

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۱۹ بهمن ماه ۱۴۰۴



هفته اخیر بازار سرمایه با واگرایی میان شاخص کل و شاخص هم وزن همراه بود. خبر احتمال مذاکره بین ایران و آمریکا در آخر هفته اخیر که در نهایت محقق هم شد، امیدواری ها نسبت به ادامه روند بازار سرمایه را افزایش داد.

در نهایت با برگزاری دور اول مذاکرات بین ایران و آمریکا در روز جمعه، بازار سهام در اولین روز کاری هفته جاری با تقاضا همراه شد، اما امروز، یکشنبه، بار دیگر موج عرضه بر معاملات غالب شد.

مهم ترین پارامتر نقدینگی بازار، ارزش معاملات خرد، سیگنال اصلاحی را صادر کرده و کراس نزولی بین میانگین های هفتگی و ماهانه رخ داده است. همچنین دیگر پارامتر نقدینگی بازار، تحرکات حقیقی ها، نیز روند اصلاحی بازار را تایید می کند. در نتیجه تا زمان برقراری دوباره تاییدیه های مثبت از سوی پارامترهای نقدینگی و همچنین مشخص تر شدن شرایط کلان، می توان گارد محتاطانه تری نسبت به صعود بازار داشت.

در هفته اخیر، برآیند گردش نقدینگی حقیقی‌ها در معاملات خرد، ۲.۲ همت منفی بود و خروج پول حقیقی به ثبت رسید. در معاملات صندوق‌های درآمد ثابت بیش از ۲.۸ همت ورود پول حقیقی به ثبت رسید و در صندوق‌های طلا نیز، شاهد خروج پول حقیقی به میزان ۱.۲ همت بودیم.

به لحاظ تکنیکالی نیز، تا زمانی که شاخص کل، زیر میانگین متحرک ۲۶ روزه باشد، نمی‌توان انتظار شکل‌گیری صعود پایدار در بازار سرمایه داشت. در نتیجه حد تایید روند صعودی کوتاه‌مدت را می‌توان شکست و تثبیت میانگین متحرک توسط کندل‌های شاخص کل و البته در ادامه شکست و تثبیت بر فراز سقف اخیر در محدوده ۴ میلیون و ۵۵۰ هزار واحد دانست.

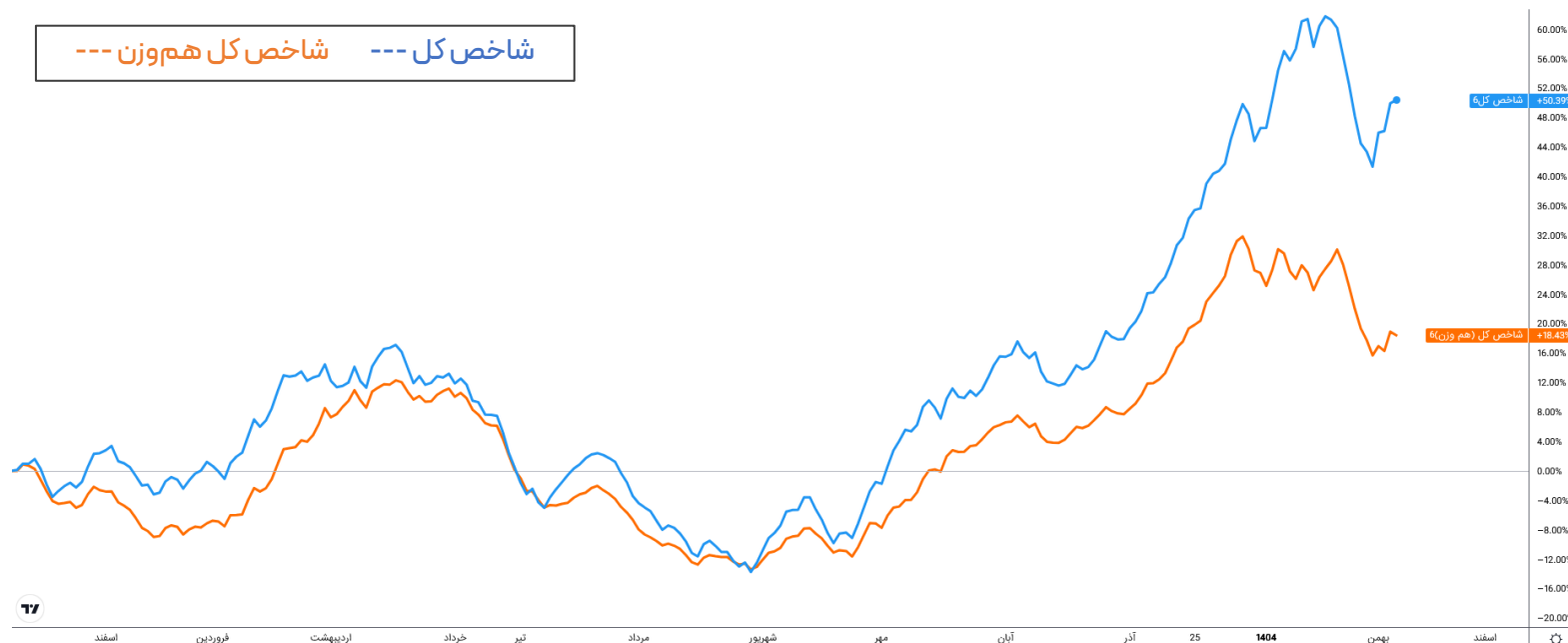
در نهایت، آنچه مشخص است، بسیاری از فعالان بازارها در مقطع کنونی که به لحاظ کلان و سیاسی، ابهامات زیادی وجود دارد، کاهش ریسک را به کسب سود ترجیح می‌دهند و منتظر شکل‌گیری فضای مطمئن‌تری برای ازسرگیری روند سرمایه‌گذاری هستند.

بازار سرمایه در هفته‌ای که گذشت	گزارش جامع صندوق‌ها	گزارش هفتگی بازار اختیار	داده‌های کلان بازار سرمایه	اخبار و فاندامنتال	اقتصاد کلان
۱-۹	۱۰-۱۵	۱۶-۱۷	۱۸-۲۵	۲۲-۲۴	۲۵-۳۰

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	+1.95%	-0.29%	+26.74%	+56.77%	+46.19%
بازده شاخص کل هم‌وزن	-1.27%	-7.08%	+9.77%	+28.53%	+16.30%



شاخص کل هموزن به شاخص کل

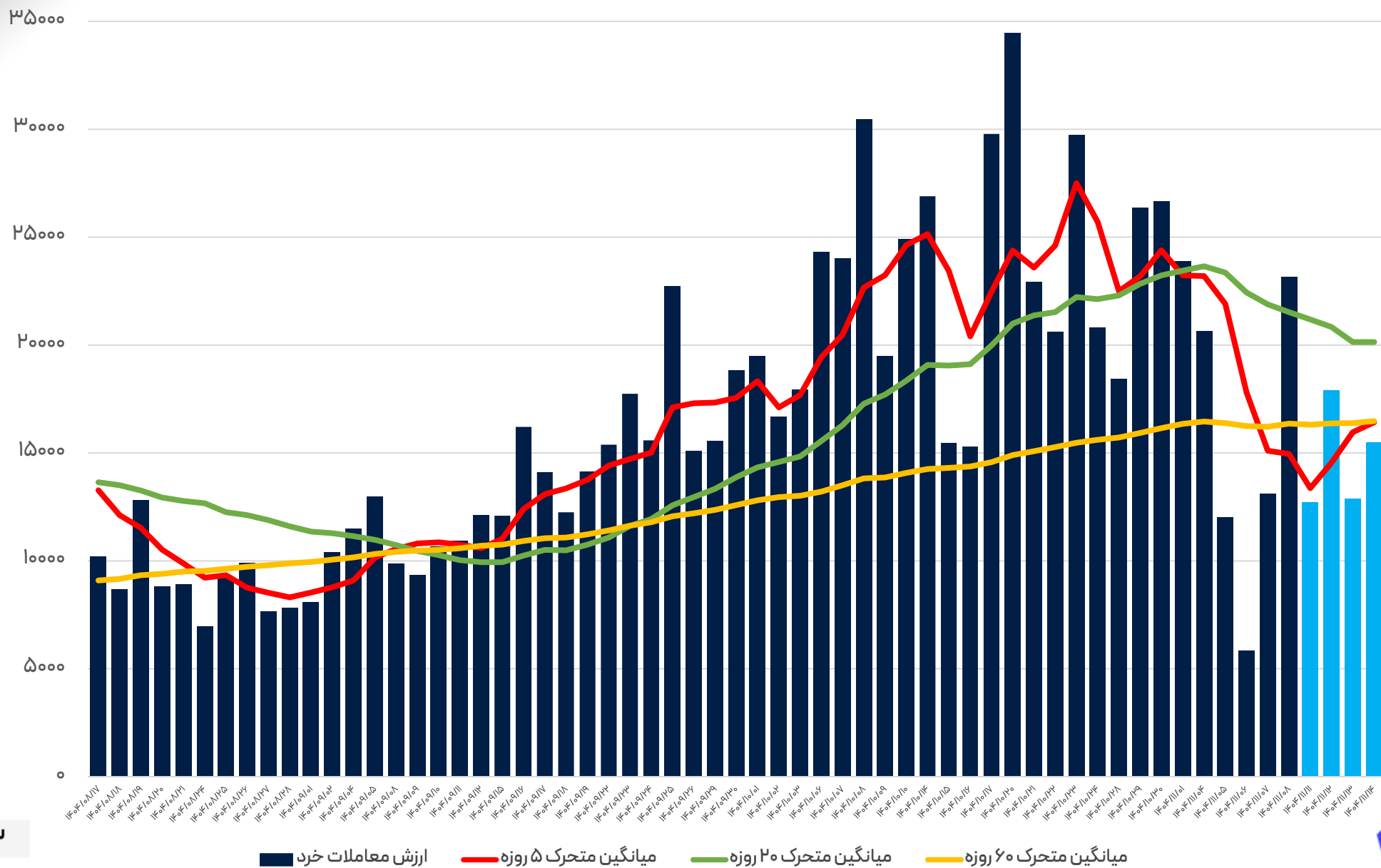
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هموزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هموزن نسبت به شاخص کل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

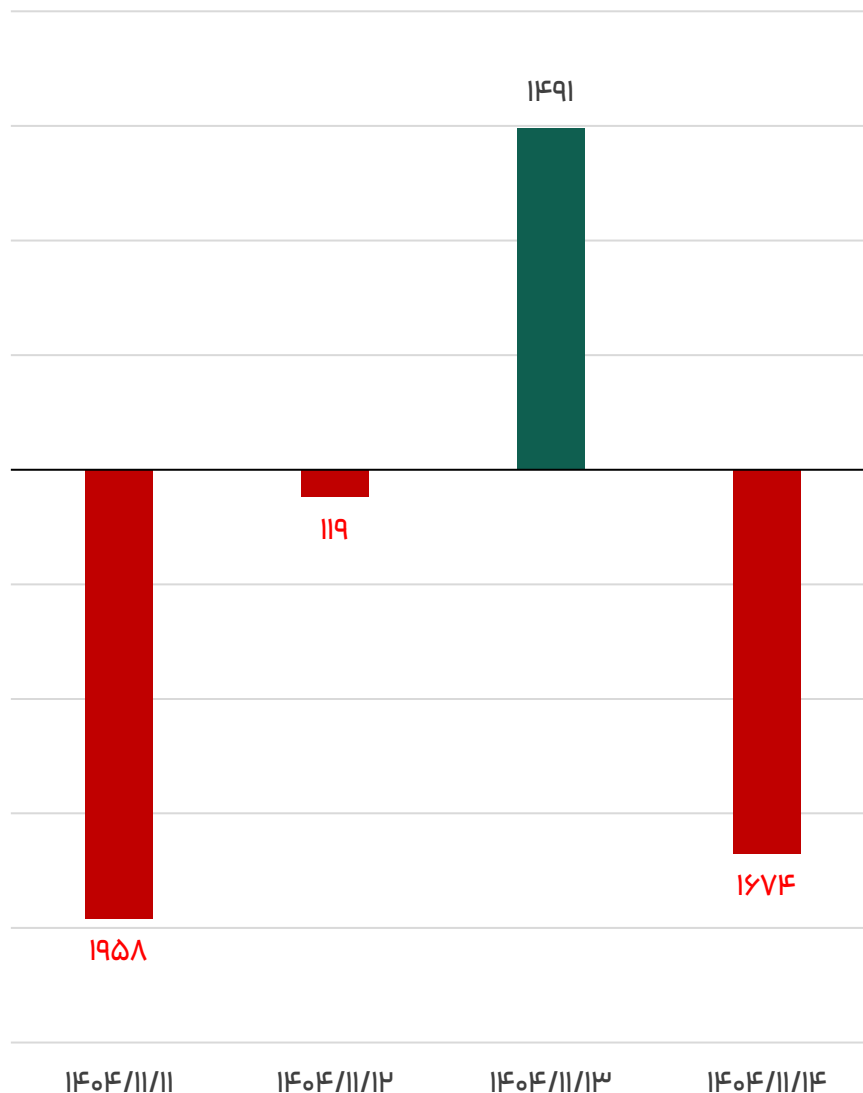


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

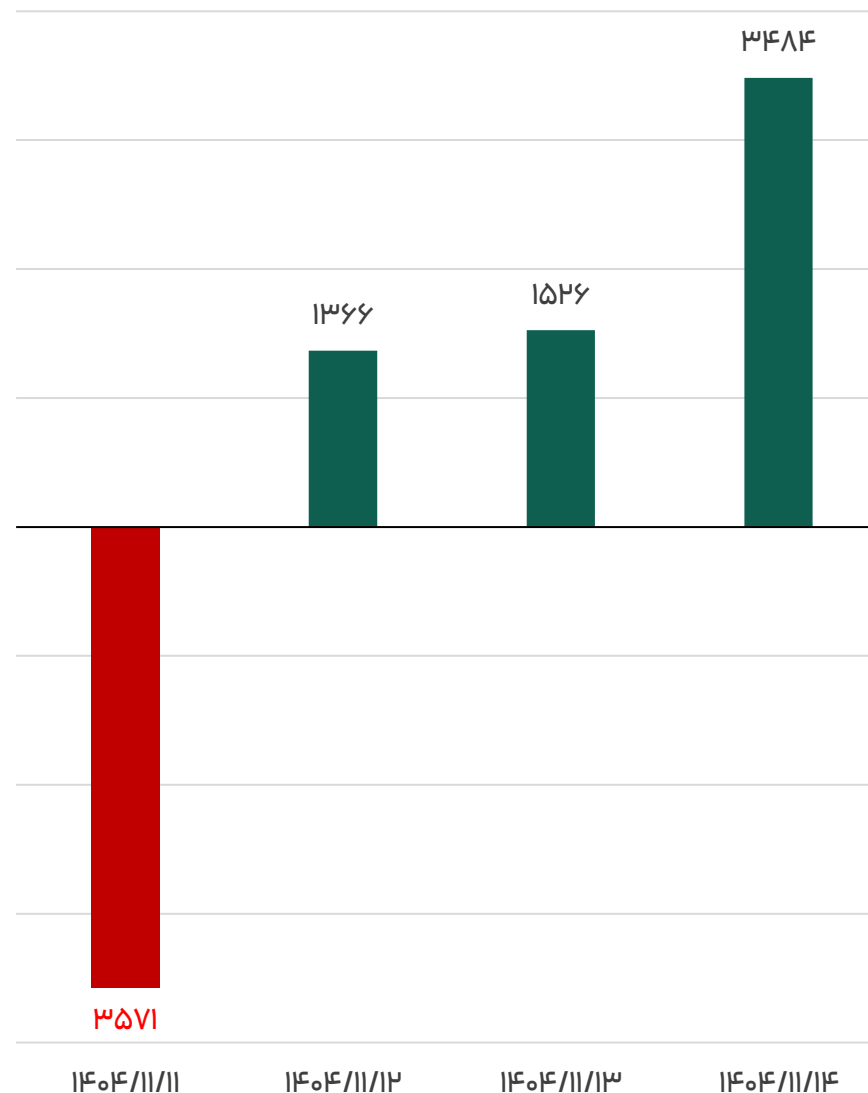


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

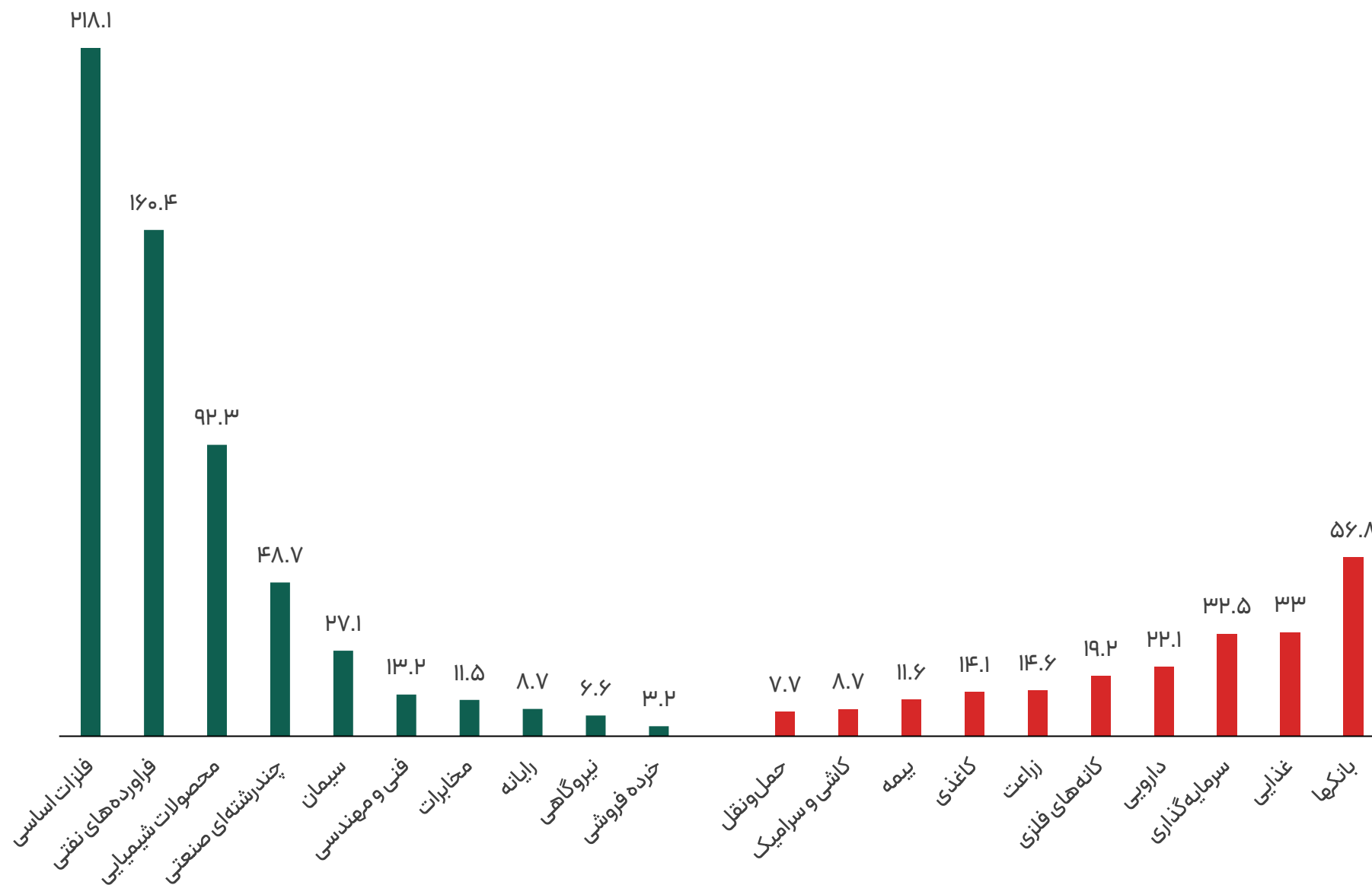
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



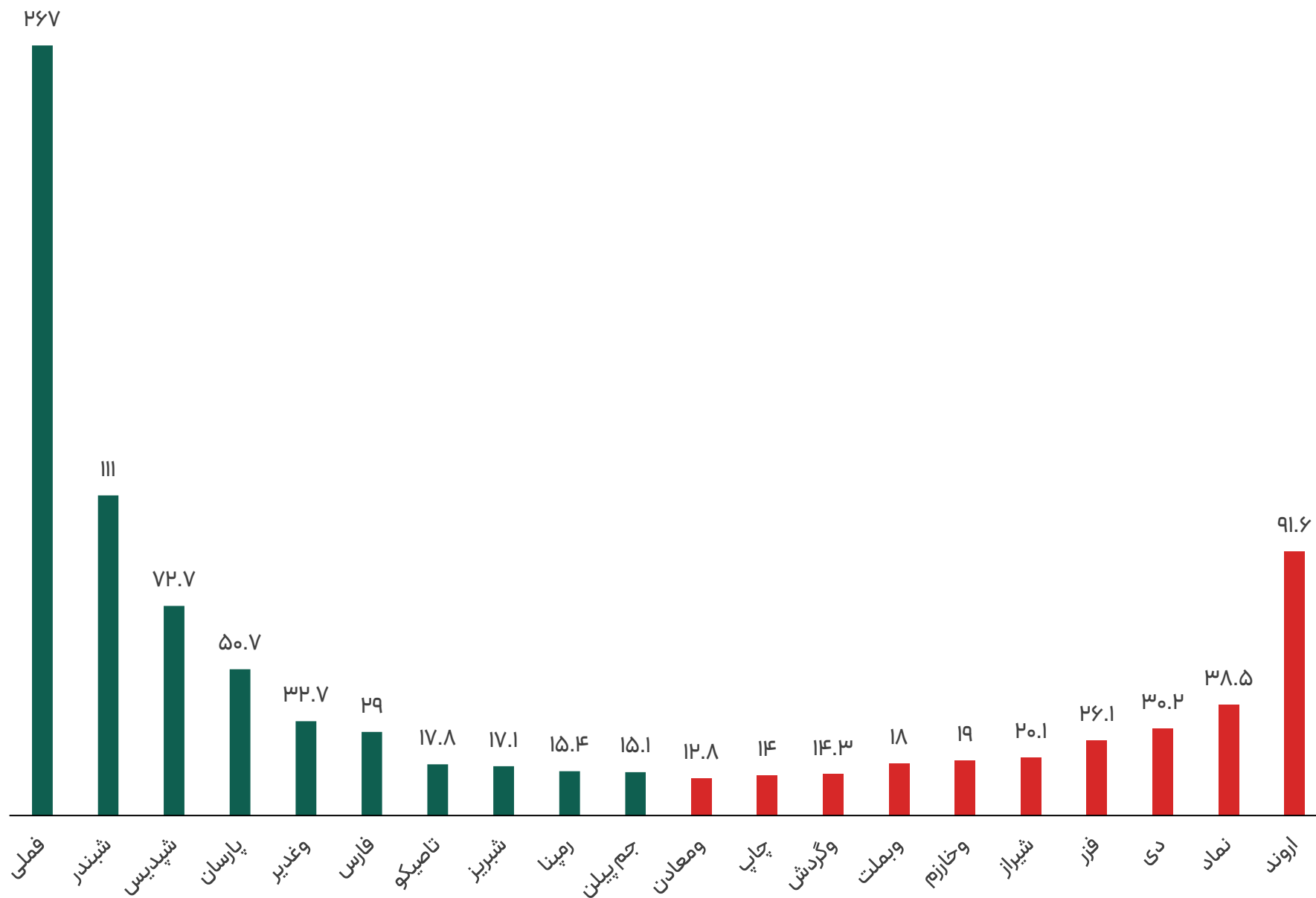
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



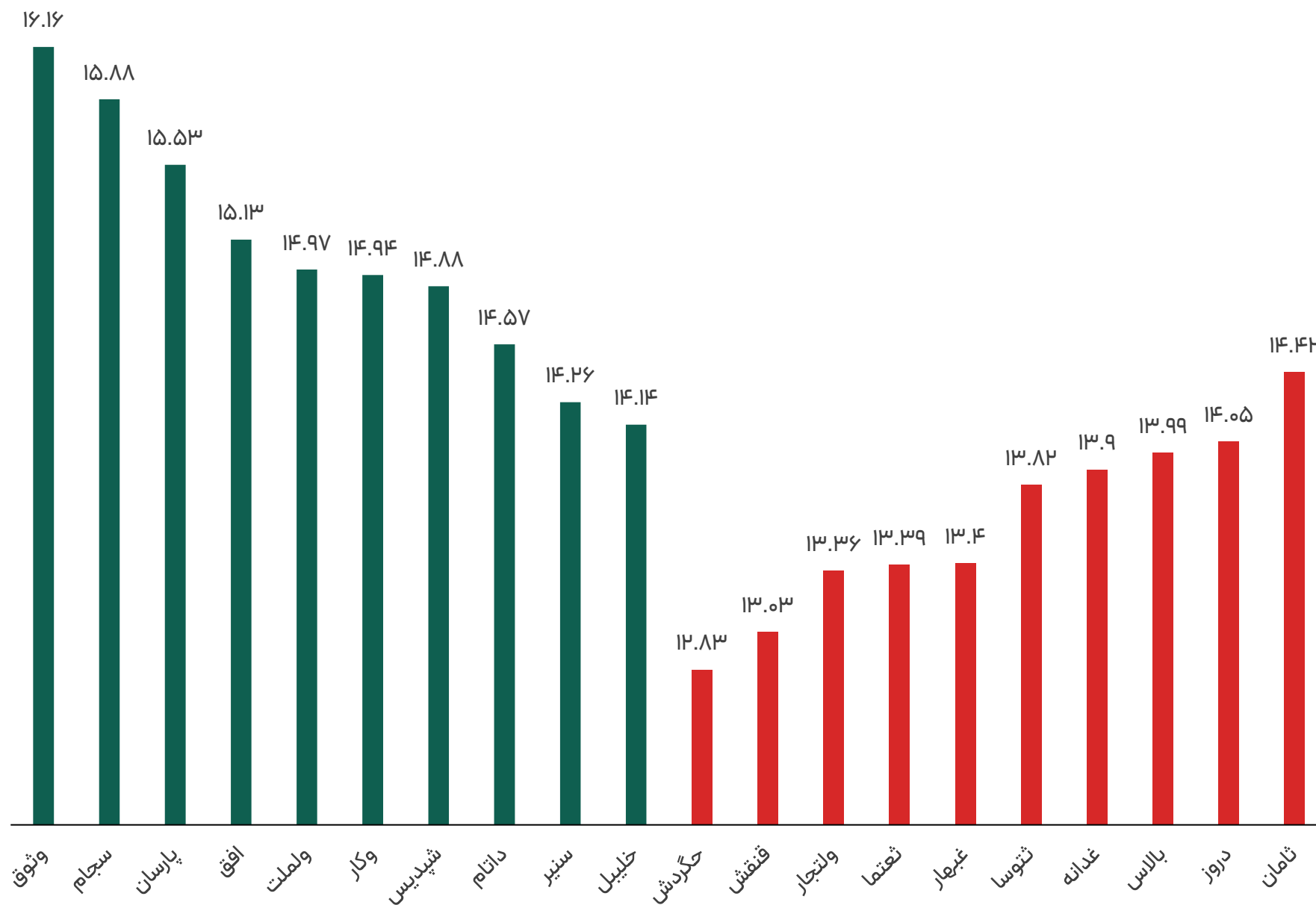
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



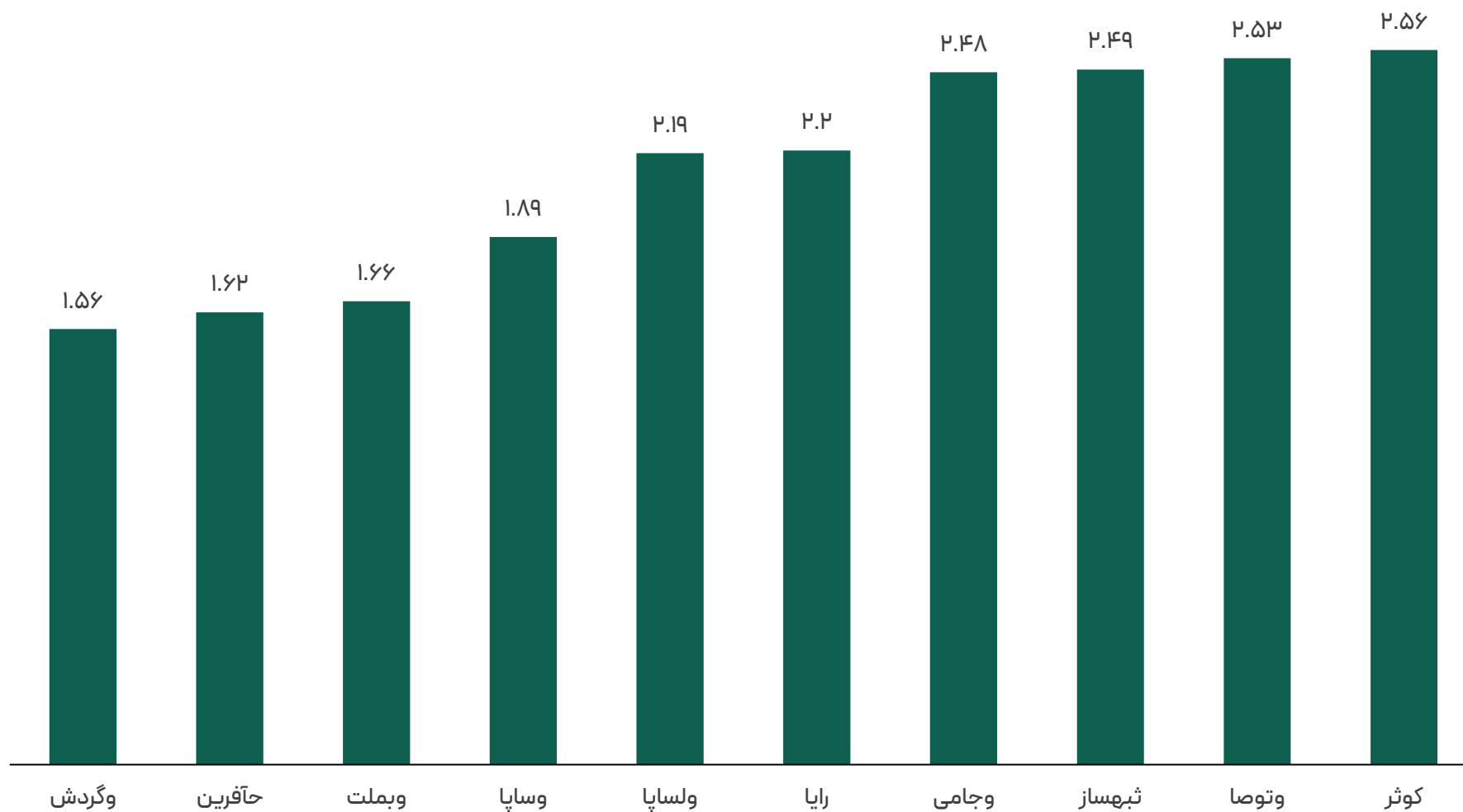
بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)



دسته‌بندی شده بر اساس صنایع | اندازه سلول بر اساس میانگین ارزش معاملات هفته اخیر | رنگ سلول بر اساس بازده هفتگی نمودار

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	-۴.۹	-۲.۹۹	-۲.۴۶	۱.۷۳	۰.۹۱	۱.۵۷	۱.۶۵	-۵.۶	۵۱.۶۳	۵۷.۲۶
 دوایکس	-۵.۵۸	۴.۵۹	-۱.۲۸	۱.۹۲	۰.۹۹	۱.۹	۲.۰۱	۱.۹۷	۶۳.۹۵	۴۰
 موج	-۱۰.۷۱	-۸.۶۳	-۶.۳۷	۱.۵۸	۰.۹۹	۱.۵۶	۱.۷۳	-۶.۲۸	۵۱.۹۵	۷۲.۶۴
 توان	-۱۱.۷۹	۲۵.۰۷	۱۴.۲۶	۱.۸	۰.۹۴	۱.۶۹	۱.۸۹	-۱۲.۱	۵۰.۳	۳۹.۸۳
 نارنج اهرم	-۱۳.۰۹	-۷.۶۹	-۶.۷۸	۱.۹	۰.۹۸	۱.۸۶	۲.۱	-۱۲.۰۷	۵۱.۳۹	۸۹.۵۹
 اهرم	-۱۵.۴	-۱۱.۹۳	-۹.۰۴	۱.۶۵	۰.۹۳	۱.۵۳	۱.۷۷	-۱۲.۷۸	۳۳.۶۷	۲۹.۸۴
 شتاب	-۱۷.۴۷	-۱۴.۵۷	-۱۲.۱۴	۱.۸	۰.۸۷	۱.۵۷	۱.۸۴	-۱۱.۳۱	۴۳.۴۸	۴۷.۵۷
 بیدار	-۱۷.۶	-۱۶.۰۷	-۱۳.۰۹	۱.۸۱	۰.۸۵	۱.۵۴	۱.۸۱	-۶.۲۱	۵۷.۹۹	۶۷.۹۴
 جهش	-۱۷.۹۷	-۱۳.۴۷	-۱۱.۷۵	۱.۹۲	۰.۹۴	۱.۸	۲.۱۲	-۱۴.۶۶	۵۱.۸۳	۴۰.۳۲

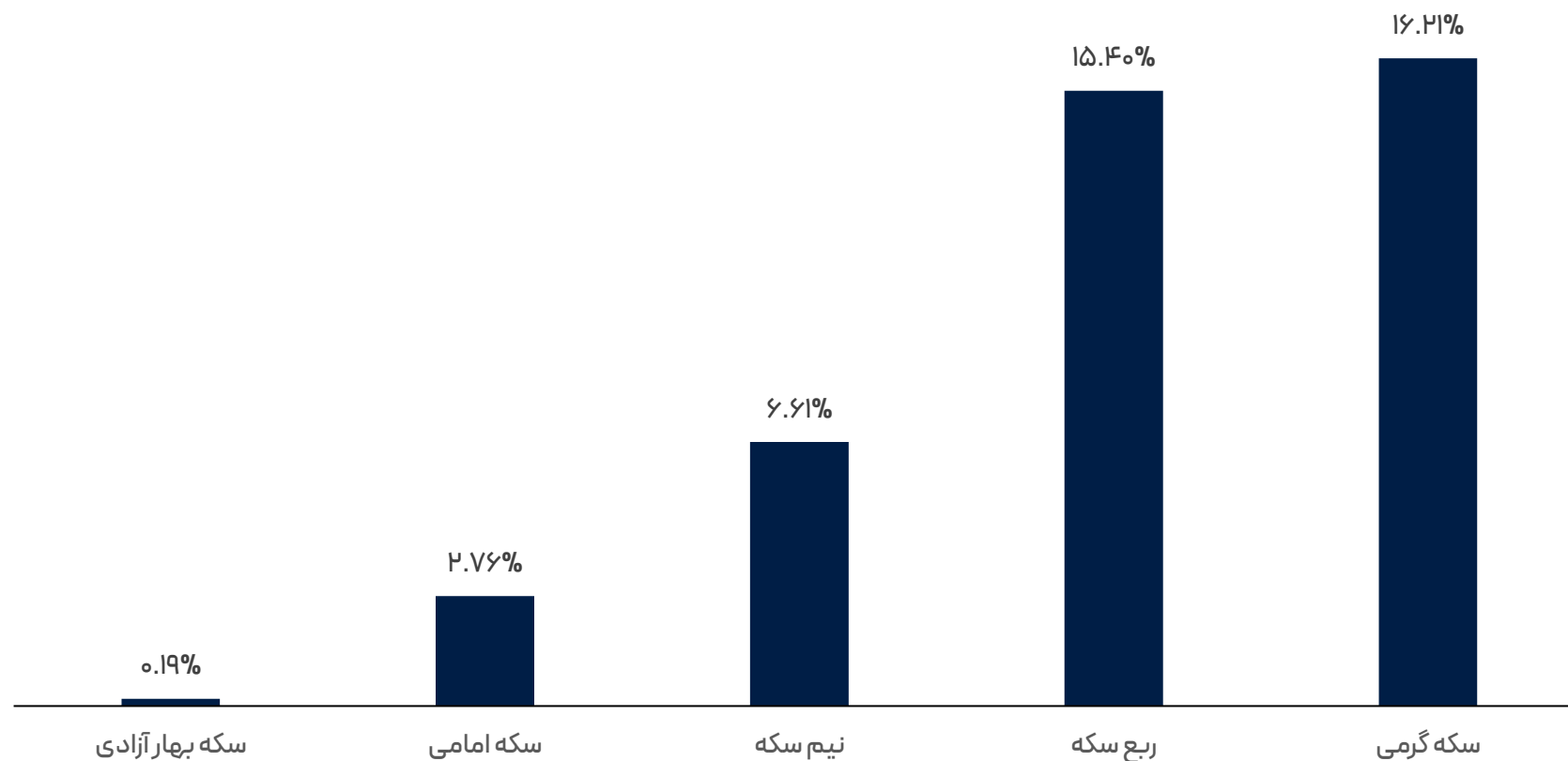


گزارش صندوق‌های طلا

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حباب
تمام سکه طرح جدید ۴۱۱ آئنده	۱,۸۴۷,۴۷۷	۴.۹۶	۰.۹۱
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ رفاه	۱,۳۹۳,۹۲۰	-۱.۱۴	-۲۳.۸۷
تمام سکه طرح جدید ۴۱۲ سامان	۱,۸۸۲,۹۰۰	۰.۹۴	۲.۷۹
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۵,۲۵۰,۰۰۰	۲.۳۷	۱.۳۶
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۸۶۰,۰۰۰,۰۰۰	۰.۲۱	۱.۵۹
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۲۳,۸۰۰,۱۰۰	-۰.۹	-۴.۳۷



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
 انار	۲.۵۷	۹.۱۹	۲۷.۴۵	۱۴.۲۶	۲۸.۳۹	-۰.۱۵	-۱.۹	-۱.۰۸
 عرش	۱.۷۹	۳۵.۷۱	۵۹.۸۷	۰.۳۷	۰.۷۵	۴.۰۸	-۰.۲	-۰.۸۸
 صدف	۱.۲۲	۳۴.۳۴	۷۰.۵۱	۰.۹۳	۰.۶۶	۰.۲۴	-۰.۸۹	۰.۲۳
 سپینود	۰.۸۱	۳۰.۵۱	۴۶.۶۱	۰.۲۲	۰.۱۷	۰.۴۳	-۲.۳۱	-۲.۴۳
 خلیج	۰.۷۵	۳۷	۵۹.۴۶	۲.۱۷	۱.۳۵	۳.۰۶	۱.۳۲	۰.۶۱
 ارزش	۰.۶۹	۳۰.۰۸	۳۹.۵۲	۱۹.۸۸	۱۶.۱۹	-۲.۶۴	-۱.۷۹	-۱.۵۳
 مانا	۰.۴۸	۳۵.۲۱	-۸۵.۸۹	۰.۳۹	۹.۱۶	۱.۷۴	۰.۰۴	-۰.۲۷
 هومان	۰.۳۸	۲۹.۱۴	۵۵.۳۸	۰.۵۴	۰.۵۵	۱.۷۵	۰.۶۲	۰.۱۴
 سلام	۰.۱۷	۳۳.۵۴	۴۳.۹	۱۸.۸۲	۱۹.۲۳	۰.۱۱	-۰.۳۲	۰.۱۱

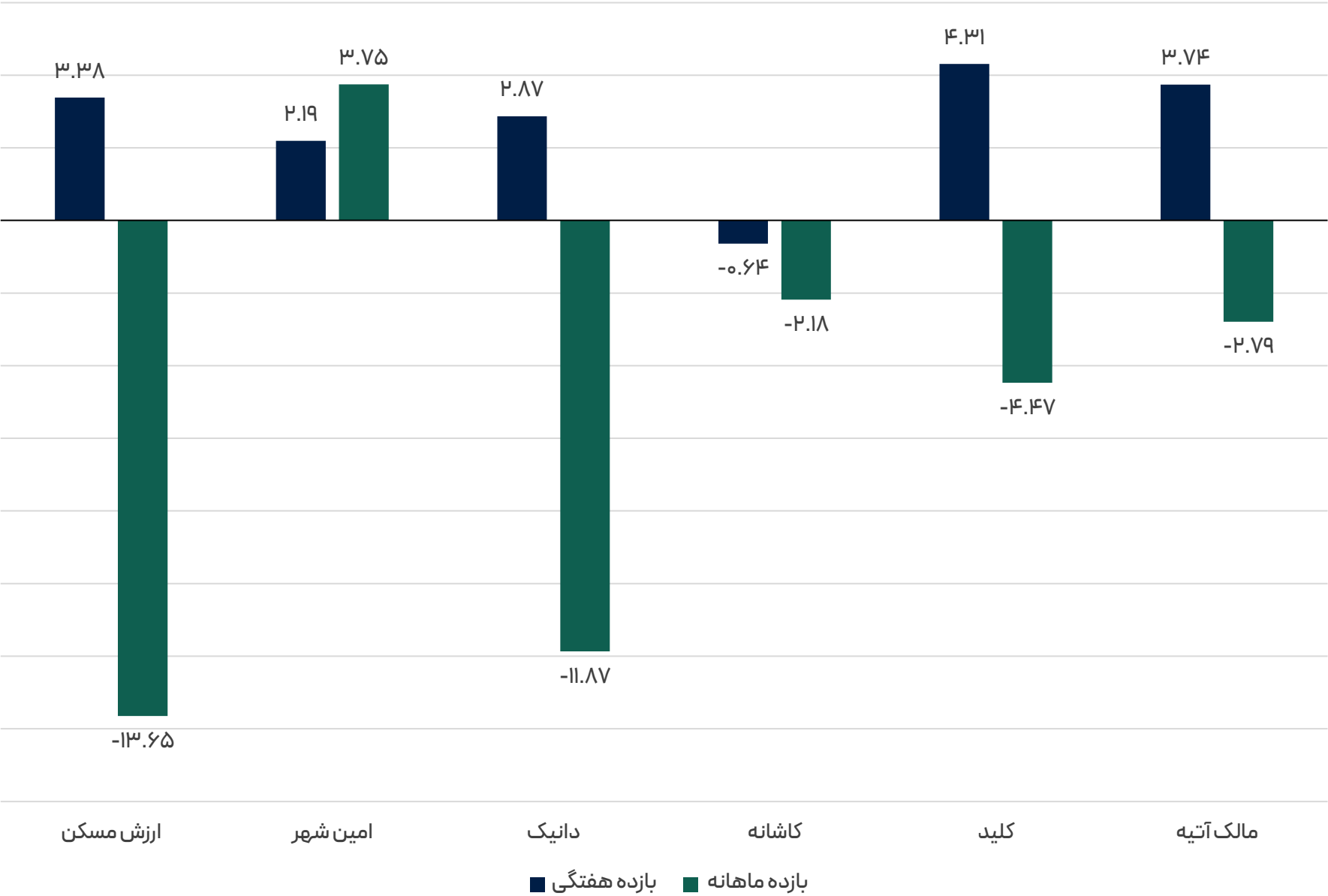


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حباب	میانگین حباب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	یک ماهه	سه ماهه
 پتروپاداش	۴.۸۳	۳۸.۰۱	۵۴.۶۹	۹.۴۱	۷.۳۴	-۰.۲۶	
 پتروفارس	۳.۳	۳۹.۸۷	۶۰.۷۹	۱۰.۲۶	۴.۹۱	-۰.۷۵	-۰.۳۳
 مزه	۳.۲۵	۲۷.۳۵	۳۹.۷	۸.۲۸	۶.۴	-۰.۷۳	۰.۲۳
 سورنافود	۲.۸۸	۲۲.۶۶	۵۶.۲۲	۳.۱۲	۳.۳	۱.۹۷	-۰.۲۱
 فرا الگوریتم	۲.۶۶	۲۴.۵۹	۶۱.۱	۱.۳۷	۳.۶۶	-۰.۳۲	-۰.۲۱
 اگدان	۰.۷۴	۳۹.۳۵	۵۰.۰۷	۲۶.۱۲	۱۵.۶۷	-۰.۸۱	-۰.۳۵
 پتروما	۰.۶۳	۳۲.۹۵	۲۸.۶۷	۶.۷۸	۲.۶۸	۰.۸	-۰.۶۶
 پتروفاود	-۱.۲۲	۳۰.۷۷	۵۰.۴۵	۱.۵۸	۱.۶۴	-۰.۲۸	۰.۹۸
 پتروفاود	-۱.۴۹	۴۴.۵۴	۸۳.۵۷	۲.۸۱	۶.۴	۰.۲۶	



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)

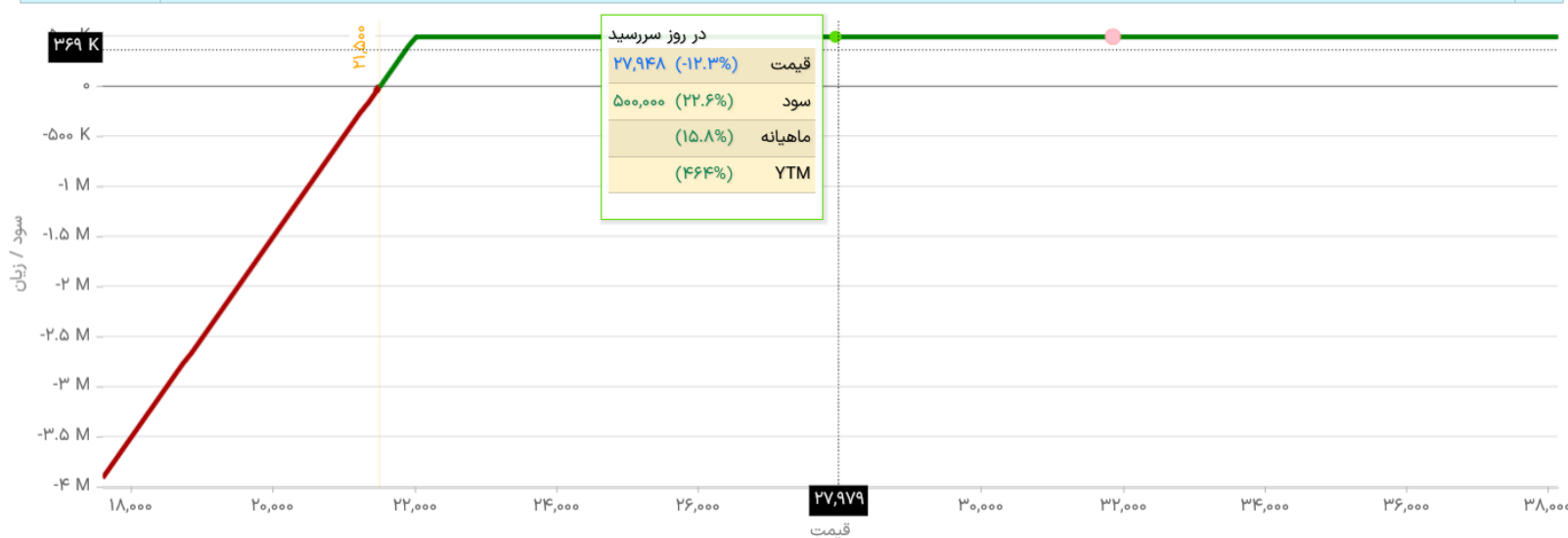


گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

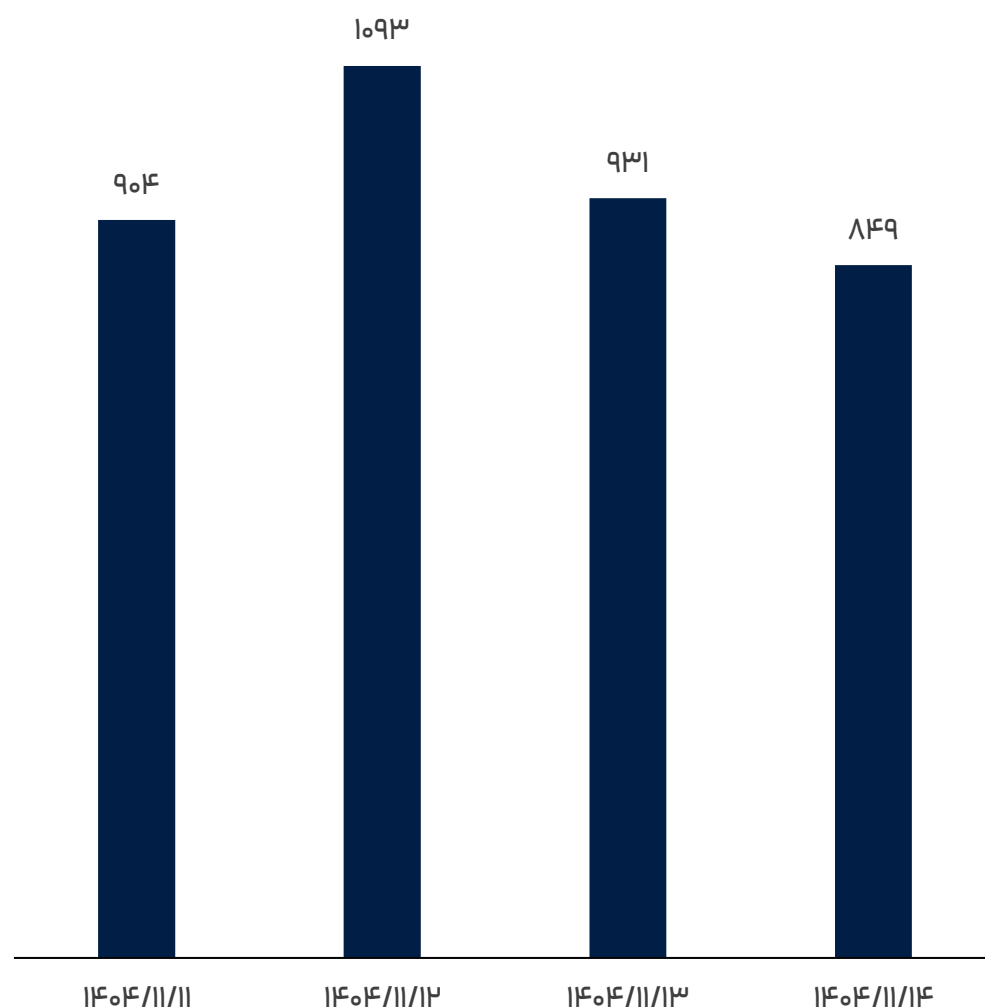
مروری بر استراتژی استرانگل فروش (Short Strangle) با قراردادهای اختیار فروش برج ۱۲ صندوق اهرم (پیشنهاد شده در بولتن هفتگی منتهی به ۱۰ بهمن) این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش و اختیار خرید (هر دو در زیان) با نمادهای ضرهم ۱۲۶ و طهرم ۱۲۵ انجام می‌شد. چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم بین ۲,۰۶۸ و ۵,۱۳۲ تومان باقی بماند، استراتژی در سود به میزان ۲۴.۷ درصد، (۱۷.۲ درصد ماهانه) بسته خواهد شد. با این وجود گفته شد که 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) - قیمت امروز اهرم حوالی ۳,۴۰۰ تومان (تمامی استراتژی‌ها در سود)

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	۰	-۳,۱۴۰,۰۰۰
فروش	طهرم ۱۲۵	اختیار فروذ	۱	۲۲,۰۰۰	۵۰۰	۰	۱۰۳	۲,۲۱۰,۰۰۰	۰	-۲,۲۱۰,۰۰۰
روز ۴۳										
+ ۱۷۹,۰۰۰ (-۸.۱%)										



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماهنامه	هفتگی	روزانه
۱۲۵۸ ضهرم ۲۷,۴۴۴ B	۱۲۵۸ ضهرم ۹,۲۱۹.۱ B	۱۲۵۸ ضهرم ۹۰۸.۹ B
۱۱۲۶ ضهرم ۲۶,۵۹۳.۱ B	۱۲۵۶ ضهرم ۴,۹۱۸.۵ B	۱۲۵۶ ضهرم ۷۸۴.۵ B
۱۱۲۸ ضهرم ۱۰,۰۳۴ B	۱۲۵۷ ضهرم ۴,۱۴۹.۷ B	۱۲۵۵ ضهرم ۴۸۲ B
۱۲۵۶ ضهرم ۹,۲۰۴.۶ B	۱۲۵۵ ضهرم ۳,۴۰۵.۵ B	۱۲۵۷ ضهرم ۴۳۸.۱ B
۱۲۵۷ ضهرم ۹,۱۳۸ B	۱۲۴۲ ضستا ۲,۰۰۰.۵ B	۱۲۴۲ ضستا ۲۸۱.۹ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهنامه	هفتگی	روزانه
۱۱۲۶ طهرم ۱۰,۰۵۴.۸ B	۱۲۵۶ طهرم ۳,۷۵۹.۱ B	۱۲۵۶ طهرم ۶۱۴.۶ B
۱۲۵۸ طهرم ۶,۲۱۴.۱ B	۱۲۵۵ طهرم ۱,۴۷۳.۱ B	۱۲۵۷ طهرم ۲۵۷.۹ B
۱۲۵۶ طهرم ۶,۰۵۹.۸ B	۱۲۵۷ طهرم ۱,۲۵۴.۸ B	۱۲۵۵ طهرم ۱۶۸.۵ B
۱۲۵۷ طهرم ۴,۴۸۹.۵ B	۱۲۵۸ طهرم ۸۲۵.۷ B	۱۲۴۲ طستا ۱۴۰ B
۱۱۲۸ طهرم ۴,۰۸۳.۵ B	۱۲۴۲ طستا ۵۴۹.۴ B	۱۲۵۸ طهرم ۱۳۹.۹ 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.

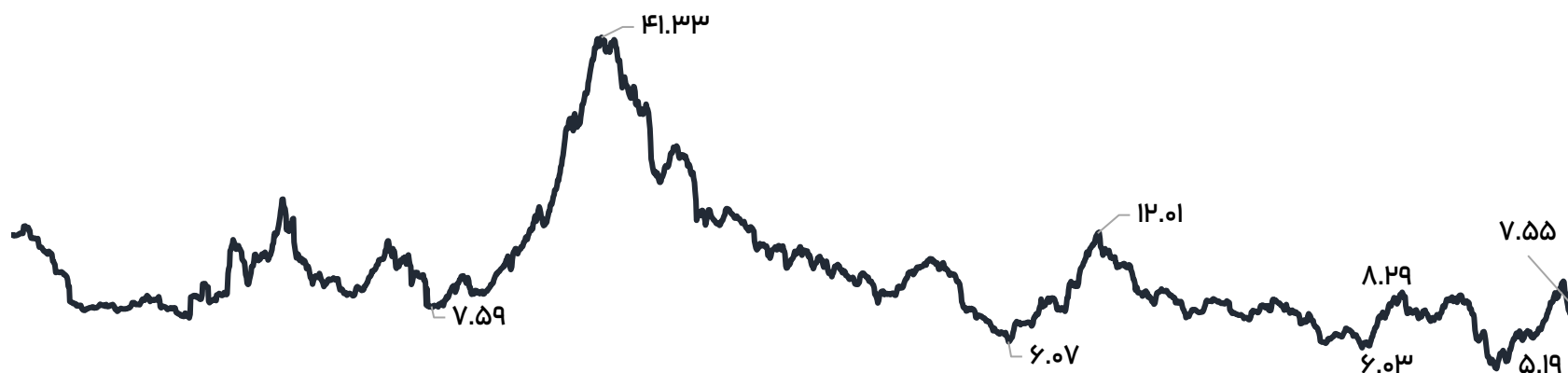
پس از اصلاحی که از سقف اردیبهشت ماه سال ۱۴۰۲ آغاز شد، شاخص کل بورس در آبان ماه سال گذشته، صعود خوبی را آغاز کرد که در شاخص کل به بیش از ۶۵ درصد رشد رسید و در اردیبهشت ماه سال جاری، سقف جدیدی در تاریخچه ی شاخص کل، به ثبت رسید. پس از آن، روند اصلاحی آغاز شد که در تابستان با شکل گیری جنگ ۱۲ روزه بین ایران 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 نسبت ۱۲۷.۲ فیبوناچی سه نقطه ای در شاخص کل رسید. 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 صلاحی کوتاه مدت بازار را تأیید شده دانست که همین اتفاق هم افتاد. در حال حاضر هم به نظر در بازگشت به میانگین متحرک شکسته شده، شاهد واکنش دوباره منفی هستیم و چنانچه کف اخیر به سمت پایین شکسته شود، اصلاح بازار به سمت محدوده های فیبوناچی مندرج بر روی چارت، تأیید خواهد شد. در غیر این صورت، با شکست میانگین متحرک به سمت بالا، باید منتظر مشاهده نوع رفتار بازار با سقف ۴ میلیون و ۵۵۰ هزار واحد باشیم.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

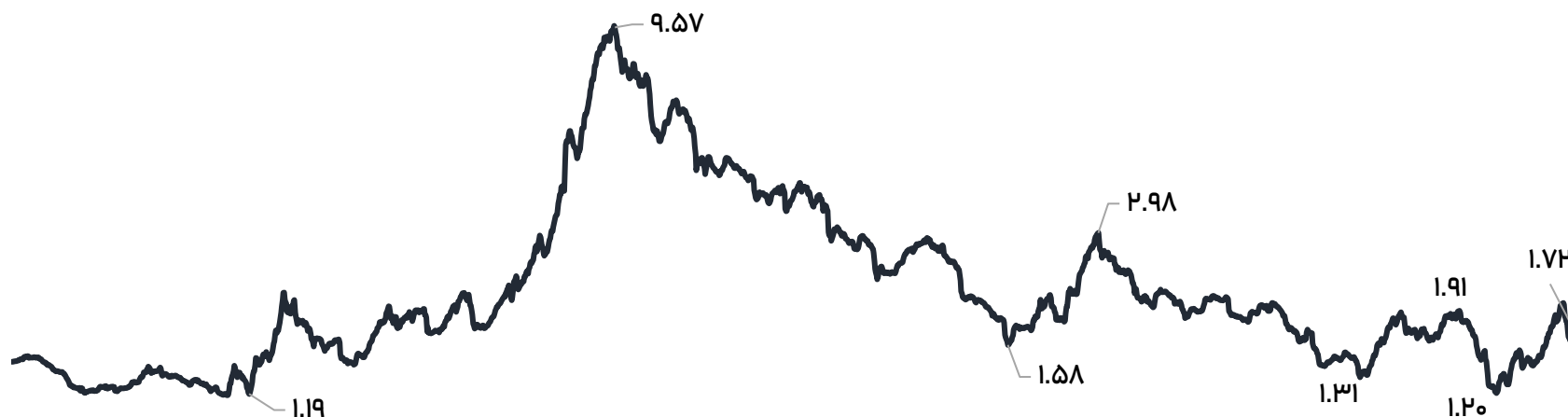
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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)





انس طلا دوباره به محدوده ۵ هزار دلار رسید.

پس از افت شدیدی که طلای جهانی طی دو روز تجربه کرد، در پایان هفته میلادی اخیر، شاهد بازگشت قیمت این فلز گرانبها به حوالی ۵ هزار دلار بودیم.



یکی از بزرگترین پتروشیمی‌ها عرضه اولیه می‌شود.

مدیرعامل شرکت بورس:
کارهای ابتدایی عرضه اولیه تاریخی یکی از بزرگترین پتروشیمی‌ها به ارزش ۱,۰۰۰ همتی انجام شده است.

مذاکرات ایران و آمریکا انجام شد. دور دوم به زودی...

عباس عراقچی، وزیر امور خارجه ایران گفت: سری دوم مذاکرات به زودی برگزار می‌شود. اگر جدیت طرف مقابل را ببینیم، ممکن است در تصمیم‌مان برای غیرمستقیم بودن تجدیدنظر کنیم.



شفن

پتروشیمی فناوران از محل سود انباشته ۷۴ درصد افزایش سرمایه می‌دهد.

خودرو، خسپا

لیدرهای گروه خودرویی، نمادهای خودرو و خسپا تا ۲۵ بهمن ماه تمدید تعلیق شدند.

پتایر

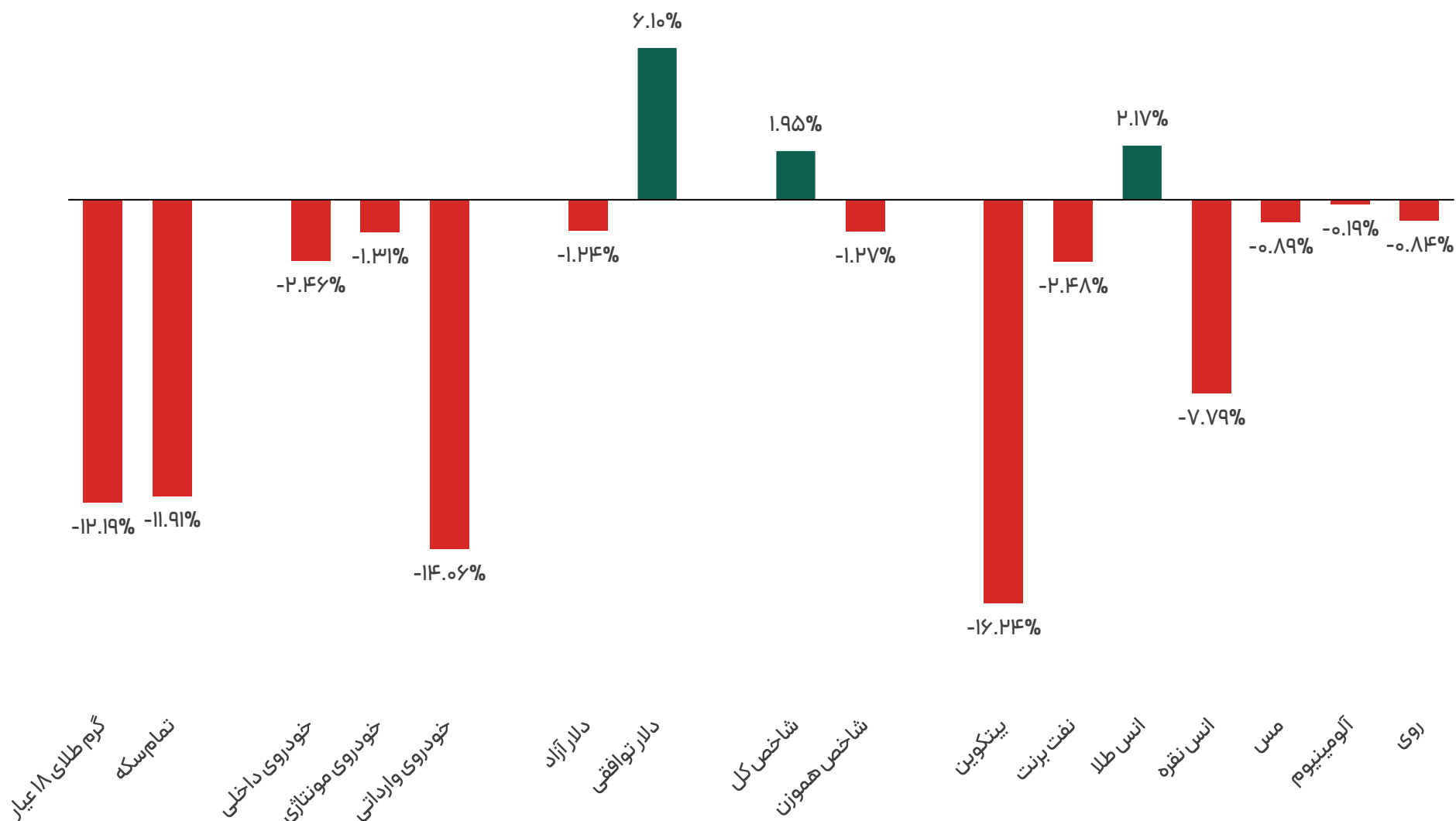
ایران تایر نرخ تایرهای بایاس و رادیال را ۱۵ درصد افزایش داد.



کرک اسپرد پالایشی‌ها

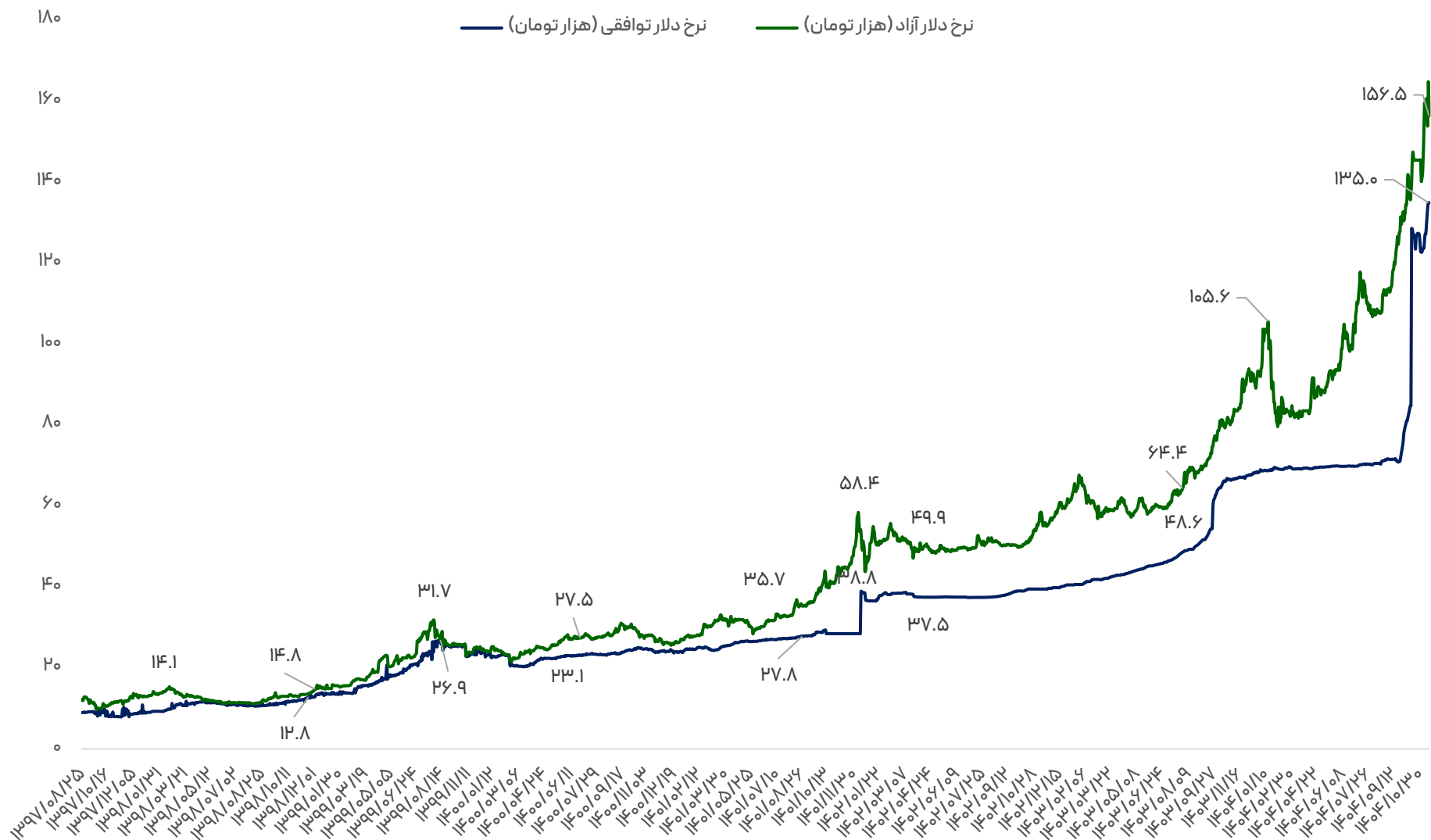


بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر



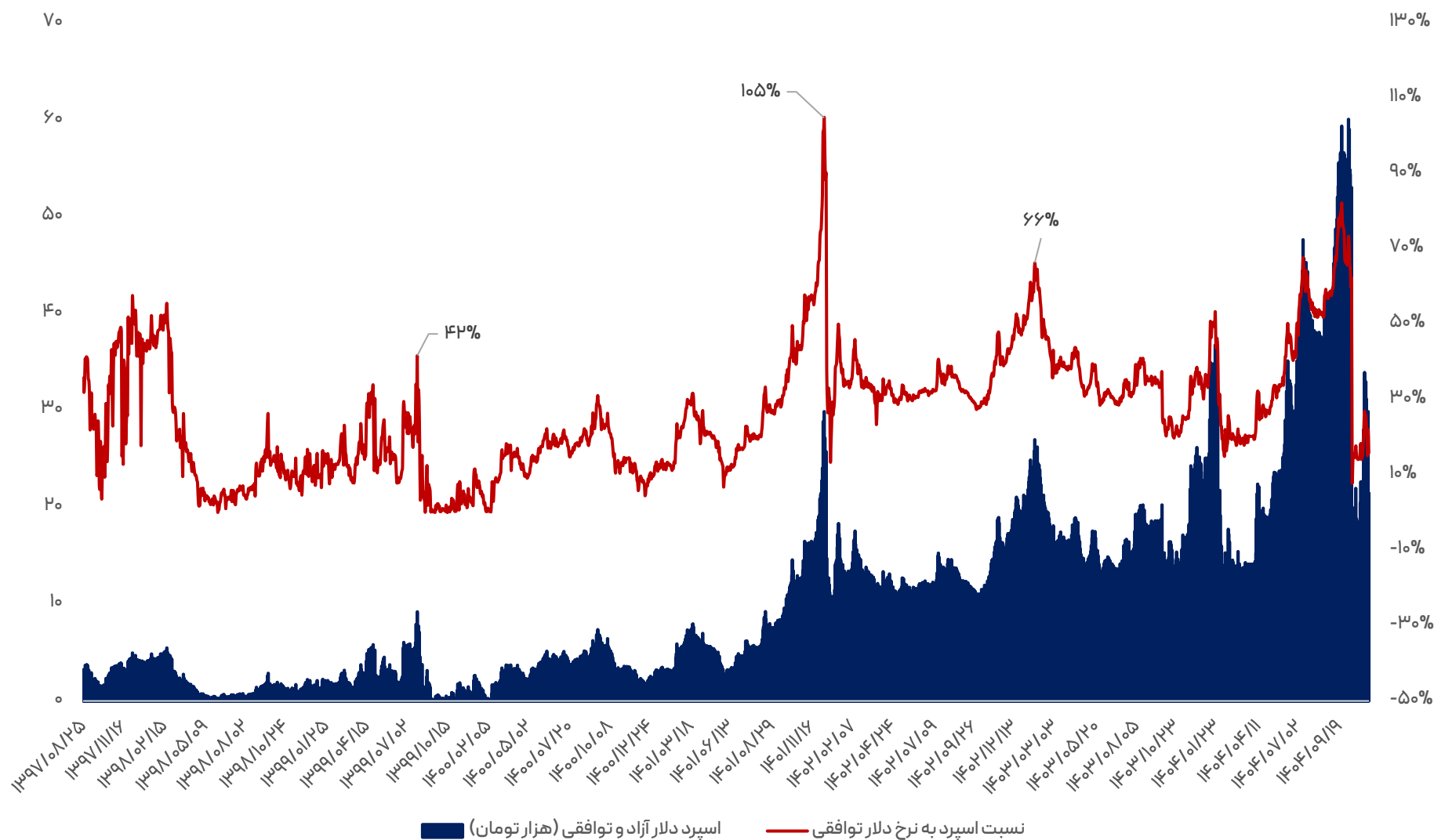
رند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۷۷,۶۱۶ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۱,۳۴۹,۹۷۳ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

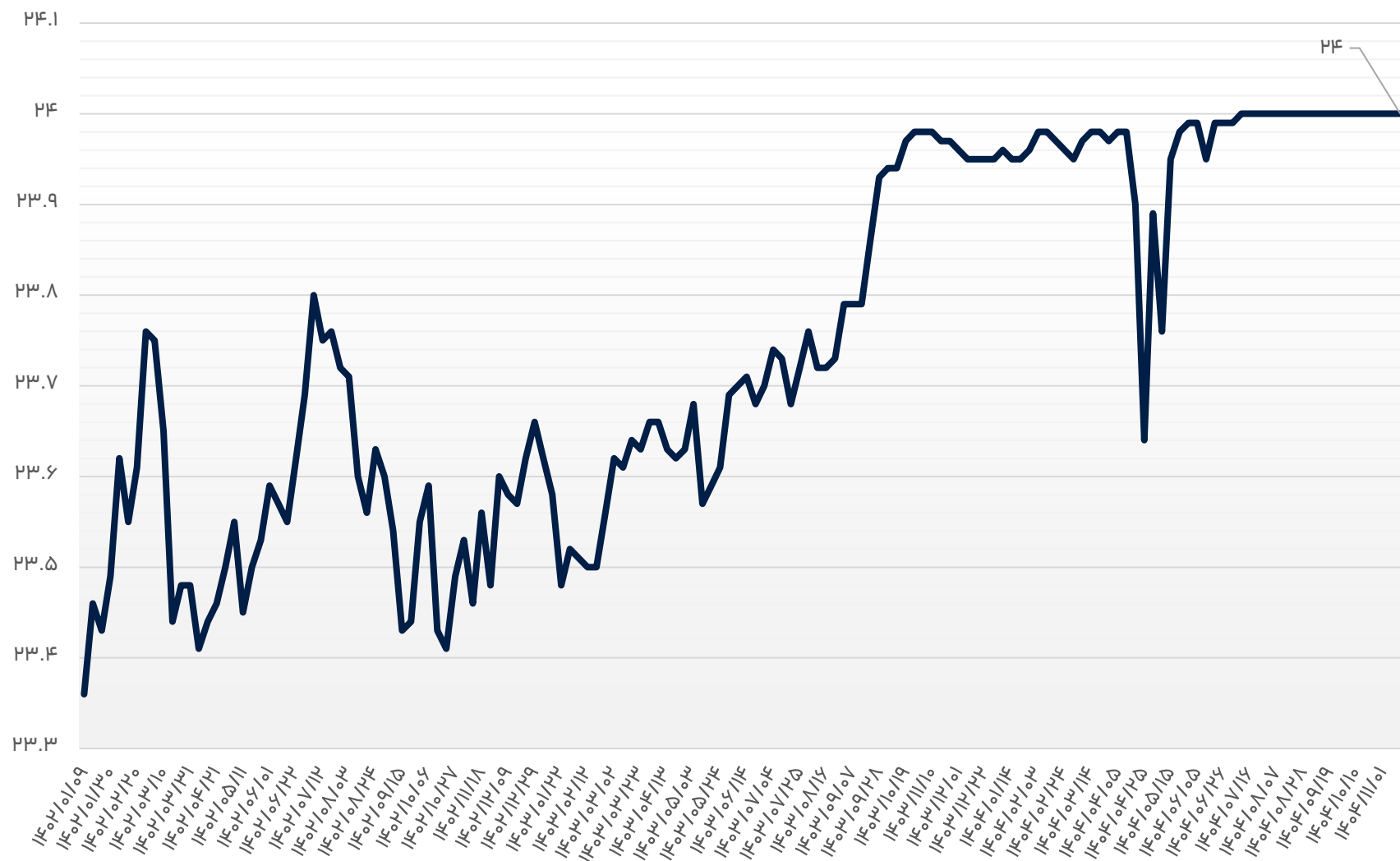
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



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 تولیدکننده بخش صنعت - پاییز ۱۴۰۴

شاخص قیمت کل

در فصل پاییز ۱۴۰۴، شاخص قیمت تولیدکننده بخش صنعت ۳۴۹.۸ بود که نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۱۱.۷ درصد افزایش، نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۵۰.۹ درصد افزایش و در چهار فصل منتهی به فصل جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل (تورم سالانه) ۴۴.۵ درصد افزایش داشته است.

افزایش تورم فصلی

در فصل پاییز ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش صنعت نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۱۱.۷ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۸.۲ درصد)، ۳.۵ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان محصولات صنعتی به ازای تولید کالاهای خود در داخل کشور، در فصل پاییز ۱۴۰۴ نسبت به فصل قبل، ۱۱.۷ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم فصلی با ۲۵.۶ درصد مربوط به گروه «ساخت مبلمان» و کم‌ترین تورم فصلی با ۱.۱ درصد افزایش مربوط به گروه «ساخت کُک و فراورده‌های حاصل از پالایش نفت» بوده است.



افزایش تورم نقطه به نقطه

در فصل پاییز ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش صنعت نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۵۰.۹ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۴۶.۵ درصد)، ۴.۴ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان محصولات صنعتی به ازای تولید کالاهای خود در داخل کشور، در فصل پاییز ۱۴۰۴ نسبت به فصل مشابه سال قبل، ۵۰.۹ درصد افزایش داشته است. در این فصل بیش‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۸۲.۶ درصد مربوط به گروه «ساخت کاغذ و محصولات کاغذی» و کم‌ترین تورم نقطه به نقطه با ۲۶.۵ درصد مربوط به گروه «ساخت وسایل نقلیه‌ی موتوری، تریلرو نیم تریلر» بوده است.

افزایش تورم سالانه

در فصل پاییز ۱۴۰۴، درصد تغییرات شاخص قیمت تولیدکننده بخش صنعت در چهار فصل منتهی به این فصل نسبت به دوره مشابه در سال قبل، ۴۴.۵ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۸.۳ درصد)، ۶.۲ واحد درصد افزایش داشته است. به عبارتی، میانگین قیمت دریافتی توسط تولیدکنندگان محصولات صنعتی به ازای تولید کالاهای خود در داخل کشور، در چهار فصل منتهی به فصل پاییز ۱۴۰۴ نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۴۴.۵ درصد افزایش دارد. در این فصل بیش‌ترین تورم سالانه با ۶۵.۸ درصد مربوط به گروه «ساخت انواع آشامیدنی‌ها» و کم‌ترین تورم سالانه با ۲۹.۴ درصد مربوط به گروه‌های «ساخت وسایل نقلیه‌ی موتوری، تریلرو نیم تریلر» و «ساخت سایر مصنوعات» بوده است.



با سپاس از توجه شما

