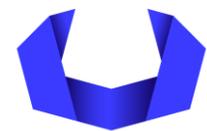


بولتن هفتگی بازار سرمایه

هفته منتهی به ۳ اسفندماه ۱۴۰۴



دانیان
کارگزاری

دیدگاه دانایان

هفته اخیر بازار سرمایه با تداوم عرضه و افت شاخص‌ها همراه بود. شاخص کل بیش از ۵ درصد ریزش کرد. همچنین در شاخص هم‌وزن شاهد ریزش تقریباً ۲.۵ درصدی بودیم.

کماکان بیشتر فعالان بازار در مقطع فعلی، با توجه به شرایط مبهم سیاسی، ترجیح می‌دهند با حداقل ریسک فعالیت کنند. همین موضوع باعث شده است دست‌بالا را فروشندگان و عرضه‌کنندگان داشته باشند و روند کلی بازار اصلاحی و رکودی باشد و زور تقاضا به فروشندگان نرسد.

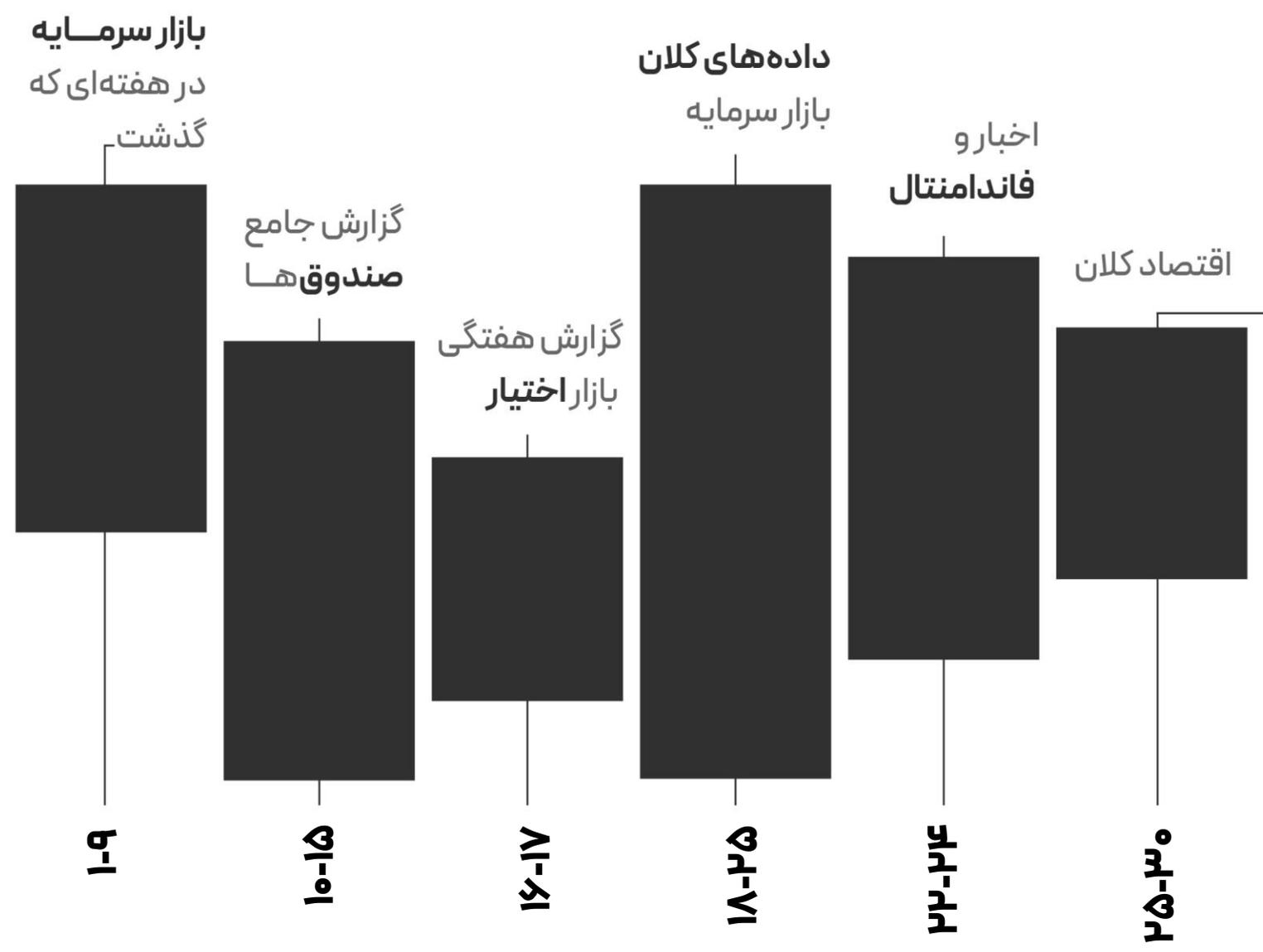
مهم‌ترین پارامتر نقدینگی بازار، یعنی **ارزش معاملات خرد**، سیگنال اصلاحی را چند هفته‌ای است که صادر کرده، طی هفته‌های اخیر کراس نزولی بین میانگین‌های هفتگی و ماهانه هم رخ داده و روند اصلاحی کوتاه‌مدت بازار تایید شده است. همچنین کراس نزولی بین میانگین ماهانه و فصلی هم اخیراً رخ داده و عملاً روند اصلاحی برای میان‌مدت هم تایید شده است. در نتیجه تا زمان شکل‌گیری دوباره تاییدیه‌های مثبت در موارد اشاره شده، بهتر است با احتیاط بیشتری روند بازار را دنبال کرد.

دیگر پارامتر نقدینگی بازار، یعنی **تحركات حقیقی‌ها** نیز، روند اصلاحی بازار را تایید می‌کند. در هفته اخیر، برابند گردش نقدینگی حقیقی‌ها در معاملات خرد، ۱.۳ همت منفی بود و مشابه هفته‌های پیش از آن، **خروج پول حقیقی** ادامه پیدا کرد.

گردش نقدینگی حقیقی‌ها در معاملات **صندوق‌های درآمد ثابت**، تقریباً خنثی بود. در **صندوق‌های طلا** اما ورود پول قابل توجهی به ثبت رسید. طی هفته اخیر بیش از ۵.۹ همت منابع حقیقی به صندوق‌های طلا وارد شد.

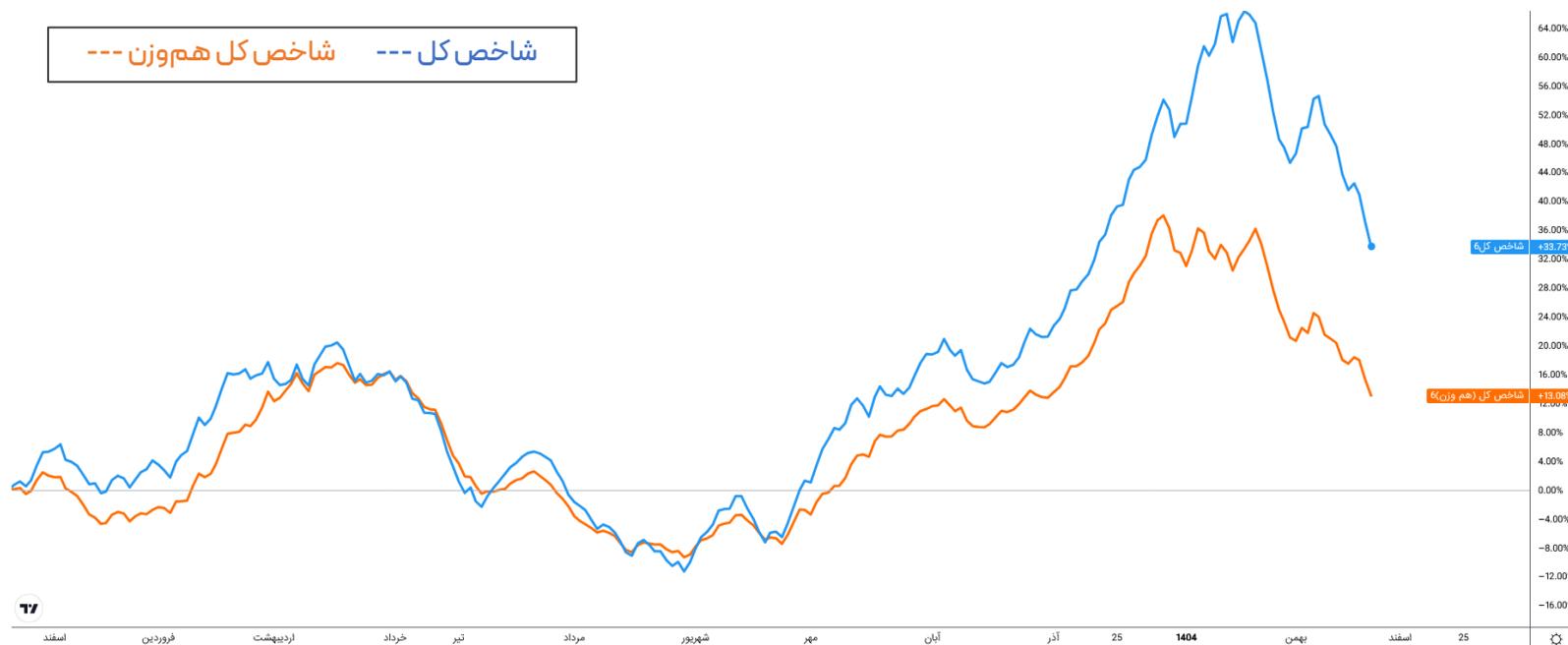
در نهایت، به لحاظ تکنیکالی نیز، تا زمانی که شاخص کل، زیر میانگین متحرک ۲۶ روزه باشد، نمی‌توان انتظار شکل‌گیری صعود پایداری را در بازار سرمایه داشت. در نتیجه حد تایید روند صعودی کوتاه‌مدت را شکست و تثبیت میانگین متحرک توسط کندل‌های شاخص کل و البته در ادامه شکست و تثبیت بر فراز سقف اخیر در محدوده ۴ میلیون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





عملکرد شاخص کل و شاخص کل هم‌وزن

در تصویر زیر، عملکرد مقایسه‌ای شاخص کل و شاخص کل هم‌وزن در یک نمودار قابل مشاهده است. در رشد اخیر بازار که از پاییز سال گذشته آغاز شد و تا دی‌ماه 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 حالی‌که 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 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 بازار، شاخص هم‌وزن با شتاب کمتری نسبت به شاخص کل اصلاح کرده است و به نظر می‌رسد بعد از مدت‌ها بازی به نفع شاخص هم‌وزن در حال تغییر است و باید دید که این روند ادامه خواهد یافت یا نه.



دوره زمانی	یک هفته	یک ماهه	سه ماهه	شش ماهه	یک ساله
بازده شاخص کل	-۵.۵۱۴%	-۱۵.۲۵%	+۲۰.۱۴%	+۵۴.۰۶%	+۴۰.۹۴%
بازده شاخص کل هم‌وزن	-۲.۴۶%	-۱۱.۵۸%	+۶.۱۹%	+۲۷.۶۴%	+۱۷.۹۷%



شاخص کل هموزن به شاخص کل

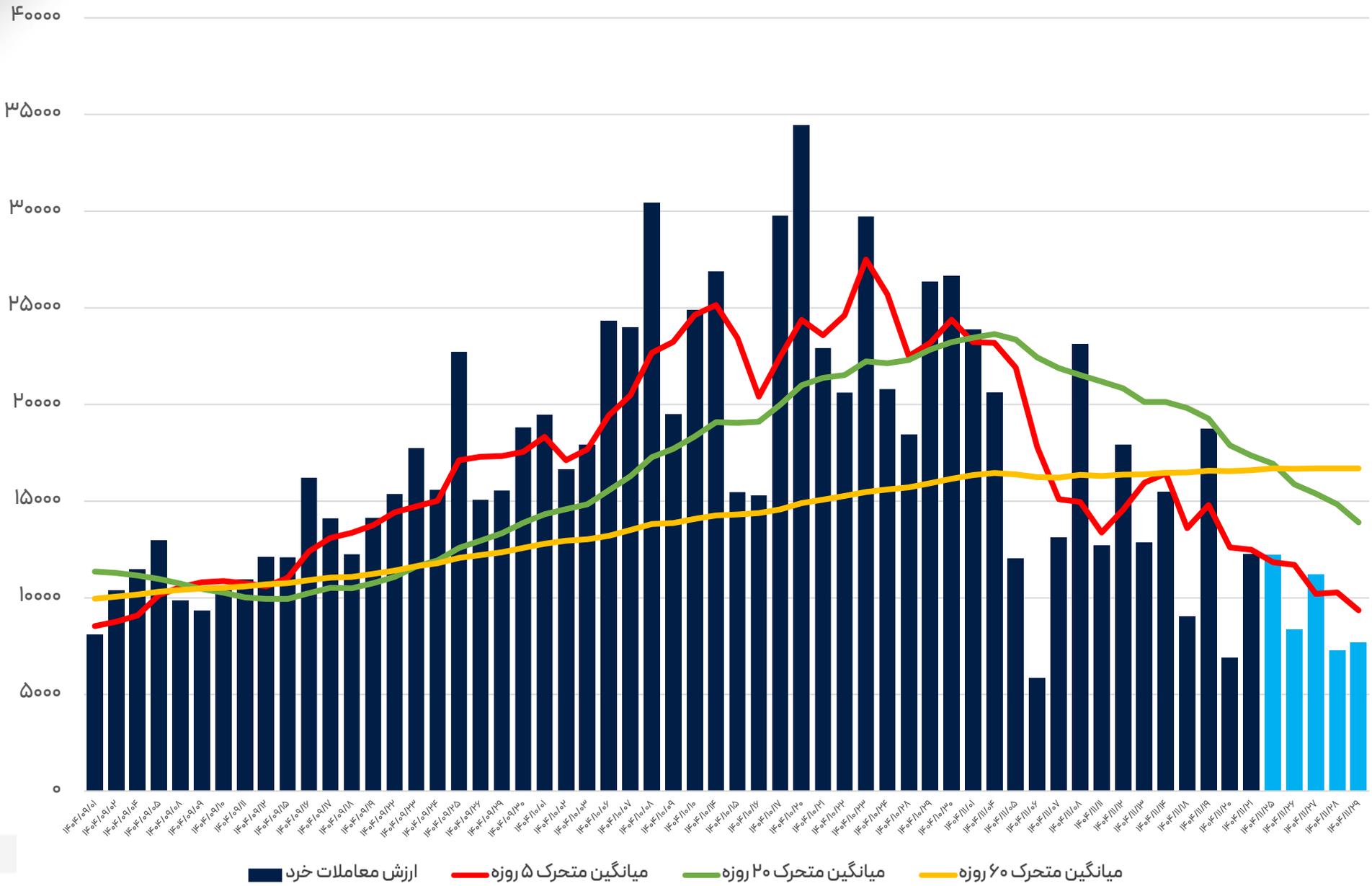
نمودار نسبی، از مقادیر یک کسر تشکیل می‌شود که در نمودار زیر، صورت این کسر، شاخص کل هموزن و مخرج آن شاخص کل است. بدیهی‌ست با بزرگ‌تر شدن صورت کسر یا کوچک‌تر شدن مخرج، مقدار کلی کسر افزایش می‌یابد. این موضوع بدین معناست که رشد نمودار زیر، بیانگر عملکرد بهتر صورت کسر، یعنی شاخص کل هموزن نسبت به شاخص کل 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 و در انتهای حرکت نیز مشکوک به الگوی بازگشتی کف دوقلو است. اگرچه حد تایید نهایی پایان این اصلاح، شکست خط روند نزولی ترسیم شده به سمت بالا بوده، 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.

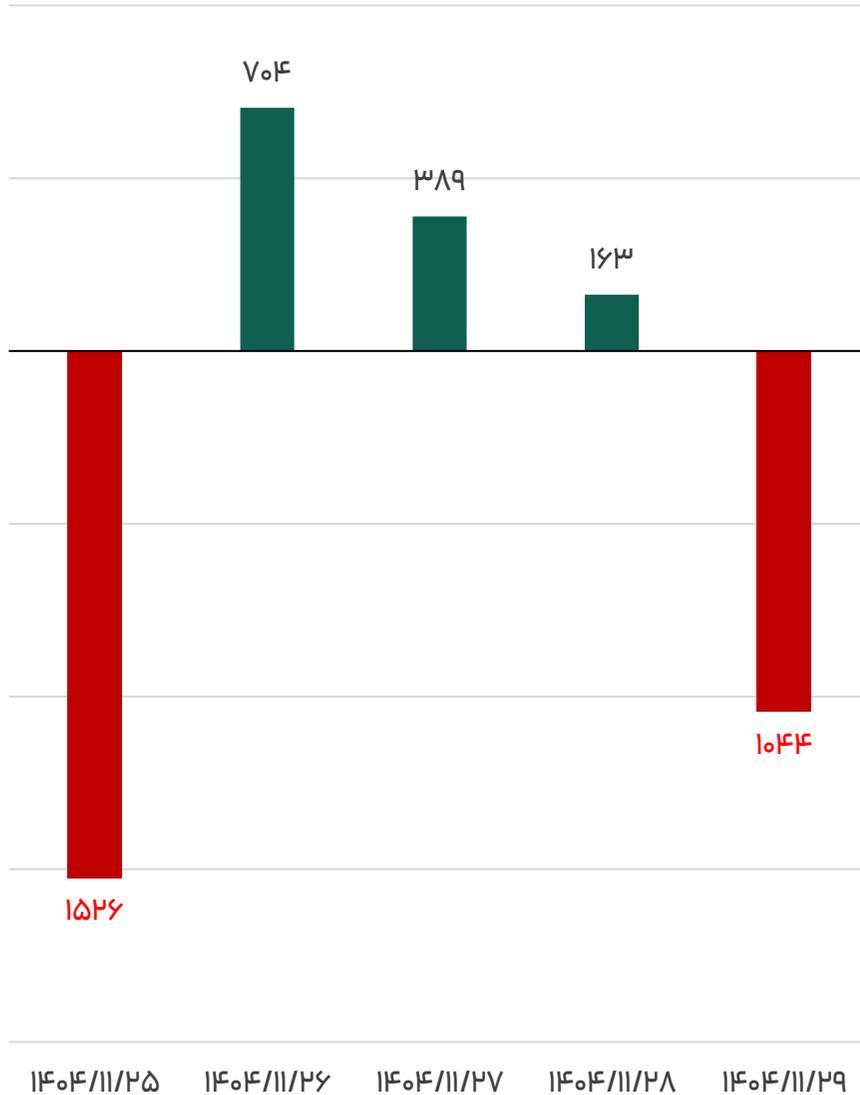


ارزش معاملات خرد ۹۰ روزه بازار سرمایه (میلیارد تومان)

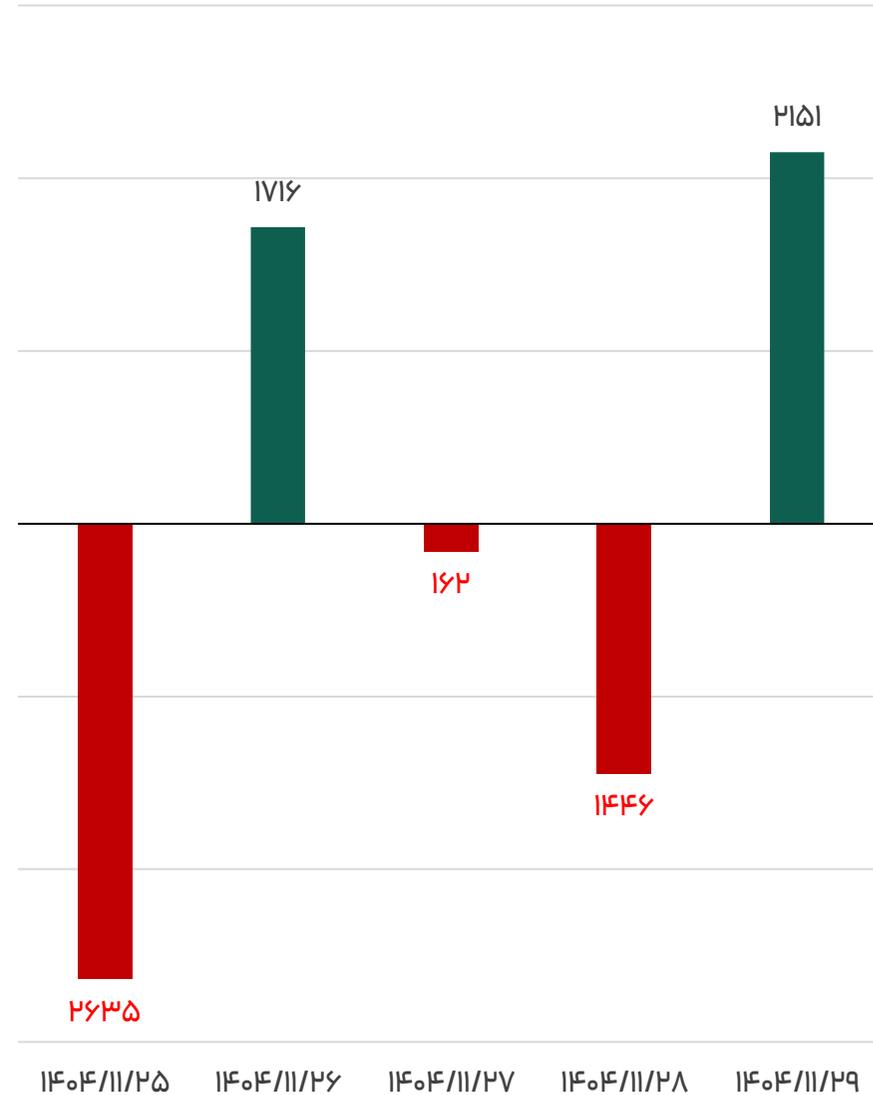


ورود و خروج پول حقیقی طی هفته اخیر (میلیارد تومان)

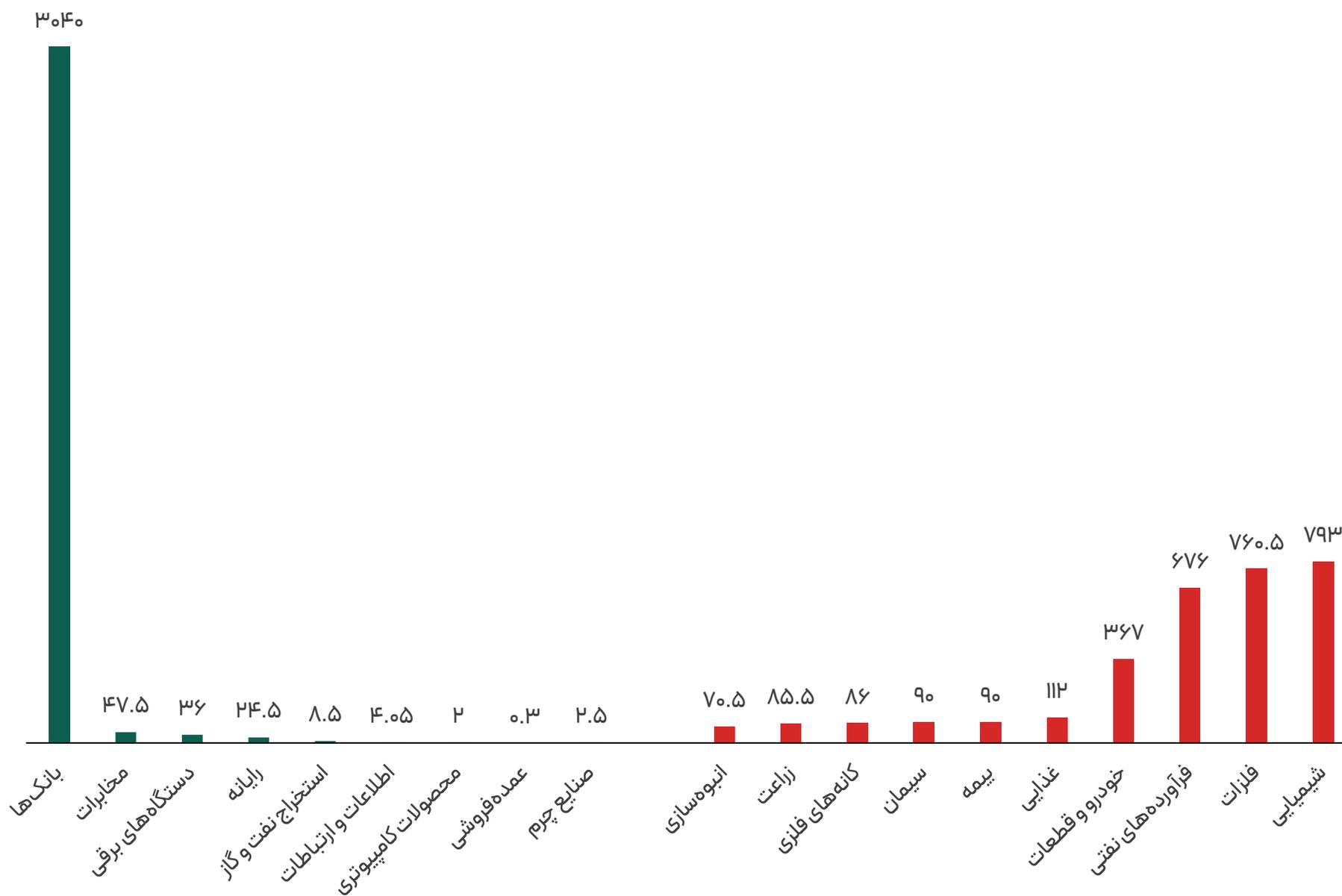
ورود و خروج پول حقیقی به معاملات خرد



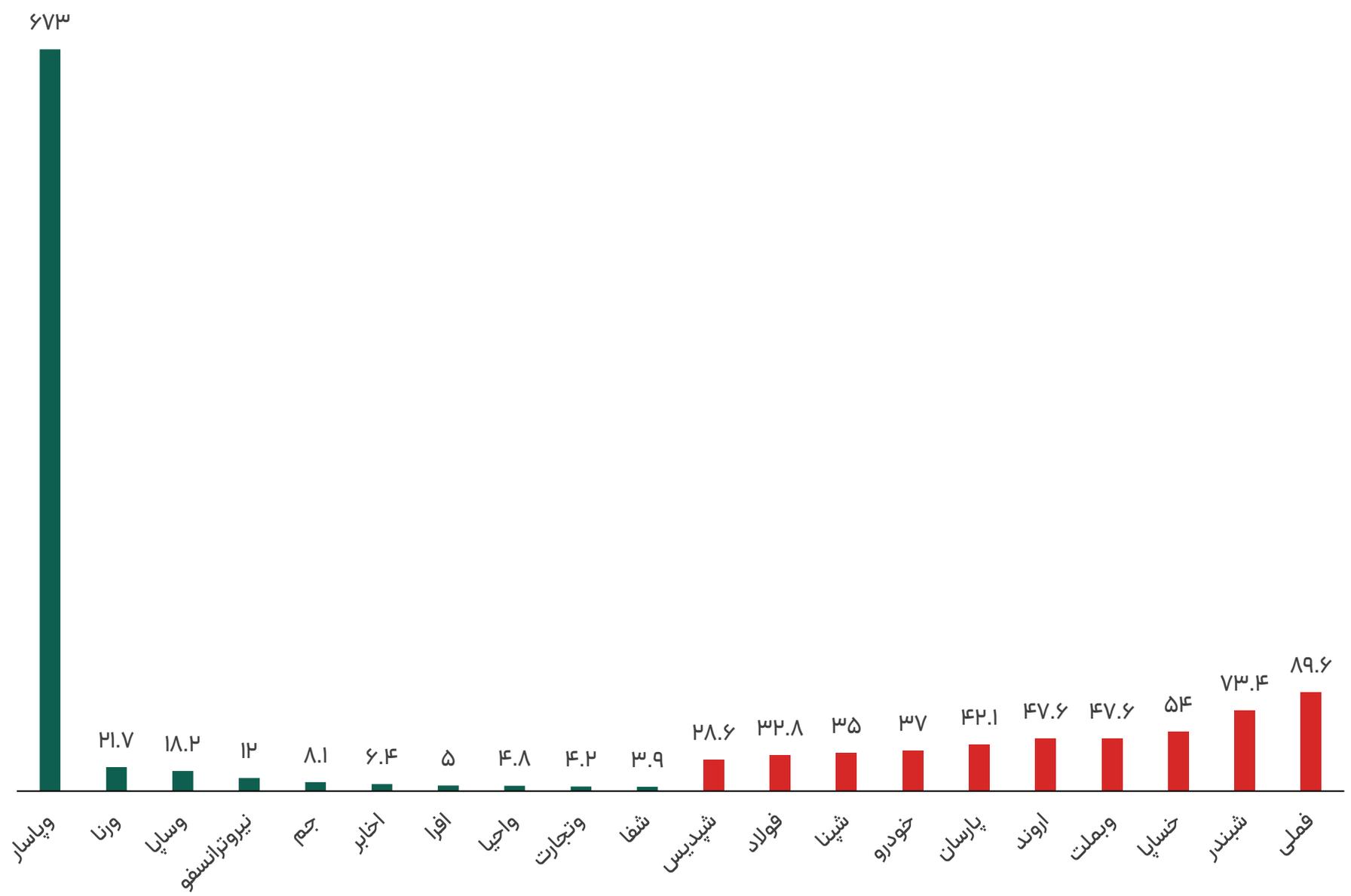
ورود و خروج پول حقیقی به درآمد ثابت‌ها



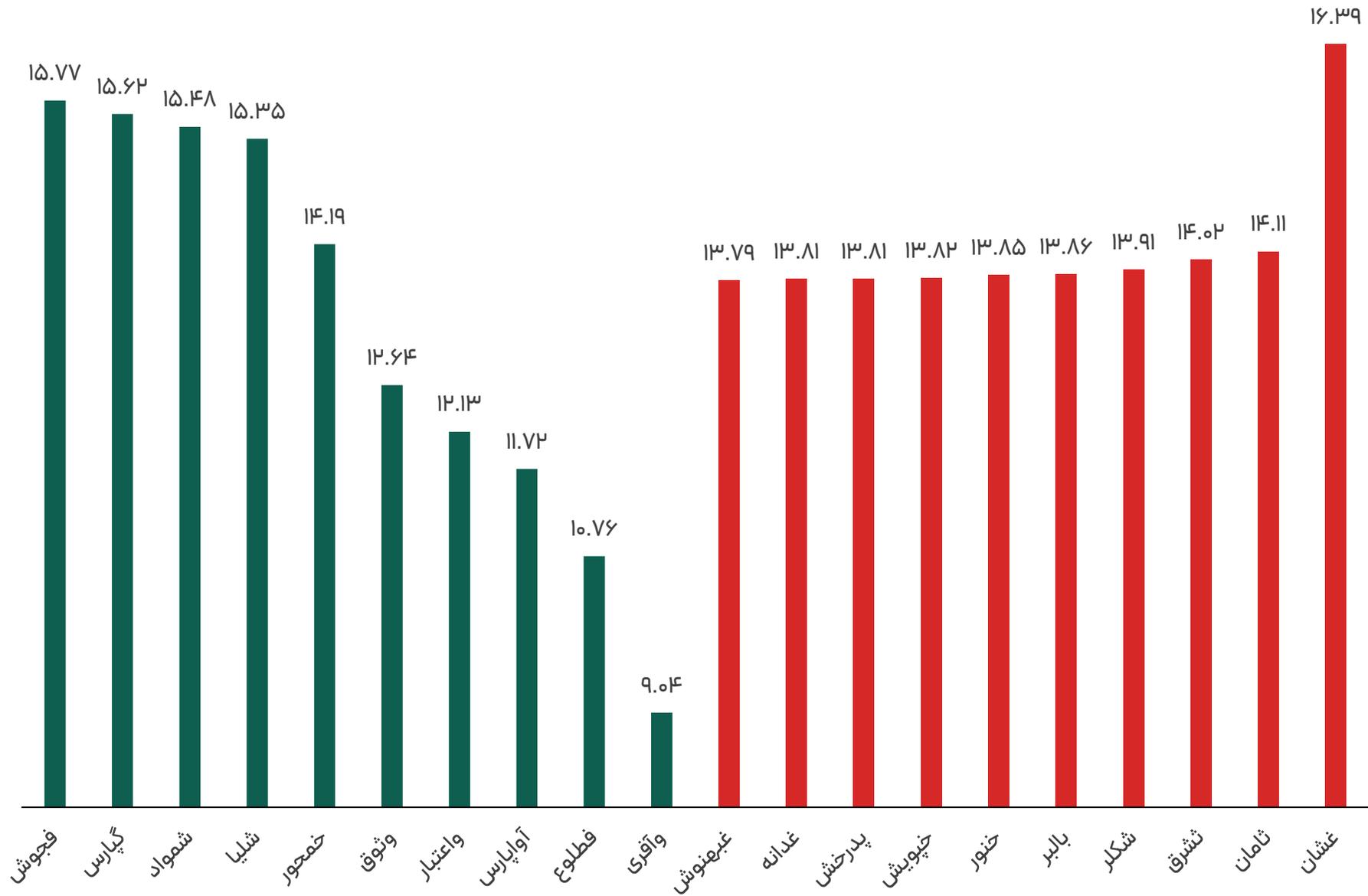
بیشترین ورود و خروج پول هفتگی به صنایع (میلیارد تومان)



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

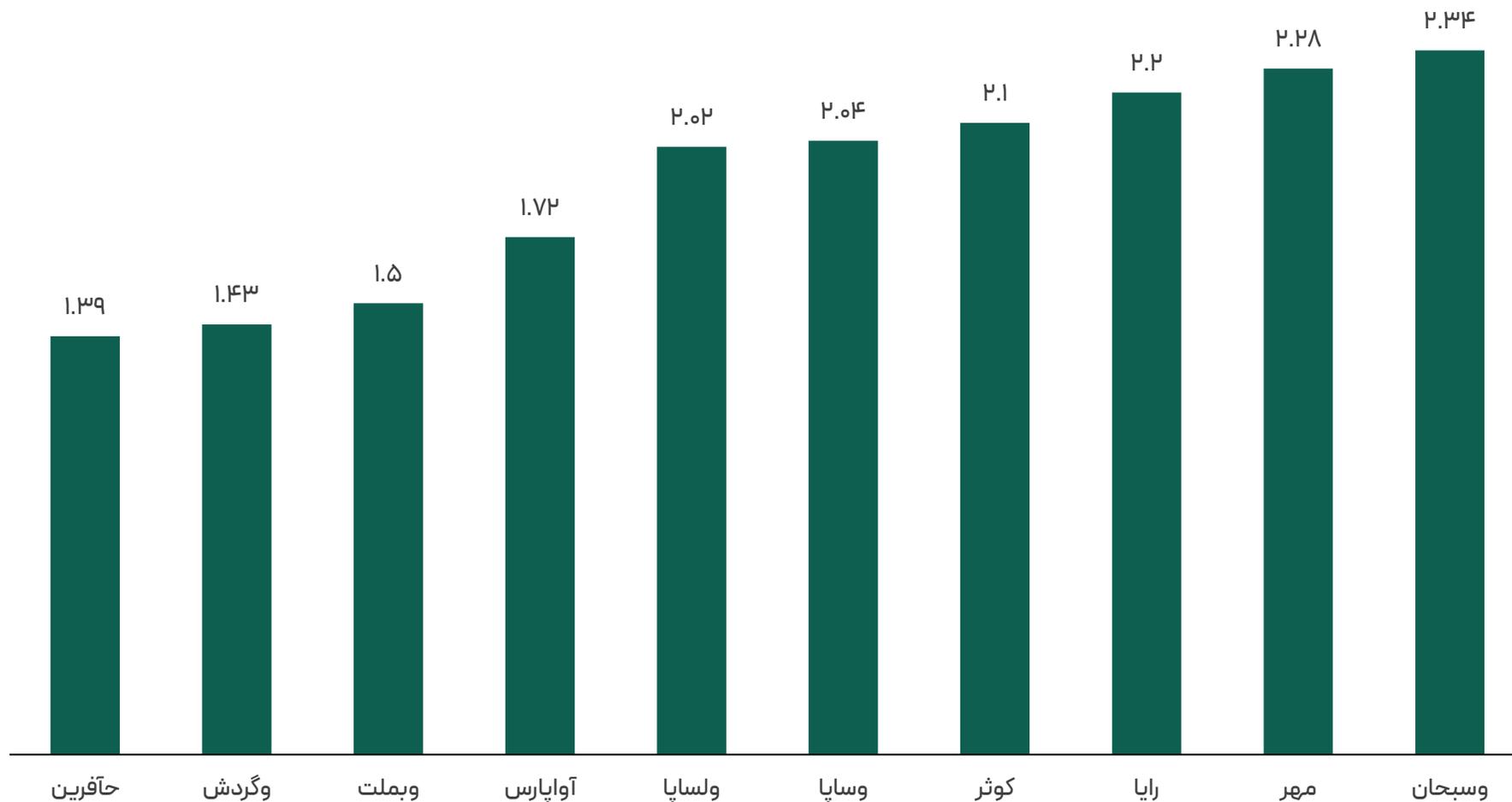


ترین‌های بازده هفتگی (درصد)



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
پیشران 	۰.۶۸	-۳.۲۷	-۲.۰۳	۱.۹۴	۰.۹۱	۱.۷۷	۱.۷۶	-۲۰.۳۷	۳۰.۰۳	۳۶.۴۷
دوایکس 	-۲.۵۸	۱.۵۸	-۱.۵	۲.۰۳	۰.۹۹	۲.۰۱	۲.۰۶	-۳۸.۳۱	۴۲.۷۵	۱۰.۶
نارنج اهرم 	-۶.۱۸	-۱۰.۳۹	-۷.۰۵	۲.۱۸	۰.۹۹	۲.۱۶	۲.۲۹	-۲۱.۹۳	۳۲.۴۵	۷۷.۵۱
توان 	-۱۰.۰۵	۱۳.۲۳	۱۶.۶۷	۱.۹۸	۰.۹۷	۱.۹۲	۲.۱۱	-۲۸.۸۶	۲۱.۲۹	۱۶.۸۷
موج 	-۱۱.۸۷	-۱۰.۳۶	-۷.۰۷	۱.۷۲	۰.۹۹	۱.۷	۱.۹	-۲۷.۹۴	۲۳.۸۹	۴۷.۰۲
جهش 	-۱۴.۳۲	-۱۶.۷۱	-۱۲.۵۵	۲.۲۷	۰.۹۵	۲.۱۶	۲.۴۷	-۲۹.۰۴	۱۵.۹۴	۲۴.۹
اهرم 	-۱۴.۶۲	-۱۵.۲۴	-۱۰.۴۱	۱.۸	۰.۹۲	۱.۶۶	۱.۹	-۲۶.۶۵	۱۱.۲۱	۱۳.۹۳
شتاب 	-۱۶.۵۲	-۱۷.۸۳	-۱۳.۰۲	۲.۰۲	۰.۸۶	۱.۷۴	۲.۰۳	-۲۲.۷۹	۱۵.۵۱	۳۳.۴۷
بیدار 	-۱۸.۰۶	-۱۸.۵	-۱۴.۰۲	۱.۹۸	۰.۸۶	۱.۷	۲.۰۱	-۲۱.۶۳	۲۴.۰۴	۴۷.۲۶



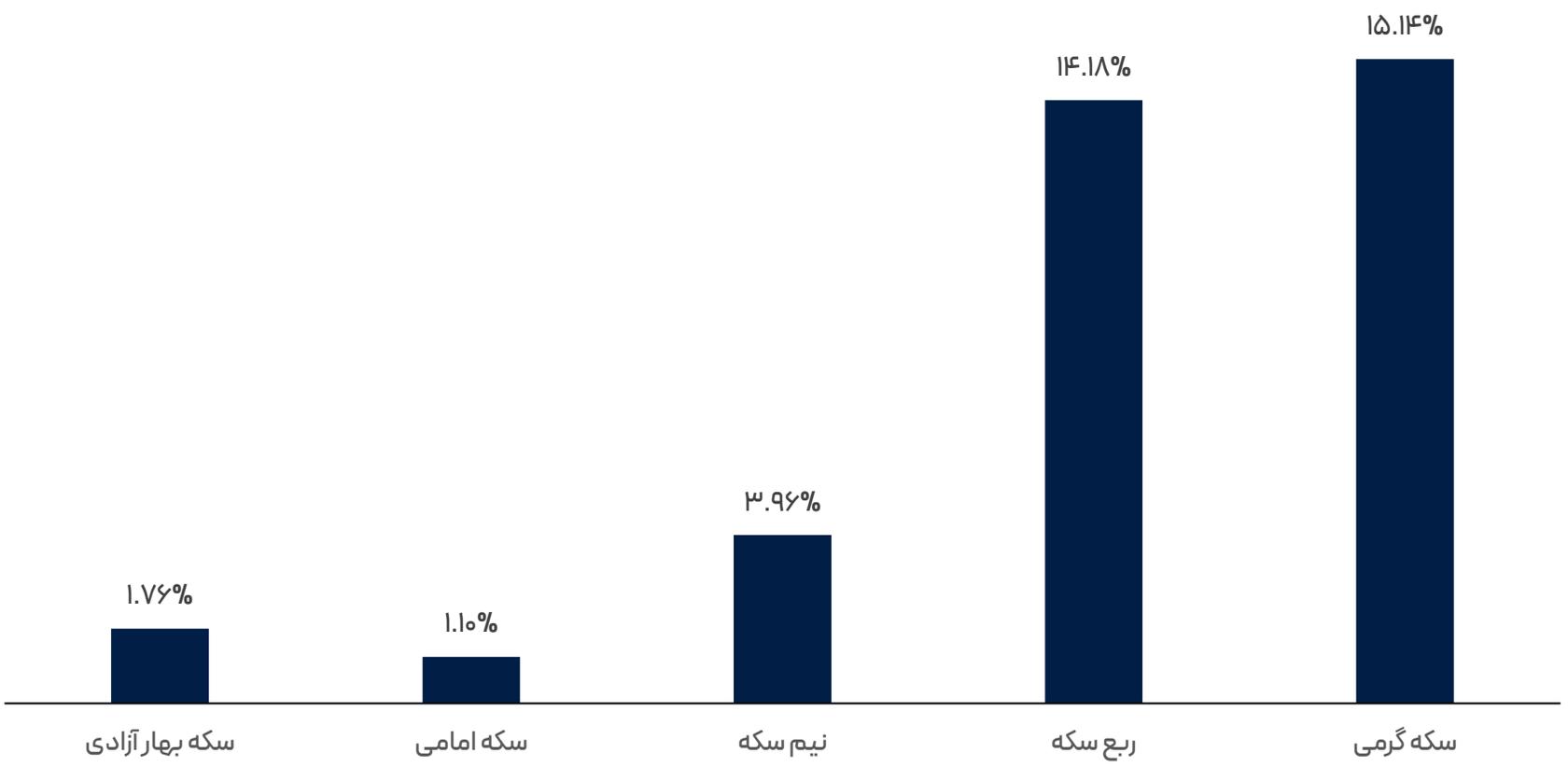
گزارش صندوق‌های طلا

دلار (۰.۵۵%) ۱,۶۴۲,۰۰۰ ریال انس طلا انس نقره انس نقره (۰.۳۹%) ۵,۱۰۶ دلار (۰.۸۴%) ۸۴ دلار

نماد	قیمت آخرین معامله	درصد تغییر آخرین معامله	درصد حساب
تمام سکه طرح جدید ۱۴۱۱ آینده	۱,۸۴۷,۴۷۷	۴.۹۶	-۶.۳۹
تمام سکه طرح جدید ۳۱۲ رفاه	۱,۳۹۳,۹۲۰	-۱.۱۴	-۲۹.۳۷
تمام سکه طرح جدید ۴۱۲ سامان	۱,۹۵۶,۹۰۰	۱.۸۳	-۰.۸۴
گواهی سپرده پیوسته شمش نقره ۹۹۹.۹	۵,۰۵۹,۹۲۰	۰.۲۶	۱۳.۳۷
گواهی سپرده پیوسته تمام سکه بهار آزادی طرح جدید	۱,۹۶۶,۶۵۷,۹۰۰	۲.۸۸	-۰.۳۵
گواهی سپرده پیوسته شمش طلای ۹۹۵+	۲۵,۶۵۹,۹۳۰	۲.۵۸	-۴.۳۵



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	سه ماهه	یک ماهه		یک ماهه	سه ماهه
پناه 	-۱.۶۵	۱.۵۱	۲۳.۳۱	۱.۱۲	۶.۰۹	۰.۹۶	۰.۹۶
فرا الگوریتم 	-۱۰.۱۶	۱۵.۵۹	۵۲	۰.۷۳	۱.۹	-۰.۰۷	-۰.۱۹
بازیمه 	-۱۰.۴۵	۲.۲۷	۲۰.۳	۳.۹۲	۱.۲۳	۰.۶۶	۰.۷۹
آذربین 	-۱۱.۰۸	۲۴.۷	۴۳.۷۲	۱.۸۴	۲.۳۵	-۰.۱۴	-۰.۱۸
فلزا 	-۱۲.۱۳	۲۹.۰۹	۶۸.۰۸	۱.۳۷	۲.۳۵		
طعام 	-۱۲.۲۷	۲۱.۹۹	۴۳.۹۸	۰.۵۶	۴.۵۵	۱.۳۴	۱.۹۷
پتروفارس 	-۱۲.۳۵	۲۵.۹۷	۶۰.۵۴	۵.۲۶	۲.۷۹	-۱.۰۷	-۰.۳۹
دایب متال 	-۱۳.۰۶	۳۷	۵۱.۵۴	۷.۷۲	۱.۲۵	-۰.۱۴	۰.۰۶
دایب سیمانا 	-۱۳.۴۱	-۹.۷۹	۲۳.۱۲	۰.۹۳	۰.۱۸	-۰.۱۵	۰.۱۱

بازده ماهانه منفی تمامی صندوق‌های سهامی! در جدول فوق، صندوق‌های برتر به لحاظ کمترین ریزش قیمتی مرتب شده‌اند.



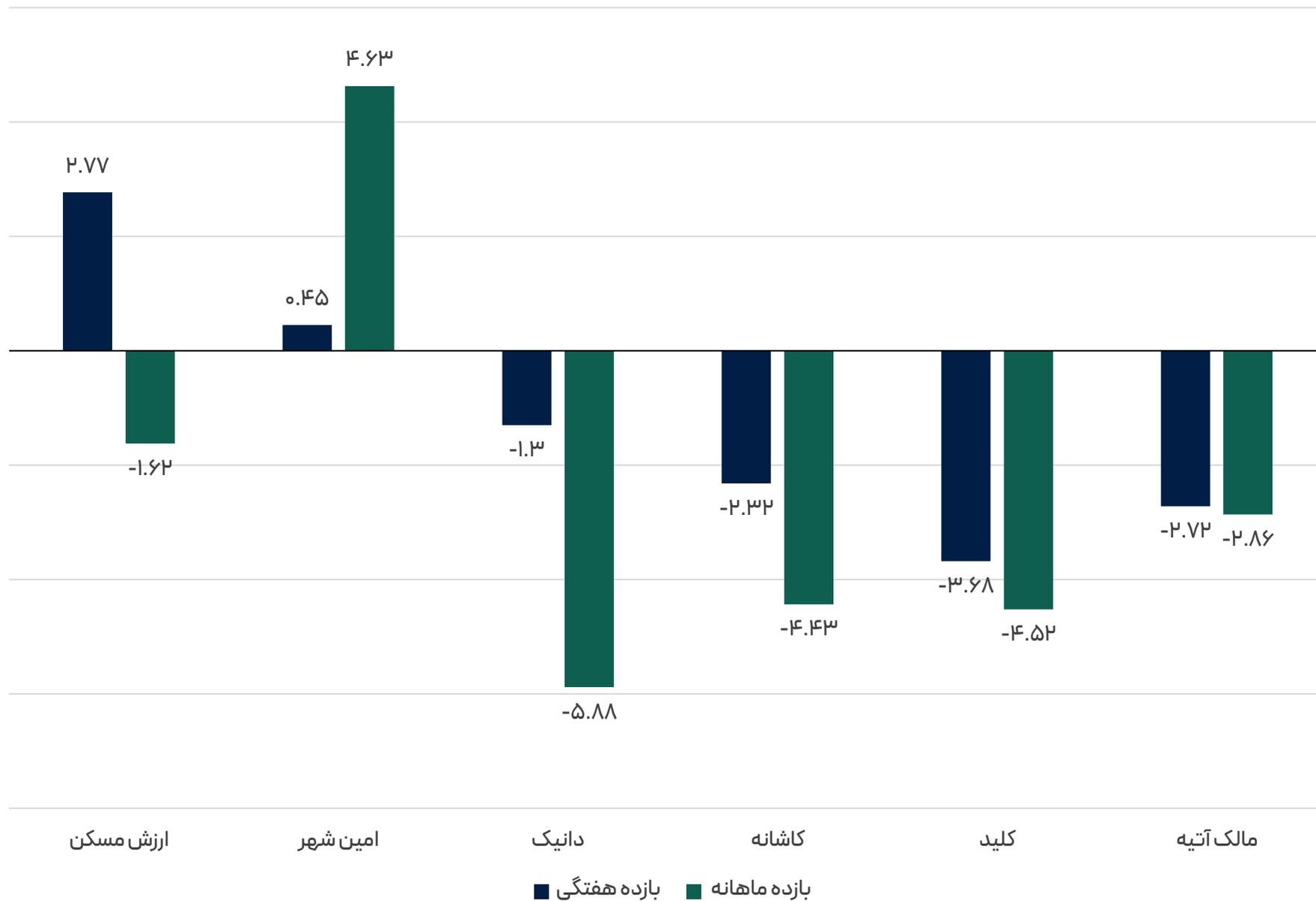
بازده ماهانه صندوق‌های بخشی به درصد (ده صندوق برتر)

نماد	بازدهی		میانگین ارزش معاملات		درصد حساب	میانگین حساب	
	ماهانه ↓	سه ماهه	سه ماهه	یک ماهه		سه ماهه	یک ماهه
دریا	۲.۹۸	۲۶.۱۳	۴۶.۰۹	۴۸.۴۵	۰.۹۱	۰.۷۵	۰.۴۱
انار	۲.۷	۹.۲۸	۳۴.۰۸	۱۴.۸	۵.۹۷	-۰.۲۴	-۰.۸۷
رخش	۰.۰۶	۲۵.۴۶	۵۵.۴۲	۰.۱	۷.۰۶		-۰.۲۱
رماس	۰	۰	۱.۱۱		۴.۵۹		
درسا	-۳.۲۳	۲۰.۶۱	۳۶.۶۹	۰.۱۸	۰.۳۵	-۵.۶۶	-۴.۲۴
عرش	-۴.۴۶	۲۶.۸	۵۵.۹۷	۰.۴	۱۰.۱۴	۴.۴۵	۰.۴۲
ثنا	-۷.۸۷	۹.۵۵	۳۲.۵۶	۰.۰۱	۷.۱۷		-۱.۴۹
مانا	-۷.۹۵	۲۵.۱۸	-۸۶.۱۹	۰.۲۱	-۰.۴۷	-۰.۱	-۰.۲۸
مروارید	-۸.۵۹	-۵.۵۳	-۱۳.۰۹	۰.۰۳	۴.۷۴	۱.۸۹	۶.۹۹

همچنین در صندوق‌های بخشی هم، جز چهار مورد، تمامی صندوق‌ها بازده ماهانه منفی به ثبت رسانده‌اند! در جدول فوق، صندوق‌های برتر ابتدا به لحاظ بازده مثبت، و سپس به لحاظ کمترین ریزش قیمتی مرتب شده‌اند.



بازده صندوق‌های املاک و مستغلات (درصد)

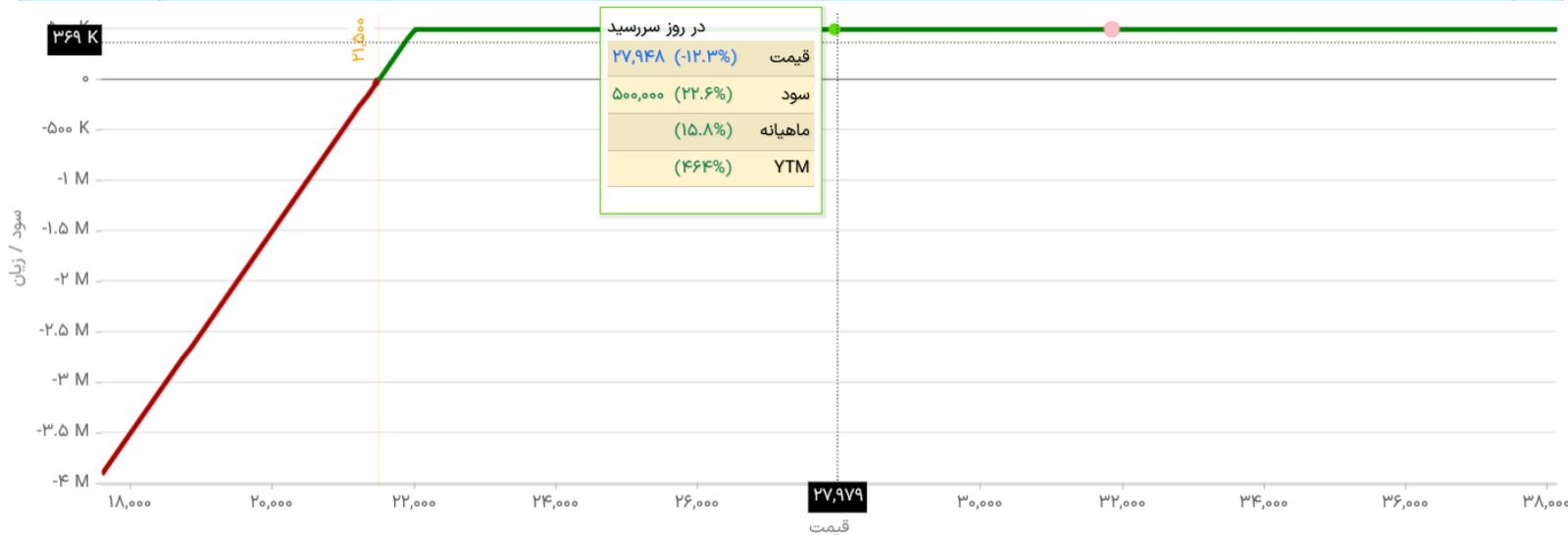


گزارش هفتگی بازار آپشن

پیشنهاد استراتژی ترکیبی بازار آپشن

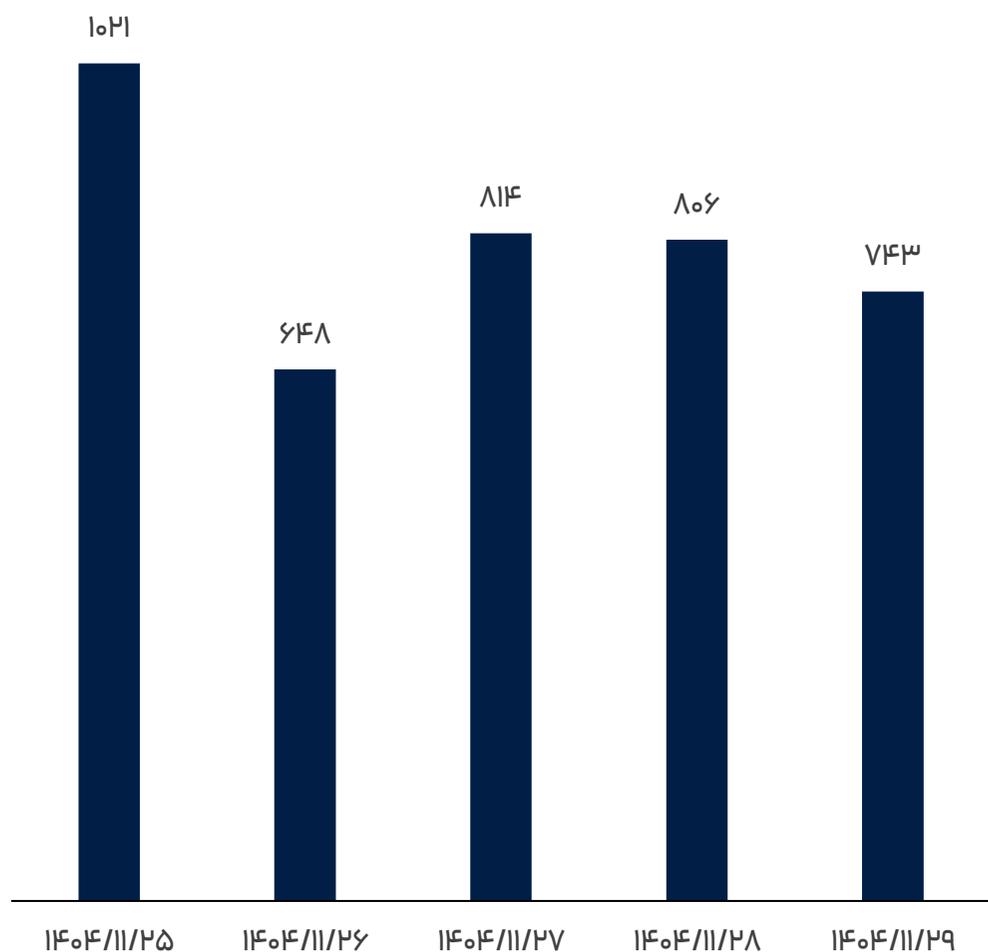
مروری بر استراتژی استرانگل فروش (Short Strangle) با قراردادهای اختیار فروش برج ۱۲ صندوق اهرم (پیشنهاد شده در بولتن هفتگی منتهی به ۱۰ بهمن) این استراتژی با فروش همزمان اختیار فروش و اختیار خرید (هر دو در زیان) با نمادهای ضرهم ۱۲۶ و طهرم ۱۲۵۱ انجام می‌شد. چنانچه در روز سررسید، قیمت صندوق اهرم بین ۲,۰۶۸ 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 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 ۱۲۵۱ به تنهایی) - قیمت امروز اهرم حوالی ۲,۸۶۶ 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		-۳,۱۴۰,۰۰۰
فروش	طهرم ۱۲۵۱	اختیار فروذ	۱	۲۲,۰۰۰	۵۰۰	۰	۱۰۳	۲,۲۱۰,۰۰۰		-۲,۲۱۰,۰۰۰
<div style="display: flex; justify-content: space-between; align-items: center;"> روز ۴۳ + </div>										



گزارش هفتگی بازار آپشن

ارزش معاملات روزانه (میلیارد تومان)



اختیار خریدها با بیشترین ارزش معاملات

ماه‌بانه	هفتگی	روزانه
۱۲۵۸ ضهرم ۲۲,۰۴۷.۲ B	۱۲۵۶ ضهرم ۲,۵۵۱.۹ B	۰۱۳۴ ضهرم ۴۱۸.۵ B
۱۲۵۶ ضهرم ۱۱,۹۱۶.۴ B	۱۲۵۸ ضهرم ۱,۹۲۱.۵ B	۰۱۳۳ ضهرم ۴۱۱.۸ B
۱۲۵۷ ضهرم ۹,۰۸۶.۴ B	۱۲۵۵ ضهرم ۱,۶۴۰.۳ B	۰۱۳۱ ضهرم ۱۵۸.۷ B
۱۲۵۵ ضهرم ۸,۴۳۳.۲ B	۰۱۳۴ ضهرم ۱,۴۱۶.۲ B	۰۱۳۲ ضهرم ۱۵۲.۹ B
۱۲۴۲ ضستا ۴,۶۲۶.۶ B	۱۲۵۷ ضهرم ۱,۰۸۱.۱ B	۰۱۳۰ ضهرم ۱۱۴.۷ B

اختیار فروشها با بیشترین ارزش معاملات

ماه‌بانه	هفتگی	روزانه
۱۲۵۶ طهرم ۹,۴۶۸ B	۱۲۵۶ طهرم ۲,۰۶۴ B	۰۱۳۲ طهرم ۵۵۱.۳ B
۱۲۵۸ طهرم ۵,۴۵۲.۴ B	۱۲۵۵ طهرم ۸۹۳.۵ B	۰۱۳۳ طهرم ۳۰۷.۶ B
۱۲۵۷ طهرم ۴,۸۷۰.۳ B	۱۲۴۲ طستا ۶۸۱.۲ B	طملت ۱۲۰۵ ۲۲۴.۵ B
۱۲۵۵ طهرم ۳,۷۰۵ B	۱۲۵۸ طهرم ۶۵۳.۱ B	طستا ۱۲۴۲ ۲۱۵.۳ B
۱۲۴۲ طستا ۱,۹۶۴.۴ B	۰۱۳۲ طهرم ۶۲۰.۴ B	طستا ۱۲۴۳ ۱۴۳.۱ B



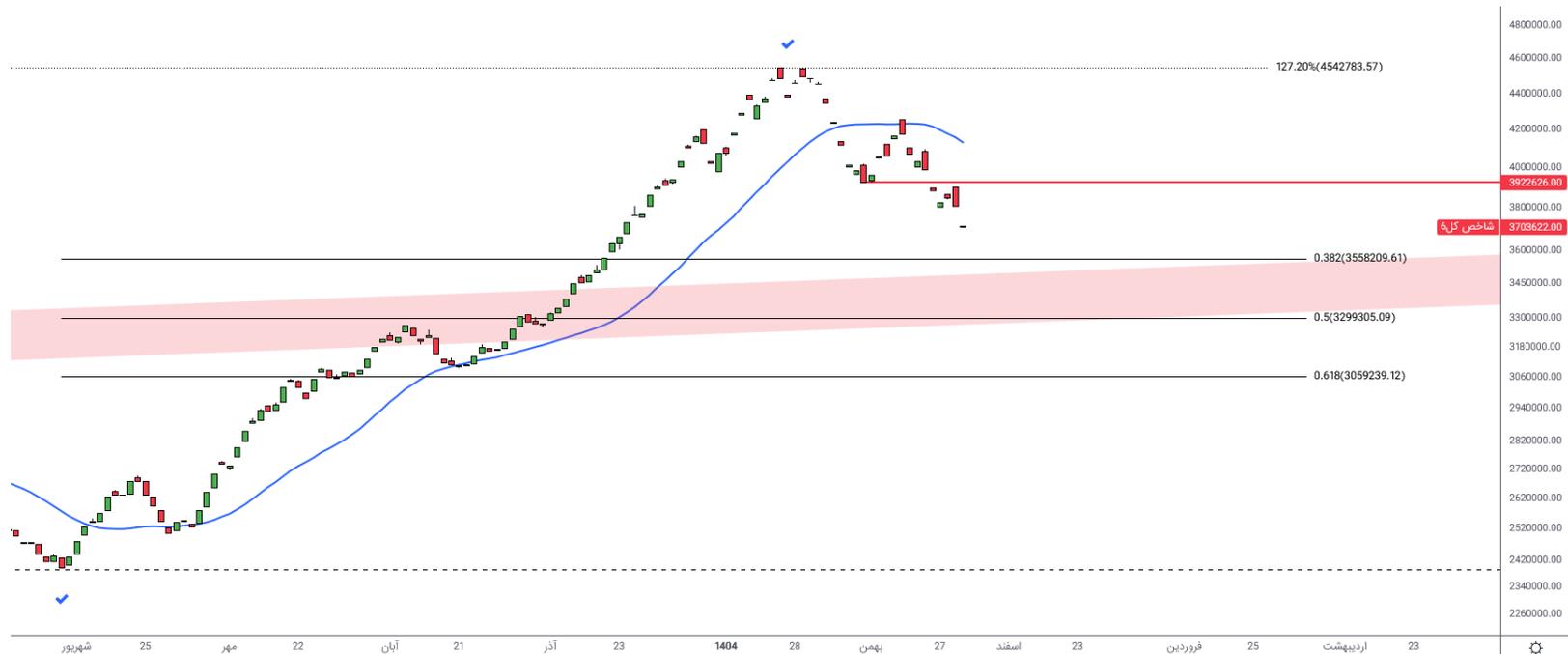
تحليل تکنیکال هفتگی شاخص کل بورس



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.

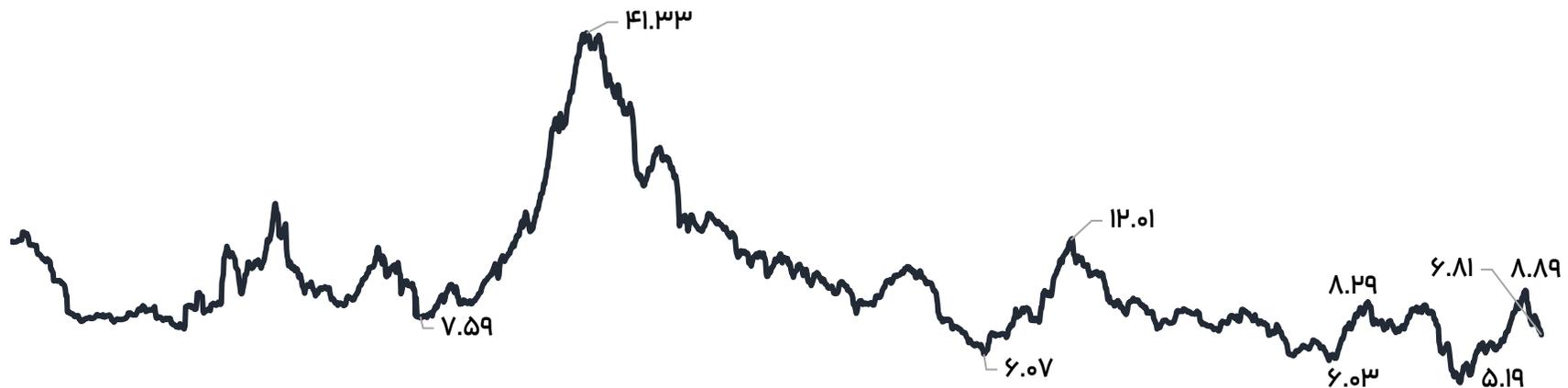
پس از اصلاحی که از سقف اردیبهشت ماه سال ۱۴۰۲ آغاز شد، شاخص کل بورس در آبان ماه سال گذشته، صعود خوبی را آغاز کرد که در شاخص کل به بیش از ۶۵ درصد رشد رسید و در اردیبهشت ماه سال جاری، سقف جدیدی در تاریخچه ی شاخص کل، به ثبت رسید. پس از آن، روند اصلاحی آغاز شد که در تابستان با شکل گیری جنگ ۱۲ روزه بین ایران 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 های 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. پس از آن، در بازگشت به میانگین متحرک شکسته شده، شاهد واکنش دوباره منفی بودیم و در نهایت با شکست کف شکل گرفته در محدوده ۳ میلیون و ۹۲۰ هزار واحد، اصلاح بازار به سمت محدوده های فیبوناچی مندرج بر روی چارت، تایید شد و حال باید دید واکنش بازار و شاخص کل به محدوده های ترازهای فیبوناچی که در تلاقی با مقاومت داینامیک ۵ ساله شکسته شده نیز هستند، چه خواهد بود.



نسبت P/E و P/S بازار سرمایه

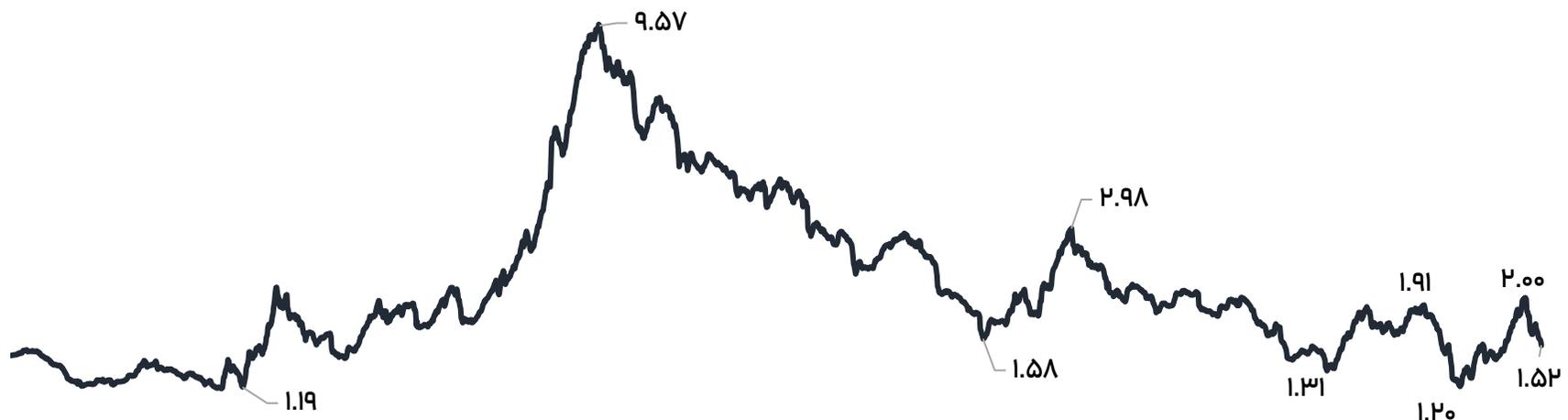
نسبت P/E (قیمت به سود)، یک معیار برای سنجش ارزش سهام است که از قیمت فعلی سهام بر سود هر سهم به دست می‌آید. این نسبت نشان می‌دهد که سرمایه‌گذاران برای هر واحد سود شرکت چه میزان پول پرداخت می‌کنند. به طور کلی هرچه نسبت P/E پایین‌تر باشد، ارزندگی سهام بیشتر است.

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.

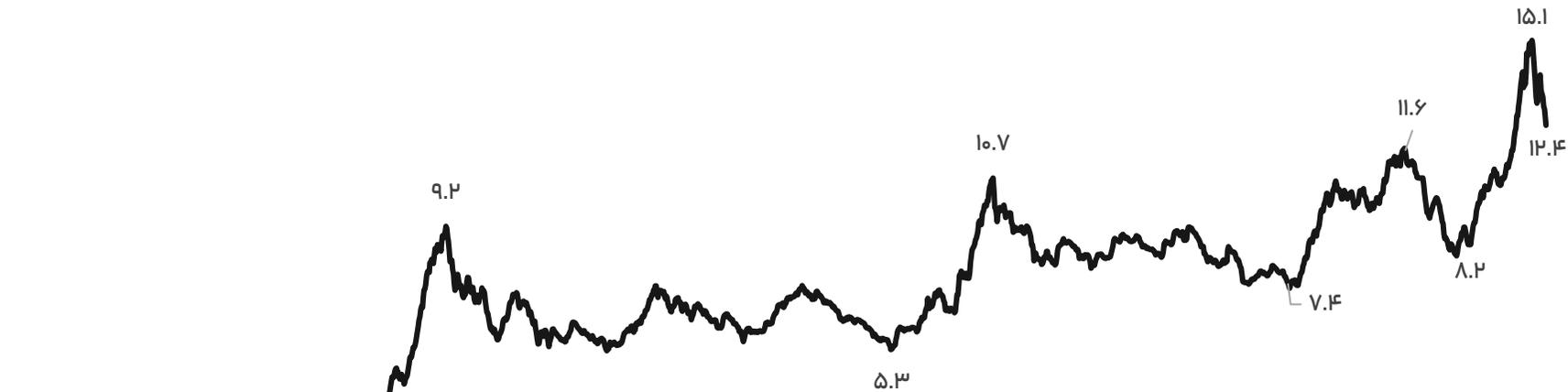
روند تغییرات P/S بازار سرمایه از سال ۱۳۹۶ تا کنون



ارزش دلاری و ریالی بازار سرمایه

با وجود رشد ریالی بازار و سقف شکنی شاخص کل و شاخص هموزن طی یک سال اخیر، اما از لحاظ ارزش دلاری، بازار تقریباً رشدی نداشته و در کف ۶ ساله و بلندمدت خود قرار دارد که می‌تواند به نوعی نشان‌دهنده ارزندگی بازار سرمایه حتی با وجود رشدهای جسته و گریخته 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)





واگذاری سهام تودلی سایپا وارد مرحله اجرایی شد.

رئیس هیات عامل سازمان گسترش و نوسازی صنایع ایران از تداوم فرایند قانونی واگذاری سهام تودلی گروه خودروسازی سایپا خبر داد و اعلام کرد مراحل اجرایی این واگذاری در حال انجام است.



قیمت جدید گاز اعلام شد.

قیمت گاز طبیعی سبک و شیرین خوراک شرکت‌های پتروشیمی و نرخ گاز سوخت صنایع تعیین و اعلام شد.

برگزاری دور دوم مذاکرات بین ایران و امریکا

دور دوم مذاکرات بین ایران و امریکا، در سفارت عمان، واقع در ژنو برگزار شد. با این وجود، نتیجه نهایی هنوز حاصل نشده و توافق میان ایران و امریکا، کماکان در هاله‌ای از ابهام قرار دارد.



شگویا

افزایش سرمایه ۴۲ درصدی شگویا از محل سود انباشته مورد تایید حسابرس قرار گرفت.

حبندر

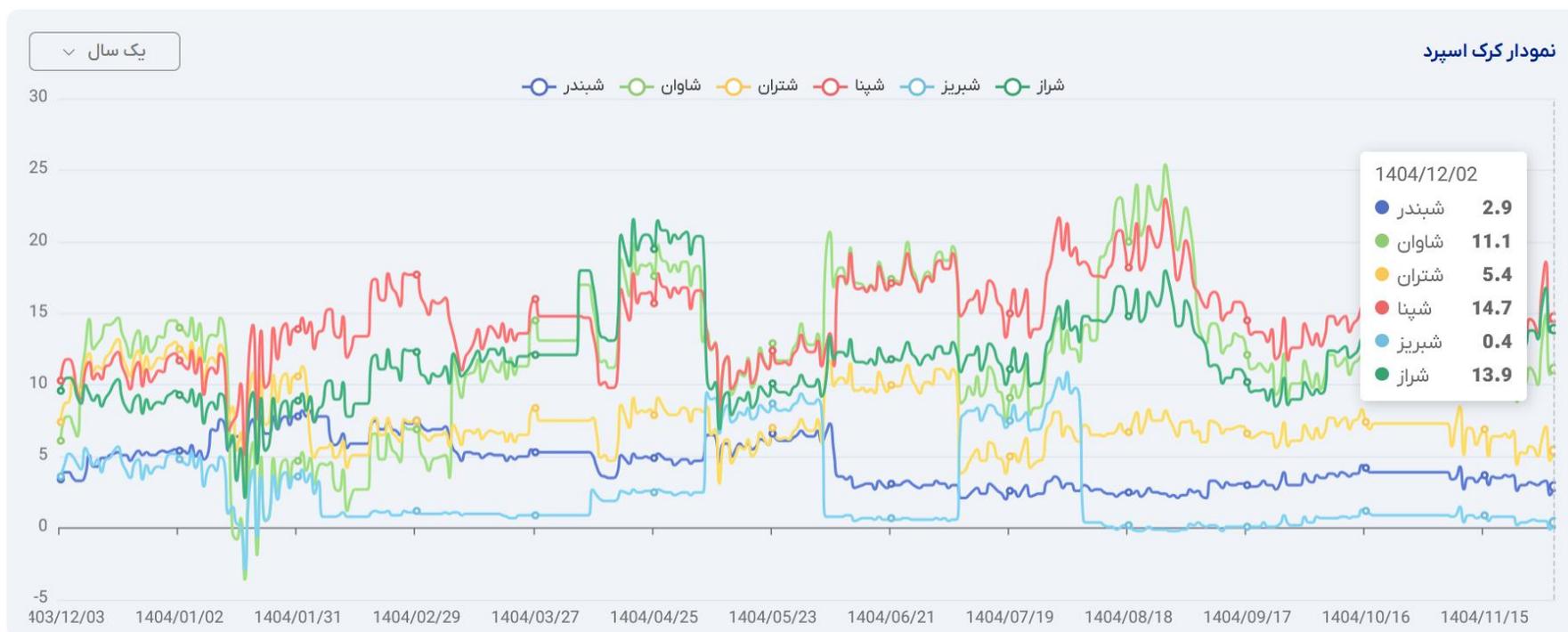
مجوز افزایش سرمایه ۳۰۰ درصدی حبندر از محل مطالبات حال شده سهامداران و آورده نقدی صادر شد.

دفرا

دفرا نرخ انواع سرم‌های تزریقی را ۵۰ درصد افزایش داد.



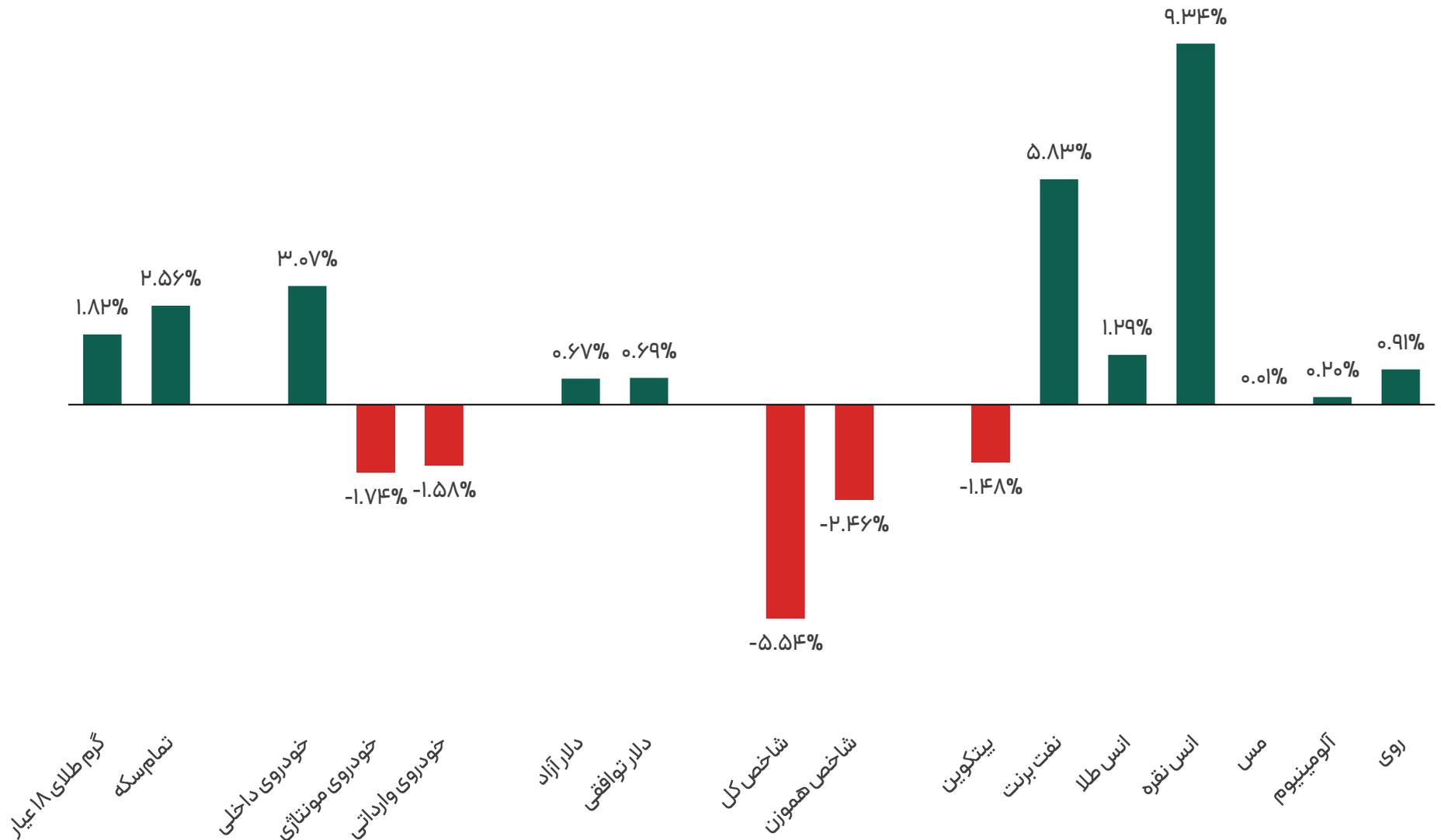
کرک اسپرد پالایشی‌ها



میانگین کرک اسپرد: **شبندر** \$ ۴.۴ شاوان \$ ۱۲.۲ شتران \$ ۷.۶ شپنا \$ ۱۴.۶ شبریز \$ ۲.۶ شراز \$ ۱۱.۹

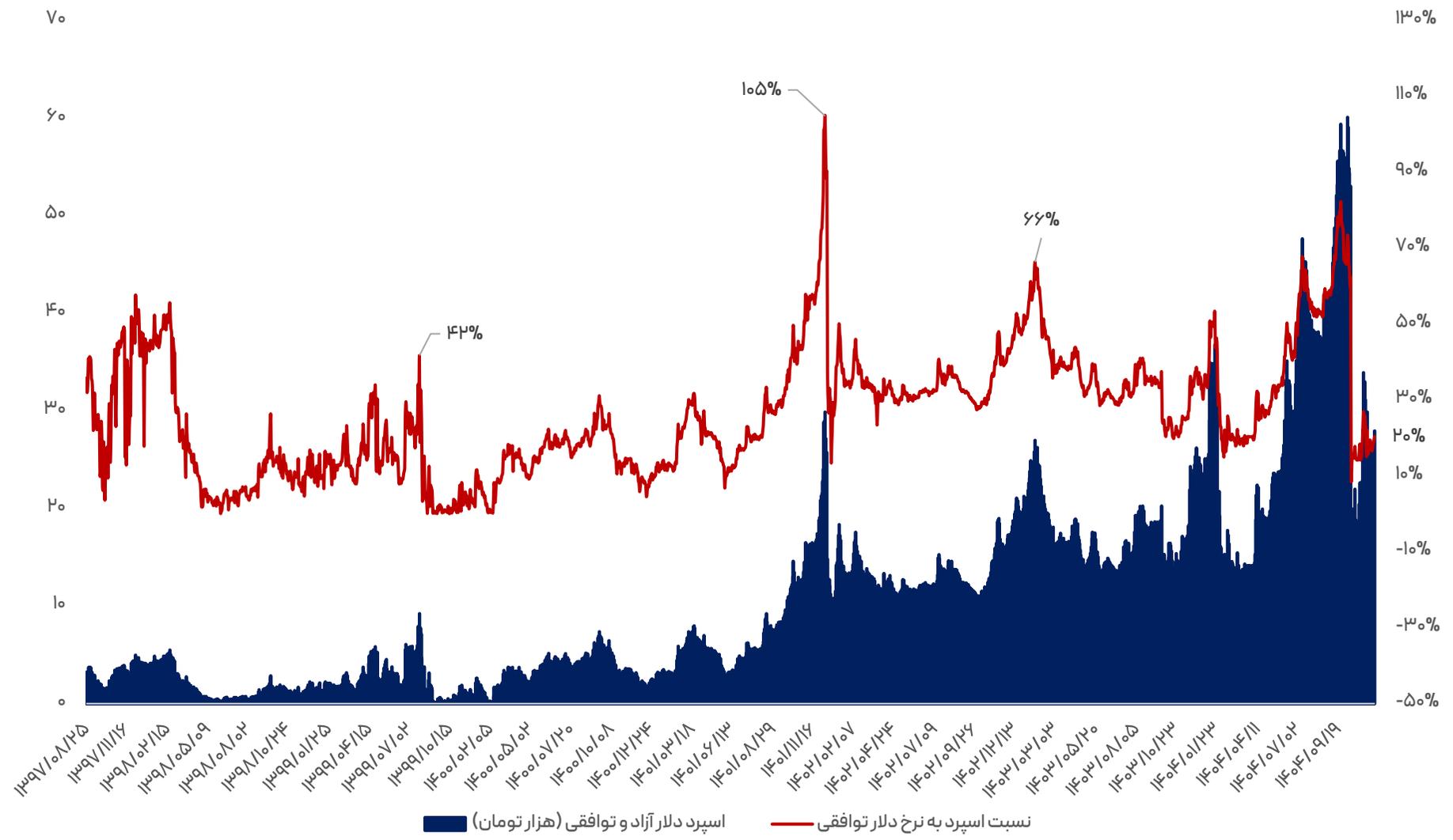


بازده هفتگی بازارهای موازی و جهانی طی هفته اخیر



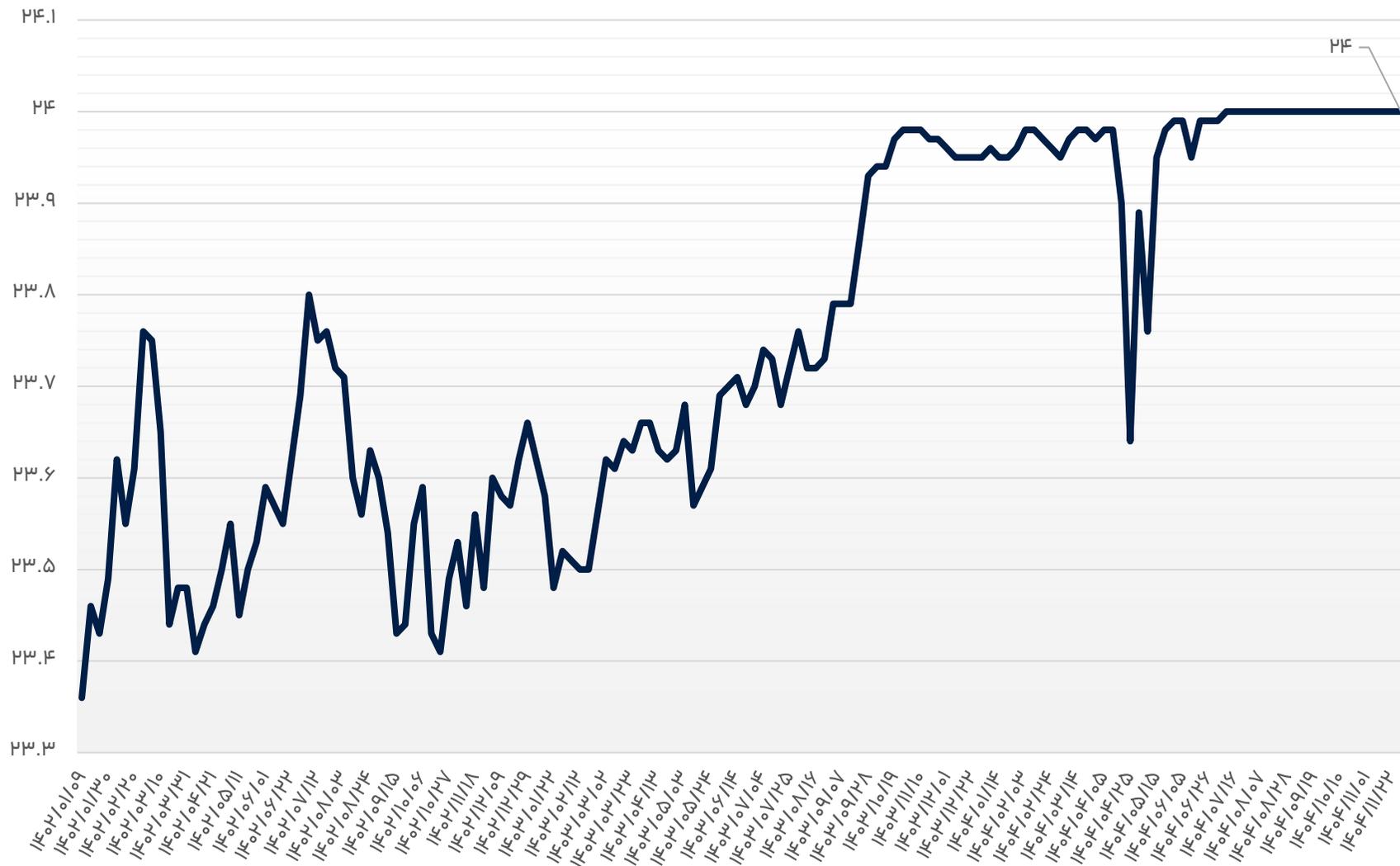
اسپرد (شکاف) دلار توافقی و دلار آزاد

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 و متوسط قیمت نهاده‌های ساختمانی شهر تهران فصل پاییز ۱۴۰۴ (بر مبنای سال پایه ۱۴۰۲)

شاخص کل

در فصل پاییز ۱۴۰۴ شاخص قیمت نهاده‌های ساختمانی مسکونی شهر تهران ۲۰۴.۸ بود که نسبت به فصل قبل ۱۸.۴ درصد، نسبت به فصل مشابه سال قبل ۶۱.۳ درصد و در چهار فصل منتهی به فصل جاری نسبت به دوره‌ی مشابه سال قبل ۴۴.۹ درصد افزایش داشته است.

افزایش تورم فصلی

در فصل پاییز ۱۴۰۴ درصد تغییرات شاخص قیمت نهاده‌های ساختمانی مسکونی شهر تهران نسبت به فصل قبل (تورم فصلی) ۱۸.۴ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۶.۳ درصد) ۱۲.۱ واحد درصد افزایش داشته است. در این فصل، در بین گروه‌های اجرایی، بیشترین تورم فصلی با ۳۶.۴ درصد مربوط به گروه اجرایی «تاسیسات مکانیکی و انواع عایق حرارتی» بوده است و این در حالیست که گروه «سیمان، بتن و انواع شن و ماسه» با ۱.۸ درصد کاهش نسبت به فصل قبل مواجه شده است.



افزایش تورم نقطه به نقطه

در فصل پاییز ۱۴۰۴ درصد تغییرات شاخص قیمت نهاده‌های ساختمان‌های مسکونی شهر تهران نسبت به فصل مشابه سال قبل (تورم نقطه به نقطه) ۶۱.۳ درصد بود که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۴۳.۶ درصد) ۱۷.۷ واحد درصد افزایش داشته است. در این فصل در بین گروه‌های اجرایی، بیشترین تورم نقطه به نقطه با ۹۶.۶ درصد مربوط به گروه اجرایی «چوب» و کمترین تورم نقطه به نقطه با ۲۸.۲ درصد مربوط به گروه اجرایی «شیشه» بوده است.

افزایش تورم فصلی

در فصل پاییز ۱۴۰۴ درصد تغییرات شاخص قیمت نهاده‌های ساختمان‌های مسکونی شهر تهران در چهار فصل منتهی به فصل جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل (تورم سالانه) ۴۴.۹ درصد بوده است که در مقایسه با همین اطلاع در فصل قبل (۳۶.۷ درصد) ۸.۲ واحد درصد افزایش داشته است. در این فصل در بین گروه‌های اجرایی بیشترین تورم سالانه با ۷۰.۷ درصد مربوط به گروه اجرایی «چوب» و کمترین تورم با ۲۲.۹ درصد مربوط به گروه «شیشه» بوده است.



با سپاس از توجه شما

