



شرکت سرمایه گذاری اهتمام ایرانیان
(سهامی عام)

روی خوش بازار سرمایه به برجام!؟

امروز (شنبه ۱۶ بهمن ۱۴۰۰) خبر ارائه معافیت آمریکا برای برخی از تحریم‌های هسته‌ای ایران منتشر شد و برداشت بازار از این خبر، نزدیک شدن بیش‌ازپیش به احیای توافق برجام بود. در همین راستا، بازار سرمایه با رشدی (هرچند ناچیز) بسیاری از سرمایه‌گذاران را به آینده بازار امیدوار کرد. درعین‌حال، واکنش بازار ارز به این خبر مهم نیز باعث افت غیرمنتظره نرخ ارز نشد و همین موضوع فعالان بازار سرمایه را به عدم واکنش منفی این بازار، حتی در کوتاه‌مدت، نسبت به احیای برجام امیدوار کرده است.

گزارش تحلیل بازارها - شماره ۹۲ - هفته منتهی به ۱۶ بهمن ۱۴۰۰

گروه تحلیل‌گران شرکت سرمایه‌گذاری اهتمام ایرانیان (سهامی عام)

EhtemamIranian.com

مهمترین عناوین

- حقایق پیرامون چشم‌انداز اقتصاد جهانی: چالش جدی غول خودروسازی اروپا - بحران کمبود ریزپردازنده‌ها و کاهش تولید خودرو، منجر به کاهش حقوق نیروی کار در شرکت فولکس واگن شد!
- تصویر اقتصاد کلان: کاهش محسوس نرخ رشد اقتصادی در منطقه یورو؛
- بازار مسکن: پایداری معاملات؛
- بورس و انرژی: سقوط ۲۰۰ میلیارد دلاری ارزش سهام فیس‌بوک در هفته مثبت وال‌استریت؛
- فلزات گرانبها و ارز: بازیابی رمزارزها؛
- بازار کالاهای خام: تداوم صعود سنگ‌آهن؛
- بررسی صندوق‌ها و بازدهی آنها؛
- بررسی بورس کالا؛
- بررسی آخرین وضعیت شاخص مدیران خرید (PMI) در ایران و جهان؛
- تحلیل تکنیکال: بورس - خمیده شدن قامت موج صعودی؛
- تحلیل تکنیکال: بیت‌کوین - رشد قابل توجه و عبور از مقاومت ۴۰ هزار دلار؛
- تحلیل تکنیکال: اونس طلا - کندل‌های کم‌رمق صعودی؛
- تحلیل تکنیکال: شاخص دلار - اصلاح شدید شاخص دلار؛
- 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

چالش جدی غول خودروسازی اروپا

بحران کمبود ریزپردازنده‌ها و کاهش تولید خودرو، منجر به کاهش حقوق نیروی کار در شرکت فولکس واگن شد!

اشاره

طی هفته اخیر افزایش قیمت نفت و تثبیت نرخ نفت خام برنت دریای شمال بر بالای کانال ۹۰ دلاری، یکی از مهمترین اخبار جهان بود. همچنین سقوط سهام فیس‌بوک بارزش بیش از ۲۰۰ میلیارد دلار، در کنار افزایش ارزش بازار رمزارزها و اقدامات دولت آمریکا برای کنترل تورم خبرهای مهم دیگر بودند. در نهایت کمبود ریزپردازنده‌ها مجدداً خبرساز شد و در آخرین خبر مربوط به این حوزه، شرکت فولکس واگن مجبور به کاهش تولید و به تبع آن کاهش حقوق نیروی کار خود شد.

بلومبرگ

Bloomberg

- نفت برنت، در آستانه‌ی ۹۴ دلاری شدن قرار گرفت. تقاضا در بازار نفت، سر کاهش ندارد.
- بیت‌کوین به کانال ۴۰,۰۰۰ دلار بازگشت.
- مبارزه فدرال رزرو با تورم سخت‌تر شده است.
- آمار هفتگی اشتغال آمریکا علاوه‌براینکه بدون توجه به اومیکرون افزایش یافته، قیمت اوراق قرضه دولتی این کشور را نیز کاهش داده است.
- آمازون، پیش‌تاز صعود قیمت در بازار سهام تکنولوژی شد.
- فیس‌بوک برای اولین بار در تاریخش، کاهش کاربران روزانه را گزارش کرد.
- ارزش سهام فیس‌بوک در یک روز، ۲۰۰ میلیارد دلار سقوط کرد.
- شرکت آرامکوی عربستان سعودی، بدنبال مرحله جدیدی از عرضه اوراق بهادار خود است.
- روش‌های جدید بانک مرکزی ترکیه جهت حفظ ارزش لیر، کارآمدتر هستند و امید است عملکرد بهتری داشته باشند.
- در پی افزایش تقاضا در آمریکای شمالی، قیمت کود شیمیایی در این قاره افزایش داشت.
- ناتو به درخواست چین و روسیه برای عدم گسترش به اروپای شرقی پاسخ منفی داد.
- بزرگترین بانک اسلامی امارات، قصد گسترش فعالیت‌های بین‌المللی و بستن قرارداد با دول خارجی را دارد.
- فروپاشی اقتصاد لبنان، جوانان را به فعالیت در گروه‌های شبه‌نظامی علاقه‌مند کرده است.

BUSINESS INSIDER

بیزینس اینسایدر

- ترامپ گفت «جاستین تروودی دیوانه و چپ افراطی، در حال نابود کردن کاناداست».
- شیوه پیچیده و ناکارآمد انتشار آمار اشتغال، اقتصاددانان را به اشتباه می‌اندازد.
- علی‌رغم شدت گرفتن گسترش اومیکرون، در ماه ژانویه ۴۶۷,۰۰۰ فرصت شغلی در آمریکا خلق شد.
- افزایش هزینه‌های زندگی در انگلستان، در مرحله القای بحران‌های اجتماعی قرار دارد.
- آمریکا در حال تجربه یک رکود استعداد در نیروی انسانی است.
- زیرگونه بی‌آز از گونه اومیکرون که اکنون در حال گسترش است، جای نگرانی خاصی ندارد.
- تحقیقات شرکت‌های خصوصی منادی این است که دنیای رمزارزها می‌تواند سریع حرکت کند و مشکلات اعمالی از طرف دولت‌ها را مرتفع سازد.
- افزایش قیمت مسکن در ایالات متحده گویا انتهایی ندارد!
- گروه مالی بلک‌راک، بعنوان تأثیرگذارترین مدیریت سرمایه در جهان، وارد شبکه‌های اجتماعی مدرن شدن.
- روند بالارفتن قیمت ملک در تورنتو، پس از تجربه بزرگترین افزایش در ۵ سال اخیر، متوقف شد.

موارد ابتلاء به ویروس کرونا

۳۹۱,۶۵۹,۷۱۹ +۵/۷۱%

جان باختگان

۵,۷۴۴,۶۷۴ +۱/۳۵%

بهبودیافتگان

۳۱۰,۵۱۳,۹۲۹ +۶/۱۴%

منبع: www.worldometers.info

فایننشال تایمز



- ششمین روز پیاپی بحران سوخت در آلمان رقم خورد.
- بحران بدهی پس از رکود اقتصادی ناشی از کرونا، اکنون گریبان‌گیر کشورهای فقیر جهان شده است.
- فروش خودروهای الکتریکی در انگلستان، صعود ۲۸ درصدی را در ژانویه امسال تجربه کرد.
- گوگل قصد همکاری با فورد در آزمایشگاه‌های تحقیقاتی پیشرفته خودروهای الکتریکی را دارد.
- با از دست رفتن فرصت شرکت مرک برای گرفتن تأییدیه‌های لازم برای تولید نهایی داروی کرونا، این بازار ۱۷ میلیارد دلاری احتمالاً به فایزر برسد.
- بازار نفت شیل آمریکا، بار دیگر با افزایش قیمت نفت جان گرفت.
- اعتراضات مردم کانادا به محدودیت‌های کرونایی و قوانین سختگیرانه واکسیناسیون در حال بیشتر شدن است.
- بحران کمبود ریزپردازنده‌ها و در نتیجه کاهش تولید خودرو، گریبان‌گیر کارگران غول خودروسازی اروپا، فولکس واگن، با کاهش حقوق آنها شد.

تصویر اقتصاد کلان

کاهش محسوس نرخ رشد اقتصادی در منطقه یورو

مقایسه بازدهی بازارها

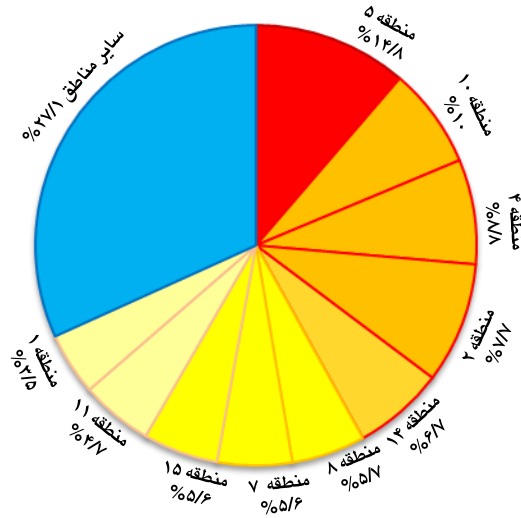
یکساله	۱۴۰۰	ماهنامه	هفتگی	بازار
دلار (ریالی)	%۲۱/۰۹	%۱۴/۵۲	%۱/۵۴	%۱/۳۶
سکه (ریالی)	%۱۲/۰۸	%۸/۰۲	%۵/۹۶-	%۱/۱۰-
بورس (شاخص)	%۷/۹۴	%۰/۶۴-	%۵/۴۴-	%۵/۷۳
ارزش بازار رمزارزها (دلاری)	%۶۴/۳۹	%۷/۴۹	%۱۰/۲۲-	%۱۱/۶۱
مسکن (ریالی - تهران)	%۲۰/۳	-	%۱/۱	-

؟؟؟

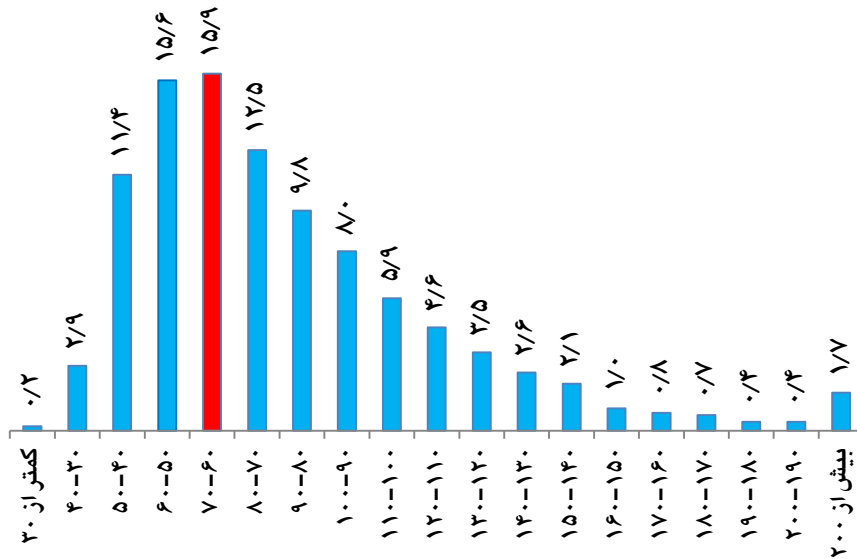
نرخ بهره (درصد)	فصلی نرخ رشد اقتصادی (درصد)	نقطه به نقطه (ماهانه)		میانگین سالیانه			درآمد سرانه (دلار)	تولید ناخالص داخلی (میلیون دلار)	حوزه جغرافیایی متغیر
		نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ تورم (درصد)	نرخ بیکاری (درصد)	نرخ رشد اقتصادی - به قیمت‌های ثابت (درصد)			
جهان									
-	-	-	-	۲۰۲۰	-	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
-	-	-	-	%۳/۱۸	-	%۵/۹	۱۰،۸۴۵	۸۴،۵۳۷،۶۹۰	مقدار شاخص
				-	-	%۴/۴	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
آمریکا									
۲۲- ژانویه	دسامبر-۲۱	دسامبر-۲۱	ژانویه-۲۲	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۰/۲۵	%۶/۹	%۷	%۴	%۴/۷	%۳/۹	%۵/۵	۶۳،۴۱۶	۲۰،۹۳۲،۷۵۰	مقدار شاخص
				-	-	%۴	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
چین									
۲۱- فوریه	دسامبر-۲۱	دسامبر-۲۱	دسامبر-۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۳/۷	%۱/۶	%۱/۵	%۵/۱	%۰/۹	%۵/۱	%۴	۱۰،۴۸۵	۱۴،۷۲۳،۸۳۷	مقدار شاخص
				-	-	%۴/۸	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		
منطقه یورو									
۲۲- فوریه	دسامبر-۲۱	ژانویه-۲۲	دسامبر-۲۱	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									
دسامبر-۲۱	تابستان ۱۴۰۰	دی ۱۴۰۰	پاییز ۱۴۰۰	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۱	۲۰۲۰	۲۰۲۰	بازه زمانی
%۱۸	%۴/۲	%۳۵/۹	%۸/۹	%۴۴	%۸/۹	%۲/۵	۷،۵۵۵	۲۰،۳،۴۷۱	مقدار شاخص
				-	-	%۲	پیش‌بینی (۲۰۲۲)		

بازار مسکن پایداری معاملات

توزیع مناطق شهر تهران بر حسب سهم از تعداد معاملات انجام شده (دی ۱۴۰۰)

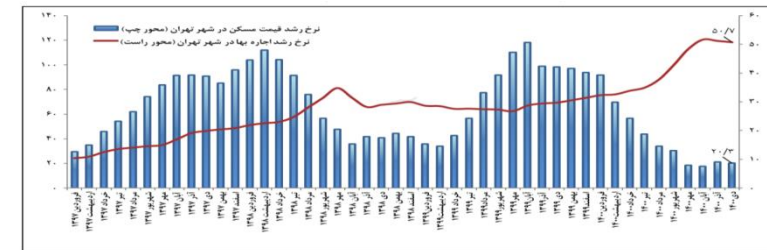


توزیع درصد فراوانی معاملات مسکن انجام شده در شهر تهران بر حسب مترمراژ (دی ۱۴۰۰)



بنا بر گزارش بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، در دی ماه سال ۱۴۰۰ تعداد معاملات آپارتمان‌های مسکونی تهران به ۹/۸ هزار واحد مسکونی رسید که نسبت به ماه قبل و ماه مشابه سال قبل به ترتیب ۰/۵ و ۱۷۹/۳ درصد افزایش داشته است. در دی ماه سال ۱۴۰۰ متوسط قیمت خرید و فروش یک مترمربع زیربنای واحد مسکونی معامله شده از طریق بنگاه‌های معاملات ملکی تهران ۳۲۹/۴ میلیون ریال بود که نسبت به ماه قبل ۱/۱ درصد و نسبت به ماه مشابه سال قبل ۲۰/۳ درصد افزایش را نشان می‌دهد. در میان مناطق ۲۲ گانه شهر تهران در دی ماه، بیشترین متوسط قیمت یک مترمربع زیربنای مسکونی معامله شده معادل ۷۰۲/۲ میلیون ریال به منطقه ۱ و کمترین آن با ۱۵۶/۵ میلیون ریال به منطقه ۱۸ تعلق داشته که نسبت به ماه مشابه سال ۱۳۹۹ به ترتیب ۱۷ و ۲۸/۸ درصد افزایش داشته‌اند. بررسی شاخص کرایه مسکن اجاری در شهر تهران و در کل مناطق شهری در دی ماه سال ۱۴۰۰ به ترتیب نشان‌دهنده رشد ۵۰/۷ و ۵۴ درصدی نسبت به ماه مشابه سال قبل است. بررسی توزیع تعداد واحدهای مسکونی معامله شده در شهر تهران، به تفکیک عمر بنا، حاکی از آن است که واحدهای ۵ سال ساخت با سهم ۳۳/۶ درصد بیشترین سهم را به خود اختصاص داده‌اند.

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



منبع: بانک مرکزی

منبع: بانک مرکزی

بورس و انرژی

سقوط ۲۰۰ میلیارد دلاری ارزش سهام فیس بوک در هفته مثبت وال استریت

بورس های جهانی
ماه فوریه بازارهای مالی، پس از ژانویه سیاه طوری شروع شد که با افزایش ۲ الی ۵ درصدی شاخص ها در روز دوم این ماه، امید به بازیابی کامل سقوط ۹ تریلیون دلاری ژانویه می رفت. اما فشار دادگاه های فدرال و حرف و حدیث ها در مورد اعمال سیاست های شدید آنتی ترست روی ۷ غول تکنولوژی و همچنین انتشار آمار عملکرد بد نتفلیکس، که موجب سقوط ۲۰ درصدی سهام این شرکت شد، در نهایت منتج به سقوط شاخص نزدک و به تبعیت از آن، سایر بازارهای آمریکا شد. در روز آخر هفته که بازار در مسیر رسیدن به تعادل قرار داشت نیز انتشار صورت های مالی سال ۲۰۲۱ فیس بوک و عملکرد بد و کاهش درآمدهای آن، که برای اولین بار در تاریخ، کاهش کاربران روزانه این پلتفرم را نشان می داد، موجب شروع موج منفی بسیار قوی در سهام این شرکت شد که باعث از دست رفتن ۲۰۰ میلیارد دلار از ارزش سهام این شرکت شد! (یعنی رقمی معادل ارزش دلاری GDP ایران در سال ۲۰۲۰ طبق اعلام بانک جهانی!) در اروپا نیز شاهد کاهش پیوسته شاخص دکس آلمان در طول این هفته بودیم که در کنار فرانسه، هر دو عملکردی منفی را ثبت کردند، درحالی که بورس لندن هفته را سبز رنگ به پایان برد. بازارهای شرق آسیا نیز برخلاف اروپا و آمریکا مثبت بوده و شاهد عملکرد بسیار خوب بورس هنگ کنگ در این هفته بودیم.

نفت و محصولات پتروشیمی

نرخ هر بشکه نفت خام برنت دریای شمال این هفته با قدرت تمام از ۹۰ دلار عبور کرد و در محدوده بین ۹۳ الی ۹۴ دلار در ساعات پایانی معاملاتی روز جمعه دادوستد شد. تقاضای بسیار بالای بازار و اختلال در عرضه جهانی از دلایل اصلی این افزایش قیمت بودند. اما اصلی ترین دلیل همچنان شرایط پرتلاطم صحنه سیاست جهان بود که ادامه دار شدن تنش های اروپا و دریای چین جنوبی، خود را در افزایش قیمت حامل های انرژی نشان داد. افزایش ۲۰ درصدی قیمت سوخت در آمریکا طی یک ماه گذشته و کمبود سوخت در آلمان، که برای ششمین روز متوالی ادامه دارد، از نتایج رالی پر قدرت ۷ هفته ای نفت هستند. گلدمن ساکس معتقد است که وضعیت کنونی صحنه سیاست جهان قیمت نفت را به آسانی به محدوده ۱۲۰ دلار می رساند. با قیمت های امروزی نفت، بار دیگر استخراج نفت شیل در آمریکا بصره شده و این محصول به بازارها برمی گردد. کارشناسان نیز قیمت های انرژی امروز را از دلایل تعجیل ایالات متحده برای امضای توافق با ایران می دانند. در عین حال قیمت گاز در هاب های ایالات متحده به علت سبک تر شدن موج سرمایه ایالات جنوبی، کاهش یافت. هفته ساکن محصولات پتروشیمی در این هفته، شاهد افزایش قیمت ۱۰ درصدی نرخ اوره در بازارهای جهانی، پس از سقوط ۴۵ درصدی ماه پیش، بود. اخبار مثبتی بر توقف صادرات اوره توسط روسیه بعثت حمایت از کشاورزان داخلی و افزایش کشت و همچنین تصمیم چین بر کاهش تولید اوره، از دلایل این شوک مثبت قیمتی بود، که در این هفته به بازارهای این محصول و کشاورزان جهان وارد شد. شایان ذکر است روسیه بزرگترین صادرکننده کود اوره در جهان و چین نیز یکی از بزرگترین تولیدکنندگان این محصول است.

منبع	بازده یکساله	بازده ماهانه	بازده هفتگی	معادل	آخرین قیمت	عنوان	ردیف
	۱۲.۹۵%	-۴.۶۳%	۱.۰۷%	واحد	۳۵,۰۹۵	Dow Jones	۱
	۸.۳۶%	-۹.۷۴%	۱.۶۶%	واحد	۱۴,۶۹۴	Nasdaq	۲
	۱۶.۱۷%	-۶.۱۳%	۱.۵۴%	واحد	۴,۴۹۸	S&P 500	۳
TeleTrader	۱۷.۱۴%	۰.۵۳%	-۰.۳۱%	واحد	۷,۵۳۳	FTSE 100	۴
	۷.۳۹%	-۶.۵۲%	-۱.۴۳%	واحد	۱۵,۱۰۰	DAX	۵
	۲۳.۹۴%	-۵.۰۰%	-۰.۲۱%	واحد	۶,۹۵۱	CAC 40	۶
	-۳.۱۸%	-۶.۳۵%	۲.۷۰%	واحد	۲۷,۴۴۰	NIKKEI 225	۷
	-۴.۰۱%	-۷.۴۶%	۰.۰۰%	واحد	۳,۵۲۳	SHANGHAI	۸
TradingEconomics	۲.۳۱%	-۹.۰۲%	-۰.۵۰%	واحد	۳,۴۷۱	Moex	۹
TeleTrader	۵۶.۳۷%	۱۶.۰۴%	۴.۰۴%	دلار / بشکه	۹۲.۵۲	نفت خام برنت	۱۰
TeleTrader	۶۱.۷۱%	۱۷.۵۳%	۴.۵۶%	دلار / بشکه	۸۹.۸۳	نفت خام WTI	۱۱
TeleTrader	۵۸.۹۶%	۱۷.۲۳%	-۱.۹۰%	دلار / MMBtu	۴.۵۵	گاز طبیعی (هنری هاب)	۱۲
OilPrice	۳۲.۸۷%	۱۷.۶۹%	-۰.۰۲%	دلار / بشکه	۹۰.۱۸	سبب اوپک	۱۳
OilPrice	۵۱.۴۶%	۱۱.۰۶%	-۰.۱۹%	دلار / بشکه	۸۴.۹۵	نفت سنگین ایران	۱۴
TeleTrader	۷۹.۵۲%	۱۹.۸۸%	۵.۲۵%	دلار / تن	۸۲۶	گازوئیل	۱۵
TradingEconomics	۵۷.۱۲%	۱۵.۰۳%	۸.۴۷%	دلار / تن	۸۳۹.۲۹	نفتا	۱۶
TradingEconomics	۲۲.۷۴%	-۱۱.۱۴%	-۵.۶۷%	دلار / تن	۶۷۹	اتانول	۱۷
Sunsirs	۳۸.۰۰%	۱۲.۲۴%	۶.۹۸%	دلار / تن	۴۲۱	متانول (داخلی چین)	۱۸
PLATTS	۱۸.۲۶%	۱۱.۴۴%	۰.۲۷%	دلار / تن	۳۶۷	متانول (CFR)	۱۹
Fertilizerworks	۴۴.۳۷%	-۱۴.۸۶%	۱۲.۴۶%	دلار / تن	۶۳۴.۸۳	اوره گرانول خاورمیانه	۲۰
PLATTS	۲۷.۲۳%	۷.۲۳%	۰.۰۰%	دلار / تن	۱,۱۷۵	پت - فوب جنوب شرق آسیا	۲۱

فلزات گرانبها و ارز

بازیبی رمزارزها



گروه سرمایه گذاری اقتصاد ایران
(میانگین سالانه)

منبع	بازده سالانه	بازده ماهانه	بازده هفتگی	معادل	آخرین قیمت	عنوان	ردیف
فلزات گرانبها							
TeleTrader	-۰.۱۷%	-۰.۱۳%	۱.۰۹%	دلار/اونس	۱,۸۰۶	طلا	۱
TeleTrader	-۱۶.۲۳%	-۱.۰۱%	۰.۴۹%	دلار/اونس	۲۲.۵۰	نقره	۲
طلا و سکه (داخلی) - پنجشنبه ۷ بهمن							
tgju/org	۱۰.۵۳%	-۴.۴۱%	-۱.۷۴%	ریال	۱۲,۱۰۹,۰۰۰	یک گرم طلای ۱۸ عیار	۳
tgju/org	۱۰.۳۰%	-۵.۹۸%	-۱.۳۷%	ریال	۱۲۱,۱۸۰,۰۰۰	سکه امامی	۴
ارز - پنجشنبه ۷ بهمن							
tgju/org	۱۴.۲۲%	۱.۰۲%	-۱.۸۲%	ریال	۲۷۲,۶۵۰	دلار آزاد	۵
sanarate/ir	۳.۱۲%	-۳.۵۹%	-۱.۹۱%	ریال	۲۳۸,۷۲۰	دلار حواله (خرید)	۶
sanarate/ir	۲.۵۵%	-۳.۵۹%	-۱.۹۱%	ریال	۲۴۰,۸۸۸	دلار حواله (فروش)	۷
sanarate/ir	۵.۲۰%	-۹.۰۵%	۰.۰۲%	ریال	۳۰۲,۴۹۰	یورو آزاد	۸
sanarate/ir	-۷.۷۵%	-۳.۵۱%	-۰.۶۸%	ریال	۲۶۹,۷۰۸	یورو حواله (خرید)	۹
sanarate/ir	-۶.۷۴%	-۳.۵۱%	-۰.۶۸%	ریال	۲۷۲,۱۵۸	یورو حواله (فروش)	۱۰
sanarate/ir	۸.۹۰%	-۹.۱۲%	-۱.۲۱%	ریال	۶۷,۲۱۴	درهم آزاد	۱۱
sanarate/ir	۰.۸۷%	-۳.۵۹%	-۱.۹۱%	ریال	۶۵,۰۰۲	درهم حواله (خرید)	۱۲
sanarate/ir	۲.۷۷%	-۳.۵۹%	-۱.۹۱%	ریال	۶۵,۵۹۳	درهم حواله (فروش)	۱۳
رمزارز							
Tradingview	۸.۴۷%	-۴.۳۱%	۸.۸۳%	دلار	۴۱,۵۷۱	بیت‌کوین	۱۴
Tradingview	۷۵.۹۶%	-۱۴.۳۸%	۱۶.۳۸%	دلار	۳,۰۲۸	اتریوم	۱۵

بازار فلزات گرانبها
اونس جهانی طلا در حالیکه هفته گذشته ریزش ۳ درصدی را تجربه کرد، این هفته دچار نوساناتی با برآیند مثبت شد. از علل این نوسانات می‌توان به مواردی از قبیل تنش‌های روسیه و اوکراین، کاهش ۱/۷۸ درصدی شاخص دلار، افزایش نرخ بهره توسط بانک مرکزی انگلیس و رسیدن آن به عدد ۰/۵، اظهار نظر پاتریک هارکر رئیس فدرال رزرو فیلادلفیا و مخالفت او با افزایش نیم درصدی نرخ بهره در ماه مارس و در ادامه انتشار داده‌های مربوط به مشاغل ایالات متحده اشاره کرد. با توجه به بالا بودن نرخ تورم در جهان و همچنین تصمیمات بانک‌های مرکزی در دنیا برای مقابله با تورم از جمله اعمال سیاست‌های انقباضی، اکثر تحلیل‌گران دیدگاه نزولی و نوسانی را برای این فلز زرد رنگ در سال ۲۰۲۲ پیش‌بینی می‌کنند.

سکه و ارز (داخلی)
هفته گذشته با انتشار سیگنال‌های مثبت حول مسائل مربوط به مذاکرات وین و همچنین بحث آزادسازی بسیاری از منابع مالی بلوکه‌شده ایران، شاهد افت قیمت ارز در بازار بودیم. با توجه به کاهش نرخ دلار، افزایش اونس جهانی طلا هم نتوانست مانع ریزش طلای داخلی شود.

رمزارز
بیت‌کوین روز جمعه بدنبال گزارش مالی قدرتمند غول تجارت الکترونیک، یعنی شرکت آمازون، افزایش یافت و قیمت آن با رشد ۱۱ درصدی در سطح ۴۱ هزار دلار قرار گرفت. اتریوم نیز با همین میزان افزایش به سطح ۳ هزار دلار رسید. در پی این گزارش، اعتماد سرمایه‌گذاران نسبت به سهام بخش فناوری تقویت شد. گفتنی است که بازار رمزارزها در ماه‌های گذشته بطور قابل توجهی از روند سهام بخش فناوری پیروی کرده است.

هفته گذشته نیز شرکت مایکرواستراتژی به عادت افراطی خود در خریداری بیت‌کوین ادامه داد و روز سه‌شنبه مدیرعامل آن، یعنی آقای مایکل سایلور، از طریق توئیتر اعلام کرد که این شرکت ۶۶۰ بیت‌کوین دیگر را به ارزش تقریبی ۲۵ میلیون دلار با میانگین قیمت ۳۷,۸۶۵ دلاری خریداری کرد. با این خرید، دارایی‌های یکی از نهنگ‌های بیت‌کوین، یعنی شرکت مایکرواستراتژی، به ۱۲۵,۰۵۱ عدد افزایش یافت. شایان ذکر است که قیمت متوسط این دارایی‌ها ۳۰,۲۰۰ دلار به ازای هر BTC است.

بازار کالاهای خام تداوم صعود سنگ آهن



ردیف	عنوان	آخرین قیمت	معادل	بازده هفتگی	بازده ماهانه	بازده سالانه	منبع			
محصولات کشاورزی										
۱	ذرت	۶۲۱.۷۵	سنت / بوشل	۲۴۵	دلار/تن	-۲.۲۸%	۴.۸۹%	۳۵.۴۶%	TeleTrader	
۲	کتان (پنبه)	۱۲۷.۵۲	سنت / پوند	۲.۸۱۱	دلار/تن	۳.۲۰%	۹.۷۷%	۵۷.۴۳%	TeleTrader	
۳	سویا	۱,۵۵۶.۵۰	سنت / بوشل	۵۷۲	دلار/تن	۵.۷۶%	۱۱.۹۴%	۳۸.۲۹%	TeleTrader	
۴	شکر	۱۷.۹۷	سنت / پوند	۳۹۶	دلار/تن	-۱.۳۷%	-۲.۰۷%	۱۷.۷۶%	TeleTrader	
۵	گندم	۷۶۵.۲۵	سنت / بوشل	۲۸۱	دلار/تن	-۲.۷۹%	-۰.۶۶%	۱۸.۸۳%	TeleTrader	
۶	کانولا	۱۰۲۶.۲	دلار کانادا/تن	۸۱۱	دلار/تن	۰.۸۵%	-۱.۶۰%	۴۸.۲۳%	TradingEconomics	
کالاهای صنعتی										
۷	مس	۹۸۷۵.۰	دلار/تن				۳.۹۹%	۰.۸۲%	۲۶.۳۷%	TeleTrader
۸	قیر	۳,۵۹۰	یوان/تن	۵۷۴.۴۰	دلار/تن	۲.۱۶%	۱۳.۹۰%	۳۵.۵۷%	TradingEconomics	
۹	فولاد	۴,۷۷۸	یوان/تن	۷۶۴.۴۸	دلار/تن	۰.۷۴%	۴.۹۰%	۱۴.۰۱%	TradingEconomics	
۱۰	آلومینیوم	۳,۰۳۶	دلار/تن				-۰.۷۸%	۷.۱۸%	۵۲.۲۲%	TeleTrader
۱۱	سرب	۲,۲۱۱	دلار/تن				-۱.۷۶%	-۳.۳۵%	۷.۰۵%	TeleTrader
۱۲	روی	۳,۶۰۵	دلار/تن				-۰.۴۱%	۰.۹۵%	۳۴.۳۱%	TeleTrader
۱۳	سنگ آهن	۱۴۳.۵۰	دلار/تن				۵.۹۰%	۲۲.۶۵%	-۷.۷۲%	TradingEconomics
۱۴	بیلت CIS (فوب دریای سیاه)	۶۶۵.۰	دلار/تن				۲.۴۱%	۱۱.۰۹%	۲۲.۶۰%	Metal Bulletin
۱۵	بیلت صادراتی ایران (فوب بندر ایران)	۵۶۰	دلار/تن				۱.۲۷%	۲.۳۸%		Metal Bulletin
شاخص های کالایی										
۱۶	بالتیک خشک	۱,۴۲۳	واحد				۹.۲۹%	-۳۷.۹۴%	۶.۷۵%	tgiu.org
۱۷	شاخص کالاهای اساسی در جهان (CRB)	۲۷۶	واحد				۳.۶۲%	۱۰.۴۱%	۴۴.۳۲%	TradingEconomics
۱۸	شاخص بورس فلزات لندن (LME)	۴,۶۷۷	واحد				-۰.۰۸%	۳.۰۱%	۳۵.۱۲%	TradingEconomics
۱۹	شاخص کالاهای اساسی گلدمن ساکس اس اند پی (S&P GSCI)	۳,۱۵۳	واحد				۲.۹۷%	۱۱.۷۰%	۴۶.۴۷%	TradingEconomics

بازار محصولات کشاورزی

بازار محصولات کشاورزی که هفته پیش دچار هیجانانگام ناشی از وضعیت سیاسی جهان بود، این هفته متعادلتر بوده و در اکثر محصولات اصلی و غلات پرمصرف، به جز دانه سویا، شاهد کاهش قیمت هفتگی بودیم. سویا، که افزایش قیمت نزدیک به ۶ درصدی را در این هفته سپری کرد، در مجموع نزدیک به ۱۲ درصد بالاتر از قیمت ماه گذشته معامله می‌شود. با توجه به اخبار مبنی بر کاهش تولید و صادرات کود اوره توسط چین و روسیه، باید شاهد افزایش قیمت این محصول در جهان و تأثیر آن روی محصولات کشاورزی باشیم.

بازار کالاهای صنعتی

بدنبال افزایش تقاضا و بالارفتن تمامی اجزای زنجیره فولاد در جهان، از آهن اسفنجی و کنسانتره تا زغال سنگ، شاهد افزایش ادامه دار قیمت فولاد در این هفته بودیم. قیمت بیلت فوب دریای سیاه به ۶۶۵ دلار به ازای هر تن رسیده و بیلت وارداتی در بندر چین نیز ۶۵۵ دلار بر تن معامله شد. پیش‌بینی می‌شود پس از اتمام تعطیلات سال نو چینی طی هفته‌ی آتی، شاهد افزایش دوباره این قیمت‌ها باشیم.

این هفته افزایش قیمت ۴ درصدی مس در حالی رخ داد که شاهد کاهش قیمت آلومینیوم، سرب و روی بودیم. به جز سرب، که روند نزولی یک ماهه را پشت سر می‌گذارد، سایر فلزات اساسی پس از یک رالی قابل توجه صعودی، بازدهی منفی را تجربه می‌کنند. واهمه از افزایش تنش‌ها در اوکراین و خطر درگیری با روسیه از عوامل افزایش قیمت فلزات در اروپا طی دو ماه اخیر بوده و اکنون با امضای قراردادهای تأمین گاز اروپا با قطر، آمریکا و آذربایجان و حضور پررنگ‌تر آمریکا در منطقه، شاهد کمتر شدن اضطراب ناشی از تنش‌ها با وجود بالا بودن خطرات احتمالی هستیم.

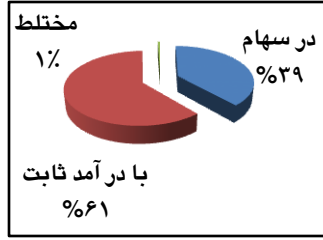
قیمت سنگ آهن که در ماه گذشته با صعود ۲۳ درصدی به ۱۴۳ دلار به ازای هر تن رسیده بود، نوید قیمت‌های بالاتر فولاد طی ماه‌های آتی را می‌دهد و کاهش محدودیت‌های محیط زیستی دولت چین روی شرکت‌های فولادساز، از عوامل افزایش تقاضای سنگ آهن و افزایش قیمت آن است.

شاخص های کالایی

شاخص بالتیک خشک نیز پس از هفته‌های متمادی کاهش و سکون، این هفته با ۱۰ درصد افزایش، حاکی از رونق گرفتن حمل و نقل دریایی در ماه فوریه است.

بررسی بازدهی صندوق‌های سرمایه‌گذاری

نوع صندوق	خالص ارزش دارایی صندوق (میلیارد ریال)	میانگین دارایی‌های نقدی (%)	میانگین بازدهی ماهانه (%)	میانگین بازدهی ۳ ماهه (%)	میانگین بازدهی ۶ ماهه (%)	میانگین بازدهی سالانه (%)
در سهام	۵۶۰,۳۱۶	۲۱	۲/۵	۴/۶-	۲/۷-	۲۲/۷
با درآمد ثابت	۸۸۳,۶۴۱	۸۵	۰/۶	۱/۳	۸/۱	۱۷/۱
مختلط	۸,۳۵۹	۴۷	۲/۵	۲/۰-	۶/۴	۳۰/۳
جمع کل صندوق‌ها	۱,۲۶۸,۰۳۲	۳۴	۲/۷	۲/۰-	۱/۵-	۱۲/۶



صندوق‌های سرمایه‌گذاری
در این هفته بازدهی هفتگی همه صندوق‌ها مثبت بود. سهم صندوق‌ها نیز تقریباً بدون تغییر باقی ماند.

منبع: شرکت مدیریت فناوری بورس

بررسی بازدهی اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)

نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM	بازده ساده
اخزا۱۹۱	۸۰۰,۶۱۰	۱۴۰۰-۱۱-۱۳	۱۴۰۲-۰۳-۲۲	۱۷,۸۲٪	۱۸,۳۶٪
اخزا۱۸۱	۵۴۲,۸۲۰	۱۴۰۰-۱۱-۱۶	۱۴۰۳-۰۹-۱۹	۲۳,۹۷٪	۲۹,۶۲٪
اخزا۱۷۱	۵۳۲,۸۰۰	۱۴۰۰-۱۱-۱۶	۱۴۰۳-۱۰-۲۴	۲۳,۸۸٪	۲۹,۸۳٪
میانگین بازدهی					۲۴,۰۲٪

منبع: فرابورس ایران

اسناد خزانه اسلامی (اوراق بدون ریسک)
طی هفته اخیر، کمترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده در میان اوراق بدهی سرسیدنشده متعلق به نماد اخزا۱۹۱ با سررسید ۱۴۰۲/۰۳/۲۲ به ترتیب با بازدهی‌های YTM و ساده ۱۷/۸۲ و ۱۸/۳۶ درصد بود. همچنین بیشترین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده به ترتیب متعلق به نماد اخزا۱۸۱ و اخزا۱۷۱ با سررسیدهای ۱۴۰۳/۰۹/۱۹ و ۱۴۰۳/۱۰/۲۴ و به ترتیب بازدهی‌های YTM و ساده ۲۳/۹۷ و ۲۳/۸۳ درصد بود. از سوی دیگر، میانگین بازدهی تا سررسید (YTM) و بازدهی ساده اسناد خزانه اسلامی، به ترتیب، معادل ۲۲/۳۳ و ۲۴/۰۲ درصد است.

بررسی بازدهی اوراق تأمین مالی

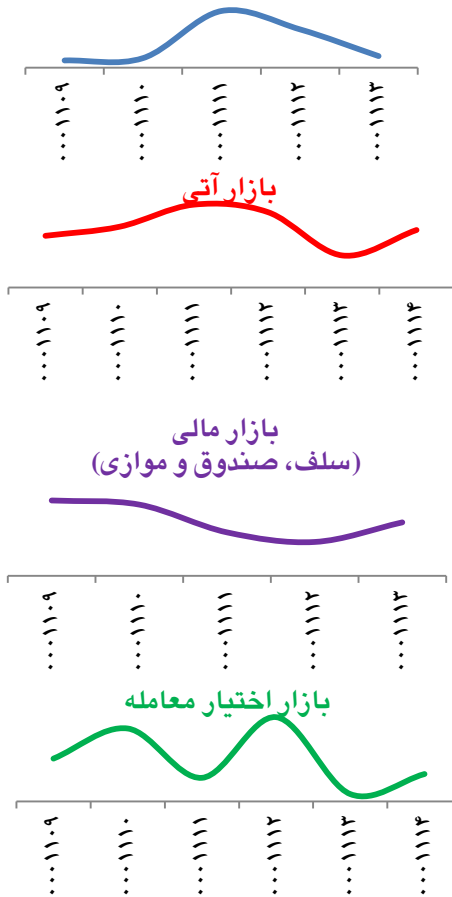
نماد	قیمت معامله شده هر سهم	تاریخ آخرین روز معاملاتی	تاریخ سررسید	YTM
اراد۸۶	۱,۰۳۲,۸۳۰	۱۴۰۰-۱۱-۱۳	۱۴۰۲-۰۴-۰۴	۱۳,۸۹٪
اشاد۱۰	۹۹۰,۸۳۰	۱۴۰۰-۱۱-۱۳	۱۴۰۰-۱۲-۲۶	۲۶,۱۴٪

منبع: فرابورس ایران

اوراق تأمین مالی
از میان اوراق تأمین مالی معامله‌شده طی هفته اخیر کمترین بازدهی متعلق به نماد اراد۸۶ به میزان ۱۳/۸۹ درصد با سررسید ۱۴۰۲/۰۴/۰۴ و بیشترین بازدهی متعلق به نماد اشاد۱۰ به میزان ۲۶/۱۴ درصد با سررسید ۱۴۰۰/۱۲/۲۶ بوده است.

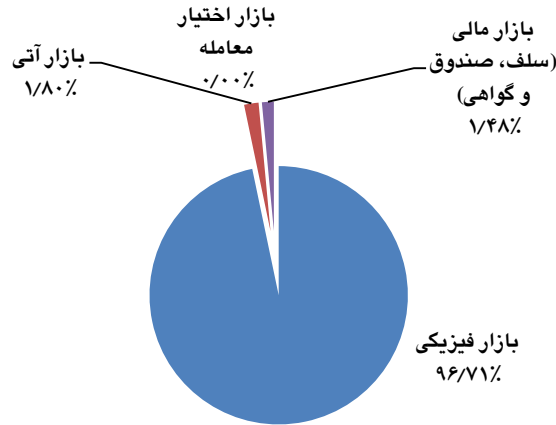
بورس کالا

بازار فیزیکی



تحولات معاملات بورس کالا در هفته اخیر، نشان‌دهنده روند نوسانی و نسبتاً ثابت در کلیه بازارها است.

سهم بازارهای کالایی از ارزش معاملات یک هفته اخیر



در این هفته ۹۶/۷ 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 ۷۷/۲ و حجم معاملات ۲۹/۹ 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	۱۵۷,۰۸۲,۷۳۴	۱,۷۰۶,۹۲۲	۷۲/۳%
پتروشیمی و نفتی	۵۲,۱۳۸,۰۷۰	۲۸۰,۰۴۹	۲۴/۳%
معنی	۳,۰۳۴,۰۵۸	۴۳,۵۰۰	۱/۴%
بازار فرعی	۲,۱۳۱,۸۳۳	۱۰,۴۵۶	۱/۰%
جمع	۲۱۴,۳۸۶,۶۹۵	۲,۰۴۰,۹۲۷	۱۰۰%

همچنین بررسی تحولات براساس نرخ ارز حواله ارزی، حاکی از عقب ماندن بیلت فولاد خوزستان از نرخ‌های جهانی و همچنین پیشی گرفتن نرخ اوره گرانول و نرخ مس کاتد 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 شمش بیلت فولاد خوزستان و مس کاتد از نرخ‌های جهانی و پیشی گرفتن نرخ اوره گرانول و 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	۱۴۷,۵۵۶,۰۰۰	۲۴۰,۳۳۰	۲۷۸,۱۲۰	۶۱۴	۵۳۱	۵۶۵	۱۰۸/۸%	۹۴/۰%	-۱۱/۷%
یک تن کاتد مس	۲,۴۰۷,۴۹۷,۰۰۰	۲۴۰,۳۳۰	۲۷۸,۱۲۰	۱۰,۰۱۷	۸,۶۵۶	۹,۴۹۶	۱۰۵/۵%	۹۱/۲%	-۰/۳%
یک تن پت شهید تندگویان	۲۷۳,۶۰۴,۹۴۵	۲۴۰,۳۳۰	۲۷۸,۱۲۰	۱,۵۵۵	۱,۳۴۲	۱,۱۷۵	۱۳۲/۳%	۱۱۴/۳%	۵/۵%
یک تن بیلت فخوز	۱۳۰,۱۳۶,۰۰۰	۲۴۰,۳۳۰	۲۷۸,۱۲۰	۵۴۱	۴۶۸	۵۵۳	۹۷/۹%	۸۴/۶%	۱/۶%
یک تن سیمان تیپ 2 فله	۴,۱۴۲,۵۲۶	۲۴۰,۳۳۰	۲۷۸,۱۲۰	۱۷	۱۵	-	-	-	۱/۴%

شاخص مدیران خرید (PMI) در جهان

ردیف	کشور	آخرین PMI	PMI قبلی	تغییر ماهانه	تاریخ محاسبه
۱	انگلیس	۵۴/۲	۵۳/۶	٪۱	۲۲ ژانویه
۲	آلمان	۵۳/۸	۴۹/۹	٪۸	۲۲ ژانویه
۳	هند	۵۳	۵۶/۴	-٪۶	۲۲ ژانویه
۴	فرانسه	۵۲/۷	۵۵/۸	-٪۶	۲۲ ژانویه
۵	منطقه یورو	۵۲/۳	۵۳/۳	-٪۲	۲۲ ژانویه
۶	جهان	۵۱/۴	۵۴/۳	-٪۵	۲۲ ژانویه
۷	آمریکا	۵۱/۱	۵۷	-٪۱۰	۲۲ ژانویه
۸	برزیل	۵۰/۹	۵۲	-٪۲	۲۲ ژانویه
۹	آفریقای جنوبی	۵۰/۹	۴۸/۴	٪۵	۲۲ ژانویه
۱۰	روسیه	۵۰/۳	۵۰/۲	٪۰/۲	۲۲ ژانویه
۱۱	ایتالیا	۵۰/۱	۵۴/۷	-٪۸	۲۲ ژانویه
۱۲	ژاپن	۴۹/۹	۵۲/۵	-٪۵	۲۲ ژانویه
۱۳	اسپانیا	۴۷/۹	۵۵/۴	-٪۱۴	۲۲ ژانویه
۱۴	ایران	۴۶/۹۴	۵۰/۹۷	-٪۸	۲۲ ژانویه
۱۵	استرالیا	۴۶/۷	۵۴/۹	-٪۱۵	۲۲ ژانویه

منبع: TradingEconomics

شاخص مدیران خرید (PMI)

شاخص کل اقتصاد و شاخص صنعت ایران

جهان

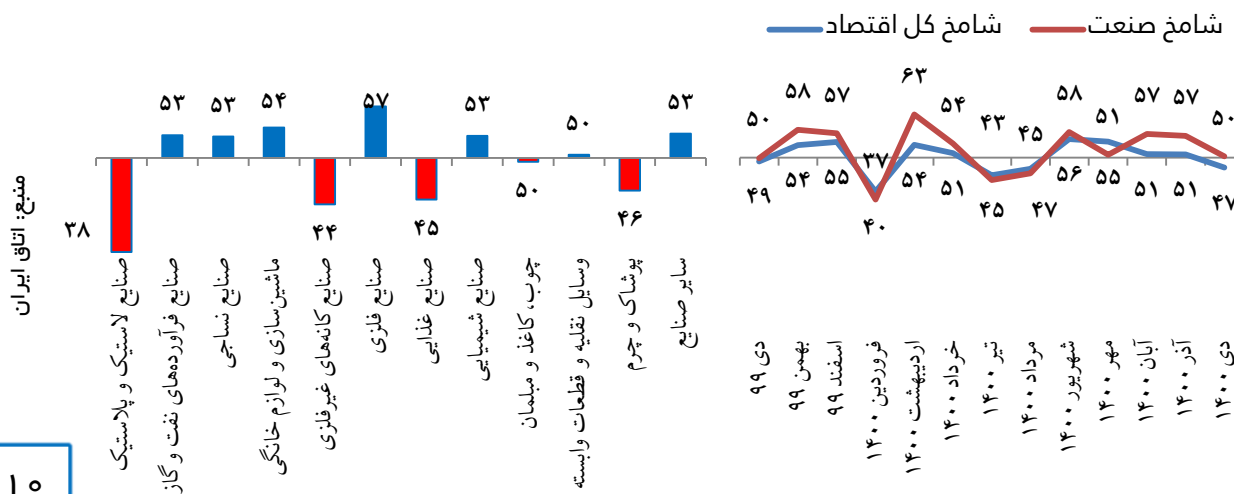
گزارش PMI ژانویه ۲۰۲۲، بیانگر پایین آمدن این شاخص در کشورهای مختلف است و فقط سه کشور انگلیس، آلمان، آفریقای جنوبی و روسیه توانستند بازدهی مثبت به نام خود ثبت کنند. بیشترین تغییرات منفی به ترتیب به استرالیا، اسپانیا و آمریکا تعلق گرفت. همچنین کشورهای ژاپن، اسپانیا، ایران و استرالیا به ترتیب با ریزش‌های ۵، ۱۴، ۸ و ۱۵ درصدی به زیر عدد ۵۰ تنزل یافتند.

ایران

هفته گذشته گزارش شاخص دی ماه کل اقتصاد ایران منتشر شد که با تداوم روند نزولی ماه قبل خود، البته با شدتی بیشتر، با افت ۴/۰۳ واحدی به عدد ۴۶/۹۴ رسید. از علل افت شاخص اقتصاد در این ماه می‌توان به کاهش قدرت خرید و نقدینگی و کمبود شدید تقاضا اشاره کرد. در بخش زیرشاخص‌های اصلی شاخص اقتصاد، کمترین مقدار مربوط به شاخص میزان سفارشات جدید مشتریان با مقدار ۴۳/۱۴ است. شاخص سرعت انجام و تحویل سفارش نیز همانند ماه‌های قبل بیشترین مقدار را با عدد ۵۲/۴۲ به خود اختصاص داد. در بخش زیرشاخص‌های فرعی شاخص اقتصاد، بیشترین مقدار همانند ماه‌های قبل مربوط به شاخص قیمت خرید مواد اولیه یا لوازم خریداری شده با مقدار ۷۵/۶۸ است و کمترین آن همانند ماه قبل متعلق به شاخص میزان صادرات کالا یا خدمات با عدد ۴۷/۱۴ است.

در بخش صنعت نیز چهلمین گزارش شاخص منتشر شد، که با کاهش محسوس ۶/۲۲ واحدی، به عدد ۵۰/۳۱ رسید. در بخش زیرشاخص‌های اصلی شاخص صنعت، کمترین مقدار مربوط به میزان سفارشات جدید با مقدار ۴۴/۹ و بیشترین مقدار مربوط به سرعت انجام و تحویل سفارش بمیزان ۵۷/۵ بوده است. در بخش زیرشاخص‌های فرعی شاخص صنعت، بیشترین مقدار همانند ماه‌های قبل متعلق به قیمت خرید مواد اولیه با عدد ۷۵/۹۱ و کمترین مقدار در این بخش مربوط به شاخص میزان فروش محصولات با عدد ۴۵/۶۳ است. در بخش گزارش شاخص صنایع منتخب، شاخص گروه صنایع فلزی با مقدار ۵۶/۶۳ در صدر قرار گرفت. کمترین مقدار نیز به نام شاخص گروه صنایع لاستیک و پلاستیک با عدد ۳۷/۸۱ ثبت شد.

روند تغییرات شاخص مدیران خرید (شاخص) ایران



منبع: اتاق ایران

تحلیل تکنیکال بورس

خمیده شدن قامت موج صعودی

شاخص کل



- طی هفته گذشته شاخص کل به روند صعودی خود ادامه داد و امروز (شنبه ۱۶ بهمن ۱۴۰۰) توانست تا ۱,۳۰۶,۳۸۸ واحد افزایش یابد اما دو کندل آخر شاخص کل شرایط امیدوارکننده‌ای ندارند و به نظر می‌رسد قامت موج صعودی شاخص کل در حال خمیده شدن است.
- احتمال می‌رود در ادامه شاهد چند کندل منفی از شاخص کل باشیم و تا محدوده ۱,۲۸۵,۰۰۰ الی ۱,۲۷۵,۰۰۰ واحد نیز ادامه داشته باشد که در این صورت می‌توان آن را پولبکی به مقاومت شکسته‌شده ۱,۲۸۵,۰۰۰ واحد دانست.
- همانطور که قبل‌تر نیز ذکر شده بود، برای تأیید تغییر روند در کوتاه‌مدت شاخص کل نیاز دارد از کف قبلی خود در محدوده ۱,۲۸۵,۰۰۰ واحد عبور کرده و بر بالای آن تثبیت شود. همچنین برای تأیید تغییر روند در میان‌مدت نیز شاخص کل نیاز دارد تا سقف کانال نزولی خود را پر قدرت روبه‌بالا شکسته و از آن عبور نماید که در این صورت شاخص کل از ساختار کارکشن نزولی خارج و انتظار یک موج صعودی در میان‌مدت از آن می‌رود.

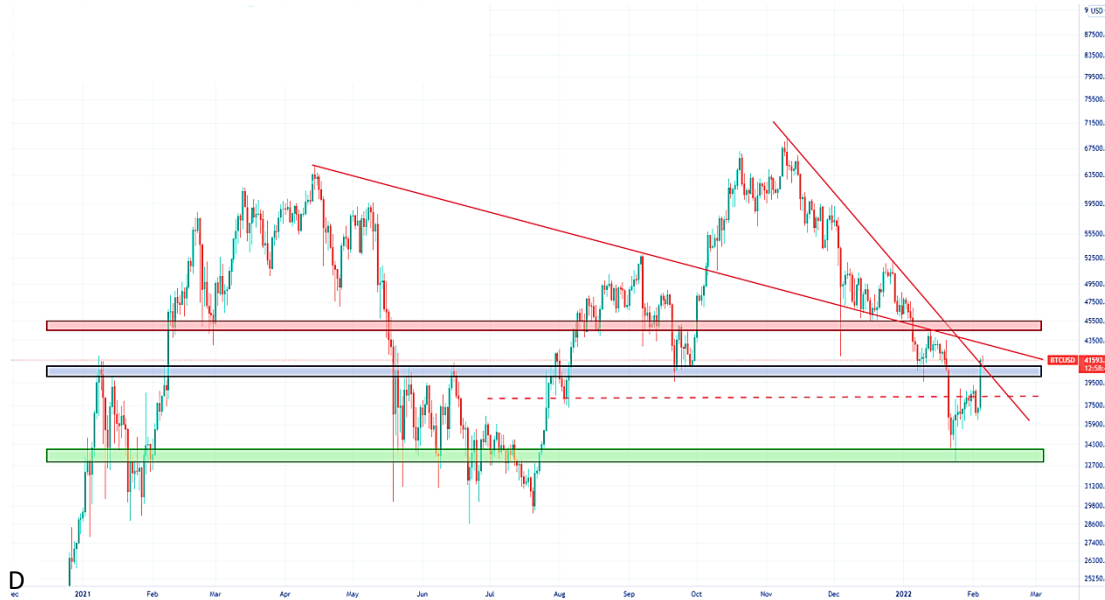
❖ توضیحات:

- 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.

تحلیل تکنیکال بیت کوین

رشد قابل توجه و عبور از مقاومت ۴۰ هزار دلار

بیت کوین (BTCUSD)



- هفته گذشته پس از انتشار اخبار مثبت برای بیت کوین شاهد یک رشد قابل توجه در بازه زمانی کوتاه بودیم، که طی آن قیمت بیت کوین موفق شد از مقاومت ۴۰ هزار دلار خود عبور کند و در حال حاضر نیز در محدوده ۴۱,۴۰۰ دلار در حال معامله است.
- در حال حاضر بیت کوین در حال شکستن خط روند نزولی خود است، که در صورتیکه موفق به شکست این خط روند و تثبیت بر بالای محدوده ۴۰ هزار دلار شود، می توان انتظار رشدی کوتاه مدت را از آن داشت.
- اولین هدف قیمتی بیت کوین مقاومت داینامیک در محدوده ۴۲,۶۰۰ دلار و دومین هدف قیمتی آن محدوده ۴۴ الی ۴۵ هزار دلار 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 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 اونس طلا

کندل‌های کمرمق صعودی

اونس طلا (XAUUSD)



- همانطور که هفته گذشته نیز پیش‌بینی شده بود، اونس جهانی طلا در محدوده کف کانال صعودی مورد حمایت قرار گرفت و تا محدوده‌ای که انتظار داشتیم (۱,۸۱۵ دلار) افزایش یافت.
- جهت ادامه‌دار شدن این موج صعودی، اونس طلا نیاز دارد بر بالای محدوده ۱,۸۱۵ دلار تثبیت شود، در غیر این صورت احتمال اینکه شاخص دلار بار دیگر قیمت ۱,۷۹۰ دلار را به خود ببیند وجود دارد.
- اونس طلا در تایم فریم ۱ ساعته در حال ساختن کندل‌های ضعیفی است که نشانگر کافی نبودن قدرت خریداران است و بر این مبنا احتمال نزول مجدد قیمت آن بیشتر از صعود آن 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.

تحلیل تکنیکال شاخص دلار

اصلاح شدید شاخص دلار

شاخص دلار (DXY)



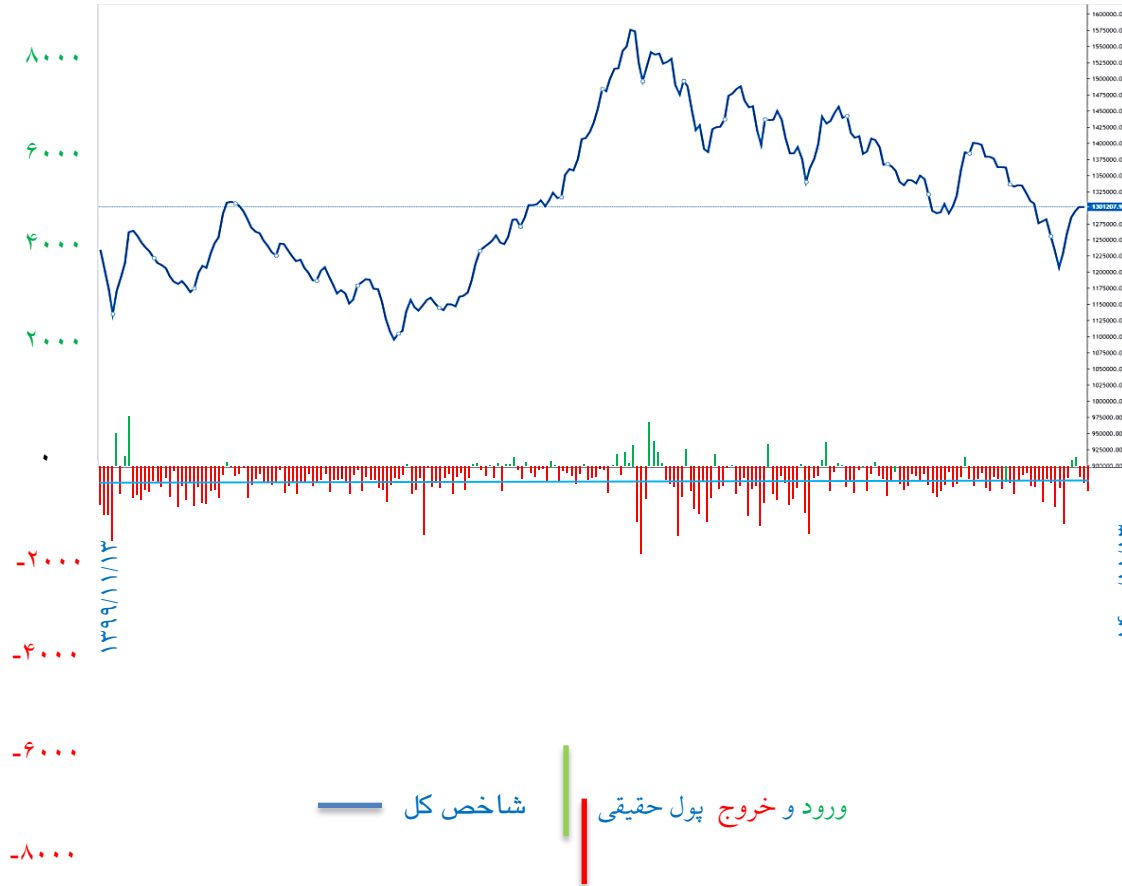
- شاخص دلار با طی کردن ۷۸ درصد موج A به کار خود در موج C صعودی خاتمه داد و دچار اصلاحی شدید شد.
- این اصلاح شدید ناشی از انتشار گزارش اشتغال غیرکشاورزی بخش خصوصی آمریکا (ADP)، که بسیار پایین تر از پیش‌بینی‌ها بود، اتفاق افتاد.
- شاخص دلار با رسیدن به حمایت داینامیک خود، مجدداً مورد حمایت قرار گرفت و به نظر می‌رسد در آستانه تغییر روند است.
- انتظار می‌رود شاخص دلار ۵۰ درصد موج نزولی پیشین خود را جبران کند و تا محدوده ۹۶/۰۰۰ الی ۹۶/۳۰۰ واحد صعود نماید.

❖ 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.

شاخص کل و ورود/خروج پول حقیقی کل بازار

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

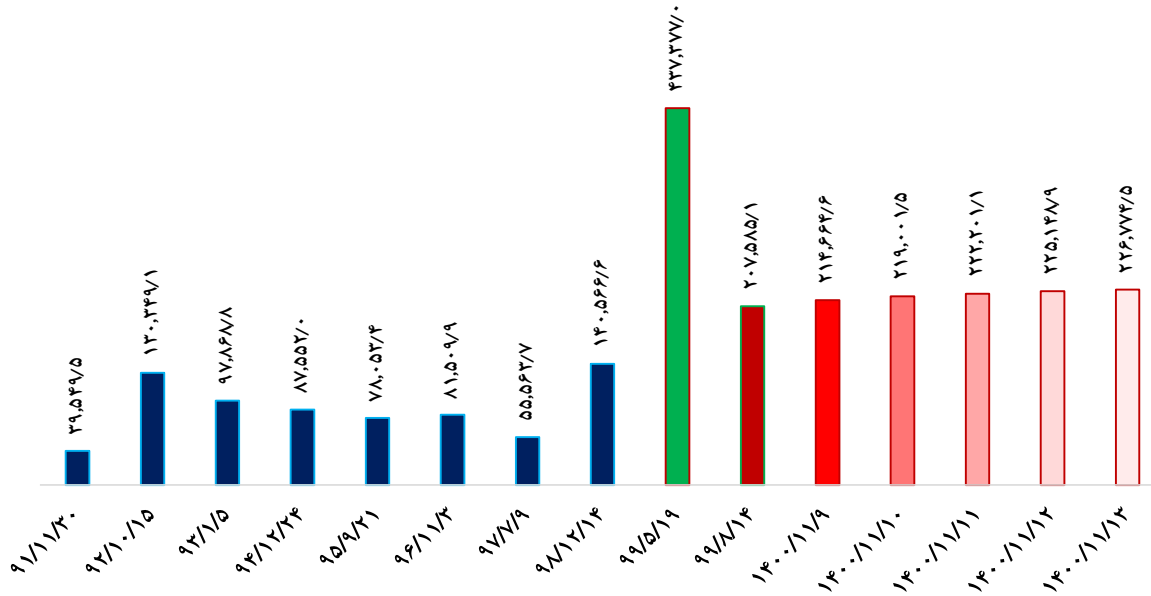


- هفته گذشته بازار با ثبت شاخص کل ۱,۳۰۱,۱۶۱ واحدی و بازده هفتگی ۵/۸۳+ درصد بسته شد.
- برآیند هفتگی، حاکی از خروج ۷۶۴ میلیارد تومان پول حقیقی از بازار است.
- خالص ورود/خروج پول حقیقی از ابتدای سال ۱۴۰۰، نشان دهنده خروج ۶۲,۹۹۰ میلیارد تومان از بازار است؛ یعنی بطور میانگین، روزانه ۳۰۰ میلیارد تومان از بازار خارج شده است.

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

شنبه	۱۴۰۰/۱۱/۰۹	+۱۲۹	میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۱۱/۱۰	+۱۷۲	میلیارد تومان
دوشنبه	۱۴۰۰/۱۱/۱۱	-۴۳۷	میلیارد تومان
سه شنبه	۱۴۰۰/۱۱/۱۲	-۱۱۸۸	میلیارد تومان
چهارشنبه	۱۴۰۰/۱۱/۱۳	-۲۳۱	میلیارد تومان

منبع: شرکت بورس (TSE.ir)



ارزش دلاری شاخص کل

طی هفته اخیر ارزش دلاری بازار سرمایه در نرخ ۲۲۷ میلیارد دلار به کار خود پایان داد. به این ترتیب میزان اصلاح ارزش دلاری شاخص کل نسبت به قله سال گذشته خود معادل ۴۸/۲ 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 ۱۱۲ درصد محاسبه می‌شود. گفتنی است که این شاخص برای آمریکا در تاریخ ۲۸ ژانویه سال ۲۰۲۲، با توجه به ارزش ۴۶/۳ تریلیون دلاری بازارهای مالی و GDP برابر با ۲۴ تریلیون دلار در این کشور، شاخص وارن بافت برای آمریکا معادل ۱۹۳ 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	۰.۶۸	۱,۳۹۵	۹۵۰	۴.۰۶	۲۳۴	۱۴۰۰/۰۳/۳۱	۷۳%
وبانک	۵.۰۵	۱,۵۳۶	۷,۷۶۰	۴.۹۸	۱,۵۵۷	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۱%
وسندوق	۵.۱۸	۲,۰۹۹	۱۰,۸۷۰	۴.۷۵	۲,۲۹۰	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۶۸%
وامید	۱۱.۸۳	۱,۱۸۰	۱۳,۹۶۰	۱۰.۹۵	۱,۲۷۵	۱۴۰۰/۱۲/۲۹	۵۸%
وغدیر	۱۱.۲۱	۱,۲۱۲	۱۳,۵۹۰	۶.۴۷	۲,۱۰۱	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۶۵%
ونیکی	۵.۳۲	۱,۶۵۳	۸,۷۹۰	-	-	۱۴۰۰/۰۹/۳۰	۴۰%

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، رکسانا ثابت‌قدم، رضا جعفری، عبدالکریم جهاندار و بردیا وکیلی

راهبری و نظارت بر محتوا:
احسان برین

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