

کارگزاری بارز
BAREZ BROKERAGE



ماهنامه بارز
مهرماه ۱۴۰۲

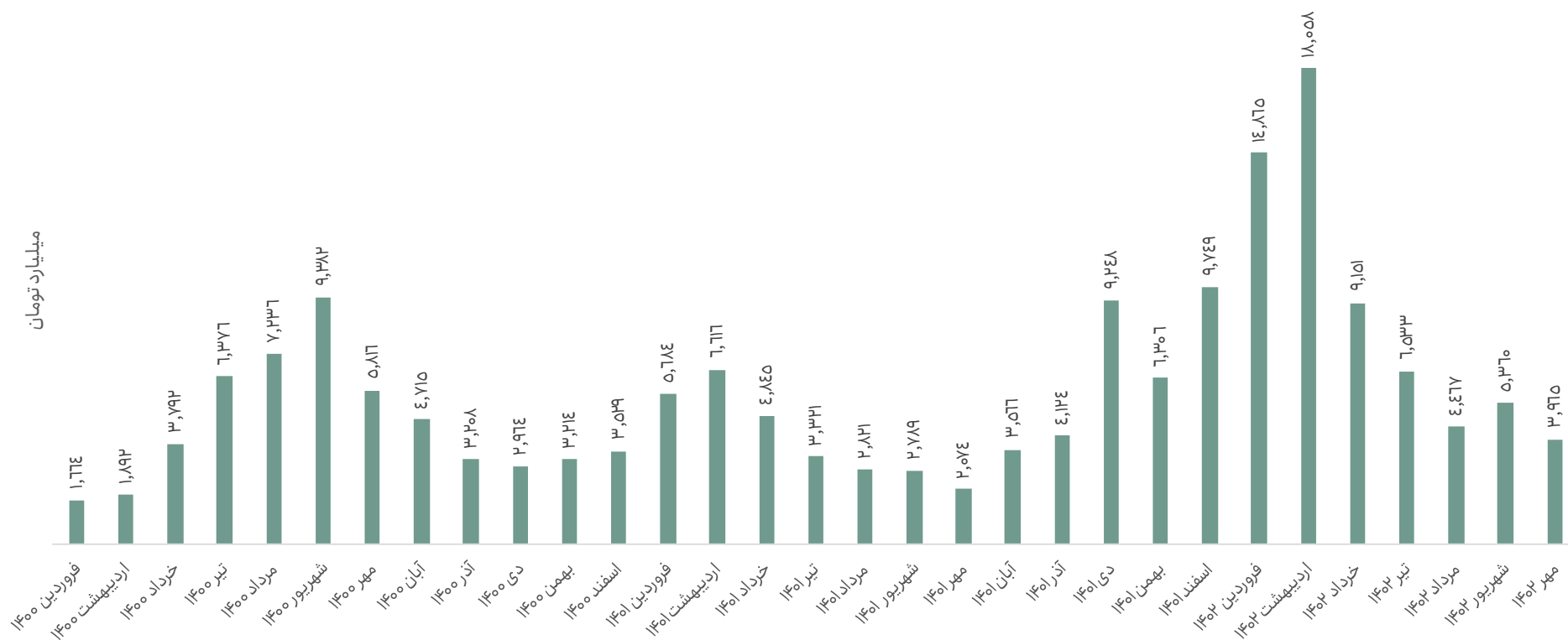
بازار سرمایه



میانگین ماهانه ارزش معاملات

میانگین ماهانه ارزش معاملات در ادامه روند کاهشی خود، در مهرماه نیز با افت ۲۶ درصدی نسبت به ماه گذشته، ۳۹۶۵ میلیارد تومان ثبت شد. کمترین ارزش معاملات از ابتدای سال در ۱۹ مهرماه و عدد ۳۲۰۷ میلیارد تومان ثبت شد.

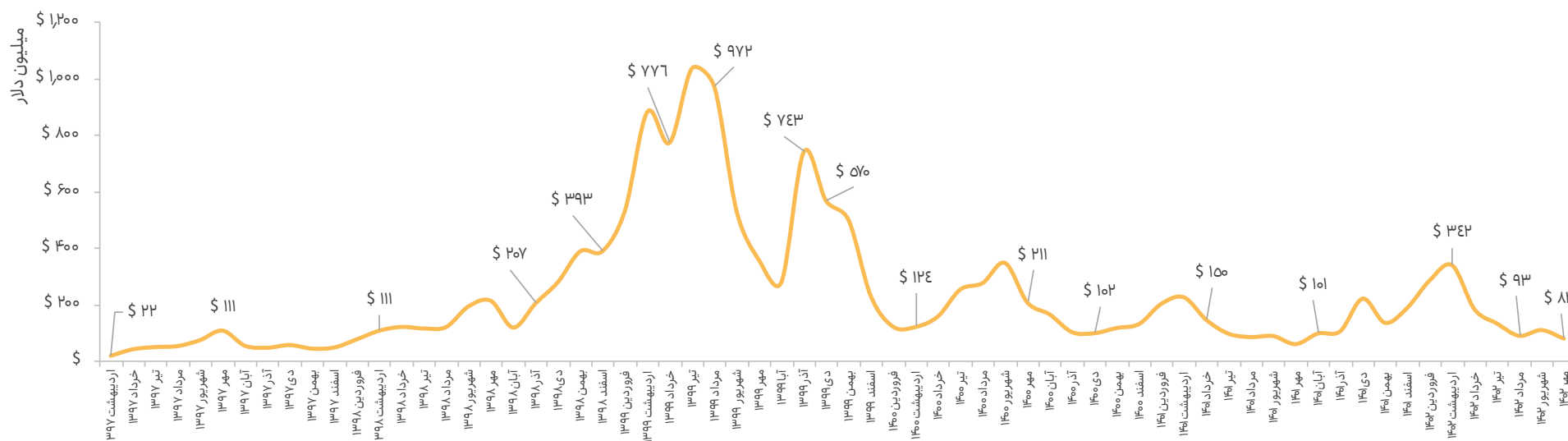
میانگین ماهانه ارزش معاملات



ارزش دلاری معاملات سهام

میانگین ارزش معاملات روزانه بر حسب دلار در شهریورماه ۸۳ میلیون دلار بوده است در حالی که در پیک اردیبهشت ماه ۳۴۲ میلیون دلار ثبت شده است. این آیتم در مهرماه سال گذشته ۶۴ میلیون دلار بود.

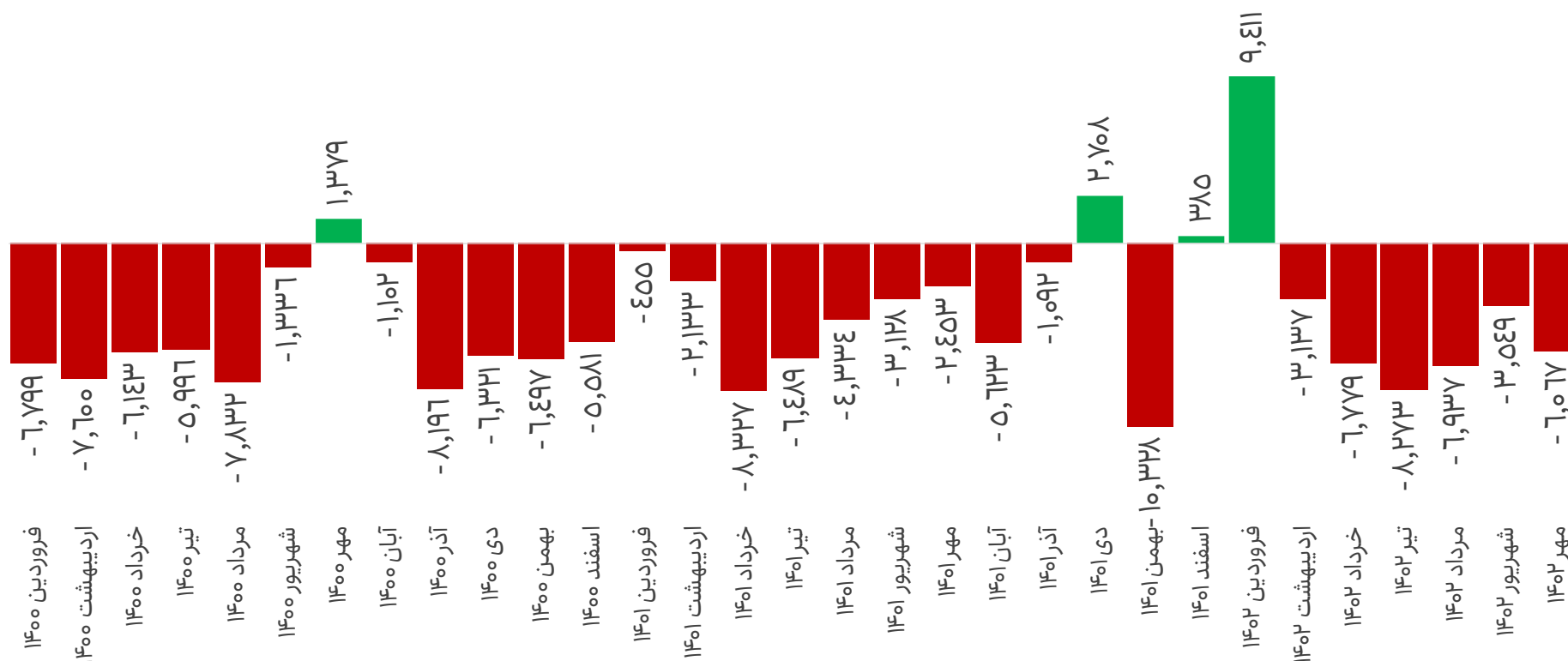
میانگین ارزش معاملات سهام و صندوق های سهامی بدون بلوک - دلار آزاد



تغییر ماهانه مالکیت حقیقی در معاملات خرد سهام و حق

با ثبت ۶۰۶۷ میلیارد تومان خروج حقیقی در مهرماه، مجموع خروج حقیقی از ابتدای سال جاری تا پایان مهر به ۲۵۳۳۱ میلیارد تومان رسید. این در حالی است که در اسفند و فروردین تنها ۹۷۹۶ میلیارد تومان به بازار سهام وارد شده بود.

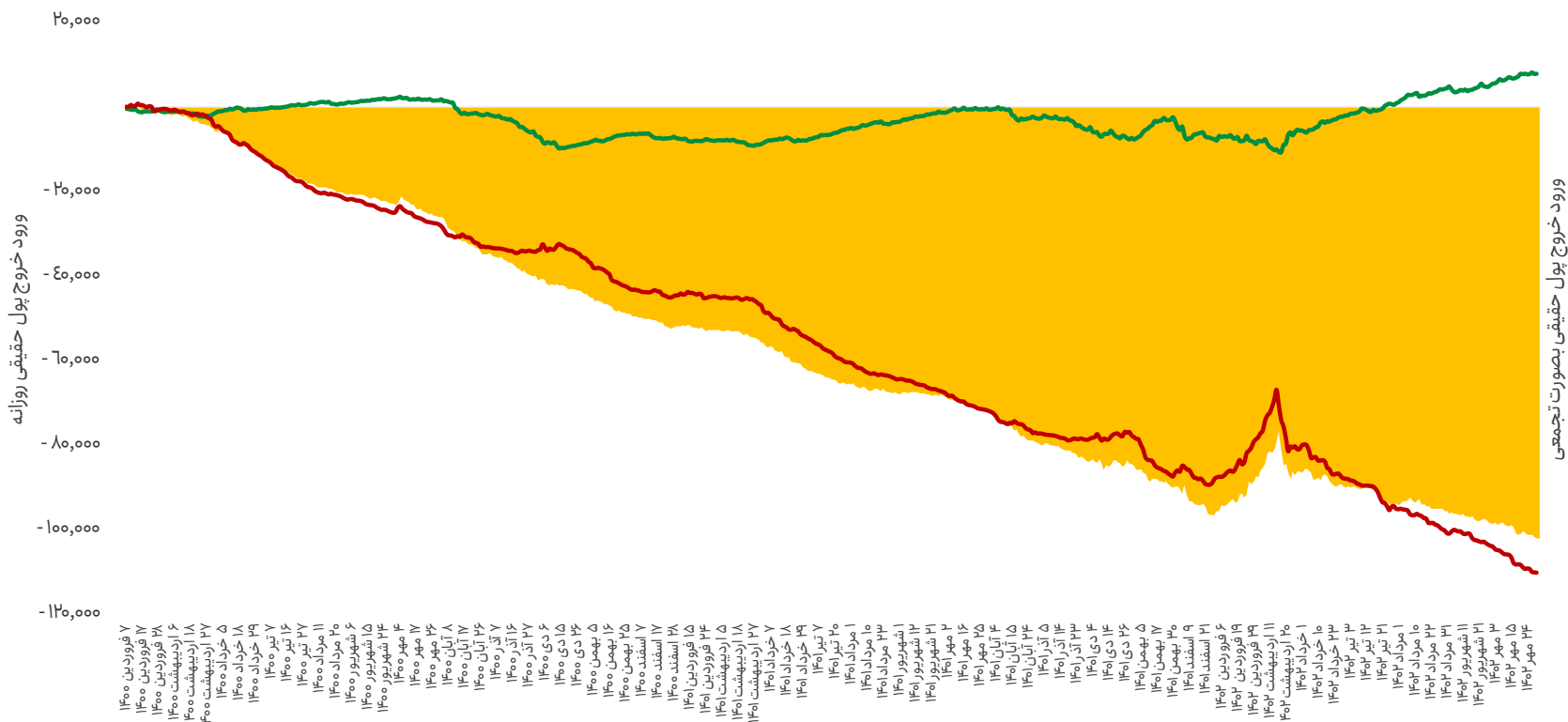
تغییر ماهانه مالکیت حقیقی در معاملات خرد سهام و حق تقدم (میلیارد تومان)



تغییر مالکیت حقیقی در سهام و صندوق های درآمد ثابت

همزمان با ریزش بازار در تاریخ ۱۷ اردیبهشت و خروج پول حقیقی از بازار، ۱۷۹۹۹ میلیارد تومان پول حقیقی به صندوقهای درآمد ثابت وارد شده است. به دنبال وضعیت رکودی بازار ۲۷۱۱ میلیارد تومان آن درمهرماه وارد صندوق های درآمد ثابت شده است. برآیند ورود (خروج) به درآمد ثابت و بازار سهام از ابتدای سال ۱۴۰۲ خروج ۶۶۲۶ میلیارد تومان بوده است.

تغییر مالکیت حقیقی در صندوقهای درآمد ثابت (میلیارد تومان)



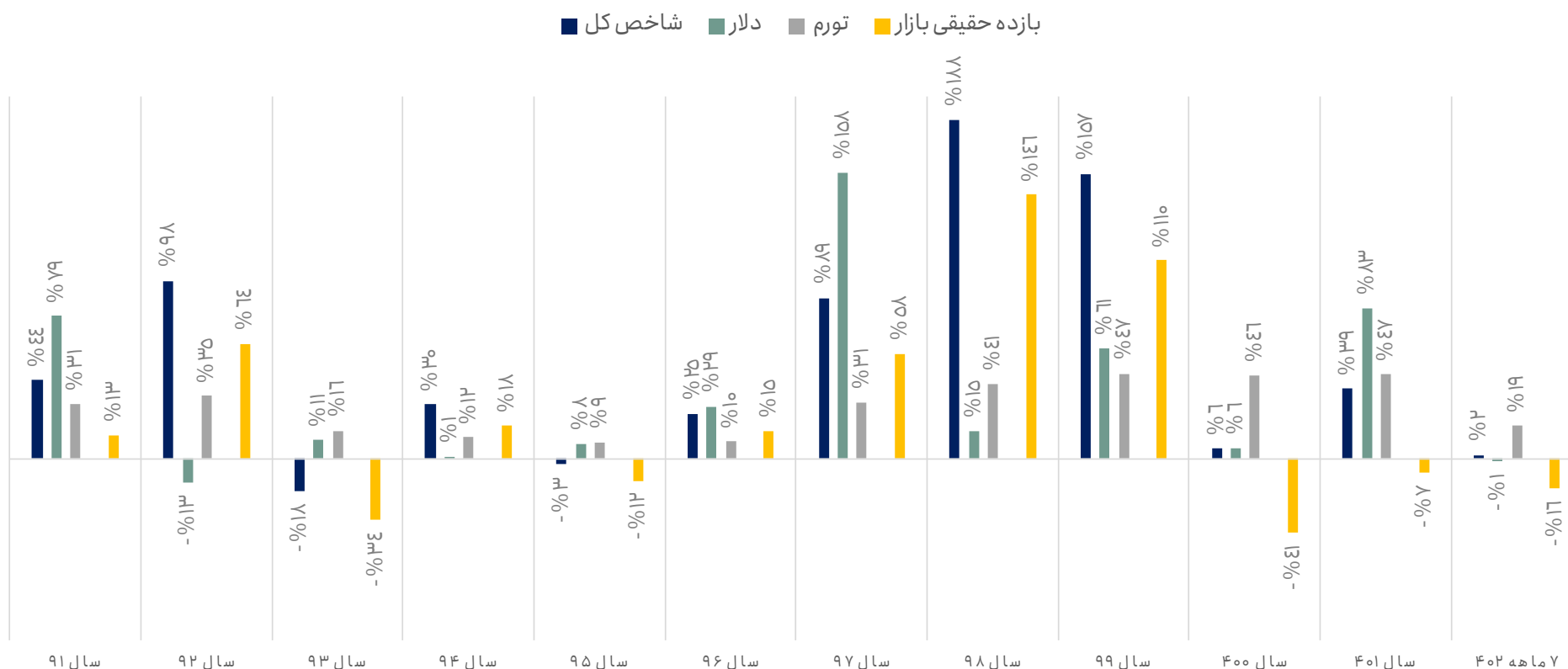
ارزش دلاری بازار و شاخص کل

ارزش دلاری بازار علیرغم ورود شرکت های جدید بازار پایینتر از میانگین ۳ ساله خود قرار دارد. کاهش شدید طرح های توسعه ی شرکت های بورسی، افزایش هزینه های تولید اعم از افزایش دلاری نرخ سوخت و گاز، افزایش هزینه های تحریمی و استهلاکی، اقدامات مداخله جویانه بیش از حد دولت، فاصله ۳۵ درصدی دلار فروش شرکت ها با دلار آزاد به همراه ذهنیت بد جامعه نسبت به بازار سهام از مهمترین دلایل این کاهش است.



بازدهی سالانه بازار سهام در برابر تورم و رشد دلار

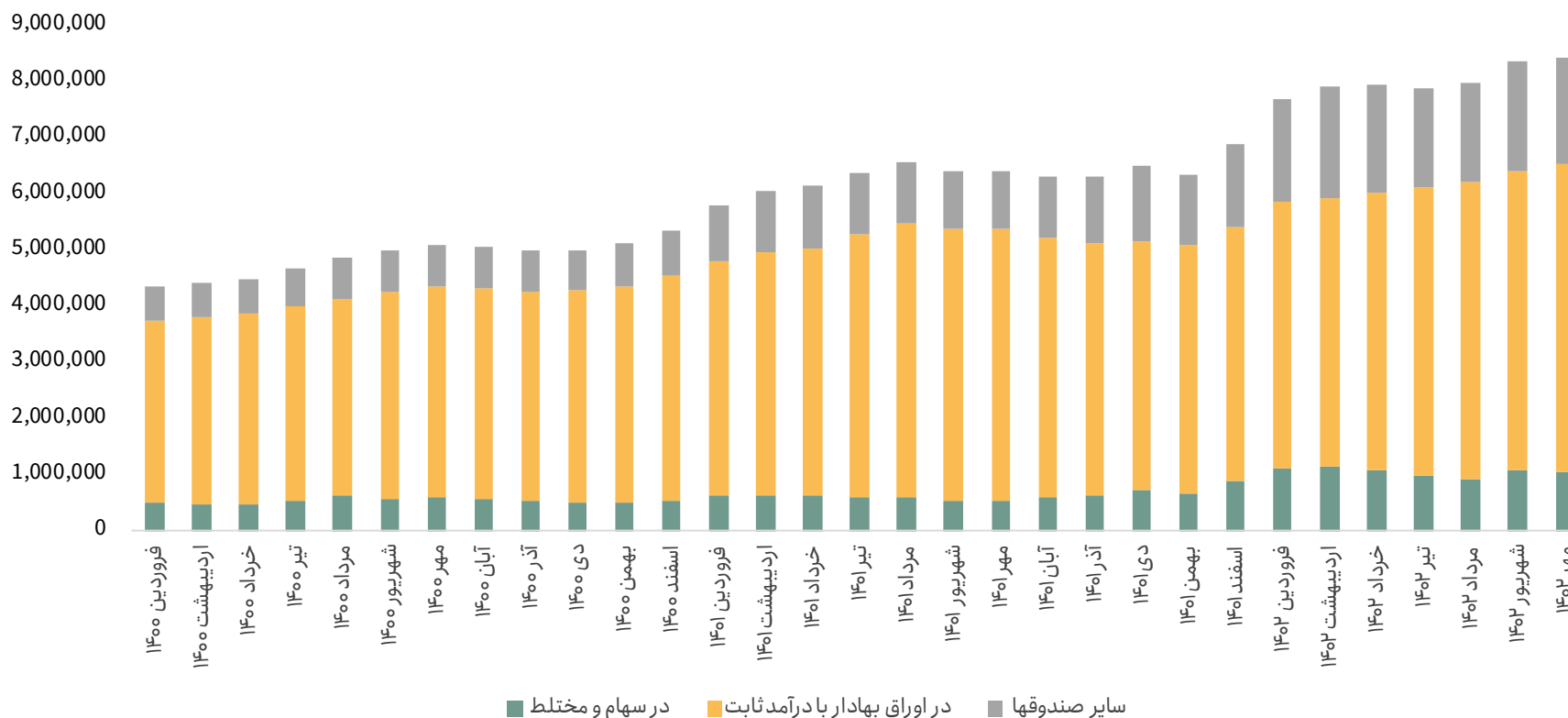
نکته قابل تامل این است که از سال ۹۹ به بعد، علی رغم رشد قابل توجه دلار که همیشه یکی از درایورهای اصلی رشد بازار سهام بوده، همواره بازده حقیقی بازار سهام منفی بوده است.



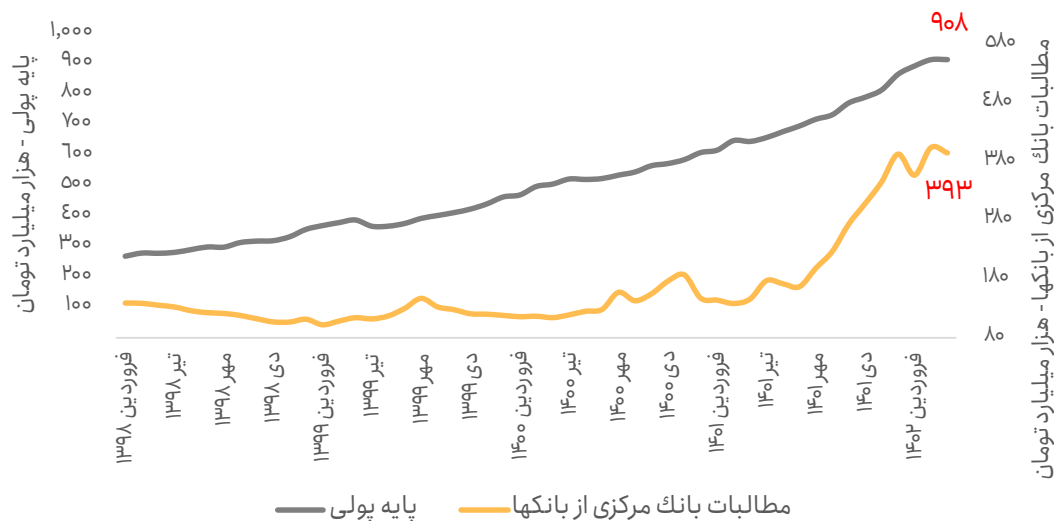
خالص ارزش دارایی صندوقهای سرمایه گذاری

مجموع ارزش بازار انواع صندوقها از حدود ۴۳۴ هزار میلیارد تومان در ابتدای ۱۴۰۰ به ۸۴۳ هزار میلیارد تومان در مهرماه سال جاری رسیده است. مجموع ارزش صندوقهای درآمد ثابت از ۳۲۳ همت در ابتدای ۱۴۰۰، در انتهای مهرماه سال جاری با رشد ۶۹٪ به ۵۴۷ همت افزایش یافته است.

مجموع ارزش صندوقهای درآمد ثابت از ۵۲ همت در ابتدای ۱۴۰۰، در انتهای مرداد سال جاری با رشد ۱۰۴٪ به ۱۰۴ همت افزایش یافته است.



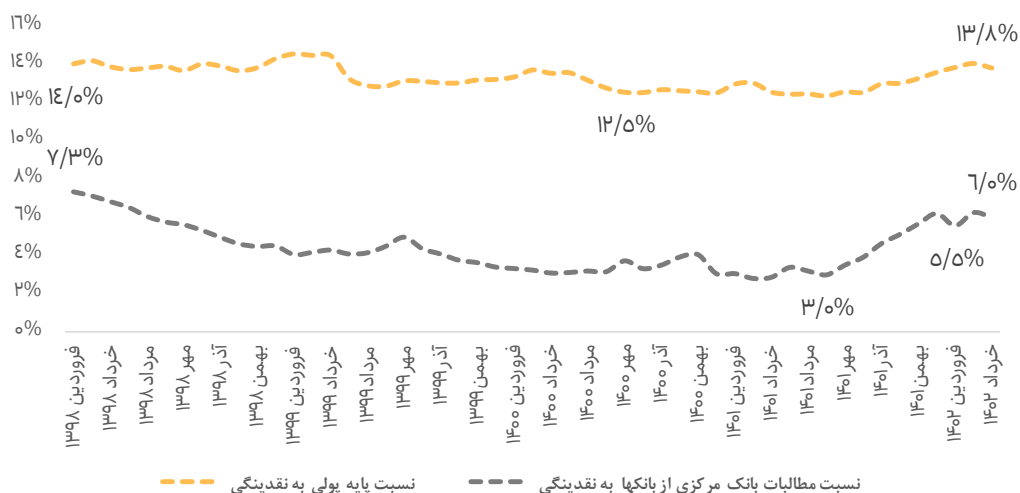
پایه پولی و مطالبات بانک مرکزی از بانک ها



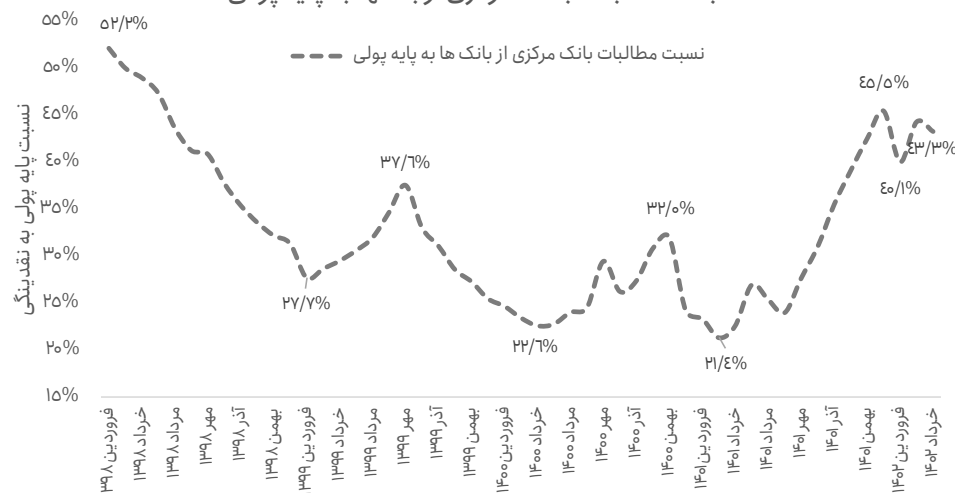
مطالبات بانک مرکزی به پایه پولی

مطالبات بانک مرکزی از بانکها به مقدار ۳۹۳ همت رسید که نقطه به نقطه (خرداد ۱۴۰۲ نسبت به خرداد ۱۴۰۱) ۱۷۱٪ درصد افزایش و نسبت به اسفند ماه افزایشی ۵٪ درصدی داشته است. بیشترین رشد در پایه پولی به صورت نقطه به نقطه مربوط به مطالبات بانک مرکزی از بانک ها بوده است. خالص مطالبات بانک مرکزی از بخش دولتی به صورت نقطه به نقطه افزایشی ۵٪ ۳۳ درصدی و نسبت به اسفند ماه ۲۱٪ افزایش داشته است.

نسبت پایه پولی و نسبت مطالبات بانک مرکزی از بانکها به نقدینگی

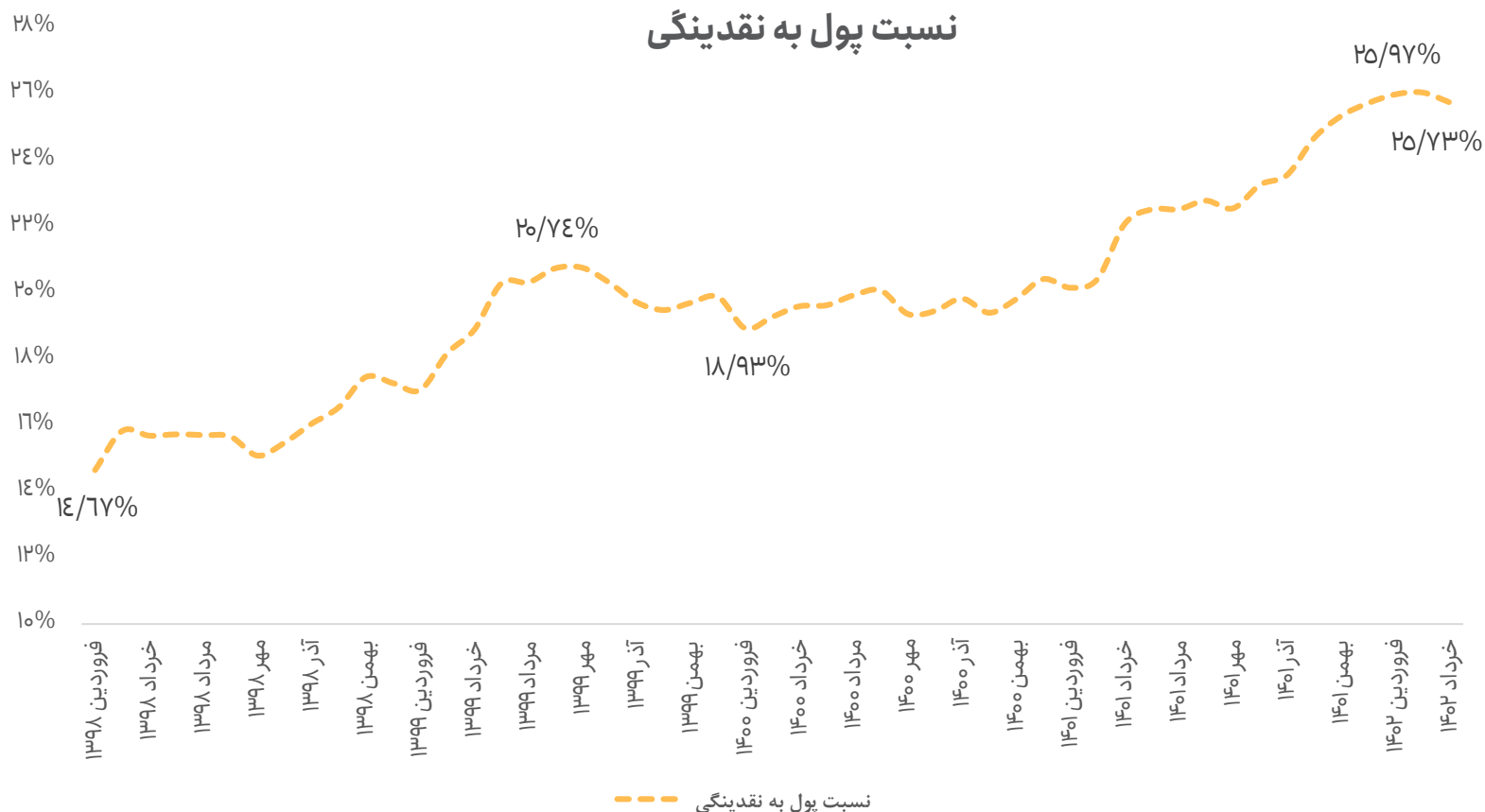


نسبت مطالبات بانک مرکزی از بانکها به پایه پولی





اقتصاد ایران - بررسی ترازنامه بانک مرکزی ایران

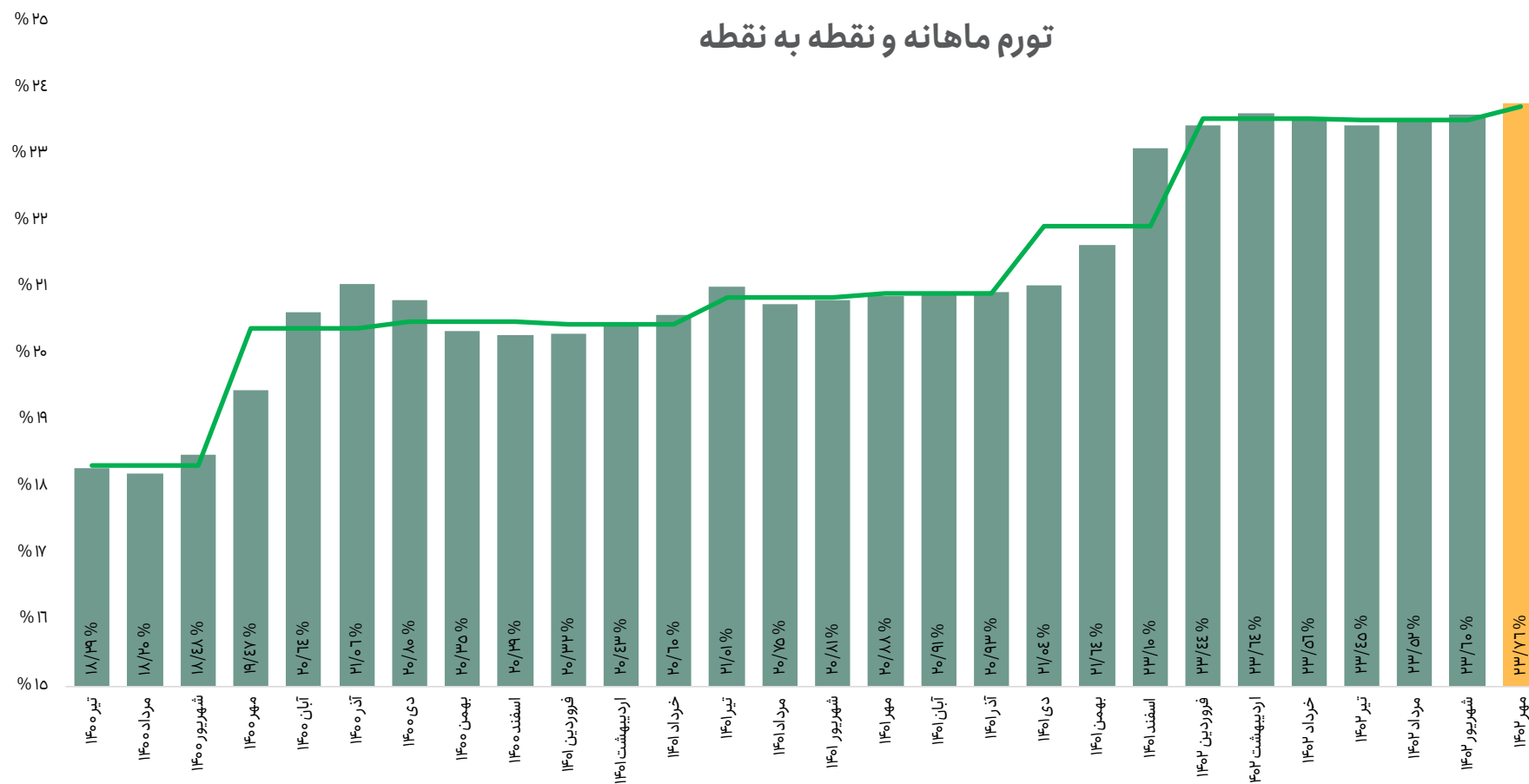


در ترازنامه خرداد ماه ۱۴۰۲ بانک مرکزی نسبت پول به کل نقدینگی به ۲۵/۷۳ درصد رسید، سهم حجم اسکناس نسبت به اردیبهشت ماه کاهش و سهم سپرده دیداری افزایش یافته است. سپرده های دیداری به صورت نقطه به نقطه (خرداد ۱۴۰۲ نسبت به خرداد ۱۴۰۱) ۵۱/۳ درصد و نسبت اسفند سال گذشته ۴/۵ درصد افزایش داشته است.



نرخ بهره بین بانکی

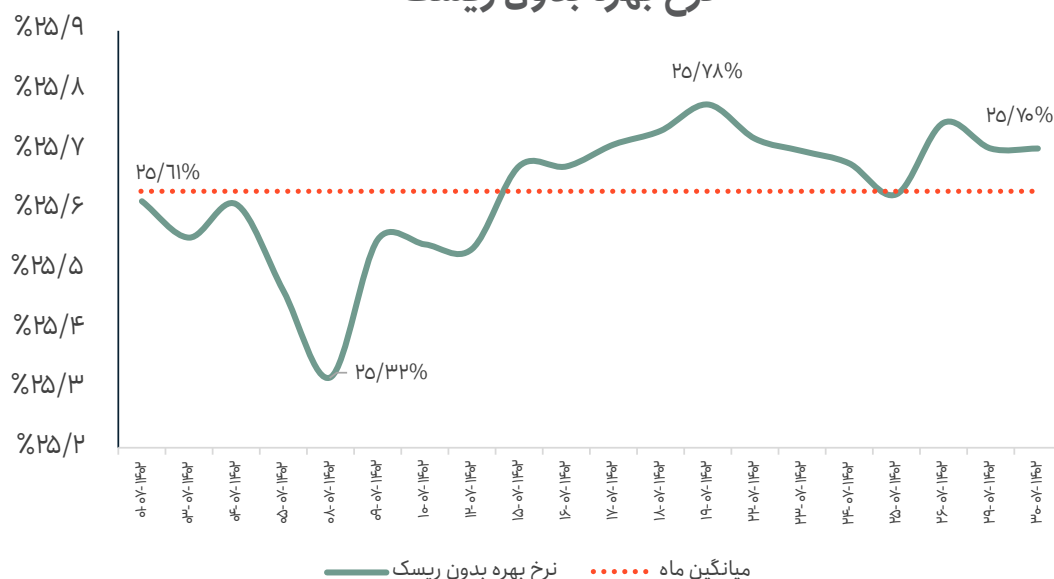
میانگین نرخ بهره بین بانکی در مهرماه ۲۳'۷۶ درصد ثبت شد که نسبت به شهریور ماه افزایشی ۰'۱۶ واحد داشته است. نرخ حداقل نرخ توافق بازخرید در ۲۴ درصد باقی ماند.



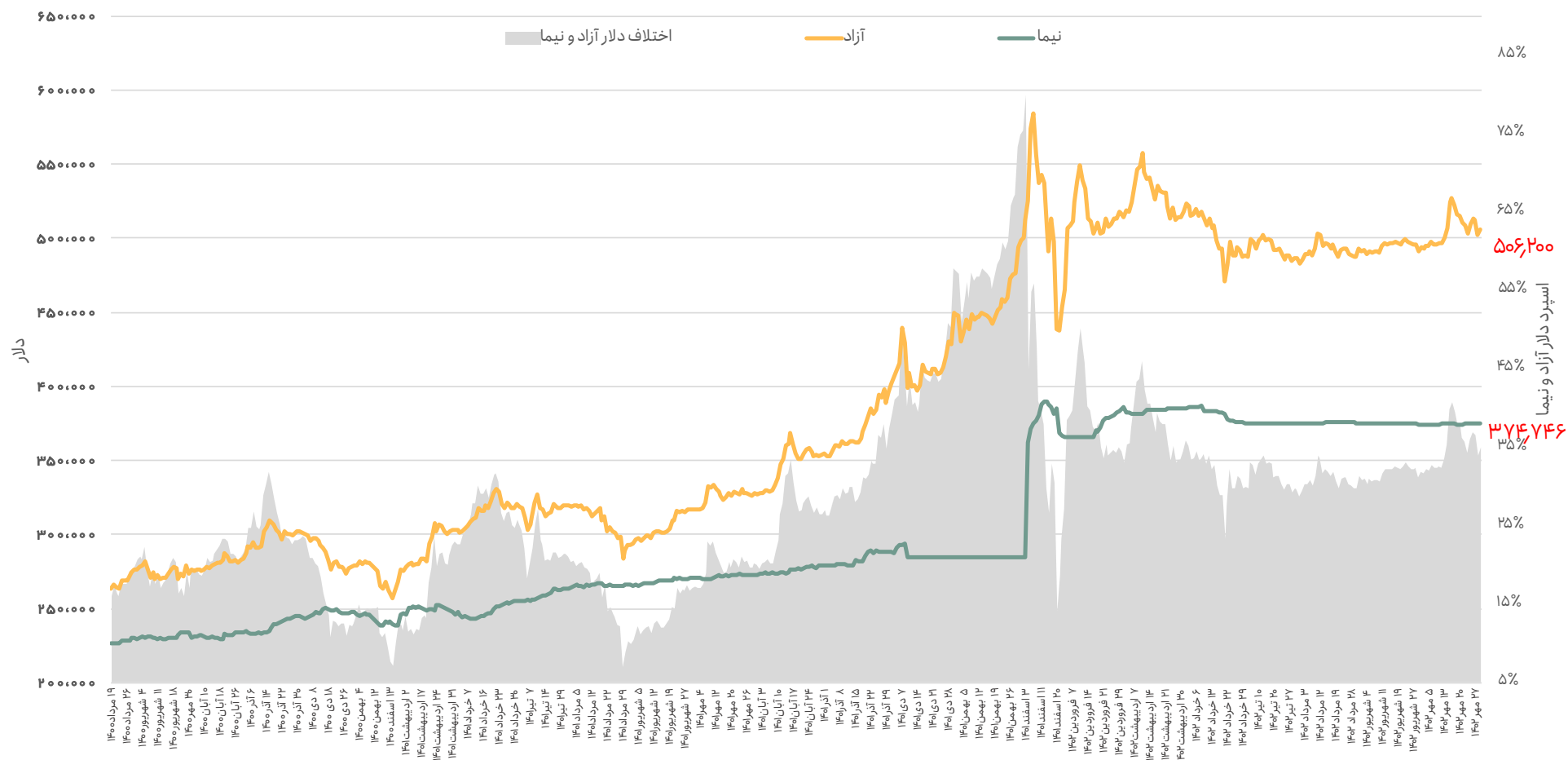
میانگین ماهانه نرخ بهره بدون ریسک

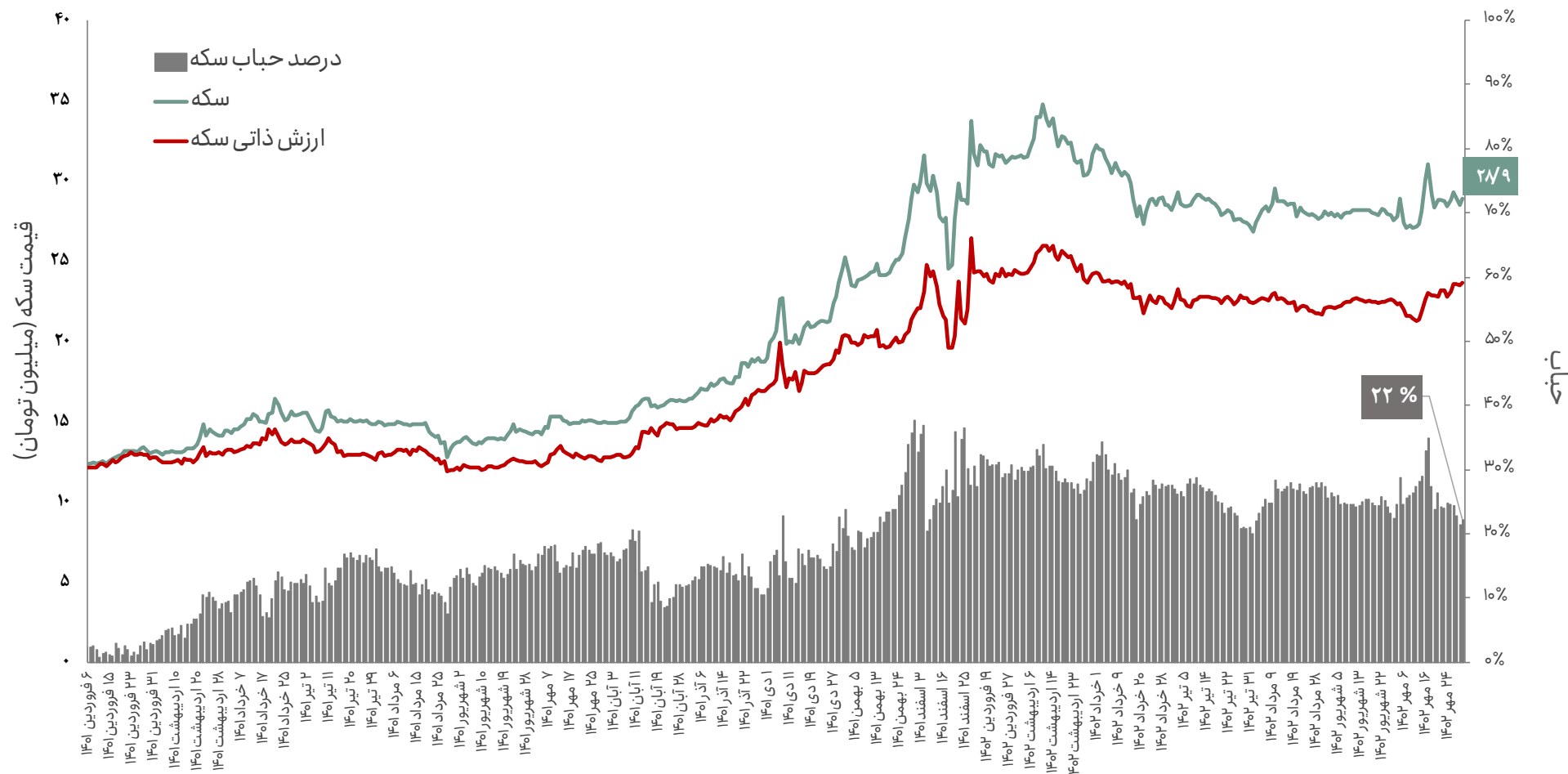
نوع گندم	میانگین نرخ بهره بدون ریسک ماهانه (میلیون ریال/۱۰۰ کیلوگرم)	میانگین فصل (میلیون ریال/۱۰۰ کیلوگرم)
فروردین ۱۴۰۲	۲۲/۴	۲۲/۴۰
اردیبهشت ۱۴۰۲	۲۲/۵	۲۲/۳۰
خرداد ۱۴۰۲	۲۲/۳	۲۲/۲۷
تیر ۱۴۰۲	۲۲/۳	۲۲/۲۷
مرداد ۱۴۰۲	۲۲/۴	۲۲/۲۷
شهریور ۱۴۰۲	۲۲/۱	۲۲/۲۷
مهر ۱۴۰۲	۲۲/۹	۲۴/۹۱
آبان ۱۴۰۲	۲۵/۱	۲۴/۹۱
آذر ۱۴۰۲	۲۶/۷	۲۷/۴۲
دی ۱۴۰۲	۲۷/۷	۲۷/۴۲
بهمن ۱۴۰۲	۲۷/۰	۲۶/۱۵
اسفند ۱۴۰۲	۲۷/۵	۲۶/۱۵
فروردین ۱۴۰۳	۲۶/۵	۲۶/۱۵
اردیبهشت ۱۴۰۳	۲۶/۳	۲۵/۱۲
خرداد ۱۴۰۳	۲۵/۶	۲۵/۱۲
تیر ۱۴۰۳	۲۴/۶	۲۵/۱۲
مرداد ۱۴۰۳	۲۴/۸	۲۵/۱۲
شهریور ۱۴۰۳	۲۵/۹	۲۵/۱۲
مهر ۱۴۰۳	۲۵/۶	۲۵/۱۲

نرخ بهره بدون ریسک



اختلاف دلار بازار آزاد و نیما





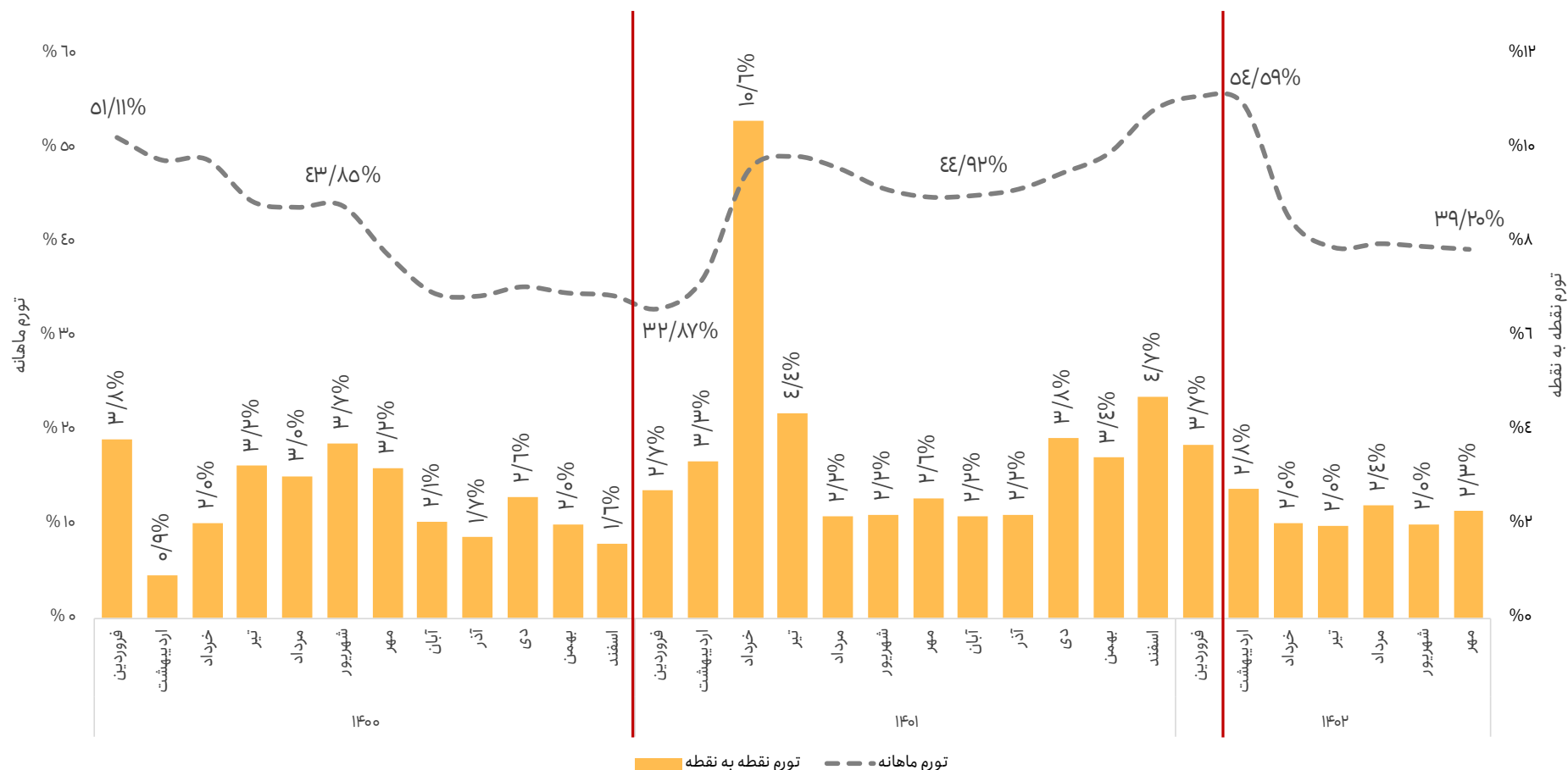
بدنبال تنش های غزه در مهرماه طلای جهانی با رشد همراه بود تا منجر به افزایش ارزش ذاتی سکه شود. با افزایش دلار و هیجانات در بازار ارز و طلا با شروع جنگ غزه حباب سکه مجددا صعودی شد اما با آرام شدن جو سیاسی حباب سکه به کمترین سطح از آذر سال گذشته رسید.

تورم مهرماه مجددا صعودی شد



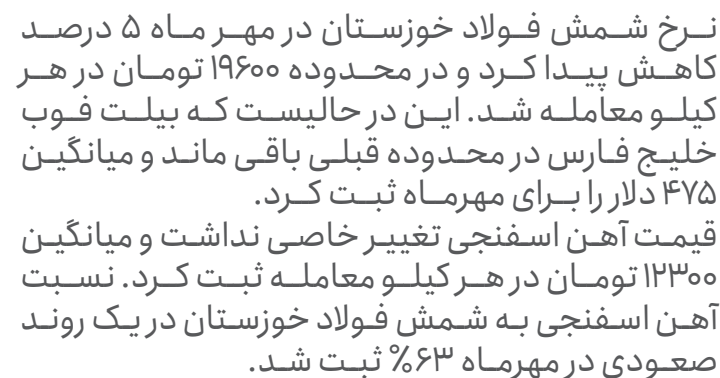
در مهرماه ۱۴۰۲ شاخص قیمت مصرف کننده خانوارهای کشور به عدد ۲۶,۵ رسیده است که نسبت به ماه قبل، ۲.۳ درصد افزایش، نسبت به ماه مشابه سال قبل، ۳۹.۲ درصد افزایش و در دوازده ماهه منتهی به ماه جاری نسبت به دوره مشابه سال قبل، ۴۵.۵ درصد افزایش داشته است. تورم ماهانه برای گروه‌های عمده «خوراکی‌ها، آشامیدنی‌ها و دخانیات»، ۵.۵ درصد و برای گروه عمده «کالاهای غیرخوراکی و خدمات»، ۳.۳ درصد بوده است..

تورم ماهانه و نقطه به نقطه





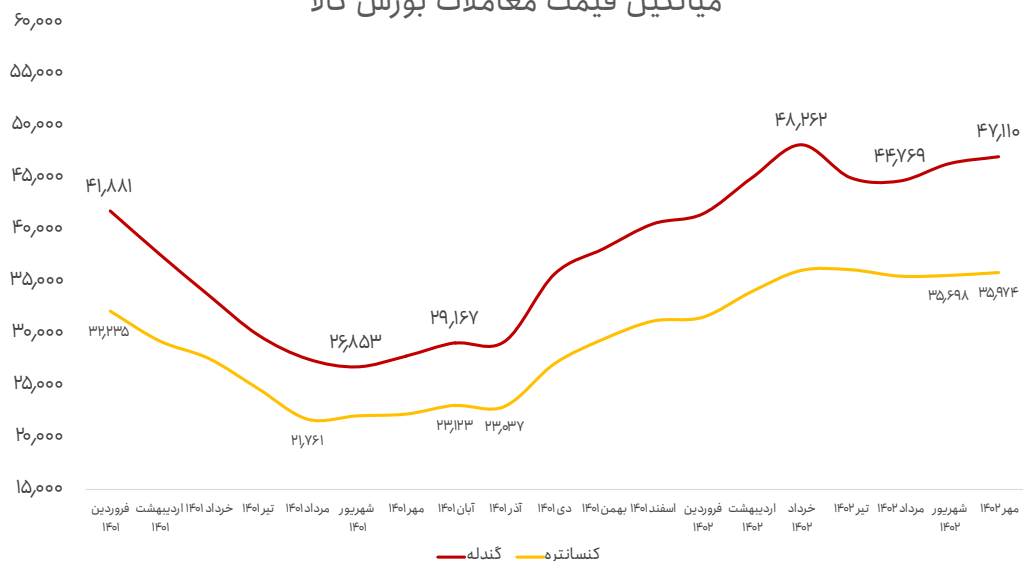
زنجیره فولاد



% ΔΔ



میانگین قیمت معاملات بورس کالا



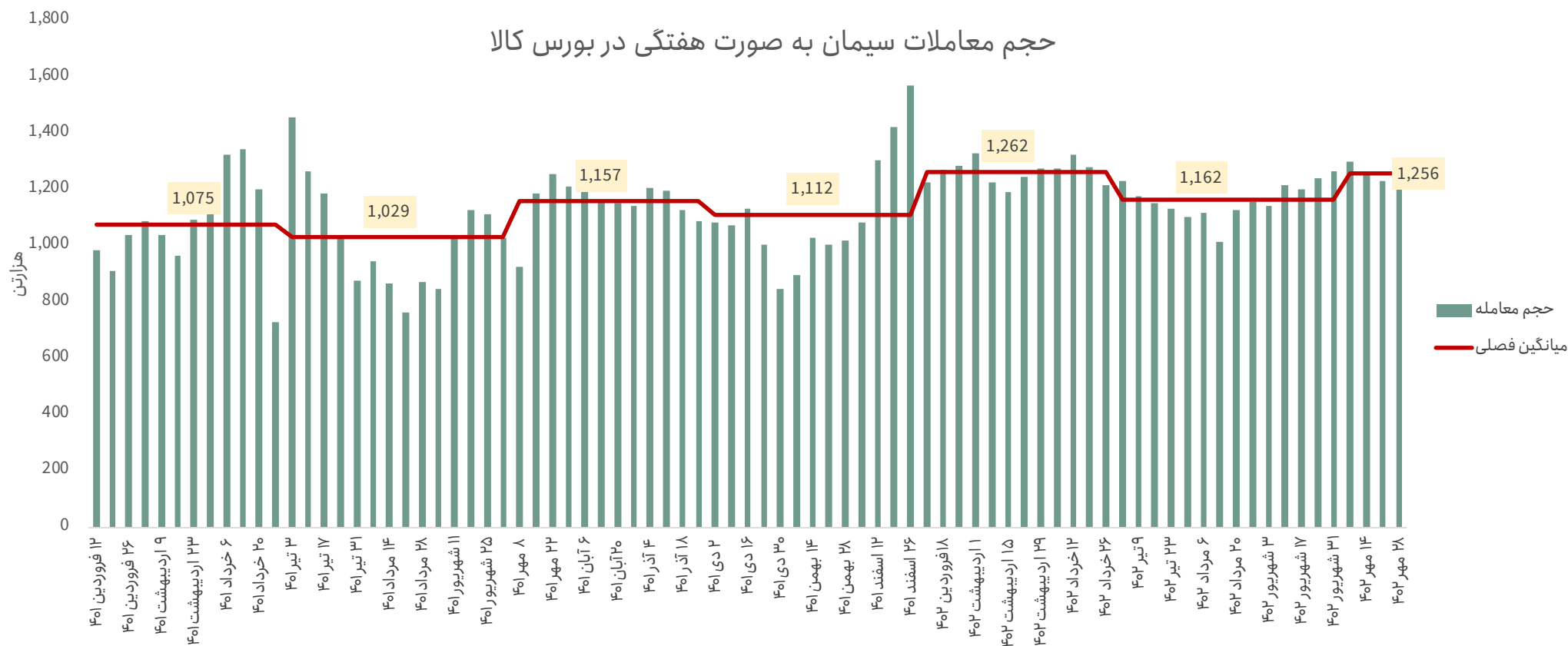


نام شرکت	۱۴۰۲/۰۱	۱۴۰۲/۰۲	۱۴۰۲/۰۳	۱۴۰۲/۰۴	۱۴۰۲/۰۵	۱۴۰۲/۰۶	۱۴۰۲/۰۷	تغییرات قیمت شهریور نسبت به مرداد
بنزن	۲۶۳,۸۱۲	۲۴۲,۸۷۵	۲۱۶,۲۲۴	۲۰۲,۷۲۵	۲۳۸,۲۱۲	۲۷۹,۴۴۲	۴۰۳,۰۱۵	%۴۴
آروماتیک سنگین	۲۲۳,۵۵۲	۱۸۶,۸۳۴	۱۸۱,۰۷۰	۱۹۲,۴۵۵	۲۲۲,۵۹۸	۲۴۱,۴۹۳	۳۲۵,۷۶۶	%۳۵
پلی بوتادین رابر	۴۳۹,۵۶۵	۴۰۶,۱۵۱	۳۹۷,۶۶۴	۳۵۸,۲۷۰	۳۶۹,۰۱۵	۴۵۹,۹۴۴	۵۷۹,۵۵۳	%۲۶
پارازایلین	-	۲۷۵,۲۳۸	۲۴۸,۹۳۳	۲۴۸,۰۵۴	۲۷۴,۳۸۲	۳۰۳,۵۳۰	۳۷۴,۳۰۱	%۲۳
لوب کات	۱۳۳,۱۵۷	۱۳۴,۴۷۸	۱۲۷,۰۶۲	۱۲۸,۳۱۷	۱۴۷,۹۰۳	۱۷۴,۶۱۱	۲۱۰,۲۱۷	%۲۰
دوده صنعتی	۴۲۵,۶۲۵	۴۳۲,۳۴۶	۴۴۶,۳۶۱	۴۷۲,۰۳۷	۴۵۹,۵۲۹	۴۷۲,۳۰۰	۵۵۷,۳۱۲	%۱۸
الکیل بنزن خطی	۴۳۹,۳۳۰	۴۱۸,۱۹۴	۳۹۳,۷۷۳	۳۹۰,۴۳۶	۳۶۹,۸۳۰	۴۶۰,۱۴۹	۵۱۹,۳۴۱	%۱۸
اوره	۷۷,۸۵۰	۷۷,۴۹۲	۷۸,۴۷۹	۷۳,۹۴۸	۹۷,۲۵۹	۱۱۱,۶۷۳	۱۲۹,۲۰۶	%۱۶
استایرن بوتادین رابر	۵۱۸,۲۵۸	۴۵۸,۱۰۰	۴۴۱,۵۵۱	۴۱۲,۰۸۴	۴۳۰,۶۵۵	۵۲۹,۳۸۸	۶۱۰,۹۴۶	%۱۵
پلی اتیلن ترفتالات	۵۱۷,۹۸۲	۴۷۹,۵۲۶	۴۰۵,۰۱۷	۴۳۵,۳۷۰	۳۸۰,۷۹۸	۴۳۳,۴۰۲	۴۹۸,۹۸۷	%۱۵
روغن پایه	۲۸۹,۷۴۵	۲۶۳,۶۲۶	۲۴۵,۹۹۷	۲۸۶,۸۸۸	۲۶۰,۹۶۸	۳۲۲,۷۸۹	۳۵۸,۹۰۲	%۱۱
پلی وینیل کلراید	۳۳۹,۰۹۱	۳۳۳,۳۵۵	۳۲۲,۹۲۳	۳۶۳,۹۱۱	۳۵۴,۲۴۱	۳۰۳,۶۲۶	۳۳۵,۰۰۷	%۱۰
پلی پروپیلن	۴۱۸,۳۸۳	۵۰۸,۴۴۲	۴۶۴,۴۵۵	۴۹۴,۷۲۱	۴۲۶,۴۷۰	۴۷۰,۶۱۹	۵۱۵,۲۹۲	%۹
ارتوزایلین	۳۳۲,۹۱۰	۳۲۵,۲۶۷	۳۶۸,۹۱۲	۳۳۰,۷۷۴	۲۸۴,۷۶۲	۳۷۰,۳۲۵	۳۹۲,۴۲۴	%۶
پلی اتیلن سنگین	۳۲۱,۹۵۰	۳۲۵,۵۳۷	۳۰۲,۵۲۴	۳۰۲,۵۴۶	۲۸۲,۷۵۲	۳۴۶,۶۶۳	۳۶۳,۱۳۰	%۵
پلی اتیلن سبک	۳۲۱,۸۲۸	۳۰۷,۸۵۸	۲۸۵,۳۸۰	۳۰۱,۲۸۷	۲۹۲,۲۹۷	۳۴۵,۲۲۵	۳۶۱,۶۰۶	%۵
استایرن منومر	۳۱۵,۱۹۶	۲۹۴,۳۵۵	۲۸۷,۸۴۶	۲۵۳,۹۳۳	۲۷۳,۶۹۷	۴۷۴,۸۴۴	۴۸۸,۶۳۲	%۳
پلی استایرن	۴۲۶,۰۱۰	۳۹۲,۴۶۲	۳۵۲,۰۰۰	۳۳۹,۵۹۶	۳۴۲,۶۲۷	۳۸۵,۵۷۴	۳۸۴,۱۰۰	%۰
وکیوم باتوم	۱۵۵,۶۹۰	۱۳۲,۲۶۷	۱۱۳,۵۰۶	۱۲۶,۵۶۰	۱۴۱,۲۵۵	۱۳۹,۳۸۴	۱۳۶,۴۳۱	%-۲

بیشترین رشد نسبت به ماه گذشته :اوره، بنزن، آروماتیک، پلی بوتادین رابر
بیشترین افت نسبت به ماه گذشته : پلی استایرن و وکیوم باتوم



روند هفتگی معاملات سیمان در بورس کالا



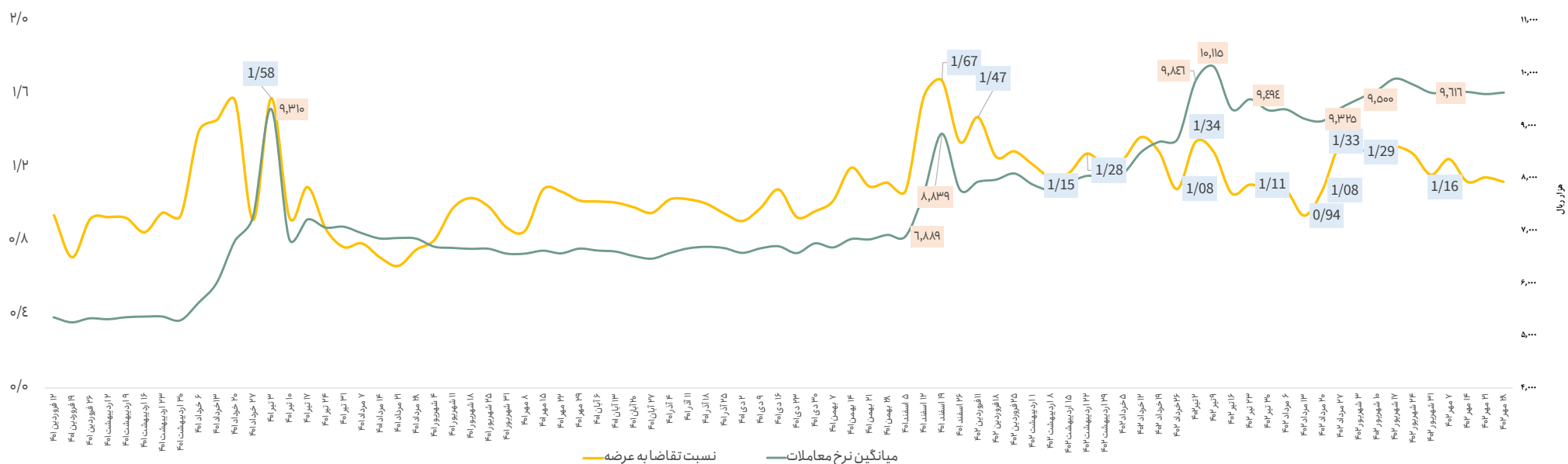
در ۵ هفته مهرماه ۶۸۴۸ هزار تن انواع سیمان عرضه شده که با تقاضای ۷۷۹۴ هزار تنی همراه بود و نهایتاً ۶۰۶۵ هزار تن معامله شد.

میانگین نرخ معاملات انجام شده در بورس کالا در مهرماه ۹۵۷ تومان در هر کیلو ثبت شد که نسبت به ماه قبل کاهش ۵٪ داشته است.

رند هفتگی معاملات سیمان در بورس کالا



رند هفتگی معاملات سیمان در بورس کالا

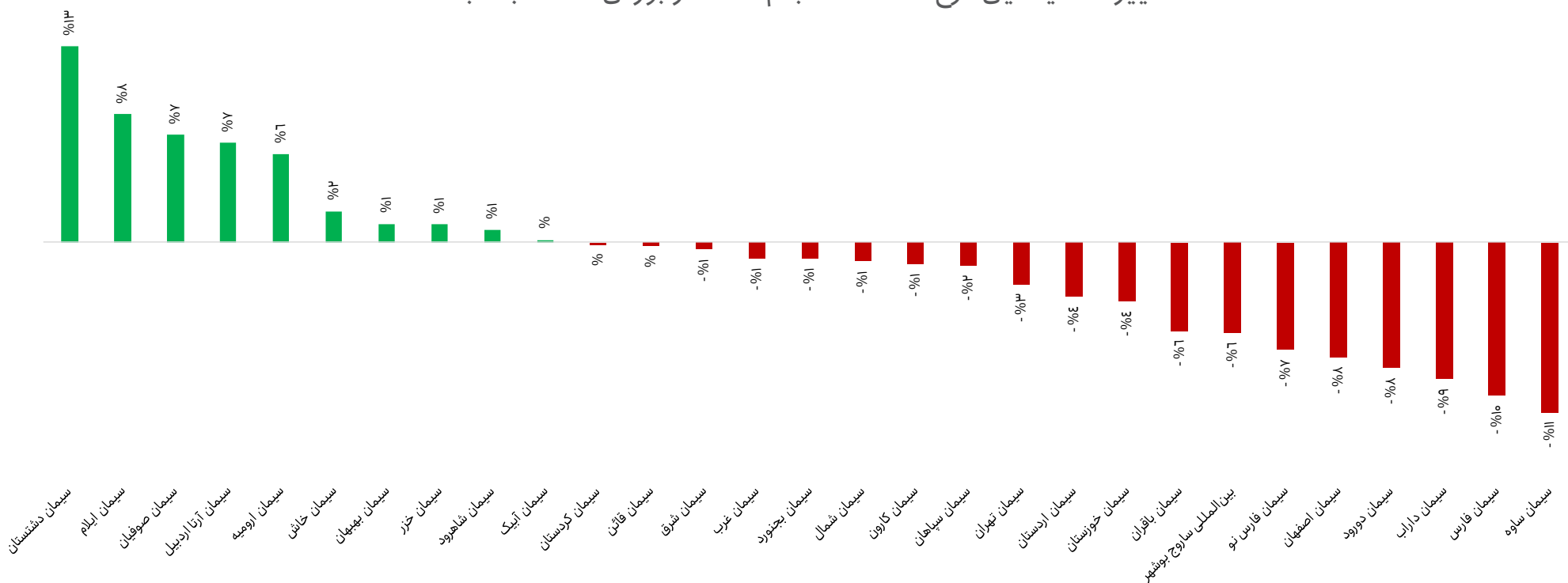




معاملات بورس کالا - سیمان

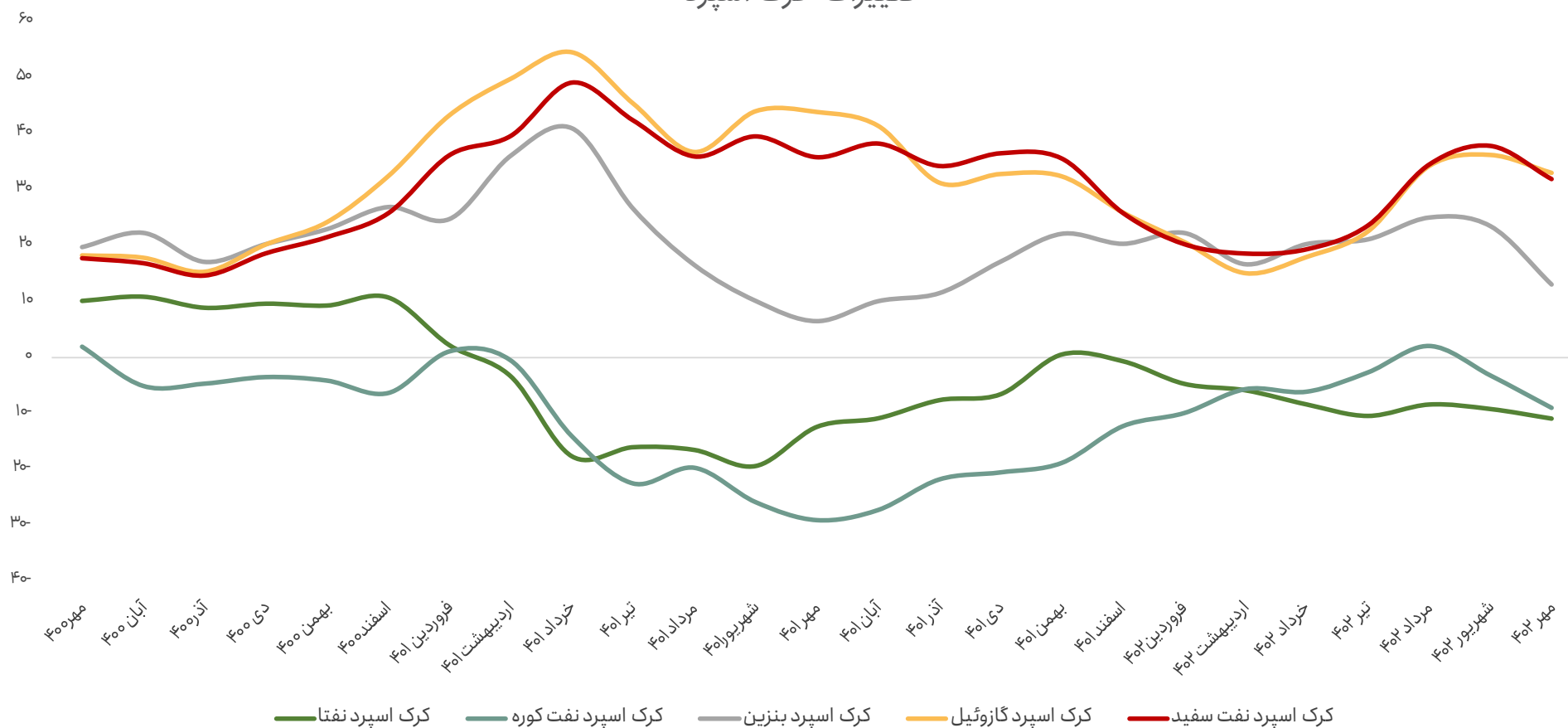
سیمان دشتستان و فارس بیشترین رشد و سیمان ساوه و فارس بیشترین افت نرخ را در معاملات مهرماه نسبت به ماه قبل داشته اند

تغییرات میانگین نرخ معاملات انجام شده در بورس کالا نسبت به ماه





تغییرات کرک اسپرد





معاملات بورس کالا - فرآورده های نفتی

مهر ۱۴۰۲	شهریور ۱۴۰۲	مرداد ۱۴۰۲	تیر ۱۴۰۲	خرداد ۱۴۰۲	اردیبهشت ۱۴۰۲	فروردین ۱۴۰۲	میانگین ۱۴۰۱	
۳۲/۷	۳۶/۲	۳۴/۲	۲۲/۶	۱۸/۰	۱۵/۱	۲۰/۷	۴۰/۰	کرک اسپرد گازوئیل
۱۲/۸	۲۳/۵	۲۵/۰	۲۱/۱	۲۰/۳	۱۶/۶	۲۲/۳	۲۰/۰	کرک اسپرد بنزین
۳۲/۴	۳۷/۹	۳۴/۶	۲۳/۷	۱۹/۵	۱۸/۷	۲۰/۴	۳۷/۳	کرک اسپرد نفت سفید
-۱۰/۷	-۹/۳	-۸/۵	-۱۰/۵	-۸/۵	-۵/۹	-۴/۸	-۸/۸	کرک اسپرد نفتا
-۸/۷	-۳/۲	۲/۱	-۲/۷	-۶/۱	-۵/۷	-۹/۹	-۱۷/۸	کرک اسپرد نفت کوره
۹۰/۴	۹۰/۲	۸۴/۸	۷۸/۴	۷۵/۱	۷۶/۴	۸۱/۳	۹۴/۳	میانگین نفت
۸۱/۶	۸۱/۲	۷۳/۳	۶۶/۶	۶۵/۵	۶۸/۷	۷۵/۲	۸۸/۲	میعانات پارس جنوبی



کارگزاری بارز
BAREZ BROKERAGE