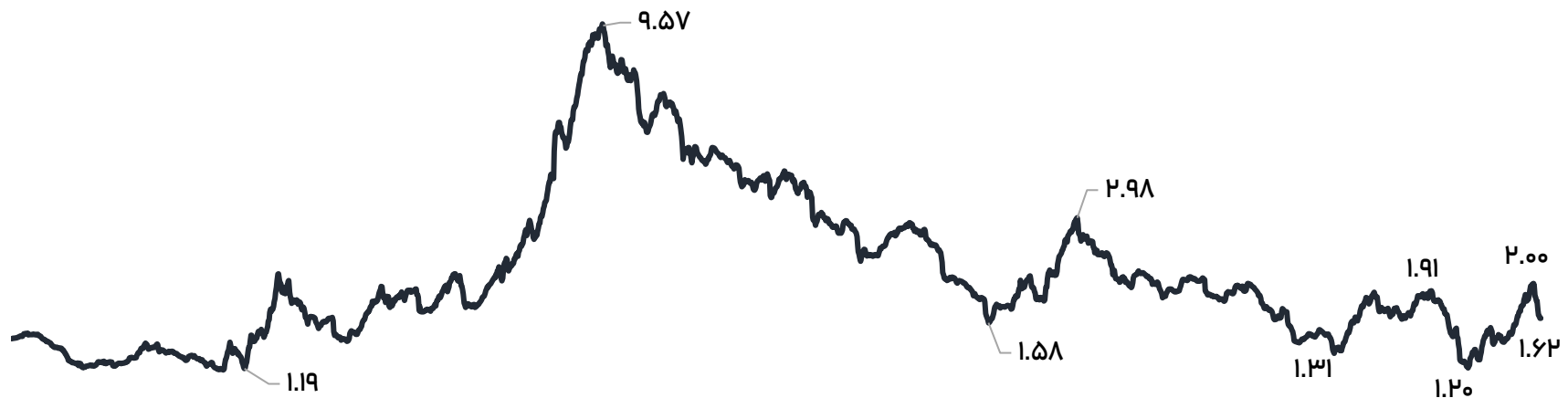
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

روند 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.

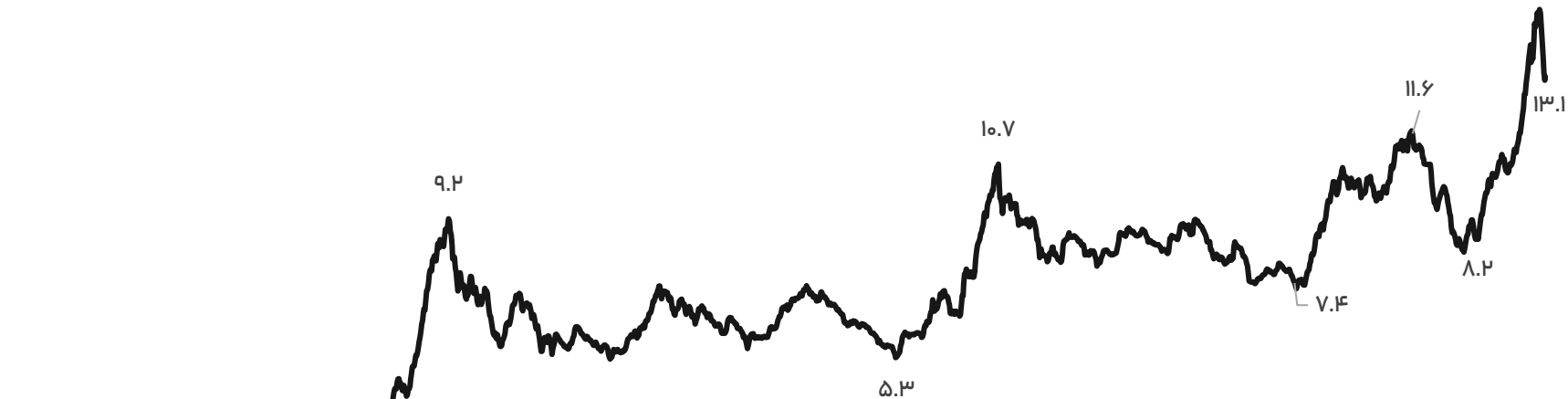
روند تغییرات P/S بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



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 می‌تواند به نوعی نشان دهنده 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)





ریزش عجیب و کم سابقه طلا و نقره جهانی

انس طلا که به ۵ هزار دلار رسیده بود، تا ۵۶۰۰ دلار هم پیشروی کرد، اما با اعلام خبر تغییر رییس فدرال رزرو توسط ترامپ، ریزش شدیدی تا سطوح زیر ۴۹۰۰ دلار تجربه کرد. نقره هم در دو روز آخر هفته معاملاتی میلادی، حدود ۴۰ درصد ریزش کرد!



محدودیت عجیب بورس کالا برای صندوق‌های نقره

بر اساس ابلاغیه جدید بورس کالا، تا اطلاع ثانوی، سقف دارایی هر سرمایه‌گذاری حقیقی و حقوقی در هر یک از صندوق‌های نقره، تنها ۵۰۰ واحد صندوق است!

اطلاعیه جدید معاملات گواهی شمش طلا

سقف خرید گواهی شمش طلا از ۲۰۰ به ۴۰۰ کیلوگرم افزایش یافت.



صندوق‌های نقره

افزایش سقف صندوق‌های نقره صادر شد. روز دوشنبه ۱۳ بهمن ماه، این صندوق‌ها بازگشایی خواهند شد.

کگل

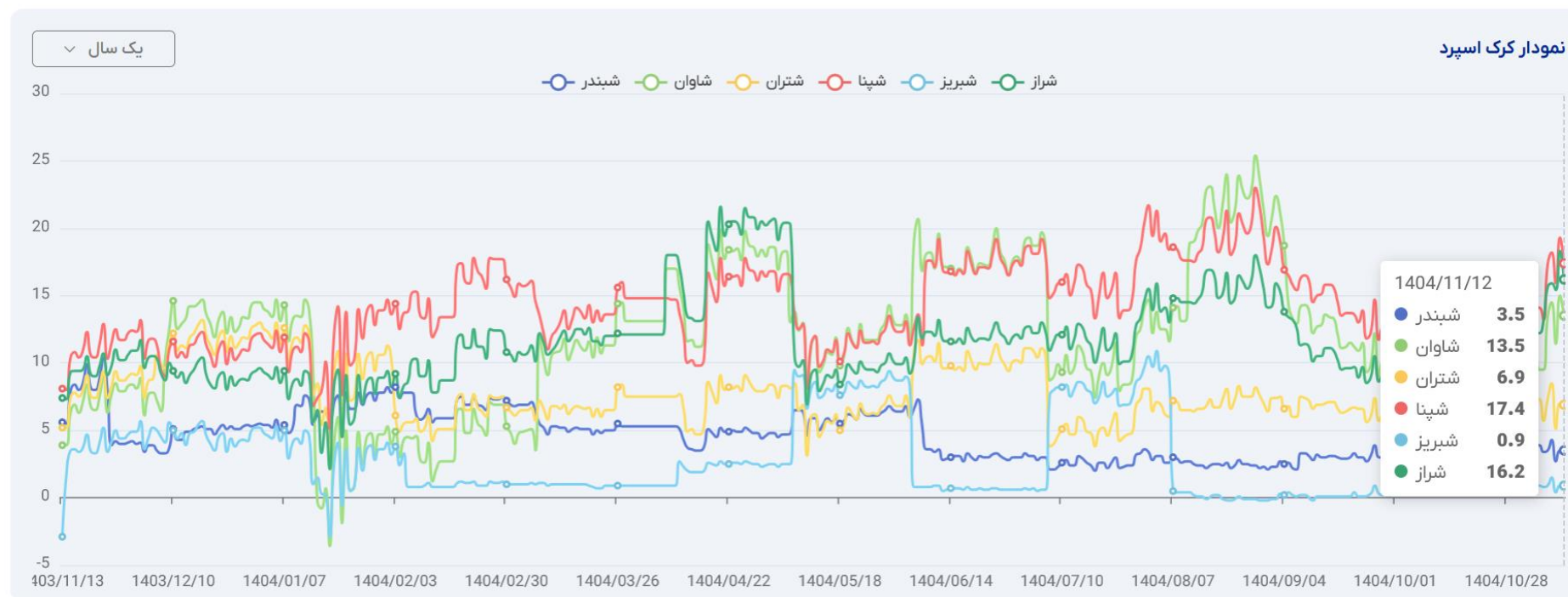
مجوز افزایش سرمایه ۳۴ درصدی کگل عمدتاً از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی و کمی انباشته صادر شد.

خودرو، خساپا

به منظور بررسی وضعیت شفافیت اطلاعاتی ناشر، نماد معاملاتی حداکثر تا تاریخ ۱۴۰۴/۱۱/۱۸ تعلیق شد. بر سر افزایش نرخ محصولات خودرو و خساپا چالش‌ها و کشمکش‌های زیادی به وجود آمده است.



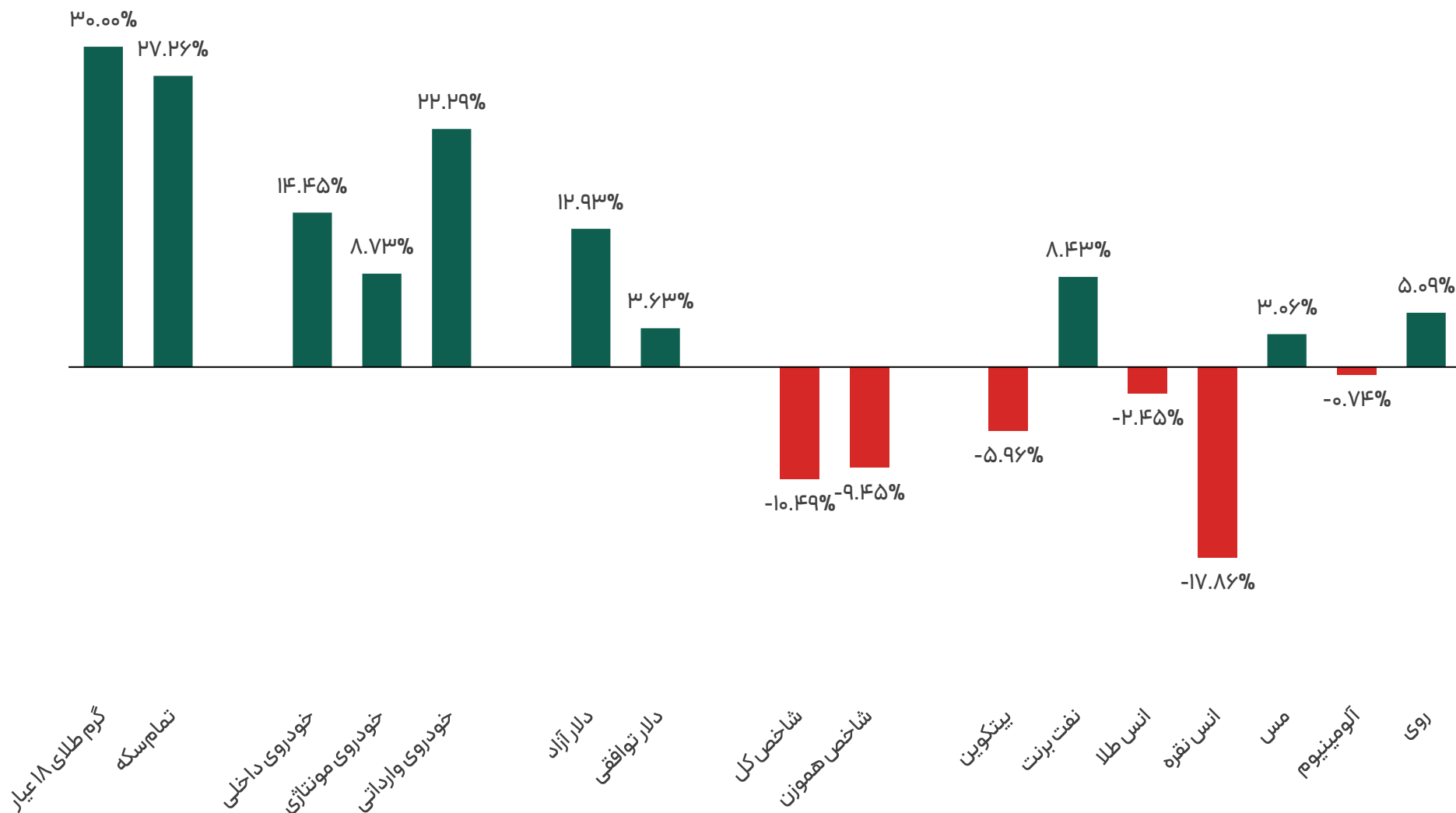
کرک اسپرد پالایشی‌ها



میانگین کرک اسپرد: شبندر \$ ۴.۶ شاون \$ ۱۱.۹ شتران \$ ۷.۷ شپنا \$ ۱۴.۳ شبریز \$ ۲.۷ شراز \$ ۱۱.۷

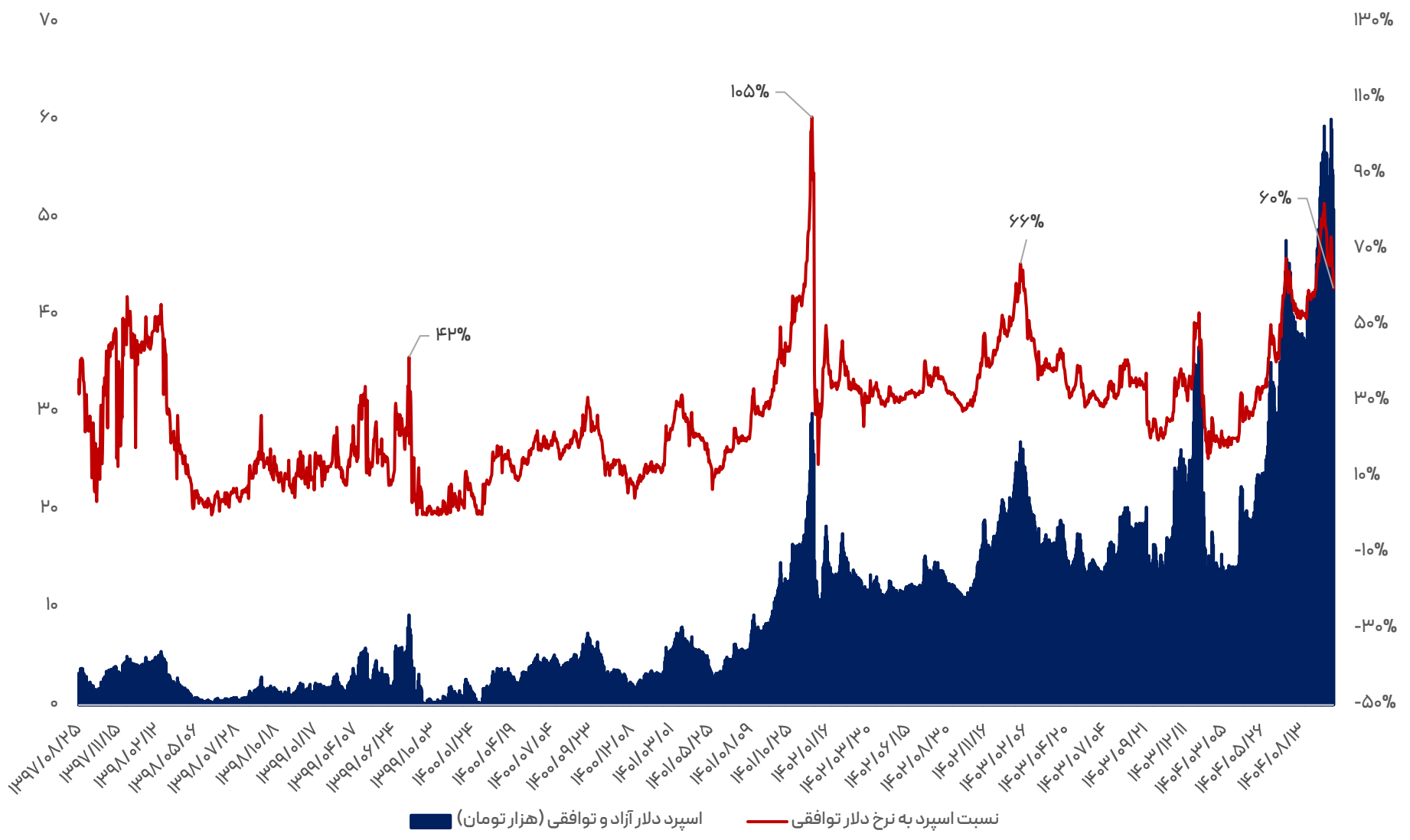


بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر



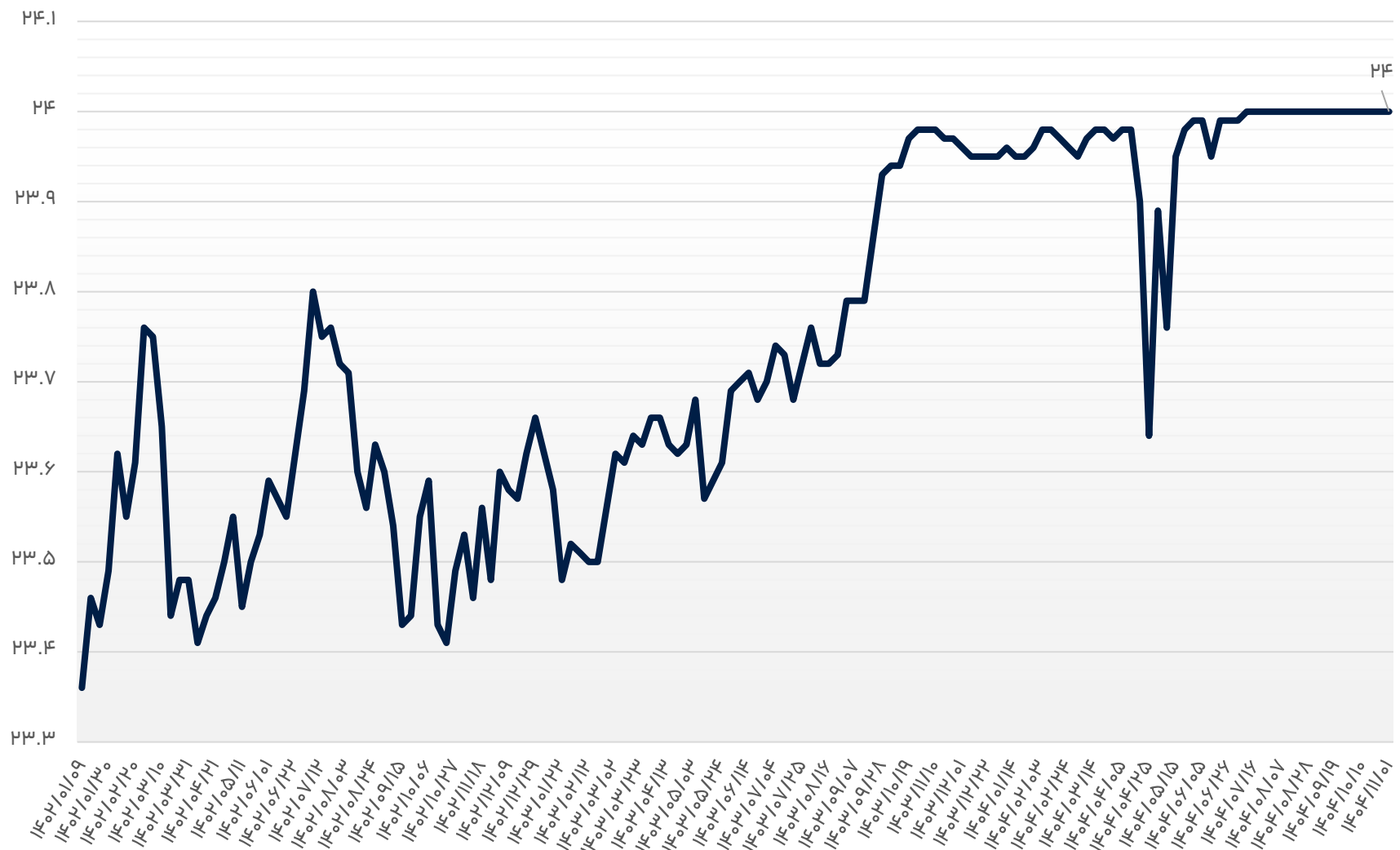
اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

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 مصرف‌کننده – دی ماه ۱۴۰۴

شاخص قیمت

در دی ماه ۱۴۰۴ شاخص قیمت مصرف‌کننده خانوارهای کشور به عدد ۴۶۹.۴ رسیده است که نسبت به ماه قبل، ۷.۹ درصد افزایش، نسبت به ماه مشابه سال قبل، ۶۰.۰ درصد افزایش و در دوازده ماهه منتهی به ماه جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۴۴.۶ 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 دی ماه ۱۴۰۴ تورم نقطه به نقطه خانوارهای کشور، ۶۰.۰ درصد بوده است؛ یعنی خانوارهای کشور به طور میانگین، ۶۰.۰ درصد بیشتر از دی ماه ۱۴۰۳ برای خرید یک «مجموعه کالاها و خدمات یکسان» هزینه کرده‌اند. تورم نقطه به نقطه دی ماه ۱۴۰۴ در مقایسه با ماه قبل، ۷.۴ واحد درصد افزایش داشته است.



تورم ماهانه خانوارهای کشور

منظور از تورم ماهانه، درصد تغییر عدد شاخص قیمت، نسبت به ماه قبل است. در دی ماه ۱۴۰۴ تورم ماهانه خانوارهای کشور برابر ۷.۹ درصد بوده است. تورم ماهانه برای گروه‌های عمده «خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات»، ۱۳.۷ درصد و برای گروه عمده «کالاهای غیرخوراکی و خدمات»، ۴.۴ 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 دی ماه ۱۴۰۴ نرخ تورم سالانه برای خانوارهای کشور به ۴۴.۶ درصد رسیده که نسبت به همین اطلاع در ماه قبل، ۲.۴ واحد درصد افزایش یافته است.

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

نرخ تورم سالانه کشور در دی ماه ۱۴۰۴ برابر ۴۴.۶ درصد است که دامنه تغییرات آن برای دهک‌های مختلف هزینه‌ای از ۴۳.۵ درصد برای دهک دهم، تا ۴۶.۸ درصد برای دهک دوم است. بر این اساس فاصله تورمی دهک‌ها در این ماه به ۳.۳ واحد درصد رسید که نسبت به ماه قبل (۲.۵ واحد درصد) ۰.۸ واحد درصد افزایش داشته است.



با سپاس از توجه شما

