



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

بازار سرمایه در انتظار برجام و کاهش ابهامات اقتصادی

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۱۱۶ - هفته منتهی به ۱۵ مرداد ۱۴۰۱
گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

EhtemamIranian.ir

eii.co.ir

مهمترین عناوین

- - - - - حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی: همکاری استراتژیک مالی سیاسی ترکیه و روسیه؛
- - - - - تصویر اقتصاد کلان: کاهش نرخ بیکاری در آمریکا؛
- - - - - بازار مسکن: ثبت رکوردهای تازه؛
- - - - - بورس و انرژی: سقوط سنگین قیمت نفت!؛
- - - - - فلزات گرانبها و ارز: سایه تنش های ژئوپلیتیک و داده های اشتغال آمریکا بر سر طلا؛
- - - - - بازار کالاهای خام: فرانسه، قیمت برق صنایع خود را تثبیت کرد؛
- - - - - بررسی وضعیت صندوق ها؛
- - - - - بررسی وضعیت بازار بدهی؛
- - - - - بررسی بورس کالا؛
- - - - - تحلیل تکنیکال: بورس - نشانه های مثبت اما ناکافی در شاخص کل؛
- - - - - تحلیل تکنیکال: بیت کوین - شکست در عبور از مقاومت ۲۴ هزار دلار؛
- - - - - تحلیل تکنیکال: اونس طلا - حفظ خط روند نزولی و واکنش منفی به آن؛
- - - - - تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - بازگشت به مدار مثبت؛
- - - - - بررسی شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار؛
- - - - - ارزیابی دلاری شاخص کل و محاسبه شاخص وارن بافت؛
- - - - - مقایسه نسبت های مالی هلدینگ های چندرشته ای صنعتی.

حقایق پیرامون چشم انداز اقتصاد جهانی

فایننشال تایمز



همکاری استراتژیک مالی سیاسی ترکیه و روسیه

اشاره

انتشار آمار فراتر از انتظار اشتغال آمریکا در ماه جولای، نگرانی کارشناسان بلومبرگ از وضعیت ماه‌های آتی بازارها و اقتصاد جهانی و تشبیه آن به یک استخر پر از گل و بدون هیچ دید و شفافیتی، بالا گرفتن تنش‌ها در منطقه تایوان و دریای چین جنوبی پس از سفر نانسو پلوسی به این کشور و بازگشت او، و اکنون عرض اندام چین برای کشورهای منطقه وقتی دیگر تهدیدی متوجه مقامات آمریکا نبوده و احتمال پاسخ از طرف آمریکا وجود ندارد، خبر همکاری‌های گوناگون روسیه و ترکیه در مسائل اقتصادی و پروژه‌های عظیم صنعتی و تبدیل ترکیه به واسطه روسیه برای دور زدن تحریم‌های جهانی و در نهایت تصمیم به افزایش نرخ بهره توسط بانک مرکزی انگلیس، بخشی از اخبار مهم این هفته بودند.

- بانک مرکزی بریتانیا، نرخ بهره را ۰.۵ درصد افزایش می‌دهد.
- ایالات متحده اکنون تمام مشاغلی که به خاطر همه‌گیری کرونا از دست داده بود را باز ایجاد کرده است.
- با شرایط فعلی شکستی سخت در انتظار دموکرات‌ها در انتخابات ماه نوامبر است.
- آلمانی‌ها طی یک ماه اخیر نسبت به مدت مشابه سال گذشته ۱۷ درصد گاز کمتری مصرف کردند!
- حملات روزهای اخیر اسرائیل به غزه و ترور سران حماس، ترس وقوع یک جنگ دیگر در نوار غزه را افزایش داده است.
- شرکت نفت عمان یک بلوک یک میلیارد دلاری خود را جهت انتشار اوراق وثیقه می‌کند.
- آمار خوب اشتغال مانع از تاثیر منفی افزایش نرخ بهره فدرال رزرو روی اقتصاد و باعث افزایش خوش‌بینی‌ها شده است.
- طبق گزارش‌ها از هر ۸ بیمار کرونا، ۱ نفر پس از بهبود هم به صورت طولانی مدت با علائم این بیماری دست و پنجه نرم می‌کند.
- در فصل اوج سفرهای توریستی و گردشگری، بحران کمبود کارگر در فرودگاه‌ها گریبانگیر خطوط هوایی و عامل تأخیر پروازها به شکل گسترده شده است.
- اوکراین اظهارات دیدبان حقوق بشر مبنی بر اینکه ارتش کشورش با استفاده از شهروندان بعنوان سپر انسانی جان آنها را به خطر می‌اندازد محکوم کرد.
- با کمتر شدن تب و تاب بازار رمزارزها و منطقی شدن روند آن، اکنون باید دست به قانونگذاری و وضع مقررات روی این بازار بزنیم.
- با انتشار آمار اشتغال، بیت‌کوین هنوز در محدوده ۲۳,۰۰۰ دلار نوسان می‌کند.
- مایکل پری، سرمایه‌گذاری که رکود اقتصادی سال ۲۰۰۸ را پیش‌بینی کرده بود گفت: «ساده‌لوحی و حماقت دوباره به بازارها برگشته است.»
- پوتین واردوغان رقبایی هستند که منافع مشترک زیادی دارند.

- چشم‌انداز اقتصاد جهان، به شفافیت یک استخر پر از گل است!
- چین با انجام مانورهای نظامی سنگین در آب‌های تایوان در حال محک زدن قدرت پاسخگویی و تحمل کشورهای منطقه است.
- آمار مثبت روند افزایش مشاغل در آمریکا بار دیگر بر ترس بازار از رکود غلبه کرد.
- ذخایر ارزی ترکیه پس از انتقال منابع شرکت‌های روسی به این کشور به شکل محسوسی افزایش یافت.
- اردوغان، پس از ایفای نقش رابط جهت امضای توافقنامه روسیه و اوکراین جهت اجازه صادرات غلات این کشور، اکنون بدنبال ایفای نقش رابط بین پوتین و جهان است.
- چین مذاکرات نظامی با آمریکا بر سر مسائل حوزه تایوان و دریای چین جنوبی را متوقف کرد.
- سیتی‌گروپ و وودافون اعلام کردند تورم ترکیه شرایط کار در این کشور را برای آنها سخت کرده است.
- امارات بدنبال سرمایه‌گذاری ۱ میلیارد دلاری در حوزه‌های متعدد، از سوخت تا مسائل لجستیک، در پاکستان است.
- آتش‌سوزی جنگل‌ها در آمریکا در حال تبدیل شدن به معضل جدید تابستان است.
- برنامه پیشنهادی مالیات بر ثروتمندان از طرف دموکرات‌ها، هنوز درگیر مناسبات درون حزبی است.
- فدرال رزرو باید تمرکزش را از روی تورم بردارد. این نگرانی بین اقتصاددانان وجود دارد که پاول تنها و فقط به تورم توجه می‌کند.

بلومبرگ
Bloomberg

- ایالات متحده در ماه جولای ۵۲۸,۰۰۰ فرصت شغلی جدید ایجاد کرد.
- آمازون با قرارداد ۱.۷ میلیارد دلاری صاحب بزرگترین شرکت سازنده جاروهای رباتیک شده و این نگرانی وجود دارد که دلیل این خرید، بدست آوردن نقشه منزل دارندگان این ربات‌ها برای تبلیغات هدفمندتر با بهره‌گیری از هوش مصنوعی باشد.
- شرکت‌های حوزه رمزارز ۲.۴ میلیارد دلار برای تبلیغات ورزشی تیم‌ها در این فصل هزینه کردند.
- شرکت نفتی لوک اوایل پیشنهاد بازخرید اوراق قرضه خود با نرخ کمی بیشتر از ۲۰ درصد را با توجه به سود انبوه دو سال اخیرش داده است.
- بزرگترین تولیدکننده مس اروپا بدنبال کاهش تولید و کاهش مصرف گاز خود در آلمان است.
- پوتین خروج شرکت‌های نفتی خارجی و بانک‌ها از روسیه را تا پایان سال جاری ممنوع کرد.
- صندوق سرمایه‌گذاری سلطنتی سعودی یک شرکت مستقل جهت سرمایه‌گذاری و مدیریت سرمایه‌هایش در مصر تأسیس می‌کند.
- شرکت پلاتینر (یکی از شرکت‌های بزرگ متعلق به میلیاردر صاحب‌نام و پیشرو جمهوری‌خواه، پیتیر تیل) که پروژه‌های جمع‌آوری اطلاعات شهروندان برای دولت‌ها و سازمان‌های جاسوسی انجام می‌دهد، هم‌زمان با کاهش موقعیت‌های شغلی در شرکت‌های نرم‌افزاری و خدمات امنیتی در حال استخدام گسترده نیرو است.

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۵۸۷,۸۳۶,۴۵۳	+1,15%
جان باختگان ۶,۴۳۴,۰۰۴	+۰,۲۵%
بهبودیافتگان ۵۵۸,۴۰۷,۷۴۲	+1,۳۵%

تصویر اقتصاد کلان

کاهش نرخ بیکاری در آمریکا

مقایسه بازدهی بازارها

یکساله	۱۴۰۱	ماه‌یانه	هفتگی	بازار
دلار (ریالی)	۱۹,۹۵٪	۰,۶۹-٪	۱,۴۴-٪	۲۲,۷۶٪
سکه (ریالی)	۲۰,۱۱٪	۱,۹۳-٪	۰,۰۳٪	۳۱,۰۴٪
بورس (شاخص)	۴,۶۰٪	۴,۶۳-٪	۰,۴۲-٪	۴,۴۹٪
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	۴۰,۶۹-٪	۲۱,۵۳٪	۰,۵۶٪	۳۴,۰۹-٪
مسکن (ریالی - تهران)	-	۵/۸٪	-	۳۸/۸٪

منبع داده‌ها:

وبسایت TGIU : بازدهی دلار و سکه
 وبسایت TSETMC : بازدهی شاخص کل بورس تهران
 بانک مرکزی ج.ا.ا. : بازدهی مسکن
 وبسایت TradingView : بازدهی رمزارزها

نرخ بهره (درصد)	فصلی	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالیانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی
		نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ رشد اقتصادی - قیمت ثابت (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
-	-	-	-	۴/۷٪	-	۶/۱٪	۱۰.۸۴۵	۹۶,۲۹۲,۵۷۰	مقدار شاخص
				۷/۴٪	-	۳/۲٪	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
آمریکا									
۲۲-جولای	۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۲-جولای	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
۲/۵٪	۰/۹-٪	۹/۱٪	۳/۵٪	۴/۷٪	۵/۴٪	۵/۷٪	۶۹,۲۳۱	۲۲,۹۹۷,۵۰۰	مقدار شاخص
				۷/۷٪	۳/۵٪	۲/۳٪	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
چین									
۲۲-آگوست	۲۰۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۲-ژوئن	۲۰۲۰	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	بازه زمانی
۳/۷٪	۲/۶-٪	۲/۵٪	۵/۵٪	۰/۹٪	۴/۲٪	۸/۱٪	۱۲,۳۵۹	۱۷,۴۵۸,۰۴۰	مقدار شاخص
				۲/۱٪	۳/۷٪	۳/۳٪	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه یورو									
۲۲-جولای	۲۲-ژوئن	۲۲-جولای	۲۲-ژوئن	۲۰۲۱	-	۲۰۲۱	۲۰۱۹	۲۰۲۰	بازه زمانی
۰/۵٪	۰/۷٪	۸/۹٪	۶/۶٪	۲/۶٪	-	۵/۳٪	۳۷,۷۲۳	۱۲,۹۱۶,۶۱۸	مقدار شاخص
				۵/۳٪	۷/۷٪	۲/۶٪	پیش‌بینی (۲۰۲۱)		
ایران									
۲۲-می	زمستان ۱۴۰۰	تیر ۱۴۰۱	بهار ۱۴۰۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۱۴۰۰	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
۱/۸٪	۲/۳٪	۵/۴٪	۹/۲٪	۴۰/۱٪	۹/۸٪	۴/۳٪	۷,۵۵۵	۲۳۱,۵۴۷/۵۷	مقدار شاخص
				۳۲/۳٪	۱۰/۲٪	۳٪	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		

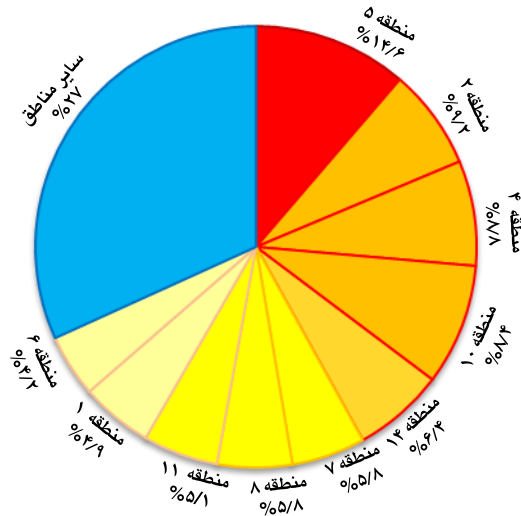
منبع:

مستدوق بین‌المللی پول: پیش‌بینی ۲۰۲۲ و داده‌های مربوط به تولید ناخالص داخلی و درآمد سرانه ۲۰۲۰
 وبسایت TradingEconomics : آمارهای میانگین سالیانه، نقطه‌نقطه و فصلی کشورها (به جز ایران) و همچنین آمار مربوط به نرخ بهره
 مرکز آمار ایران: آمارهای میانگین سالیانه، نقطه‌به‌نقطه و فصلی ایران

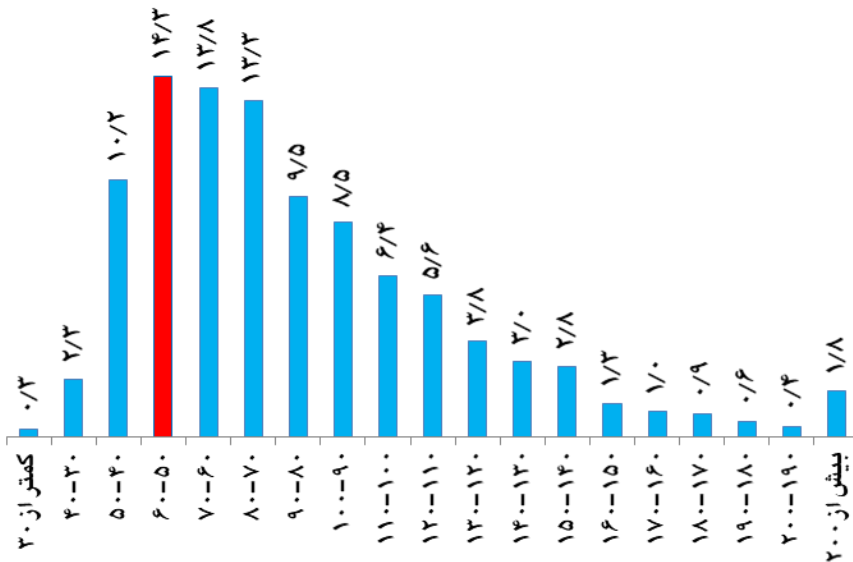
ثبت رکوردهای تازه

بنا بر گزارش بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، در تیرماه سال ۱۴۰۱ تعداد معاملات آپارتمان‌های مسکونی تهران به ۱۰۳ هزار واحد مسکونی رسید که نسبت به ماه قبل و ماه مشابه سال قبل ۲۵.۸ درصد کاهش و ۱۰۳ درصد افزایش داشته است. در تیرماه سال ۱۴۰۱ متوسط قیمت خرید و فروش یک مترمربع زیربنای واحد مسکونی معامله‌شده از طریق بنگاه‌های معاملات ملکی تهران ۴۱۷ میلیون ریال بود که نسبت به ماه قبل ۵.۸ درصد و نسبت به ماه مشابه سال قبل ۳۸.۸ درصد افزایش را نشان می‌دهد. در میان مناطق ۲۲ گانه شهر تهران در تیرماه ۱۴۰۱، بیشترین متوسط قیمت یک مترمربع زیربنای مسکونی معامله‌شده معادل ۸۳۷.۵ میلیون ریال به منطقه ۱ و کمترین آن با ۲۰۷.۸ میلیون ریال به منطقه ۱۸ تعلق داشته که نسبت به ماه مشابه سال ۱۴۰۰ به ترتیب ۳۵ و ۵۴.۶ درصد افزایش داشته‌اند. بررسی شاخص کرایه مسکن اجاری در شهر تهران و در کل مناطق شهری در تیرماه سال ۱۴۰۱ به ترتیب نشان‌دهنده رشد ۴۷.۴ و ۵۲.۳ درصدی نسبت به ماه مشابه سال قبل است. بررسی توزیع تعداد واحدهای مسکونی معامله‌شده در شهر تهران، به تفکیک عمر بنا، حاکی از آن است که واحدهای تا ۵ سال ساخت با سهم ۳۰/۱ درصد بیشترین سهم را به خود اختصاص داده‌اند.

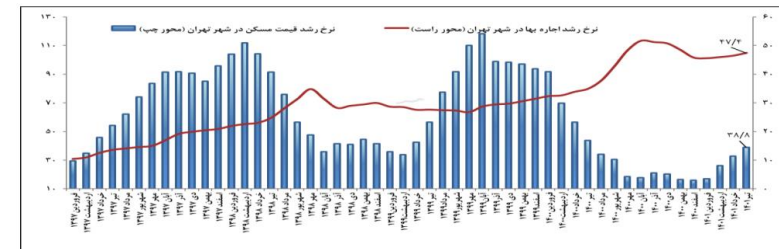
توزیع مناطق شهر تهران بر حسب سهم از تعداد معاملات انجام شده (تیر ۱۴۰۱)



توزیع درصد فراوانی معاملات مسکن انجام شده در شهر تهران بر حسب متر از (تیر ۱۴۰۱)



روند رشد قیمت مسکن و اجاره بها در شهر تهران نسبت به ماه مشابه سال قبل



بورس و انرژی

سقوط سنگین قیمت نفت!

بورس‌های جهانی

هفته گذشته محرک اصلی اقبال سرمایه‌گذاران شرکت‌های بزرگ بازار گزارش‌های خوب ۳ ماهه و ۶ ماهه آنها بود. جدای از اینکه اثر هیجانی این موضوع هنوز از بین نرفته، این هفته شاهد این هستیم که سهامداران به اقدام فدرال رزرو در افزایش نرخ بهره روی خوش نشان داده‌اند و تأثیر آن در بازدهی شاخص‌ها طی یک ماه اخیر مؤید این موضوع است. این رضایت در کنترل رشد تورم آمریکا را می‌توان در صعود ۷.۸ درصدی شاخص S&P500 طی ۳۰ روز و بازدهی خیره‌کننده ۱۱.۴ درصدی شاخص نزدک دید که بیانگر وضعیتی مطلوب است. بورس‌های اروپایی نیز این هفته را با بازدهی اندکی مثبت به پایان رساندند و تنها شاخص صنعتی داو جونز با توجه به شرایط پر تنش سیاسی و اخبار متعدد مهم اقتصادی از جمله افزایش نرخ اشتغال در آمریکا در سردرگمی، قرمز پوش شد. بازارهای شرق آسیا با توجه به شرایط مشوش سیاسی نظامی منطقه وضعیت متلاطمی دارند ولی با وجود این شاهد بازدهی قابل توجه ۱.۴ درصدی بورس توکیو طی این هفته بودیم.

نفت و محصولات پتروشیمی

ابتدای هفته با انتشار آمار تولید نفت خام اعضای اوپک پلاس شاهد کسری عرضه توسط تقریباً تمامی کشورها به جز سودان و امارات بودیم، با وجود این شروع مجدد مذاکرات برجام و ادامه عرضه نفت ارزان قیمت روسیه در کنار بحران اقتصادی که دام‌گیر بسیاری از کشورها شده و در نهایت تقویت دوباره محدودیت‌های کرونایی در چین را می‌توان از جمله عوامل اصلی سقوط قیمت نفت در این هفته دانست.

بازگشایی ترمینال فری‌پورت ایالات متحده که مدت ۸ هفته بعثت آتش‌سوزی و تعمیرات تعطیل بود، شاهد جهش ناگهانی قیمت گاز طبیعی هنری هاب به بالای ۲۵ سنت بودیم. این ترمینال با ظرفیت عرضه نزدیک به ۶۰ میلیون مترمکعب در روز، وظیفه صادرات ۱۵ درصد از گاز تولیدی آمریکا را بعهده دارد و بازگشت آن به مدار جدای از کمک به تأمین گاز اروپا مازاد عرضه قابل توجهی که در بازار گاز طبیعی این کشور وجود داشت را از بازار حذف کرد. شایان ذکر است آلمان نیز طبق گزارش اسپیگل موفق به تکمیل بخش اعظم ذخایر استراتژیک خود برای زمستان شده است.



منبع

بورس‌های جهانی

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده یکساله
بورس‌های جهانی						
۱	Dow Jones	۳۲,۸۰۳	واحد	-۰.۱۳%	۵.۶۹%	-۶.۸۳%
۲	Nasdaq	۱۳,۲۰۸	واحد	۲.۰۱%	۱۱.۴۳%	-۱۲.۵۹%
۳	S&P 500	۴,۱۴۵	واحد	-۰.۳۶%	۷.۸۱%	-۶.۵۷%
۴	FTSE 100	۷,۴۴۰	واحد	-۰.۲۲%	۴.۶۷%	۴.۴۵%
۵	DAX	۱۳,۵۷۴	واحد	۰.۶۷%	۷.۷۸%	-۱۳.۸۸%
۶	CAC 40	۶,۴۷۲	واحد	-۰.۳۷%	۹.۴۷%	-۵.۰۶%
۷	NIKKEI 225	۲۸,۱۶۲	واحد	۱.۴۱%	۷.۸۷%	۱.۲۳%
۸	SHANGHAI	۳,۲۲۷	واحد	-۰.۸۱%	-۳.۸۲%	-۶.۶۹%
۹	Moex	۲,۰۵۴	واحد	-۷.۲۱%	-۷.۵۴%	-۴۶.۰۲%

TeleTrader

TradingEconomics

نفت و انرژی

۱۰	نفت خام برنت	۹۴.۹۲	دلار/بشکه	-۱۰.۳۰%	-۶.۸۶%	۲۹.۵۶%
۱۱	نفت خام WTI	۸۹.۱۲	دلار/بشکه	-۸.۷۶%	-۲.۳۰%	۳۴.۱۷%
۱۲	گاز طبیعی (هنری هاب)	۸.۰۲	دلار/ M M B tu	۲۸.۳۸	سنت/متر مکعب	-۲.۹۳%
۱۳	سبب اوپک	۱۰۱.۱۹	دلار/بشکه	-۹.۵۸%	-۱۲.۹۶%	۲۹.۰۱%
۱۴	نفت سنگین ایران	۹۱.۰۷	دلار/بشکه	-۱۱.۸۶%	-۲.۳۳%	۳۷.۱۵%
۱۵	گازوئیل	۱,۰۵۸	دلار/تن	۴.۹۳%	-۵.۳۲%	۸۲.۵۷%
۱۶	اتانول	۲.۴۵	دلار/گالن	۸۱۷	دلار/تن	۱۷.۴۹%
۱۷	نفتا	۶۷۷.۵۴	دلار/تن	-۲.۷۵%	۲.۵۱%	۱۱.۳۶%
۱۸	متانول (داخلی چین)	۲,۶۱۰	یوان/تن	۴۱۰	دلار/تن	۵.۷۴%
۱۹	متانول CFR	۳۱۰	دلار/تن	۱۶۱%	-۱,۲۹%	-۰,۳۲%
۲۰	اوره گرانول خاورمیانه	۶۱۲.۸۳	دلار/تن	۱۶.۱۴%	۱۵.۱۲%	۴۵.۹۱%
۲۱	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۱۱۸۰	دلار/تن	-۱.۶۹%	-۳,۳۹%	۱۵,۲۵%

Sunsirs

PLATTS

Fertilizerworks

PLATTS

فلزات گرانبها و ارز

سایه تنش‌های ژئوپلیتیک

و داده‌های اشتغال آمریکا بر سر طلا

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع
فلزات گرانبها							
۱	طلا	۱,۷۷۴	دلار/اونس	۰.۵۲%	۰.۵%	-۲.۲%	TeleTrader
۲	نقره	۲۰,۳۳	دلار/اونس	-۲.۰۳%	۳.۷۲%	-۱۶.۶۴%	TeleTrader
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۱۳ مرداد							
۳	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۱۳,۷۴۱,۰۰۰	ریال	۰.۸۷%	-۳.۵۵%	۲۵.۰۴%	tgju/org
۴	سکه امامی	۱۴۸,۶۲۰,۰۰۰	ریال	۰.۰۳%	-۲.۴۹%	۳۱.۹۲%	tgju/org
ارز - پنجشنبه ۱۳ مرداد							
۵	دلار آزاد	۳۱۴,۵۰۰	ریال	-۱.۴۴%	-۰.۶۹%	۲۲.۷۶%	tgju/org
۶	دلار حواله (خرید)	۲۶۴,۲۰۰	ریال	۰.۴۳%	۳.۱۱%	۱۷.۹۹%	sanarate/ir
۷	دلار حواله (فروش)	۲۶۶,۶۰۰	ریال	۰.۴۳%	۳.۱۱%	۱۷.۹۹%	sanarate/ir
۸	یورو آزاد	۳۲۱,۰۵۰	ریال	-۱%	۰.۴۵%	۸.۹۰%	tgju/org
۹	یورو حواله (خرید)	۲۶۷,۹۲۸	ریال	۰.۷۱%	۰.۲۸%	۱.۷۵%	sanarate/ir
۱۰	یورو حواله (فروش)	۲۷۰,۳۶۲	ریال	۰.۷۲%	۰.۲۸%	۱.۷۵%	sanarate/ir
۱۱	درهم آزاد	۷۷,۷۵۱	ریال	۰.۸۲%	۳.۵۲%	۱۴.۳۵%	sanarate/ir
۱۲	درهم حواله (خرید)	۷۱,۹۴۰	ریال	۰.۴۳%	۳.۱۱%	۱۷.۹۸%	sanarate/ir
۱۳	درهم حواله (فروش)	۷۲,۵۹۴	ریال	۰.۴۳%	۳.۱۱%	۱۷.۹۹%	sanarate/ir
رمزارز							
۱۴	بیت‌کوین	۲۳,۳۱۲	دلار	-۰.۴۸%	۱۵.۵۱%	-۴۳.۶۱%	TradingEconomics
۱۵	اتریوم	۱,۷۳۶	دلار	۲.۵۱%	۵۳.۶۷%	-۳۱.۷۲%	TradingEconomics

بازار فلزات گرانبها

اونس جهانی طلا هفته پرنوسانی را پشت سر گذاشت، بطوریکه با افزایش ۱.۷ درصدی، عدد ۱,۷۹۴ دلار را نیز لمس کرد، اما در نهایت هفته کاری خود را با بازده ۰.۵ درصد به پایان رساند. از علل رشد رشد قیمت طلا می‌توان به سفر نانسو پلوسی به تایوان و افزایش تنش بین چین و تایوان اشاره کرد و آنچه که باعث افت این فلز زرد رنگ و مانع رشد بیشتر آن شد، انتشار آمار اشتغال بخش غیرکشاورزی آمریکا بود که بهتر از پیش‌بینی‌ها منتشر شد. شایان ذکر است که بهبود شرایط اشتغال مسیر را برای ادامه سیاست‌های فدرال رزرو بمنظور مهار تورم، هموارتر می‌سازد.

سکه و ارز (داخلی)

بازار سکه و ارز داخلی، هفته کم‌نوسانی را تجربه کردند و شاهد ثبات نسبی در این بازار بودیم. در پایان هفته با انتشار اخبار مثبت برجای، نرخ‌ها کمی عقب‌نشینی کردند.

رمزارز

الکساندر براونزیکوف، رئیس انجمن بلاک‌چین روسیه، در کنفرانس تکنوبلاک که طی روز پنجشنبه (۱۳ مرداد) برگزار شد، گفت که بزودی نمایندگی خود را در ایران دایر خواهیم کرد و اظهار کرد: «امیدوارم کارهایی که در این روزها انجام شده، پلی بین ایران و روسیه باشد تا اقتصاد ایران و روسیه را بهم متصل کنیم که سود آن هم به هر دو کشور برسد. این پل باید مطمئن و بدون خطر باشد.» او ادامه داد: «نمایندگان ما در پنجاه نقطه روسیه و در بیش از یازده کشور دنیا حضور دارند و بزودی در ایران هم نمایندگی خواهیم داشت. ما آماده هستیم که ارز دیجیتال را قانونمند کنیم. در روسیه نیز کلاهبرداری در حوزه رمزارز زیاد است اما باید مراقب باشیم مردم امنیت اقتصادی داشته باشند. ما سعی داریم استارت‌آپ‌های مختلف را پیدا و کمک کنیم تا کسب‌وکار خود را گسترش دهند.»

آخرین تحقیقات بازار کریپتو از بلومبرگ اینتلیجنس (Bloomberg Intelligence) نشان می‌دهد که بیت‌کوین ممکن است به جای سهام، بیشتر شبیه اوراق قرضه و طلای خزانه‌داری ایالات متحده رفتار کند. این واحد تحقیقاتی در گزارش «دیدگاه رمزارز، آگوست (امرداد) خود، که توسط مایک مک‌گلون، استراتژیست ارشد کالا، و جیمی کوتس (Jamie Coutts)، تحلیل‌گر ارشد ساختار بازار، نگارش شده بود، بازارهای بیت‌کوین را با بازارهای طلا، اوراق قرضه و نفت مقایسه کرد. نویسندگان پیشنهاد کردند که تأثیرات کلان اقتصادی مانند سیاست‌های پولی فدرال رزرو منجر به ایجاد شباهت‌هایی در بازارهای اوراق قرضه خزانه‌داری و بیت‌کوین شده است. انقباض بازارها و کاهش رشد جهانی از تغییر جهت فدرال رزرو طی ماه جولای (تیر) حمایت می‌کند، که ممکن است به چرخش بیت‌کوین به سمت شباهت اوراق قرضه خزانه‌داری ایالات متحده کمک کند.»



بازار کالاهای خام فرانسه، قیمت برق صنایع خود را تثبیت کرد

بازار محصولات کشاورزی

رواق هفته گذشته بازار مواد غذایی در این هفته جای خود را به روند کم‌رنگ منفی داد.

با وجود روند مثبت کود اوره به خاطر شروع فصل خرید و کودپاشی در بسیاری از نقاط جهان و قیمت قابل توجه قریب به ۶۰۰ دلاری آن، شاهدیم که علم به این موضوع تأثیری روی قیمت محصولات تازه برداشته شده فعلی ندارد. در نهایت عرضه غلات اوکراین به بازار از یک سو و رکود جهانی که گریبانگیر بسیاری از کشورهای فقیر و کم‌درآمد شده از طرف دیگر، دو کفه عرضه و تقاضا را در بازارها به سمت عرضه سنگین کرده و شاهد افت قیمت محصولات در هفته جاری هستیم.

بازار کالاهای صنعتی

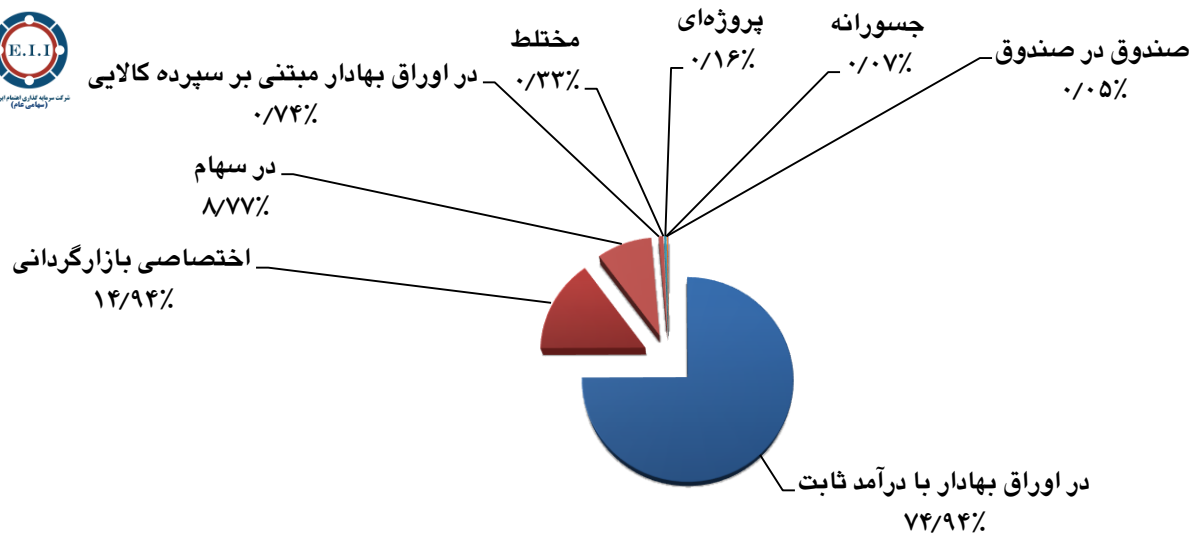
پس از هفته پرفروغ گذشته، این هفته شاهد بازارهای متعادل‌تری برای محصولات صنعتی و کامودیتی بودیم. اقدام دولت فرانسه در تثبیت قیمت ۸۰ درصدی برق مصرفی صنایع جهت کاهش قیمت تمام‌شده و صرفه اقتصادی تولید در آنها اثر خود را روی قیمت آلومینیوم نشان داد. قیمت روی اما با توجه به بحران انرژی در کشورهای تولیدکننده اروپایی همچنان صعودی بوده و نزدیک به ۵ درصد در این هفته افزایش داشته است. پیش‌بینی روندی مشابه برای قیمت مس نیز می‌شد که با توجه به وضع نابسامان سیاسی منطقه شرق آسیا و وابستگی شدید مس به سلامت افق صنعتی سیاسی، این هفته شاهد افزایش تقاضا برای این فلز نبودیم. قیمت سنگ آهن نیز با توجه به انباشته شدن انبارهای بنادر چین از این محصول و شمش فولادی و ورق گرم و افزایش دوباره محدودیت‌های کرونایی کاهش قابل توجه داشت و تا نزدیکی محدوده ۱۱۰ دلار سقوط کرد.

شاخص‌های کالایی

کاهش شدید شاخص بالتیک خشک با توجه به تحرکات نظامی منطقه شرق آسیا و عدم عبور و مرور کشتی‌ها از شلوغ‌ترین تنگه و دریای جهان امری طبیعی و قابل پیش‌بینی بود. در صورت بهبود وضعیت سیاسی این منطقه طی هفته‌های آتی احتمال آن می‌رود که این شاخص به سطح قبلی خود باز گردد.

شاخص‌های اصلی مصرف‌کننده نیز در این هفته با توجه به افت سنگین قیمت حامل‌های انرژی و کاهش قیمت مواد غذایی و وضع کم‌رونق بازار محصولات صنعتی با کاهش شدید روبرو بود.

ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه
محصولات کشاورزی						
۱	ذرت	۶۰۸	سنت / بوشل	۲۳۹	دلار/تن	۹.۵۶%
۲	کتان (پنبه)	۱۰۱.۶۸	سنت / پوند	۲۲۴۲	دلار/تن	۱۰.۰۲%
۳	سویا	۱,۶۱۶.۵۰	سنت / بوشل	۵۹۴	دلار/تن	۱۱.۷۵%
۴	شکر	۱۷.۹۴	سنت / پوند	۳۹۶	دلار/تن	-۳.۹۶%
۵	گندم	۷۷۶.۵۲	سنت / بوشل	۲۸۵	دلار/تن	-۳.۸۷%
۶	کانولا	۸۵۰.۲۰	دلار کانادا/تن	۶۷۲	دلار/تن	-۴.۶۶%
کالاهای صنعتی						
۷	مس	۷۸۳۳	دلار/تن			-۰.۸۷%
۸	قبر	۴۰۶۱	یوان/تن	۶۵۰	دلار/تن	-۳.۷۷%
۹	فولاد	۴,۲۵۰	یوان/تن	۶۸۰	دلار/تن	-۱.۳۷%
۱۰	آلومینیوم	۲,۴۲۸	دلار/تن			-۵.۰۶%
۱۱	سرب	۲,۰۹۵	دلار/تن			۵.۴۸%
۱۲	روی	۳,۴۷۱	دلار/تن			۱۵.۹۸%
۱۳	سنگ آهن	۱۱۱.۵۰	دلار/تن			-۳۸.۲۳%
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۵۲۰	دلار/تن			-۸.۲۱%
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۴۵۵	دلار/تن			-۹.۳۶%
شاخص‌های کالایی						
۱۶	بالتیک خشک	۱,۵۶۰	واحد			-۱۱.۷۰%
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۳۰۰	واحد			۳۱.۸۰%
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۳,۷۶۵	واحد			۱.۸۶%
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدامن ساکس اس‌اند‌پی (S&P GSCI)	۳,۵۳۳	واحد			-۴.۹۹%



در هفته منتهی به شنبه ۱۵ مرداد ۱۴۰۱ بازدهی هفتگی صندوق‌های درآمد ثابت، خصوصی، جسورانه، مختلط و مبتنی بر سپرده کالایی مثبت و بازدهی صندوق‌های بازارگردانی، صندوق در صندوق و در سهام منفی و بازدهی صندوق‌های پروژه‌ای صفر بود.

درعین حال، بیشترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های درآمد ثابت با ۰/۳۵ درصد و کمترین میزان بازدهی هفتگی مربوط به صندوق‌های اختصاصی بازارگردانی با ۰/۸۳- درصد بود.

از سوی دیگر به ترتیب صندوق‌های با درآمد ثابت با ۷۴/۹۴ درصد، اختصاصی بازارگردانی با ۱۴/۹۴ درصد و سهامی با ۸/۷۷ درصد دارای بیشترین سهم از ارزش دارایی کل صندوق‌ها بودند.

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی هفتگی (%)	میانگین بازدهی ماه (%)	میانگین بازدهی ماه 3 بازدهی (%)	میانگین بازدهی 6 بازدهی (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
صندوق در صندوق	۳,۳۴۳	۰.۰۰%	۰.۲۶%-	۲.۲۰%-	۳.۷۵%-	۸.۵۵%	۴.۹۵%
خصوصی	۱,۶۱۳	۰.۰۱%	۰.۰۹%	۰.۳۶%	۱.۴۳%	۳.۰۴%	۵.۵۰%
در اوراق بهادار با درآمد ثابت	۴,۸۷۱,۵۶۱	۰.۰۸%	۰.۳۵%	۱.۲۸%	۴.۰۷%	۸.۷۴%	۱۳.۵۹%
اختصاصی بازارگردانی	۹۷۱,۰۷۰	۲.۲۸%	۰.۸۳%-	۵.۹۹%-	۷.۴۰%-	۹.۹۸%	۲.۱۷%-
در سهام	۵۷۰,۰۱۰	۰.۴۱%	۰.۱۶%-	۳.۹۲%-	۷.۶۶%-	۱۲.۵۲%	۰.۵۶%
در اوراق بهادار مبتنی بر سپرده کالایی	۴۷,۹۱۶	۰.۰۰%	۰.۱۳%	۰.۲۳%-	۱۰.۲۷%	۲۴.۰۳%	۳۸.۱۰%
مختلط	۲۱,۷۲۱	۰.۰۳%	۰.۰۷%	۱.۸۵%-	۲.۴۷%-	۱۱.۰۵%	۸.۲۱%
پروژه‌ای	۱۰,۵۷۶	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%	۰.۰۰%
جسورانه	۴,۳۸۴	۰.۹۵%	۰.۰۷%	۰.۳۱%	۰.۸۳%	۵.۲۰%	۲۲.۰۲%
جمع کل	۶,۵۱۳,۶۰۲						

بررسی وضعیت بازار بدهی

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

طی هفته اخیر، بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سررسید نشده به ترتیب متعلق به نمادهای اخزا۰۳ و اخزا۰۱ با سررسید ۱۴۰۳/۰۴/۱۸ و ۱۴۰۳/۱۱/۱۵ و بازدهی‌های ۲۳/۵۳ و ۲۷/۵۲ درصد بود.

همچنین کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا۰۱ با سررسید ۱۴۰۱/۰۶/۲۱ و بازدهی‌های ۲۱/۳۸ و ۱۹/۵۸ درصد بود.

از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۲/۴۷ و ۲۳/۷۱ درصد است.

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده	
اخرزا۰۳	۶۶۷۰۰۰	۱۴۰۱-۰۵-۱۵	۱۴۰۳-۰۴-۱۸	۲۳.۵۳%	۲۶.۰۸%	
اخرزا۰۱	۵۹۲۵۲۰	۱۴۰۱-۰۵-۱۵	۱۴۰۳-۱۱-۱۵	۲۳.۳۰%	۲۷.۵۲%	
اخرزا۰۱	۹۷۸۹۹۰	۱۴۰۱-۰۵-۱۲	۱۴۰۱-۰۶-۲۱	۲۱.۳۸%	۱۹.۵۸%	
میانگین بازدهی					۲۲.۴۷%	۲۳.۷۱%

منبع: فرابورس ایران

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

اوراق تأمین مالی

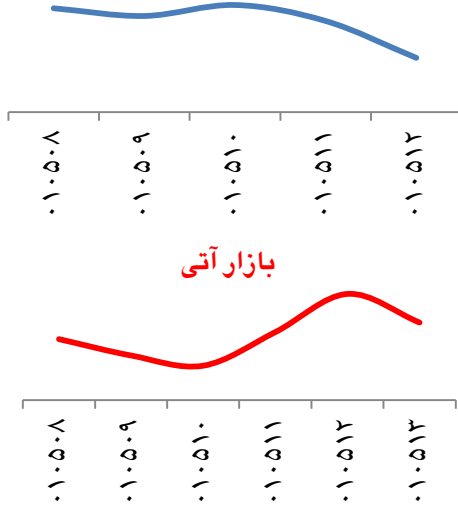
از میان اوراق تأمین مالی معامله شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد تابان۰۱ بمیزان ۱۲.۱۸ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۵/۱۰ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد ارادا۰۱ بمیزان ۲۵/۴۵ درصد با سررسید ۱۴۰۱/۰۵/۱۰ بوده است.

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
ارادا۰۱	۹۹۵۰۰۰	۱۴۰۱-۰۵-۱۱	۱۴۰۱-۰۶-۰۷	۲۵.۴۵%
تابان۰۱	۱۰۹۰۰۰۰	۱۴۰۱-۰۵-۱۰	۱۴۰۲-۱۲-۰۶	۱۲.۱۸%

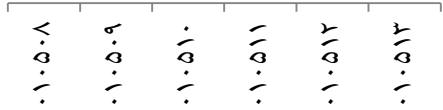
منبع: فرابورس ایران

بورس کالا

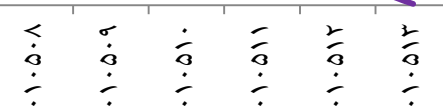
بازار فیزیکی



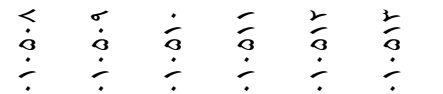
بازار آتی



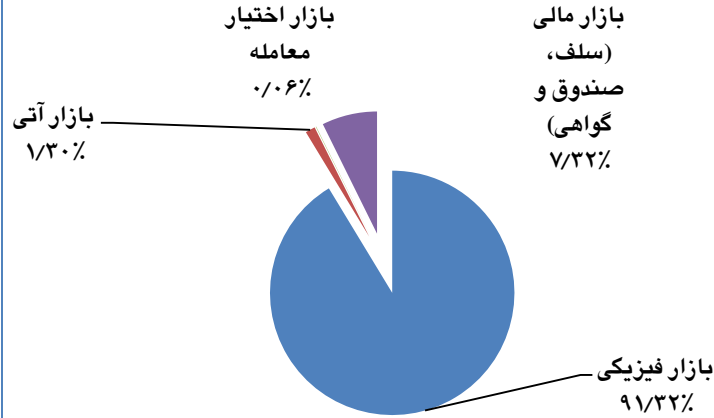
بازار مالی (سلف، صندوق و موازی)



بازار اختیار معامله



سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۶.۹ 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 ۱۱.۴۵ درصد افزایش و حجم معاملات ۱.۵۵ درصد افزایش پیدا کرده است.

ارزش و حجم معاملات مهمترین گروه‌های کالایی در بازار فیزیکی

گروه اصلی	ارزش (میلیون ریال)	حجم	درصد از کل
صنعتی	۷۳,۸۶۱,۷۹۳	۱,۶۴۳,۳۰۹	۵۲/۹%
پتروشیمی و نفتی	۶۱,۴۵۲,۷۰۸	۴۰۸,۴۴۰	۴۴/۰%
معدنی	۳,۷۱۲,۹۴۵	۳۴,۵۰۰	۲/۷%
بازار فرعی	۶۵۰,۰۴۲	۷,۸۶۷	۰/۵%
جمع	۱۳۹,۶۷۷,۴۸۸	۲,۰۹۴,۱۱۶	۱۰۰%

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

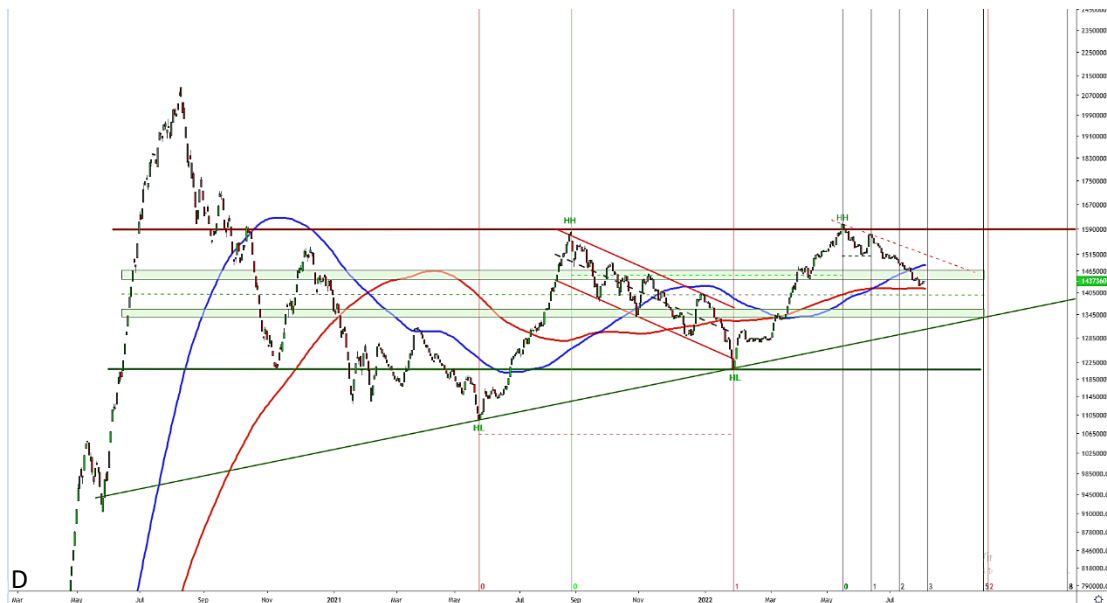
مقایسه نرخ‌های بورس کالا با نرخ‌های جهانی

مصول	نرخ ریالی	میانگین هفتگی نرخ (قیمای دلار)	میانگین هفتگی نرخ (دلار آزاد)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ نیما)	ارزش دلاری در بورس کالا (نرخ آزاد)	نرخ جهانی (دلار)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ نیما)	نسبت بورس کالا به قیمت جهانی (نرخ آزاد)	تغییرات هفتگی نرخ ریالی
یک تن اوره گرانول	۱۱۳,۴۷۴,۰۰۰	۲۶۴,۵۹۷	۳۱۴,۹۵۳	۴۲۹	۲۶۰	۶۰۷	۷۰/۷%	۵۹/۴%	-۶/۹%
یک تن کاتد مس	۲,۲۶۸,۴۸۸,۰۰۰	۲۶۴,۵۹۷	۳۱۴,۹۵۳	۸,۵۷۳	۷,۲۰۳	۷,۸۳۳	۱۰۹/۵%	۹۲/۰%	۹/۹%
یک تن پت شهید تندگویان	۳۸۸,۹۶۷,۰۰۰	۲۶۴,۵۹۷	۳۱۴,۹۵۳	۱,۴۷۰	۱,۲۳۵	۱,۲۰۰	۱۲۲/۵%	۱۰۲/۹%	-۳/۵%
یک تن بیلت فخور	۱۲۵,۰۳۸,۰۰۰	۲۶۴,۵۹۷	۳۱۴,۹۵۳	۴۷۳	۳۹۷	۵۲۴	۹۰/۲%	۷۵/۸%	-۳/۳%
یک تن سیمان تیب ۲ قه	۶,۷۹۵,۰۰۰	۲۶۴,۵۹۷	۳۱۴,۹۵۳	۲۶	۲۲	-	-	-	-۹/۰%

تحولات معاملات بورس کالا در هفته اخیر، نشان‌دهنده روند نوسانی بازارهای آتی و اختیار معامله و روند نزولی بازارهای فیزیکی و مالی بوده است.

تحلیل تکنیکال شاخص کل

نشانه‌های مثبت اما ناکافی در شاخص کل



- شاخص کل هفته گذشته به روند نزولی خود ادامه داد و تا محدوده ۱,۴۲۳,۰۰۰ واحد نیز افت کرد.
- اما طی معاملات چهارشنبه هفته گذشته و امروز (شنبه ۱۵ مرداد ۱۴۰۱) علی‌رغم در پیش بودن تعطیلات رسمی هفته جاری و بدین واسطه انتظار افزایش فشار فروش، امروز شاهد بازاری مثبت همراه با جریان مثبت ورود نقدینگی به بازار بودیم که این می‌تواند نشانه مثبتی برای بازار باشد.
- باید توجه داشت که برای تغییر روند، لازم است شاهد افزایش قابل توجه ارزش معاملات، شکست خط روند نزولی و تثبیت بر بالای محدوده ۱,۵۰۰,۰۰۰ واحد باشیم. در غیر این صورت شاخص کل می‌تواند مجدداً به روند نزولی خود ادامه داده و تا محدوده‌های حمایتی ۱,۴۰۰,۰۰۰ و ۱,۳۵۰,۰۰۰ واحد نیز برسد.

❖ 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 روندهای اشاره شود.

تحلیل تکنیکال بیت کوین (BTCUSD)

شکست در عبور از مقاومت ۲۴ هزار دلار



- هفته گذشته بیت کوین بار دیگر به سمت محدوده مقاومتی ۲۴ هزار دلار خیز برداشت اما این بار نیز نتوانست از ۲۴,۶۷۰ دلار فراتر رود و مجدداً به زیر سطح ۲۴ هزار دلار بازگشت.
- به نظر می رسد بیت کوین مجدداً روندی اصلاحی در پیش گرفته و می تواند این روند را تا محدوده حمایتی ۲۰ هزار دلار نیز ادامه دهد.

❖ 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 طلا (XAUUSD)

حفظ خط روند نزولی و واکنش منفی به آن



- هفته گذشته اونس جهانی طلا موفق شد از محدوده مقاومتی ۱,۷۸۰ دلار عبور و خود را تا محدوده ۱,۷۹۴ دلار نیز برساند اما موفق به تثبیت بر بالای این محدوده نشد و به خط روند نزولی میان مدت خود واکنشی منفی نشان داد و به زیر محدوده مقاومتی ۱,۷۸۰ دلار بازگشت.
- به نظر می رسد طی هفته جاری روند اصلاحی طلا ادامه داشته باشد و به سطوح پایین تری نیز برسد.
- در این راستا محدوده های حمایتی پیش روی اونس جهانی طلا عبارتند از ۱,۷۵۰ و ۱,۷۳۰ دلار.

❖ 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 شاخص دلار (DXY)

بازگشت به مدار مثبت



- همانطور که انتظار می‌رفت شاخص دلار با رسیدن به خط روند صعودی میان‌مدت خود در محدوده ۱۰۵ واحد تغییر روند داد و مجدداً وارد فاز صعودی شد.
- در صورتیکه شاخص کل موفق به بازپس‌گیری سقف قبلی خود در محدوده ۱۰۹ واحد شود انتظار می‌رود روند صعودی خود را تا محدوده سقف کانال صعودی بلندمدتش ادامه دهد.

❖ 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 روندهای 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 ۱,۴۳۷,۳۶۰ واحدی و بازده هفتگی ۲.۳۴- درصد بسته شد.
- برآیند هفته گذشته پول حقیقی، حاکی از خروج ۱,۵۰۷ میلیارد تومان از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول اشخاص حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۱، نشان دهنده خروج ۱۹,۴۱۰ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۲۲۳ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.
- خالص پول اشخاص حقیقی کل بازار از ابتدای سال ۱۳۹۹ که در قله خود (۱۹ مرداد ۱۳۹۹) به عدد ۱۱۸,۲۴۲ میلیارد تومان رسیده بود، به عدد ۳۷,۲۴۰- میلیارد تومان افول کرد.

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

شنبه	۰۱/۰۵/۰۸	-۲۸۸	میلیارد تومان
یکشنبه	۰۱/۰۵/۰۹	-۵۴۵	میلیارد تومان
دوشنبه	۰۱/۰۵/۱۰	-۲۸۸	میلیارد تومان
سه شنبه	۰۱/۰۵/۱۱	-۲۹۸	میلیارد تومان
چهارشنبه	۰۱/۰۵/۱۲	-۸۹	میلیارد تومان

ارزش دلاری شاخص کل

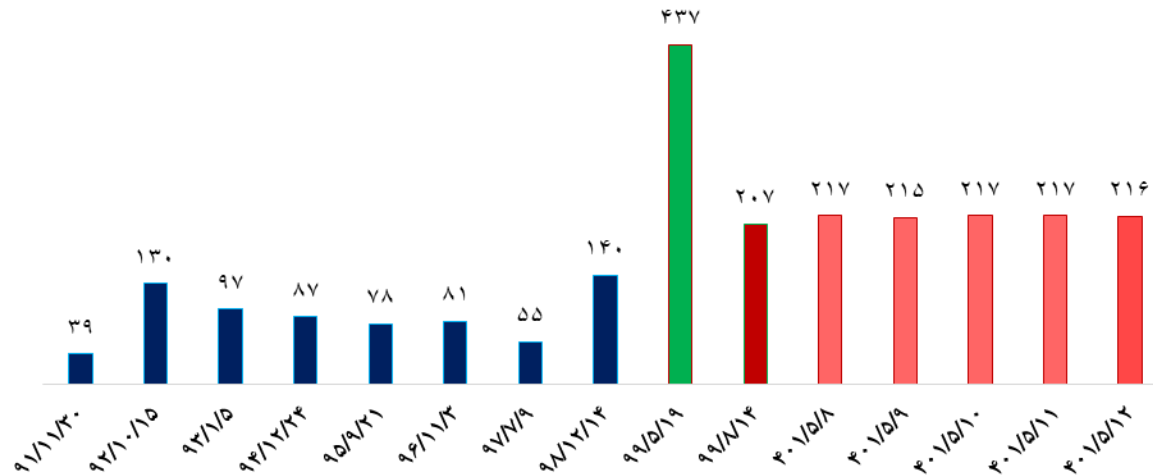
نمودار ارزش دلاری قله‌های شاخص کل طی سال‌های ۹۱-۱۴۰۱ (میلیون دلار)

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۱۶ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله شاخص معادل ۵۱ درصد شد.

شاخص وارن بافت

بر اساس بروزرسانی جدید گزارش بانک جهانی، در سال ۲۰۲۰ ارزش GDP ایران معادل ۲۳۱/۵ میلیارد دلار اعلام شده است. لذا، نسبت ارزش دلاری بازار سرمایه به GDP ایران (موسوم به شاخص وارن بافت) معادل ۹۳.۳ درصد محاسبه می‌شود.

گفتنی است که در تاریخ ۲۹ جولای سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۴.۲ تریلیون دلار بازارهای مالی آمریکا و GDP برابر با ۲۴.۹ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۷۷ 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
شستا	۶.۸۲	۱۳۹	۹۴۸	۵.۹۶	۱۵۹	۱۴۰۲/۰۳/۳۱	۷۳٪
وبانک	۴.۰۶	۲,۰۷۸	۸,۴۴۰	۴.۳۴	۱,۹۴۴	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۲٪
وصندوق	۴.۳۶	۲,۵۴۶	۱۱,۱۰۰	۴.۱۵	۲,۶۷۶	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۴۸٪
وامید	۹.۵۰	۱,۳۶۷	۱۲,۹۸۰	۶.۶۴	۱,۹۵۵	۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۵۵٪
وغدیر	۶.۹۶	۲,۰۷۳	۱۴,۴۳۰	۴.۹۰	۲,۹۴۷	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۵۱٪
ونیکي	۴.۳۳	۱,۹۶۳	۸,۴۹۰	-	-	۱۴۰۱/۰۹/۳۰	۴۴٪

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، عبدالکریم جهاندار و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
رضا جعفری

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