

بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۲۴ بهمن ماه ۱۴۰۴



هفته اخیر بازار سرمایه با برتری عرضه و افت شاخص‌ها همراه بود. روند بازار در این روزها به شرایط کلان سیاسی گره خورده و یک روز با گمانه‌زنی‌های مثبت نسبت به پیشرفت مذاکرات، رنگ سبز به خود می‌گیرد و روز دیگر با افزایش اخبار تنش‌زا، با برتری عرضه همراه می‌شود.

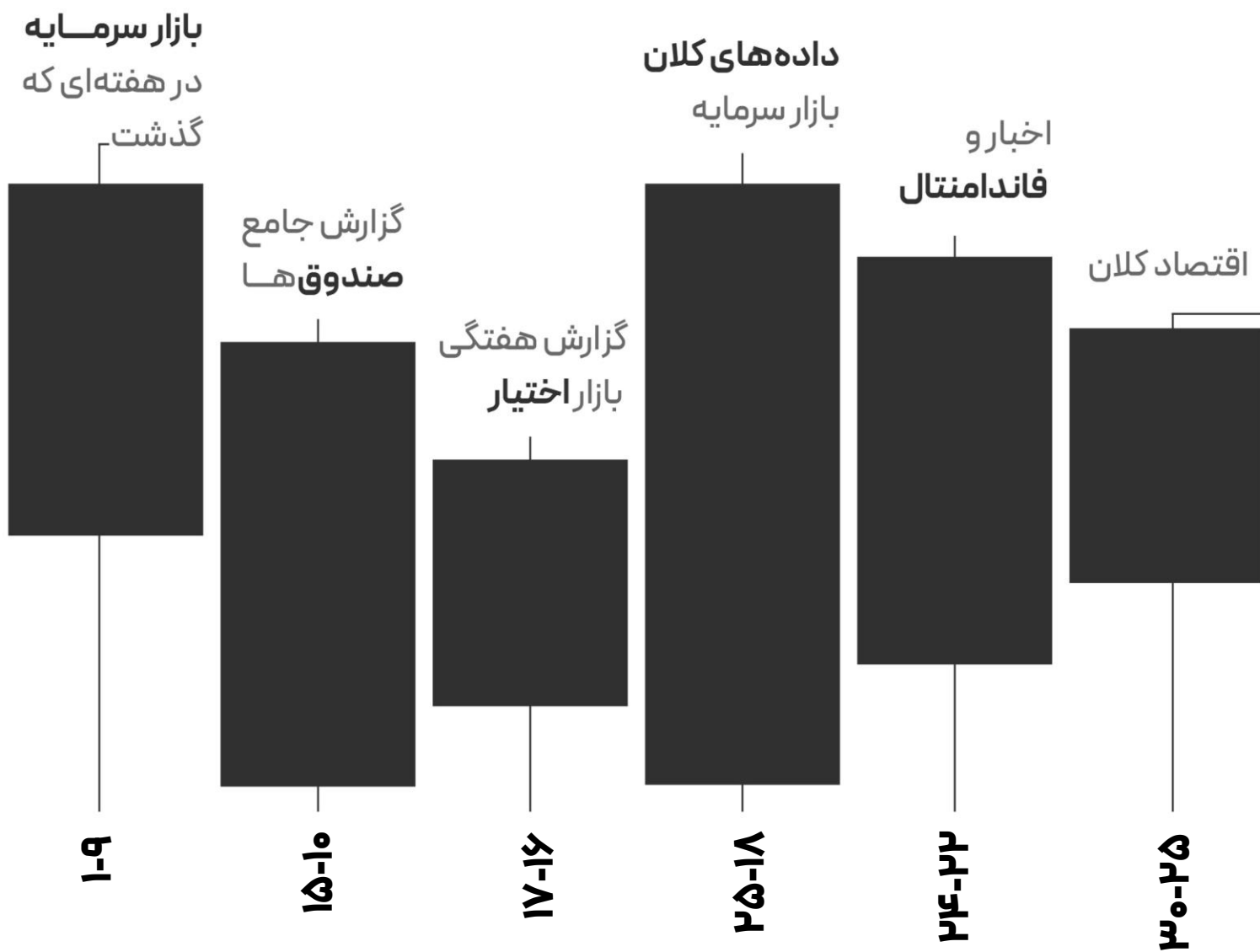
با این وجود اما، بیشتر فعالان بازار در مقطع فعلی ترجیح می‌دهند با حداقل ریسک در بازار فعالیت کنند و همین موضوع باعث شده است، دست بالا را فروشندگان و عرضه‌کنندگان بگیرند و روند کلی بازار اصلاحی و رکودی باشد.

مهم‌ترین پارامتر نقدینگی بازار، یعنی ارزش معاملات خرد، سیگنال اصلاحی را چند هفته‌ای است که صادر کرده و کراس نزولی بین میانگین‌های هفتگی و ماهانه رخ داده و روند اصلاحی کوتاه‌مدت بازار تایید شده است. در صورت کراس نزولی بین میانگین ماهانه و فصلی، روند اصلاحی برای میان‌مدت هم تایید خواهد شد که البته هنوز رخ نداده است.

دیگر پارامتر نقدینگی بازار، یعنی **تحركات حقیقی‌ها** نیز، روند اصلاحی بازار را تایید می‌کند. در نتیجه تا زمان برقراری دوباره تاییدیه‌های مثبت از سوی پارامترهای نقدینگی و همچنین مشخص‌تر شدن شرایط کلان، می‌توان گارد محتاطانه‌تری نسبت به صعود بازار داشت.

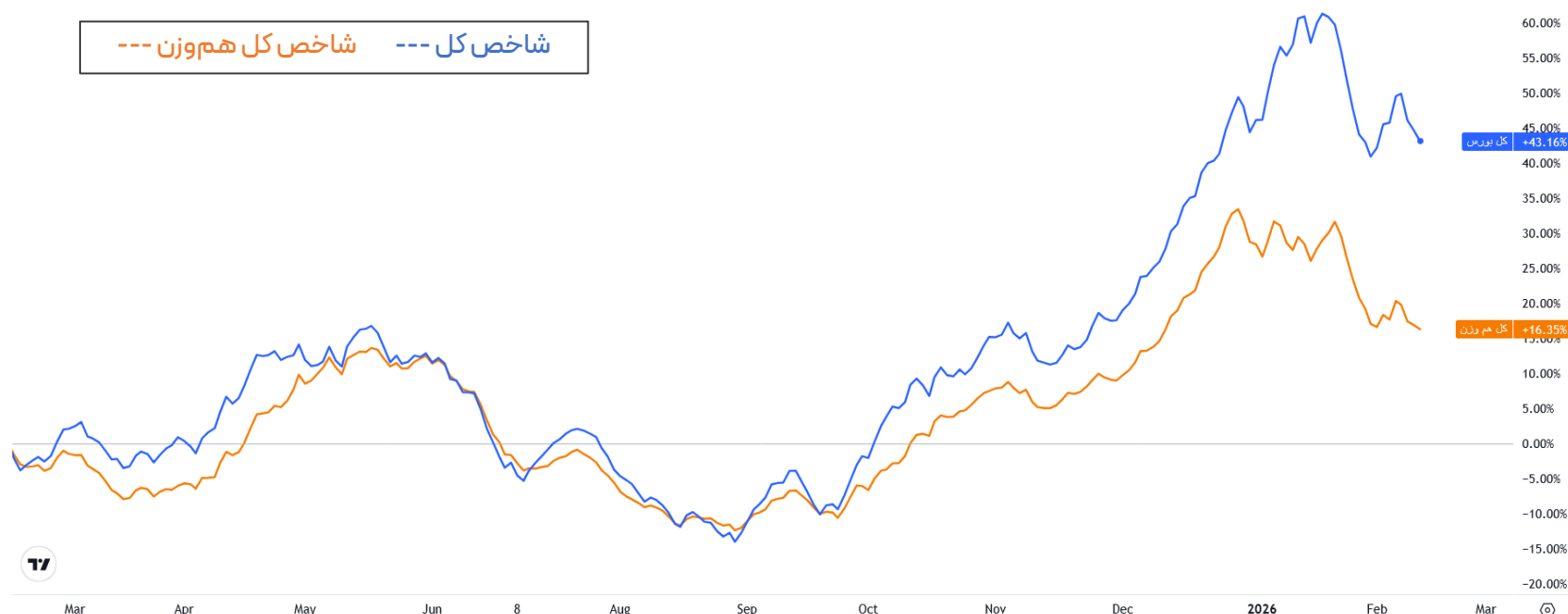
در هفته اخیر، برابند گردش نقدینگی حقیقی‌ها در معاملات خرد، ۱.۳ همت منفی بود و خروج پول حقیقی به ثبت رسید. در معاملات **صندوق‌های درآمد ثابت** بیش از ۱.۹ همت ورود پول حقیقی به ثبت رسید و در **صندوق‌های طلا** برابند گردش نقدینگی حقیقی‌ها خنثی بود.

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.



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.



۶۷

دوره زمانی	یک هفته	یک ماهه	سه ماهه	شش ماهه	یک ساله
بازده شاخص کل	-۱.۸۰ %	-۸.۹۲ %	+۲۶.۹۶ %	+۶۲.۴۱ %	+۴۳.۱۶ %
بازده شاخص کل هم وزن	-۱.۱۶ %	-۷.۷۲ %	+۹.۳۵ %	+۳۱.۷۰ %	+۱۶.۳۵ %



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)

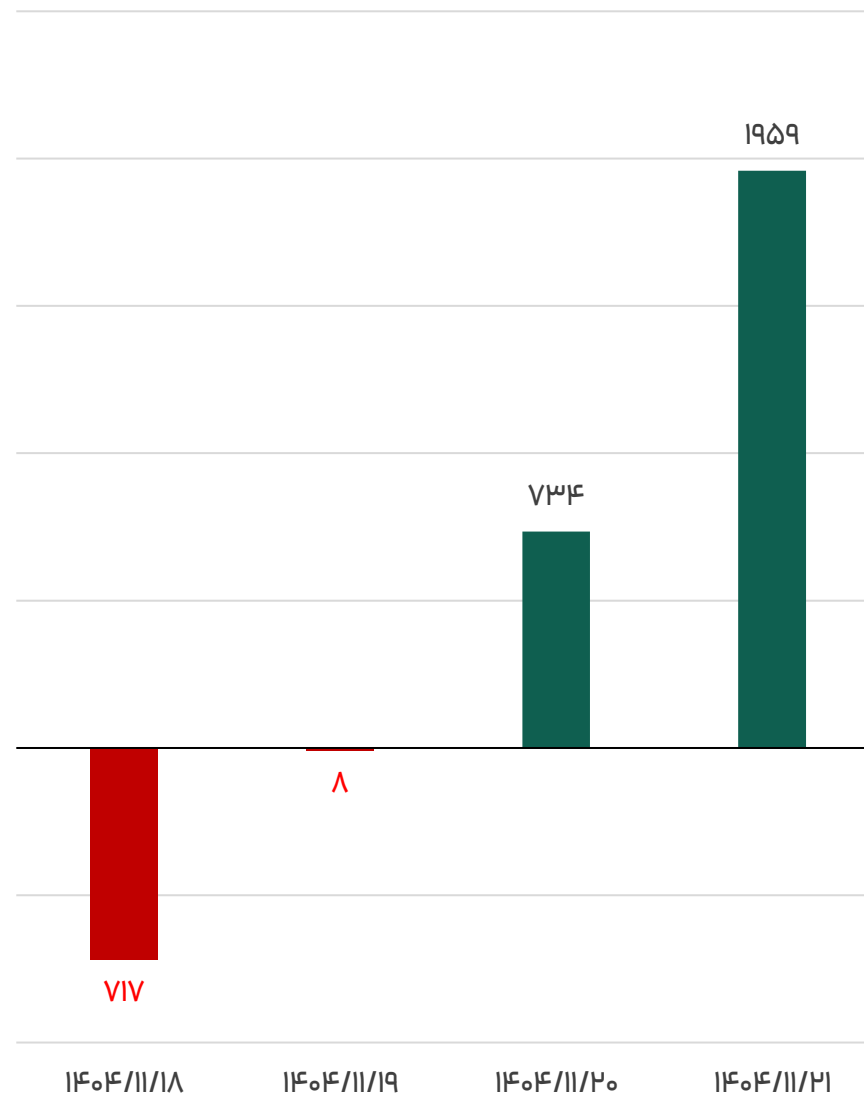


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

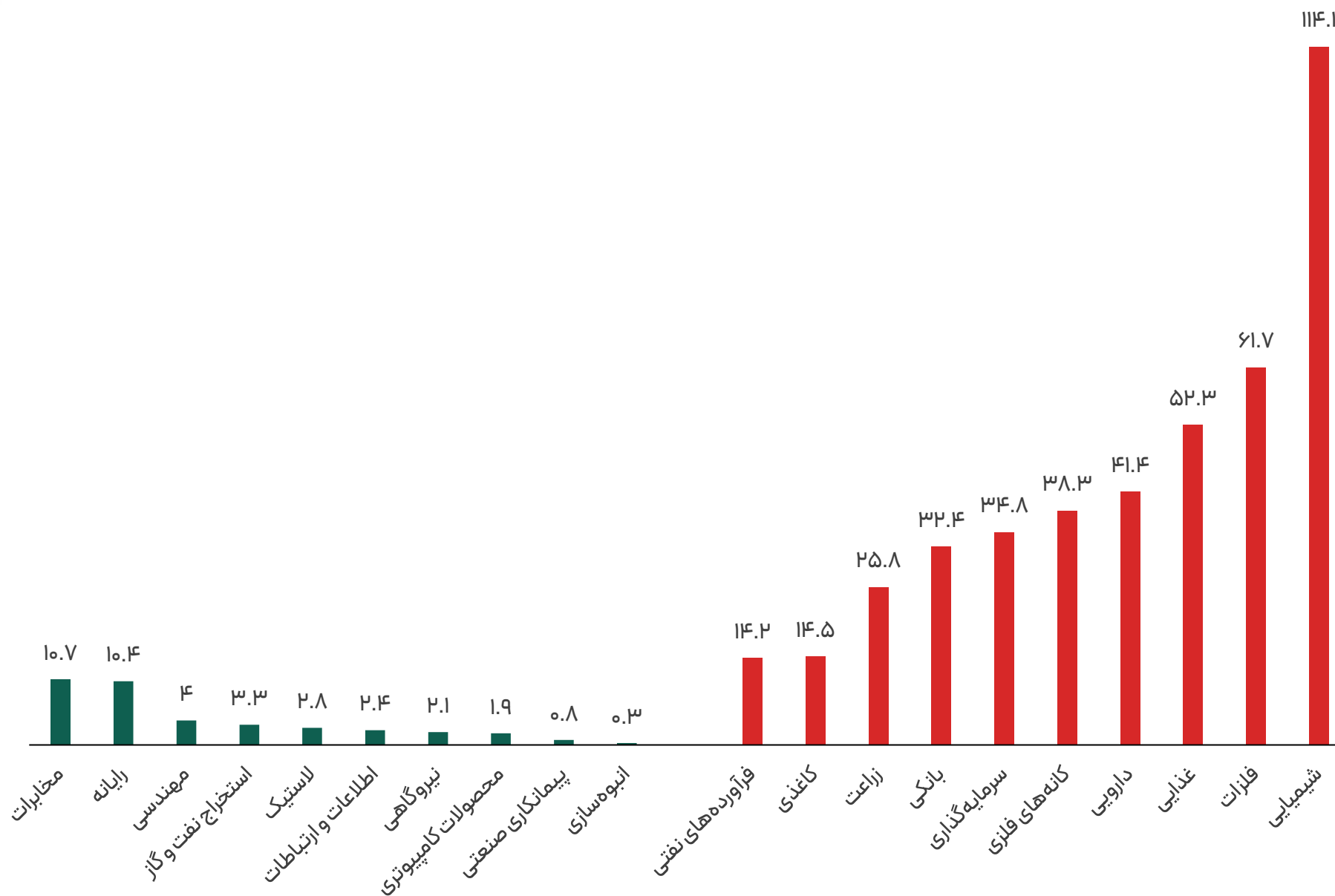
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



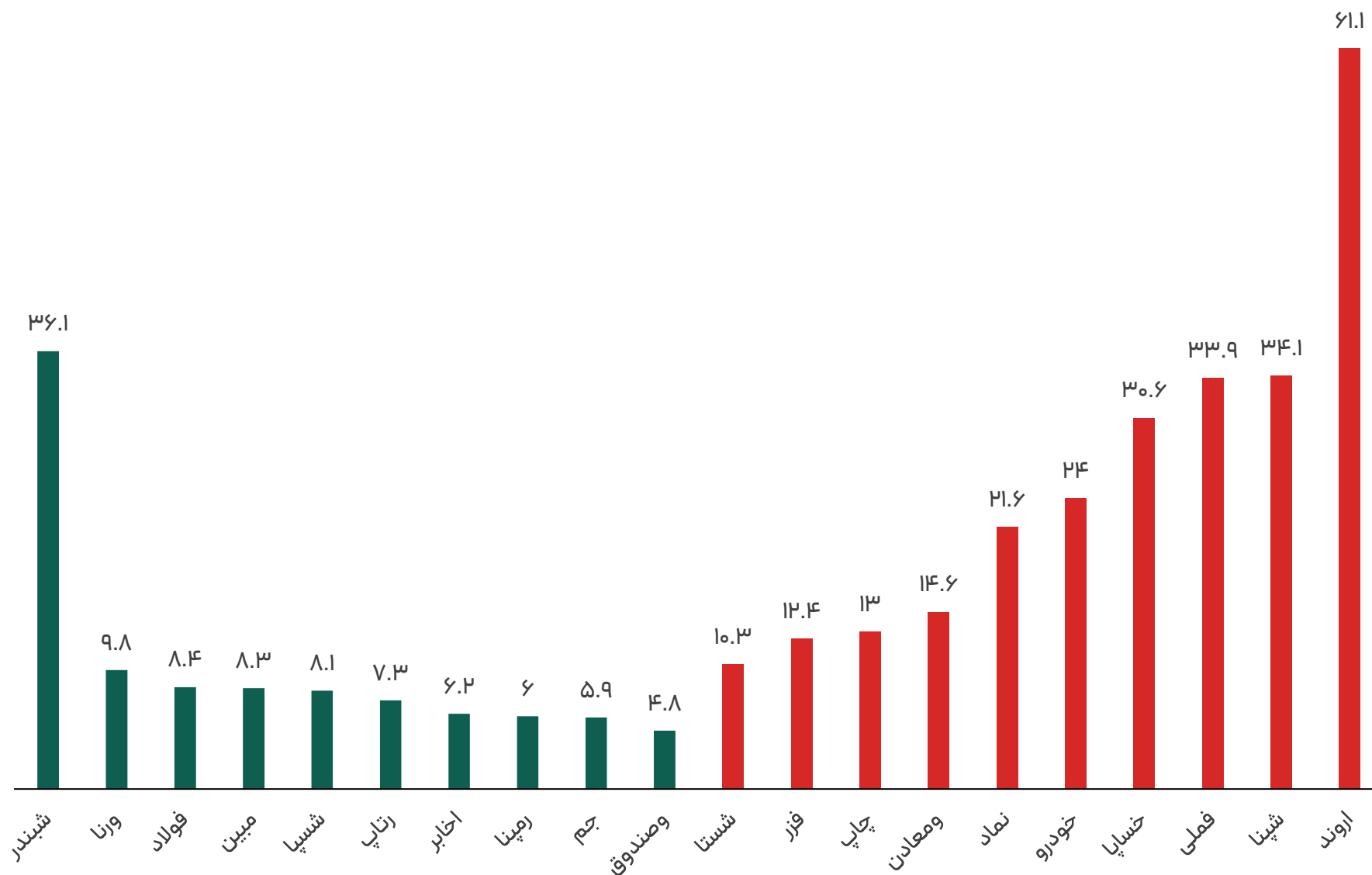
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



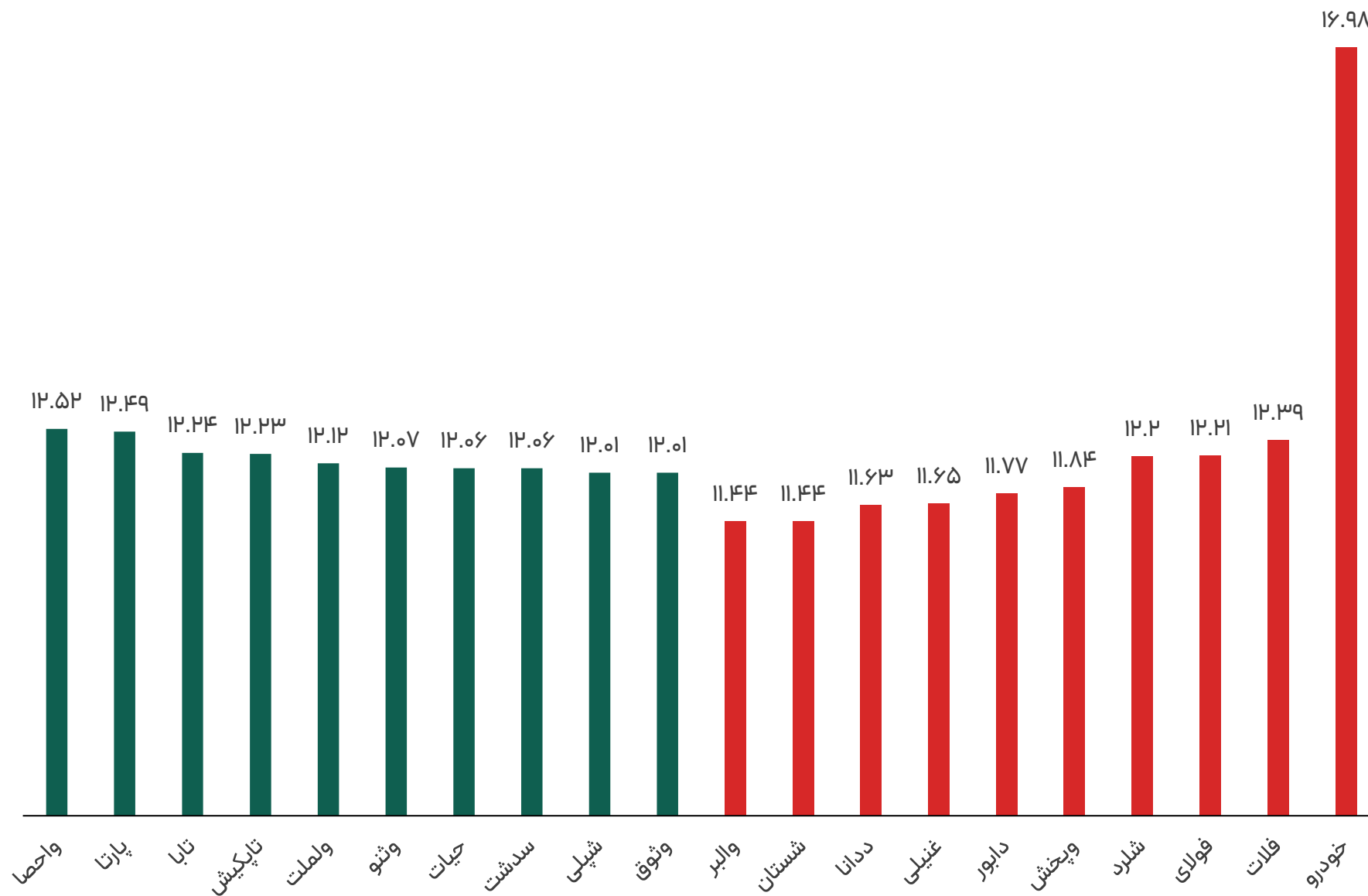
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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



ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



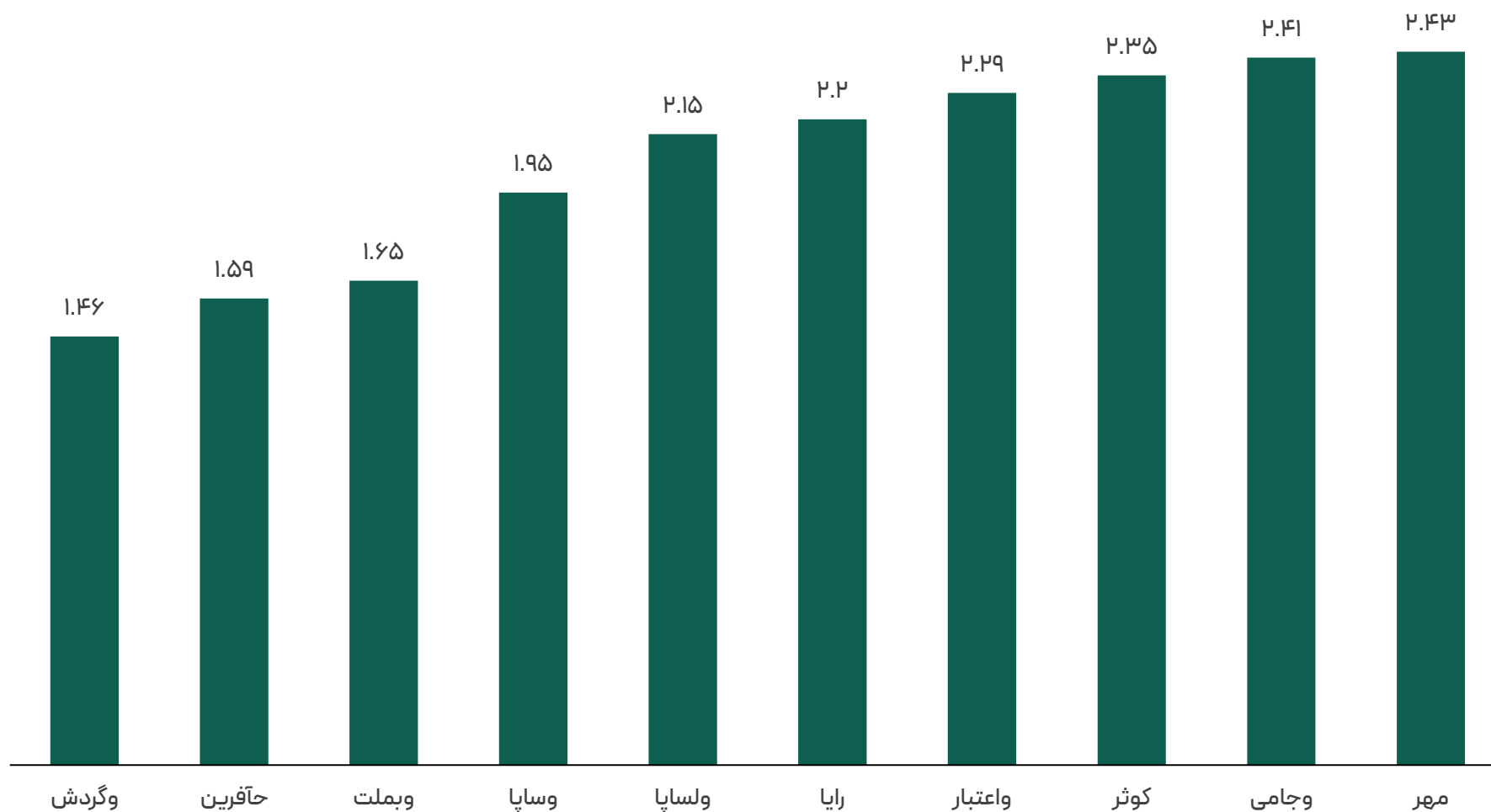
بیشترین ارزش معاملات هفتگی (میلیارد تومان)



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
 دوبایکس	-۲.۹۶	۵.۳۹	-۱.۵۴	۱.۸۶	۱	۱.۸۶	۱.۹۲	-۲۱.۲۲	۶۵.۴۱	۲۶.۵۲
 پیشران	-۲.۹۶	-۳.۹	-۲.۳۷	۱.۷۷	۰.۹۱	۱.۶۱	۱.۶۶	-۱۴.۶۵	۴۴.۳۵	۴۶.۶۲
 نارنج اهرم	-۶.۸	-۱۰.۵۵	-۷.۱۶	۱.۹۵	۰.۹۸	۱.۹۱	۲.۰۴	-۱۷.۴۶	۵۴.۶۴	۸۹.۸۷
 موج	-۱۱.۱۱	-۹.۱۴	-۶.۵۹	۱.۵۹	۰.۹۸	۱.۵۶	۱.۷۳	-۲۱.۰۹	۴۳.۵۲	۶۰.۲۳
 توان	-۱۱.۸۸	۱۹.۸۵	۱۵.۵۴	۱.۸۴	۰.۹۳	۱.۷۱	۱.۹۱	-۲۵.۱۱	۴۰.۷۷	۳۲.۲۴
 اهرم	-۱۵.۵	-۱۴	-۹.۵۶	۱.۶۷	۰.۹۲	۱.۵۴	۱.۷۸	-۲۳.۳۹	۲۴.۲	۲۱.۹۵
 جهش	-۱۶.۶۴	-۱۵.۷۷	-۱۲	۲	۰.۹۴	۱.۸۸	۲.۱۹	-۲۳.۷۲	۳۶.۳۶	۳۱.۶۹
 شتاب	-۱۷.۵۹	-۱۶.۸۳	-۱۲.۴	۱.۹۲	۰.۸۴	۱.۶۱	۱.۸۹	-۲۰.۰۷	۳۱.۷۲	۳۸.۲۲
 بیدار	-۱۷.۹۹	-۱۷.۸۷	-۱۳.۳۳	۱.۸۳	۰.۸۵	۱.۵۶	۱.۸۴	-۱۶.۱۸	۴۱.۳۵	۵۴.۵۱



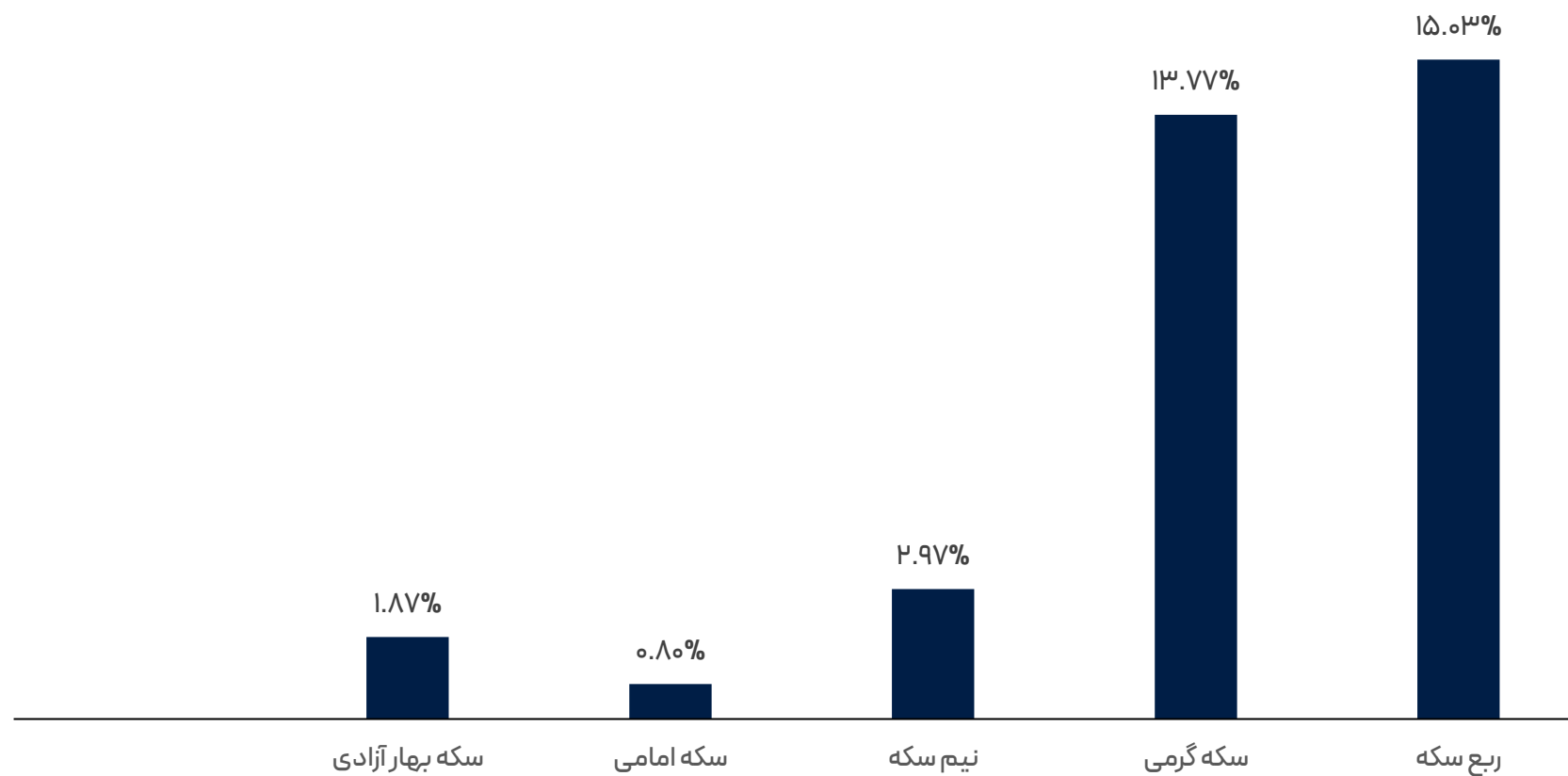
گزارش صندوق‌های طلا

انس طلا	انس نقره	انس طلا	انس نقره
دلار	انس نقره	انس طلا	انس نقره
۰.۳۱% (۱,۵۹۶,۰۰۰ ریال)	۰.۲۶% (۵,۰۴۲ دلار)	۰.۲۶% (۵,۰۴۲ دلار)	۰.۲۶% (۵,۰۴۲ دلار)
۷۷% (۰ دلار)	۷۷% (۰ دلار)	۷۷% (۰ دلار)	۷۷% (۰ دلار)

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حساب
تمام سکه طرح جدید ۴۱۱ + آینده	۱,۸۴۷,۴۷۷	۴.۹۶	-۲.۴۶
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ + رفاه	۱,۳۹۳,۹۲۰	-۱.۱۴	-۲۶.۴۱
تمام سکه طرح جدید ۴۱۲ + سامان	۱,۹۱۵,۹۹۹	-۲.۳۱	۱.۰۳
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۵,۴۵۰,۰۰۰	-۴.۶۳	۳۷.۳۱
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۸۹۰,۵۰۲,۰۰۰	-۳.۱۸	-۰.۱۹
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۲۴,۷۳۸,۰۱۰	-۲.۷۸	-۳.۹۲



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 حساب	میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	یک ماهه	سه ماهه
 عرش	۶.۳۱	۴۰.۸۶	۷۱.۷۵	۰.۳۹	۱۳.۴۲	۰.۴۲	-۰.۷۴
 انار	۲.۶۳	۹.۰۲	۳۱.۴۸	۱۴.۳۳	۲۷.۷۵	-۱.۳۷	-۱.۰۸
 رماس	۰	۰	-۱.۸۷		۴.۴۵		
 دریا	-۰.۰۳	۲۶.۱۳	۴۰.۳۴	۳۵.۳۱	۱۵.۵۴	۰.۴۲	۰.۲۴
 آوا	-۲.۱	۹.۱۷	۴۳.۶۹	۰.۱۸	۱.۷۹	-۰.۳۱	-۰.۲۹
 خلیج	-۲.۴	۳۵.۵۳	۵۷.۰۵	۰.۹۹	۱.۴۱	۱.۷	۰.۷۱
 تراز	-۲.۵۷	۱۹.۰۵	۳۴.۸۴	۱.۱۲	۱.۲	-۰.۷۸	-۰.۲۹
 مانا	-۳.۰۵	۳۴.۹۱	-۸۵.۸۲	۰.۳۶	۹.۱۹	۰.۰۹	-۰.۲۵
 صدف	-۳.۳۷	۲۸.۸۱	۶۵.۹۲	۰.۷۲	۰.۶۵	-۰.۸۴	۰.۱۹

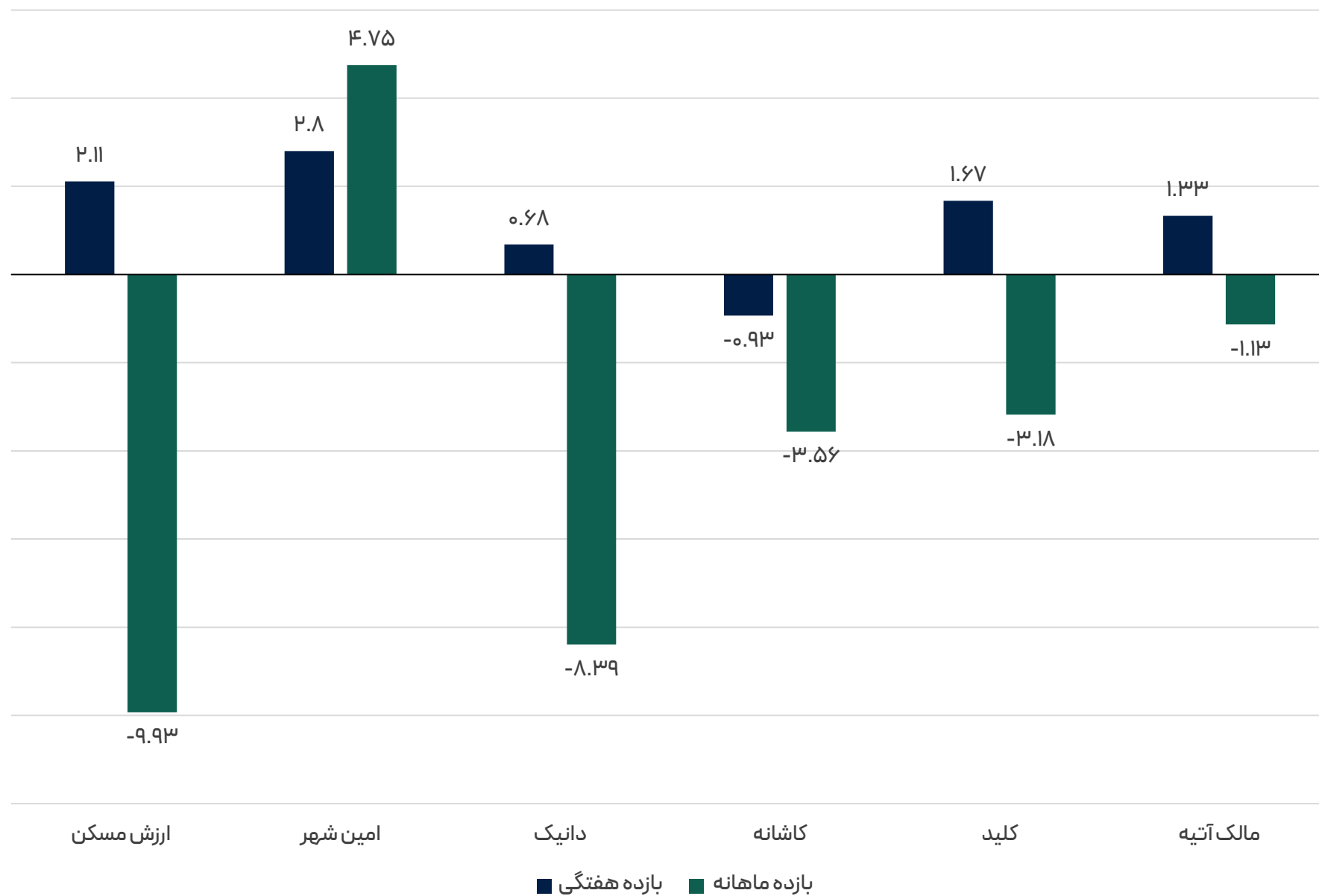


بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حساب	میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سالانه	یک ماهه	سه ماهه	یک ماهه	سه ماهه
طعام 	۰.۱۱	۲۹.۴۲	۵۲	۱.۰۹	۵.۳۷	۰.۸۴	۱.۳۷
فرا الگوریتم 	-۰.۰۳	۲۰.۱۲	۵۴.۹۵	۱.۱۳	۳.۶۸	-۰.۱۲	-۰.۲
پتروفارس 	-۲.۷۶	۳۵.۹۷	۶۲.۹۱	۸.۱۵	۵.۲۳	-۱.۷۳	-۰.۴۶
دایب مزه 	-۳.۲	۲۲.۹۲	۳۳	۹.۴۷	۷.۱۸	۰.۱	۰.۲۳
پناه 	-۳.۷۷	۴.۷۲	۲۱.۸۴	۰.۹۲	۱.۲۹	۰.۵۳	۰.۹۹
سیمانیا 	-۳.۹۶	-۶.۴۹	۲۴.۹۷	۱.۹۷	۲.۲۱	-۳.۱۸	-۱.۷۶
اتوداریوش 	-۴.۱۵	۷.۷۲	۱۲.۹۹	۱.۰۶	۱.۹۹	۰.۹	۰.۱۷
سورنافود 	-۴.۶۶	۱۵.۸۳	۴۶.۰۹	۲.۷۵	۳.۳۴	-۰.۵۳	-۰.۱۸
دایب سیمانا 	-۴.۷۴	-۴.۳۷	۲۶.۲۳	۱.۵۵	۶.۵۱	-۰.۱۳	۰.۱۴



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)



پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آیشن

مروری بر استراتژی استرانگل فروش (Short Strangle) با قراردادهای اختیار فروش برج ۱۲ صندوق اهرم (پیشنهاد شده در بولتن هفتگی منتهی به ۱۰ بهمن)

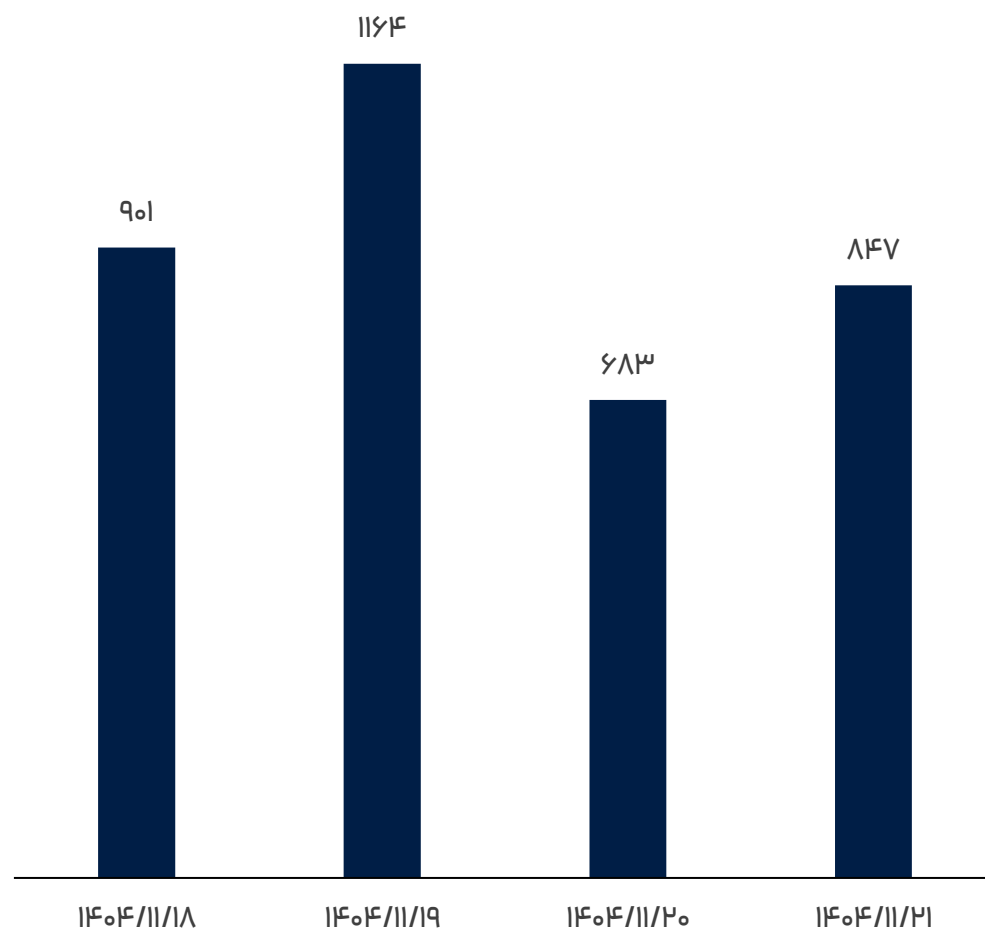
این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش و اختیار خرید (هر دو در زیان) با نمادهای ضررم ۱۲۶ و طهرم ۱۲۵۱ انجام می‌شد. چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم بین ۲,۰۶۸ و ۵,۱۳۲ تومان باقی بماند، استراتژی در سود به میزان ۲۴.۷ درصد، (۱۷.۲ درصد ماهانه) بسته خواهد شد. با این وجود گفته شد که اگر معامله‌گر تصور می‌کند قیمت آستانه بالا در دسترس خواهد بود، می‌توان تنها فروش طهرم ۱۲۵۱ را انجام دهد 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 ضررم 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 ۱۲۵۱ به تنهایی) - قیمت امروز اهرم حوالی ۳,۰۹۵ تومان (تمامی استراتژی‌ها در

		خرید/فروش	نماد	نوع	تعداد	اعمال	قیمت	دلتا	Δ	IV %	وجه تضمین	آفست	خالص	
✖	☐	فروش	ضهرم۱۲۶	اختیار خرب ✓	۱	۵۰,۰۰۰	۸۲۰	۰	۴۳	۱۰۲	☒	۳,۱۴۰,۰۰۰	-۳,۱۴۰,۰۰۰	
✖	☒	فروش	طهرم۱۲۵۱	اختیار فروذ ✓	۱	۲۲,۰۰۰	۵۰۰	۰	۴۳	۱۰۳	☒	۲,۲۱۰,۰۰۰	-۲,۲۱۰,۰۰۰	
+	☐	روز ۴۳			۰۰۰									-۲,۲۱۰,۰۰۰
(-۸.۱%) -۱۷۹,۰۰۰														



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۲۵۸ ضهرم ۳۱,۰۱۹.۸ B	۱۲۵۸ ضهرم ۶,۳۲۴.۸ B	۱۲۵۸ ضهرم ۱,۴۳۱.۳ B
۱۱۲۶ ضهرم ۱۵,۰۱۶.۲ B	۱۲۵۶ ضهرم ۵,۱۹۶.۵ B	۱۲۵۶ ضهرم ۱,۳۵۸.۸ B
۱۲۵۶ ضهرم ۱۲,۴۴۵.۴ B	۱۲۵۷ ضهرم ۳,۱۸۱.۹ B	۱۲۵۵ ضهرم ۹۱۰.۲ B
۱۲۵۷ ضهرم ۱۰,۸۶۳.۹ B	۱۲۵۵ ضهرم ۳,۰۷۲.۸ B	۱۲۵۷ ضهرم ۶۳۷.۶ B
۱۲۵۵ ضهرم ۸,۹۱۸.۴ B	۱۲۴۲ ضست ۱,۹۴۵.۳ B	۱۲۰۵ ضملت ۳۹۸.۱ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماهانه	هفتگی	روزانه
۱۲۵۶ طهرم ۸,۷۴۶.۸ B	۱۲۵۶ طهرم ۳,۸۲۳.۶ B	۱۲۵۶ طهرم ۱,۰۷۴ B
۱۱۲۶ طهرم ۸,۰۰۵.۶ B	۱۲۵۵ طهرم ۱,۳۸۱.۴ B	۱۲۵۵ طهرم ۴۷۳ B
۱۲۵۸ طهرم ۶,۹۰۱.۵ B	۱۲۵۷ طهرم ۱,۱۹۰.۵ B	۱۲۵۸ طهرم ۳۳۰.۳ B
۱۲۵۷ طهرم ۵,۲۰۷.۵ B	۱۲۵۸ طهرم ۹۹۹.۴ B	۱۲۵۷ طهرم ۲۳۰.۶ B
۱۲۵۵ طهرم ۳,۳۰۷.۲ B	۱۲۴۲ طستا ۸۷۱.۴ B	۱۲۰۵ طملت ۱۶۲.۲ 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.

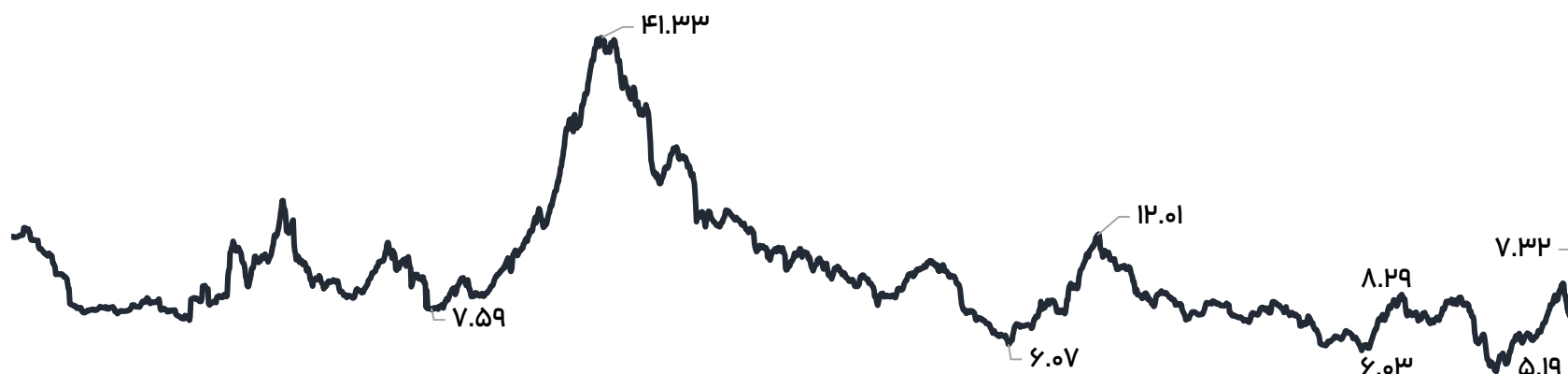
پس از اصلاحی که از سقف اردیبهشت ماه سال ۱۴۰۲ آغاز شد، شاخص کل بورس در آبان ماه سال گذشته، صعود خوبی را آغاز کرد که در شاخص کل به بیش از ۶۵ درصد رشد رسید و در اردیبهشت ماه سال جاری، سقف جدیدی در تاریخچه ی شاخص کل، به ثبت رسید. پس از آن، روند اصلاحی آغاز شد که در تابستان با شکل گیری جنگ ۱۲ روزه بین ایران 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 اصلاحی کوتاه مدت بازار را تایید شده دانست که همین اتفاق هم افتاد. هفته پیش نیز، در بازگشت به میانگین متحرک شکسته شده، شاهد واکنش دوباره منفی بودیم و حال، چنانچه کف اخیر به سمت پایین شکسته شود، اصلاح بازار به سمت محدوده های فیبوناچی مندرج بر روی چارت، تایید 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

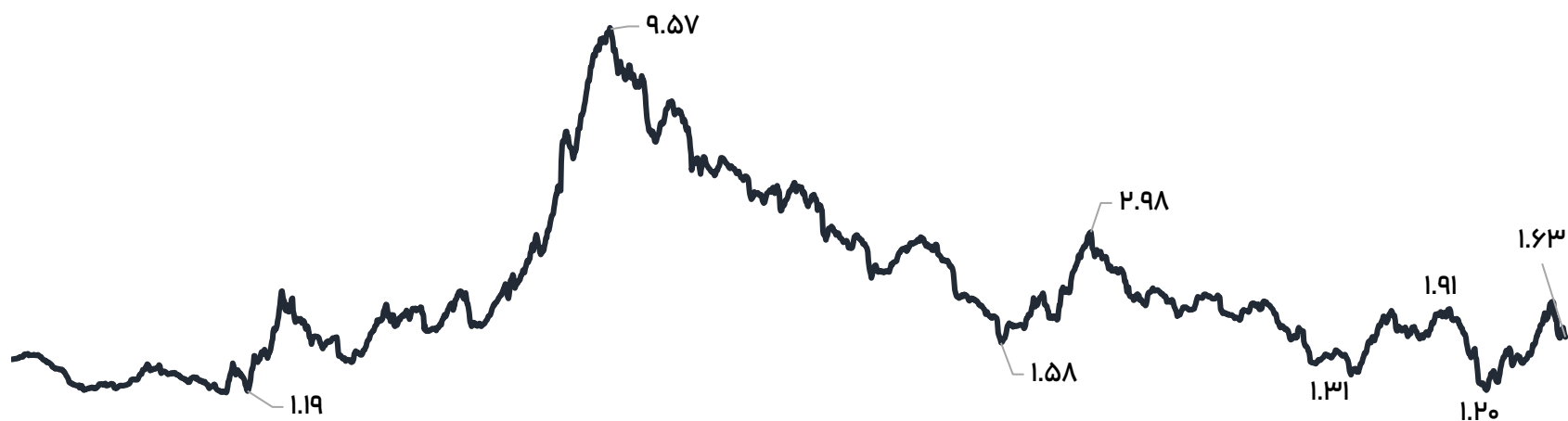
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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 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)





دامنه نوسان صندوق‌های نقره و گواهی نقره ۱۰ درصد شد.

از روز سه‌شنبه ۲۱ بهمن‌ماه، محدوده نوسان قیمت صندوق‌های سرمایه‌گذاری مبتنی بر نقره و گواهی سپرده کالایی شمش نقره، ۱۰ +/- درصد قیمت پایانی روز قبل تعیین شد.



انس بر فراز ۵ هزار دلار باقی ماند.

انس جهانی طلا، در حالیکه روز پنجشنبه با کاهش همراه شد و به سطوح زیر ۴۹۰۰ دلار هم رسید، روز جمعه ریزش شکل گرفته را کاور کرد و بر فراز سطح ۵ هزار دلار به معاملات خود در هفته معاملاتی پایان داد.

گمانه‌زنی‌ها در مورد برگزاری دور دوم مذاکرات بین ایران و آمریکا

رویترز: استیو ویتکاف، فرستاده ویژه ایالات متحده و جرد کوشنر، سه‌شنبه آینده دو دور مذاکره در ژنو برگزار خواهند کرد؛ یک دور بین ایالات متحده و ایران و یک دور بین روسیه و اوکراین.



اروند

شرکت پتروشیمی اروند در دوره ۹ ماهه منتهی به ۱۴۰۴/۰۹/۳۰ به ازای هر سهم ۵,۵۸۲ ریال سود شناسایی کرده است، که نسبت به مدت مشابه سال قبل ۷۶ درصد افزایش داشته است.

خودرو، خساپا، خپارس

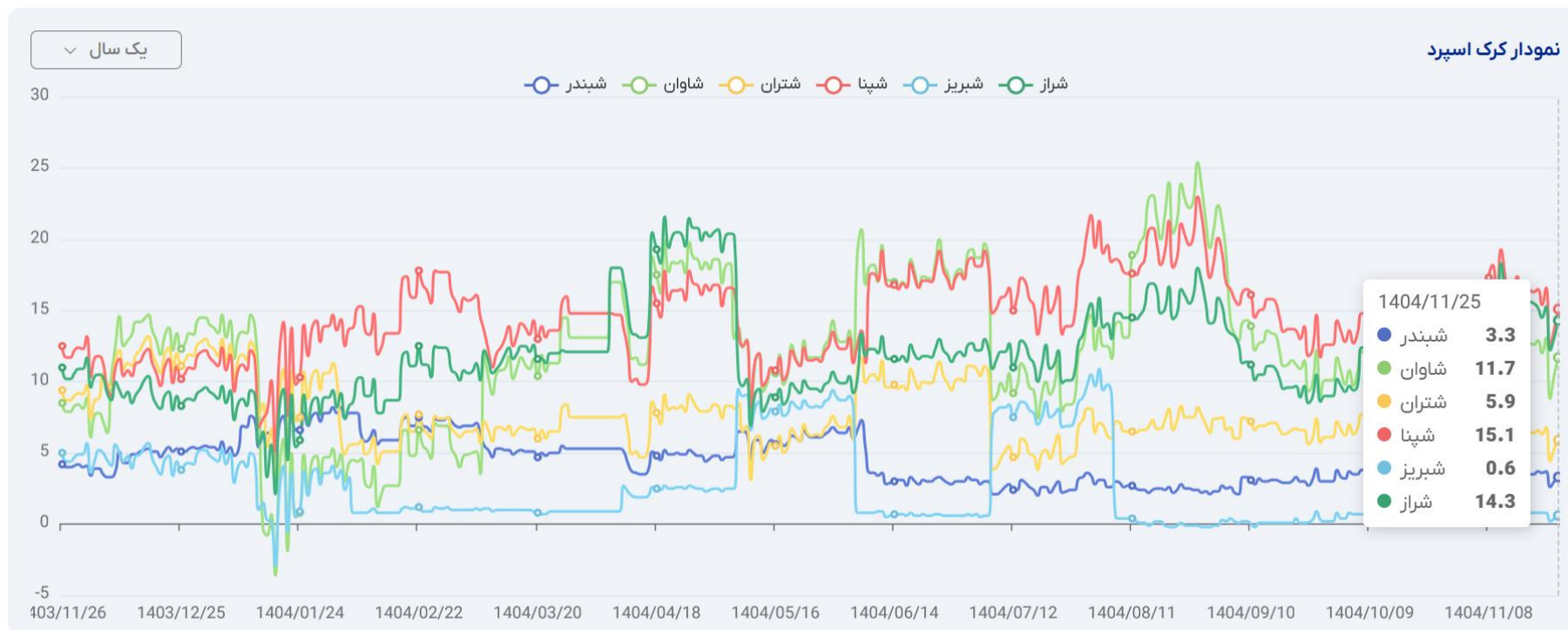
ایران خودرو مجوز افزایش متوسط ۳۹ درصدی، سایپا ۳۰ درصدی و پارس خودرو ۳۵ درصدی دریافت کردند.

خاور

پیش بینی سود ۵.۱ همتی امسال و ۲۷ همتی برای سال ۱۴۰۵ و با اعمال قیمت های جدید توسط ایرانخودرو دیزل



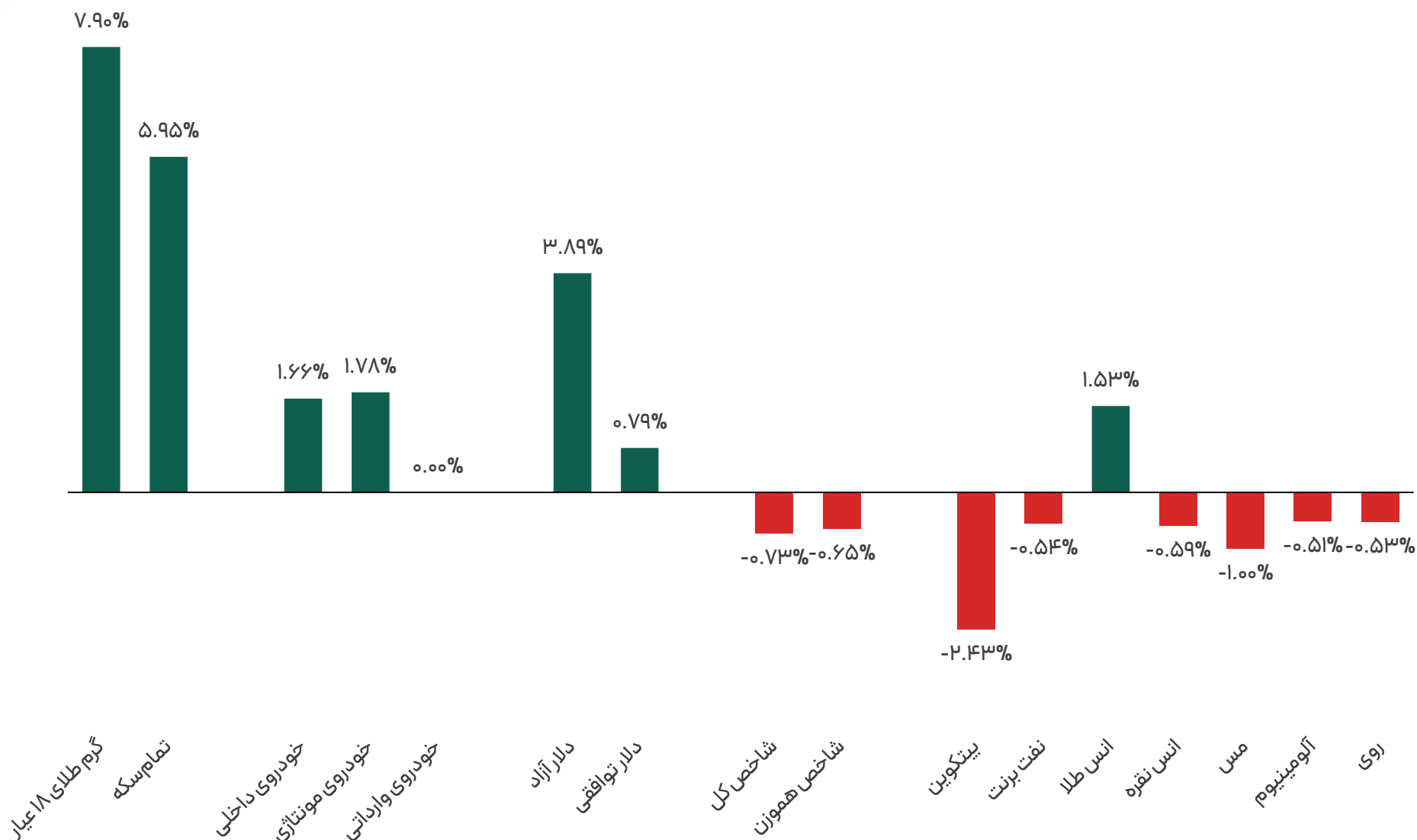
کرک اسپرد پالایشی‌ها



میانگین کرک اسپرد: شبندر \$ ۴.۵ شاوان \$ ۱۲.۱ شتران \$ ۷.۷ شپنا \$ ۱۴.۵ شبریز \$ ۲.۶ شراز \$ ۱۱.۹



بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر

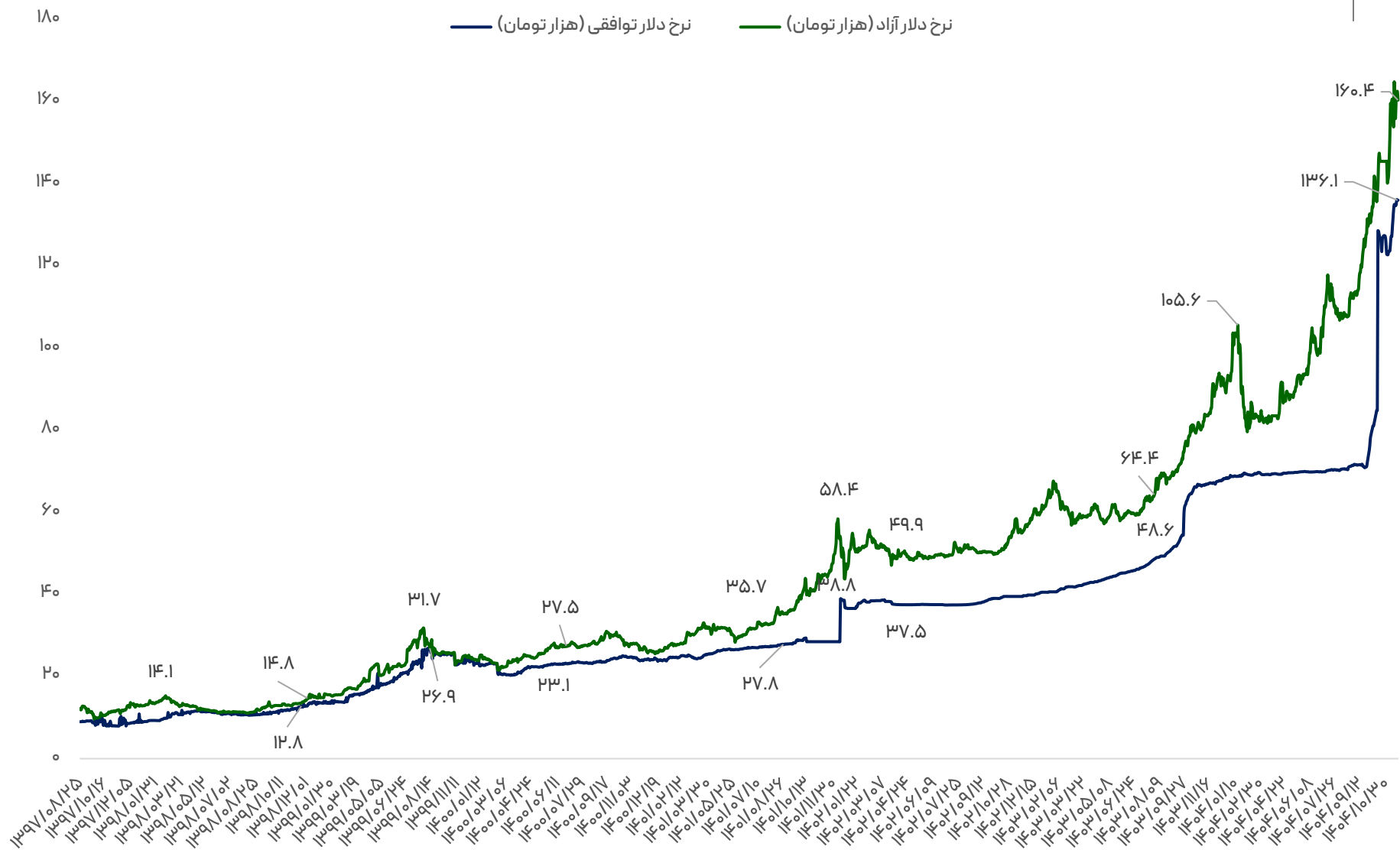


• ملاک تغییرات قیمت خودروی داخلی، دنایپلاس اتوماتیک، خودروی مونتاژی KMC JV و خودروی وارداتی کیا K۵ در نظر گرفته شده است.



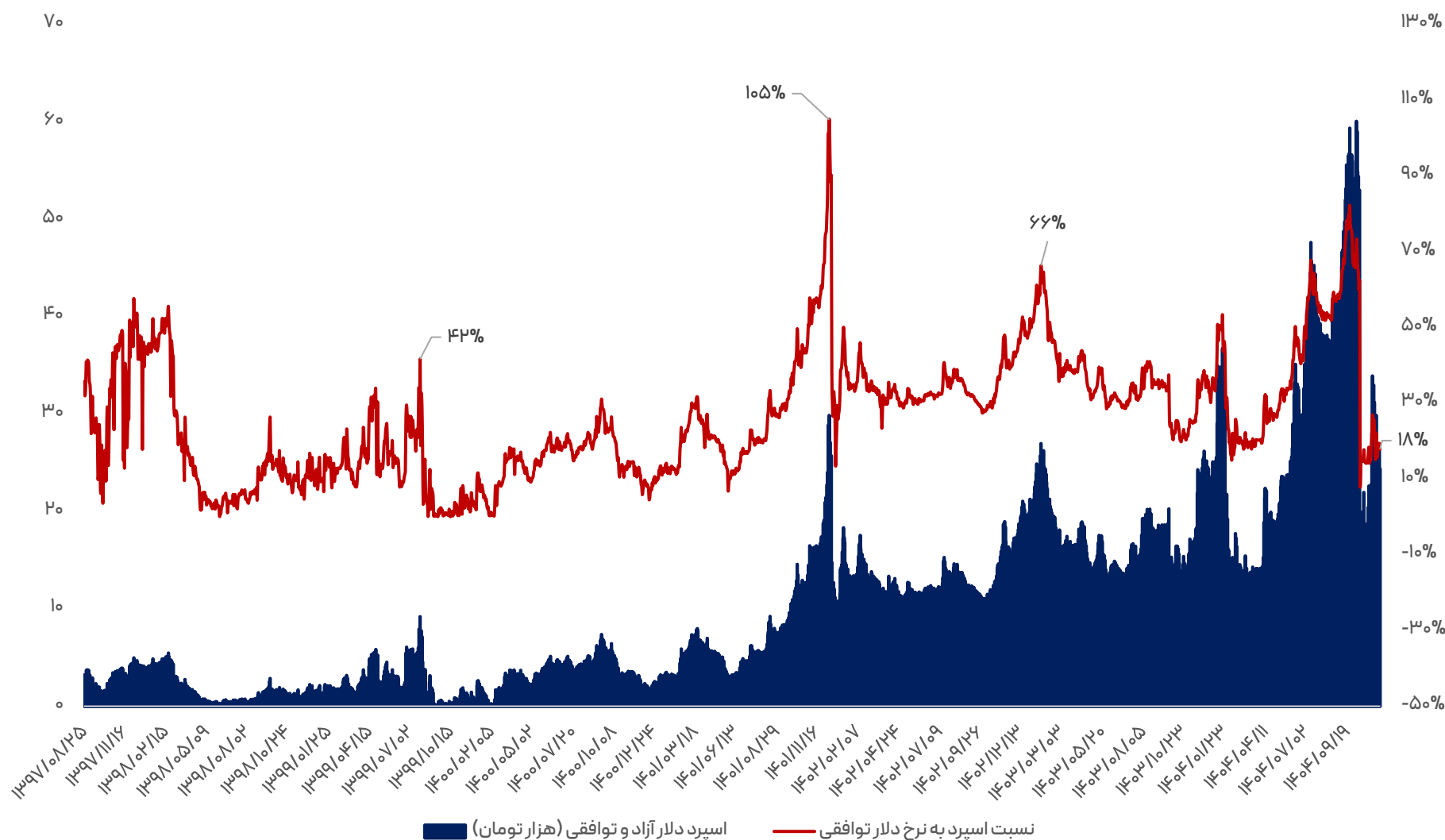
روند تغییرات دلار توافقی و آزاد

هفته گذشته، دلار توافقی با افزایش ۱۰,۶۰۸ ریالی همراه شد و در پایان هفته در سطح ۱,۳۶۰,۵۸۱ ریالی ایستاد.



اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

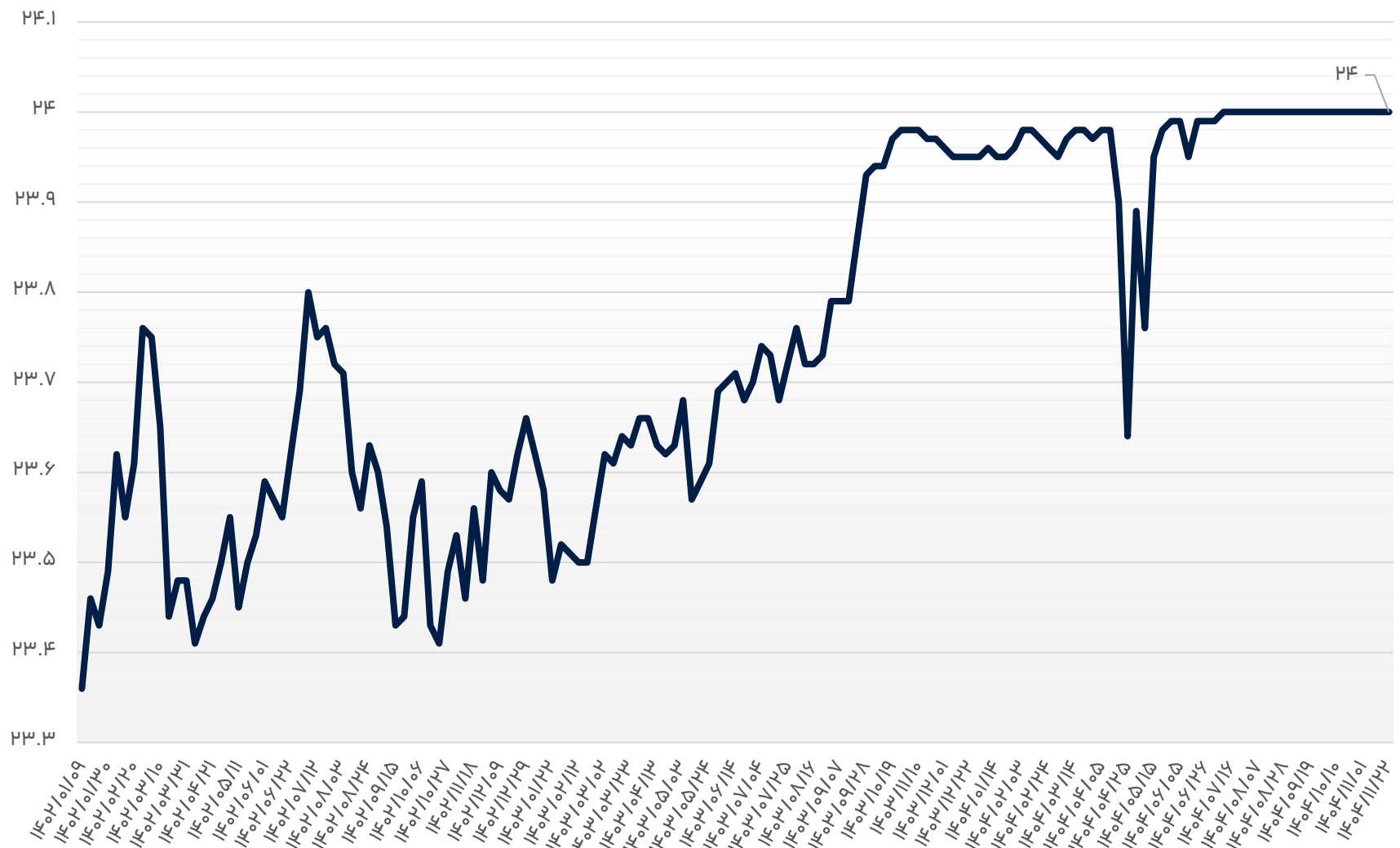
در نمودار زیر، روند تاریخی اسپرد (شکاف) دلار توافقی (نیمای سابق) و دلار آزاد و همچنین نسبت اسپرد به نرخ دلار توافقی را از پاییز سال ۱۳۹۷ تا کنون، مشاهده می‌کنید.



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.



در پاییز ۱۴۰۴ نرخ بیکاری جمعیت ۱۵ ساله و بیشتر ۷.۸ درصد و نرخ مشارکت اقتصادی ۴۰.۷ درصد بوده است

نتایج طرح آمارگیری نیروی کار پاییز ۱۴۰۴ منتشر شد. بررسی نرخ بیکاری افراد ۱۵ ساله و بیش‌تر نشان می‌دهد که ۷.۸ درصد از جمعیت فعال (شاغل و بیکار)، بیکار بوده‌اند. بررسی روند تغییرات نرخ بیکاری حاکی از آن است که این شاخص، نسبت به فصل مشابه در سال قبل (پاییز ۱۴۰۳)، به میزان ۰.۶ درصد افزایش یافته است.

در پاییز ۱۴۰۴، به میزان ۴۰.۷ درصد جمعیت ۱۵ ساله و بیش‌تر از نظر اقتصادی فعال بوده‌اند، یعنی در گروه شاغلان یا بیکاران قرار گرفته‌اند. بررسی تغییرات نرخ مشارکت اقتصادی حاکی از آن است که این نرخ نسبت به فصل مشابه در سال قبل (پاییز ۱۴۰۳) ۰.۵ کاهش یافته است.

جمعیت شاغلان ۱۵ ساله و بیش‌تر در این فصل ۲۴ میلیون و ۸۵۷ هزار نفر بوده که نسبت به فصل مشابه سال قبل تقریباً ۱۲۷ هزار نفر کاهش داشته است. همچنین جمعیت غیرفعال از نظر اقتصادی (اعم از افراد محصل، خانه‌دار، دارای درآمد بدون کار مانند بازنشستگان و غیره) ۳۹ میلیون و ۳۰۰ هزار نفر بوده که نسبت به فصل مشابه سال قبل تقریباً ۸۰۰ هزار نفر افزایش داشته است.



بررسی اشتغال در بخش‌های عمده اقتصادی نشان می‌دهد که در پاییز ۱۴۰۴، بخش خدمات با ۵۳.۲ درصد بیش‌ترین سهم اشتغال را به خود اختصاص داده است. در مراتب بعدی بخش‌های صنعت با ۳۳.۲ درصد و کشاورزی با ۱۳.۶ درصد قرار دارند.

نرخ بیکاری جوانان ۱۵ تا ۲۴ ساله حاکی از آن است که ۲۱.۵ درصد از فعالان این گروه سنی در پاییز ۱۴۰۴ بیکار بوده‌اند. بررسی تغییرات فصلی نرخ بیکاری این افراد نشان می‌دهد، این نرخ نسبت به فصل مشابه در سال قبل (پاییز ۱۴۰۳) ۱.۳ درصد افزایش یافته است.

بررسی نرخ بیکاری گروه سنی ۱۸ تا ۳۵ ساله نیز نشان می‌دهد که در پاییز ۱۴۰۴، به میزان ۱۵.۹ درصد از جمعیت فعال این گروه سنی بیکار بوده‌اند. این در حالی است که تغییرات فصلی نرخ بیکاری این افراد نشان می‌دهد این نرخ نسبت به پاییز ۱۴۰۳، به میزان ۱.۶ درصد افزایش یافته است.

بررسی سهم جمعیت دارای اشتغال ناقص جمعیت ۱۵ ساله و بیش‌تر نشان می‌دهد که در پاییز ۱۴۰۴، ۷.۹ درصد جمعیت شاغل، به دلایل اقتصادی (فصل غیرکاری، رکود کاری، پیدا نکردن کار با ساعت بیش‌تر و غیره) کم‌تر از ۴۴ ساعت در هفته کار کرده و آماده برای انجام کار اضافی بوده‌اند. این در حالی است که ۳۷.۹ درصد از شاغلان ۱۵ ساله و بیش‌تر، بیش از ۴۹ ساعت در هفته کار کرده‌اند.



با سپاس از توجه شما

