



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

آغاز سال جدید و خروج بازار از روند نزولی میان مدت

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۹۹ - هفته منتهی به ۲۰ فروردین ۱۴۰۱

گروه تحلیل گران شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com
EhtemamIranian.ir
eii.co.ir

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: بحران غذایی؛
- تصویر اقتصاد کلان: سکه طلا با بیشترین بازدهی سالانه در میان بازارها؛
- بورس و انرژی: ریزش بورس های جهانی و عقب نشینی قیمت نفت از سقف قیمتی خود؛
- فلزات گرانبها و ارز: حفظ جذابیت طلا در سایه تداوم تنش بین روسیه و اوکراین؛
- بازار کالاهای خام: آتش جنگ در دریای سیاه؛
- بررسی صندوق‌ها و بازدهی آنها؛
- بررسی بورس کالا؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - شروع روند صعودی پس از ماه‌ها نزول؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - مقاومت محکم ۴۸ هزار دلار مانع ادامه رشد بیت‌کوین؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - تقابل شاخص دلار با اصلی‌ترین مقاومت خود؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - تقابل شاخص دلار با اصلی‌ترین مقاومت خود؛
- بررسی شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار؛
- ارزیابی دلاری شاخص کل و محاسبه شاخص وارن بافت؛
- مقایسه نسبت‌های مالی هلدینگ‌های چندرشته‌ای صنعتی؛

حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی

بحران غذایی

با طولانی‌تر شدن جنگ در اوکراین و اوضاع نابسامان مراتع این کشور و زنجیره تامین جهان، بحران غذایی در مناطق در حال توسعه قریب الوقوع می‌باشد.

بلومبرگ
Bloomberg

اشاره

بالتر رفتن قیمت مواد غذایی در جهان و بر هم خورد نظم این بازار موضوعی است که اذهان بسیاری از فعالان حوزه سیاست و اقتصاد را به خود اختصاص داده و بنا بر اعلام دولت آمریکا، شرایط در ۶ ماه آتی وخیم‌تر نیز خواهد شد.

اکنون شاهدیم که با وجود واکنش شدن جهان، اومیکرون هنوز جولان می‌دهد و نیاز به واکنش‌های بهتر و پیشرفته تری برای مقابله با این بیماری احساس می‌شود.

هدف قراردادن غیر نظامیان توسط نیروهای روس در اوکراین و ارتکاب جنایت جنگی خیر داغ این هفته است که اکنون سازمان ملل در حال بررسی صحت وقوع آن می‌باشد.

فعالان حوزه‌ی رمز ارز نیز برخی ناکامی‌های دو فصل اخیر این بازار را به فعالیت سنگین ضد تبلیغاتی بزرگان بازار و سرمایه‌گذاران سنتی بر ضد این بازار عنوان می‌کنند.

حمایت بانک مرکزی ژاپن و آلمان از صنایع خود که به خاطر بحران انرژی و زنجیره تامین دچار مشکل شده اند از دیگر اخبار مهم این هفته بود.

BUSINESS
INSIDER
بیزینس اینسایدر

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۴۹۷,۸۳۵,۲۲۴	+۱,۴۰%
جان باختگان ۶,۱۹۹,۲۷۶	+۰,۳۳%
بهبودیافتگان ۴۳۳,۲۰۴,۱۷۳	+۱,۹۶%

فایننشال تایمز
FT
FINANCIAL
TIMES

- قیمت تمام مواد غذایی اصلی در محدوده رکورد تاریخی خود نوسان میکند.
- نفت بخش زیادی از جهش قیمتی با محرک جنگ خود را، به خاطر عرضه‌ی ذخائر استراتژیک و قرنطینه شانگهای عقب نشست.
- با صدمه زدن جنگ در اروپا به زنجیره تامین، پیش بینی می‌شود که افزایش قیمت مواد غذایی ادامه‌دار باشد.
- سازمان ملل متحد روسیه را از عضویت در شورای حقوق بشر معلق کرد.
- اتخاذ سیاستهای پولی جدید توسط اتحادیه‌ی اروپا، بازارهای مالی را به سردرگمی فرو برد.
- بازار ۱۲۰ میلیارد دلاری غلات در جهان تحت تاثیر حمله به اوکراین در آشوب به سر می‌برد.
- حملات مسلحانه در اسرائیل، موضع احزاب تندرو را قوی‌تر کرد.
- به نقل از سازمان ملل ریسک بحران غذایی و سو تغذیه به خاطر جنگ اوکراین به شدت متوجه خاورمیانه است.
- جهان به واکنش‌های بویستر بهتری نیاز دارد.
- مقامات سازمان ملل متحد برای بررسی صحت جنایات جنگی مرتکبه توسط روسیه به شهر بوچا خواهند رفت.
- در حمله‌ی موشکی روسیه به یک ایستگاه قطار که در حال تخلیه‌ی غیر نظامیان بود، حدود ۱۵۰ تن کشته و زخمی شدند.
- شرکتهای بزرگ حوزه تکنولوژی خطاب به دولتمردان: به جای دنبال کردن بی نتیجه‌ی قوانین ضد انحصار و آنتی‌تراست، قوانین جدیدی برای حوزه‌ی حریم خصوصی تصویب کنید.

- یوان چین، در حساب‌های ارزی مشتریان بانک‌های روسیه، در حال جایگزینی دلار و یورو است.
- محققین توانستند سلول‌های بدن انسان را ۳۰ سال جوانتر کنند و روند مسن شدن آنها را معکوس کنند!
- بیتکوین در کف قیمتی دو هفته‌ی اخیر خود.
- ایلان ماسک در پی بهم زدن نظم جاری و قوانین فعلی دنیای شبکه‌های اجتماعی.
- تحریم‌های غرب، در حال فلج کردن اقتصاد روسیه.
- بازار ملتهب مسکن آمریکا، هنوز هم موجب ناکامی متقاضیان در تهیه‌ی مسکن است.
- پیتربیل، سرمایه‌گذار مهم و با نفوذ آمریکایی، از وارن بافت جیمی دیمن و لری فینک را به برپایی حکومت سالخوردگان برحوزه ایده‌های مالی جهان متهم کرد و دشمن اول بیتکوین خواند.
- صرافی رابین‌هود، کیف پول رمز ارز خود را در اختیار دو میلیون نفر از مشترکان متقاضی خورد قرار داد.
- سرمایه‌گذاران بزرگ بیتکوین با جوسازی حول مساله تورم دلار، سرمایه‌گذاران را به آمدن زیر چتر بیتکوین فرا خواندند.
- حوزه‌ی ساخت ساز، جولانگاه بعدی استارت‌آپ‌های سبز گرا و حافظ محیط زیست خواهد بود.

- بانک مرکزی روسیه، برای حمایت از اقتصاد در حال کوچک شدن این کشور، نرخ بهره را به ۱۷% کاهش داد.
- آلمان، به شرکتهای حوزه انرژی که از جنگ اوکراین ضربه خورده اند، ۱۰۰ میلیارد دلار وام خواهد داد.
- زیان ۴۳۰ میلیون دلاری بخش کامیون سازی ولوو پس از توقف فعالیت ها در روسیه
- آلمان و انگلیس، برای نشان دادن موضع خود در قبال جنگ جاری، کمک‌های تسلیحاتی بیشتری به اوکراین می‌کند.
- بانک مرکزی ژاپن به دنبال تصویب یک بسته حمایتی ۴۳۰ میلیارد دلاری بلند مدت است.
- شرکتهای بزرگ استخراج بیتکوین، برای گسترش فعالیت خود چشم به خاورمیانه و انرژی ارزان این منطقه است.
- شرکت اسپیس‌ایکس، سه توریست را به ازای ۵۵ میلیون دلار برای هر بلیط به ایستگاه فضایی فرستاد.
- تعداد خودروهای الکتریکی در حال تردد سطح جهان به مرز ۲۰ میلیون دستگاہ رسیده است.
- شرکتهای بزرگ، در حال سرمایه‌گذاری بخش اعظم سودهای کلان دو سال اخیر خود در حوزه تحقیق و توسعه جهت عقب‌نماندن از آینده هستند.
- هزینه‌ی بیمه‌ی کشتی‌های در دریای سیاه، خارج از کنترل و توان پرداخت شرکتهای کشتی رانی.
- دولت آمریکا: صادرات ذرت و گندم اوکراین، در ماه‌های آتی کاهش شدیدی خواهد داشت و موجب دامن زد هرچه بیشتر به بحران خواهد بود.
- بحران غذایی ناشی از افزایش قیمت‌ها در نتیجه‌ی جنگ اوکراین، گریبانگیر غرب آفریقا شده است.

تصویر اقتصاد کلان

سکه طلا با بیشترین بازدهی سالانه در میان بازارها

نرخ بهره (درصد)	فصلی	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی
		نرخ رشد اقتصادی (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	۲۰۲۰	-	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
-	-	-	-	%۳/۱۸	-	%۵/۹	۱۰,۸۴۵	۸۴,۵۳۷,۶۹۰	مقدار شاخص
				-	-	%۴/۴	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
آمریکا									
۲۲-مارس	۲۱-دسامبر	۲۲-فوریه	۲۲-مارس	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۰/۵۰	%۶/۹	%۷/۹	%۳/۶	%۴/۷	%۳/۹	%۵/۵	۶۳,۴۱۶	۲۰,۹۳۲,۷۵۰	مقدار شاخص
				-	-	%۴	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
چین									
۲۱-فوریه	۲۱-دسامبر	۲۱-دسامبر	۲۱-دسامبر	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۳/۷	%۱/۶	%۰,۹	%۵/۱	%۰/۹	%۵/۱	%۴	۱۰,۴۸۵	۱۴,۷۲۳,۸۳۷	مقدار شاخص
				-	-	%۴/۸	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه یورو									
۲۲-فوریه	۲۱-دسامبر	۲۲-ژانویه	۲۱-دسامبر	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۰/۰۰	%۰/۳	%۵/۱	%۷	%۲/۶	%۷/۹۲	%-۶/۳	۳۷,۷۲۳	۱۲,۹۱۶,۶۱۸	مقدار شاخص
				%۲/۲	%۸	%۵	پیش‌بینی (۲۰۲۱)		
ایران									
۲۱-دسامبر	۱۴۰۰-پاییز	۱۴۰۰-اسفند	۱۴۰۰-زمستان	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۱۸	۳,۸	%۴۰,۲	%۹,۴	%۴۴	%۸/۹	%۲/۵	۷,۵۵۵	۲۰,۳,۴۷۱	مقدار شاخص
				-	-	%۲	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		

مقایسه بازدهی بازارها

بازار	هفتگی	ماهانه	۱۴۰۱	یکساله
دلار (ریالی)	۲,۳۳%	۴,۸۵%	۵,۵۷%	۱۱,۹۹%
سکه (ریالی)	۲,۳۷%	۴,۶۸%	۳,۵۷%	۱۸,۷۵%
بورس (شاخص)	۲,۲۲%	۱۲,۵۷%	۶,۵۲%	۱۳,۹۶%
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	-۹,۱۳%	۱۱,۷۲%	۵,۸۶%	-۰,۲۶%
مسکن (ریالی - تهران)	-	۶/۲%	-	۱۶,۴۰%

بورس و انرژی

ریزش بورس های جهانی و عقب نشینی قیمت نفت از

سقف قیمتی خود

بورس های جهانی

سیاستهای جدید بانک مرکزی اروپا، تحریم بیشتر بخش انرژی و صنعت روسیه و نگاه به رفتار فدرال رزرو در تعیین نرخ بهره، دلیل سردرگمی بازار در هفتهی اخیر بود. شرکتها که همچنان به خاطر خروج از بازار روسیه در حال متحمل شدن زیان هستند و با وجود کاهش قیمت نفت، بالا بودن قیمت محصولات پتروشیمی و پالایشی بسیاری از صنایع را با مشکل روبرو کرده است. افق کاهش سود دهی شرکتها در نتیجهی این عوامل اقبال و تقاضای سهام آنها را در هفتهی اخیر زیر سوال برده است.

هفتهی گذشته، ایلان ماسک، ثروتمند ترین فرد جهان و مالک کمپانی های تسلا و اسپیس ایکس، با خرید ۹.۲ سهام شرکت توئیتر باعث بالا رفتن ۳۰ درصدی ارزش سهام این شرکت شد که در ادامه ی هفته با متعادل شدن، به قیمت قبلی برگشت.

موج فشار جدید مجلس نمایندگان و سنای آمریکا بر ۷ غول حوزه ی تکنولوژی جهت اعمال سیاستهای ضد انحصار روی آنها، از دلایل افت ارزش این شرکتها طی این هفته بود. شایان ذکر است دلیل عدم توفیق دولت آمریکا در انجام این امر پیچیدگی بیش از حد فرایند مورد التزام جهت اجرای این رویکرد بوده و بنا بر اظهار نظر متخصصان، با رویکرد فعلی، توان تدوین یک فرایند یکپارچه و موفق برای انجام این کار مانند آنچه دولت در ابتدای قرن ۲۰ام انجام داد وجود ندارد و فعلا، تهدید سیستماتیکی در این زمینه، متوجه شرکتهای مذکور نیست.

نفت و محصولات پتروشیمی

آزادسازی روزانه ذخائر نفتی استراتژیک ایالات متحده هم زمان با قرنطینهی کامل شانگهای و ترس از شروع قرنطینهی های گسترده بعدی و موج های آتی کرونا، باعث شد قیمت نفت از سقف قیمتی ای که به واسطه وحشت ناشی از جنگ اوکراین بدان رسیده بود عقب نشینی کند و تا کانال ۱۰۰ دلار پایین بیاید. کم شدن هیجانان بازار در مورد نفت در صورتی اتفاق میافتد که هنوز بحران انرژی در اروپا در حال شدت گرفتن است و با اقدامات جدید اتحادیه اروپا در راستای تحریم صنایع انرژی روسیه و همچنین زغال سنگ این کشور، قیمت هر کیلووات ساعت برق در فرانسه، از سقف تاریخی خود عبود کرده است.

همچنین سوخت جت هم اکنون قیمتی حدودا دو برابر بالاترین قیمت تاریخی خود در سال ۲۰۰۸-۲۰۰۹ دارد. با وجود اینکه قیمت نفت از محدوده ی قیمتی ناشی از ترس خود عقب نشینی کرده، روند کلی بازار تغییری نکرده و پیش بینی میشود رشد پایستهی قیمت تا پایان تابستان ادامه داشته باشد.



منبع

بورس های جهانی و انرژی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
بورس های جهانی						
۱	Dow Jones	۳۴,۷۳۶	واحد	-۰,۲۶%	۶,۴۲%	۳,۶۰%
۲	Nasdaq	۱۴,۳۲۷	واحد	-۳,۵۹%	۷,۹۹%	۴,۱۳%
۳	S&P ۵۰۰	۴,۴۸۹	واحد	-۱,۲۱%	۷,۷۰%	۹,۴۸%
۴	FTSE ۱۰۰	۷,۶۵۴	واحد	۱,۱۵%	۹,۲۲%	۱۰,۴۱%
۵	DAX	۱۴,۲۸۴	واحد	-۱,۱۳%	۱۱,۳۲%	-۶,۰۵%
۶	CAC ۴۰	۶,۵۴۸	واحد	-۲,۰۴%	۹,۸۱%	۶,۲۰%
۷	NIKKEI ۲۲۵	۲۶,۹۸۶	واحد	-۲,۴۶%	۸,۸۵%	-۹,۱۷%
۸	SHANGHAI	۳,۲۵۲	واحد	-۰,۹۴%	-۱,۲۷%	۶,۸۵%
۹	Moex	۲,۵۹۳	واحد	-۶,۰۵%	۰,۵۵%	-۲۵,۶۳%
نفت و انرژی						
۱۰	نفت خام برنت	۱۰۲,۴۰	دلار/بشکه	-۲,۲۴%	-۱۷,۹۷%	۷۲,۴۸%
۱۱	نفت خام WTI	۹۷,۴۲	دلار/بشکه	-۱,۰۰%	-۱۶,۲۳%	۷۵,۴۱%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۶,۳۲	دلار / MMBtu / سنت / مترمکعب	۱۰,۵۴%	۳۹,۷۰%	۱۵۰,۳۲%
۱۳	سبب اوپک	۱۰۰,۱۲	دلار/بشکه	-۱۳,۲۵%	-۸,۴۰%	۳۰,۸۶%
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۹,۵۹	دلار/بشکه	-۵,۶۵%	-۱۵,۶۸%	۶۹,۶۳%
۱۵	گازوئیل	۱,۰۲۸	دلار/تن	-۶,۹۹%	-۲۴,۴۴%	۹۴,۳۷%
۱۶	نفتا	۸۲۶,۶۷	دلار/تن	-۳,۶۲%	۱۹,۹۸%	۷۴,۰۶%
۱۷	اتانول	۲,۵۲	دلار/گالن	۴,۲۴%	۰,۰۰%	۲۶,۵۳%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۳,۰۲۳	یوان/تن	-۸,۵۸%	-۱۸,۸۳%	۶۷,۴۴%
۱۹	متانول CFR	۳۹۵	دلار/تن	-۱,۵۲%	۱,۲۷%	۲۴,۰۵%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۸۴۵,۶۷	دلار/تن	-۸,۱۰%	۲۴,۰۰%	۵۵,۱۱%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱۳۷۰	دلار/تن	-۲,۱۹%	۸,۰۳%	۲۳,۷۲%

فلزات گرانبها و ارز

حفظ جذابیت طلا در سایه تداوم تنش بین روسیه و اوکراین

بازار فلزات گرانبها

اونس جهانی طلا هفته‌ای نوسانی را سپری کرده و با ثبت بازدهی مثبت ۱.۱۴ درصد به کار خود پایان داد. از علل نوسانات منفی طلا می‌توان به انتشار صورت جلسه فدرال رزرو اشاره کرد که نشان می‌داد بانک مرکزی آمریکا به منظور مقابله با تورم، افزایش سریعتر نرخ بهره و کاهش دارایی‌های ترانزنامه‌ی خود را در دستور کار قرار داده است. همین عامل سبب بالا رفتن شاخص دلار و افزایش بازدهی اوراق قرضه ۱۰ ساله آمریکا شد به طوری که این اوراق با ثبت بالاترین میزان بازدهی خود طی ۳ سال اخیر به عدد ۲.۷ درصد رسید. آنچه که جذابیت طلا را حفظ کرده و مانع افت بیشتر قیمت طلا شد، جنگ بین روسیه و اوکراین و بالا گرفتن تنش‌ها طی روزهای پایانی هفته بود.

سکه و ارز (داخلی)

هفته گذشته با توجه به انتشار سیگنال‌های منفی از مذاکرات، شاهد بالا رفتن نرخ ارز بودیم. در ادامه، افزایش نرخ دلار و اونس جهانی طلا و همچنین جنگ بین روسیه و اوکراین، افزایش قیمت سکه و طلای داخلی را به همراه داشته به طوری که بازار طلا با ثبت بازدهی هفتگی مثبت ۲.۳ درصد به کار خود پایان داد.

رمزارز

نخست‌وزیر روسیه اعلام کرد که دارایی‌های ارز دیجیتال روس‌ها میلیاردها دلار ارزش دارد، اما دولت هنوز یک چارچوب نظارتی برای این صنعت اتخاذ نکرده است. میخائیل میشوستین در ارائه گزارش سالانه دولت روسیه ادعا کرد که روس‌ها مجموعاً بیش از ۱۰ تریلیون روبل (۱۳۰ میلیارد دلار) در رمزارزهایی مانند بیت کوین، سرمایه دارند. نخست‌وزیر منبع این رقم را ذکر نکرد و با اشاره به اینکه این مبلغ بر اساس «برآوردهای مختلف» است، اظهار داشت: ما به خوبی می‌دانیم که بیش از ۱۰ میلیون جوان داریم که تا کنون کیف پول‌های رمزارزی را ایجاد کرده‌اند که ارزش آن‌ها بیش از ۱۰ تریلیون روبل است. اگر این برآوردها که توسط میشوستین ذکر شده درست باشد، آخرین تخمین‌ها از ذخایر ارزهای دیجیتال روسیه، بسیار نزدیک به ذخیره طلای روسیه است که طبق گزارش‌ها تا اواخر مارس ۲۰۲۲ (اواسط فروردین ۱۴۰۱) به ۱۴۰ میلیارد دلار رسیده است. در اوایل سال جاری، برخی منابع مجموع دارایی‌های کریپتو روسیه را ۲۱۴ میلیارد دلار تخمین زدند. علیرغم سرمایه‌گذاری فزاینده روس‌ها در ارزهای دیجیتال، دولت روسیه در اتخاذ قوانین شفاف برای تنظیم بازار رو به رشد ارزهای دیجیتال تا حدودی کند عمل کرده است، زیرا ساختارهای دولتی مختلف نتوانسته‌اند در مورد نحوه تنظیم و قانونگذاری این صنعت به اجماع برسند. در ادامه روز جمعه، وزارت دارایی روسیه نسخه دیگری از لایحه کریپتو روسیه را پس از اصلاح سند مطابق با اظهارات سایر وزارتخانه‌ها و تنظیم‌کننده‌ها، به دولت ارائه کرد.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۹۴۵	دلار/اونس	۱,۱۴%	-۲,۲۹%	۱۱,۶%	TeleTrader
۲	نقره	۲۴,۷۶	دلار/اونس	-۰,۵۳%	-۳,۸۴%	-۱,۹۴%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۱۸ فروردین							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۲,۸۷۸,۰۰۰	ریال	۲,۳۹%	۵,۲۳%	۲۱,۶۶%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۲۸,۱۶۰,۰۰۰	ریال	۲,۳۷%	۴,۶۸%	۱۹,۲۳%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۱۸ فروردین							
۵	دلار آزاد	۲۷۴,۸۳۰	ریال	۱,۳۶%	۶,۷۵%	۱۲,۳۵%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۴۳,۹۱۶	ریال	۳,۲۴%	۲,۲۶%	۷,۲۷%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۴۶,۱۳۲	ریال	۳,۲۴%	۲,۲۶%	۷,۳۲%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۰۱,۳۴۰	ریال	-۰,۰۲%	۵,۲۶%	۴,۶۸%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۶,۱۴۰	ریال	-۰,۹%	۲,۵۵%	-۳,۸۹%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۶۸,۵۵۸	ریال	-۰,۹%	۲,۵۵%	-۲,۴۴%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۶۸,۲۹۷	ریال	۰,۶%	۳,۸۵%	۳,۸۲%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۶۶,۴۱۷	ریال	۳,۲۴%	۲,۲۶%	۶,۱۴%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۶۷,۰۲۱	ریال	۳,۲۴%	۲,۲۶%	۶,۵۸%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۴۲,۴۷۷	دلار	-۷,۳%	۱,۲۳%	-۲۶,۹%	Tradingview
۱۵	اتریوم	۳,۲۱۲	دلار	-۶,۷۶%	۱۷,۷۵%	۵۵,۴۶%	Tradingview

بازار کالاهای خام آتش جنگ در دریای سیاه

بازار محصولات کشاورزی

خبرهای بد در حوزه محصولات کشاورزی و غذایی گویا تمامی ندارد. هفته دولت آمریکا اعلام کرد که معضل اصلی ذرت و گندم جهان در فصل برداشت آتی با کاهش شدید عرضه این محصولات توسط اوکراین شکل خواهد گرفت. هم اکنون بازار ۱۲۰ میلیارد دلاری غلات در جهان به شدت متزلزل بوده و با قیمتهای کنونی، غرب آفریقا در فراهم کردن مواد غذایی دچار مشکل شده است. با ادامه وضع کنونی به زعم سازمان ملل متحد، این مشکل گریبانگیر خاور میانه نیز خواهد شد و کشورهای کم درآمد این منطقه در صورت نی اندیشیدن تمهیدات جدی، با مشکل جدی فراهم کردن مواد غذایی روبرو خواهند.

بازار کالاهای صنعتی

با وجود تعطیلی کامل شانگهای، قیمت محصولات فولادی در این هفته از سقف قیمتی خود عقب نشینی نکرد. کاهش قیمت سنگ آهن که به مجرد کاهش تقاضا در چین رخ داد و کاهش قیمت دو هفته‌ای آهن اسفنجی، نمودی در قیمت فولاد نداشت و شاهد رسیدن قیمت بیلت صادراتی ایران به بالاترین قیمت تاریخی خود در ۷۳۰ دلار بودیم. قیمت میلگرد نیز در آمریکا به ۱۲۰۰ دلار به ازای هر تن رسیده که یک رکورد محسوب می‌شود. با این وجود پیش بینی می‌شود تقاضای فولاد جهان در سال آتی افزایش داشته و شاهد محدوده های قیمتی بالاتری تا پایان ۲۰۲۲ و ابتدای ۲۰۲۳ باشیم. بحران انرژی نیز عامل دیگر محدود کننده حداقل قیمت فولاد است که محرک قیمت تمام شده و نهایی خواهد بود.

هفته‌ی گذشته در مجموع هفته‌ای آرام برای بازار فلزات اساسی بود و کاهش قیمت اندک در مقابل افزایش شاخص دلار بجز مس در مورد سایر محصولات بازار صادق بود.

پیش بینی می‌شود که با ادامه افزایش شاخص دلار و اعلام فدرال رزرو مبنی بر کاهش ارزش ترازنامه و افزایش نرخ بهره، شاهد کمی کاهش قیمت محصولات فلزی در هفته آتی باشیم.

شاخص‌های کالایی

قرنطینه‌ی شانگهای، در اینجا نیز مهمترین خبر هفته‌ی اخیر است. کاهش شدید شاخص بالتیک خشک به خاطر این امر در کنار بالا رفتن هزینه‌ی بیمه‌ی کشتی‌ها و عدم صرفه‌ی اقتصادر کشتیرانی در دریای سیاه تا دورتر شدن جنگ از بندرگاه‌های شمالی این محدوده، دلایل عمده‌ی نزول ۲۵٪ ای یک ماهه‌ی تعداد کشتی‌های در حال جابجایی در سطح دریاهای جهان است.

در مورد شاخصهای کالایی نیز هم زمان با کاهش LME و گلدمن ساکس، با افزایش پیوسته قیمت غلات، علی‌رغم متعادل تر بودن بازار فلزات و نزولی بودن محصولات نفتی، شاهد افزایش ۱٪ ای شاخص CRB طی این هفته بودیم.



منبع
ترجمه و گردآوری: گروه تحولات بازارهای انرژی و مواد

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
محصولات کشاورزی						
۱	ذرت	۷۵۹,۷۵	سنت/بوشل	۲۹۹	دلار/تن	۵,۴۸٪ ۷,۴۲٪ ۴۹,۵۶٪
۲	کتان (پنبه)	۱۳۱,۴۷	سنت/پوند	۲,۸۹۸	دلار/تن	۰,۱۸٪ ۱۶,۰۹٪ ۶۱,۳۱٪
۳	سویا	۱,۶۸۹,۰۰	سنت/بوشل	۶۲۱	دلار/تن	۶,۸۵٪ ۰,۹۴٪ ۳۷,۶۸٪
۴	شکر	۱۹,۸۸	سنت/پوند	۴۳۸	دلار/تن	۲,۷۹٪ ۴,۳۶٪ ۳۳,۰۷٪
۵	گندم	۱۰۵۶,۵	سنت/بوشل	۳۸۸	دلار/تن	۷,۵۹٪ -۱۰,۹۲٪ ۷۰,۸۹٪
۶	کانولا	۱۱۶۱,۹	دلار کانادا/تن	۹۱۸	دلار/تن	۲,۴۷٪ ۲,۵۴٪ ۴۳,۲۷٪
کالاهای صنعتی						
۷	مس	۱۰۳۴۴,۰	دلار/تن			۰,۷۳٪ ۰,۰۹٪ ۱۴,۸۲٪
۸	قیر	۳,۶۳۵	یوان/تن	۵۸۱,۶۰	دلار/تن	-۳,۰۷٪ -۱۶,۴۸٪ ۳۰,۱۹٪
۹	فولاد	۵,۱۱۵	یوان/تن	۸۱۸,۴۰	دلار/تن	۰,۰۰٪ ۰,۵۹٪ ۲,۳۰٪
۱۰	آلومینیوم	۳,۳۷۲	دلار/تن			-۱,۹۸٪ -۸,۳۹٪ ۴۷,۵۴٪
۱۱	سرب	۲,۴۱۰	دلار/تن			-۰,۰۴٪ -۵,۶۰٪ ۲۱,۳۸٪
۱۲	روی	۴,۲۹۸	دلار/تن			-۰,۷۶٪ ۱,۱۲٪ ۵۰,۲۵٪
۱۳	سنگ آهن	۱۵۰,۰۰	دلار/تن			-۱,۹۶٪ -۴,۱۵٪ -۱۱,۵۰٪
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۷۸۲,۰	دلار/تن			-۴,۶۰٪ -۸,۶۸٪ ۲۱,۹۲٪
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بنادر ایران)	۷۳۰	دلار/تن			۴,۸۹٪ ۵,۸۰٪ ۳۲,۴۹٪
شاخص‌های کالایی						
۱۶	بالتیک خشک	۲,۰۶۱	واحد			-۱۲,۴۸٪ -۲۳,۹۵٪ ۸,۴۷٪
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۱۷	واحد			۱,۰۴٪ -۳,۴۹٪ ۵۹,۳۵٪
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۵,۱۴۳	واحد			-۰,۶۱٪ -۵,۰۸٪ ۳۲,۴۵٪
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳,۶۲۱	واحد			-۱,۹۶٪ -۱۲,۷۸٪ ۵۹,۵۱٪

بررسی بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

مختلط در سهام %۴۲ %۰	میانگین بازدهی سالانه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی هفته (%)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	نوع صندوق
								در سهام
با درآمد ثابت %۵۸	۳۴,۰۵	۹,۰۳	-۰,۰۱	-۱,۲۵	۲,۰۷	۲۱,۰۷	۵۶۱,۸۷۳	در سهام
	۱۶,۷۴	۸,۷۶	۴,۸	۲,۰۳	۰,۵	۸۵,۰۲	۷۷۹,۴۷۴	با درآمد ثابت
	۱۸,۰۸	۱,۲۱	۶,۹۹	۸,۰۸	۲,۵۴	۴۲,۷۸	۵,۲۲۶	مختلط
	۱۳,۹	۳,۸۲	۶,۲۳	۶,۷۹	۲,۱۵	۳۴,۳۱	۱,۱۱۵,۵۷۵	جمع کل صندوق‌ها



منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

صندوق‌های سرمایه‌گذاری

در این هفته بازدهی هفتگی همه صندوق‌ها مثبت بود. همچنین در این هفته سهم ارزش صندوق‌های با درآمد ثابت ۵۸ درصد، صندوق‌های سهامی ۴۲ درصد بود.

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده	
اخزا۱۳	۹۸۰,۰۷۰	۱۴۰۱-۰۱-۱۷	۱۴۰۱-۰۲-۱۹	۲۴,۹۴%	۲۲,۴۹%	
اخزا۰۰۹	۵۶۲,۲۳۰	۱۴۰۱-۰۱-۱۷	۱۴۰۳-۱۱-۰۱	۲۲,۸۸%	۲۷,۸۶%	
اخزا۱۹	۸۱۰,۳۰۰	۱۴۰۰-۱۲-۱۱	۱۴۰۲-۰۳-۲۲	۱۷,۸۷%	۱۸,۳۰%	
اخزا۱۴	۹۷۳,۹۰۰	۱۴۰۱-۰۱-۱۷	۱۴۰۱-۰۳-۱۸	۱۶,۵۶%	۱۵,۵۳%	
میانگین بازدهی					۲۱,۷۳%	۲۲,۹۲%

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده متعلق به نماد اخزا۱۳ و اخزا۰۰۹ با سررسیدهای ۱۴۰۱/۰۲/۱۹ و ۱۴۰۱/۰۳/۱۱/۰۱ و بازدهی‌های ۲۴/۹۴ و ۲۷/۸۶ درصد بود. همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا۱۹ و اخزا۱۴ با سررسیدهای ۱۴۰۲/۰۳/۲۲ و ۱۴۰۱/۰۳/۱۸ و بازدهی‌های ۱۷/۸۷ و ۱۵/۵۳ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۱/۷۳ و ۲۲/۹۲ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
اراد۴۲	۹۹۸,۴۸۰	۱۴۰۱-۰۱-۱۴	۱۴۰۱-۰۶-۰۷	۱۷,۴۱%
ماهان۰۱	۹۴۳,۰۰۰	۱۴۰۱-۰۱-۱۶	۱۴۰۱-۱۱-۲۳	۲۵,۷۱%

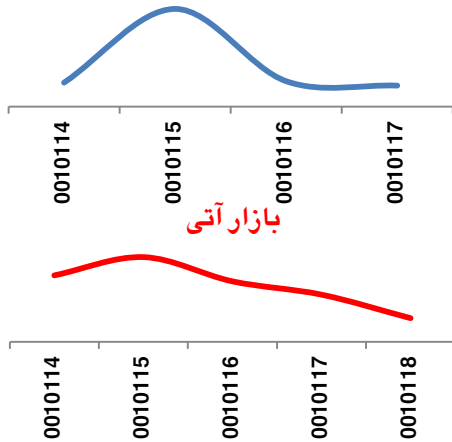
منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی

از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد۴۲ به میزان ۱۷/۴۱ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۶/۰۷ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد ماهان۰۱ به میزان ۲۵/۷۱ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۱۱/۲۳ بوده است.

بورس کالا

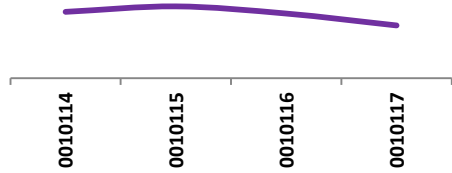
بازار فیزیکی



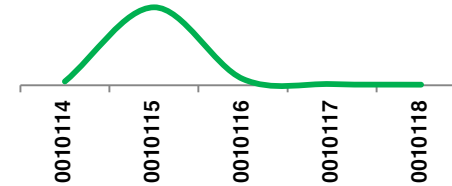
بازار آتی



بازار مالی
(سلف، صندوق و موازی)

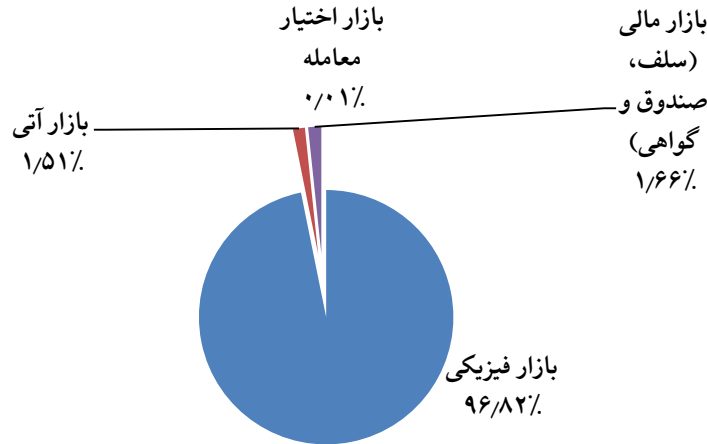


بازار اختیار معامله



تحولات معاملات بورس کالا در هفته اخیر، نشاندهنده نزولی بودن بازار آتی و اختیار معامله و همچنین روند نوسانی و نسبتاً ثابت بازار مالی و بازار فیزیکی است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۸/۹ درصد از معاملات در بازار فیزیکی مربوط به دو گروه کالاهای صنعتی و پتروشیمی و نفت بود. همچنین ارزش معاملات بازار فیزیکی نسبت به هفته گذشته ۵۹/۹۴ افزایش و همچنین حجم معاملات ۲۰/۷۸ درصد کاهش پیدا کرده است.

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروههای کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۱۴۸,۰۴۷,۹۱۳	۱,۷۷۵,۰۶۴	۷۳/۵٪
پتروشیمی و نفتی	۵۱,۳۰۸,۰۴۰	۲۶۹,۱۱۵	۲۵/۵٪
بازار فرعی	۲,۱۶۹,۶۲۷	۸,۴۴۹	۱/۱٪
جمع	۲۰۱,۵۲۵,۵۸۰	۲,۰۵۲,۶۲۸	۱۰۰٪

همچنین بررسی تحولات براساس نرخ ارز حواله ارزی نیز، حاکی از عقب ماندن بیلت فولاد خوزستان و اوره گرانول و نرخ کاتد مس از نرخهای جهانی و همچنین پیشی گرفتن نرخ پت گرید بطری شهید تندگویان از نرخهای جهانی است.

درخصوص مهمترین کالاهای خام جهانی، تحولات ارزش دلاری آنها در بورس کالا بر مبنای نرخ ارز بازار آزاد، حاکی از عقب ماندن نرخ اوره گرانول و شمش بیلت فولاد خوزستان، نرخ کاتد مس و نرخ پت گرید بطری شهید تندگویان از نرخهای جهانی است.

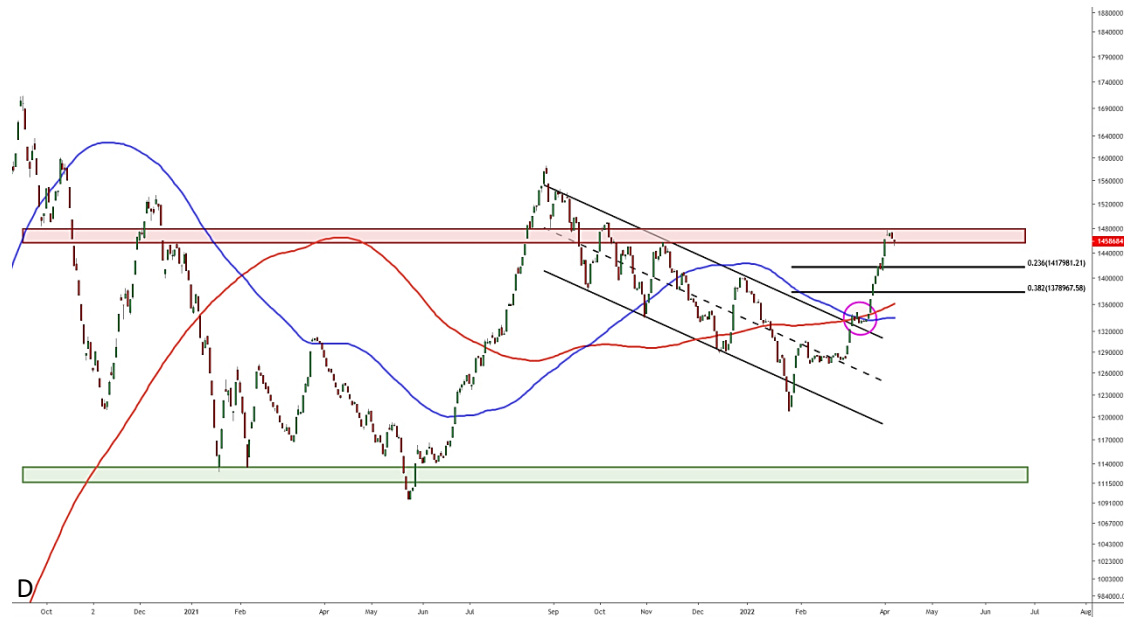
مقایسه نرخهای بورس کالا با نرخهای جهانی

محصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی نرخ نیمایی دلار	میانگین هفتگی نرخ دلار آزاد	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیمایی)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد)	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیمایی)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد)	تغییرات هفتگی نرخ ریالی
یک تن اوره گرانول	۱۷۹,۴۵۳,۵۵۶	۲۴۴,۷۶۷	۲۷۲,۱۳۳	۷۳۳	۶۵۹	۸۴۶	۷۷/۹٪	۸۶/۷٪	۹/۳٪
یک تن کاتد مس	۲,۴۶۳,۴۸۶,۰۰۰	۲۴۴,۷۶۷	۲۷۲,۱۳۳	۱۰,۰۶۵	۹,۰۵۲	۱۰,۳۴۴	۸۷/۵٪	۹۷/۳٪	-۰/۲٪
یک تن پت شهید تندگویان	۳۵۰,۱۱۲,۷۲۰	۲۴۴,۷۶۷	۲۷۲,۱۳۳	۱,۴۳۰	۱,۲۸۷	۱,۳۹۱	۹۲/۵٪	۱۰۲/۸٪	۴/۳٪
یک تن بیلت فحوز	۱۵۱,۰۰۲,۰۰۰	۲۴۴,۷۶۷	۲۷۲,۱۳۳	۶۱۷	۵۵۵	۷۳۰	۷۶/۰٪	۸۴/۵٪	-۲/۳٪
یک تن سیمان تیپ ۲ فله	۴,۵۹۴,۶۵۶	۲۴۴,۷۶۷	۲۷۲,۱۳۳	۱۹	۱۷	-	-	-	-۱/۱٪

تحلیل تکنیکال

شروع روند صعودی پس از ماه ها نزول

شاخص کل



- همان طور که در تحلیل شماره قبل پیش بینی شده بود، شاخص کل با شکست کانال نزولی و تثبیت بر بالای آن موفق به شروع موجی صعودی شد و بدین ترتیب از روند نزولی میان مدت خود خارج گشت.
- در طی موج صعودی اخیر شاخص کل تا محدوده ۱/۴۷۶/۹۰۲ واحد رشد کرد اما با شدت گرفتن عرضه ها در بازار شاخص کل از ادامه رشد خود بازماند. افزایش عرضه ها را در این محدوده با توجه به این که بسیاری از سهم های بزرگ بازار به بازدهی قابل توجهی رسیدند، می توان ناشی از فروش جهت ذخیره سود و یا کاهش زیان برخی سهامداران دانست.
- به طور کلی باید گفت که شاخص کل از روند نزولی میان مدت خود خارج شده و انتظار تشکیل کف های پایین تری از آن نمی رود اما با توجه به صعود شارپ آن و واکنش به محدوده مقاومتی ۱/۴۸۰/۰۰۰ واحد، شروع موجی اصلاحی دور از انتظار نیست که در این صورت محدوده ۱/۴۲۰/۰۰۰ الی ۱/۴۰۰/۰۰۰ واحد اولین محدوده حمایتی معتبر خواهد بود.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانال ها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

مقاومت محکم ۴۸ هزار دلار مانع ادامه رشد بیت کوین

بیت کوین (BTCUSD)



- بیت کوین پس از خروج از روند نزولی تا محدوده مقاومتی ۴۸ هزار دلار صعود کرد اما در شکست این مقاومت بازماند و خط روند صعودی خود را رو به پایین شکست که باعث شد مجددا وارد فاز نزولی شود.
- بیت کوین در حال حاضر در محدوده ۴۲.۵۰۰ دلار در حال معامله است و با توجه به رسیدن قیمت به حمایت داینامیک کوتاه مدت در این محدوده در تایم فریم ۴ ساعته شاهد به وجود آمدن واگرایی مثبت در اندیکاتور RSI هستیم که نوید بخش افزایش تدریجی قدرت تقاضا در مقابل عرضه است.
- انتظار می رود بیت کوین در محدوده ۴۲ الی ۴۰ هزار دلار مورد حمایت قرار گرفته و شاهد واکنشی مثبت باشیم اما در صورتی که بیت کوین موفق به تثبیت بر بالای این محدوده نشود احتمال ادامه روند نزولی تا محدوده ۳۷.۵۰۰ دلار نیز وجود دارد.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانالها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

تحلیل تکنیکال

حمله مجدد به مقاومت ۱۹۶۰ دلار

طلا (XAUUSD)



- همان طور که در گزارش شماره قبل پیش بینی شده بود انس جانی طلا پس از تثبیت بر بالای محدوده حمایتی ۱۹۰۰ دلار برای مدتی بین این محدوده حمایتی و محدوده مقاومتی ۱۹۶۰ دلار در نوسان بود. انس طلا در حال حاضر در محدوده ۱۹۴۷ دلار در حال معامله است و روند صعودی را در پیش گرفته است.
- اولین هدف قیمتی انس طلا محدوده مقاومتی ۱۹۶۰ دلار است. در صورتی که طلا موفق به شکست آن شود از تراکم قیمتی فعلی خارج خواهد شد و بدین ترتیب هدف قیمتی بعدی آن محدوده ۲۰۰۰ دلار خواهد بود.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته‌اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانال‌ها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل‌های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

تقابل شاخص دلار با اصلی ترین مقاومت خود

شاخص دلار (DXY)



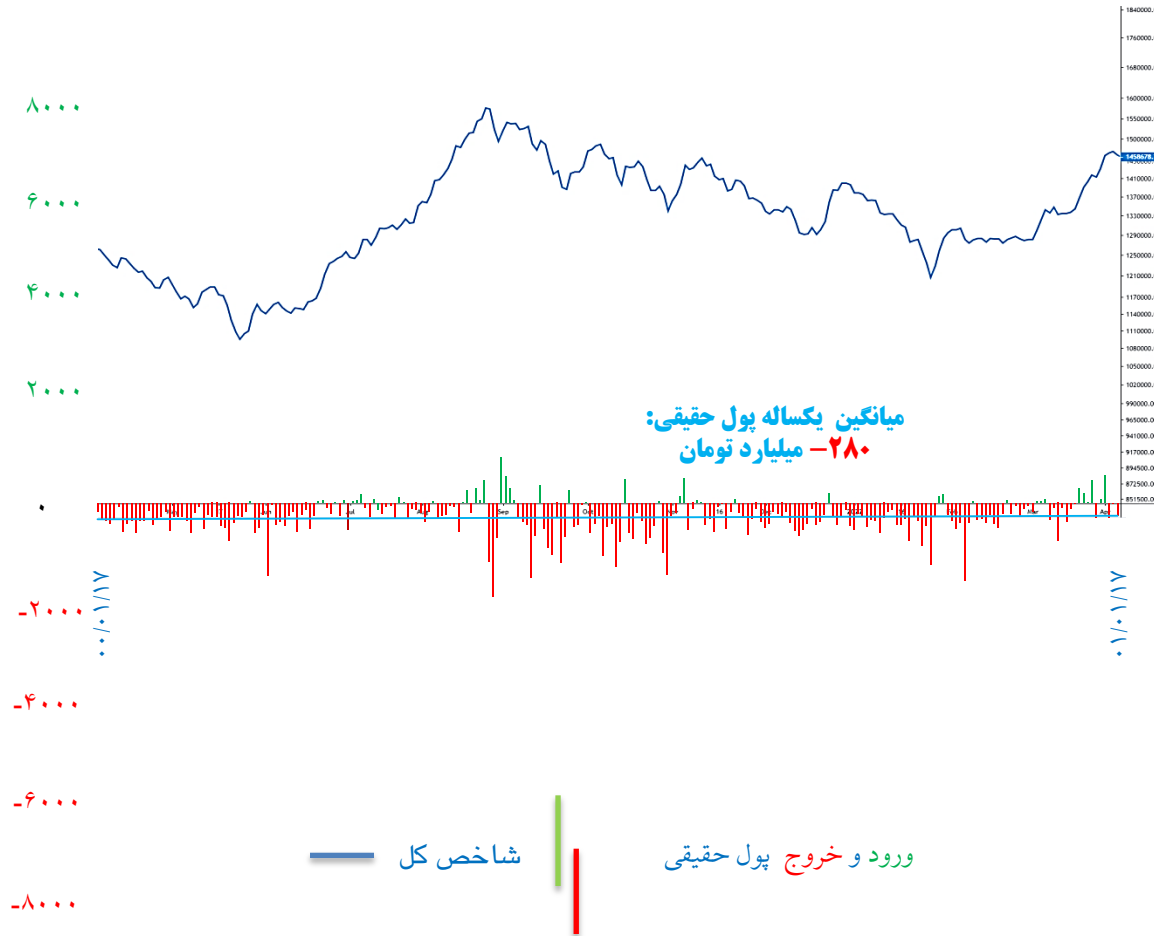
- شاخص دلار پس از کف سازی خوبی که در محدوده حمایتی ۹۷.۵۰۰ واحد کرده بود بالاخره توانست از این محدوده فاصله بگیرد و با شروع موجی صعودی خود را به اصلی ترین مقاومت خود یعنی محدوده ۱۰۰ واحد برساند.
- عبور از این محدوده مقاومتی به هیچ عنوان کار راحتی برای این شاخص نخواهد بود و در صورتی که شاخص دلار موفق به شکست این مقاومت نشود، تغییر روند و اصلاحی عمیق در انتظار آن خواهد بود.
- کندل روزانه امروز با توجه به سایه بلندی که بر بالای آن تشکیل شده است، نشان از برگشت قیمتی و عدم توانایی تثبیت بر بالای مقاومت ۱۰۰ واحد است.

❖ توضیحات:

- نمودار از زوایای گوناگون و با توجه به اندیکاتورهای مختلف مورد بررسی قرار گرفته اند، سپس جهت زیبایی بصری، قاطبه اندیکاتورها، خطوط روند و کانالها حذف شده است.
- در جهت فهم عموم تلاش شده نتایج تحلیل های فوق به زبانی ساده و به طور مختصر نگاشته و تنها به نکات مهم و روند آتی اشاره شود.

شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار

شاخص کل، خالص ورود و خروج پول حقیقی (هزار میلیارد تومان)

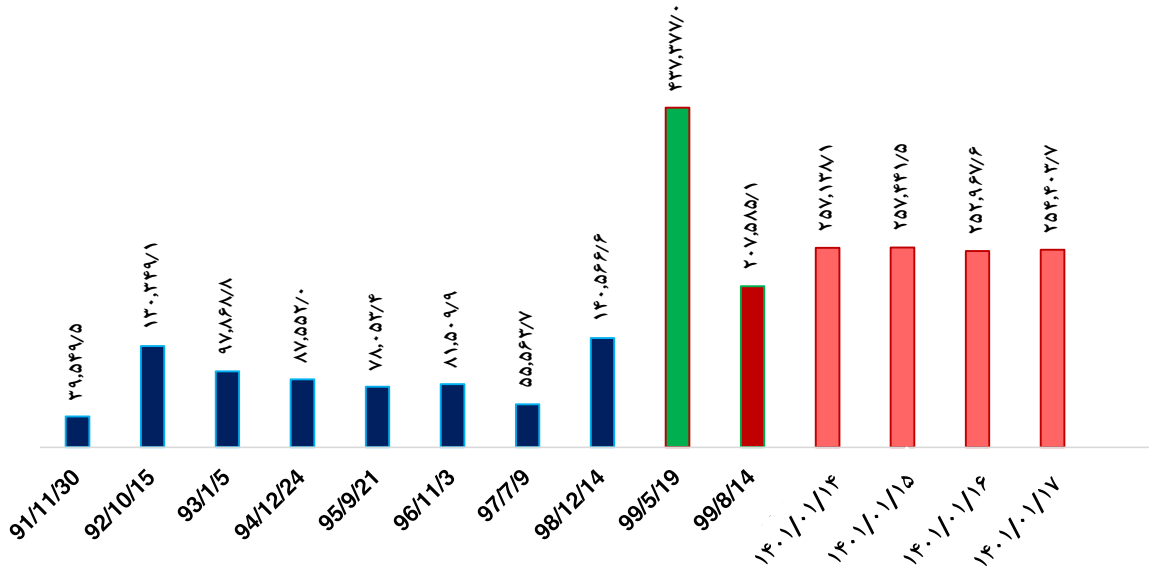


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۴۶۳,۷۷۹ واحدی و بازده هفتگی ۲.۲۱+ درصد بسته شد.
- سال ۱۴۰۰ با میانگین خروج روزانه ۲۹۱ میلیارد تومان پول حقیقی و ثبت خالص خروج ۶۹,۵۸۷ میلیارد تومان، به پایان رسید.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۶ میلیارد تومان پول از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان دهنده‌ی ورود ۴۰۳ میلیارد تومان به بازار است؛ یعنی به طور میانگین، روزانه ۴۵ میلیارد تومان به بازار وارد شده است.

خالص ورود و خروج پول حقیقی کل بازار طی هفته گذشته:

- یکشنبه ۰۱/۰۱/۱۴ : +۵۳۲ میلیارد تومان
- دوشنبه ۰۱/۰۱/۱۵ : -۲۸۲ میلیارد تومان
- سه‌شنبه ۰۱/۰۱/۱۶ : -۸ میلیارد تومان
- چهارشنبه ۰۱/۰۱/۱۷ : -۲۴۸ میلیارد تومان

نمودار ارزش دلاری قله‌های شاخص کل طی سال‌های ۹۱-۱۴۰۱ (میلیون دلار)



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۵۴ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۴۲ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس گزارش جدید بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ GDP ایران معادل ۲۰۳ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۱۲۵ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۸ آوریل سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۸/۹ تریلیون دلار بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۴/۲ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۲۰۲ درصد محاسبه شده است.

مقایسه نسبت‌های مالی هدینگ‌های چندرشته‌ای

نماد	P/E (TTM)	EPS (ریال) (TTM)	P (ریال)	P/E (پیش‌بینی)	EPS (ریال) (پیش‌بینی)	سال مالی	P/NAV ۱۴۰۰/۱۲/۲۸
شستا	۷.۲۶	۱۴۰	۱,۰۱۷	۶.۴۰	۱۵۹	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۸۶٪
وبانک	۵.۶۹	۱,۵۳۶	۸,۷۴۰	۴.۸۸	۱,۷۹۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۷٪
وصندوق	۶.۲۲	۲,۰۹۹	۱۳,۰۶۰	۵.۰۶	۲,۵۸۱	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۴۱٪
وامید	۱۲.۲۸	۱,۱۸۰	۱۴,۴۹۰	۸.۲۱	۱,۷۶۴	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۵٪
وغدیر	۵.۹۰	۲,۲۳۹	۱۳,۲۲۰	۴.۵۹	۲,۸۷۸	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۵۳٪
ونیکی	۶.۱۶	۱,۶۰۰	۹,۸۶۰	-	-	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۴۷٪

منبع: سایت انیگما

*در محاسبه NAV شرکت‌های فوق، پرتفوهای غیربورسی نیز بر اساس ارزش کارشناسی شده لحاظ گشته‌اند.

بیانیه سلب مسئولیت:

شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)، هیچگونه مسئولیتی در برابر صحت اطلاعات موجود در گزارش‌های تحلیلی تهیه شده توسط کارشناسان این شرکت، که با نام و نشان اهتمام ایرانیان منتشر می‌شود، بر عهده نمی‌گیرد و نظرات ارائه شده در این گزارش‌ها به هیچ وجه به عنوان توصیه‌ای جهت خرید، فروش یا نگهداری سهام شرکت‌ها و سایر ابزارهای معاملاتی نیست و مسئولیت استفاده از این اطلاعات برعهده خوانندگان محترم است.

شناسنامه:

محتوای سری گزارش‌های «تحلیل بازارها»، حاصل تلاش گروهی تیم تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام) است.

اسامی تحلیل‌گران، به ترتیب حروف الفبا، عبارت است از:

صدرا آدم‌عارف، احسان برین، رکسانا ثابت‌قدم، عبدالکریم جهاندار

راهبری و نظارت بر محتوا:

رضا جعفری

استفاده از محتوای این گزارش، با ذکر منبع، مجاز است.