



کارگزاری خبرگان سهام

گزارش تحلیلی بازارها

به همراه گزارش ویژه

ماخبرگان بازار هستیم

مجله شماره سی و هشت



کارگزاری خبرگان سهام

فهرست

۱	اخبار ماهی که گذشت
۲	گزارش بازار سرمایه در مهر ماه
۷	صندوق اندیشه خبرگان
۱۳	کامودیتی ها
۱۵	تحلیل مهرماه بورس کالا
۱۶	تحلیل مهرماه اختیار معامله
۱۸	هفته آخر مهر



شبکه های اجتماعی

 khobregan.com

 ۰۲۱-۴۲۳۸۲

 @khobregan_saham

صفحه آزایی:

صدیقه کرمی

نویسندگان و تحلیلگران:

نیلا قاسمی، غلامرضا ترابی زاده،
مهدی مالکی

تهیه شده توسط:

کارگزاری خبرگان سهام

سر دبیر

مریم نصر



روزنامه «اسرائیل هیوم» مدعی شد: عربستان سعودی، بحرین و امارات به دولت آمریکا هشدار دادند؛ اگر شروط توافق را بر حماس تحمیل و خلع سلاح‌هایشان نکنند، در بازسازی غزه کمکی نخواهند کرد.

مقام روس: هند یکی از شرکای اصلی روسیه در حوزه انرژی است؛ عرضه نفت به این کشور ادامه دارد.

اولیانوف: موضوع عدم اشاعه برنامه هسته‌ای ایران از دستور کار شورای امنیت حذف شد.

خبرگزاری رویترز به نقل از منابع امنیتی مدعی شد که ارزیابی‌های اولیه نشان می‌دهد که انفجار کشتی فالکون در خلیج عدن که دو روز گذشته واقع شده بود، مرتبط با محموله آن بوده و عامل خارجی در انفجار آن دخیل نبوده است.

رئیس بانک مرکزی از انتقال تدریجی ارز صادراتی صنایع فولاد و پتروشیمی به بازار دوم مرکز مبادله جهت مدیریت آثار تورمی خبر داد.

هیات عالی بانک مرکزی، دستورالعمل تاسیس، فعالیت، انحلال و نظارت بر کارگزاران رمزیول را تصویب کرد. انجمن فولاد با انتقاد از سیاست‌های دوگانه نرخ تسعیر ارز در زنجیره، خواهان فراهم کردن شرایط فروش ارز صادراتی در تالار دوم بازار توافقی شد.

رئیس مرکز اطلاعات و رفاه ایرانیان از حذف یارانه ۸ میلیون نفر از افراد پردرآمد خبر داد و گفت: تا پایان سال باید یارانه ۱۸ میلیون نفر قطع شود.

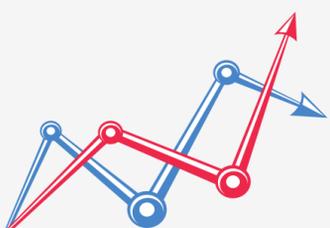
انتقال بیت‌کوین یا پرداخت با تتر بدون صدور صورتحساب الکترونیکی می‌تواند برای خریداران حکم درآمد اتفاقی داشته باشد و مشمول مالیات سنگین شود.

نماد معاملاتی ۶ محصول کاتد مس، شمش روی، میلگرد، گندله سنگ آهن، خودرو و قیر به منظور آغاز معاملات گواهی سپرده کالایی در بورس کالای ایران از 27 مهر در تابلوی بازار مالی بورس کالا ثبت و از دوشنبه ۲۸ مهر ماه معاملات آنها آغاز شد.

رئیس بانک مرکزی از تثبیت نرخ دلار ۷۰ هزار تومانی در مرکز مبادله رسمی و تامین همه نیازهای وارداتی با همین نرخ خبر داد.

طبق آخرین آمارهای مهم از بازار سرمایه، تعداد سهامداران فعال حقیقی و حقوقی بیش از ۱۷۵ هزار نفر بود که طی ماه گذشته تغییری نداشت.

مدیرعامل تامین سرمایه کیمیا، راه‌اندازی معاملات گواهی سپرده کاتد مس را دروازه‌ای برای سرمایه‌گذاری و تأمین مالی حوزه فلزات اساسی دانست.

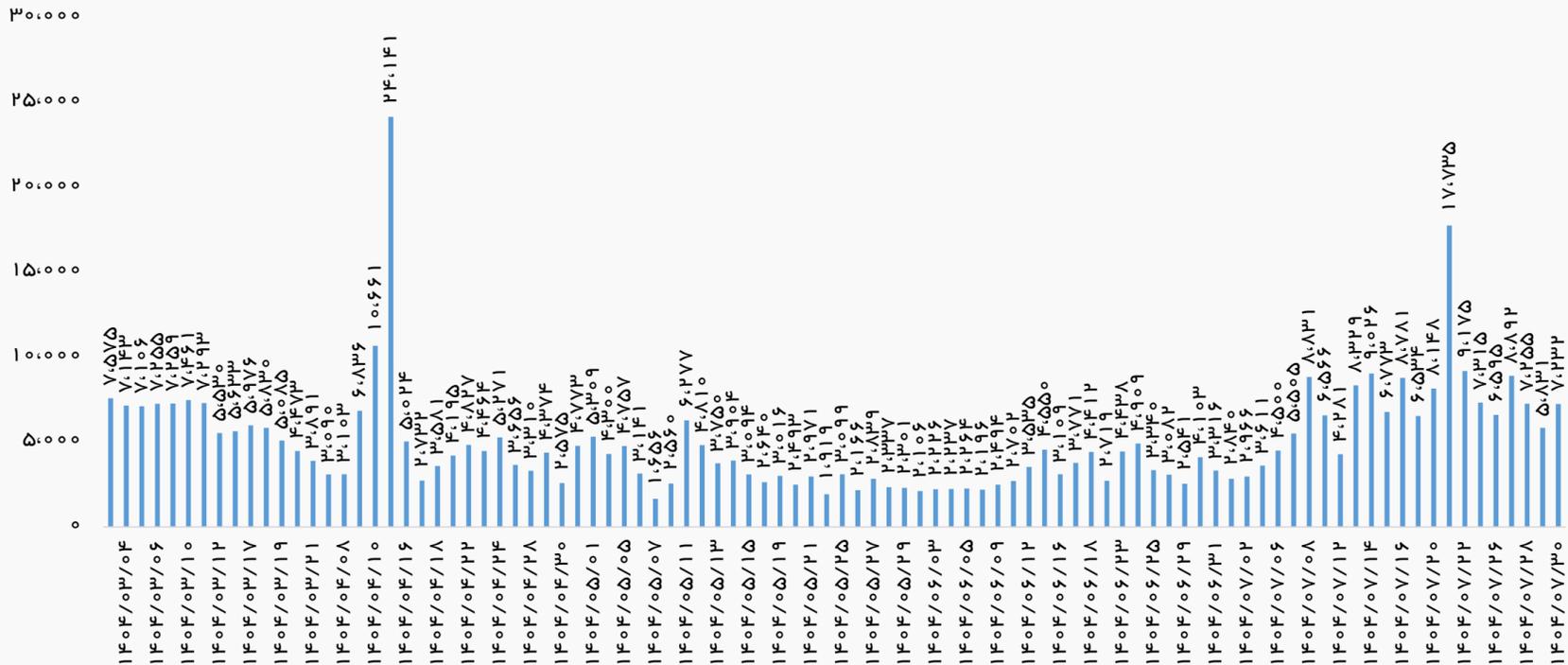




بازار در مهرماه‌ی که گذشت



ارزش معاملات خرد (میلیارد تومان)

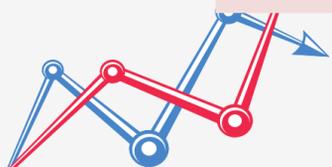


نمودار فوق روند ارزش معاملات خرد بازار را از ابتدای خرداد ماه ۱۴۰۴ نشان می‌دهد. جمع ارزش معاملات خرد طی مهرماه ۱۵۶ هزارمیلیارد تومان بوده که نسبت به ماه گذشته افزایش ۱۴۵ درصدی (ارزش معاملات ماه گذشته ۶۴ هزار میلیارد تومان) را نشان می‌دهد.

کدهای خریدار حقیقی

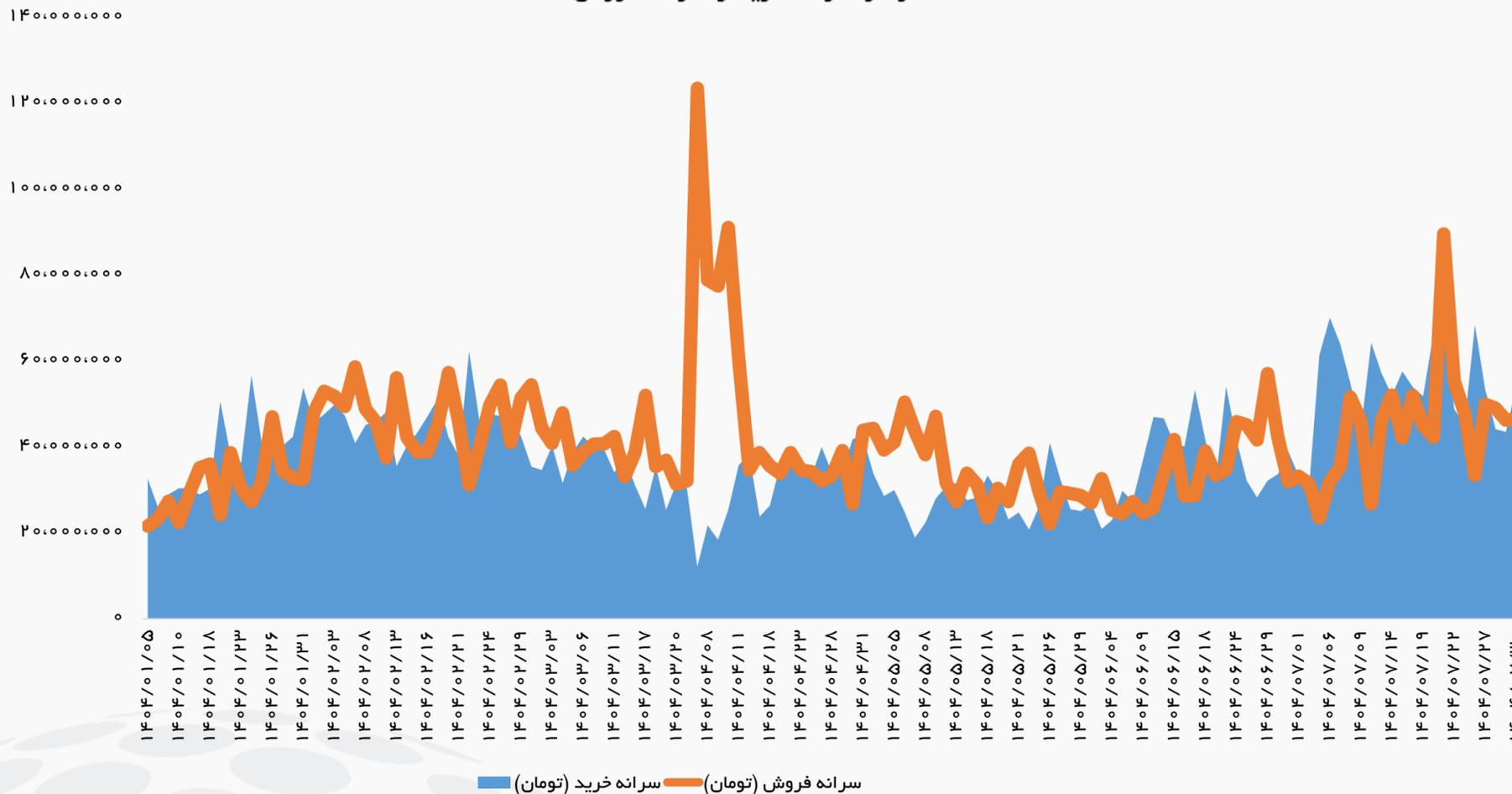


نمودار فوق روند تعدادهای خریدار در هر روز را نشان می‌دهد. در آخرین روز بررسی این عدد به ۱۰۴.۳۰۵ کد رسید. برای مقایسه بهتر، بیشترین تعداد کدهای خریدار در سال ۱۴۰۴ معادل ۲۲۴.۰۰۰ کد بود و رکورد تاریخی مربوط به سال ۱۳۹۹ با ۱.۸۳۰.۰۰۰ کد ثبت شده است.

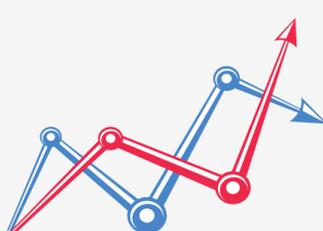




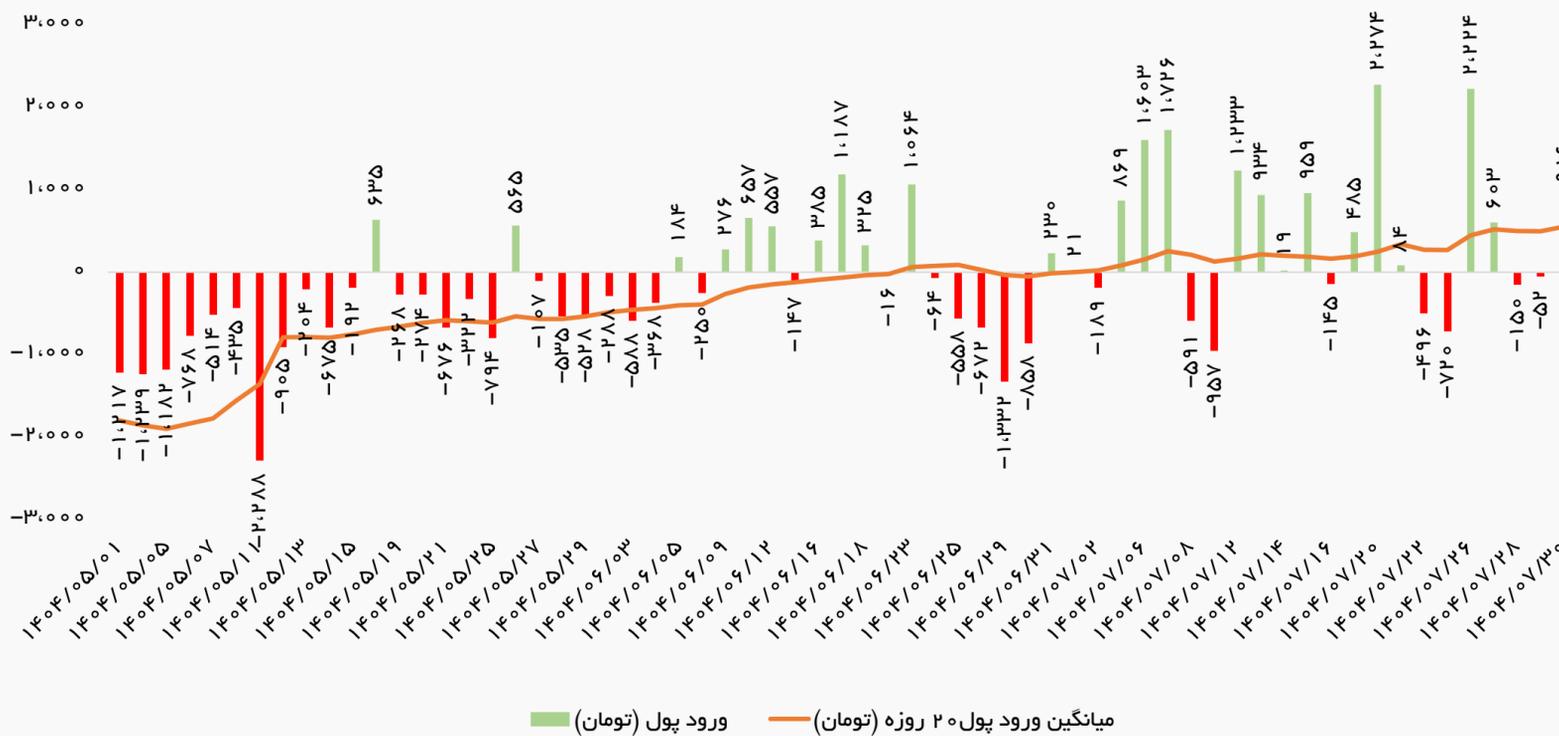
نمودار سرانه خرید و سرانه فروش



طی مهرماه، جمع سرانه خرید ۱.۲۰۵.۱۳۵.۹۹۸ تومان بوده که نسبت به ماه گذشته افزایش ۶۶ درصدی نشان می دهد. جمع سرانه فروش ۹۷۷,۹۲۷,۲۶۲ تومان بوده است و نسبت به ماه گذشته افزایش ۴۱ درصدی نشان می دهد. و قدرت خرید طی ماه اخیر ۱۳ بوده است.

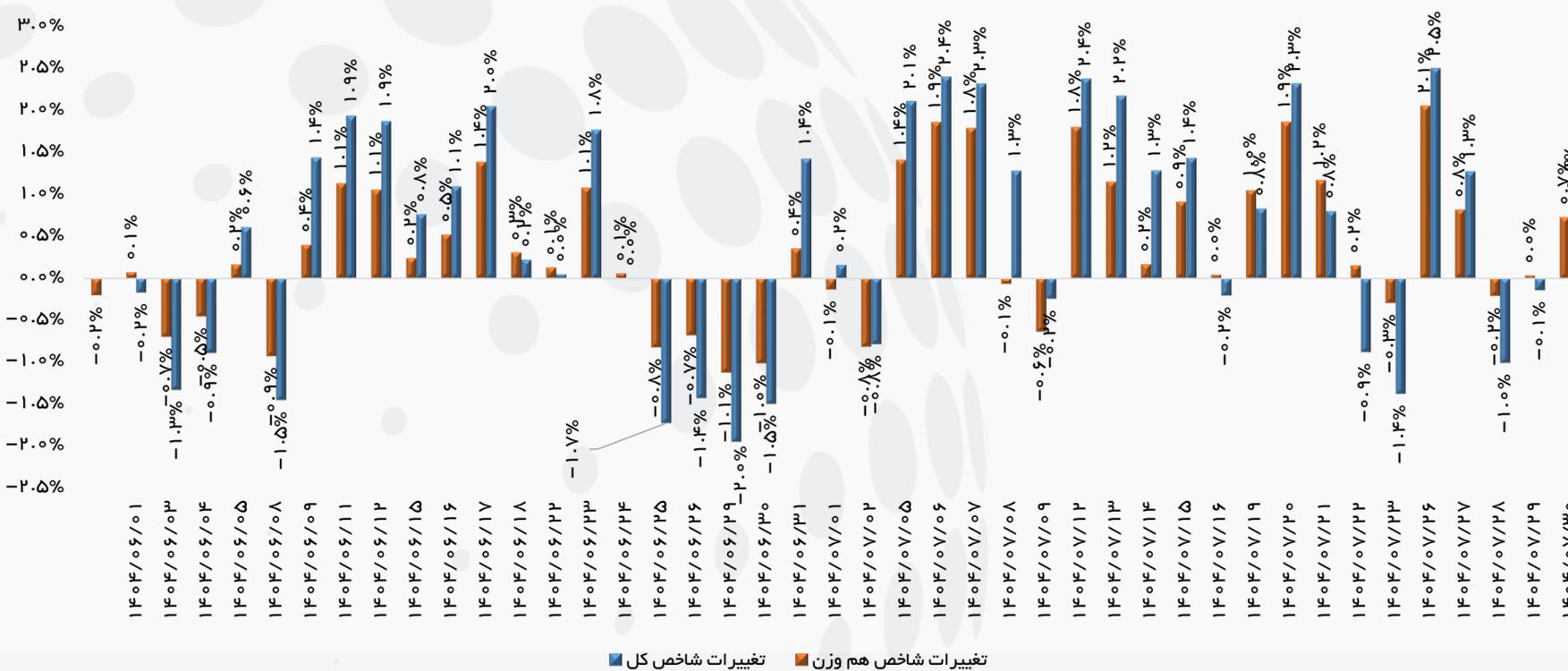


نمودار ورود و خروج پول

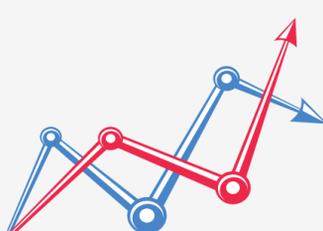


در طی ماه اخیر حدود ۱۰.۶۴۹ همت ورود پول به بازار اتفاق افتاده است، این درحالی است که در ماه گذشته خروج پول ۰.۲۷۷ همت بوده است.

نمودار تغییرات شاخص کل و هموزن



در طی ماه اخیر، شاخص کل ۱۹.۵ درصد و شاخص هم وزن ۱۴.۸ درصد افزایش داشتند و طی شهریور ماه شاخص کل ۲.۹ درصد و شاخص هم وزن ۱.۱ درصد افزایش نشان دادند.





بیشترین ریزش یک ماه اخیر

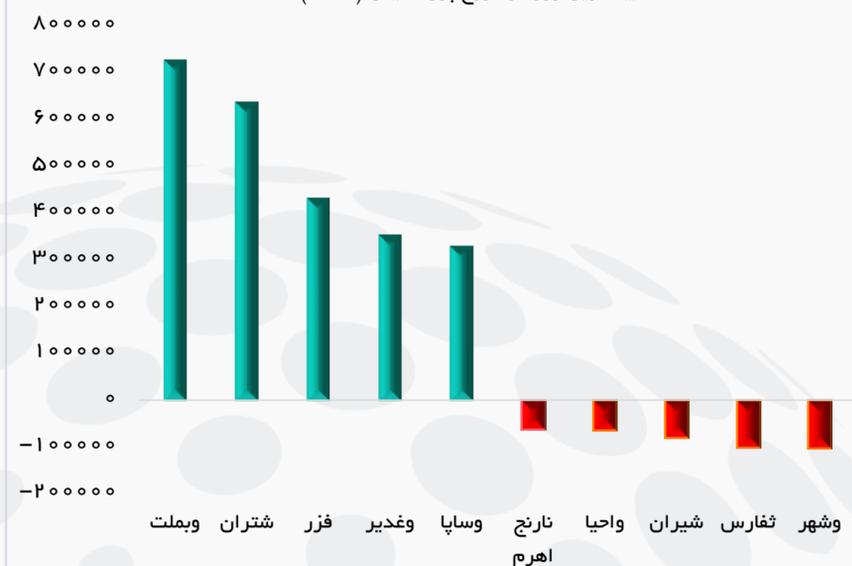
ارزش بازار (همت)	درصد تغییر	نماد
۲۰۵۴	-۳۸	دکوثر
۰.۸۳۵	-۳۰	وحکمتح
۰.۹۶۶	-۳۰	کایتا
-	-۲۵	فکمند
۰.۲۷	-۲۳	ثقزوی
۰.۷۷۹	-۲۳	کازرو

بیشترین رشد یک ماه اخیر

ارزش بازار (همت)	درصد تغییر	نماد
۲۰۵۴	۱۴	کههدا
۰.۴۸۸	۱۱	تکنو
۲.۳۳	۹	فرآور
۰.۷۸۹	۶	فگستر
۴۰.۱۵	۵	فپتا
۴۱.۹۳	۳	فزر

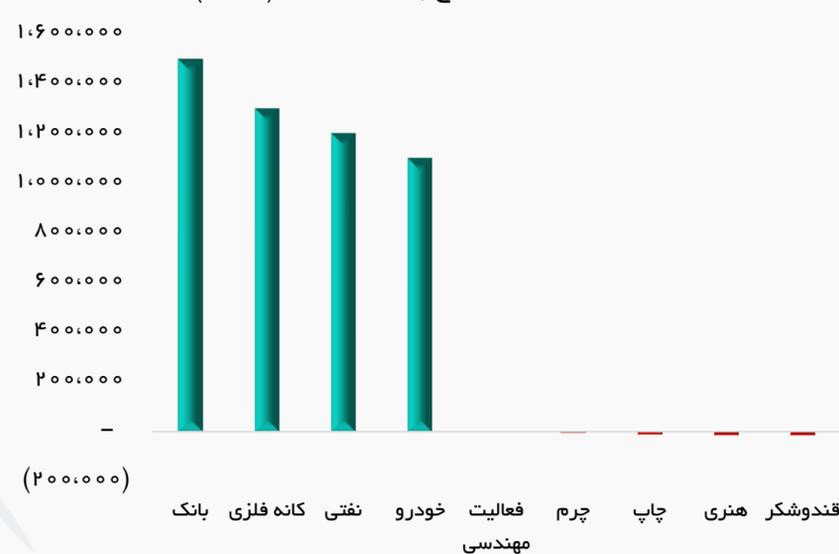
میلیون تومان

بیشترین ورود و خروج پول حقیقی (ماهانه)

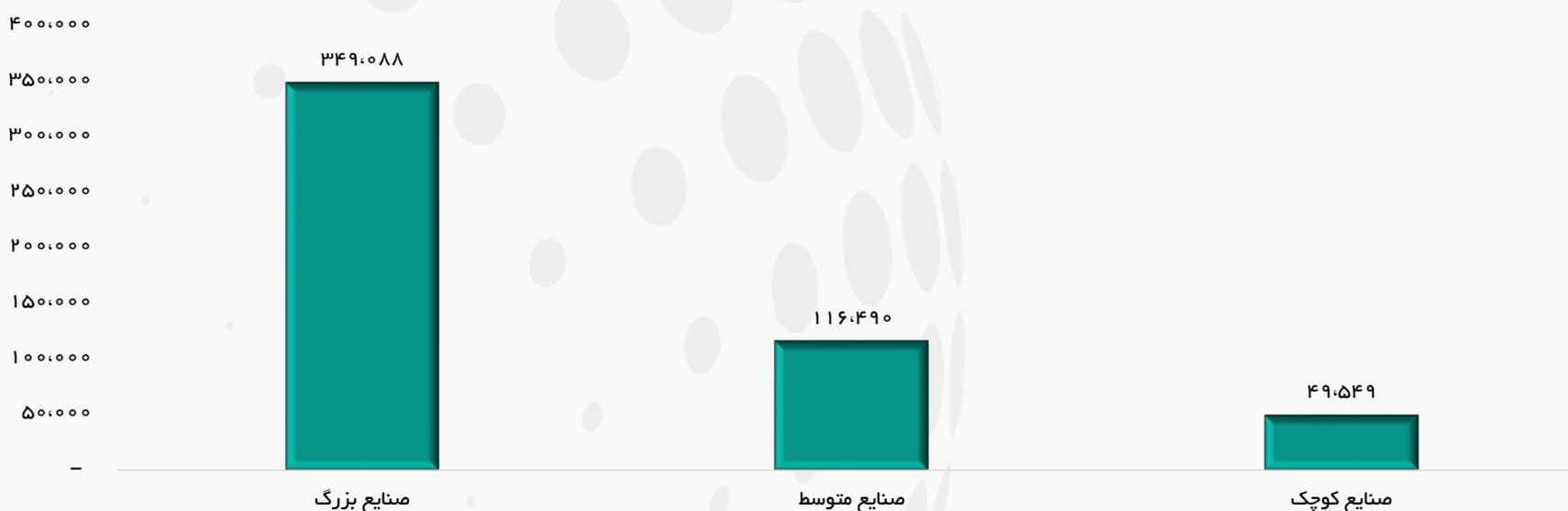


میلیون تومان

بیشترین ورود و خروج پول به صنعت (ماهانه)



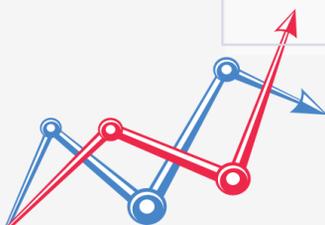
ورود و خروج پول به صنایع - میلیون تومان (میانگین ۳۰ روز گذشته)



صنایع بزرگ: صنایع با ارزش بازار بالای ۴۰ همت (۵۳ شرکت)

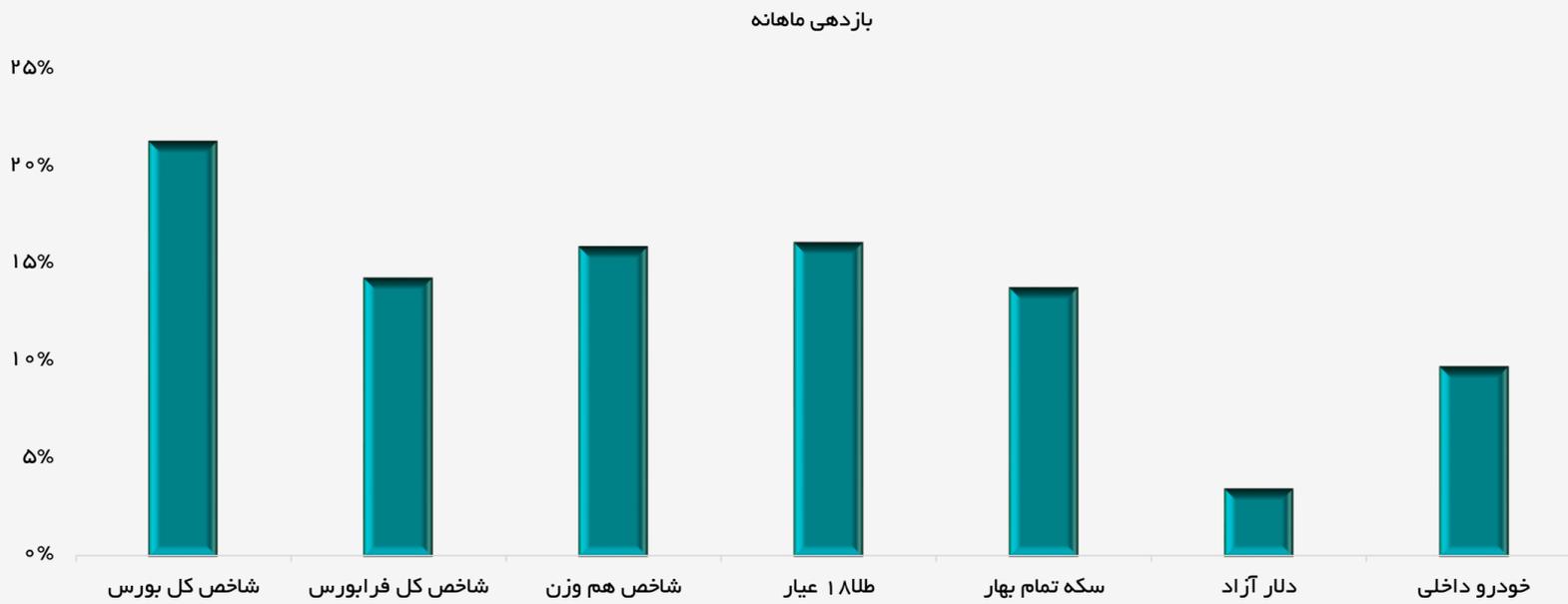
صنایع متوسط: صنایع با ارزش بازار بین ۱۰ تا ۴۰ همت (۱۰۰ شرکت)

صنایع کوچک: صنایع با ارزش بازار کمتر از ۱۰ همت (۵۷۶ شرکت)

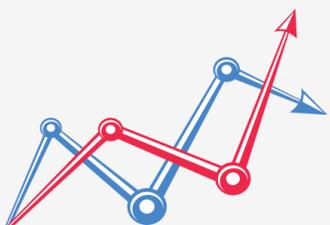




بازدهی ماهانه بازارها



طی یک ماهه اخیر شاخص کل با ۲۱ درصد افزایش بیشترین بازدهی و دلار آزاد با ۳ درصد کمترین بازدهی را داشتند.



آغاز فعالیت: ۱۳۹۴

صندوق اندیشه خبرگان

مقایسه بازدهی اندیشه خبرگان و شاخص کل در سال اخیر

۱۰۰.۱%

بازدهی اندیشه خبرگان

۵۶.۳%

بازدهی شاخص کل

پربازده‌ترین صندوق سهامی سال اخیر





اندیشه خبرگان

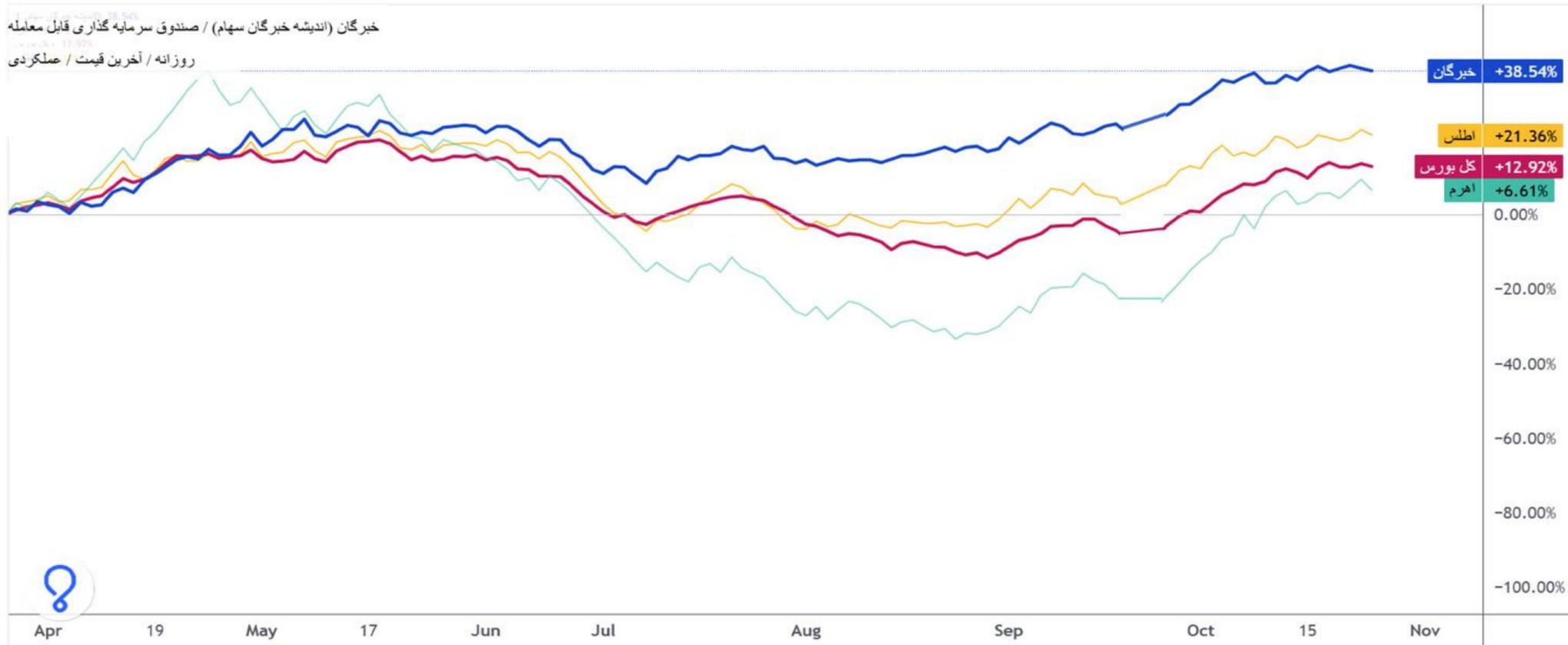
شرکت سهامی خاص سبدگردان هامرز

برترین صندوق سهامی یکسال اخیر

صندوق سرمایه گذاری خبرگان پیشتاز بازدهی در بین صندوق های قابل معامله سهامی

در میان تمامی صندوق های سهامی، صندوق سرمایه گذاری خبرگان با ثبت بازدهی ۱۰۰.۱% سالانه در رتبه اول صندوق های سهامی قرار گرفته است. شایان ذکر است که این صندوق در دوره مورد بررسی ۴۳.۸% بازدهی مازاد نسبت به شاخص کل کسب کرده و عملکردی فراتر از بازار داشته است.

مقایسه عملکرد سالانه صندوق خبرگان با شاخص کل و صندوق های اهرم و اطلس





صندوق های سهامی



پرتو	اوج	هوشیار	بازده زمانی
%۴.۲۱	%۴.۳۲	%۵.۶۴	بازده هفتگی
%۱۸.۴۶	%۲۰.۱۱	%۱۸.۷	بازده ماهانه
%۷.۵۲	%۹.۴	%۱۱.۴۴	بازده ۳ ماهه
%۰.۴۶	%-۱.۱۵	%۰.۷۳	بازده ۶ ماهه
%۷۹.۴۲	%۴۲.۷	%۴۷.۴۱	بازده یکساله
۰.۷۹	۰.۸۶	۰.۸	ضریب بتا

صندوق های مختلط

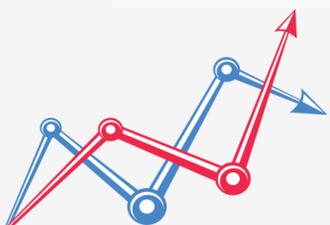


هیبرید	صنوبین	آفرین	بازده زمانی
%۱.۶۱	%۱.۶۳	%۲.۲۳	بازده هفتگی
%۱۱.۳۸	%۹.۹۱	%۱۱.۲۵	بازده ماهانه
%۹.۶۷	%۱۱.۲۸	%۸.۰۱	بازده ۳ ماهه
%۸.۹۹	%۱۲.۶۱	%۳.۱۱	بازده ۶ ماهه
%۵۸.۷۴	%۵۷.۸۵	%۳۵.۰۵	بازده یکساله

صندوق های اهرمی



شتاب	جهش	نارنج	بازده زمانی
%۵.۲۱	%۵.۲۹	%۶.۷	بازده هفتگی
%۴۲.۲۸	%۴۴.۷	%۴۵.۲۱	بازده ماهانه
%۱۴.۰۲	%۸.۳۹	%۸.۹۵	بازده ۳ ماهه
%-۸.۸۶	%-۱۸.۴	%-۱۳.۵۳	بازده ۶ ماهه
%۹۰.۳۶	%۸۳.۳	%۱۲۱.۸۲	بازده یکساله

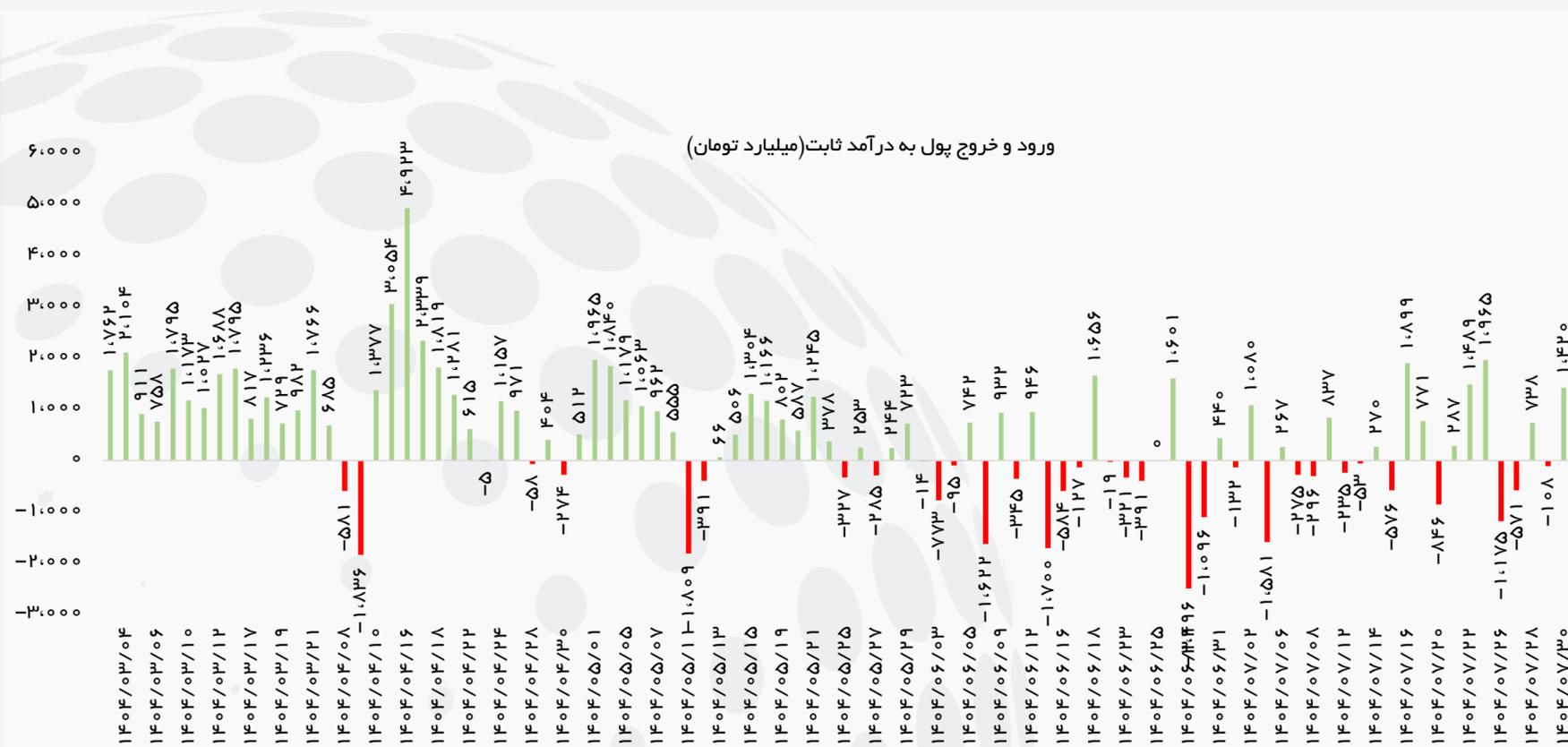




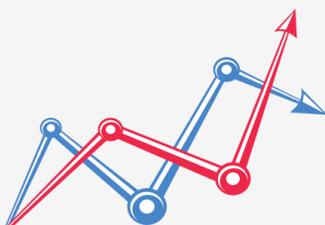
صندوق های درآمد ثابت



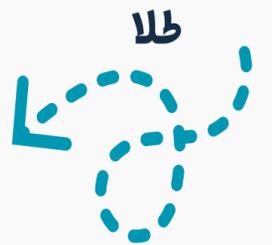
بازده زمانی	کیان	داریک	اعتماد
بازده هفتگی	۱۰۲٪	۱۰۱۳٪	۱۰۰۷٪
بازده ماهانه	۳۰۲۴٪	۵۰۶۵٪	۲۰۵۱٪
بازده ۳ ماهه	۸۰۶٪	۵۰۵۶٪	۷۰۸۶٪
بازده ۶ ماهه	۱۶۰۹۹٪	۱۲۰۰۸٪	۱۵۰۸۲٪
بازده یکساله	۳۷۰۹۳٪	۳۹۰۱۳٪	۳۴۰۶۴٪



در طی مهرماه حدود ۵.۱۷۳ همت ورود پول به درآمد ثابت ها اتفاق افتاده است، طی شهریور ماه ۳.۲۶۸ همت تومان خروج پول از درآمد ثابت ها اتفاق افتاده است.

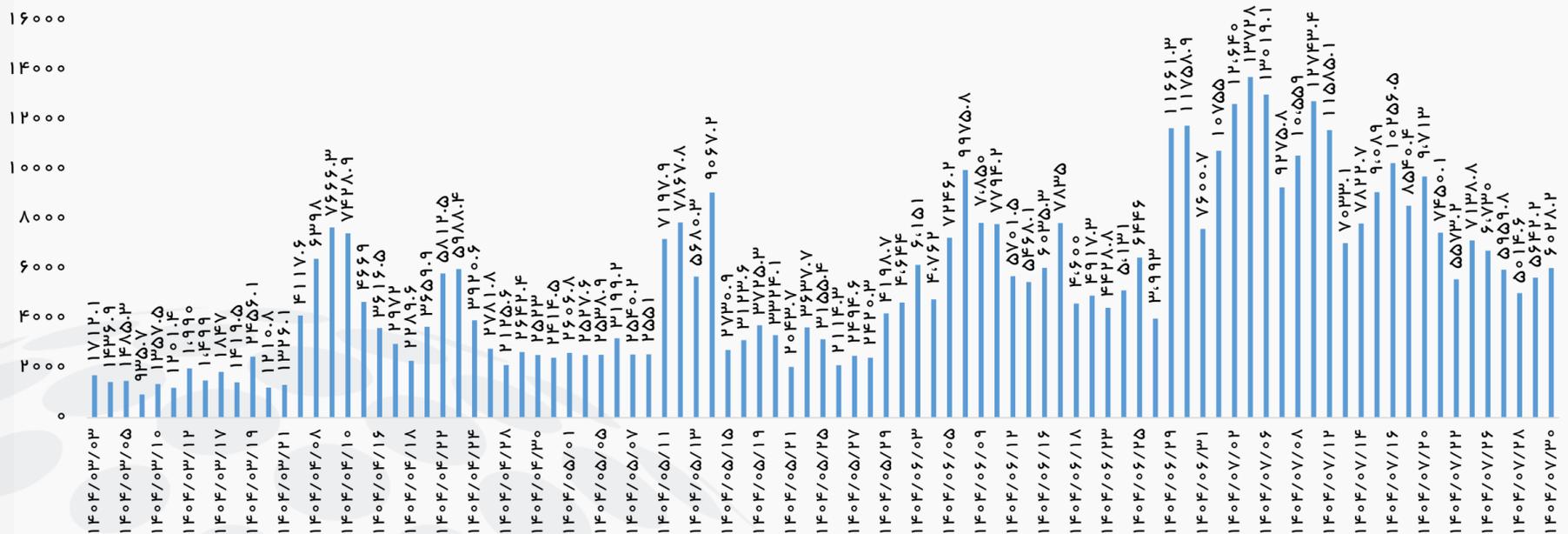


صندوق های طلا

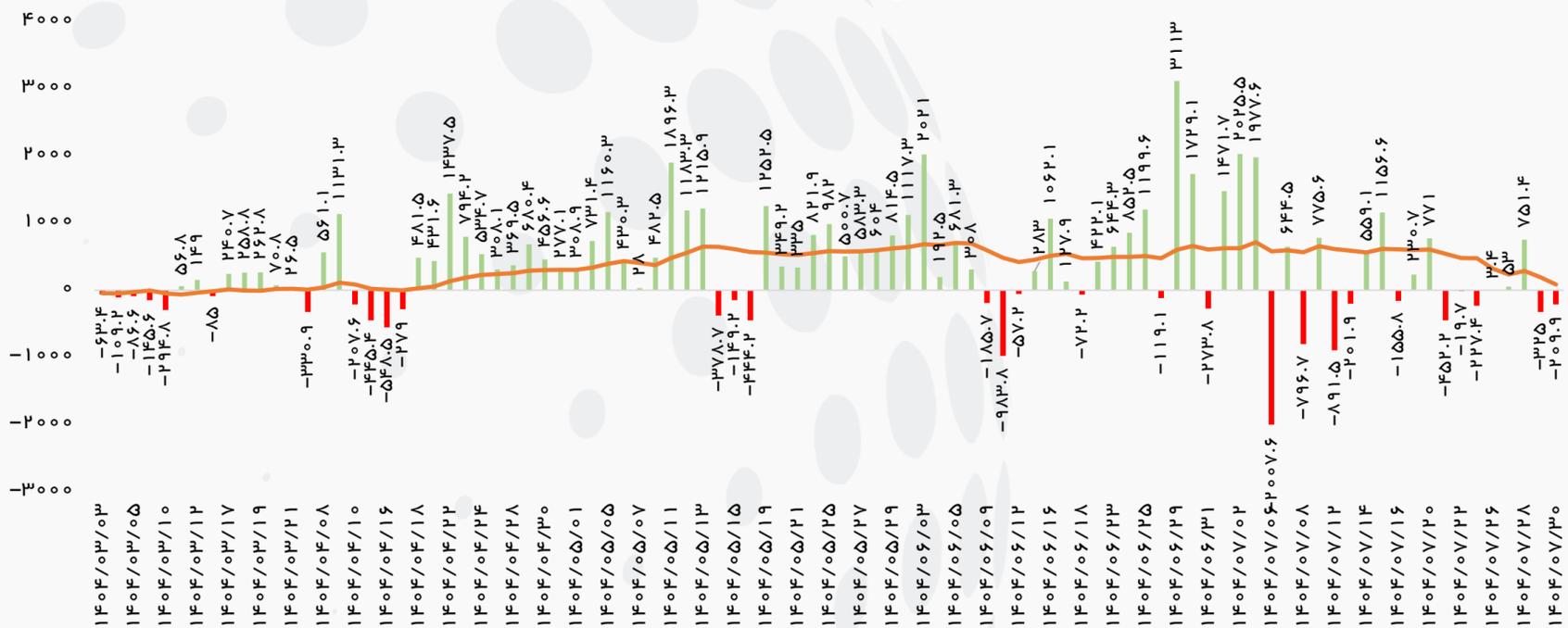


بازده زمانی	درخشان	قیراط	لیان
بازده هفتگی	۳.۷۴%	۳.۷۳%	۳.۷۲%
بازده ماهانه	۲۶.۸۶%	۲۷.۰۴%	۲۶.۷۷%
بازده ۳ ماهه	۶۱.۰۸%	۶۰.۶۶%	۶۱.۵۴%
بازده ۶ ماهه	۵۷.۲۳%	۵۷.۵۲%	۵۸.۱۷%
بازده یکساله	-	-	-

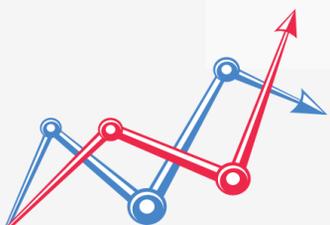
ارزش معاملات خرد صندوق های طلا (میلیارد تومان)



ورود و خروج پول حقیقی به صندوق های طلا



در طی مهرماه ارزش معاملات خرد صندوق های طلا حدود ۱۹۶ همت بوده و افزایش ۴۶ درصدی نسبت به ماه گذشته داشته است. ورود پول به صندوق های طلا طی مهرماه ۵۱۳۲ میلیارد تومان بوده است.

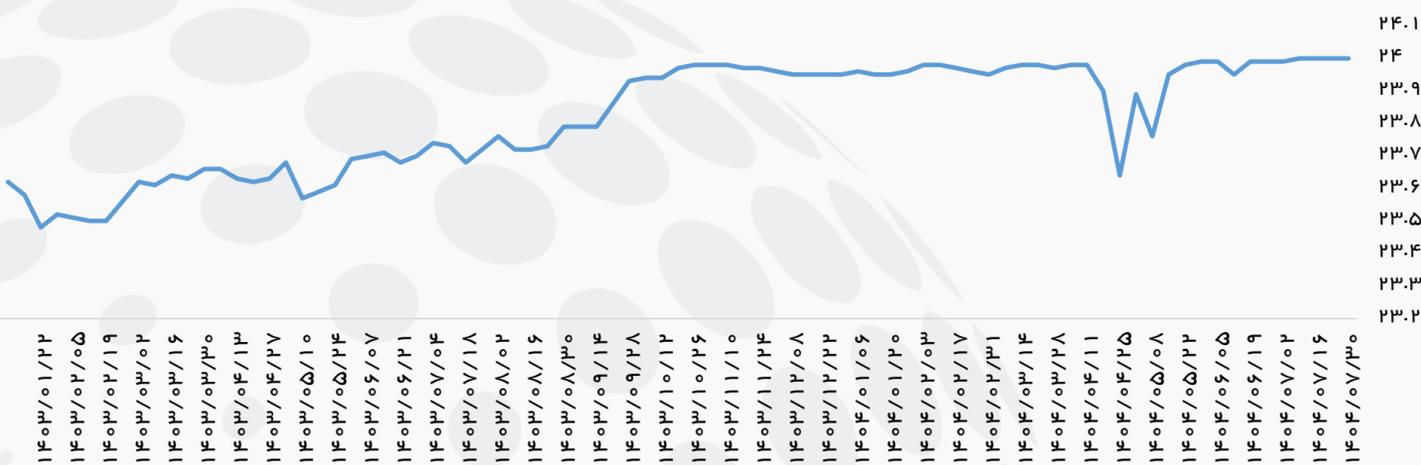




اخزا

نام نماد	قیمت معامله	تاریخ آخرین معامله	قیمت پایانی	حجم	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
گام ۱۰۱۶	۹۱۴,۲۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۱۶	۹۱۴,۲۰۰	۰	۱۴۰۴-۱۰-۳۰	۰.۳۷	۳۲/۹۴%
اخزا ۱۰۸۱	۹۹۳,۰۹۰	۱۴۰۴-۰۷-۲۳	۹۹۳,۲۱۰	۰	۱۴۰۴-۰۷-۲۸	سررسید شده	سررسید شده
اخزا ۲۰۴۱	۶۹۳,۴۲۰	۱۴۰۴-۰۷-۲۶	۶۸۹,۳۴۰	۰	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۴/۵۸%	۳۵/۸۶%
گام ۵۰۶۱۶	۷۴۱,۰۷۷	۱۴۰۴-۰۷-۲۸	۷۴۱,۰۷۷	۰	۱۴۰۵-۰۶-۳۱	۳۸/۲%	۳۷/۷۱%
اخزا ۱۰۴۱	۹۶۲,۲۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۹۶۲,۲۵۰	۰	۱۴۰۴-۰۹-۱۷	۳۴/۸۸%	۳۰/۵۱%
اخزا ۱۰۵۱	۹۴۹,۸۹۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۹۴۸,۷۷۰	۰	۱۴۰۴-۱۰-۱۵	۲۸/۴۳%	۲۵/۶۷%
اخزا ۱۰۹۱	۹۷۸,۳۶۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۹۷۸,۳۶۰	۰	۱۴۰۴-۰۸-۲۶	۳۵/۹۵%	۳۱/۰۵%
اخزا ۲۰۱۱	۸۲۸,۸۶۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۸۲۱,۹۰۰	۰	۱۴۰۵-۰۳-۲۵	۳۳/۶۸%	۳۱/۹۳%
اخزا ۲۰۲۱	۷۰۸,۲۳۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۷۰۷,۸۸۰	۰	۱۴۰۵-۰۹-۲۳	۳۵/۱۵%	۳۵/۹۷%
اخزا ۲۰۳۱	۷۳۰,۰۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۷۲۹,۱۸۰	۰	۱۴۰۵-۰۸-۱۸	۳۴/۹۸%	۳۵/۲۵%
اخزا ۲۰۷۱	۹۶۷,۵۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۹۶۷,۰۸۰	۰	۱۴۰۴-۰۹-۱۰	۳۵/۱۹%	۳۰/۶۵%
اخزا ۲۰۸۱	۸۹۸,۰۱۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۸۹۸,۰۱۰	۰	۱۴۰۴-۱۲-۱۱	۳۴/۹۵%	۳۱/۶۴%
اخزا ۲۱۰۱	۶۸۰,۸۶۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۶۷۹,۴۸۰	۰	۱۴۰۵-۱۱-۱۲	۳۵/۰۵%	۳۶/۶۴%
اخزا ۲۱۱۱	۷۴۷,۴۹۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۷۴۶,۸۲۰	۰	۱۴۰۵-۰۷-۲۰	۳۴/۸۸%	۳۴/۷۳%
اخزا ۲۱۲۱	۷۱۳,۹۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۷۱۳,۹۰۰	۰	۱۴۰۵-۰۹-۱۶	۳۴/۸۹%	۳۵/۵۹%
اخزا ۲۱۳۱	۶۹۲,۹۸۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۶۹۱,۴۱۰	۰	۱۴۰۵-۱۰-۲۱	۳۵/۰۱%	۳۶/۲۶%
اخزا ۳۰۱۱	۵۶۴,۰۰۰	۱۴۰۴-۰۷-۳۰	۵۶۴,۲۵۰	۰	۱۴۰۶-۰۶-۱۵	۳۵/۷۵%	۴۱/۲۵%

نرخ بازار بین بانکی (%)

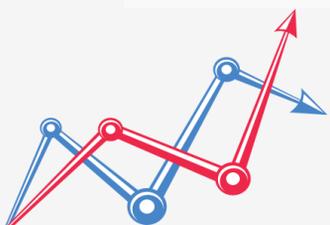
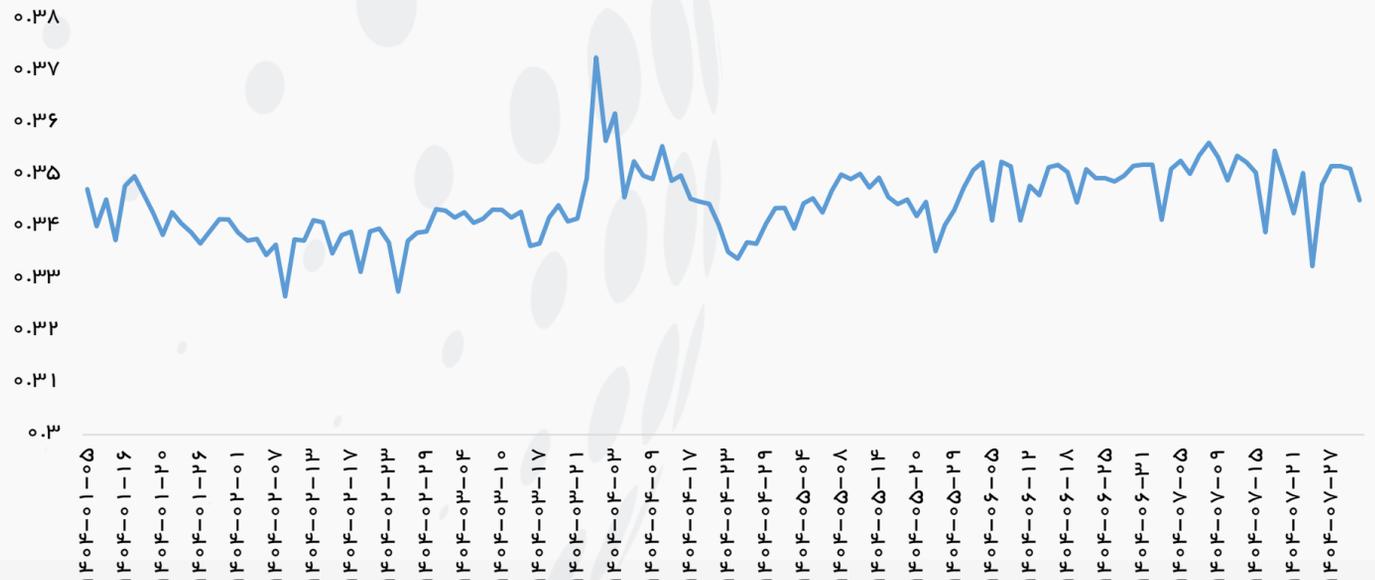
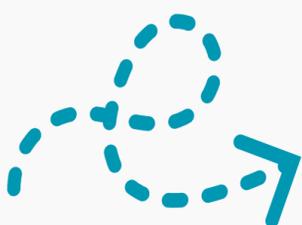


نرخ بهره بین بانکی



میانگین نرخ بهره بدون ریسک

میانگین نرخ بهره بدون ریسک

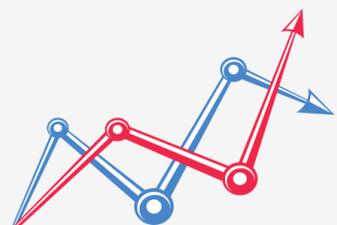




کامودیتی ها



درصد تغییرات	نرخ ماه گذشته-\$	نرخ این ماه-\$	محصول
-۱۰%	۸۴۱	۷۵۶	اتیلن - CFR CHINA
-۵%	۸۰۱	۷۶۱	پروپیلن - CFR CHINA
-۹%	۱۰۶۱	۹۶۱	بوتادین - CFR CHINA
۰%	۶۵۱	۶۵۱	جنوب شرق آسیا - PVC
-۳%	۱۲۷۱	۱۲۳۶	ABS - CFR CHINA
-۴%	۹۰۹	۸۷۷	پلی اتیلن سنگین - جنوب شرق آسیا
-۳%	۱۰۸۶	۱۰۵۶	پلی اتیلن سبک - جنوب شرق آسیا
-۱۲%	۸۶۱	۷۶۱	پلی پروپیلن - جنوب شرق آسیا
۰%	۲۶۱	۲۶۱	متانول - CFR CHINA
-۶%	۷۳۳	۶۹۲	بنزن - CFR CHINA
-۴%	۸۰۱	۷۶۶	اورتوزایلین - CFR CHINA
۰%	۸۱۵	۸۱۴	پارازایلین - CFR CHINA
-۶%	۸۶۶	۸۱۲	استایرن - CFR CHINA
-۶%	۴۰۷	۳۸۳	اوره گرانوله - فوب جنوب شرق آسیا





گزارش تحلیل مهرماه بورس کالا



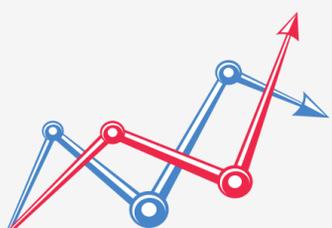
آمار معاملات محصولات فلزی در تالار صنعتی بورس کالا طی مهرماه ۱۴۰۴

تغییرات قیمت	قیمت قبلی معامله	رقابت درصدی	قیمت میانگین	قیمت پایه	مجموع حجم معامله شده	مجموع حجم عرضه	نام کالا
۵%	۳۰۹۰۲۵۳	۷%	۳۳۰۰۵۹۹	۳۰۷۰۷۹۹	۴۸۸۰۲۲۵	۴۸۸۰۲۲۵	شمش فولادی
-۳%	۲۰۵۸۸۰۴۰۱	-۴%	۲۰۹۱۲۰۰۹۷	۳۰۰۴۷۰۲۸۱	۱۱۰۸۰۰	۱۳۰۹۲۵	شمش آلومینیوم
۲۶%	۷۰۵۵۶۰۱۲۴	۲۴%	۹۰۳۹۲۰۱۸۶	۷۰۵۵۷۰۳۲۲	۱۳۰۰۹۰	۱۳۰۰۹۰	مس کاتد (سهمیہ ای)
۱۲%	۷۰۵۲۶۰۲۶۸	۱۸%	۸۰۵۱۱۰۶۲۰	۷۰۲۱۶۰۰۰۰	۱۰۰۰۰	۱۰۰۰۰	مس کاتد (غیر سهمیه ای)
۲%	۷۱۰۷۲۶	۲%	۷۲۰۴۴۴	۷۰۰۸۷۱	۱۰۶۸۸۰۰۰۰	۲۰۵۴۳۰۰۰۰	گندله سنگ آهن
۰%	۶۰۰۸۵۳	۰%	۶۳۰۱۳۹	۶۳۰۰۹۳	۷۹۵۰۵۰۰	۲۰۰۸۰۰۱۰۰	کنسانتره سنگ آهن
۳%	۱۶۹۰۸۸۷	۴%	۱۷۶۰۲۹۵	۱۶۹۰۳۱۰	۵۳۸۰۶۰۰	۵۶۱۰۰۰۰	آهن اسفنجی

آمار معاملات محصولات فرآورده های نفتی در بورس کالا طی مهرماه ۱۴۰۴

تغییرات قیمت	قیمت قبلی معامله	رقابت درصدی	قیمت میانگین	قیمت پایه	مجموع حجم معامله شده	مجموع حجم عرضه	نام کالا
-۵%	۲۶۸۰۱۵۷	۴۷%	۲۶۸۰۱۵۷	۱۸۲۰۲۴۵	۵۸۹۰۰۰۰	۵۸۹۰۰۰۰	وکیوم معمولی
-۳%	۲۶۶۰۰۱۸	۴۰%	۲۶۶۰۰۱۸	۱۸۹۰۴۳۰	۲۲۳۰۰۰۰	۲۲۳۰۰۰۰	وکیوم مرغوب
۰%	۲۶۴۰۲۹۹	۰%	۲۶۴۰۲۹۹	۲۶۴۰۲۹۹	۲۵۸۰۰۰۰	۳۵۳۰۰۰۰	لوب کات
۱۳%	۶۱۶۰۸۲۴	۱۳%	۶۱۶۰۸۲۴	۵۴۷۰۵۴۶	۱۶۰۴۹۵	۱۷۰۱۲۲	روغن پایه

اثر افزایش نرخ دلار بر قیمت روغن پایه مشهود است.





گزارش تحلیل مهرماه بورس کالا

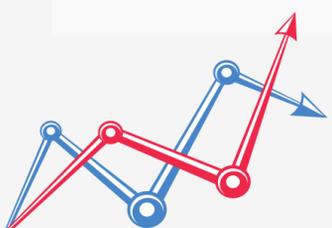


آمار معاملات محصولات پتروشیمی در تالار پتروشیمی بورس کالا طی مهرماه ۱۴۰۴

مجموع قیمت میانگین کمتر از قیمت پایه است

نام کالا	مجموع عرضه	مجموع حجم معامله شده	قیمت پایه	قیمت میانگین	رقابت درصدی	قیمت قبلی معامله	تغییرات قیمت
پلی پروپیلن شیمیایی	۱۷,۳۱۱	۱۷,۳۱۱	۷۴۶,۶۱۸	۱,۰۳۵,۵۵۲	۳۹%	۸۵۷,۲۳۹	۲۳%
پلی پروپیلن نساجی	۴۳,۷۷۷	۴۳,۷۷۷	۶۸۴,۰۱۴	۱,۰۶۸,۰۴۵	۵۶%	۸۸۳,۶۵۸	۲۷%
پلی وینیل کلراید	۳۵,۸۴۰	۳۳,۴۸۶	۴۶۷,۵۵۶	۶۲۹,۰۰۰	۳۵%	۵۱۷,۸۵۷	۲۵%
پلی اتیلن سبک فیلم	۴۲,۲۹۳	۴۲,۲۹۳	۶۴۹,۵۸۹	۷۸۶,۷۸۰	۲۱%	۷۰۷,۷۶۸	۱۴%
پلی اتیلن سبک خطی	۵۲,۶۱۰	۵۲,۶۱۰	۵۵۶,۸۴۵	۷۶۶,۶۴۹	۳۸%	۶۸۲,۴۹۶	۱۷%
پلی اتیلن سنگین فیلم	۴۳,۹۱۱	۴۳,۹۱۱	۵۳۷,۰۵۷	۷۲۴,۸۷۲	۳۵%	۶۲۹,۳۵۹	۱۹%
پلی اتیلن سنگین بادی	۴۲,۲۵۶	۴۲,۲۵۶	۵۲۳,۸۸۹	۷۱۴,۹۴۴	۳۶%	۶۲۶,۶۷۰	۱۸%
پلی اتیلن ترفتالات بطری	۲۴,۵۵۲	۲۴,۵۵۲	۷۴۲,۷۷۵	۸۳۳,۳۰۵	۱۲%	۷۳۰,۷۱۷	۱۲%
پلی اتیلن ترفتالات نساجی	۲۵,۰۱۴	۲۵,۰۱۴	۷۴۶,۳۳۰	۸۲۹,۱۴۰	۱۱%	۷۵۵,۷۵۵	۷%

اثر افزایش نرخ دلار بر محصولات پتروشیمی مشهود است.





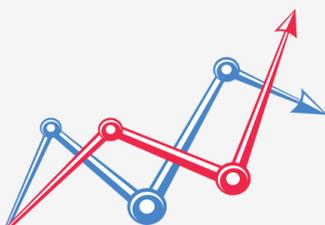
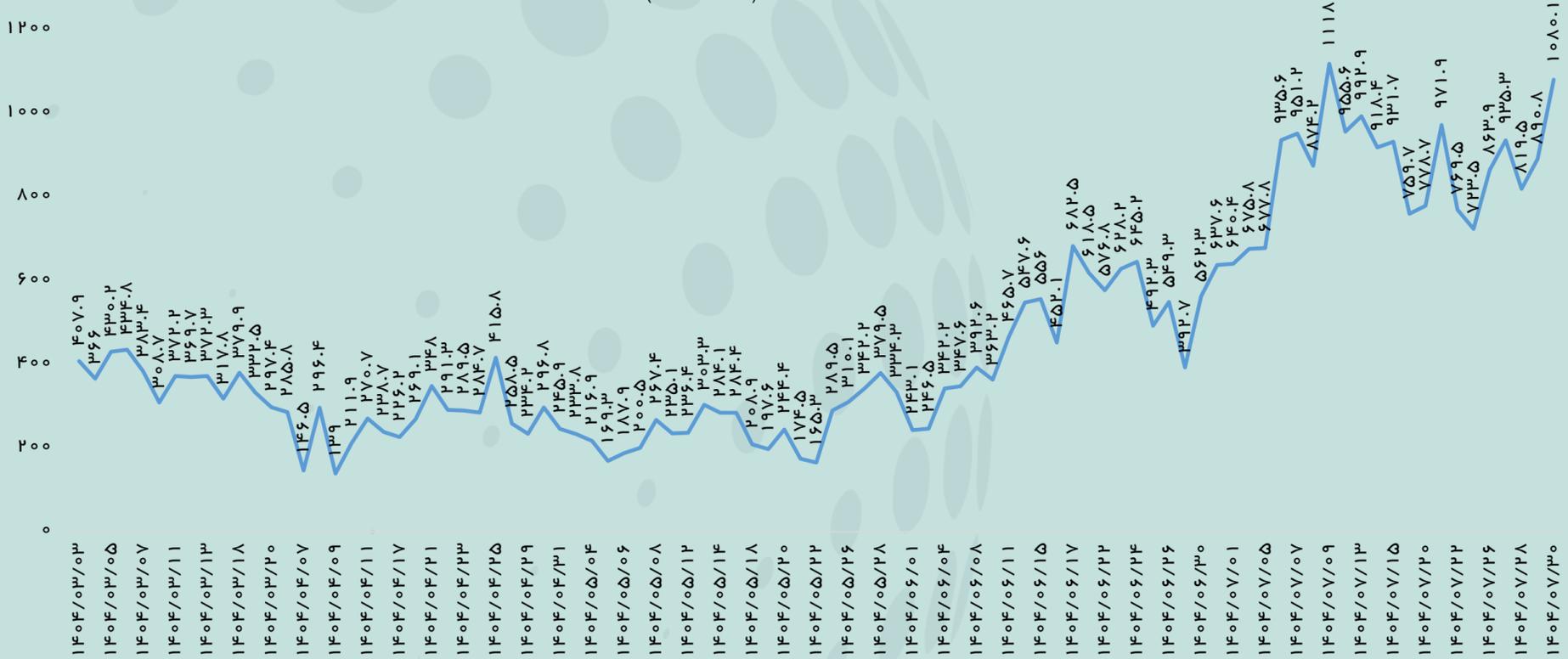
گزارش تحلیل مهرماه بازار اختیار معامله



ارزش معاملات اختیار خرید و فروش به تفکیک (میلیارد ریال)



ارزش معاملات اختیار (میلیارد ریال)





هفته آخر مهر

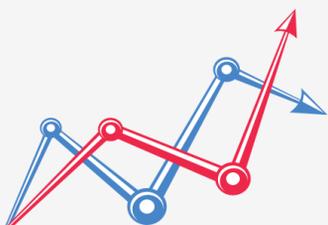


خوب، در ابتدا بازار را با اعداد و ارقام بررسی می‌کنیم و سپس به سراغ رویدادها و اخبار می‌رویم.

شروع بورس در اولین ماه پاییز طوفانی بود؛ در حالی که در هفته‌های میانی مهر شاهد رشد ارزش معاملات و بهبود نسبی نقدشوندگی بودیم، در روزهای پایانی ماه بازار بار دیگر وارد فاز احتیاط شد.

در بازه‌ی ۱۹ تا ۲۳ مهر ۱۴۰۳، میانگین ارزش معاملات خرد بازار حدود ۸,۱۹۶ میلیارد تومان بود. این عدد در بازه‌ی بعدی، یعنی ۲۶ تا ۳۰ مهر، به حدود ۷,۱۷۹ میلیارد تومان کاهش یافت؛ افتی نزدیک به ۱۲ درصد که نشان‌دهنده‌ی کاهش تحرک معامله‌گران و احتیاط بیشتر در خریدهای جدید است. با این حال، در سمت مقابل، ورود پول حقیقی روندی کاملاً متفاوت داشت. در دو هفته قبل، مجموع ورود پول حقیقی حدود ۱,۸۷۵ میلیارد تومان بود، اما در هفته‌ی پایانی ماه این رقم به ۳,۵۳۵ میلیارد تومان افزایش یافت؛ رشدی حدود ۸۸ درصدی که نشان می‌دهد با وجود افت ارزش معاملات، اعتماد و تمایل سرمایه‌گذاران حقیقی به بازار تقویت شده است.

این رفتار متضاد بین ارزش معاملات و جریان پول حقیقی، می‌تواند نشانه‌ای از چرخش تدریجی نقدینگی به سمت سهم‌های بنیادی و کم‌ریسک‌تر باشد. به بیان دیگر، فعالان حقیقی در حال ورود هدفمند به بازار هستند، در حالی که بخش عمده‌ای از معامله‌گران حقوقی و نوسان‌گیرها در وضعیت انتظار قرار گرفته‌اند. به طور کلی، مهرماه را می‌توان ماهی با شروع پرانرژی و پایان محتاطانه توصیف کرد؛ دوره‌ای که اگرچه از تب‌وتاب ابتدای ماه کاسته شد، اما رشد ورود پول حقیقی در روزهای پایانی، نقطه‌ی امیدی برای ادامه‌ی روند بهبود در آبان‌ماه محسوب می‌شود.

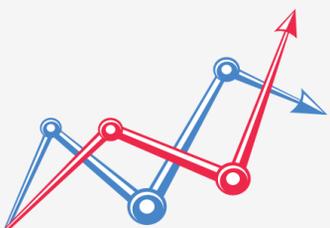


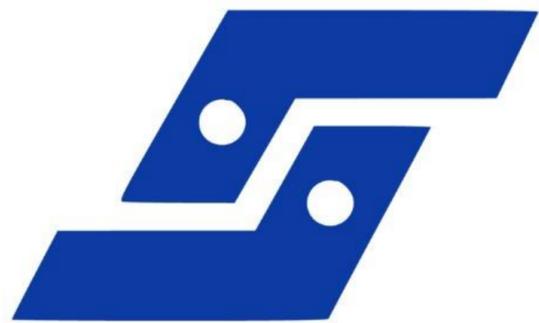


و حالا بخش اخبار رو با بررسی کلی گزارش های فصلی آغاز میکنیم: در مجموع، صنایع بانکی، دارویی و زراعتی ستاره های این دوره بودند و گزارش هایی فراتر از انتظار ارائه دادند. در مقابل، تایرسازان، فولادی ها و پتروشیمی ها ضعیف ترین عملکرد را داشتند، البته در بین پتروشیمی ها، اوره سازها وضعیت متفاوتی داشتند و عملکرد خوبی را روانه کدال کردند. سایر گروه ها از جمله سیمانی ها، کاشی و سرامیکی ها و پالایشی ها در محدوده ی انتظارات ظاهر شدند و ثبات نسبی در وضعیت مالی آنها مشاهده می شود.

در هفته آخر مهر، آلومینیوم، نفت، مس و دیگر کالاهای جهانی رشد خوبی داشتند و به بالاترین قیمت ها از مدت ها رسیدند. این افزایش قیمت ها حتماً روی بازار ایران هم تأثیر می گذارد. عمده دلیل رشد قیمت نفت و گاز به خاطر افزایش چشمگیر تحریم ها علیه بخش انرژی روسیه و گسترش تنش های روسیه و اوکراین بود. با توجه به چهارمین جلسه کامل حزب کمونیست چین و ارائه برنامه های قوی برای حمایت از اقتصاد، قیمت های مس و آلومینیوم در هفته آخر مهر رشد قابل توجهی داشتند. این افزایش نشان دهنده تأثیر مستقیم سیاست های اقتصادی چین بر بازار جهانی فلزات است و انتظار می رود روند تقاضا و قیمت ها همچنان تحت تأثیر این کشور باقی بماند.

با این حال، طلا و نقره پس از یک صعود قوی، هفته آخر را با کاهشی حدود ۳٪ پشت سر گذاشتند. شاخص دلار نیز اندکی تقویت شد. پیش بینی می شود در هفته پیش رو، بازار کامودیتی ها با نوسانات محدود و روند افزایشی قیمت ها همراه باشد، شرایطی که می تواند بر بازار داخلی و صنایع مرتبط تأثیرگذار باشد.





کارگزاری

خبیرگان سهام

خبیرگان بازار در کنار شما

۲۵%

بازگشت کارمزد

تخصیص اعتبار

به صورت آنی و ۲۴ ساعته
در فرآیندی تمام اتوماتیک



باشگاه بازاریابان

تا سقف ۲۵% با تسویه
۲۴ ساعته



اکسیر / اومکس

کاربری حرفه‌ای +
امنیت و دقت بالا



برداشت وجه آنی

به صورت ۲۴ ساعته
در ۷ روز هفته



جونپور بروکر

سرمایه‌گذاری برای
کودکان زیر ۱۸ سال

تهران، میدان ونک، خیابان نلسون ماندلا، خیابان ناوک، پلاک ۱۸

